

管理经济学

工商管理硕士(MBA)教材

TEXTBOOKS FOR MASTER OF
BUSINESS ADMINISTRATION (MBA)

MBA

● 袁志刚 主编

复旦大学出版社

根据上述分析,可以把管理经济学与经济理论和决策科学之间的关系用图 1.1 表现出来。

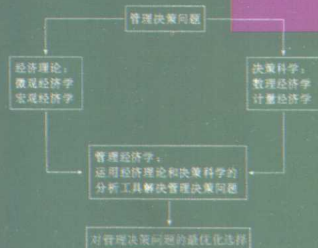


图 1.1 管理经济学的性质

从图 1.1 中可以看到,管理经济学作为一门独立学科的意义在于,它是为了解决企业的管理决策问题而存在的,因此它在进行经济理论推理时,始终围绕企业的决策问题来展开。例如,管理经济学的第三章就是需求分析,初看起来,它与微观经济学中的需求分析没有什么两样,但是管理经济学中的需求分析不仅是为了理解市场需求机制而设置的,而且是为了企业的生产决策而设置的,因此,在完成了一般的需求理论分析之后,紧接着就要展开对需求预测内容的分析。因此就管理经济学和微观经济学的许多方面来说,它们具有很多共同点,它们有共同的内容,并且在内容相互



工商管理硕士(MBA)教材

管理经济学

袁志刚 主编

参加编写者 (按篇章顺序排列)

袁志刚 陆 铭 彭 强

葛苏勤 赵 扬 宋 铮

复旦大学出版社

内 容 提 要

管理经济学是 MBA 研究生的一门重要基础课。本书从 MBA 教学的实际需要出发,设计了较多的例题、案例和复习思考题,既能满足集中的课堂教学需要,也便于分散的自学所用。

本书共分:导论、需求分析、生产和成本理论、市场结构与价格决策、政策环境与制度环境、投资与风险等六篇三十三章。

图书在版编目(CIP)数据

管理经济学/袁志刚主编. —上海:复旦大学出版社,
1999. 11
(工商管理硕士(MBA)教材)
ISBN 7-309-02358-7

I. 管… II. 袁… III. 管理经济学-研究生教育-教材
IV. C93-05

中国版本图书馆 CIP 数据核字(1999)第 40411 号

出版发行 复旦大学出版社

上海市国权路 579 号 200433

86-21-65102941(发行部) 86-21-65642892(编辑部)

fupnet@fudanpress.com <http://www.fudanpress.com>

经销 新华书店上海发行所

印刷 复旦大学印刷厂

开本 850×1168 1/32

印张 14

字数 363 千

版次 1999 年 11 月第一版 1999 年 11 月第一次印刷

印数 1—6 000

定价 20.00 元

如有印装质量问题,请向复旦大学出版社发行部调换。

版权所有 侵权必究

前 言

工商管理硕士(MBA)的培养在中国是一项非常年轻且带有开拓意义的事业,而工商管理硕士教材的建设在中国更是一种“前无古人”的尝试。这种尝试,一方面是要努力把欧美基于成熟市场经济之上的成功企业的管理经验和经济学先进研究手段本土化,这是一种引进和消化的过程;另一方面是要努力创新,把中国市场经济的特有环境(政治、制度、文化等),中国企业特有的管理经验上升到经济学和管理学理论的高度,融合到自己编写的 MBA 教材中,形成中国 MBA 教材的特色。这样,从实践角度讲,可以做到“有的放矢”,理论联系实际,使我们培养的 MBA 具有较高的实际判断和决策能力。从理论角度讲,中国亦可为全球 MBA 教材建设贡献自己的一份力量。就是抱着这样的想法,我们推出这一本管理经济学教材。

