

图书在版编目 (CIP) 数据

新政治经济学评论. 第3卷, 第2期 / 汪丁丁主编. —上海:
上海人民出版社, 2007

ISBN 978 - 7 - 208 - 07040 - 0

I. 新... II. 汪... III. 政治经济学 - 文集 IV. F0 - 53

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2007) 第 062660 号

出品人 施宏俊

责任编辑 王志毅

装帧设计 王小阳



新政治经济学评论

第三卷·第二期

汪丁丁 主编

出版 世纪出版集团 上海人民出版社
(200001 上海福建中路 193 号 www.ewen.cc)
出品 世纪出版集团 北京世纪文景文化传播有限公司
(100027 北京朝阳区幸福一村甲 55 号 4 层)
发行 世纪出版集团发行中心
印刷 北京中科印刷有限公司
开本 787 × 1092 毫米 1/16
印张 10.5
插页 2
字数 182 000
版次 2007 年 7 月第 1 版
印次 2007 年 7 月第 1 次印刷
ISBN 978 - 7 - 208 - 07040 - 0/F · 1591
定价 25.00 元

目 录

论文

自然资本与人类社会的可持续发展 马士国 · 1

产品构造、文化禀赋与分工组织——水平分工格局下贸易结构的形成机制初探 张捷 · 28

民主集中制下的主流观念与政策变迁的政治经济学 赵德余 · 45

长期购买力平价：来自南亚的证据 李志宏 · 76

产权安排、经营者特征与企业效率——关于中国制造业的实证研究 赵世勇 · 97

读书笔记

知识，秩序，悟性浅说——一份不断重写的读书笔记 汪丁丁 · 123

学术前沿

个人权利和社会评价：一个概念框架

Prasanta K. Pattanaik and Kotaro Suzumura 汪蓉译 · 141

附录 社会选择理论及福利经济学的新思路——铃村兴太郎访谈录 · 158

稿约 · 164

CONTENTS

Papers

Natural Capital and Sustainable Development Ma School · 1

*Product Architecture , Cultural Endowment ,
and Organization of Division of Labor* Zhang Jie · 28

*The Political Economics of Dominant-opinion and
the Policy Change Under the Democratic Centralism* Zhao De-yu · 45

Long Run Purchasing Power Parity : Evidence from South Asia Li Zhihong · 76

*Property Rights Arrangements , Manager Characteristics , and Firm Efficiency :
An Empirical Study on Chinese Manufacturing Industry* Zhao Shiyong · 97

Reading Notes

Knowledge , Order , and an Introduction to Human Understanding Wang Dingding · 123

Academic Perspective

Individual Rights and Social Evaluation : A Conceptual Framework
Prasanta K. Pattanaik Kotaro Suzumura translated by Wang Rong · 141

New Development of Social Choice Theory and Welfare Economics
—An Interview with Kotaro Suzumura · 158

自然资本与人类社会的可持续发展

马士国*

摘要：市场机制在私人物品的配置上是有效和公平的。然而，私人物品的生产和消费需耗用自然资本，这在无形中将市场机制延伸到了自然资本的分配中。由于自然资本的共用品特性，以及生产和消费的环境负外部性，使得市场机制不能有效和公平地配置自然资本。由于现行的经济、社会和政治制度产生于相对局部的、小规模的经济活动，且自然资本无限丰富的时期，这种制度与当今相对于全球性的、大规模的经济活动，自然资本已变得稀缺的现实不相适应，威胁到了人类的可持续发展。在此分析基础上，本文提出了抑制商业广告的影响、实施绿色税收机制和教育变革等政策建议，以实现兼顾生活质量的人类社会可持续发展目标。

关键词：自然资本；生活质量；可持续发展

一、引言

自然资本由自然资源、生命系统和生态环境所构成（Costanza and Daly, 1992）。自然资本具有两种功能：一是生态服务功能，即环境的吸收净化功能、生态系统的生命支持功能和环境舒适性功能等；二是资源供给功能，即它能提供林业、渔业和矿业产品等。保护生态服务功能对于人类的生存和健康至关重要，而保护环境的资源供给功能则对于人类的经济安全非常重要。高质量的自然资本直接增加了人类福利，因为人们可从恬静的环境和森林中享受愉悦，可在清洁的湖水和河水中畅游和垂钓；高质量的自然资本也间接地增加了人类福利，因为它是经济产品和服务可持续生产的一种重要投入。

因此，自然资本同人造资本等其他类型的资本一起，共同对人类的生活质量和可持续发展

* 马士国，复旦大学产业经济学系 2004 级博士生。通讯地址：上海市武川路 78 弄 123 号 701 信箱；邮编：200433。E-mail：041025012@fudan.edu.cn。复旦大学研究生创新基金资助协议（编号：EYH1019024）对本研究给予了支持。复旦大学中国经济研究中心的石磊教授、“石磊论坛”的其他成员，以及匿名审稿人对本文提出了修改建议。作者在此一并表示感谢，但文责自负。

发挥着作用。然而,这些资本之间的替代弹性有限。^①为了实现人类的可持续发展,这些资本必须以未扭曲的或相对均衡的速率增长。以人造资本快速增长、自然资源逐渐枯竭为标志的资本结构扭曲或不均衡的增长,增加了人类社会发展的波动性。如果人类社会的发展模式更加注重于提高环境质量和资源使用效率,那么它将有利于资本积累、经济增长和人类生活质量的提高(Munasinghe, 2000)。

