

经济学经典文献选读

第二讲

现代经济学的边界

授课人：刘 岩

中山大学管理学院（创业学院）

经济学的研究范畴：Robbins基于稀缺性的定义

Economics is the science which studies human behavior as a relationship between **ends** and **scarce means** which have alternative uses.

Lionel Robbins, 1898 – 1984

An Essay on the Nature and Significance of Economic Science

1935, p. 15

❖ 有限的资源 vs. 无尽的追求



什么是经济活动？

❖ 经济学以人类经济活动为分析对象，如何对界定经济活动(economic activity)?

- 内涵：利用稀缺资源满足人类需求的行为活动
- Robbins资源稀缺性定义：satisfy ends by scarce means with alternative uses
 - ✓ Ends目标->需求，means手段->资源

❖ 什么是人类的需求？

- 生存，繁衍，精神
 - ✓ 现在能活，未来能活（以基因的形式，道金斯《自私的基因》），活得愉快
- 满足上述需求，需要消耗资源（物质或非物质）
 - ✓ 资源：一定的物质或能量（现代物理-质能统一），思想素材或精神活动也可归结为物质-能量

❖ 稀缺性的根源：物质、能量有限，特别是对人类个体而言（时空有限）

经济活动的分类：一个人

❖ 单个人的经济活动：生产-消费

- 不同历史阶段的物质生产特征
 - ✓ 原始社会：采集、狩猎
 - ✓ 前现代社会：种植、游牧
 - ✓ 现代社会：工业化生产
- 物质生产的产品是消费品(consumption good)，但人不只需要消费品，还需要非物质生产的产品，即服务品(service good)
 - ✓ 典型的服务品：餐饮住宿，文化旅游，个人服务（理发、美妆）
 - ✓ 个人能给自己提供服务吗？可以：比如原始人给自己磨一块玉石
- 生产活动的共同特点：消耗劳动（时间）
 - ✓ 每个人时间有限，且时间可用于劳动，也可用于闲暇(leisure)消费

❖ 单个人经济活动的核心矛盾：有限的时间，最大化消费，包括消费品、服务品与闲暇

荒岛上的鲁滨逊 / 荒野中的贝爷



经济活动的分类：多个人

- ❖ 单个人只需进行生产-消费决策
- ❖ 如果是多个人，则还可以进行经济交换(exchange)
 - 消费品与服务品的经济交换，称为交易(transaction)
 - 进行交易的消费品、服务品及劳动，统称为商品(good)
 - ✓ 劳动是一种商品：可以用劳动（通过生产服务）交换他人的消费品或服务品
 - ✓ 闲暇的特殊性：每个人自己的闲暇无法与他人的商品或闲暇进行直接交易
 - ✓ 劳动与闲暇可以1-1替换，因此个人的闲暇依然可进行间接交易：有可能通过自己的商品与他人商品的交换，节约自己的劳动时间，从而获得更多的闲暇
- ❖ 商品交换一定能体现稀缺资源的价值
 - 资源（物质与能量）都是有限的，不会有无成本获取商品的可能，没有免费午餐
- ❖ 多个人经济活动的核心矛盾：原有个体层面生产-消费矛盾之外，还有以自身资源交换他人商品的矛盾

《清明上河图》



资源禀赋

❖ 禀赋(endowment): 可用于生产或交换的资源

❖ 个人禀赋

- 时间: 所有人一致
- 天赋(gift): 人与人之间有差异
- 人力资本(human capital): 在天赋基础上, 后天可以通过学习积累的知识技能
- 财产(property)/财富(wealth): 不动产(real estate), 包括土地、房屋、矿产等; 动产(包括金融资产), 无形资产(知识产权等)

❖ 集体禀赋

- 所有自然资源: 土地, 森林, 草场, 河流, 海洋, 野生动物, 矿产资源(化石能源), 可再生能源(风能、水能、太阳能等)
- 非物质禀赋: 知识、技术等

