

市场过程理论视野的时间分析*

——与主流经济学理论的对比研究

王廷惠

(北京师范大学 经济与工商管理学院,北京 100875)

摘要:由于对时间的简单处理,基于一般均衡理论的新古典经济学无法解释市场动态过程。不同于主流经济学,洞察到真实时间的主观性和动态性,市场过程理论强调真实时间导致的不确定性以及必然的学习过程之重要意义。时间是理解现实市场运行的核心要素,真实时间决定了无知的不可避免,决定了人类行动的特征。

关键词:市场过程;时间;不确定性;无知

中图分类号:F019.1 **文献标识码:**A **文章编号:**1001-9952(2005)03-0005-12

主流经济学将市场经济看作是一个没有真实时间、静态和不存在知识问题的均衡状态,或者仅仅理解为机械运动,这一理解无助于认识市场经济实际运行的过程特征。被认为证明了斯密“看不见的手”有效性的一般均衡理论,似乎更适合作为政府对微观经济活动领域进行不适当介入和广泛干预的理论依据,是政府实施微观经济规制的理论基础。越来越多的学者关注到一般均衡理论(GE)不容忽略的缺陷,试图在真实时间、知识问题和人类行动的基础上,重新理解市场经济的实际运行情况,关注非均衡、非市场出清和时间依赖的动态特征,强调经济系统的动态性和开放性,思路不再局限于稀缺资源的短期配置问题。具有真实时间维度的复杂市场过程,要求解释市场现象的工具与思路也应该是开放的、非线性的和多样的。局限于主流框架解释各种市场现象并推演出相应的政策涵义,显然难以提供合适的解释工具。

源于对均衡经济学对市场经济的错误理解及其解释方法的不满,催生了将市场作为一个过程加以理解的理论分析。市场过程理论^①关注真实时间过程中的知识发现与利用,强调真实时间中的人类行动,尤其是企业家发现和创造过程,运用过程分析代替状态分析,将市场过程理解为不断学习、发现、创造、复杂、争胜、开放的动态过程,提供了观察经济现象和市场活动的新视角。

收稿日期:2004-12-25

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。

市场过程理论建立在独特时间观、知识观和人类行动公理基础上对市场的真实理解,以及将市场作为动态、演化和复杂过程的其他经济思想脉络,例如演化经济学、复杂适应系统范式甚至当代主流经济学各个流派中将市场作为一个过程进行分析的思想素材,有助于现实地把握市场经济运行的过程特征,为理解各种市场现象提供了合适的理论基础。不同于主流经济学框架内的时间观,更是这一过程分析路径独树一帜的重要标志。认识到主流经济学时间观及其对时间简单处理的缺陷,把握市场过程经济学对时间的理解,对于真实理解市场经济运行过程中的市场与非市场现象,具有重要理论价值和现实意义。

一、主流经济学对时间的简单处理:缺乏过程的静态分析

主流经济学在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。牛顿为代表的近代科学革命,奠定了绝对时空观。在牛顿的时空框架中,时间在任何空间位置都是绝对均匀流逝的,因而整个物质世界存在统一的时间,在一切参照空间都有共同的“同时性”,时间间隔在任何惯性参考系中都是绝对的,而且作为参数的牛顿时间具有反演对称性。20世纪初爱因斯坦提出的相对论时空,虽然革新了牛顿时空观,成为人类时空认识史上的又一次重要进展。然而,在相对论的“四维时空连续体”中,两个事件之间的时空间隔也是恒定的,在此意义上,仍然秉承了牛顿的可逆时间概念,相对论与牛顿力学,仍然属于同一范畴。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(Rizzo, 1994: 112)^②,仅仅是经济学家视野内的一个坐标轴(Shackle, 1972: 277~278)。新古典理论不加批评地采纳了这一时间思想,并且运用于经济学问题的时间分析中。

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问题。实际上,牛顿时间概念是将时间转换为静态时间,时间仅仅为描述运动的一个参量,不存在经济主体的学习过程。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)。根据牛顿时间概念,如果存在任何变化,那么这些变化必然由过程起点决定,时间没有实质意义。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态均衡状态。新古典经济学的一个重要特点,就是将变化压缩至瞬间完成。毫无疑问,这样有助于数学上的技术处理,却排除了类似错误交易的现实问题,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,试图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,但遗憾的是,Grandmont预期函数