长期以来,人们常常将快速的经济增长作为人类社会发展的首要指标。然而,仅以国民核算表计算的经济增长作为发展的尺度,已经难以令人满意(Aldeman, 1975; Sen, 1988),更加重要的应该是生活质量。经济增长和生活质量的改善一般是相辅相成的,但是,两者之间有时也会出现背离,即一国在长时期内生活质量得不到持续改善的情况下,经济却保持快速的增长。

环顾世界,不幸的是许多国家为了追求短期的经济增长,都过度采伐森林、过度捕鱼、过度采矿,并造成了环境污染。这些国家的政策制定者们认为,他们所采取的促进经济增长的方法将会增加国民的福利。在这些国家,由于森林退化、生物多样性的丧失,以及空气和水污染,许多自然资本被耗蚀了。

在这种情形下,尽管消费的比祖父辈们多,但我们并没有因此而享受到更高的生活质量。有关美国的个人福利研究发现,在1972—1994年,宣称对自己的婚姻、工作、经济状况及居住条件“非常满意”的人口比例日益下降,宣称自己“非常幸福”的人口比率正在下降(Lane, 2000, p. 465)。

就中国而言,自改革开放以来,国内生产总值(GDP)以年均近两位数的速率增长,人们的消费水平得到了显著的提高。但是人们对其生活质量的评价并没有同比例提高。中国社会调查所发布的2005年常规民意调查报告显示:有47.6%的被访者在“幸福感”综合指标中感到“非常满意”或者“满意”;公众对幸福感指标下的“健康状况”、“物质生活水平”、“精神生

^① 在文献中,对各种类型资本之间替代弹性的大小有以下两种观点:一是“弱可持续性”观点,这种观点认为任何一种资本的缺失或减少,都可被其他类型的资本所替代,资本类型之间具有高度的可替代性;二是“强可持续性”观点,它假定自然资本与其他类型资本之间存在着有限的可替代性,因此强可持续性要求把自然资本同其他类型的资本区分开来,并保持其存量。当前,弱可持续性和强可持续性的分界线并不明确。风险和不确定性是导致两者之间分歧的关键问题。目前人类对生态系统的了解还很不充分,无法预测人类活动对生态系统自身再生能力的影响,也无法预测未来会开发出何种技术以替代生态服务功能,那些在长时间和大的空间尺度上提供基本的生命支持功能的自然资本,如周围的气体、水文循环、紫外线防护等,一般没有合适的替代资本形式,尽管在小尺度上可能存在着一定的可替代性。因此,我们认为强可持续性是一个更符合谨慎性原则的合意概念。在强可持续性情形下,社会需要确定自然资本的临界水平,超过这个水平自然资本就不可能被替代,也就会有我们是否已接近了不可逆转的生态界限的担忧。

活水平”和“受教育程度”的满意度分别为48.5%、44.8%、39%和39%。^①中国社会调查所在其报告中认为，2005年中国政府做了大量营造和谐社会的工作，但由于各种原因，中国社会的和谐度仍然较低。

美国1972—1994年的个人福利研究，以及中国社会调查所的2005年常规民意调查报告表明：生活质量并不完全取决于消费。然而长期以来，占主导地位的价值观以消费来衡量生活质量。在这种价值观下，人们简单地认为增加消费就能改善生活质量。人们错误地认为，财富越集中资本供给就越多，国家福利的获益也就越多，通过更公平地分配财富来消除贫困将破坏激励机制，以致从长远来看实际上增加了贫困。事实上，在长期中公平和效率并不冲突，公平还是进一步实现效率的前提条件。而且，人们还错误地认为市场价格将会为当代人决定自然资源和生态服务的最佳使用，也会保证为后代人开发新的替代资源，人类社会的可持续发展目标完全可以通过市场力量拉动的技术进步来实现，自我调节的市场机制根本不需要政府的干预。然而，正是这些似是而非的认识引导着各国政府对自然资本的配置问题关注不足，未能采取适当的政策来缓解或消除与市场机制有关的自然资本配置不公平问题。针对现实中的认识和政策误区，本文将通过对生活质量、需求以及满足品这三个概念的分析，来阐述自然资本、生活质量与人类社会的可持续发展三者之间的关系，以及政府在自然资本配置中的作用。本文将说明，作为私人物品有效配置机制的市场，在配置自然资本时是无效的和不公平的，因而应适度引入政府的干预，缓解财富和消费分配不公平的现状，从而促进自然资本的公平配置。然后，我们将从这些概念分析出发，来讨论人类社会对生活质量的认知和政策上的误区，并在此基础上提出有利于实现人类社会可持续发展目标的政策建议。

二、生活质量、需求与自然资本三者之间的关系

（一）对生活质量的认知及其政策含义

要评价自然资本对生活质量的认知，就必须清楚生活质量是什么。至少从亚里士多德时代起，众多学科便将提高人类的生活质量作为一个基本目标，但其真正含义目前各界仍莫衷一是。例如，环境运动背后的真正动机是改善人类的生活质量，但环境运动的反对者也经常宣称工业发展具有同样的动机。对生活质量的认知不足造成了两者的分歧。

^① 参见《新京报》2006年1月1日；新华网：http://news.xinhuanet.com/fortune/2005-12/31/content_3993764.htm。

