

一般均衡理论的有限扩展与边际修正

——新制度经济学与信息经济学批评

王廷惠

(北京师范大学 经济与工商管理学院, 北京 100875)

摘要:由于忽略了时间、知识与企业家等重要现实因素,一般均衡理论存在致命缺陷。一般均衡理论的现代发展,包括新制度经济学和信息经济学边际意义上的努力,仍然没有突破原有框架的根本局限。新制度经济学不过是一般均衡理论的现代制度版本,方法上仍然继承了新古典的衣钵。信息经济学将信息理解为一种商品的方法,忽略了无知的知识问题,同样无法为理解真实世界的许多现象提供合适解释。

关键词:一般均衡;新制度经济学;信息经济学;知识

中图分类号:F019.1 **文献标识码:**A **文章编号:**1001-9952(2004)10-0070-14

以一般均衡理论为核心的新古典经济学有关市场机制的分析及结论,为发展和完善市场经济做出了积极贡献。一般均衡理论至少可以为研究非均衡问题提供一个基准点和参照系,作为理解现实世界可供选择的工具之一。基于一般均衡理论的新古典经济学感兴趣的基本问题,是寻找实现给定资源最优配置的条件,不是更为贴近现实地解释经济现象。正如科尔奈所指出的那样,“现代均衡理论不过是以最优方式协调自利行为的斯密‘看不见的手’之数学精确表达形式。在斯密时代,对于资本主义经济运行的这一描述是真实的(尽管不够精确)。斯密直觉以无瑕疵的精确形式得以表达,历时100余年。一旦获取精确的表达形式,(这一理论)却变成了完全错误的东西”(Kornai, 1971)^①。

一般均衡理论的缺陷,在于均衡条件的极其非现实性和远离真实世界的高度抽象性。由此产生的谬误,集中表现在三个方面,静态、机械的均衡世界、完全知识以及缺乏市场过程动力的解释。新制度经济学和信息经济学的边际努力,仍然局限于新古典框架,未能跳出一般均衡世界,仍然不足以成为理解现实世界经济运行的合适理论工具。

收稿日期:2004-07-14

作者简介:王廷惠(1968—),女,贵州铜仁人,北京师范大学经济与工商管理学院博士后流动站研究人员,广州行政学院经济学教研部副教授。

一、一般均衡理论：对时间、知识与企业家的忽略

一般均衡理论所描述的，是一个缺乏时间过程的静态、机械的均衡世界。自Steuart(1769)首次在经济学的中使用均衡概念以来，均衡分析一直是经济理论自我吹嘘为科学理论的基础之一^①。然而，均衡不过是一个马虎的概念(Hahn, 1984: 8)。大多数经济理论几乎仍然在关注均衡状态，包括各种动态均衡和随机均衡，不论这些理论在其他方面差异多大，似乎都严重依赖均衡概念。瓦尔拉斯在其《纯粹经济学要义》中研究的均衡概念，实际上是牛顿力学在经济学领域中具体运用的结果。杰文斯同样认为经济理论可以近似地用静态力学加以类推。通过继承牛顿的绝对时空观，借鉴界定科学事实、提出假说、实验验证、形成理论等经典物理学体系的基本方法，经济学开拓了发展概念体系的道路，利用经典力学范式建构了经济学分析框架，促进了精密新古典经济理论的形成^②。均衡世界中的经济系统被描述成为线性的、静态的、确定的、简单的和可逆的，经济系统被理解为一台机器，所有厂商和居民仿佛事先编好程序的机器人般行事。在给定资源和初始条件下，结果是惟一的，因而可以准确地加以预测。原则上，结果是可以重复的，过程是可以逆转的，结果和过程独立于历史，整个体系及其组成部分的行为可以准确地进行预测并且加以控制^③。这样的机械经济活动观逐渐成长并主宰了经济学领域，这就是众所周知的一般均衡理论。经济学成为机械学的翻版，包含约束条件和最优化规则模型不过是一个机械模拟。均衡经济学家将市场看作是始终处于均衡状态，意味着不用分析“看不见的手”。由于假设所有市场能够同时进行瞬时调整，均衡理论实际上没有涉及市场过程问题。强调对均衡状态的研究，实际上就是回避了关键问题，各种均衡状态的数学描述不过是游戏而已。问题的关键是要分析市场过程，均衡分析方法只能导致对市场关键内容的错误理解。费雪(Fisher, 1983: 7)认为，不能回避非均衡问题，应该关注非均衡调整过程。

正如辛普森(Simpson, 2000: 3)所言，均衡理论也许更适合于几乎没有什么变化的计划经济或者原始社会，无助于理解现代市场经济的实际运转。自二次世界大战以来，西方世界的经济政策都是建立在均衡概念的理解和信念基础上。正因为国民经济像机器一样，经济运行的效果可以通过政府介入和适当干预加以控制，政府就有责任维持经济有效运行^④。一般均衡理论倾向于认为政府能够像工程师控制机器一样控制市场经济的运转(Simpson, 2000: 22)，因此，机械比喻实际上提供了市场经济中政府广泛介入和干预微观经济领域的理论基础。与其说一般均衡理论适合用以说明市场体系效率，不如说更适合于解释政府介入微观经济领域活动和进行微观经济干预。