仍然建立在严格的概率统计基础上,并未超越 Arrow-Debreu 框架。

自马歇尔以来对均衡理论加以发展的新古典经济学家,似乎都将经济活动理解为机械程序,而不是时间之箭的真实过程,经济系统总能自动反应,形式上能够反复,原则上可以逆转,将来不过是现在的延伸,能够准确预测结果。在普里高津看来,在牛顿力学中,时间作为一个描述运动的参数,是反演对称的,这意味着未来和过去没有实质区别^③。对时间的简化处理直接引发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。在一般均衡的动态变量中,不同系统或者不同方程式描述了代表不同经济状态的一组变量如何随着时间变化而变化,然而,这只是一个移动均衡条件,并未说明单个行为主体之间的相互作用及其与产出之间的关系。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,不少经济理论创新,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,但是却错误地以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仍然是相容的。令人遗憾的是,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。

二、市场过程视野中的真实时间:动态时间和主观时间

时间是经济理论中的一个关键概念,是所有经济难题的核心。问题导向的经济学之研究对象,必然是随着时间流逝发生的真实经济活动,绝对不能忽略时间。“经济学是时间中的,与自然科学不同。所有经济数据都是过时的”(Hicks, 1979: 38)。经济文献常常用历史、现在与预期等术语区分时间的不同方面。时间可以定义为思想与事件继起的顺序。新古典经济学非主观主义方法未能以满意方式处理时间问题,正统理论的核心充满了时间上的矛盾^④。新古典经济学无法解释大量现实经济问题,关键原因在于其静态和相对静态框架中抽象掉了时间因素。新古典世界经济系统的演化是机械的,在时间上是可逆的,原因与结果之间的联系是惟一和确定的,显然具有封闭系统的特征。

不同于新古典框架牛顿的空间化时间,市场过程理论强调的是真实时间,注重时间动态流逝过程中的主观经验,即真实或者主观的时间。这一意义上的时间,不是计划或回顾时使用的静态主观主义概念,而是新鲜经验的不断流淌与涌现。这一时间概念与人类感觉有关,个人在思考一项行动时,时间内生于意识过程,是特定思想的内在部分。真实时间具有方向,永远向前飞奔,决定了现实世界不断演化的特征。内生的时间具有主观性,因为对已经发生的

事情、正在发生什么事情以及将来会发生什么事情的感觉,对每个人而言不尽相同。在经济学中,个人处理所有问题时,区分过去、现在和将来都是重要的^⑤,这对理解经济决策的形成至关重要。动态时间、记忆时间、预期时间和历史时间,都与个人心理体验(经历)有关,都是主观时间^⑥,真实时间不可避免地具有主观维度。

真实时间具有三个相互联系的特点,即动态连续、异质性和因果效应(Capek, 1971: 90~91)。首先,真实时间的动态结构由两个方面构成,即记忆和预期(Shackle, 1958:16)。记忆和预期是解释真实时间动态连续的结构因素。牛顿机械的静态世界不存在记忆和预期,每一时刻都独立于前后时间,过去和将来并无多少意义。真正的时间,不可避免地过去的记忆和将来的预期联系在一起^⑦。其次,真实时间具有异质性。随着时间的流逝,人们不断受到新知识和新经验的影响,个人记忆不断发生变化,进而影响将来计划与选择。从主观角度看,个人感受到世界在发生变化。结果,真实时间的每一阶段都是新的,这就是时间之箭(Blum, 1951)的意义。时间异质性意味着时间是不可逆转的(“人不能两次踏进同一条河流”),而且所有经济活动存在内在不确定性,个人预测将来的能力必然有限。最后,因果效应。这一特点可直接由异质性推出。由于记忆的积累改变了观察世界的眼光,时间必然是强有力的和富有创造性的。时间流逝成为新事物的源泉,这意味着经济过程必然包括知识的传递和知识的增长。

