

北京大学工商管理丛书



朱善利 著

微观经济学

北京大学出版社

微 观 经 济 学

朱善利 著

北京大学出版社

北 京

新登字(京)159号

图书在版编目(CIP)数据

微观经济学/朱善利著. — 北京:北京大学出版社, 1994, 10
(北京大学工商管理丛书)
ISBN 7-301-02677-3

I. 微… II. 朱… III. 微观经济学 IV. F·016

书 名: 微观经济学

著作责任者: 朱善利

责任编辑: 符丹

标准书号: ISBN 7-301-02677-3/F·216

出 版 者: 北京大学出版社.

地 址: 北京市海淀区中关村北京大学校内 100871

电 话: 出版部 2502015 发行部 2559712 编辑部 2502032

排 印 者: 北京银祥福利印刷厂印刷

发 行 者: 北京大学出版社

开 本: 850×1168毫米 32开 14印张 351千字

1994年10月第一版 1994年10月第一次印刷

印 数: 0000—8000册

定 价: 14.50元

前 言

近几年我曾分别为北大经济学院与工商管理学院的学生讲授微观经济学。许多学生对微观经济学表现出浓厚兴趣,以至修课者扩大到北大数学、物理、计算机等系、所的学生。

我想,微观经济学之所以受到如此众多学生的欢迎,一方面是因为中国由计划经济体制转向市场经济体制的改革迫切需要未来新经济体制的设计者与建设者系统掌握包括微观经济学在内的现代经济学理论;另一方面是因为微观经济学是一门非常令人感兴趣、也非常富有挑战性的经济科学。

经济改革需要经济理论指导。计划经济理论不可能用于指导市场经济体制取向的改革。作为现代经济学基础理论的微观经济学所研究的是市场经济体制下所提出的种种经济问题,它无疑会对市场经济的设计与建设提供理论上的指导。本世纪三十年代以后,相对于宏观经济学而言,微观经济学曾经在相当长一段时期内发展缓慢。道理很简单,以凯恩斯为代表的经济学家创立宏观经济学的初衷就是要为政府干预经济提供理论基础,尽管宏观经济学发展到今天,在许多方面已经违背了其创立者的初衷。而微观经济学则始终强调市场价格机制对于经济的调节作用。二次大战后的很长一段时期内,在各主要发达市场经济国家强调政府干预经济的环境下,微观经济学难以获得进展就不足为奇了。但是,政府干预经济所导致的种种问题使得经济学家重新探究政府与市场调节经济的作

用。这种探究使得微观经济学在近些年获得长足的发展。微观经济学不仅象传统上所做的那样分析市场价格机制有效配置资源的功能,也分析市场的失灵及其对策。外部性、非对称信息、委托人—代理人、公共产品等问题以及与解决这些问题有关的所有权理论、利润分享理论、公共选择理论等代表了微观经济学理论近年来的新发展。微观经济学的这些新发展不仅拓宽了微观经济学的研究范围,也为有效解决经济运行中所出现的实际经济问题提供了系统而又丰富的理论。

大学生或研究生大多喜欢探讨一些令人感兴趣的、富有挑战性的问题。微观经济学之所以受到听课学生的普遍欢迎正是它满足了大学生在这方面的需要。微观经济学既研究企业或其他社会团体、政府的决策行为,也研究个人的决策行为,研究政府、企业、社团、个人如何最优地使用他们所拥有的稀缺资源。对于每时每刻都需要就如何最优使用自己所拥有的货币、时间以及其他资源进行决策,或者关心社会范围内资源有效配置的本科生或研究生而言,对微观经济学产生兴趣是理所当然的。微观经济学所研究的许多问题又是非常富有挑战性的。关于资源配置效率的实证分析,关于社会福利的规范讨论,关于公平与效率的社会伦理,关于个人选择与社会选择的价值判断等等,都是经济学家、社会学家、乃至哲学家长期争论不休的非常复杂的问题。微观经济学用其独特的理论体系与分析方法对这些问题给以独到的解释。微观经济学在讨论这些问题时所使用的抽象的逻辑推理、严格的数学证明,对于人们完整、准确地理解这些问题,都是一种智力上的挑战。