1. 一般均衡理论对时间的理解：牛顿时间

基于一般均衡理论的新古典经济学无法解释大量的现实经济问题,关键原因在于其静态和相对静态框架对时间的草率处理。由于建构模型时抽掉了时间因素(rejection of time, Shackle, 1972:263),不考虑时间(atemporal, timeless),或通过极为简单的技术处理,将时间看作是可逆的过程,原因与结果之间的联系是惟一和确定的,将来不过是现在的伸展,结果能够准确加以预测。一般均衡理论框架里的时间,是牛顿时间,是可以空间化或者是理解为容器的时间(the spatialized or container view of time, Rizzo, 1994:112)^⑥,仅仅是经济学家视野内的一个坐标轴(Shackle, 1972:227~228)。毫无疑问,虽然牛顿时间概念具有许多用途,但是却抽掉了现代经济学必须解释的最为重要的问题。实际上,牛顿时间概念就是把时间转换为静态时间,时间仅仅是描述运动的一个参量,没有经济主体的学习过程^⑦。牛顿学说的信仰者,仍然试图将变化描述为“一系列同质的状态,……结果就是没有变化”(Bergson, 1911:163)^⑧,时间之箭没有任何实际意义。借助瓦尔拉斯拍卖者,包括引入货币因素的 Patinkin 一般均衡体系,本质上仍然是无时间的、静止的均衡状态。新古典经济学的一个重要特点,就是将变化压缩到一瞬间完成。毫无疑问,这样有助于数学上的技术处理,然而却排除了类似错误交易的问题,因而也就排除了经济学家公开声称要解决的问题。20世纪70、80年代法国经济学家 Grandmont 发表了一系列论文试图将 Arrow-Debreu 模型动态化,发展了短期一般均衡理论(temporary general equilibrium theory),致力于寻找宏观经济学的微观基础(尹恒、龚六堂,2002)。虽然意识到 Arrow-Debreu 一般均衡模型表面上的动态特征,遗憾的是,Grandmont 预期函数仍然建立在严格的概率统计基础上,他的努力实际上没有超越 Arrow-Debreu 框架。对时间的简化处理直接产生了理论上的很多缺陷,低估了经济运行中真实时间、不确定性和无知的重要现实意义,忽略了技术变迁对经济过程动态演进的推动作用,只是停留在经济现象表层分析变量之间的关系,忽视了对问题本质的研究。由于假定时间可逆,经济演进过程中的报酬递增、正反馈、路径依赖、非线性、混沌、多重均衡等现象均无从解释,价格相对变动显然无法解释经济长期变迁。在一定程度上,可以认为过去50年里经济学没有发生多少变化,许多最近的经济理论创新,不过是将静态的最大化工具用于分析动态问题,虽然时间在纯粹静态条件下得以考虑,但是却错误地认为能够将特定时间分配从事特定活动。这样,时间和完全知识、完全可预测在本质上是相容的。不可思议的是,尽管生活在动态、不断变化的世界里,我们用以解释问题的理论仍然是静态的。

2. “理想”均衡世界的根源——完全知识假设的谬误

将经济比喻为机器的根本错误,根源在于完全知识假设。一台机器的成功运行,关键在于机器的控制者或者工程师掌握机器运行的完全知识。然而,

市场经济中的知识是分散的和专业化的,无法加以汇总和集中。即使分散的知识能够以一定方式收集,仍然存在默示知识问题。即使默示知识问题在一定程度上可以克服,仍然会存在更为重要的问题,即有关未来的知识仍然是含糊不清和不确定的。缺乏将来的知识和有关他人的知识,没有时间维度决定的前向知识以及不同主体之间的横向知识,就不能将市场经济运行类比为—台运转的机器。实际上,即使运用最为先进的计算机,也无法克服知识问题(Simpson, 2000:19)。哈耶克认为,完全知识是最令人惊讶和最为虚假的一个假设(哈耶克,2003:144)。事实上,人类非但缺乏完全知识,而且处于极其无知(radical ignorance)状态,决策和行动不得不在知识分散环境下进行,不同人知道不同事情,每个人知道的事情通常是默示或隐含的、零散的、不准确有时甚至是相互矛盾的知识。因此,抽象掉知识问题的均衡分析框架,无法胜任研究经济体系如何解决知识问题的艰巨任务。竞争性均衡假设不同个人的数据能够相互协调,只关注调整过程的结果,忽略了竞争性过程的原因。而真正需要解释的问题,恰好就是数据得以调整的过程性质(Hayek, 1946: 94),过程分析是惟一重要的经济问题。由于假设所有市场能够即时、同时进行完全调整,均衡理论压根就没有涉及市场过程问题。实际上许多市场现象都与知识问题密切相关,由知识问题所引发。