非牛顿时间概念包含了两个重要结果,第一,真实时间是不可逆转的,不可能重新回到从前,真实时间由具有路径依赖的一系列事件连接而成。时间不可逆意味着演化过程中的事件是准唯一的,历史至关重要,社会经济系统是一个不可逆的历史演化过程。第二,时间流逝包括了创造性变化,时间过程会产生无法预测的变化,真正的变化必然出现意外。真实时间最为重要的意义,在于经济调整过程和真正的不确定性^⑧。由于真实时间的本质决定了过程的不确定性,将来无法从现在逻辑推导而来,因为将来还没有出现。这意味着只可能对结果进行总的、类型的预测(如制度种类或类型),而不能对具体结果进行精确预测(如制度类型的特定变量)。这一观点在 Hayek(1967)类型预测思想中也得以体现。增加的知识也许不能克服内在的、真正的不确定性,在一定程度上难以避免不确定性。由于行动发生在真正的时间里,设计的对付不确定性的任何活动也许仅仅变换了不确定性形式,不确定性的根源是内生于真实时间的世界,因此不可能真正完全得以消除。

O'Driscoll 和 Rizzo(1985)对比了牛顿时间和伯格森时间^⑨,强调门格尔框架中时间的主观和动态特征。边际主义者引入的时间,是一个连续的、同质的和逻辑的时间概念。在瓦尔拉斯摸索过程的终点,交换立即完成并且直接以均衡价格和均衡数量得以实现。瓦尔拉斯的摸索过程只需要一分钟,而门

格尔的摸索过程需要一个世纪。遵循门格尔逻辑,经济行动只能在真实时间中发生。“因果思想与时间思想密不可分,……无论不同阶段的生产时间过程多长,时间过程的完全消失是无法想象的”(Menger, 1871 [1951]: 67~68)。门格尔感兴趣的是经济主体决策过程以及经济现象的演化,而不是最终均衡状态,注意到经济活动的真实时间维度。引入时间维度之后,米塞斯(1936)认识到,任何均衡状态很快会过时。任何企图复制数据事先决定的均衡条件之努力,事实上都会产生无效率现象,因为数据总是不断变化的。

三、真实时间、内生的不确定性与学习

忽略时间和变化问题,是经济学中居于支配地位的机械均衡最为致命之问题,真实时间必然产生真正的不确定性。真正的内生不确定性之最重要特点,在于无法穷尽一种行动方式所产生的所有可能结果,而这正是新奇和真正意外的基础,这显然与新古典框架仅仅权衡已知的不确定性截然不同。静态时间里完全得以调整的经济学中,时间没有任何实质价值,不存在真正的不确定性(Shackle, 1955: 218)。在一定程度上,经济学就是个人如何处理随着时间流逝而出现的不确定性问题。不确定性内生的特点,在于正在进行的市场过程本身会发生变化。真实时间的引入,使不确定性表现为对有关事件的基本性质和可能出现的结果缺乏必要的知识与信息。

真正不确定性的最重要特征,在于其源自真实时间过程的内生性质。原则上,预见将来或者在真实时间里克服不确定性的活动不可能全部成功。时间依赖的不确定性与静态均衡完全不相容。如果将经济行动理解为发生在真实时间之中,分析经济现象就应该引入两个基本因素:不确定性与知识。只要允许时间流逝,知识就会增长,就会出现内生变化(O'Driscoll 和 Rizzo, 1985: 74)。因此,经济系统不可能实现均衡。时间依赖的不确定性必然导致个人无法完全预测将来。波普证明了个人不可能预测自己将来的知识(Popper, 1950; O'Hear, 1980: 141)。当然,如果将来完全不可预测,就不可能出现计划和行动。实际上,解决不确定性问题的思路,在于认识到将来事件的典型和独特特征。在事件发生的过程中,真正的不确定性既相对独立于时间,又相对依赖时间(O'Driscoll 和 Rizzo, 1985: 76)。典型化能够使我们抓住未知将来,是一个“在变动的事实中选取稳定和常规的事件”的过程(Bergson, 1946: 111)^①。事件的独特性是不可重复的方面,非重复性源于事件时间的“位置价值”(Schutz 和 Luckmann, 1973: 240),即事件变动过程中的顺序。