微观经济学按照内容的难易程度可以分为高级、中级、初级几种水平。初级水平的微观经济学讨论微观经济学的基本概念、基本理论,在分析中用到一些初等数学知识,对微观经济学中的一些难点问题不加讨论。高级水平的微观经济学使用高深的数学知识,采取公理化的推理方法对微观经济学的基本理论加以严格的证明,并对微

观经济学中的难点问题进行深入地讨论。中级水平的微观经济学介于高级微观经济学与初级微观经济学之间。对于微观经济学基本理论的分析,中级微观经济学用到一些高等数学知识,但都是比较简单的数学知识。对于某些难点问题,中级微观经济学虽然有所涉及,但只作简要分析,不作深入讨论。

本书属中级微观经济学。书中广泛涉及微观经济学的基本概念与基本理论。为了使读者能够准确地把握微观经济学的某些重要的概念与结论,在大凡可能的地方,本书都使用一些简单的数学知识严格地证明这些结论。那些对数学证明不感兴趣的读者可以不看这部分内容,而并不妨碍对于微观经济学基本理论的完整理解。全书共分十六章。首先从局部均衡价格理论入手,然后分别讨论消费者行为理论、生产理论、商品市场定价理论、生产要素定价理论、一般均衡与福利理论、市场失灵与政府调节理论。其中最后一章的市场失灵与政府调节理论所探讨的许多问题都是微观经济学近年来发展的新理论。我相信读者定会从中受到深刻的启示。

本书在材料的收集与写作过程中曾得到现在美国任教的经济学同仁内布拉斯加大学的林双林博士,印第安那大学的易纳博士,斯坦福大学的钱颖一博士,以及荷兰社会研究院的孙来祥先生的帮助,在此深表感谢。本书书稿的打印与复印工作曾得到北大工商管理学院管理科学中心与院办公室的吴安女士、范平女士、张洁女士、刘萍女士、孙凯先生、葛锐先生以及其他诸位女士与先生的帮助。本人向他们表示深切的谢意。北京大学出版社的符丹先生为本书的尽早面世做了大量的工作。我愿借此向他表示诚挚的谢意。本书若能受到读者欢迎,应该首先归功于上述给我提供帮助的人。对本书可能出现的所有错误概由作者负责。

朱善利

一九九四年六月于北京大学中美国

目 录

第一章 导言	1
第一节 经济学与微观经济学	1
一 经济学	1
二 微观经济学	3
第二节 微观经济学中的实证分析与规范分析	4
一 实证经济学与规范经济学	4
二 微观经济学中的实证分析与规范分析	5
第三节 微观经济学的功能与用途	7
一 微观经济学的功能	7
二 微观经济学的用途	9
第二章 需求、供给与局部均衡价格的决定	11
第一节 需求	11
一 个人需求	11
二 市场需求	15
第二节 供给	17
一 单个厂商的供给	17
二 市场供给	20
第三节 局部均衡价格的决定	22
一 均衡价格与均衡数量	22
二 关于均衡点的讨论	23
三 均衡点的移动	26
四 关于均衡点移动的数学分析	27
第三章 弹性理论	32

第一节 弹性的定义	33
一 函数不可求导情况下的弹性定义	33
二 函数可以求导情况下的弹性定义	33
三 弹性的对数定义	34
四 几种常见的弹性	34
五 偏弹性	35
第二节 点弹性与弧弹性	36
一 点弹性	36
二 弧弹性	37
第三节 需求的价格弹性	39
一 需求的价格弹性定义	39
二 需求价格弹性的几何意义	41
三 需求价格弹性的分类	42
四 需求价格弹性的比较	43
五 决定需求价格弹性大小的因素	45
第四节 需求的其他弹性	46
一 需求的收入弹性	46
二 需求的交叉弹性	48
第五节 供给弹性	48
一 供给价格弹性	49
二 供给价格弹性的几何意义	49
三 供给价格弹性分类	51
四 供给的交叉弹性	52
五 供给的成本弹性	53
第四章 效用理论	56
第一节 消费者偏好	56
一 消费者偏好的含义	56
二 关于偏好的几种假设	57