我们在编写这本《管理经济学》时,着重注意以下几个问题的处理:一是如何与理论经济学教材中的微观经济学相区别;二是如何结合中国的企业环境,描述这些环境因素对企业决策的影响;三是如何结合每一篇章的内容寻找合适的中国案例。关于第一个问题,我们是严格从企业的角度出发,根据企业决策的需要考察和讨论微观经济问题。例如,我们在论述需求理论以后,专辟需求的估计和预测章节,在生产理论和成本理论之后,专设生产函数和成本函数的经验估计章节,这些章节直接讨论企业实践中所面临的问

题,操作性强,是微观经济学教材中所没有涉及到的。关于第二个问题,我们将中国企业所面临的政策环境与制度环境在严密的理论框架之下作了详细的分析(第三篇),尤其是对中国转轨经济中国有企业的产权安排演变及其对企业决策的影响进行了讨论。对于第三个问题,我们在每一篇(第一篇导论除外)都设置了两个中国案例,如中国转轨时期住房市场需求的收入弹性分析,国有企业产出的计量分析,国有企业的内部股份制改革分析等等。总而言之,经过这些努力,我们希望这本《管理经济学》在理论深度上达到国际 MBA 教材标准这一前提之下,在教材的中国化方面有所贡献。当然,如前面所述, MBA 教材在中国的建设还是一件处于尝试阶段的事物,加之编写者学识和经验的不足,错误一定难免,恳请读者不吝指正。

本人主要从事经济学理论教学和研究工作,1997 年以来参加复旦大学管理学院部分管理经济学的教学工作,并被复旦大学和香港大学联合举办的沪港管理教育与研究中心聘为兼职教授,这是我主编这本教材的缘起,在本书付印之际,特对郑绍濂院长表示感谢。复旦大学出版社刘子馨先生大力促进本书的写作和出版,也表示我们由衷的谢意。最后我们还要感谢复旦大学经济系陈钊先生为我们提供了一个案例。

本书由我设计提纲、准备材料和提出具体的写作要求,并完成第一篇的写作,其他篇章的写作次序是:陆铭(第二篇)、彭强(第三篇)、葛苏勤(第四篇)、赵扬(第五篇)、宋铮(第六篇),最后由我统稿。

袁志刚

1999 年 10 月于复旦

目 录

第一篇 导 论

第一章 管理经济学的内涵及外延	2
第一节 管理经济学的界定	2
第二节 企业理论	7
第三节 企业利润与决策	14
第二章 管理经济学的分析工具	21
第一节 描述经济关系的方法	21
第二节 在决策制定中的边际分析	28
第三节 约束条件下的极大化问题	36

第二篇 需 求 分 析

第三章 需求理论	42
第一节 消费者需求	42
第二节 需求函数与影响需求的各种因素	45
第三节 消费者选择理论	50
第四节 需求的弹性分析	57
第四章 需求的估计和预测	76
第一节 需求的估计	76
第二节 需求的预测	89

案例一	中国转轨时期住房市场需求的收入弹性分析	110
案例二	对一个家用电器市场展开的消费者调查	114
附录 A	回归分析	116

第三篇 生产和成本理论

第五章	生产理论	128
第一节	生产与生产函数	128
第二节	一种可变要素的生产函数	132
第三节	两种可变要素的生产函数	141
第四节	投入要素的最优组合	149
第五节	规模报酬	156
第六节	生产函数的经验估计	158
第六章	成本理论	165
第一节	成本的测度	165
第二节	短期成本函数	169
第三节	长期成本曲线	176
第四节	规模经济与范围经济	182
第五节	学习曲线	185
第六节	损益平衡分析与经营杠杆率	187
第七节	成本函数的经验估计	193
案例三	国有企业产出的计量分析	203
案例四	企业的成本控制	206

第四篇 市场结构与价格决策

第七章	市场结构：完全竞争和完全垄断	212
第一节	完全竞争市场：含义及特征	212
第二节	完全竞争市场：短期均衡和长期均衡	218
第三节	完全垄断市场：含义及特征	228