❖ 禀赋的价值, 同样在生产、消费、交换中获得体现

功利主义、效用与偏好

- ❖ 功利主义(utilitarianism)的公理：个人通过消费（包含服务）与闲暇获得效用(utility)，并且希望最大化自己的效用
 - 功利主义源远流长：司马迁“天下熙熙，皆为利来；天下攘攘，皆为利往”
 - 现代功利主义思想的奠基人：杰里米·边沁(Jeremy Bentham), 1748–1832, 英国政治哲学家
- ❖ 19世纪古典经济学有很长时间的争论，效用可以度量吗？效用是客观实体还是主观感受？
 - 19世纪末，Pareto等为代表的经济学家最终选择了后者作为理论基础
 - 现代微观经济学中，首先定义个人的偏好(preference)，再说明一定条件下，偏好定义了一个效用函数，每个消费组合对应一个效用值，且效用值的高低代表个人对消费组合的偏好

$$x \succeq y \Leftrightarrow U(x) \geq U(y)$$

稀缺资源的价值度量：交换价格

- ❖ 日常语言中，资源稀缺表明该资源是值钱的(valuable)，换句话说，获取该资源是有成本的(costly)
 - 衍生逻辑：越稀缺，越值钱
- ❖ 如何衡量稀缺资源的价值？答案1：.....交换价格(exchange price)
 - 交换价格是一个相对价格(relative price)概念：1单位A商品，能够交换多少单位的B商品，C商品，.....
 - 任何时间、地点、环境下的商品交易，都给出一个交换价格
 - 一瓶水：不同人可能愿意付出的交换比例不同
 - ✓ 快渴死的人当然愿意付出更多的交换比例
- ❖ 稀缺资源（如商品）的价值，取决于市场通行的交换价格
 - 市场的意义：众多参与者交易类似商品/服务，能够形成广泛认可的交换比例
 - ✓ 经典的例子：两个人，互相要价¥1000...卖给对方一袋垃圾，问垃圾值多少？

稀缺资源的价值度量：使用价值

- ❖ 若稀缺资源不进行（市场）交换，还是否有价值？答案2：使用价值
- ❖ 考虑鲁滨逊一个人的荒岛经济，没有其他人来进行交换
- ❖ 更具体的考虑，鲁滨逊的时间是否有价值？
 - 直觉：有，因为时间用于劳动，可以产生消费带来效用；用于闲暇，也带来效用
 - 假设时间单位化为1，闲暇数量为 L ，劳动数量为 N ， $L + N = 1$
 - 假设鲁滨逊有消费效用 $\log C$ ，闲暇效用 $\log L$ ，总效用 $\alpha \log C + (1 - \alpha) \log L$ ， $\alpha \in (0,1)$ ，有生产函数 $Y = N^\phi$ ， $\phi \in (0,1)$
 - 鲁滨逊的生产-消费-闲暇最优化问题：

$$\max_{C,L} \alpha \log C + (1 - \alpha) \log L \quad \text{s.t. } C = N^\phi, L + N = 1$$

- ❖ 稀缺资源用于直接消费、生产，一定具有使用价值

稀缺资源的价值度量：均衡价格

❖ 交换价格与使用价值是否具有内在联系？答案：有，市场均衡价格统一两者，构成内在逻辑一致的资源价值尺度

■ 市场均衡：给定每人的资源禀赋，一组商品价格与一组资源配置（消费、投入、产出等）构成一个市场均衡，若下列3个条件得到满足（ $\cdot$ 表示向量内积）

1. 给定价格，每个人最大化效用 $\max_{x^h} U^h(x^h) \text{ s.t. } p_x \cdot x^h \leq p_x \cdot e^h$

2. 给定价格，每个厂商最大化利润 $\max_{z^f} p_y \cdot y^f - p_z \cdot z^f \text{ s.t. } y^f = G^f(z^f)$

3. 消费与生产的最优选择满足供给等于需求，即市场出清(market clearing)

