

经济学经典文献选读

第三讲

市场交易与均衡思想

授课人：刘 岩

中山大学管理学院（创业学院）

L. E. Read 1958 “I, Pencil” 《我，铅笔》（秋风译）

我是一支铅笔——最普通的木杆铅笔，只要是能读会写的男女老少都最再熟悉不过的铅笔。

写字是我的职责，也是我的业余爱好；那是我的全部工作所在。

你肯定有点奇怪，我干嘛要搞一个什么家谱。好吧，我来解释一下。嗯，首先，因为我的故事很有趣。其次，我是一件神秘的东西——要比树木、比日落、甚至比闪电要神秘多了。不过，很不幸，那些用我的人把我看得平淡无奇，就好象我完全是自己钻出来的，一点背景都不需要。这种目空一切的心态把我归入大路货的档次。这实在是一个令人伤痛的错误，而如果人们一直犯这种错误，难免会出乱子。因为，博学的 G. K. Chesterton 曾经说过：“我们会因为缺乏好奇而毁灭，而不会因为期望奇迹而毁灭。”

《我，铅笔》（续）

我，铅笔，尽管看起来平平凡凡，但是也值得你探索和敬畏，我会证明给你看的。事实上，如果你能理解我的心——唉，这对不管什么人来说，恐怕都是过高的要求——如果你能认识到我所蕴涵的那些不可思议之处，你就会愿意努力维护人们正在不幸地丧失的自由。我可以教给你们一些深刻的教训。而且我教给你的教训，要比汽车、飞机或者是洗碗机还要深刻——这恰恰是因为，我看起来是这么地简单。

简单？在这个地球上，没有一个人能了解我是如何被制造出来的。这听起来实在有点荒唐，是不是？尤其是当我们得知，在美国，每年要生产15亿支我，就更荒唐了。

《我，铅笔》（续）

我的家谱得从一棵树算起，一棵生长在加利福尼亚北部和俄勒冈州的挺拔的雪松。现在，你可以想象一下，锯子、卡车、绳子，以及无数用于砍伐和把雪松圆木搬运到铁道旁的各种设备。再想想制造砍伐和运输工具的形形色色的人和数不胜数的技能：开采矿石，冶炼钢铁，再将其加工成锯子，轴，发动机；要种植黄麻，经过复杂的工序将其加工成粗壮的绳子；伐木场要有床铺，有帐篷，要做饭，要消耗各种食物。哎呀，忘了说了，在伐木工喝的每杯咖啡背后，也有成千上万的人的劳作！”

《我，铅笔》（续）

圆木运输：平板大卡车、铁轨、火车头、整个交通体系；

木材加工： ...

石墨：开采、提炼、加工、包装、运输

添加黏土：精炼工艺过程...变成铅笔芯；

雪松木杆上涂了六层漆： ...

标签： ...制造树脂和炭黑；

金属箍：开采锌矿石和铜矿石，制作成闪闪发光的薄铜片，加上黑圈（黑镍）；

橡皮头：硫化油胶（由荷兰东印度群岛出产的菜籽油跟氯化硫进行化学反应制造出） ...各种各样的硫化剂和催化剂，上色的颜料则是硫化铬。

《我，铅笔》（续）

我，铅笔，是种种奇迹的复杂的结合：树，锌，铜，石墨，等等。然而，在这些大自然所显现的种种奇迹之外，还有一个更为非凡的奇迹：人的种种创造精神的聚合——成百上千万微不足道的实际知识，自然地、自发地整合到一起，从而对人的需求和欲望作出反应，在这个过程中，竟然没有任何人来主宰！

假如我，铅笔，是唯一能够对世界上的男男女女们在可以自由尝试的情况下可以达到何种成就提供证据的东西，那么，某些人信心不足，还情有可原，但是，证据多的是，都近在眼前，唾手可得。

主流经济学的两个理论基石

- ❖ 通过市场交易，实现资源、商品、服务在数量众多的市场参与者之间的配置
 - 市场交易尊重个人意愿：个人自由(individual liberty)的重要实现条件与实践结果
 - Hayek：市场是一个非常经济的信息传递机制
 - ✓ 最简化的情况下，只需要价格来传递信息
 - 合作博弈论：市场是一个高度简洁的利益协调(coordination)机制
 - ✓ 资源分配，只需要通过交易价值/价格来体现——价高者得，人往高（价）处走
- ❖ 依托均衡概念，在理论上确保内在逻辑一致性
 - 市场总能出清：一般均衡存在性定理，Arrow & Debreu (1954, *ECTA*), McKenzie (1959, *ECTA*)
 - 均衡配置 $\Leftrightarrow$ 有效配置：Pareto (1901, 1906), Debreu (1951, *ECTA*; 1954, *PNAS*)
 - ✓ 经济规模增加，均衡配置与核(core)配置等价(Debreu & Scarf, 1963, *IER*)

市场及均衡是新古典经济学理论构建的核心

❖ Debreu (1959) *Theory of Value*

- 尽管Debreu并没有成功在Yale拿到tenure

❖ 市场当然不是唯一的资源配置机制，还有其他经济组织(organization)，如企业在其内部进行的大量资源配置活动

- Coase: 市场存在交易成本，故有些资源配置活动宜通过非市场形式进行
 - ✓ 匹配(matching)，缔约(contracting)，实施(implementation)