各种新古典模型的基本内容就是预测函数,用以详细描述以前观察到的现象与将来变量(价格是最为典型的变量)之间的函数关系。真实时间内生的不确定性,必然导致经济学中的预测毫无意义。现代预测和决策技术显然无法克服内生于真实时间过程中的不确定性问题。经济学不能假设从过去经验

中足以推测出未来图景。总是存在一些仅仅根据有关过去和现在的信息无法抓住将来的事件。即将来“已经存在而且仅仅是等着出现,果真如此,如果世界是确定的,那么提及选择就毫无价值。选择……是有发明潜能的,是新的影响之开端”(Shackle, 1972: 122~123)。

所有经济主体所处环境都是不确定的,几乎所有经济思想都已考虑这一现实问题。随着时间的推移,经济主体会调整或修改其决策,通过改正错误和从错误中学习,不断以更加合适的方式改变认识,以减少不确定性。新古典经济主体是通过对风险概率的估计和修改加以学习,哈耶克和柯兹纳的市场主体通过无知和迄今为止没有认识到的机会来学习,拉赫曼等极端主观主义者的经济主体则通过不确定性和想象来学习(Littlechild, 1986: 30)。新古典模型已经大大发展了搜寻概念,根据搜寻成本解释许多经济现象(如失业和价格传播)。奥地利学派尽管没有拒绝搜寻概念,但是充分意识到搜寻方法对付无知问题时的笨拙。搜寻能够揭示过去的信息,但是不能直接获取将来的信息。搜寻假设经济主体已经知道搜寻对象及搜寻方式,然而,在市场过程的世界里,这些事情并非显而易见。关键问题是发现什么值得搜寻,成本—效益分析在内含于真实时间的不确定市场过程中显得极其笨拙。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。这样,就隐含着一个自相矛盾的问题,即在能够开始寻找之前必须知道我们想要知道但仍然不知道的东西,必须知道事实上仍然不得而知的东西。这种方法未能从根本上认识到真正的知识问题,忽略了尚未知道的知识。由于无知,人们不可能搜寻其压根就不知道的事物,更谈不上权衡搜寻成本与收益。真正的不确定性意味着全然无知(sheer ignorance)、根本无知(radical ignorance)、必然无知(necessary ignorance)、不可避免的无知(inevitable ignorance)、不可知(the unknowable),即个人不知道他是无知的,存在个人无法想象的知识。这样的知识是没有边界的集合,而且永远都是不完全的。

真实时间的引入,意味着人类行动必然存在学习过程(Vaughn, 1998: 10)。人类不可避免的无知,需要通过学习过程加以克服。学习过程是一个不断获取知识的过程,是提高解决问题能力的手段之一(Dosi 和 Marengo, 1994)。人类能够自经验中学习,是善于归纳推理的学习者,而且不会从同样经验中学习到同样的东西。人类学习体现在整个市场过程之中,包括价格调整、资源利用、产品制造、技术进步、组织变化以及制度演化等过程。学习的过程就是社会化的过程,也是有机制度的形成过程。人并非天生聪明并富于理性,学习采取何种方式行动,是人类洞察力、理性和理解力的源泉(Hayek, 1988: 21)。学习是理解经济增长和经济发展的关键,而经济增长与经济发展是市场过程理论的核心内容之一,学习在市场过程理论中居于核心地位。通过试验和模仿,人类学习行动及其满足人类需要之间的因果关系之方式,包括

策略、行事方式、程序、范式、解决问题的方法等等。均衡可以理解为通过试验学习到的行动类型得以重复发生,直至发现更好的解决问题方式,是市场主体交互学习过程表现出来的倾向。企业可以看作是习得(learned)生产策略的整理者,资本货物可以理解为习得程序和操作的人工制品,生产策略与资本货物的积累就是经济增长与经济发展,学习是实现经济增长和经济发展的关键环节与方式。一定程度上,进步就是体现人类学习的市场制度成长和扩散过程的结果。

四、真实时间视野的知识与经济主体:无知与人类行动

时间、知识和人类行动是市场过程理论理解市场经济的核心要素。其中,迥异于新古典时间,市场过程经济学的时间是主观时间、动态时间,独特的时间观决定了无知的知识观以及对经济主体的特有理解。这样,对时间的深刻理解,实际上成为理解市场运行三个要素中的核心前提。