从 20 世纪 60 年代早期生活质量一词开始普遍应用以来，其定义得到了不断的发展。早期的研究者常常探讨客观的定义。然而，经验研究表明，生活质量的客观测量与主观评估的结果之间差异巨大（Mishan, 1967, p. 190）。因此，自 20 世纪 70 年代末期以来，越来越多的研究者认为，生活质量根本不是客观情形而是主观情形，与人们对自己的福利评估有关；人们通常是以一个理想标准或一组人群的状况作为参照，来主观地评估其生活质量的（Schuessler and Fisher, 1985；Frank, 1999, p. 326）。在日常生活中我们时常会发现，消费水平低的人群对其生活质量的评价，与消费水平高的人群相当、甚至更高，这大概是因为他们的欲望较低，或者他们是与那些消费水平相当的人群作比较得出的结论。在综合考虑各种影响因素后，Haas（1999）将生活质量定义为：“个人在其生活的文化氛围和拥有的价值观范畴内，对目前生活状况的多维评价。生活质量主要是对包括物质、心理、社会和精神方面在内的福利的一种主观评价。在某些情况下，客观指标可以作为生活质量的补充评价，或者在个人主观评价不易被察觉、意识到时，作为生活质量的一种不完美的替代评价。”

Haas 对生活质量的定义有四个值得关注的方面。第一，这个定义兼顾了生活质量的主观与客观特性。虽然生活质量可能主要是主观性的，但客观性方面也不能被忽略。而且因为客观方面的可衡量性，有时还会被作为生活质量的不完美代理（proxy）指标。第二，对生活质量主观特性的强调，给利用政策来影响人们对生活质量的理解决以启发。第三，在这个定义中，物质方面仅仅是生活质量的多维评价之一。第四，在这个定义中，生活质量兼有文化和价值观两方面的含义。许多经济学家认为，个人偏好是固定不变的和特定的。经济学家的目标只是确定如何才能最有效地满足人们的偏好，而社会决策者的目标是创造条件来实现它。然而，由于文化和价值观是不断变化的，因此，生活质量的特定决定因素也会随之而变。由于本文主要讨论的是自然资本、生活质量与可持续发展之间的相互关系，因此，Haas 的定义为我们提供了这样的可能性，即更公平地分配财富和资源不会影响那些已拥有最大份额的人们生活质量，一个社会能够通过有目的的改变人们的偏好来提高他们的生活质量。^① 如果我们关注当代和后代的生活质量，那么，以改变偏好的方式来维持和提高一个国家或一代人的生活质量，而不损害其他人

^① 有目的的改变人们的偏好，这与拥有独立自主的偏好是个人不可分割的自由的自由主义观念相违背。毫无疑问，这将受到那些担心侵犯个人自由的人的审视。然而，广告业确实每天都在不遗余力地改变着我们的偏好。需求和欲望能够被操纵而走向不同的结局，其中相当多的结局从理智上都不会被接受。但我们不应当让对结局的正当关心模糊这样一个事实，即我们的欲望和需求已经不断地被操纵。正如 Rawls（1971, p. 607）所指出的，“一个经济系统不仅是满足现有欲望和需求的一种制度工具，而且是创造和塑造未来欲望的途径。”当然，我们要确保，任何操纵欲望和需求的努力均应是透明的，允许公众讨论，并且置于适应性管理的原则之下。

的生活质量，似乎就是合理的。因为财富和资源是生活质量的惟一能被耗尽的组成部分。因此，任何人过度消费或挥霍都将危害到其他人的生活质量。

总之，生活质量是一个复杂的、多维的、而且基本上是主观性的概念，但是，可以通过某些客观因素来提高。维持或提高生活质量的政策目标是，寻求创造与更高的生活质量相联系的客观条件，或者试图改变人们对自身状况的主观评价来提高他们的生活质量。财富和资源作为生活质量的惟一能被耗尽的组成要素，某些国家或世代对财富和资源的过度消费，会影响其他国家或世代的生活质量。而且，财富和资源的耗尽会威胁到自然的生命支持功能，如果没有这种功能，人类生命本身将受到威胁。因此，财富和资源的更合理分配是维持和提高生活质量的关键因素。

（二）生活质量与人类需求

将 Max-Neef (1992) 的人类需求概念与上述生活质量的定义相结合，可以得到具有政策含义的、从决定因素角度考察的生活质量概念：生活质量由人们满足自身需求的能力所决定。

1. 什么是人类需求

理解上述从决定因素考察的生活质量概念，需要我们确切地说明需求的含义。首先，我们把绝对需求定义为生存所必需的东西，这由生物过程所决定。当前全球约 12 亿人生活在极端贫困之中 (World Bank, 2001)，这些人的绝对需求还没有得到满足。对于这部分人群，更多的消费可能与生活质量的提高密切相关。其次，一旦绝对需求得到满足，正如目前全球约 80% 的人口已经达到的情形，生活质量就由一整套基本人类需求的满足程度所决定。人类作为一种物种，其需求也在不断地发展变化。研究人员已经提出了各种人类需求，并认为这些需求成等级体系。^① 在这种等级体系中，各层次间的顺序并不是刚性的，在一个层次的需求未得到满足的情况下，仍存在追求其他需求的可能。即使是目前生活在绝对贫困中的 12 亿人口，也寻求满足生存以外的需求。例如，营养不良的儿童尚未满足他们的基本生理需求，但仍然寻求爱和保护。

