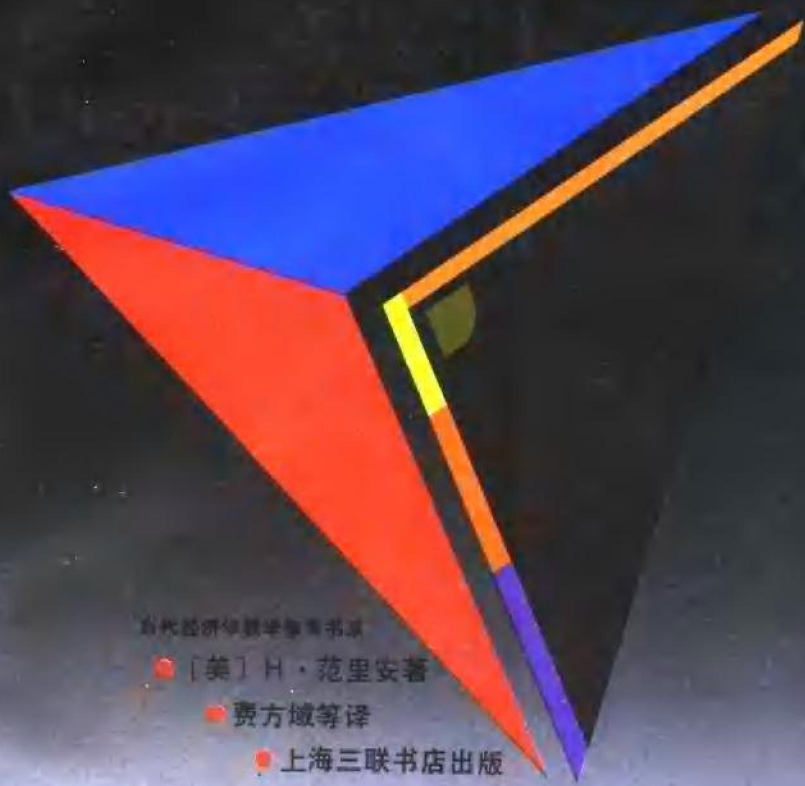


DANGDAIJINGJIXUEXILIE
CONGSHU ● 当代经济学系列丛书



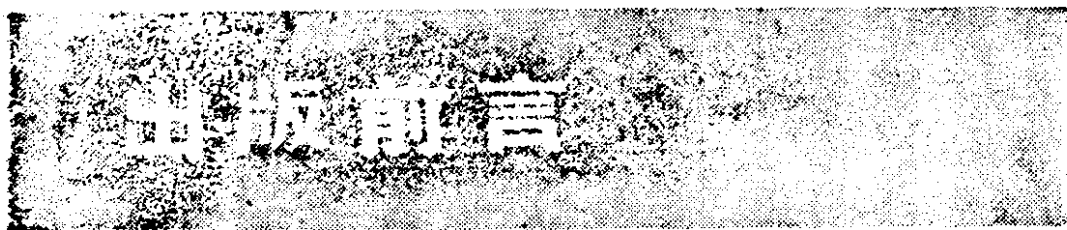
当代经济学系列丛书

● [美] H·范里安著

● 贾方域等译

● 上海三联书店出版

微观经济学：现代观点



为了全面地、系统地反映当代经济学的全貌及其进程，总结与挖掘当代经济学已有的和潜在的成果，展示当代经济学新的发展方向，我社决定出版“当代经济学系列丛书”。

“当代经济学系列丛书”是大型的、高层次的、综合性的经济学术理论丛书。它包括四个子系列：（1）当代经济学文库；（2）当代经济学译库；（3）当代经济学教学参考书系；（4）当代经济学新知文丛。该丛书在学科领域方面，不仅着眼于各传统经济学科的新成果，更注重经济前沿学科、边缘学科和综合学科的新成就；在选题的采择上，广泛联系海内外学者，努力开掘学术功力深厚、思想新颖独到，作品水平拔尖的“高、新、