1. 真实时间与无知。真实时间是重要的,因为在计划和行动的过程中,个人不断获取新经验。这些新经验又以不确定方式产生新知识。在新知识基础上,个人又会改变其将来计划和行动。真实时间和全然无知导致知识不可避免地具有不完全性,并且始终处于变化过程中。真实时间的世界无法避免不可预测的变化,知识问题的存在源于将来与过去的不同。真实时间中发生的相互作用以及演化过程的非确定性,使人们不可能知道经济主体在随后继起的经济活动中出现的新信息。无知是缺乏知识的状态,不是某一过程可以逐渐消除的不完全知识之状态,是真实时间内生的必然,是无法回避和难以克服的问题。问题的关键是,人们在事实上处于无知状态时,通常却自认为无所不知,似乎能够知道他们根本不知道的东西。

经济活动是真实时间中发生的事实,因此,必须从动态角度研究经济主体的信息和知识问题。时间和知识是影响市场过程中人类行动相互联系的关键问题。时间流逝是变化的源泉,能够改变经济主体的知识状态,影响其预期和决策。所有真正的经济问题,并非纯粹的计算问题所致,而是源于时间流逝以及相应知识与数据的变化。“只要允许时间流逝,我们必须承认知识会变化,而且知识不能被理解为任何其它变量的函数”(Lachmann, 1976: 127~128)。不可能进行预测的原因在于经济变化与知识变化有关,将来知识无法在将来出现之前获取(Shackle, 1977: 90)。

由于将知识理解为一种商品,信息经济学要求经济主体必须事先能够获取有关知识的成本和收益,即他们必须知道仍然不知道的东西。市场行动主体的无知特征并非有意识和理性的成本—收益分析之结果,否则,从理论上就无法解释最初知识之来源。必须区分两种不同的知识或者无知,一个是经济主体大体上知道所需寻找的信息特性与内容,但是缺乏某些补充性知识,因此需要搜寻信息。另外就是对自己还不了解的事情一无所知,处于全然无知的

状态时,需要在不断展开的市场过程中得以发现。市场主体也许不知道其无知的范围与程度,因此理性搜寻过程可能劳而无功。由于认为通过花费成本能够解决无知问题,信息经济学在理解市场过程方面存在严重局限。

新古典经济学的不确定性,是指经济主体知道问题的结构,但是不知道一个或多个变量的准确值。通过将不确定性模型化处理,不确定的将来被描述为一定的概率分布、没有遗漏的一系列事件集合,决策者所面临的风险仅仅是奈特世界已知概率函数的情况。将来存在于预设之中,未来是已知的。Stigum(1969), Rothschild(1973)和 Frydman(1982)使用的新古典模型中,每个经济主体运用概率分布方式描述将来的价格特征,并且根据可以观察到的相关变量之客观价值不断更新。因此,事先就能够以概率形式知道将来的变化,明天可以被看作是随机变量的向量,其价值范围今天已经知道,更为重要的是已经知道变量本身(Littlechild, 1986: 28)。实际上,人们不可能搜寻尚不知道是否存在的事情,不可能对将来结果确定相应概率。市场过程理论认为,对将来的无知是事实,不能客观地计算将来状态的概率,甚至无法进行主观计算^①,将来的不同状态都是可能的,这样必然导致不同的不确定结果,决策者不可能知道所有结果。市场过程理论的经济主体知道一些事情,但不知道另外一些事情,问题并非不确定性或风险,而是全然无知,必须关注全然无知的开放性质。随着时间的流逝,经济主体会发现以前不知道的事情,市场过程会出现很多意外的现象。正如阿罗和 Langlois 等学者所认识到的那样,真正的无知是结构上的无知。无知最为基本的一面,是无法穷尽所有可能结果。这不仅仅是在给定集合下不知道可能发生什么事情的问题,而是这一集合自身没有边界。