在不存在知识问题的框架下,新古典世界的经济人进行计算的技术、可利用资源、价格、事件发生概率,均被假设已经正确地获知,市场均衡必然意味着市场参与主体无所不知,模型是封闭的,不存在任何不确定性。均衡理论通过完全信息假设,事先就能确保所有市场瞬时和同时出清,意味着经济主体没有学习余地,协调问题得以解决^⑨。在一般均衡理论的视野中,决策不过是严格的数学计算,所有决策以完全机械方式和编好程序的计算机(a well-programmed computer)方式得以事先协调(pre-reconciled)。在虚假和高度抽象的框架下,经济主体的选择只能是事先协调,并非随着时间之箭的射出必然存在意外的真实选择。经济主体有能力选择达到目标的最优路线,实现机械性质的最优化(mechanical optimization)。这样,主流框架中的经济主体失去了人类选择的基本特征,在排除人类犯错可能性的同时,也排除了行动主体想象力和创造力的重要作用,排除了发现、犯错或学习的过程以及许多现实问题。最为关键的问题是,新古典理论无法解释行动主体是如何获知有关机会的,未能说明经济主体如何发现未被利用的机会。

新古典经济学的牛顿时间观所导致的有关知识假设,不论是传统形式的完全知识和全然预见,还是现代版本的完全随机知识和预见(perfect stochastic knowledge and foresight),由于本质上都是没有时间维度(timeless),因此都没有真正涉及无知问题。实际上,真实时间和完全知识是不相容的,伴随时间之旅必定会出现新的知识。经济学要成为“选择的逻辑”(the pure logic of

choice),只有抽象掉时间,进而抽象掉知识的变化(Shackle, 1972: 151)。通过抽象掉个人缺乏知识的问题,主流经济学就束缚和深陷于资源最优配置的宿命论(foreordination of theory)泥潭,能够实现确定的市场结果(determinate market outcomes),“均衡的存在就等同于在逻辑上能够对选择活动进行事先协调”(Weintraub, 1979: 29),这样,一般均衡概念就脱离了竞争过程的古典特征(McNulty, 1968)^⑧。一旦局限于完全知识假设,不可避免地会简化现实经济运行过程中许多极其复杂的关系。

3. 抽象掉企业家行动:无法解释经济增长的微观基础

在对现在和完全确定的将来具备完全知识的世界中,可以客观定义最优解,没有企业家存在的必要,一个计算器足以胜任计算工作。人类行动等同于无生命物体之行为(Shackle, 1972: 443),排除了想象力和创造力对个人行动的决定作用。新古典经济学的厂商理论没有企业家的位置,企业根据边际成本等于边际收益原则确定均衡价格和均衡产量,生产经营活动只是一个计算过程,更具有机械特征,了无人的因素(human element)。由于根本不需要企业家,新古典经济学也就没有企业家理论^⑨。

一般均衡理论在解释经济增长时忽略了制度和动机以及不易量化处理的经济因素,包括与经济增长过程密切相关的企业家,仅仅局限于计算GDP与总投资、总资本存量和人口增长率等因素之间的关系。当然,正如Simpson(2000: 145)所指出的那样,一般均衡理论之所以忽略企业家,不仅因为他们相信科学方法的标准是运用数学模型,因而排斥了难以量化的变量,更为重要的是因为均衡经济学假定企业和居民具有完全信息,他们能够知道所有事先已经知道的选择及结果,决策者只需要计算各种不同组合并且选择能够实现意愿的方案。为了便于进行均衡分析,新古典经济学通过引入代表性企业,将企业简缩为一个点,抹杀了企业多样性以及企业间的差异。在新古典视野中,每个企业和每个居民不仅具备所有经济中现行价格和潜在机会的知识,而且还具有关于将来价格和机会的知识。企业家被假定通过选择特定的投资机会组合能够实现利润最大化,而居民则通过购买特定消费品组合能够实现消费效用最大化。完全竞争条件下的静态均衡特征,没有为企业家理论或利润理论留下发展空间(Leff, 1979; Kirzner, 1979),无法解释经济增长现象。报酬递减规律这一工具性假设,无法解释真实时间展开过程中的收益递增现象,同样也不能提供解释经济增长的现实工具。随着经济理论日益复杂化、边际分析和市场均衡理论日趋细致化和表述的日渐完整,企业家逐渐退出了理论视野。即使是舒尔茨的企业家概念,实际上也仍然是新古典意义上的企业家,企业家职能仅仅局限于非均衡条件下重新配置资源,市场总是能够产生由企业家实施的矫正活动。这样,新古典世界总是处于完全和持续均衡状态,实质上并没有留下企业家自发创新活动的余地。这种新古典方法不过是将真实世界的企

业家塞进新古典完全均衡的盒子中(Kirzner, 1985: 9)。

只要经济分析专注于完全竞争条件下的静态均衡特征,沉迷于缺乏变化的静态市场环境,就不会有企业家理论和利润理论存在的价值。由于对时间和知识的曲解,主流经济学中的自由选择显得空洞无物(Shackle, 1969: 273),因为个人不能自由选择手段和目的,自由意味着没有选择,实际上在决策之前就已经选择好了(Kirzner, 1979: 227)。如此,本质上就排除了企业家对利润机会的敏感和警觉,排除了企业家发现和创造新的手段-目的框架的可能性。由于可以进行瞬时调整并且具备完全知识,由于具有关于将来的完全知识因此不存在不确定性,无论是康替龙(Cantillon)的套利企业家、萨伊(Say)发挥协调和领导功能的企业家,还是熊比特具有创新功能的企业家以及奈特承担不确定性功能的企业家,都没有存在的价值和余地。