尖”著作。“文库”力求达到中国经济学界当前的最高水平；“译库”翻译当代经济学的名人名著；“教学参考书系”主要出版国外著名高等院校 80 年代后期 90 年代初期的通用教材；“新知文丛”则运用通俗易懂的语言，介绍国际上当代经济学的最新发展。

本丛书致力于推动中国经济学的现代化和国际标准化，力图在一个不太长的时期内，从研究范围、研究内容、研究方法、分析技术等方面逐步完成中国经济学从传统向现代的转轨。我们渴望经济学家们支持我们的追求，向这套丛书提供高质量的标准经济学著作，进而为提高中国经济学的水平，使之立足于世界经济之林而共同努力。

我们和经济学家一起瞻望着中国经济学的未来。

上海三联书店

1991年5月

译者的话

(一)

经济学是研究如何将稀缺的资源有效地配置给相互竞争的用途的科学。自从莱昂内尔·罗宾斯的《论经济科学的性质和意义》一书于1935年问世以来，这个定义就一直在英美等国教科书中占据统治地位。时下经常见诸国内报刊文献的“现代西方经济学”一词，大多也都在这个意义上使用。

古希腊人最早创造了经济学这个名字，但只赋予它齐家之道即家庭管理法则的意思，而没有将它视为莱昂内尔·罗宾斯的研究领域。虽然，到1615年，就有一位不重要的重商主义文者蒙克莱田·德瓦特维尔，出于“生财之学，于家于国皆同”的辩争，首次将经济学称为政治经济学。但是，政治经济学作

为一门新兴的社会科学，却还是在古典经济学问鼎欧洲以后才被人们普遍接受。它集科学、道德、哲学和技能于一身，熔理论原则、实际政策、科学证据和政治辩护于一炉，而始终关注国民财富和经济的增长。

整个十九世纪，政治经济学沿着两个不同的方向发展。一个方向是把现存的制度当作外在的，既定的或从来就有的社会秩序，强调将复杂的社会现象简约成某种可以像物理学那样准确把握的东西进行研究，试图以此来达到净化经济学科的目的。另一方向是对既定的社会制度本身提出疑问和否定，强调将生产关系作为主要内生变量进行研究，试图以此来达到拨正经济学科的目的。

在西方，第一个方向被描述成经济学科从本来具有道德、政治和规范特点的政治经济学转换成为具有工具、科学和实证特点的经济学的过程。其间，一方面，是经济学从传统意义的伦理哲学中分离出来，只研究可以纯粹用目的和手段刻画和判断的人类理性行为。这也就是说，经济学中的人，不再是有丰富情感，有爱人之心的活生生的人，而是帕累托称呼的那种有动机有能力寻求自己最大利益的抽象的“经济人”。

然而“经济人”的称呼，更多地是在这种意义上使用的。

古希腊人最早创造了经济学这个名字，但只赋予它齐家之道即家庭管理法则的意思，而没有将它视为莱昂内尔·罗宾斯的研究领域。虽然，到1615年，就有一位不重要的重商主义文者蒙克莱田·德瓦特维尔，出于“生财之学，于家于国皆同”的辩争，首次将经济学称为政治经济学。但是，政治经济学作

济学和边际主义综合基础上的新古典经济学，成为主流经济学。这就是罗宾斯定义的经济学。

稍后，经济学进一步分蘖为微观经济学和宏观经济学，最早把这两个概念抽象出来的，一说是挪威经济学家雷格勒·弗里希，1933年，他在一篇向古斯塔夫·卡塞尔表示敬意的论文中，分别用“微观动态”和“宏观动态”这样两个词概括对个体行为和总体行为的分析。另一说是丁伯根在荷兰统计学院的同事德沃尔夫，他在1941年的一篇题为《需求收入弹性的微观经济学和宏观经济学的解释》的论文中，首次正式使用了这两个术语。可在我看来，实际上，真正使这种区分深入人心的，却是并未使用这些术语的约翰·梅纳德·凯恩斯。正是他1936年问世的《就业利息和货币通论》，才使宏观经济学的理论框架，分析方法和政策措施得以确立，才使微观经济学和宏观经济学的分离得以完成。