与等级需求理论不同，Max-Neef 将人类需求归纳和组织为非等级的价值论和存在论的分类 (见表 1)。在这个非等级的分类框架中，人们同时拥有不同的需求，这些需求之间相互联系、相互作用，许多需求是暂时性的。在 Max-Neef 的概念中，物质需求既少且有限。这与各个国家和各种意识形态所具有的根深蒂固的观念——永不停止的经济增长是满足人类需求的最好途

^① 马斯洛的需求层次论是其中最著名的一个。

径——相对立。在 Max-Neef 的框架中，拥有东西（having）是非常重要的，但只是满足我们需求的要素之一。拥有资源的慈善的独裁者，可以向我们提供幸福所需的所有物质条件，但不能满足我们对存在（being）、行为（doing）和相互作用（interacting）的存在主义需求，也不能满足我们对创造、参与和自由等价值论的需求。

表1 人类需求矩阵

价值论类型	存在论类型			
	存在 ^①	拥有 ^②	行为 ^③	相互作用
生存	身体健康 脑力健康 平衡 幽默感 适应能力	食物 居所 工作	饮食 生育 休息 工作	居住环境 社会背景
保护	关怀 适应 自治 人身自由 平衡 团结	保险 储蓄 社会安全 健康系统 权利 家庭 工作	合作 保护 规划 照顾 医疗 帮助	居住空间 社会环境住处
友情	自我尊重 团结 尊重 忍耐 宽宏大量 接纳 热情 决断 肉欲 幽默感	友谊 家庭 合作伙伴 与自然的关系	表示爱情 关怀 共享 照顾 培养 感谢 表达感情	隐私 亲密 家庭 聚集空间
理解	批评意识 接纳 好奇心 惊奇 纪律直觉 推理	文学 教师 教育政策 方法 交流策略	调查 研究 实验 教育 分析 考虑	形成相互作用的环境 学校 研究院 团体 社区 家庭
参与	适应 接纳 团结 意愿 决断 奉献 尊重 热情 幽默感	权利 责任 义务 特权 工作	附属 合作 规划 共享 异议 遵从 相互影响 表达意见	参与相互影响的环境团体 协会 教堂 社区 邻居 家庭
赋闲	好奇心 接纳 想像力 鲁莽 幽默感 平静 肉欲	游戏 场景 俱乐部 参与 平和心情	白日梦 沉思 梦想 回忆往事 幻想 记忆 休息 取乐 游戏	隐私 亲密 紧闭空间 自由时间 周围环境景观
创造	热情 决断 直觉 想像力 勇敢 推理 自治 创造力 好奇	能力 技术方法 工作	工作 发明 建造 设计 解释	生产与反馈环境 文化小组 观众表达空间 时间自由
身份	归属感 判断力 一致性 区别 自我尊重 自信心	符号 语言 宗教 习惯 风俗 参照组 肉欲 价值 规范 历史 记忆 工作	承诺自己 融合自己 面对决定 逐渐了解自己 认识自我 实现自我 成长	社会规律 日常环境 个人 所处环境 成熟阶段
自由	自治 自我尊重 决断 热情 自信 坦率 勇敢 造反 忍耐	平等权利	异议 选择 区别 冒险 意识 承诺自己 不服从	时间可塑性 空间可塑性

① “存在”一栏记录个人或集体的属性。

② “拥有”一栏记录制度、规范、法律、机制和工具（不是物质意义上的工具）等。

③ “行为”一栏记录时间和空间（位置和环境）。

2. 满足品与欲望

我们将满足人类需求的途径称为“满足品”(satisfiers)。虽然需求本质在不同时期和不同文化间是一致的,但满足品却不同。满足品会因时间和文化的不同而变化,满足人类的一种需求所需要的满足品的差异,也许是决定一种文化的关键要素之一。一般而言,不同人群需要不同的满足品来满足其特定的需求,而且对于不同的人群,相同的满足品满足特定需求的效果也不同。某些满足品可以满足人类的多种需求,而某些需求则需要几种满足品。人类是居住在复杂环境中的社会动物。因此,人类不仅有针对个人的需求,还有针对社会团体和个人生活环境的需求。当需求之间相互作用、甚至相互补充时,对一组需求的满足品的充分获取,并不能补偿另一组需求的满足品的缺乏。另外,与新古典经济学的“理性经济人”假设相反,在Max-Neef的概念中,人们并不总是能够确定什么对生活质量有贡献,而且常常不能在不同的满足品之间作最佳选择来满足其需求。

事实上,许多表面上的满足品并不是真正的满足品。Max-Neef将“侵害品和破坏品”(violators and destructors)定义为“想要满足某种需求的想当然的满足品”,但实际上它们要实现其自身的满足都不可能。以军备竞赛为例,这种竞赛意在提供保护,但实际上却减少了人们的安全感,同时又剥夺了利用这些资源以满足其他需求的机会。然后,他将“假满足品”(pseudo-satisfiers)定义为“刺激满足某种特定需求的错觉因素”。对某人的情感需求而言,造访粗俗的娱乐场所也许就是一种假满足品。最后,“阻止性满足品”(inhibiting satisfiers)是“满足(或过分满足)一种需求,但同时阻止了满足其他需求的满足品”。例如,商业电视可以满足娱乐需求,但却抑制了人们的理解力、辨别力和创造力。这里将对“侵害品和破坏品”、“假满足品”、“阻止性满足品”的期望定义为“欲望”,欲望与需求形成鲜明的对照。