借助均衡概念和均衡方法探寻经济增长的原因、分析经济增长过程,显然不是合适的研究思路^⑨。因为经济增长是一个长期的、动态的非均衡过程,经济系统不是确定的、可预测的、机械的,而是过程依存的、不完全可预测的、有机演化系统(邹恒甫等,2002)。一旦认识到我们对于将来的知识总是零碎的,不完全的而且通常可能是错误的,那么有胆有识的企业家乐意承担风险以获取利润之作用就非常重要,是市场过程和经济增长过程不容忽略的关键因素。

主流经济学自斯密论述“看不见的手”原理以后,经过边际革命、瓦尔拉斯的构造,阿罗-德布鲁的证明,经济人理念、完全信息、完全理性、单一的因果关系、对称和可重复性、经济函数连续可微假说成为主流经济学的关键词,致力于精巧、科学化——在严格假设之上的演绎推理(李嘉图恶习),使之在思想和方法论上围绕着为经济学而经济学日益趋向形式化和经院化(科斯称为黑板经济学)^⑩,表现出结构的超稳定性,离现实越来越远。虽然许多经济学家对这一模型远离现实的基本假设提出了强烈批评,不容忽略的是,仍然有一批经济学家试图改进、进一步阐述和提供更为复杂的瓦尔拉斯一般均衡模型。大多数新近均衡理论的假设条件,比100多年前瓦尔拉斯最早提出的一般均衡理论所包括的假设条件更加苛刻和严格^⑪,目的是为了理论更加与复杂的数学发展一致,能够以科学的数学语言形式得以准确表达。主流经济学沿着杰文斯——瓦尔拉斯——阿罗——德布鲁——弗里德曼——卢卡斯主流分析传统行进,经济学家变成了自己所建模型的囚徒和奴隶。现代经济学已经蜕变为一大堆假设、数学符号以及模型的混合,经济思想淹没其中,甚至荡然无存。自马歇尔以来均衡经济学发展,不是学术的进步,无法胜任解释丰富、复杂的现实世界之任务。

一些学者试图脱离新古典框架,对一般均衡理论和“市场失败”理论提出质疑,挑战传统的“黑板经济学”、“课堂经济学”、“经院经济学”。关注制度、不确定性、不完全信息、信息不对称和有限理性等现实内容和问题的结果,是在

保留新古典研究范式的基础上,呈现了一系列新兴理论分支。新制度经济学和信息经济学就是这些尝试性努力的结果。

二、新制度经济学——一般均衡理论的有限扩展:

新古典方法在制度分析领域中的应用

威廉姆森指出,“经济学家应该向经济学的制度化方向发展,要放慢数学化发展的速度,用经济组织、产业结构以及经济史的知识建立经济理论”(Williamson, 1985: 386, 190~391)。始于科斯(1937)有关企业性质研究的新制度经济学(new institutional economics, NIE),重视现实经济运行的制度基础,基于文化、历史、法律等因素对制度演化的解释,有助于理解真实世界里的经济运行^①。然而,新制度经济学一些概念的内涵和外延仍然存在分歧。最为关键的是,新制度经济学是在新古典分析范式中发展起来的,仍然借助新古典核心假定、方法和工具分析经济制度,如承袭了理性经济人假定、稳定偏好、均衡、最大化和边际分析等思想遗产,解释了不同配置机制如何解决特定配置问题。虽然试图理解真实世界的经济运行,但是新制度经济学对经济问题的定义以及分析目标都具有鲜明的新古典特征,他们认为经济学问题就是稀缺资源的配置问题,问题的关键在于比较不同配置机制之间的差异。虽然放松了完全信息、静态和确定性假设,但是新制度经济学对制度分析精确化的执着努力,使这一学派的研究仍然局限于最大化和均衡的新古典框架之中^②。有别于新古典范式同质产品假设,新制度经济学家意识到产品是不同质的,而且认为应该由交易各方在交易之前确定产品特征并对产品估价(Cheung, 1983; Barzel, 1989)。但是,新制度经济学家仍然采取了信息经济学的研究方法,将信息理解为需要花费资源换取的一种商品,获取信息会产生成本,同时也能够带来收益。在新制度经济学眼里,信息对于所有人而言是同质商品,每个人对同样信息会予以同样估价,并进行同样决策(Choi, 1999: 78)。

实际上,新制度经济学商品非同质性的分析思路,并没有彻底脱离新古典框架,没有推及信息这一特殊的商品。虽然意识到信息是不完全的,但是他们认为可以将信息定义为封闭的集合,封闭的信息集合假设能够事先获知有关信息。关于时间问题,虽然新制度经济学强调了历史过程和累积机制,但是实际上仍然忠实于逻辑概念,而不是历史分析,仍然是比较静态的分析。新制度经济学视角的同质信息假设,实际上就是忽略了真实时间过程,忽略了行动者经验、知识存量以及文化和社会背景。由于认为可以对不确定性进行测度和估量,过程状态的本质对于决策者而言已经是成竹在胸了。就方法论而言,新制度经济学与新古典经济学是一脉相承,是纯粹经济学的扩展,是一般均衡理论的制度版本。实际上,“新制度经济学无意建立迥异于传统理论教条的方法,而是倾向于在经济模型中引入更多的制度细节。因为标准的新古典分析