凯恩斯以来的宏观经济学，我以为经历了两代。第一代的特点是，从假设的经济总量的函数关系如消费函数，投资函数，货币需求函数等出发研究它们之间的相互作用。这是没有微观基础的宏观经济学。第二代试图弥补这一缺陷，不论是沿着瓦尔拉斯，还是非瓦尔拉斯的方向，都积极构筑自己的微观基础，使总体的行为和关系，能合乎逻辑地从个体的行为和关系中得到说明。从混沌变为离析，再在对立中达到统一，这就是经济学走过和正在走着的道路。

不论经济学是合还是分，微观经济学的基础和核心的地位，实际始终没有发生过丝毫动摇。显然，这同十六世纪以来，滋生和哺育经济学的生产方式没有发生过根本性变化有关，也同经济学歌颂和维护的现行自由市场制度的基本信条

没有发生过根本性变化有关。微观经济学的主要使命，就是精辟阐述严密论证这些信条的合理性和有用性。

微观经济学的研究对象，是生产什么、怎样生产和为谁生产；研究领域是消费者理论，生产者理论，市场理论，分配理论，一般均衡理论，福利经济学，和市场失灵与政府作用理论；研究方法，除了无法回避的规范分析以外，主要是实证分析，大量采用数学技术。

微观经济学的发展，我看经历了这样几个阶段。第一个阶段，从古典到马歇尔，瓦尔拉斯；主要借助文字和图表，对供给(穆勒)，需求(杰文斯)，分配(克拉克)，单个市场(马歇尔)和多个市场(瓦尔拉斯)的交换与价格决定等方面的问题作了开创性的研究。第二个阶段，到希克斯和萨缪尔逊，主要运用微积分。对消费者理论，生产者理论，不完全竞争理论，一般均衡理论，福利经济学等进行重塑和补充。第三个阶段，到阿罗和德布鲁，主要运用集合论和线性模型，在效用函数理论，竞争均衡和最优性问题，不确定性条件下的均衡，投入产出分析和对策论等方面取得重大成就。第三个阶段，到当前，综合运用各种方法，发展了交易费用，产权，非均衡，X效率，寻租，信息，次优，机会选择，资产定价，资产组合，跨时期分析，整体分析，和对偶分析等一系列新的理论和方法，大大拓宽了传统的学科边界和应用领域。

但是，从亚当·斯密始于今，上下几百年，贯穿全部微观经济学(或者，经济学)的主题，我看却始终只是一个，那就是经济自由主义信条：在自由市场经济中，大量自由的，极端自利的，追逐最大利润和最大效用的个人的分散活动，经由价格和竞争机制调节，会自动趋于和谐，有序，均衡，达

到最佳效率状态。在此意义上可以说，对于这信条证明的日趋严密和简洁，就是微观经济学的日趋成熟和精确。

这样，用公理化方法，一般地，严格地，简洁地证明一般经济均衡存在性和最佳性的阿罗-德布鲁定理，就格外值得注意。因为，它不仅严格证明了最佳的有秩序的经济配置在理论上是完全可以达到的，而且还对达到这种结果所需要的条件作了详细规定。假设的明显化，即使理论的适用范围变得容易判别，使要出现这样结果的理想世界应该怎样变得容易理解，还使不存在这些条件的现实世界变得容易认识。

完全竞争的假设(透明性，同一性，原子性等等)几乎没有一条是真实的，实际的市场既不完全也不完善，在存在规模经济，外部效应，内部效应和政府干预的情况下，混合经济能够达到怎样的状态，这是现在经济学家回答的问题。虽然，政府干预目前不是要不要，而是实施到何种程度的问题，但是，从根本上来说，它却还只是市场的补充和修正。