第四节	完全垄断市场：短期均衡和长期均衡	234
第八章	市场结构：垄断竞争和寡头垄断	241
第一节	垄断竞争市场：含义及特征	241
第二节	垄断竞争市场：短期均衡和长期均衡	244
第三节	寡头垄断市场：含义及特征	249
第四节	寡头垄断市场模型	254
第五节	博弈论	262
第九章	价格决策	274
第一节	差别定价法	275
第二节	多产品定价法	282
第三节	转移价格的制定	288
第四节	定价实践	294
案例五	寡头垄断市场上的价格竞争	300
案例六	差别定价及其条件	303

第五篇 政策环境与制度环境

第十章	市场失灵与政府的作用	310
第一节	市场失灵的几种形式	310
第二节	外部性	314
第三节	公共物品	320
第四节	垄断和反垄断措施	324
第五节	政府干预下企业决策的若干问题	331
第十一章	产权制度与企业行为	335
第一节	产权理论	336
第二节	企业的性质	344
第三节	现代企业制度	350
第四节	转轨经济中的国有企业改革	360
案例七	企业排污的负外部性及政府干预	369

案例八 国有企业的内部股份制改革.....	371
-----------------------	-----

第六篇 投资与风险

第十二章 投资决策	376
第一节 投资决策概述.....	376
第二节 投资决策.....	383
第三节 资金成本.....	395
第十三章 风险分析与企业决策	404
第一节 风险分析.....	404
第二节 风险条件下的效用函数以及企业决策.....	414
第三节 风险条件下的投资决策.....	426
案例九 投资 20 亿元、负债 35 亿元的中州铝厂	436
案例十 制止不文明行为.....	437

第一篇 导 论

20 世纪以来,科学发展的一般规律及趋势是,一方面各学科不断向纵深发展,学科之间的分工越来越细,而另一方面,各学科之间的联系又不断加强,新兴学科、交叉学科又不断涌现。经济科学和管理科学是两门相对独立发展的学科,但是它们两者之间又有非常紧密的联系,管理经济学就是这种联系的一个结果。本篇作为管理经济学的导论,由两章构成。首先,我们将在第一章“管理经济学的内涵及外延”讨论何为管理经济学,管理经济学的研究对象是什么,它与传统的微观经济学、企业管理学和决策科学之间有什么关系,为什么需要管理经济学这门学科,在 MBA 的培养中我们为什么要设置管理经济学这一门课程等问题。在这些讨论的基础上,我们还将概要讨论管理经济学中的核心问题:企业理论及企业的利润目标问题。因为这些核心问题将是管理经济学的论述及推理得以展开的基础问题,这些问题不解决,管理经济学整个推理的基础也就不存在了。其次,我们将在第二章“管理经济学的分析方法”讨论管理经济学中所使用的最为重要的分析方法:最优化决策方法,通过对最优化决策方法的论述,将引进边际分析、机会成本、时间跨度等基本概念。总而言之,本篇作为导论,着重于论述管理经济学的研究对象、研究方法及基本概念,从而为以下各章内容的展开,提供一个最为一般的方法论和概念基础。

第一章 管理经济学的内涵及外延

管理经济学是一门交叉学科,即将传统经济学(或者严格地讲是传统微观经济学)与商务和管理活动中的决策科学相结合的一门学科,管理经济学的基础是微观经济学和决策科学,因此更精确地讲,管理经济学要解决的问题是:如何应用经济理论(主要是微观经济理论)和经济分析方法于商务活动中的决策过程,从而最有效地解决企业所面临的种种管理问题。因此,在这一章里我们将涉及如下的一系列问题:如何精确定义管理经济学?管理经济学与其他学科,如传统微观经济学、企业决策科学的关系如何界定?企业是一个怎样的组织系统,它活动的目标函数是什么?企业追求利润最大这一目标函数在企业决策过程中将起到怎样的作用?等等。