过于抽象和形式化,无法有效解释理论家和决策者感兴趣的许多问题”(Furubotn and Richter, 1992: 1)。新制度经济学无意取代新古典理论,最终目的在于使新古典理论更为实用和有用,因此,制度理论必须与现有理论结合在一起(North, 2000: 8)。引入交易成本并且运用主流框架中的边际分析方法对制度进行比较分析,强调交易成本的可检验意义,正是科斯的贡献。以科斯为代表的新制度经济学的目标,显然是融入主流经济学,将主流经济学方法应用于制度研究,实现制度研究和主流经济学规范研究的统一(郑志刚,2002)。

新制度经济学创立的标志,就是科斯交易成本范式的提出。交易成本理论试图解释交易特征,并确定最优制度。与新古典经济学一样,交易成本经济学将个体决策的知识和信息看作是既定的,即行动主体具有完全知识和完全预见,企业行为可以是最优的。交易成本经济学受到了日益严肃的广泛批评,其中一个颇具攻击性的批评认为,交易成本最小化也许会通过其他成本转移形式得以实现,不一定求助最优制度安排。另外,将总成本分解为转换成本和交易成本^⑧,在实践中有时也会存在具体问题。正如 Lane(1995: 229)所质疑的那样,“通过将私人之间的合同转变为企业或官僚这样的科层组织能够减少交易成本吗?”新制度经济学家一直试图对不完全契约建立理性选择的形式化模型,Grossman 和 Hart (1986)、Hart 和 Moore(1990)开创的最优产权结构理论,从不完全契约理论到企业最优产权结构理论,虽然建立了形式化模型(GHM 模型)的规范方法,但是理论内容反而退步了。对交易成本另外一个批评就是其人类经济行为假设的狭窄性,忽略了人类行为的文化、社会和其他维度。另外,交易成本经济学还忽略了组织内部的个体学习过程(Hodgson, 1998),而组织内学习所形成的组织默示知识等优势,是组织能力和优势的重要内容。可见,交易成本理论仅仅提供了解释真实世界中经济组织差异的一些思路。在理解可供选择的治理结构之成本和收益的同时,必须小心谨慎地加以运用。

交易成本经济学仍然停留在新古典经济学分析框架中考察企业,忽视了丰富多样和复杂的现实世界,未能摆脱新古典范式的种种弊端。个体原子化决策行为假定与规则的可设计性是一致的,因为把各种社会约束简化为一系列固定关系的约束方程之后,当事人就能够运用理性选择对自己最有利的结果,这一选择过程就是一个规则的设计过程^⑨。在新制度经济学那里,产权制度的起源是通过私人成本和收益分析来解释的,制度变迁被简化为两种制度安排之间的比较静态分析,这种分析在科斯、诺斯和威廉姆森那里都得到了很好体现。制度安排的比较静态分析,仅仅是在给定某类条件下选择哪种制度更有效率的问题,至于一种制度安排为什么会演变成为另外一种制度安排,这一研究脉络无法提供合理的解释^⑩。另外,虽然科斯解释了企业存在的原因,遗憾的是未能解释企业家活动。可见,“NIE 的特色在于使用了标准经济理论进行分析制度运行,以发现制度在经济运行中的作用”(Coase, 1984: 230)。

三、一般均衡理论的边际修正:信息经济学的新古典特征 ——从完全知识到最优知识和最优无知

在主流经济学框架内对一般均衡理论完全知识假设所进行的挑战,主要来自信息经济学的研究。信息经济学抛弃了完全信息假设,引入了不完全信息、花费成本的信息和不对称信息等更为丰富的概念(Stigler, 1961; Grossman 和 Stiglitz, 1976、1980; Greenwald 和 Stiglitz, 1988)。信息理论和搜寻理论的大多数模型都假设,经济主体拥有所有不同行动方式的概率知识,一开始就完全知道所有的参与者、策略和支付,能够列出所有的世界可能状态并且赋予每种状态相应的概率。这样,运用最优规则,交易者只需要花费时间、精力和成本就能够找到有关条件,当边际寻找成本超过进一步搜寻的边际收益时,交易主体会放弃搜寻。不完全信息就成为理性的成本——收益计算之结果。而问题的关键在于,获取信息的搜寻成本只会缩小全然无知的范围,实际上并非获取信息的成本阻碍着学习过程,而是由于全然无知使得需要学习的东西尚未出现(Kirzner, 1990: 29)。

