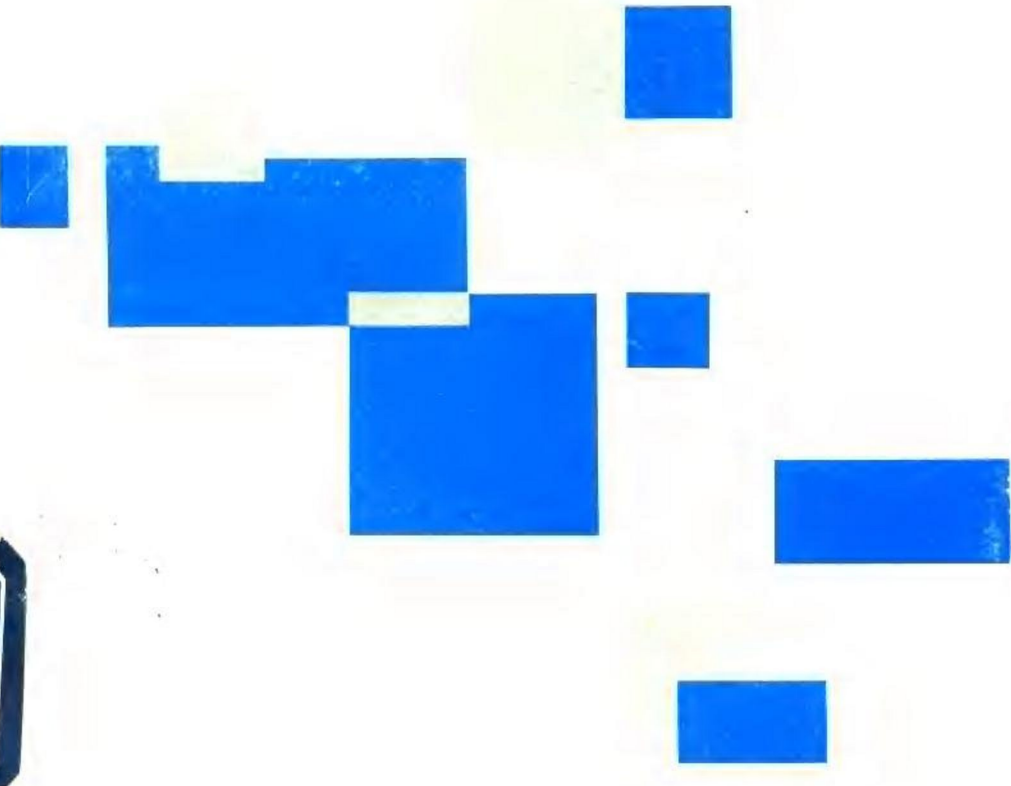


综观经济学

宏观与微观分析的综合

〔澳大利亚〕黄有光 著



中国社会科学出版社

综 观 经 济 学

● 宏观与微观分析的综合

〔澳大利亚〕黄有光 著

张荣刚 陈其广 等译校

中国社会科学出版社

(京) 新登字 030 号

图书在版编目 (CIP) 数据

综观经济学：宏观与微观分析的综合 / (澳大利亚) 黄有光著；张荣刚，陈其广译. —北京：中国社会科学出版社，1996.10

ISBN 7-5004-1952-X

I. 综… II. ①黄… ②张… ③陈… III. 综观经济学 IV. F015

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (96) 第 16486 号

中国社会科学出版社出版发行

(北京鼓楼西大街甲 158 号)

北京兆成印刷厂印刷 新华书店经销

1996 年 10 月第 1 版 1996 年 10 月第 1 次印刷

开本：850×1168 毫米 1/32 印张：7.625 插页：2

字数：190 千字 印数：1—6 000 册

定价：10.00 元

中文版序言

很高兴看到《综观经济学》一书被译为中文。这主要是由于张荣刚教授的努力，谨此致谢。

正如《译者的话》中所说，综观经济学综合了微观、宏观与一般均衡分析，是一种简便而又包括了各个主要因素的分析方法，有许多具启发性的结论。中国已经大体上改革成为市场经济，《综观经济学》中文版应当能在中国经济学界有所贡献。用综观分析法，可以更简便地得出有关整个经济或全行业之平均价格与总产量之变化。