时间和无知的最基本或者最一般的意义,在于经济学必须抛弃静态模型,正如 Loasby(1976:220)所言,“考虑时间和无知的理论必定是过程理论,而不是状态理论,甚至不是运动状态的理论”。生活在真实时间和无知的世界,意味着无法预测将来才能得到的知识,全然无知的事实提醒我们必须注意市场过程中发现知识的作用。对于市场过程理论而言,学习不仅仅是在缺乏变化的学习函数中赋与变量新值,而是包括了知识的结构变化,即学习函数自身发生了变化。具有真实时间维度及其派生真正不确定特征的市场过程,是这些结构变化的源泉和表现。承认无知的不可避免特征,是主张个人自由的基础。认识到人类知识的狭窄疆域,是正确进行经济分析和理解市场过程的关键,全然无知是理解市场过程的基石之一,企业家发现是市场过程中极其重要的推动力量。

2. 真实时间与人类行动。真实时间所孕育的前向无知,是人类有目的的行动前提。只有将来尚不知道,才有可能存在真实的选择,才有可能出现真正的人类行动。真正的人类选择和交互影响的人类行动,必然是将来导向的、不确定和无知世界里的有目的的行动。

市场过程理论认为演绎法优于归纳法的关键,在于公理假定的现实性。市场过程理论所依赖的基本公理,是有目的的人类行动,即每个人有意识地行动并实现所选择目标,而不是在一定外部激励下以给定方式作出反应的主体。米塞斯认为,人类的特质是有目的的行动,人类行动的目的在于改变所处环境,改善自身境况,人们的行动方式总是与其价值评判一致(Mises, 1949)。人类不会被动适应现有环境,可能会创造出其所适应的环境。市场过程既不会以完全确定方式呈现,也不会以完全随机和无法解释方式发生,人类具有发现对其有用之物的倾向。人们总是“倾向于注意那些可能对其有利的行动机会”(Kirzner, 1979: 29),总是在寻找目标,“人类行动不过是指警觉地发现那些尚未被认识到的机会并加以利用”(Kirzner, 1979: 109)。每个人有意识地行动并实现选择的目标(Prychitko, 1994: 77)^⑧。每个行动主体会选择特定目标,并且相信实现这一目标能改善其处境。柯兹纳对人类有目的的行动的理解,不局限于新古典框架中的给定手段一目的下的理性选择,具有十分丰富的内容(Kirzner, 2000: 62)。在他看来,人们对条件变化引起的前景变化十分敏感,总是对新的可能性保持警惕。有目的的人类行动中的行动者,总是能够认识到新的目标和实现目标的新方式,总是能够注意到迄今为止仍然不为人们所注意的机会。人类总是受到永无休止活动之激励,总是能够运用想象力探知未来。“人类行动学认为,每一个体都采取行动并且相信不管是是对是错,他都能够运用特定手段实现目标”(Rothbard, 1976: 20)。只有包含人类目的动因,才可能出现真正的人类选择。

人类行动的公理与因果关系、真实时间和不确定性密切相关。经济主体根据经济系统中的有关因素之间因果联系的知识实施行动,通过行动显示自己偏好。行动总是朝着改善个人福利的方向(至少行动主体主观上相信能够改善其处境)前进,行动发生在真实时间之中,时间就意味着变化,人类行动是变化的推动力。行动只有在能够使得人处于更好境界时才会被考虑,只有有目的的行动才能被考虑。所有个人的口味和对将来的认识存在差异,如此,每个行动都可能是独特的,会产生意外。由于行动发生在真实时间过程之中,将来不能知道或是不知道的,具有很大的不确定性。“行动总是针对变化而言的,因此总是处于时间秩序中。人类推理无法想象没有时间的存在和没有时间的行动”(Mises, 1949: 99)。行动是真正的选择,只能发生在与将来有关的不确定环境中,否则只能被反应所取代,每一行动都是针对不确定的将来。由于采取行动需要经过真实时间,不可能完全知道将来情况,这样,行动也许会产生对行为者而言意想不到的后果。人们将从愉快或不愉快的经历中吸取经验,出现的错误又会改变他们将来的行动。这就意味着理性和一致的既定手段一目的选择,不会成为人类行动学的研究领域。