第一节 管理经济学的界定

管理经济学被定义为有关运用经济学理论和决策科学的分析工具,使一个企业组织能够在一定的经济环境中,在面临的各种约束之下,最有效地达到自己既定目标的科学。一般认为,企业的目标函数是追求利润最大,为达到利润最大所作的各种决策被称为最优决策。为作出最优决策,企业的管理者首先必须了解企业所面临的经济环境。对经济环境的科学分析来自于经济学理论,包括微观经济学和宏观经济学。

我们知道,微观经济学是以单个经济主体(个人、家庭、厂商等等)的经济行为作为考察对象:

1. 考察消费者对各种产品的需求行为与生产者对产品的供给行为,以及产品的需求和供给如何决定该产品在市场上的价格和销售量。

2. 考察生产要素的所有者(家庭)供给生产要素的行为和厂商对生产要素的需求如何决定生产要素的价格(构成产品的成本)和生产要素的使用量。

对于上述问题的分析,实际上涉及到一个社会既定的(或有限的)经济资源如何被用来生产不同的产品,这些产品如何来满足社会不同的需求,因而微观经济学所要解决的问题,是经济资源的优化配置的问题。在当今世界,经济资源的优化配置一般被认为是通过市场机制而达到的,而市场机制的最主要部分是市场的价格机制问题,因此微观经济学研究的主要内容是市场机制,其中的核心内容又是市场的价格机制,因而也有人把微观经济理论称为价格理论。

宏观经济学是以一个国家的整体经济活动或经济运行作为考察对象,考察一个国家整体经济的运作情况以及政府如何运用经济政策来影响国家整体经济的运作。宏观经济学所关心的主要问题分短期和长期的问题,就短期的问题来讲,如一个经济为什么会发生周期性的波动?在周期性经济波动中,一个经济为什么会交替出现失业和通货膨胀等宏观非均衡运行现象?全球经济体系如何影响一个国家的经济运行?政府的宏观经济政策在改进一个国家的经济运作上面有多大的作为等等。就长期的问题来讲,宏观经济学主要考察一个国家经济的长期增长和发展的的问题,即何种因素决定了一个国家经济的长期增长和经济的可持续的发展。

由此可见,管理经济学所考察的问题,首先是企业所面临的经济环境,包括微观经济环境和宏观经济环境。就微观经济环境来

讲,我们要搞清楚企业所生产的产品的市场环境,企业所使用的生产要素的市场环境,因此企业的管理者必须了解,是什么经济力量(如需求的力量和供给的力量)以及这些经济力量如何影响产品的市场环境,同样地,经济力量又是如何影响生产要素市场的市场环境。他们不仅要了解经济环境对他们决策的影响,而且还要了解他们的决策对经济环境的反作用等等。当然,除了微观经济环境之外,企业的管理者还必须了解企业所处的宏观经济环境,如企业的经济活动正好面临什么样的宏观经济环境,宏观经济是处于景气状态,还是处于萧条状态,政府为了治理经济周期的过度波动,正在采取什么样的宏观经济政策等等。这些考虑都将对企业管理者的微观决策具有重要的意义。另外,对于像中国那样处于经济体制转轨状态的经济来讲,企业的管理者还需要对企业经济活动所处的制度环境或者制度的变迁环境要有所了解,因为制度环境也直接影响到企业决策的后果。

管理经济学就是为了便于企业管理者更好地理解企业所面临的各类经济环境,而提供分析工具和手段,因此管理经济学所涉及的内容,应该包括微观经济学和宏观经济学。由于在课程设置上,宏观经济学一般作为一门独立的学科而存在,加上企业所面临的经济环境中,对企业决策有重大影响的主要是企业微观经济环境,因此管理经济学的主要内容更多地是侧重于经济科学中的微观经济学部分。但是,我们又不能简单地把管理经济学等同于微观经济学。微观经济学作为经济科学的一个主要分支部分,是站在经济学的角度,考察和分析微观经济主体的行为及其结果——经市场供求波动从而变动价格去引导经济资源的优化配置问题。而管理经济学则是站在企业管理者的角度,为企业的最优决策提供经济分析工具,因此管理经济学论述的展开是紧紧围绕企业的决策问题而进行的。所以,管理经济学的另一个理论基础是决策科学。所谓决策科学就是研究决策目标的确定,如何在可供决策者选择的步