在澳大利亚研究理事会及 MONASH 大学研究基金的资助下，笔者正在进行综观经济学及与杨小凯合著之新兴古典经济学的推广与应用，尤其是应用于中国经济方面之研究。此研究项目得到中国社会科学院经济研究所之合作，也有来自中国及世界其他地方之研究员参与合作。在熟读本书后，对此研究项目有兴趣之读者，或可与笔者联系有关合作之可能性。

1996 年 3 月 27 日

黄有光 (YEW-KWANG NG)
ECONOMICS, MONASH UNIVERSITY
CLAYTON, MELBOURNE, AUSTRALIA 3168

1
A

本书的出版得到了 MONASH 大学
出版委员会的资助

译者的话

黄有光教授是国际知名的华裔经济学家，由于他在经济理论研究上的突出贡献使他成为澳洲社会科学院唯一的华裔院士。1992年，黄有光教授应邀访问了中国社会科学院经济研究所，值此，我们有机会结识并拜读了他的力作《综观经济学》。

综观经济学是黄有光教授80年代以来推出的一种新的经济学分析方法，它采用微观经济学、宏观经济学和一般均衡分析的长处综合而成，故名“综观经济学”。综观经济学集中分析一个典型厂商（可代表整个经济或一个行业），同时又考虑到其他厂商、消费者和要素供给者对这一典型厂商的影响；以及又考虑到了宏观经济变量（如总需求、总产出和平均价格等）对该典型厂商的影响。综观经济分析同一般均衡分析相比较容易掌握和运用，并能够得出许多比较静态的结论；它可以用于分析整体经济或整个行业的某种外生变化（如成本、总需求及预期等变化）对平均价格和总产出的影响。与传统的宏观经济分析相比较，综观经济学在其分析方法中已经包含了对微观经济基础的研究，而不必担心其是否符合微观个体单位的最优化行为；其次，在传统的宏观经济分析中，往往假设厂商是一个完全竞争的厂商，而这一假设又往往与现实经济生活不相符合；相反，综观经济分析则不必采取这一假设，其分析结论更接近于现实，其分析方法具有更强的实际操作性。在结论方面，综观经济分析可以得出一般性的结论，表明货币学派和凯恩斯主义学派的理论分析均是一种特例，都只有在某种特殊的经济条件下才能成立。

综观经济分析突破了传统的宏观和微观经济分析的一般框架，它的理论内涵和分析方法对于我国社会主义市场经济体制建设过程中的理论研究与实际运作具有重要的借鉴意义。为此，我们组织翻译了这部专著。参加翻译工作的同志有：张荣刚：前言、第一章、第二章、第三章。谢艳红：第四章、第五章。陈其广：第六章、第七章。周云帆：第八章、第九章、第十章、第十一章。钟学义：第十二章、第十三章、第十四章。任宇光：附录及注释。全书最后由张荣刚、陈其广、文玫、徐海洋、赵益民等同志进行了校对，黄有光教授对中文译文提供了重要的建设性的意见，由于译者水平有限，译文中错陋难免，敬请读者指正。

译 者

1996 年 1 月

前 言

这部著作是在我的经济学论文(黄有光, Ng 1982a)的基础上扩展而形成的,从某种意义上说,其研究内容的基本轮廓发表得更早一些(黄有光, 1977, 1980)。但在本书中,除第三章(相应的前四节取之于原经济学论文)、第十章(取材于 Ng & McGregor)和第十一章(取材于 Ng 1981)以外,几乎所有的章节都有新的观点和内容的扩展。

基本上说,本书采用一种考虑到宏观经济变量(总需求,总产出,平均价格)的影响所进行的典型厂商的微观经济分析,模拟整个经济(或者一个行业,如第五章)对成本、需求、预期以及其他因素的全经济性变化的反应。这是在宏观经济和一般均衡状态下得到这些变量相互作用的最简单的分析方法。它可以用来检验众多的对产出和价格水平变化的影响,并且可以引导我们去进一步研究诸如失业和通货膨胀等一些重要的问题。由于采用简单的分析方法使得本书易于理解,因此它的对象并不一定是专业经济学家而是可以作为大学本科的专业课程和研究生课程的教科书;为了尽可能扩大读者范围,我在前言后面为非数理读者做了一些提示,并且在第二章第一节将基本结果做了更直观的解释。