消费主义文化取向认为,“拥有和使用数量与种类日益增加的物品和服务,是一种最主要的文化倾向,也是最可感觉到的能带来个人幸福、社会地位和国家成功的途径。”(Ekins, 1991)据此观点,消费能满足人们对幸福、地位和成功等这些显然被认为是好的生活质量要素的需求。然而,虽然我们消费的比祖父辈多,但生活质量并没有随之成比例地提高。在这种情形下,消费就是假满足品,但它消耗了自然资本,否则这些资本可以被其他人或其他世代使用。对于假满足品,就是追求到了,也仍然满足不了需求。如果达到了破坏生态服务的极端,消费就变成了侵害品和破坏品。错误类型的满足品不能满足人们真正的需求,所以对它们的需求也是无限的。因此,在消费主义文化下,关注消费可能已经导致了家庭、社区和自然等的亲近减少,导致了人类需求的满足程度下降。

3. 需求和欲望对生活质量的影晌

上面对需求和欲望概念的考察有什么用途呢?确切地说,它提供了提高生活质量的三种途径,而且对发展促进生活质量的政策有所帮助。首先,它使我们明白可以通过获得更多必需的满足品,或通过更有效地利用满足品,来提高人们满足一组给定的需求的能力。那些不消耗物质资源的满足品,将不会侵害其他人提高他们生活质量的能力。但是,如果必需的满足品会消耗有限的物质资源,因而一个人的利用会减少其他人的可利用总量时,提高满足品的使用效率将是更为合意的。其次,是去改变社会的偏好。一种方法是有意识地改变社会对满足品的文化偏好,以形成这样一种共识,即较少的资源也能很好地满足需求。同样地,社会应作出努力以减少或消除个人的欲望。如上文所述,在这里,欲望被定义为对那些会以某种方式降低人们满足自身需求能力的满足品的需要。这是一个非常有前景的方法。与需求不同,欲望是无限的,而且许多欲望是关于财富和资源的。由于财富和资源是能被耗竭的,因而与分配、公平性和可持续发展最为密切相关。最后,社会应当避免会增加需求、但又不能同时提高满足需求能力的东西,因为它会降低生活质量。

与 Max-Neef 的论调相似,基于人类行为来评价生活质量的人文发展方法^①认为,“潜质”和“机能”对生活质量是非常关键的(Sugden, 1993)。粗略地说,“潜质”对应于人类的需求,而“机能”包括行为的机会和存在两个状态。在功利主义理论中,在几个不同的选项中人们选取其中的一项,即使事先将所作选择以外的其他选项去除,生活质量也不会因此而受影响。而在人文发展方法中,选择机会的减少会限制人们的潜质,并进而影响到生活质量。然而,尽管人文发展方法包括了经济收入之外的其他 3 个因素,但它仍然是基于“手段”的评估,并且不包括对环境退化的任何测量。

相比之下,Max-Neef 提出的人类需求矩阵,直接从“目标”的角度评估生活质量,它通过交互对话方式来进行人类需求评价(HNA)。该方法的主要思想是,人类对经济产品没有基本的需求,经济产品只是满足人类基本需求这个目标的途径之一。人类需求评价背后的基础思想意识,提供了对国内生产总值背后思想意识的重要替代,深化了人们对什么才能提高生活质量的认知。实施基于人类需求评价的生活质量评估,及其所需要的广泛对话,将把人们暴露在其背后理论的面前。暴露于一个理论面前是走向接受它的第一步。一旦人们接受了这个理论,将

^① 联合国人文发展指数(HDI)是评估人类福利的初步尝试,它由在国家尺度上一般可以获得数据的 4 个基本需求变量组成,这 4 个变量是:(1)出生时的预期寿命;(2)成人识字率;(3)平均受教育年限;(4)人均国内生产总值(转换为人均购买力平价)。

关键的资源留给后代，将不会被当代人认为是过度的牺牲。这个观念是实现人类社会可持续发展的关键一步。

（三）生活质量与自然资本

财富和资源的最终来源，以及资源利用所产生的废弃物的最终接受者，都是自然环境。所以，我们必须深入研究生活质量与自然资本的相互关系。根据自然资本具有的生态服务和资源供给这两种功能，可将自然资本的特性归纳为以下四类：第一，生产必须的人造资本所需要的自然资本是不可或缺的；第二，维持自身再生产需要一定的自然资本数量；第三，一些自然资本是其他类型的资本所无法替代的；第四，一些自然资本是不可再生的。尽管特定形式的自然资本可能不具备所有这些特性，但很显然，生活质量与自然资本之间的相互关系非常密切。