以上，是西方经济学的演进脉络，也是本书的学科背景。

(二)

越是成功的经济学家，越是懂得这样一个道理：没有旧知识的积累，就不会有新知识的拓展；经济学的进步，靠得是一代又一代人的努力。因此，他们在重视学术论文的同时，也十分关注概览和教材。在西方，许多站在科学前沿，研究成果卓著的知名经济学家，却都肯拿出时间亲自动手或主持撰写经济学教科书，原因也就在这里。

由经济学家写的教科书，同非经济学家写的相比，在视野、领悟、贯通、确切、适用等许多方面，显然有很大的不

同。本书作者H·R·范里安是位经济学家，又在密西根大学执教多年，下面，我们就以他的这本书作为“典型”，来分析一下，就反映西方微观经济学的本来面貌而言，经济学家笔下的教材，怎样地有别于非经济学家编的教材，换言之，也就是借它说明，一本好的教科书，应该具备怎样的特点，在经济学的传播、继承、应用和创新过程中，能够发挥怎样的作用。

那么，什么是本书所具备的主要特点和所能发挥的主要作用呢？

富有内容，使微观经济学的全部历史发展，在这里得以完整的逻辑展开，设立阶梯，使依赖它完成知识准备的读者，能一下子“站在前人肩膀上”，是本书第一个方面的特点和作用。

首先，是阐述的全面性，做到了：（1）研究推进到哪里，对于文献的概括和总结就跟随到那里。比如，作为1990和1991年度诺贝尔经济学奖金得主获奖成果的资产组合论，资产定价论和科斯定理的主要结论，1987年就被编织进了本书第一版。（2）在传统论题中注入新思想、新观念。比如，用序数效用取代基数效用，用偏好说明效用，来解释消费者行为的理论基础，不仅避开了个人基数效用无法测度和比较的诘难，而且还能通过显示的偏好，使偏好能由可观察的个人选择推出。（3）更准确地重新表述原有的命题。比如，正是由于在被不确切地写作商品需求随着价格的上升而下降的需求法则上，严格地加上了如果这种商品的需求随着收入增加而增加这样一个限制。才使消费者理论不致成为与所有行为都相容的没有特定内容从而也没有价值的经济理论。

其次，是阐述的系统性。做到了，（1）首尾一贯，相互

照应。作为全书主题的竞争均衡存在性和帕累托有效率原理，被安放在消费者效用极大化和生产者利润极大化，以及市场供求相等这样两块基石上。就技术而言，均衡价格的存在被置于供求函数的连续性之上，而连续性的存在又被置于凸性偏好、凸性技术的假设之上。从某种意义上可以说，福利经济学的两个定理出现以前，除了垄断和不完全竞争，交代的都是它们成立的逻辑前提，而在它们之后，加上垄断和不完全竞争，阐述的都是假设条件不存在的结果和补救办法。

(2) 由简到繁，层层深入。比如，通过将消费者收入由既定改变为获得，消费的时间选择由单期延伸为多期，范围由普通商品扩大到资产商品，条件由确定性修正为不确定性，环境由商品市场发展为保险和股票市场，对简单消费者模型进行多侧面多层次的拓展，紧凑而清晰。(3) 组织严密，排列有序。比如，诸多的寡头垄断模型，一经按照产量领头，价格领头，联合定产，联合定价，和串谋分类，它们的联系和特性就变得很容易把握了。

突出方法，竭力推行适宜中级水平的微观经济学的分析技巧；提供工具，使学生一下子就能够掌握成套善事的利器，是本书第二个方面的特点和作用。

微观经济学研究理性的个人在一定的资源限制下所能作出的最优选择。因此差不多所有的个人行为模型，形式上都可以归结为用最优化的方法处理的问题：通过确定选择的主体、可行范围和目标，在选择变量受约束的条件下，求目标函数的极大值。从而使得数学规划成为讨论它们求解和解如何随参量变动的一般条件的极为便利的工具。另一方面，由于任何个人的最优选择都是所有其他个人最优选择的函数，