我十分感谢澳大利亚研究资助计划的帮助和曼彻斯特大学西蒙基金会对我的研究项目的资助,并感谢 Bill Farebrother、David Kelsey、Lachlan McGregor、James Mirrlees、Kevin Roberts 等人对本书的模拟讨论和富有建设性的意见;我还要感谢受益于在以下一些大学的学术研讨会:剑桥、牛津、伦敦、曼彻斯特、约克、

舍费尔德、伯明翰、都柏林、女皇学院、伯克力、普林斯顿、马里兰、纽约州立大学、佛吉尼亚政治研究所、悉尼、迈邦尼、莫那什、新南威尔士、澳大利亚国立大学、英国哥伦比亚大学和斯德哥尔摩大学。最后，我十分感谢莫那什大学地理系对本书专业图表制作的技术性帮助，感谢 Helen Collens、Philippa Geurens、Jan Ottrey、Kay Preston 、Margaret Tucker 。

为非数理读者的提示

本书对于非数理读者是可以接受的，因为大部分数理求导公式都附在书后的数学注释的表中。只有一些基本的方程式出现在本书的论述中，但大部分方程式都很简单和易于理解。其中个别的数学符号如 σ^y 和 η^y 也许会给非数理读者带来一些阅读困难，但都可以通俗易懂的解释。符号 η^y 是 $(\partial x / \partial y) y / x$ 的缩写，表示当 y 变化时所引起的 x 的比例性（或弹性）反应。例如， η^{cP} 表示（按比例）关于价格水平 P 所引起的边际成本 c 的提高。符号 σ^y 是 $(dx / dy) y / x$ 的缩写，表示（按比例）对 y 的外生变化以及和所有的内生变量都许可发生变化的同时， x 的反应。例如， σ^{Pc} 表示边际成本的外生变化在所有内生变量都许可发生变化之后，对最终均衡价格水平（按比例）的影响。这主要依据在众多的因素中，边际成本如何内生地对总产出 Y 和价格水平 P 的变化作出反应。如此， η^Y 和 η^{cP} 多出现在等式对 σ^{Pc} 的值的确定过程中。

我相信，经过这些解释，即使是从未学习过微积分的读者也可以坚持读完本书，对于那些在本书数学公式的理解上仍有一定困难的读者，如果他们具有厂商利润最大化的微观经济学的基本知识，也可以循着书中非数理化的论述和简单图表的说明来理解本书的结论。

数学符号的通用涵义

a = 平均成本

A = 实际总需求 (α/P)

α = (名义) 总需求

c = 边际成本

C = 总成本

$$D = \frac{\partial \mu}{\partial A} \cdot \frac{A}{\mu|_{p, P, N}}$$

$d\bar{\alpha} = (\partial \alpha / \partial \epsilon^a) d\epsilon^a$ (总需求的外生变化)

$d\bar{c} = (\partial c / \partial \epsilon^c) d\epsilon^c$ (边际成本的外生变化)

$d\bar{C} = (\partial C / \partial \epsilon^c) d\epsilon^c$ (总成本的外生变化)

$d\bar{Q} = (\partial Q / \partial \epsilon^d) d\epsilon^d$ (行业需求的外生变化)

Δ^i = (矩阵 i^{th} 的) 行列式

$$E = \frac{\partial \mu}{\partial N} \cdot \frac{N}{\mu|_{p, P, a}}$$

ϵ^a = 影响总需求的外生因素

ϵ^c = 影响成本的外生因素

ϵ^d = 影响行业需求的外生因素

G = 政府实际支出

$H = - (p/c\eta) (\eta^{np} + \eta^{nn})$ (提高价格对边际收入的影响)

H' = 定义于等式 7.18 之下

η = 局部反应弹性; $\eta^{xy} \equiv (\partial x / \partial y) y/x$, 但 η^{np} (需求的价格弹性) 简单缩写为 η