$$\sum_h x^h + \sum_f z^f = \sum_h e^h + \sum_f y^f$$

■ 此时的价格体系（向量） $p = (p_x, p_z, p_y)$ 称为（竞争性）市场均衡价格

✓ 竞争性：所有决策主体把价格当做给定，自己的行为不影响价格

■ 注意，上述定义不是严格的数学形式表达，但不影响概念内涵

经济效率的核心概念：Pareto最优配置

Pareto最优配置

- ❖ 给定一个经济体系的要素禀赋与生产技术约束，若一个消费-生产配置 $\mathcal{A} = \left\langle \{x^h\}_{h \in H}, \{y^f, z^f\}_{f \in F} \right\rangle$ 达到了这样一种状态，即不存在满足同样要素禀赋与生产技术约束的另外一个配置 $\tilde{\mathcal{A}} = \left\langle \{\tilde{x}^h\}_{h \in H}, \{\tilde{y}^f, \tilde{z}^f\}_{f \in F} \right\rangle$ ，使得对所有消费者都有 $u^h(\tilde{x}^h) \geq u^h(x^h)$ 的同时对某一特定的消费者有 $u^\ell(\tilde{x}^\ell) > u^\ell(x^\ell)$ ，则称配置 $\mathcal{A}$ 为Pareto最优配置
- 满足要素禀赋与生产技术约束的配置，称为可行(feasible)配置
 - 若对给定的可行配置 $\mathcal{A}$ ，存在另一个可行配置 $\tilde{\mathcal{A}}$ ，满足所有消费者在 $\tilde{\mathcal{A}}$ 中所得效用不低于 $\mathcal{A}$ ，且存在某一个消费者在 $\tilde{\mathcal{A}}$ 中效用严格高于 $\mathcal{A}$ ，则称 $\tilde{\mathcal{A}}$ Pareto 优于 $\mathcal{A}$
 - 可行配置 $\mathcal{A}$ 是Pareto最优配置，即不存在其他可行配置Pareto优于 $\mathcal{A}$

福利经济学第一与第二定理

福利经济学第一定理

- ❖ 在常规条件下，任一经济体系的竞争性均衡配置都是Pareto最优配置
 - 给定一个经济体系，若配置与价格体系 $\langle \mathcal{A}, p \rangle$ 构成一个竞争性均衡，则称 $\mathcal{A}$ 为竞争性均衡配置
 - “常规条件”：偏好、生产技术等满足特定正则(regularity)条件

福利经济学第二定理

- ❖ 在常规条件下，任一经济体系的每个Pareto最优配置 $\mathcal{A}$ ，都可以找到一个价格体系 p ，使得 $\langle \mathcal{A}, p \rangle$ 构成一个竞争性均衡
 - 换言之，任何一个Pareto最优配置结果，都可以通过竞争性市场来实现

福利经济学第一与第二定理，意味着

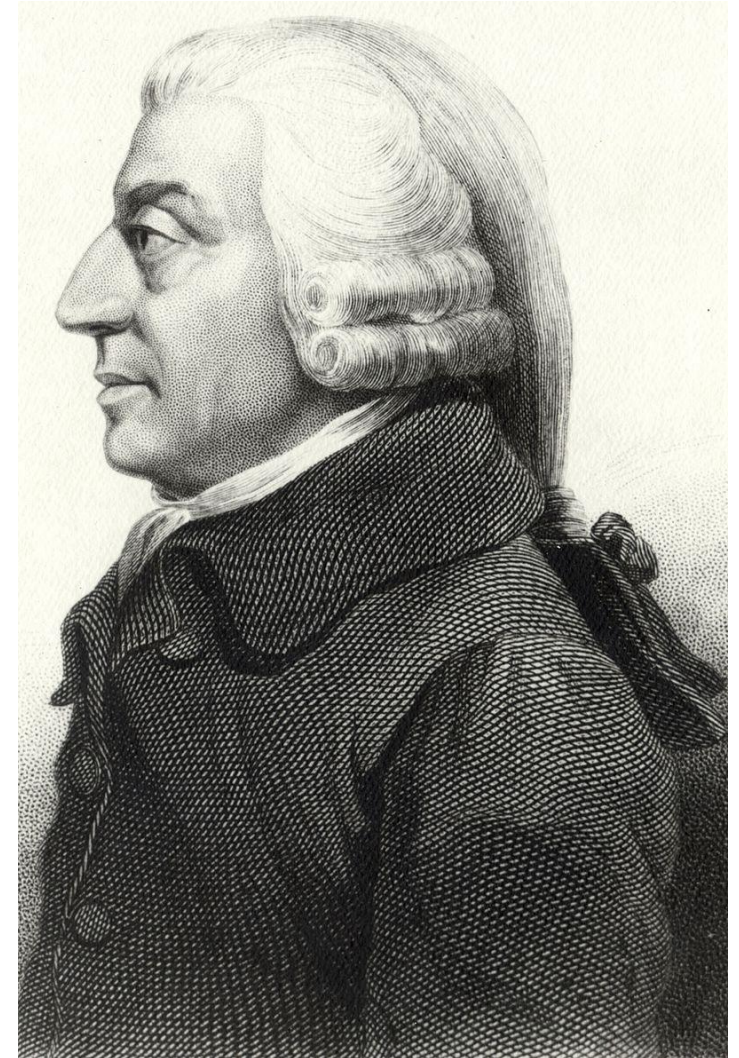
市场 $\Leftrightarrow$ 计划

现代经济关键特征：市场作为看不见的手⇔福利经济学第一定理

By preferring the support of domestic to that of foreign industry, he intends only his own security; and by directing that industry in such a manner as its produce may be of the greatest value, he intends only his own gain, and he is in this as in many other cases, led by an **invisible hand** to promote an end which was no part of his intention. [...] By pursuing his own interest he frequently promotes that of the society more effectually than when he really intends to promote it.