市场过程理论拒绝静态的主观主义概念,认为经济主体在连续变化的环

境中进行决策,时间流逝是个人认识变化的原因,决策要考虑人类意识的创造性活动而且表现为一个不确定过程。经济主体必须要经过获取知识的过程修改其行动计划,知识取决于经济主体能够获取的、其愿望和经济物品之间因果联系的信息,经济主体生活在不确定的世界中,有可能会出现问题,决策是建立在经济主体对未知未来进行预期的基础上,这使得经济主体具有创造能力。Jaffé(1976:521)认为门格斯的行动主体绝对不是聪明的计算者,而是踉跄行进的、频繁出错的、拥有错误信息的人,饱受不确定的折磨,永远在希望诱惑和恐惧威胁之间徘徊,天生无法进行完全标准的决策。

从1940年以后,米塞斯才清楚定义了经济主体概念,经济主体是指企业家,不同于新古典框架里的经济人。米塞斯的人类行动概念,包含了每个人都是企业家的思想,有目的的行动主体都是企业家。永远都不可能存在一个确定框架出现在我们面前,人类必然生活在没有尽头的、开放的世界里。从这一意义来理解,每个人确实都是企业家,所有个人在一定程度上都有企业家能力和创业特征。米塞斯的企业家是认识到“已经做的和能够做的事情之间存在差异的那类人”(1949:336),他们精明、理解迅速而且富于远见(Mises,1949:328),对潜在利润机会具有天生的敏锐与警觉,是迄今为止尚未注意到的机会之潜在发现者(Kirzner,2000:48)。企业家“意味着随着市场数据变化而采取行动的人”(Mises,1949:255)。企业家受到利润机会的激励,是对利润机会高度和时刻保持敏感的行动主体。市场过程是连续的矫正过程,受到积极主动的企业家抓住利润机会之现实驱动。抓住市场机会成为企业家表达发现资源正确价值之方式。企业家发现产生的创新,不只局限于技术改进,还包括管理方法、公司文化、组织学习、制度演进等方面的改善。将来导向的人类行动,即市场企业具备直觉、梦想、想象力、远见、创造力、判断力和发现新事物等个性和品质(Kirzner,2000:60),在不确定的世界里,这些人类行动特征对于创造将来十分重要,正是理解市场过程的关键概念。

* 本文系第36批中国博士后科学基金项目(2004036040)及国家行政学院2004年招标课题的部分研究成果之一。

注释:

- ①到了20世纪50年代,米塞斯与哈耶克建立和发展了与主流经济学不同的方法,强调真实时间视野中企业家发现知识的重要意义,本文倾向于用市场过程理论表述这一思想脉络,以强调其关注市场过程的核心特征,参阅王廷惠(2003,2004,2005)。
- ②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),被比拟为空间。
- ③普利高津对物理规律很少谈及时间、进化和不可逆现象深感惊奇,从热力学第二定律入手,挖掘其中关于时间和不可逆过程的深刻含义,提出了耗散结构理论。
- ④早在1934年,卡尔多就注意到均衡理论“价格的形成必须先于交换过程而不是其结果”的问题(Kaldor,1934:127)。Bausor在总结一般均衡理论时,更为准确地评述了有关问

题,认为“现在的决策和现在的价格之间存在逻辑上的同时性”(1981:6)。

- ⑤“过去充满了已经观察到或造成的所有事情,将来会发生许多事情或等着去做,现在仍然无法观察;而现在包括了对我们思想和行动的经验”。“我们编制将来的计划是因为能够对其施加影响,过去已经无法改变”(Mellor, 1981: 13)。
- ⑥时间还可以被看作一连串日期或瞬间。在这一背景下,时序就变得重要。时间被认为是外生于个人感觉的心理转变(从无意识到有意识)。外生时间与不同个人认识到的时间顺序有关,相对特定的个人思想而言是外在的,例如昼夜更替。事件似乎是可以重复的,因而被看作是客观时间,对于不同观察者有着相同特征。在经济文献中,通常根据特定情形将客观时间定义逻辑时间、数学时间和机械时间等概念。时间本身和对时间的描述不同,正如不能混淆真正的老鼠和老鼠图片一样。
- ⑦在里佐(Rizzo, 1994: 112~117)看来,牛顿时间和伯格森时间的关键区别是记忆和预期。
- ⑧一般将不确定性描述为对已知概率的权衡安排,这实际上仅仅是静态意义的不确定性。不同于牛顿或者新古典的不确定性,真正的不确定性完全取决于时间。
- ⑨动态时间或伯格森时间包括了伴随着个人计划调整、修改过程中知识的增长。
- ⑩Bergson, H, 1946, “The Possible and the Real”, in *The Creative Mind*, trans. Mabel L Andison, Westport, Conn.: Greenwood Press. 参阅 O’Driscoll and Rizzo(1985: 76)。
- ⑪主观概率是建立在假设事件和结果重复发生的基础上,包括了所有可能状态与结果。
- ⑫在米塞斯看来,人类行动总是理性的,富有理性等同于有目的和有意识。