自然资本不仅为人类的生存提供基本的资源，而且促进废弃物循环、调节气候、提供清洁的空气和水。如果没有自然资本，社会就没有资源来生产商品，社会也将毁灭在自身排放的废弃物中。退化或削弱的自然资本将减少贡献给人类的服务，从而降低长期的生活质量。^① 维持环境容量意味着后代可以同样地利用，这有利于代际公平，同时也增大了实现可持续发展的机会。此外，人类对自然环境具有天生的情感，它对人们的心理安宁和人与人之间的和谐相处同样重要。研究表明，当人们置身于自然景色而非城市景色时，人们则经历较低与压力有关的疾病、较低的血压、较快的术后恢复、较高的幸福程度和较低的恐惧感（Ulrich et al. , 1991）。沉浸在自然中使人们感觉“完整”和舒适。自然环境也可以满足精神、文化和审美的需要，并且具有与其物质消费无关的价值。事实上，在历史和现实中，自然资本在人类生活质量中起着根本作用。在人类演化到能够思考、建立社会、成为工具的使用者以前，人类的绝大多数需求都是由自然资本直接满足的，甚至今天，自然资本对人类需求的持续满足也作出了实质性的贡献。Max-Neef 所列举的所有人类需求，都以这样或那样的方式依赖于自然资本。考虑到高估自然资本供给的弹性，或低估人类对自然资本的依赖将产生的不可接受的风险，可以断言，健康的生态环境^②对人类的生活

^① 例如，超过环境吸收净化能力的工业排放物，可能在食物链中累积，从而对人类的健康产生毒副作用；大气污染和酸雨会使农作物减产，等等。

^② 评价生态环境健康的指标和测量方法，必须至少包括生态环境的以下 3 个方面：（1）活力，这是对系统的活动性、新陈代谢能力或者生产力的测量；（2）组织，指的是系统组成部分之间相互作用的程度和多样性；（3）弹性，指的是在存在压力的情况下，系统维持自身结构和行为格局的能力。参见 Robert Costanza, 1992, "Toward an Operational Definition of Ecosystem Health", in Robert Costanza et al., eds., *Ecosystem Health: New Goals for Environmental Management*. Washington DC: Island Press, pp. 239 - 256.

质量是至关重要的。

经济生产虽然只能为人类的某些需求提供满足品，但对经济生产的深入洞察，更能使我们明了满足人类的需求到底需要什么。经济生产不仅需要人造资本，它也需要自然资本、人力资本和社会资本的投入。这四种资本在满足人类需求和提高生活质量方面发挥着重要作用。而且，所有的人造资本生产都需要其他类型资本的投入，而这些类型的资本最终都来源于自然资本。从历史角度来看，人造资本是最新产生的东西；人类灵魂的基本需求无疑在第一件工具被发明以前就已经基本建立。虽然人造资本对满足人类的许多需求作出了贡献，但相对于其他类型的资本而言，它对自然资本具有最大的负面影响，而且人造资本也正日益变得丰富。因此，长期以来，增加人造资本被认为是实现高生活质量的关键。在以前也许的确如此，但现在增加人造资本所起的作用已经相对较小。然而，人造资本在资源耗竭中仍然起着主要作用，而且人造资本的所有权强烈地影响着现今经济体系中的分配制度。

三、对市场配置自然资本的公平性考察

对分配的任何关注都暗含假定存在一些规范性的目标。在财富与资源分配中，规范性的目标很明确，那就是当代人之间以及代际之间的公平。这里介绍两种实现公平的途径。第一种是市场机制的程序性途径，第二种是从正义理论衍生的基于结果的途径。^①虽然传统上认为市场机制不能形成“公平”，但它是全球财富与资源分配的主导机制。因此，需要考察它对公平的作用和影响。

（一）空间与时间上个人之间的公平

自由市场经济学家声称，经济学是一门不包含规范性判断的真正科学。然而，如果要给公平下定义的话，他们会将公平定义为自由市场经济下自由选择的结果。他们认为，市场是公平的，因为它（理论上）提供了应得的公平。所有的工资都是公平的，因为如果有人认为不公平的话，他有自由不为这些工资而工作。所有的价格都是公平的，因为没有人被强迫去买任何东西。对于一些人凭借更聪明或更有天分，而在自由市场中更游刃有余所导致的“不公平”，自由市场经济学家认为，这种遗传性天资的差异是一个简单的自然事实，在人类社会

^① 笔者认为，机会公平与结果公平并不矛盾。结果公平有别于结果均等。结果均等是不利于社会发展的。我国改革开放前的情形说明了这一点。笔者同样持有适当的收入差距有利于社会发展的观点。

没有理由像在自然中一样区别对待。另外，由于自由市场对生产和创新提供了激励，因而导致了消费和发明的持续增加。其结果是，新发明和不断下降的价格，使那些遗传天资较差的人的境况，比他们处在另一个不同的系统之下要好。我们把这一公平理论称为“公平赏罚理论”（theory of just deserts）。

但是，检验市场是否公平，也应该看由这个机制所决定的财富和资源的分配是否具有公平性。占全球人口仅为25%的工业化国家却消耗着全球40%—86%的各种资源（Durning, 1992, p. 200）。美国的人口仅为全球人口的4%，消耗着25%的全球资源，产出的废弃物占全球废弃物的比例也与此相当。在一国内部和国家之间，财富的集中程度正变得越来越明显（Gates, 1999）。即使我们相信市场机制在程序上是公平的，但要证明它所产生的结果也是公平的，现在却变得越来越困难了。经济学在很大程度上是一门说明性的而不是描述性的科学。当经验事实与经济理论相矛盾时，经济学家的标准反应不是去改变他们的理论，而是提出能使现实更符合其理论的政策建议。