主流经济理论框架内的不完全信息,主要是阻碍均衡得以实现的信息无效率(informational inefficiency)情况。斯蒂格勒(1961)将在不完全信息的真实世界里获取知识理解为一个花费成本的过程,建立了描述搜寻行为的传统理论^⑨。这一方法的实质,是将知识理解为花费成本就能够获取的商品,获取信息既会产生成本,同时也会带来收益。遵循这一分析脉络,信息被理解为对每个人都一样的同质商品,因此每个人对同样的信息会形成相同的估计和预期,进而进行类似的决策,置行动主体先前经验、知识存量以及文化与社会背景于不顾(Yu 和 Robertson, 1999: 78)。在主流框架中,信息成为市场机器的润滑油。这一思路强调通过信息搜寻能够“生产”出已经知道缺失的那些信息,关注通过最优搜寻(optimal search)获取最优知识(optimal knowledge)的问题。经济主体不是全知者,仅仅是由于获取信息费用过高,因此他们保持最优或理性的无知状态(optimally or rationally ignorant)^⑩。给定足够高的信息成本,经济主体能够近似于完全理性。对于主流经济学而言,不完全信息主要是引入生产或者寻找缺失信息而产生的一种新的生产成本。这意味着人们能够知道,或者能够理性估计将要出现的价值,事先能够知道可能和不可能出现的事件或现象之边界。

信息经济学研究方法最为致命之处,在于认为能够预知并列示所有可能结果,本质上暗含了经济主体无所不知(omniscience, universal awareness)、无时不知和无处不知的假设,因而能够确定所有值得搜寻的机会,仍然将经济系统理解为概率封闭的性质。搜寻理论仅仅承认一些典型的信息缺失问题,假设缺乏有关市场不完全信息的信息主体知道缺少什么信息、信息的准确价

值,而且知道如何并以多少成本能够获取这些信息。这样,由于将知识理解为另外一种稀缺商品,信息经济学和搜寻理论使得经济学家相信经济中所有的知识问题已经得到研究。

斯蒂格勒和其他学者的有关研究虽然注意到了风险和不确定性问题,但是从根本上仍然忽略了无知的问题。在他们看来,风险只是假设将来所有可能状态都已知的情况,各种可能状态能够以概率分布形式加以定义。不确定性是指已经知道所有可能的结果,只不过与不同主观评价有关,存在无数可能的概率分布(Reekie, 1984: 113)^②。然而,现实生活中不可能得到将来各种可能性数据和信息,各个行动主体必然处于局部无知状态(state of partial ignorance)(Loasby, 1976: 7~9)。一般均衡分析和纯粹数学技巧无法解释这一状态以及取决于这种状态的各种现实问题。信息经济学强调的仍然是均衡状态,将信息理解为一种商品方法,并未注意现实世界中的知识问题,未能洞悉知识问题的关键方面,没有注意到更为根本的无知问题,实际上低估了知识问题,无法全面理解价格和市场等等现象。通过搜寻能够获取知识,意味着信息在一定程度上已经知道,正如 Boulding(1966)所指出的那样,“在每个知识概念中,隐含着—个矛盾,即在能够开始寻找之前就必须知道我们想要的东西”。在信息经济学中,知识已经知道,至少能够知道有关事件发生的概率。然而,真正相关的问题是,人们如何知道必须搜集何种信息,又如何能够知道不同获取信息方式的成本和收益。以往有意识的搜寻是建立在过去情况基础上,现在客观条件的变化必然会改变对计划的认识,然而实际变化的条件如何改变人们对计划的认识呢?“问题不仅是如何利用不同的、现有的分散知识之问题,而且还是如何引出不明确和还没有发现的知识之问题。……竞争不仅使得现有分散知识能够得以最好利用,而且产生了市场过程参与者尚未拥有的、新的知识之问题”(Bartley, 1985: 31)。

斯蒂格勒(Stigler, 1961)、Telser(1966)等学者认为,不完全信息问题的有关研究丰富了主流新古典经济学。主流框架内对信息经济学的发展给予了毫不吝啬评价,认为信息经济学是经济分析领域的重大和永恒贡献(Stiglitz, 1985: 21~22),信息问题已经占据了经济分析的核心舞台,信息经济学似乎已经改变了整个经济理论。信息经济学研究甚至表示出勃勃野心,通过写出知识的生产函数,可以将知识的生产理解为其他任何商品的生产一样,正如阿罗和德布鲁通过加上上标和下标方式引入时间、位置和风险因素对静态框架竞争分析进行扩展一样,还可以加入技术变化因素进一步扩展分析框架。不完全信息在本质上是—可以得到的已知信息,是已知的无知,只不过需要花费成本“生产”出来。包括信息经济学、搜寻理论和交易成本理论在内的有关理论分析框架,都承认不完全信息问题的存在,在一定程度上突破了新古典完全知识的假设。通过将信息从商品或服务中分离出来,信息经济学运用标准供求

分析工具进行了成本-收益分析。然而,这些发展是有限的和不够的,因为主流新古典经济学认为所有的决策选择事先已经知道,仍然保留了完全知识的假设。信息经济学只是在边际意义上有限发展了基于一般均衡理论的新古典经济学,只是丰富了封闭世界的既有内容,并没有真正理解开放的世界。实际上,开放世界的任何特定时点上,决策者不仅不知道所有选择范围,而且也不知道他们无知的范围。由于将获取信息仅仅理解为深思熟虑的搜寻过程,是一个花费成本的、“生产”已知缺失信息的过程,不完全信息的根源只能是信息成本。这样,信息经济学的大多数研究仍然是在均衡框架下进行,未能真正理解具有真实时间维度的复杂市场过程。停留在新古典框架里的信息经济学之苦心努力,仍然无助于真正理解市场过程^③。