L = 流动性偏好

λ = 劳动 (厂商)
 Λ = 劳动 (整个经济, 见第九——十章; 工会, 见第十三章。)
 $M = (p - c) / p$ (价格超过边际成本的比例)
 MCC = 边际成本曲线
 MRC = 边际收入曲线
 μ = 边际收入
 N = 厂商数目
 p = 价格 (厂商)
 P = 平均价格 (整个经济, 除第七章第二节中垄断竞争的案例之外, 在那里, P 是行业的平均价格。)
 $\hat{P}$ = 预期平均价格 (整个经济)
 π = 平均价格 (行业)
 $\hat{\pi}$ = 预期平均价格 (行业)
 q = 产出 (厂商)
 Q = 实际总产出 (行业)
 r = 利率
 R = 政府实际收入
 R^i = 厂商 i 的实际利润
 $s^j = p^j q^j / \sum p^k q^k$ (厂商 j 在总产出量中的权数)
 σ = 总反应弹性, $\sigma^{xy} \equiv (dx/dy) y/x$
 t = 间接税率
 T = 收入税率
 w = 实际工资率
 W = 货币工资率
 X = 在等式 10.4 之下所定义的非负符号
 Y = 实际总产出 (整个经济)
 Z = 在等式 10.4 之下所定义的正符号

目 录

前 言	(1)
为非数理读者的提示	(3)
数学符号的通用涵义	(4)
第一篇 导 言	(1)
第一章 导言	(1)
第二章 综观经济分析方法	(11)
2.1 一些基本结论的图解	(11)
2.2 一些有关方法论的问题	(16)
第二篇 综观经济分析	(19)
第三章 短期分析	(19)
3.1 模型	(20)
3.2 外生成本的变化	(26)
3.3 总需求的外生变化	(30)
3.4 价格预期的变化	(35)
3.5 厂商之间宏观经济的外部性	(39)
第四章 长期分析	(45)
4.1 基本模型	(45)
4.2 进入/退出效应	(48)
4.3 自由进入/退出的比较静态分析	(54)
第五章 一个行业案例	(67)
5.1 短期分析	(67)
5.2 长期分析	(77)

第六章	厂商收入最大化	(89)
6.1	模型	(90)
6.2	成本和需求变动	(93)
6.3	价格水平不变情况下实际扩张/收缩的较高可能性	(98)
第七章	规模与寡头垄断	(101)
7.1	寡头垄断经济的描述	(101)
7.2	寡头垄断行业的描述	(106)
7.3	结论的理解	(110)
7.4	一个垄断案例	(112)
7.5	部分方法论的问题	(113)
7.6	寡头垄断和价格柔性	(116)
第三篇	应用与延伸	(123)
第八章	微观经济学的应用	(123)
8.1	差距订价 (mark-up pricing) 和利润最大化 边际主义的一致性	(123)
8.2	销售税的影响	(128)
第九章	一些简单的宏观经济学模型	(131)
9.1	一个简单的古典模型	(131)
9.2	一个简单的“凯恩斯主义”收入-支出模型	(134)
9.3	非通货膨胀的扩张和非通货收缩性紧缩	(138)
9.4	有关劳动需求曲线上升问题的非传统结论	(140)
第十章	政府部门	(146)
10.1	非通货膨胀性扩张：自我筹资性的 降低税率	(146)
10.2	负预算平衡赤字乘数	(152)
10.3	工资增长的无效性	(154)
第十一章	收入政策：自愿依存的可能性	(157)
11.1	滞胀中价格冻结的作用	(158)