参考文献:

- [1]王廷惠. 一般均衡理论批评:时间、知识和企业家的角度[J]. 社会科学,2004,(11).
- [2]王廷惠. 一般均衡理论的有限扩展与边际修正[J]. 财经研究,2004,(10).
- [3]王廷惠. 争胜竞争的企业家发现过程——市场过程理论的市场观[J]. 南京社会科学, 2005,(1).
- [4]尹恒,龚六堂. 短期一般均衡理论的发展及其应用[J]. 经济学动态,2002,(6).
- [5]Arrow K J. *The limits of organization*[M]. New York: W. W. Norton,1974.
- [6]Bausor R. *Time and the structure of economic analysis*[R]. Unpublished paper, University of Massachusetts at Amherst,1981.
- [7]Bergson H. *Creative Evolution*[M]. New York: Henry Holt,1911.
- [8]Kirzner I M. *Perception, opportunity and profit*[M]. Chicago: University of Chicago Press,1979.
- [9]Kirzner I M. *The driving force of the market: Essays in austrian economics*[M]. London & New York: Routledge,2000.
- [10]Lachmann L. *On the central concept of austrian economics; Market process*[A]. Lachmann L, ed. *The foundations of modern austrian economics*[C]. Kansas City: Sheed & Ward,1976.
- [11]Littlechild S C. *Three types of market process*[A]. Langlois R N, ed. *Economics as a Process*[C]. Cambridge University Press, 1986:27~39.
- [12]Menger C. *Principles of economics*[M]. Glencoe: The Free Press 1871[1951].
- [13]Mises L. *Socialism: An economic and sociological analysis*[M]. London: Jonathan Cape,1936.
- [14]Mises L. *Human action: A treatise on economics*[M]. New Haven: Yale University Press, 1966

- [15]O'Driscoll G P, Rizzo M J. The economics of time and ignorance[M]. Oxford: Basil Blackwell,1985.
- [16]Popper K R. Indeterminism in quantum physics and in classical physics[J]. British Journal for the Philosophy of Science,1950,1(3): 173~195.
- [17]Prychitko D L. Praxeology[A]. Boettke P J, ed. The elgar companion to austrian economics[C]. Edward Elgar Publishing Limited, 1994, 77~86.
- [18]Rizzo M J. Time in economics[A]. Boettke P J, ed. The elgar companion to austrian economics[C]. Edward Elgar Publishing Limited, 1994,111~117.
- [19]Rothbard M N. Praxeology: The methodology of modern austrian economics[A]. Dolan E G, ed. The foundations of modern austrian economics[C]. Kansas: Sheed and Ward,1973.
- [20]Schutz A, Luckmann T. The structures of the life world[M]. Evanston: Northwestern University Press,1973.
- [21]Shackle G L S. Uncertainty in economics and other reflections[M]. Cambridge: Cambridge University Press,1973.
- [22]因篇幅所限,一些参考文献刊略,有需要详细文献者请与作者联系(wth2000@163.com).

Time within the Framework of Market Process Theory: A Contrast with the Mainstream Economics

WANG Ting-hui

(School of Economics and Management,
Beijing Normal University, Beijing 510070, China)

Abstract: Since the simplicity of dealing with time, the Neo—economics based on the general equilibrium theory fails to explain the dynamic process of market. Unlike the mainstream economics, after discerning the subjective and dynamic characteristics of genuine time, the market process theory emphasizes the significance of genuine uncertainty and learning process resulted from the real time. Time is the hardcore of comprehending actual market operation. Both the ineluctability of ignorance and characteristics of human actions are determined by the genuine time.

Key words: market process; time; uncertainty; ignorance

(责任编辑 喜雯)