骤和方法中优选出最佳的方案,以达到已确定的目标函数的科学,决策科学一般应用数理经济学和计量经济学等分析工具,对各种决策的成本与效果进行数量分析,把最优决策方案的论证建立在数量分析的基础上。

根据上述分析,可以把管理经济学与经济理论和决策科学之间的关系用图 1.1 表现出来。

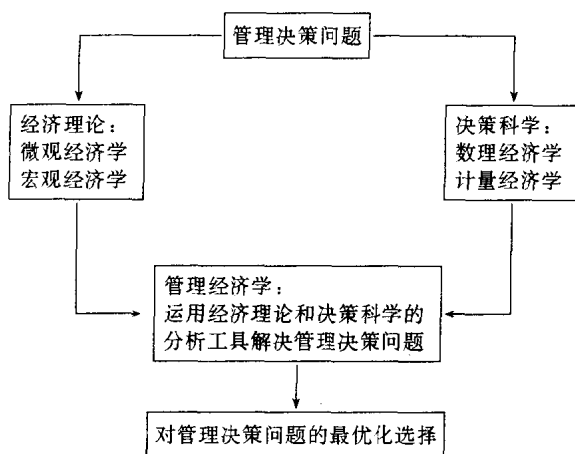


图 1.1 管理经济学的性质

从图 1.1 中可以看到,管理经济学作为一门独立学科的意义在于:它是为了解决企业的管理决策问题而存在的,因此它在进行经济理论推理时,始终围绕着企业的决策问题来展开。例如,管理经济学的第三章就是需求分析,初看起来,它与微观经济学中的需求分析没有什么两样,但是管理经济学中的需求分析不仅是为了理解市场需求机制而设置的,而是为了企业的生产决策而设置的,因此,在完成了一般的 demand 理论分析之后,紧接着还要展开对需求预测内容的分析。因此就管理经济学和微观经济学的许多方面来说,它们具有很多共同点,它们有共同的内容,采用共同的分析方

法,具有共同的假定前提,以及共同的逻辑推理等等。但是它们之间的不同点也是明显的。

1. 它们两者之间的目的是不同的,管理经济学是为企业管理者服务的,其目的是为了企业的决策问题而提供经济分析手段。微观经济学是为了揭示微观经济主体的行为,理解价格机制如何实现经济资源的优化配置。

2. 管理经济学和微观经济学各自的着重点不一样,管理经济学的着重点在于企业理论,微观经济学的着重点在于最后引申出整个经济的一般均衡构架,得出资源的帕累托最优配置等福利经济学的结论。因而管理经济学是企业服务的,微观经济学是为宏观经济学提供理论基础的,既可以为企业服务,也可以为其他经济行为服务,同时也可以为政府服务。

同样地,管理经济学与数理经济学和计量经济学的关系也十分密切。管理经济学通过运用数理经济学和计量经济学的分析工具,然后判断出企业决策是否最优,为企业的管理决策提供理论依据。举例来说,经济理论假定某一市场对商品的需求量(Q)取决于该商品的价格(P)、消费者的收入(Y)、相关商品的价格 P_c (互补商品的价格)和 P_s (替代商品的价格),因此根据数理经济学,我们可以假定如下的需求方程式:

$$Q = f(P, Y, P_c, P_s) \quad (1.1)$$

计量经济学所要解决的问题,就是要利用这一市场关于上述变量的统计数据,从而估计出括号内自变量变动所带来的因变量(需求量)的变动情况,有了计量经济学所提供的需求方程,管理经济学就可以把它用来预测自变量变动后需求量的实际变动,为企业决策提供依据。由此可见,管理经济学将涉及数理经济学和计量经济学,但是管理经济学中所运用的只是数理经济学和计量经济学中的一部分内容,而且这部分内容也是紧紧围绕企业的决策问题而