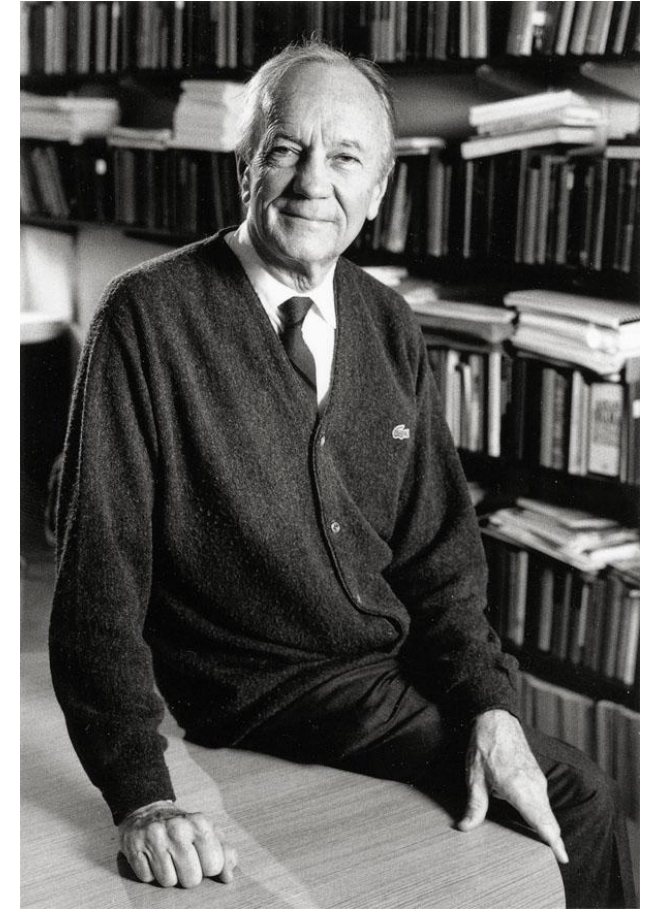
❖ 均衡也不是唯一的资源配置实现方式，历史上还有各种“非均衡”(disequilibrium)理论

- 但均衡是最简洁且自洽的资源配置决定概念
 - ✓ Hahn, F. H. 1984. On the Notion of Equilibrium in Economics. *Equilibrium and Macroeconomics*. Basil Blackwell.

稀缺资源的价值度量：均衡价格的存在性

- ❖ 上述效用、产出以及个体最优化（边际效用、边际产出）、竞争性均衡的理论框架，均在19-20世纪之交建立
 - 边际主义革命(Marginalism Revolution): Marshall, Jevons, Pareto, ...
- ❖ 但一直没有在理论上说明作为价值尺度基础的均衡价格的存在性
 - 给定一个一般性的市场经济体系，众多消费者、厂商，不同效用，不同禀赋，不同生产技术等等，是否存在均衡价格体系，使得决策者最优选择同时满足市场出清条件？
- ❖ 这一古典经济学向现代经济学（新古典经济学）转型的过程，最终在20世纪50年代完成，标志是一般均衡(general equilibrium)理论的建立
 - Arrow, Debreu, McKenzie（两前一组）的工作，严格证明了一般条件下，均衡价格向量的存在性
- ❖ 从此，所有商品的价值，都可以通过市场价格来衡量、比较

Arrow (1921-2017), Debreu (1921-2004), McKenzie (1919-2010)



均衡价格的关键意义

- ❖ 均衡价格提供了一个统一的价值尺度，用于衡量所有的人类经济活动
 - 生产、消费、交换
- ❖ 均衡价格提供了一个概念框架，统一了交换价格与使用价值
- ❖ 均衡价格提供了度量全部经济活动价值的方法（此处·表示普通乘积）

$$\underbrace{\sum_{i \in X} p_x^i \cdot x^i}_{\text{消费总价值}} = \underbrace{\sum_{i \in X} p_x^i \cdot e^i}_{\text{禀赋总价值}} + \underbrace{\sum_{i \in Y} p_y^i \cdot y^i - \sum_{i \in Z} p_z^i \cdot z^i}_{\text{技术生产活动总价值}}$$

经济活动总价值，即总增加值

- X, Y, Z 表示商品消费品（及服务）集合，产品集合，投入品集合
- 禀赋可以看做特殊的生产过程（设想为采集），则消费总价值=生产总价值

基于主流理论的经济活动测度核心指标：GDP

- ❖ 国内生产总值(gross domestic product, GDP)：一定时期内，一国境内所有商品与服务生产活动创造的增加值(value added)总额
 - 一定时期：一年，一季度
 - 一国境内：严格界定是GDP核算区，比如中国GDP核算就不含港澳台
 - 所有商品与服务：严格说来应包括家庭生产（做饭、洗衣等），以及自有住房的居住服务（基于市场租金推算）
 - 增加值：大多数生产活动都设计中间品投入，中间品的增加值要扣除，否则重复计算
- ❖ 核心假设：商品与服务的增加值衡量，必须基于市场[均衡]价格
 - 潜在假设：一国市场总体处于供需平衡的均衡状态，市场价格就是均衡价格
 - 市场价格下，前页公式才成立