导致市场失灵的外部性、共用品^①和市场的不完备等，确实使得市场不公平，当用市场机制来配置自然资本的时候，就更是如此了。我们将运用“正义论”（theory of justice）的观点来审视市场的公平性。许多正义理论学家认为，公平性是公正的基本条件。从某种意义上讲，两者在本质上是难以区别的。如Barry（1989, p. 428）所述，“任何正义理论的中心问题，都可归结为人们对不平等关系的防御。柏拉图在其《理想国》（the Republic）中阐述的正义理论是‘公正起因于互利’，简洁地说，公正是对理性的利己主义者获取他人的合作，而同意支付的最低价格的限定条件的名称。”让造成不公正且不接受此结果的人，自愿签订一个防止他这样做的协定是不可能的，从这点上说，不会有代际公正，因为我们可以对后代造成任何的不公正而不用担心报复。如果承认我们对后代有伦理责任，那么我们就必须相信另一种正义理论。也许，最为广泛接受的替代理论是通常被称作“不偏不倚的公正”或“公平的公正”理论。根据这个理论，给予后代他们没有要求的东​​西是公正的。

许多人认为，自由市场经济确实是一个能通过提供适当的激励因素，而使那些境况最差的人群获得最高生活质量的体制。经济学家已经清楚地阐明，统计数据揭示了一种“不可避免的关系”，即“财富越集中在少数人手里，资本供给就越多，因此国家福利的获益也就越多”（Snyder, 1936, p. 224）。通常被称为“积极投资理论”的供给经济学的基本假设与此相同。如

^① 在文献中，“public goods”是指具有非排他性和非竞争性的物品，主要是从使用权角度界定的，而不是从所有权角度界定的，我们认为将其翻译为“共用品”比“公共物品”更符合其原意。

果市场体系是公正的，那就意味着剩余的贫困要么是市场不完善的结果，要么是因为社会没有足够的资源以结束贫困。认为西方国家缺乏资源以消除贫困，这似乎是荒谬的。有些人坚信，通过更公平地分配财富来消除贫困，将不可避免地破坏激励机制，以致从长远来看实际上增加了贫困。^① 但是市场不可能产生比它初始时更为公平的条件，即只有当最初的财富和资源分配是公平的，市场才能公平地分配商品。而且，即使在理论上市场能公平地分配商品，但如果将市场用于分配自然资本的话，情况显然就不是这样。市场不能有效地提供既不具有排他性也不具有竞争性的任何物品。^② 对于具有竞争性而不具有排他性的物品，如海洋渔业，是会遭受“公地灾难”的“自由获取”（open access）资源，受市场力量的驱使将被过度开发利用。对于如生物多样性中储存的信息这类非竞争性物品，通过适当的机构管理能够成为排他性的，可以由市场来提供，但导致的价格将不是有效的。对既不具有排他性也不具有竞争性的生态服务，诸如臭氧层防护和全球气候调节等，将只能由非市场机构有效地提供（或保护）。许多类型的自然资本是非排他性和非竞争性的复杂混合物。

市场物品产生于自然资本的结构要素，结构的损耗将降低功能，总的来说，市场物品的生产必定减少自然资本提供共用品的能力。在市场物品的生产中存在着固有的不公平性。“应得的赏罚”应当要求消费更多市场物品的人补偿那些遭受损失的人。市场物品的过度生产和消费将破坏自然资本的资源供给和生态服务功能。这种情况的结果将是极端不公平的，特别是对后代不公平。

如果资源使用和废弃物排放超过了环境的承载能力，自然资本就会减少，污染就会加剧。那些将环境成本外部化于公共领域而获益的人，实际上是毫无补偿地占用自由获取的自然资源和生态服务的公共产权——从任何标准来看这都是不公平的。几乎没有人讨论外部性的制造者通过引起外部性而获得了潜在的补贴这一事实。经济学理论和模型没有认识到自然资本在财富创造方面的价值。外部性导致了对自然资本使用者的隐性补贴，从而进一步增加了不公平。对自然资本不加管理的市场分配是不公平的，因而需要非市场机构来保证当代和后代都能适当地使用自然资本。^③

① 比如，Rand 等人（1996，p. 1088）认为更公平地分配财富将会给所有人带来痛苦。

② 如果人们不是新古典经济学所描述的自利的理性最大化者，市场机制将能提供共用品并减少外部性。然而，如果接受这个假定而认为市场失灵不是一个问题，那么，我们也破坏了市场分配的最优性所基于的假说。

③ 科斯（Coase，1960）的观点是，当不存在交易费用和策略行为时，与外部性相关的扭曲能够通过利益相关方之间的自愿谈判来矫正。在这种情况下，无需政府的介入便可获得有效的结果。然而，我们的理解是，科斯的自愿谈判解决方案对于大多数主要的污染问题是无效的。因为对于大多数水和空气之类的环境污染，会涉及大量的污染者和受害者，协商解决方式的交易费用极大，使得科斯的解决方案不可行。

经济学家几乎都坚定地认为，自由市场经济从时间和空间上来看都是最公平的体制。自 20 世纪中叶以来，技术的持续进步和生活标准的不断提高，导致代际经济分析的焦点集中在最佳储蓄率问题上。按照目前的消费成本，这一代人应该为下一代人积累多少资本？Phelps（1961，1965）的“资本积累黄金法则”是这类分析中最有影响的结果之一。其基本含义就是当代人应该为下一代人作出牺牲，直至达到最大可持续人均消费水平。由于当代人因受益于过去世代人的贡献而生活得更好，那么，理所当然，当代人也应该为后代生活得更好而作出牺牲。