所以对于市场供求相等的经济均衡的研究，在形式上就可以归结为对于联立方程组的解的存在性，唯一性和比较静态性质的研究，而充分地利用有关的数学工具。极大化原理和均衡原理，是在构筑和分析微观经济学模型时最经常使用的技巧，也是本书竭力推行的基本分析方法。

为此，作者颇费了一番苦心。一方面，运用微积分，显然，这样不仅可以使许多论证变得相当简结、严密，而且，由于它的灵巧和精确，常常还可以使所研究的问题被得到更深刻的理解和印象。但另一方面，考虑到那些缺乏数学准备的学生可能会遇到的困难，又不得不将它们作为附录，而将正文的数学分析限制在初等代数的水平上。可贵的是，即使这样，也还要让学生能体会经济分析严密的逻辑推理，能养成用等式或数字表示经济问题的习惯，能学会给经济问题以定量回答的本领。因此，我们在书中见到的才会是，详细说明的基本概念，明确交代的假设条件，和由假设到结论的周密、严格的数理推导。不管分析是用数学符号、图表说明、还是文字阐释处理，构成分析基础的，实质上都是已被作为标准形式采用的公理化方法。深入浅出，用简易的运算和分析推出通常由高深奥密的现代数学证明的结论，又不失论证的严密性和一般性，不能不说是本书初版获得成功的重要原因。

注重应用，理论和方法都密切联系现实问题，启发诱导，培养学生运用所学到的知识和技巧解决实际问题的能力，是本书第三个方面的特点和作用。表现在：

1. 不论怎样抽象的理论，都处理得可以应用来分析实际问题。消费者行为理论，历来被视为微观经济学最神秘、最

抽象的部分，为了使它能用于政策评估，本书除了像多数教科书那样由偏好效用函数导出需求函数以外，还特别地关注由观察到的需求行为估计偏好和效用函数的问题。这样做的基本思想是，一旦根据选择行为的观察资料，估计出了偏好和效用函数，就可以用它来预测新情况下的选择行为和评估政策建议与环境变化。据此，第5、7、14章，分析介绍了用商品平均支出份额估计柯布-道格拉斯效用函数，用显示偏好分析估计无差异曲线，用消费者剩余测度拟线性效用，和用货币测度效用这样几种方法，并列举了应用它们进行税收、公共运输系统，社会养老保险计划等公共政策评估的实例加以说明。

2. 逐步放松假定，让理论不断逼近现实。微观经济学的相当部分，建立在完全竞争市场的一系列假设基础之上。这些假设，包括供求者都是价格的接受者，都有完全的信息，消费者效用函数只是他自己的消费和要素供给的函数，厂商的生产可能性只取决于他自己的投入和产出，和不存在规模收益，等等，在许多情况下都是违背现实的，因此，理论要能被应用于实际，这些假设就必须随着分析的深入和概括趋于全面，而被逐渐地放松。在某种意义上可以说，各门应用经济学，如财政学，产业组织经济学，消费经济学，劳动经济学，生产经济学，信息经济学，环境经济学，管理经济学等等，就是这些假设放松后才找回的世界。微观经济学作为各门应用经济学的基础的地位，就是这样奠定和巩固的。