四、结 语

20世纪的大部分微观经济学研究中,经济学家大多数仍然满足于根据均衡模型理解市场现象,关注均衡状态,无法解释均衡过程本身。主流方法的发展在解释一些困难问题方面并非完全失败,但是,这些新的修订不是建立在否定完全均衡的假设上,而是建立在扩展均衡原则的基础上。如均衡经济学日益意识到无知现象,使得他们将消除无知的成本和学习成本纳入模型分析中。然而,考虑无知的模型,并没有削弱其均衡假设,相反扩展了均衡假设的范围。新制度经济学所依赖的工具箱中装备的主要工具仍然是新古典假设和边际分析方法,具有明显的局部均衡分析和比较静态分析的新古典范式迹象,相当多的契约理论模型中的交易成本分析,在考虑了包括学习成本之后的因素后,每个市场必然总是处于均衡状态。总之,主流经济学仍然将均衡模型放在市场理论的核心位置,根据消除无知的必要成本建立起更为复杂的均衡理论,以消除理论和现实之间的差异。在一般均衡理论框架中对完全知识假设的修正,已经清楚地认识到了不完全信息存在的现实,但是,信息不足的本质被低估为确定情况下获取信息的成本问题。虽然信息经济学对完全知识假设进行了更加贴近现实的有限和边际修正,注意到了已经存在信息的不完全问题,但是仍然根本没有认识到新信息和新知识的出现,其根源在于没有对市场过程的真实时间维度给予足够关注,大大缩小了人类无知的范围。即使意识到完全信息假设的局限性之后提出的搜寻理论所进行的微小修正,实际上也没有摆脱均衡理论分析的根本缺陷。西蒙有限理性仍然是放松假设条件的静态均衡思路,同样低估了与全然无知有关的知识问题^④。这些发展所坚持的比较静态均衡方法局限性太强,不能解释实际经济行为。主流经济学框架中,知识、信息和无知都是给定的,实际上,大多数经济学家,包括新制度经济学和信息经济学都忽略了知识问题以及相关的过程分析,忽略了真实时间过程中的现实行为分析。仅仅通过引入新的假设以达到现有模型的要求,而不是进一步将

最为重要的因素纳入分析视野,特别是未能认真考虑时间过程展开过程中的无知与人类行动问题,显然不是科学研究的合适态度和方法,运用于相关现实政策分析必须谨慎。^⑥

注释:

- ①阿罗和德布鲁都想证明斯密秩序的正确性,即无数自利个人的活动能够实现经济资源和谐有效利用(Hahn, 1973: 324)。遗憾的是,在证明斯密秩序的过程中,实际上新古典框架内的努力却铺平了最有可能歪曲斯密主张的道路。
- ②参阅新帕尔格雷夫经济学大词典第二卷(1996:193)。
- ③哈耶克(2000:473)清楚地认识到,有关科学方法的讨论几乎完全受到古典物理学模式的支配。
- ④遗憾的是,正如 Sherden(1998)所观察到的那样,1988~1990年的通货膨胀以及1990~1992年衰退之后经济恢复的时间,有关经济预测都失败了。
- ⑤Simpson(2000: 3)认为,这也许是政治家最愿意接受的观点,因为强调政府干预能够有助于政治家获取更大、更多权力,结果通常会产生大量的政策失败。
- ⑥时间的流逝被表达为或者沿着线条的移动,不同日期被描述成为线段的连接(离散时间)或者点的连接(连续时间)。总之,时间都被比拟成为空间。
- ⑦在 Arrow-Debreu 模型中,所有决策都是某个初始日期进行的。随着时间的流逝,尽管经济主体最终会找出可能发生的各种不同情况,但是他们从不学习任何东西以改变第一天所进行的决策(Radner, 1970: 480~484)。这样的研究思路显然忽略了伴随着过程的学习以及过程中每个要素的顺序。
- ⑧牛顿体系仅仅是将静态状态连接在一起,不会发生内生变化。因此,任何运动必然发源于系统之外,即具有外生性质。
- ⑨一般均衡理论的新扩展注意到行为主体知识的不完全性,认为有时经济主体具备学习功能,能够修改自己行为,但是仍然要求经济主体已经知道相当数量的特定知识。
- ⑩Blaug(1980)也注意到一般均衡理论和“看不见的手”定理之间的联系极其纤弱,“看不见的手”并非对完全竞争性质的贴切描述,也不适用于对完全竞争进行客观评价。一般均衡(GE)理论框架既不能描述真实市场运行情况,也无法评价现实世界的市场过程,参阅 Kregel(1990: 88)。
- ⑪19世纪大部分时间的经济文献都没有企业家内容。20世纪的经济学发展除70年代的科兹纳、80年代的卡森和90年代的鲍莫尔外,主流经济学基本上仍然忽略了企业家。
- ⑫参见汪丁丁:互补性、概念格、塔尔斯基不动点定理,经济研究,2001,(11)。
- ⑬科斯对黑板经济学的批评或者 Demsetz(1969)表述为 the economics of nirvana 的研究方法,都根植于这样的信念,即不对事实进行仔细分析,就不可能推进经济理论。一旦发现事实对理论构成威胁,后者必须被修正或者被抛弃。
- ⑭均衡理论和市场经济现实之间的差异日益扩大。这样,均衡理论的新发展,实际上是进一步成为政府广泛干预和介入市场活动的好用的理论依据。
- ⑮科斯对于我们理解经济系统运行方式作出了非常重要的贡献,促使我们思考市场经济的复杂结构、经济管制和公共干预等重要问题。