展开的。因此,管理经济学也不能简单地等同于数理经济学和计量经济学,而且管理经济学作为一门基础课程,它也不可能包含数理经济学和计量经济学本身的丰富内容,如数理经济学和计量经济学中所讨论的有关宏观经济学的一些方程和模型,管理经济学是不涉及的。

管理经济学是企业管理人才(如 MBA)培养中的一门基础性课程,管理经济学与其他工商管理的功能性课程(如会计、金融、人力资源管理和生产管理等)的关系,相当于基础课或综合课与专业课之间的关系。说其是基础课,因为 MBA 的学生在学习了管理经济学之后,他们就能够更容易地掌握和理解工商管理的功能性课程;说其是综合课,因为管理经济学可以被看作是这些功能性课程的综合。如果 MBA 学生已经学习了上述功能性课程,那么在管理经济学的学习中,就可以很好地把前面学到的知识综合应用,解决企业的具体决策问题。

管理经济学是通过经济学理论和决策科学理论以及方法,改进企业的管理决策,着重通过企业模型的分析,让企业决策者更好地理解现实世界中每个企业所处的市场结构环境和宏观经济环境,增强企业决策的科学性。从这个意义上说,管理经济学是联结理论经济学和应用经济学的桥梁,它是理论经济学向应用经济学方向的延伸,但是它同时又是工商管理方面应用经济学的理论基础。

第二节 企业理论

对于学习和研究管理经济学来说,一个最好的开端莫过于从分析企业本身开始。一个工商企业是人员、物质资产和金融资产以及有关金融、技术、市场营销等信息的集合体。企业的内部人员涉及企业股票持有者(或合伙的股东)、管理者、劳动者,企业的外部人员涉及其他生产要素(如原料、能源等)的供给者和产品的需求

者,企业是社会中一个重要的组织形式,企业利用经济资源(一般通过市场购买各类生产要素)生产产品和提供服务。企业的形式有个人所有的小企业、合伙企业、有限责任公司和股份公司等。按照新制度经济学的观点,企业之所以存在,是因为生产者不可能为每一项交换或合作与工人、资本所有者签订合同,因此企业是对市场交换行为的替代,企业一旦组成以后,企业内部实行的是一种自上而下的行政领导和管理,而不是市场的交换行为。举例来说,当工人被一家企业雇用之后,工人在生产过程中必须服从企业管理者的指挥,而不可能在每一项的生产活动上与企业管理者讨价还价。在市场经济发展的初级阶段,企业组织采取的是一种简单的企业制度,其主要特征是:

- (1) 企业规模较小;
- (2) 企业的管理者即为企业资本的所有者;
- (3) 企业内部的决策只涉及管理者和工人。

但是,随着市场经济的发展,企业的规模不断扩大,同时企业的组织形式也随之发生变化。现代企业组织的特征是:

- (1) 规模大,经营的产品多;
- (2) 企业资本所有者和管理者相分离,也就是所有权和经营权相分离;
- (3) 决策体系分为所有者、经营管理者和工人三个层次,比古典企业要复杂。

企业为什么从较小规模发展到较大规模,但又没有无限制地发展下去?如何解释这些现象呢?科斯用交易成本(transaction costs)概念说明这一问题。所谓交易成本,从狭义来看,指的是一项交易所需花费的时间和精力。从广义来看,指的是协议谈判和履行协议所需的各种资源的使用,包括制定谈判所需信息的成本,谈判所花的时间,以及防止谈判各方欺骗行为的成本。从交易成本这一概念,科斯得出一条著名的定义:“法定权利的最初分配从效率