Adam Smith, 1723 – 1790

Wealth of Nations, Chapter 2 of Book IV, 1776

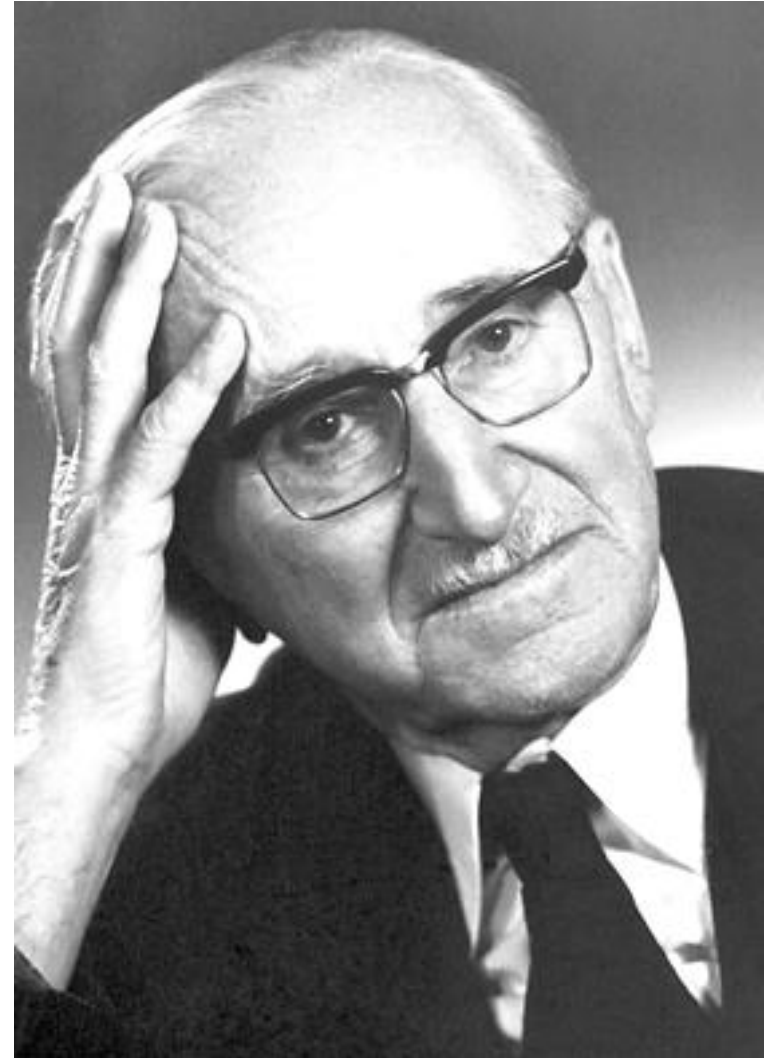


现代经济关键特征：市场与价格体系同时具有配置与信息效率

We must look at the price system as ... a **mechanism for communicating information** if we want to understand its real function ... The most significant fact about this [price] system is the economy of knowledge with which it operates, or how little the individual participants need to know in order to be able to take the right action ... by a kind of symbol, only the most essential information is passed on, and passed on only to those concerned.

Friedrich von Hayek, 1899 – 1992

“The Use of Knowledge in Society,” *A.E.R.*, 1945



市场与价格体系不是永远有效，至少是在社会公正的视角下

- ❖ 斯密与哈耶克的观点(view)是现代主流经济学的思想基础，其基本逻辑与罗宾斯的观点一致，即个体主义的经济主体（人、企业等）在（竞争性）市场与价格体系中自由决策，能够实现经济资源的有效配置
 - 有效配置的含义：Pareto有效，即不可能在没人受损的条件下，让某个人得益
 - 以上是福利经济学第一定理的角度
 - 福利经济学第二定理：任何有效配置，都可以通过市场与价格机制下，经济主体的个体化自由交易来实现
- ❖ 凯恩斯看到了上述观点的缺陷：满足经济效率与个体自由条件下的资源配置，可能具有极大的不公平性
 - 富者田连阡陌，贫者无立锥之地
 - ✓ 只考虑经济效率与个体自由，会导致社会达尔文主义：所有个体不如意，都是咎由自取，来源于个体不够努力（卷），懒惰、懈怠或其他恶习（躺平）