- ⑯尽管新制度经济学并未对现代新古典经济学研究方法构成竞争,不可忽视的是确实发生了一些重要变化。新制度经济学追随西蒙,认识到真实世界中个人处理信息能力的内在局限性以及有限理性的重要意义。
- ⑰将投入转换为产出的成本,一般指生产成本。
- ⑱新制度经济学中的契约经济学和公共选择理论都强调规则设计的经济后果,但是如果考虑当事人内在的社会约束,无论是对习惯的遵从还是内生于习惯形成过程本身,理性选择行为都会不稳定,当事人可能不得不面对多重均衡和常态的非均衡问题。这样,规则就不可能被设计出来。新制度经济学和主流经济学都将个体的行动看作是可以原子化处理的,显然都没有涉及与真实时间有关的知识问题这一实质。
- ⑲供求分析框架下的制度变迁理论认为,只要制度变迁的预期收益超过预期成本,就会出现制度变迁的需求。新制度经济学从静态均衡或者比较静态均衡的角度来研究制度变迁,没有超越新古典的分析框架。
- ⑳传统理论允许交易者在考虑各种意外结果情况下,利用许多技术进行决策。
- ㉑以最优无知取代全然无知的研究方法,完全忽略了全然无知的情况,实际上仍然没有企业家发现的余地,不可能产生真正的市场过程,无法成为解释人类行为的有意义之工具(Alchian, 1970; Stigler, 1961; Thomsen, 1992; Ikeda, 1994)。
- ㉒实际上,全然无知和根本的不确定性,使得人们不可能算计自己决策与他人决策的交互影响,只能通过社会试验逐步了解所有人决策互动以及决策与价格互动的后果。不确定性实际上是因为无知,不知道哪种状态是真实的(Arrow, 1974: 33)。
- ㉓西蒙注意到人类所处环境的复杂性及其有限的信息处理能力,认为不可能发现最优解决方法(Simon, 1976: 430),无法实现最优决策。
- ㉔全然无知不同于不完全信息,不能纳入新古典模型中进行分析。
- ㉕因篇幅所限,一些参考文献刊略,需要详细文献者请与作者联系(wth2000@163.com)。

参考文献:

- [1]尹恒,龚六堂.短期一般均衡理论的发展及其应用[J].经济动态,2002,(6).
- [2]哈耶克.经济、科学与政治:哈耶克思想精粹[M].南京:江苏人民出版社,2000.
- [3]邹恒甫,龚六堂,张晏.经济增长的“不定性”——经济增长中复杂性的体现[J].经济动态,2002,(1).
- [4]郑志刚.声誉制度理论及其实践评述[J].经济动态,2002,(5).
- [5]Kornai J. Anti-equilibrium: An economic systems theory and the tasks of research[M]. Amsterdam: North-Holland, 1971.
- [6]Hahn F. Equilibrium and macroeconomics[M]. Cambridge, Mass.: MIT Press, 1984.
- [7]Fisher F M. Disequilibrium foundations of equilibrium economics[M]. Cambridge: Cambridge University Press, 1983.
- [8]Simpson D. Rethinking economic behaviour: How the economy really works[M]. London: Macmillan, 2000.
- [9]Shackle G L S. Epistemics and economics: A critique of economic doctrines[M]. Cambridge: Cambridge University Press, 1972.
- [10]Rizzo M J. Time in economics[A]. Boettke P J. The elgar companion to austrian eco-

- nomics[C]. Edward Elgar Publishing Limited, 1994:111~117.
- [11]Bergson H. Creative Evolution[M]. New York: Henry Holt,1911.
- [12]McNulty P J. Economic theory and the meaning of competition[J]. Quarterly Journal of Economics, 1968,82,(4): 639~656.
- [13]Kirzner I M. Perception, opportunity and profit[M]. Chicago: University of Chicago Press,1979.
- [14]Kirzner I M. Discovery and the capitalism process[M]. Chicago: University of Chicago Press,1985.
- [15]Cheung S N S. The contractual nature of the firm[J]. Journal of Law and Economics, 1983,26,(1): 1~21.

The Limited Extension and Marginal Modification of General Equilibrium Theory

——A Critique of New Institutional Economics and
Information Economics

WANG Ting-hui

*(School of Economics and Business Administration,
Beijing Normal University, Beijing 100875, China)*

Abstract: Ignoring some important practical factors such as time, knowledge and entrepreneur, the general equilibrium (GE) theory faces with some fatal limitations. The modern developments of GE theory, including the marginal efforts of new institution economics and information economics, still remain within the limitations of the intrinsic framework untouched. New institution economics is merely the modern institutional edition of GE theory and inherits methodological tools of Neo-classical economics. Similarly, by neglecting the knowledge problem of ignorance, the information-as-a-commodity approach of information economics cannot provide appropriate explanations to the understanding of many phenomena in the real world.

Key words: GE; new institution economics; information economics; knowledge