第二节 效用理论与基数效用	58
一 效用	58
二 总效用与边际效用	59
三 消费者效用最大化的均衡	60
四 由消费者均衡条件导出需求曲线	62
五 边际效用理论的运用—消费者剩余	63
第三节 序数效用与无差异曲线	65
一 序数效用	65
二 无差异曲线	66
三 预算线与预算空间	72
四 消费者的均衡	73
第五章 消费者选择	78
第一节 收入变化与价格变化条件下的消费者选择	78
一 收入的变化	78
二 价格的变化	81
第二节 替代效应与收入效应	83
一 替代效应与收入效应的定义	83
二 正常品与劣等品的收入效应与替代效应	85
三 希克斯替代效应与斯勒茨基替代效应	88
第三节 显示偏好理论	91
一 显示偏好的概念	92
二 显示偏好公理	94
三 利用显示偏好理论导出无差异曲线	96
第四节 价格指数与生活水平的变化	98
一 预算线与消费者生活水平的比较	98
二 用指数比较生活水平的变化	100
第五节 不同情况下的消费者选择	102
一 消费者对于收入与闲暇的选择	103

二	储蓄与消费的选择	106
三	多约束下的消费者选择	109
四	政策分析	111
第六章	不确定性条件下的消费者选择	117
第一节	风险的测度	118
一	风险与概率	118
二	期望值与方差	119
第二节	人们对于风险的态度	122
一	风险与效用	122
二	人们对于风险的态度	124
三	风险溢价	127
第三节	如何应付风险	128
一	多样化	128
二	购买保险	130
三	获取更多的信息	132
第四节	消费者的资产选择	134
一	资产及其种类	134
二	资产赢利率	135
三	风险与赢利率的权衡及消费者的选择	137
第七章	生产理论	143
第一节	生产函数	145
一	固定投入与变动投入, 长期与短期	145
二	生产函数	147
三	投入的比例	149
第二节	具有一种变动投入要素的生产	149
一	总产量、平均产量与边际产量	150
二	总产量、平均产量以及边际产量之间的关系	154
三	生产阶段的划分	157

第三节 具有两种变动要素投入的生产函数	158
一 变比例投入下的生产	159
二 固定比例投入下的生产	161
三 要素替代	164
四 生产的经济区域	167
第四节 最优投入组合	169
一 等成本线	169
二 最优投入组合	170
三 扩张路线	173
四 要素价格变化与替代弹性	176
第五节 规模报酬	178
一 常数规模报酬	179
二 递增规模报酬	180
三 递减规模报酬	180
第八章 成本理论	184
第一节 成本的性质	184
一 显成本与隐成本	184
二 社会成本与私人成本	186
三 成本函数	187
第二节 短期成本	188
一 短期成本与生产	188
二 短期总成本	190
三 短期平均成本与短期边际成本	192
第三节 长期成本	197
一 长期总成本	198
二 长期平均成本	199
三 长期边际成本	202
四 包络线与扩张路线	204

五 成本弹性与函数系数	206
第四节 影响长期平均成本变化的因素	208
一 规模经济与规模不经济	208
二 学习效应	210
三 范围经济	212
第五节 收益与利润最大化	216
一 收益	216
二 利润最大化均衡	219
第九章 完全竞争市场下的价格与产量	223
第一节 完全竞争的条件	223
一 买者与卖者都是价格的接受者	223
二 产品同质、无差别	224
三 资源可以自由流动	224
四 经济运行主体具有完全的知识	224
第二节 完全竞争市场下的短期均衡	226
一 短期均衡及其条件	226
二 完全竞争产业厂商短期供给曲线	229
三 产业的短期供给曲线	230
第三节 完全竞争市场下的长期均衡	231
一 长期厂商的调整	231
二 产业的调整与企业的长期均衡	233
第四节 产业长期供给曲线	236
一 不变成本产业	236
二 递增成本产业	238
三 递减成本产业	239
第十章 政府对竞争产业的调节及其后果	242
第一节 政府干预市场均衡价格的后果	242
一 支持价格	242

二 限制价格	243
第二节 政府的税收政策	245
一 从量税收及其后果	245
二 一次总付税	248
第三节 对政府若干政策的评价	250
一 对政府经济政策评价的标准	250
二 价格管制的福利损失	251
三 支持价格的福利损失	253
四 政府征税的福利损失	254
第十一章 完全垄断市场下的价格与产量	258
第一节 完全垄断市场的条件与均衡	258
一 完全垄断市场的条件	258
二 完全垄断条件下的短期均衡	259
三 长期均衡	262
四 垄断的社会成本	263
第二节 垄断者的定价原则与策略	265
一 垄断者的定价原则	265
二 垄断者的价格歧视	267
三 时间差价与高峰负荷价	271
四 二重价	273
第三节 政府对垄断行业的调节	278
一 对垄断者的价格调节	278
二 对垄断者的税收调节	281
第十二章 垄断竞争与寡头	286
第一节 垄断竞争	286
一 垄断竞争的含义	286
二 垄断竞争条件下厂商的短期均衡	287
三 垄断竞争条件下厂商的长期均衡	290