11.2	冻结解除以后	(162)
11.3	几点评论	(164)
第十二章 更深层的宏观经济含义：不稳定性和商业周期		
	商业周期	(167)
12.1	连续均衡和货币非中性	(168)
12.2	不稳定性的可能性和低水平均衡陷阱	(169)
12.3	关于“自然”失业率的内涵	(172)
12.4	有关商业周期的一种解释	(174)
12.5	实际检验	(176)
第十三章 劳动供给和成本曲线		
13.1	工会最大化行为与劳动供给	(178)
13.2	影响成本的其他因素	(182)
13.3	总需求变化时对劳动的需求	(184)
第十四章 结束语		
14.1	一些相关的因素	(190)
14.2	调整成本对于低水平均衡的贡献	(192)
14.3	滞胀及其他	(195)
附录		(198)
附录 3I	方法论证明	(198)
3I.1	综观经济典型厂商的存在： 一般均衡分析	(199)
3I.2	一个简单定义的典型厂商的 可接受性	(204)
附录 8I	成本补足订价法：长期分析	(209)
数学注释		(213)

第一篇 导 言

第一章 导 言

理论经济学的研究有三种主要的方法（不包括统计学方法、历史学方法和制度分析方法等）。第一，是在一个完全竞争的行业，有关消费者、厂商（通常是利润最大化）和供给与需求分析的局部均衡微观经济学。这种方法的长处是简明扼要、结构严谨并能得出许多实际结论。它的主要缺点是忽视了一般均衡及宏观经济因素的影响。第二，是在总量方面有关整个国民经济的宏观经济学分析。它在某种程度上可以克服微观经济学的一些弱点，但由于它假定了总量的行为模式，因而失去了自身的长处，使得它的分析往往与单个经济联合体的最大化行为不相一致。近来，新的微观经济学，或者说对宏观经济学的微观经济基础的研究^①正在克服这种不足，尽管还不能完全克服。第三，是一般均衡分析，这种方法是在对整个经济的各个组成部分以及它们之间同时发生的相互影响的研究中来分析整个国民经济。从某种意义上说，它克服了局部均衡微观经济学和总量宏观经济学两者的不足，并做出了一个重要的理性贡献。但是，它也有它的不足之处，第一，由于一般均衡的严格需求，它的分析只能在局限性很大的假设下进行，包括完全竞争的假设^②。第二，除了在假设的状态下证明均衡状态的存在，惟一性、稳定性、帕累托最佳性，否则，典型的一般均衡理论所提供的分析是非常少的，

不能得出一些实质性的结论来帮助人们看到或预测一些特殊干扰的确切作用。

本书尝试提供一种新的经济学分析方法，至少在某些方面，避免在上述三种理论研究方法中的不足的地方。这一新方法是集中研究一个典型厂商的微观经济分析，而它又重视这一厂商所受到的宏观经济变量（总需求、总产出和价格水平）的影响。虽然这已超越了局部微观经济分析，但它还不是一种 Arrow-Debreu 模式的一般均衡分析。它处理总量和均值但仍依托于厂商一级的微观经济理论，它可以用来分析在成本、需求、预期以及其他因素方面中的行业或者整个经济领域变化的影响，它可以说是介于微观经济学理论和宏观经济学理论之间，也介于局部均衡和一般均衡分析之间，因此，我们称之为“综观经济学”。

典型厂商的概念首先是由马歇尔 (Marshall) 第一个使用的（据我所知），但是，他使用这一概念是要建立一个完全竞争行业的正常供给价格。在本书中，一个典型厂商的反应被用来模拟一个典型的非完全竞争的产业或者整个经济的反应。更重要的是，宏观经济变量的影响和次干扰的影响都包括在这一分析中。

我们的非完全竞争的形式在某些方面类似于不完全竞争分析。但是，不完全竞争理论必须一般均衡化，正如特里芬 (Triffin, 1940) 所强调的一样，他自己除了描述和说明的特殊案例（纯垄断等）还没有多大进展。另一方面，垄断性一般均衡的现代分析，可以理解的，是基于一些高度简化了的假设中（更不必谈及比较静态结论的损失）。③

我们的分析特别使人们联想起张伯伦 (Chamberlin, 1933) 的垄断竞争分析，以及他对 dd 和 DD 需求曲线的配合应用。但是，我的分析所主要适用的是整个经济，所涉猎的是总需求的范围，而张伯伦的分析则是只针对一个行业。其次，虽然我们并非是试图贬低张伯伦的历史作用，但是，他的分析仅仅只有少量的比较静态结论，正如阿奇巴德 (Archibald, 1961) 所强调的一样。运用典型厂