3. 大量例举具体例子，生动说明理论和方法如何付诸实践。各种例子可分为两类，一类是虚拟的，另一类来自报告文献。目的是借以启示学生，应该怎样把要解决的实际问题，

转换为能用标准的微观经济学方法处理的形式，再通过图形分析和代数求解，找出量化了的并被赋予了经济含义的答案。这样做不仅学生的直觉、抽象能力、建模技巧、解题水平可得以提高，而且，理论的经验意义也显得更为明朗：可以并且应该加以应用和得到检验。本书作者在一版序中曾说，他见到的许多教科书，常常不能使学生解决像具有线性供求曲线的竞争市场会对税收作何反应，新厂商进入会对库尔诺均衡产生什么影响这样一类问题，正因此，他才把提供分析工具和培养解决问题的能力视作本书的写作意图和创新尝试。他如愿了。

以上，是本书称得上微观经济学“典范”教材的根据，也是我们在众多的同类教材中选择翻译它的原因。

(三)

现代西方经济学是在西欧和美国的土壤上培育出来的。美国的经济学教科书，讨论的主要是美国经济，明显地刻着那里的制度烙印。当它们被介绍到具有不同文化、政治、经济背景的国家中去的时候，不可避免地会发生这样一个问题：它们能有多大程度的适用性？虽然，这个问题归根结底必须诉诸经验事实回答，可是，人们却总愿意先从理论上对它作一番探讨。

一部分西方国家的经济学家认为只存在一种经济学即罗宾斯所定义的那种经济学。这种经济学的原理，在某种意义上说，脱离了经验主义的观察和对政策的关心，完全独立于时间和空间，因此，具有普遍的适用性。

一部分非西方国家，特别是社会主义国家的经济学家则

认为，社会主义制度不同于资本主义制度，所以社会主义经济学也不同于西方经济学。如果说社会主义国家可以利用西方经济学，那就意味着社会主义经济制度多少类似于，或正在变得越来越类似于资本主义制度，而这是不能接受的。因此，作为资本主义意识形态的西方经济学，不适合于社会主义国家。

如果事情真像第一种认识那样，倒也简单。既然只有一种经济学，那么别的国家只要将它原封不动地搬去，就可以描述和规范那里的经济活动了。又何必还要称它西方经济学呢？

如果事情真像第二种认识那样，倒也干脆。既然意识形态水火不容，那就各自关门搞自己的经济学好了，又何必还要借鉴西方经济学呢？

显然，实际情况既不这样简单，也不这样干脆。这里的关键，在于应该怎样看待经济学的性质和应该怎样对待经济学的理论体系。

经济学是经验科学，它的研究对象，是一定社会关系中人们利用有限物质资源满足各种需要的物质生产活动。它以理论思维的方式，把握人们的这种经济活动。因此，不论是对人与人关系的洞悉，还是对人与物关系的观察，它的内容，都应该在现实中存在原像，它的每一个概念，每一则命题，每一条原理，都应该得到逻辑的证明和实践的检验。由于认识和实践总是在一定的社会历史条件下进行的，所以同其他科学一样，经济学所揭示的，也都是有条件的真理：一方面，只在一定的条件下成立，在特定的时空中起作用；另一方面，只要条件具备，就不受时空限制，总起作用。

经济学是社会科学。与自然科学不同，它的研究对象，不是独立于人之外，先于人类就已存在的自然界的运动规律，而是人参与其中，随着人们社会实践的发展而逐步展示的经济运动规律。人们的经济活动是社会历史活动，所以，每一个历史时代都有那一个历史时代的规律，处于不同发展阶段上的国家，肩负着不同的历史使命。每一个国家都有那一个国家的历史，它们过去走过的路不相同，现在走着的路也不会一样。自然界尽管也有历史，但它不是在人类实践的基础上形成的，就认识论讲，自然科学不像社会科学这样受到对象本身历史发展的限制，因此，经济学是历史科学，而物理学不是。人们的经济活动是社会实践，总是在一定的制度背景和组织结构中进行，体现着人们一定的目的、要求、利益，因此，经济学与自然科学不同，带有意识形态的性质。