四 垄断竞争市场的效率	291
第二节 寡头	292
一 寡头的定义与特征	292
二 古诺模型	293
三 斯泰克伯格模型	298
四 价格竞争的古诺模型	300
第三节 竞争与合作的选择	302
一 囚犯的困境: 竞争还是合作?	302
二 寡头市场下的价格刚性	305
三 价格领先模型	307
四 卡特尔模型	308
第十三章 竞赛理论	314
第一节 竞赛问题的刻画与竞赛者的策略决定	314
一 竞赛问题的刻画	314
二 竞赛者的策略决定	315
第二节 静态的竞赛	316
一 优势策略	316
二 纳什均衡	318
三 最大最小策略	319
第三节 动态的竞赛	320
一 反复竞赛下的合作解	320
二 动态竞赛条件下的策略行动	322
第十四章 生产要素定价理论	330
第一节 完全竞争市场的生产要素定价	330
一 单个厂商对于生产要素的需求	331
二 生产要素的市场需求、供给、 以及生产要素价格的决定	336
三 生产要素供求的短期均衡与长期均衡	337

第二节 不完全竞争市场的生产要素定价	340
一 商品市场不是完全竞争而要素市场是完全竞争情况下的 生产要素定价	340
二 生产要素市场不是完全竞争条件下的要素定价	344
第三节 资本市场与利率的决定	348
一 投资收益的折现值与投资决策	349
二 债券投资与债券有效收益率	350
三 投资风险与折现率的调整	352
四 均衡利率的决定	354
第十五章 一般均衡理论与福利经济学	360
第一节 交易的一般均衡	361
一 交易的一般均衡含义与条件	361
二 效用可能性边界线	365
第二节 生产的一般均衡	366
一 生产的一般均衡含义与条件	366
二 生产的一般均衡与生产可能性曲线	369
第三节 生产与交易的一般均衡	370
一 生产与交易的一般均衡的含义与条件	370
二 实现一般均衡的经济机制	374
第四节 福利问题	375
一 福利最大化	375
二 社会福利与个人偏好	377
三 社会福利、效率与平等	380
第十六章 市场失灵与政府调节	384
第一节 非对称信息	385
一 次品与逆选择	386
二 如何解决非对称信息下出现的问题	388
三 败德行为	393

四 委托人-代理人问题	395
第二节 外部性	399
一 外部性及其后果	400
二 政府干预	402
三 明确所有权	406
四 合并企业	408
五 共有财产	410
第三节 公共产品	412
一 公共产品的特征	412
二 公共产品的效率条件	414
三 公共产品有效提供的决策机制	418
四 拟公共产品	422

第一章 导 言

第一节 经济学与微观经济学

什么是经济学？什么是微观经济学？它们之间有什么区别与联系？本节将就这些问题进行讨论。

一、经济学

经济学的定义是一个争议性较大的问题。迄今为止，并不存在一个被所有的经济学家都一致接受的有关经济学的定义。较为普遍而且为多数经济学家接受的定义是：经济学是研究个人、企业、政府以及其他组织如何在社会内进行选择，以及这些选择如何决定社会稀缺资源的使用的科学。该定义强调资源的稀缺性以及选择的重要性。不管是个人、企业，还是政府，或者是其他社会组织，所拥有的资源都是有限的，即资源是稀缺的。所谓资源的稀缺性(scarcity)是相对于人们的欲望而言的。人们的欲望是无穷无尽的。这些无穷无尽的欲望都要靠资源所生产的产品与劳务去满足。

除了时间与信息这两种重要的资源外，经济学中所讨论的资源基本上分为三种，即人力资源、自然资源与资本资源。人力资源是指能够并且愿意参与生产过程的人；自然资源是指处于自然状态的生产性资源，例如土地、矿藏等；资本资源是指在长期内能够产生收入流(stream of income)的资本存量，资本资源简称为资本。

当资源被投入生产过程用以生产满足人们欲望的最终产品与劳