经济学，作为一门学科，固然有着自己区别于其他学科的特定的研究对象，有着各种经济理论都必须解决的若干基本经济问题；有着各种经济理论普遍适用的一般分析方法；有着各种经济理论共同采取的某些政策工具。但是，由于不同的国家之间，以及一个国家的不同发展阶段之间的经济情况不同，所以，共同的对象采取了因时因地不同的形态；共同的问题出现在不同的制度结构中和发展水平上，共同的方法被用于分析不同的运转机制，共同的政策在不同类型经济中的作用范围、方式和结果大相径庭。所以，经济学，在它实际存在的形态上，总是一个个深刻烙有时代和发源地印记的经济理论体系。它们每一个都是具体的，整个体系由一条被自认为是反映了所考察经济阶段主要矛盾发展始终的主要规律贯穿、统帅，并带有意识形态的性质。既然各国经济的主

要矛盾不同，所走的具体道路不同。所以，在这种意义上可以说，有多少种经济，就有多少种经济学。（或者说经济理论体系更恰当，下同。）其实，甚至关于同一种经济，也有许多种经济学。当代美国主流经济学与诸非主流经济学的对峙，就是一证。

有这么多种经济学，怎样把握？既然美国的主流经济学只是其中的一种，为什么又要对它特别地加以关注？

众多的当代经济学，可以分类把握。例如，按社会制度划分，可以有社会主义经济学和资本主义经济学；按经济发展的水平划分，可以有发达国家经济学和发展中国家经济学；按经济运行机制划分，可以有市场经济国家的经济学和计划经济国家的经济学。

对于每一种类型的经济学，可以通过典型加以把握。自由资本主义时期的中心是英国，所以，英国的经济学成为那时资本主义经济学的代表。今天，垄断资本主义的中心移到了美国，所以，抓住了美国经济学这个典型，就可以以一知万，知道其他许多种同类的经济学是怎么回事了。

以美国经济学为代表的现代西方经济学，是几百年理论探讨和经验研究相互作用的产物。发达的经济发展程度，为它反映商品经济运行过程中的变量依赖关系提供了客观的条件，由长期的理论争鸣和意见交锋沉积下来的专门知识，为它形成一个关于经济过程的前后一贯的体系创造了主观的条件。实用性，不同程度地揭示经济现象的某些内在联系，是它得以站立起来的一条腿。虽然，它所揭示的东西，反映的只是美国的特殊情况，但是，由于一般总是寓身于特殊之中，所以，从理论上说，它应该包括商品经济普遍适用的某

些一般的原理和方法。以为制度不同，不是自由市场经济，就不能向西方经济学借鉴的观点，是一种形而上学的误解。研究西方经济学，就是要在全面把握它的基础上将它体系打碎，以从中取出对于我们有用的一般原理和方法。当然，即使是适用的东西，也不能照搬，因为条件不同。从彼时彼地拿来的东西，在被用于考虑此时此地的问题的时候，通常总要根据实际情况作出修正和补充，而新的理论和新的方法，常常也就由此被创造出来。这是规律。另一方面，还要注意，在离析西方经济学的时候，切勿疏忽了它的另一条腿：或明或暗地将现存制度作为既定前提加以肯定，即通常所说的它的辩护性。

克服体系，吸取其中合理的要素，同时注意意识形态的批判，这就是我们对待西方经济学应该持有的态度和方法，也是我们阅读本书应该持有的态度和方法。

(四)

改革开放以来，许多西方经济理论被介绍进国内，就微观经济学来说，至少，在应当重视和研究资源配置效率，市场机制在资源配置中的作用，市场调节和政府干预的衔接，消费者和企业的理性行为，企业制度、法律制度和行政管理制度与经济运行效率的关系，经济效率和公平分配的关系，现代数学在经济分析中的应用，以经验为根据的估测和检验方法这样一些方面，我们确实向西方学习和借鉴了若干有用的东西，这是有目共睹的事实，无须赘述。需要讨论的倒是，在这个过程中，我们应该认真加以总结的，是怎样一些规律性的认识？我以为，值得重视的少说也有：