由于人口数量和人均资源消费在不断增长，很显然，在可预见的未来，人类很有可能耗尽某些自然资源。经济学上代际之间的分配论争，已转变为不可再生资源的利用和可再生资源的不可持续利用的问题。Hotelling（1931）在这方面作出了可能是最早的重要贡献，他认为一种不可再生资源应当以如下的速率被耗尽，即其价格应以与资本租金率同样的速率不断上涨。^①关于可再生资源，经济学家认为，当在某些情况下资源可能被用尽时，维持最大可持续产出的利用速率在经济上不可能是最佳的（Clark，1990，p. 386）。这些结论已通过使某些资源的净现值最大化而被证实。净现值最大化隐含着表明这些资源的全部权利属于当代而不属于后代。实际上，这个假设对经济分析是必需的。^②然而，经济学家若认为后代确实对自然资源拥有权利，那么，就不能再用市场机制来分配自然资源。因为很清楚，让还没有出生的后代人参与市场体系的自然资源分配是不可能的。那种认为后代人对财富和资源没有权利的观点，几乎不会符合任何人对公平的定义。

Solow（1974）研究了资源枯竭对代际公平的含义，形成的共识是：即将来临的资源枯竭将导致更高的价格，进而激发开发新的替代资源或使用现存的后备资源的动机，自我调节的市场机制根本不需要政府的干预；因此，在自由市场经济中，对所有的现实目标而言，资源从时间上讲是无限的，我们确实不必关心后代所得资源是否公平。

我们经常听到这种观点，即只要我们关心自己的后代，自由市场将会为后代提供适当数量的资源。如果确定最佳的储蓄率是惟一的问题，这种认识也许是正确的。但是它忽视了长期的环境问题的潜在危害，例如全球变暖、核废料等。我们今天的行动足以影响未来许多代人。几

① 尽管理论上如此，但目前没有任何经验证据与 Hotelling 的这一观点相符。

② “根据 Koopmans，效用贴现率是确定的，在数学上也是必然的。否则，将不能为从现在至遥远的未来的结果定义偏好，贴现率或许是决定成本—收益分析和管理选择的最具影响力的参数，然而它的正确选择却极其困难。”参见 Kenneth Arrow, Partha Dasgupta, et al., 2000, “Managing Ecosystem Resources”, *Environmental Science Technology*, vol. 34, No. 8, pp. 1401 - 1406。因而，经济学家开始认识到贴现是由方法（数学）驱动的而不是由代际公平的伦理问题驱动的。

乎可以确定的是，现实世界中有些资源正在以这样的速率被耗尽，即后代不但丝毫得不到资源本身的益处，相反还要承受资源利用产生的负面影响。化石燃料的使用导致全球变暖就是一个很好的例证。许多可再生资源的存量也因不可逆转地枯竭而受到威胁。对后代的任何公平观念，都要求我们必须保持自然资本和使自然资本的生命支持功能不受损害。

自由市场经济学家常常忽略的一个问题是，人造资本积累能够补偿后代损失的可替代和不可替代的自然资本吗？问题的答案取决于给后代造成的环境破坏的未知成本、人造资本积累的未知收益、人造资本（特别是未来的发明）替代自然资本的未知能力，以及在什么阈值以下自然资本会失去自身再生能力。因此，不确定性是必须考虑的一个决定性因素。

在伦理分析中，对不确定性的处理是很困难的。既然如此，那么，从人造资本作为自然资本一种替代品的赌注中所获得的收益大于、等于可能的损失吗？概括和总结人造资本与自然资本之间的差别有助于我们回答这个问题。第一，或许最重要的区别是，自然资本会被不可逆转地损毁和破坏，但是我们一般不知道自然资本的哪些功能何时会发生不可逆转的变化，就生态服务而言，我们也基本不了解其不可逆转的变化的全部含义。第二，人造资本必须依赖于自然资本——这二者是基本的互补物，而且人造资本不可能完全替代自然资本。迄今还没有证据证明人造资本可以替代自然资本的生命支持功能，而且还不能肯定哪种生态服务对形成生命支持功能是最关键的。第三，资本商品会贬值，如果将它们留给后代作为对一种枯竭的可再生资源的补偿，那么，维持它们所需的资源流也必须保留。第四，人造资本正趋于逐渐过时。^① 第五，技术并非总是有益的，甚至有益的技术也常常具有严重的负面作用，只是大部分的负面作用不会立即显露出来而已。第六，我们留给后代的最重要的人造资本可能是累积的知识，它可导致新的技术。然而，在一项新技术被发明之前，不能确切地说它将会是什么。因此，我们不能确切地说未来的技术能否补偿自然资本的枯竭。赢得这种资本替代赌注的益处，大概就是现在和将来更高的消费水平，而从中获益的绝大多数人是人类社会处于最高消费阶层的人们。潜在的损失就是破坏了不可再生的，以及支持生命的可再生自然资本，这种损失将对人们的生活质量，甚至人类生存具有潜在的灾难性后果。

我们生活在一个不断发展的世界里，每天都看见比以前任何时候更多的全球人口与更多的可再生和不可再生资源的耗用，人口增长的速度远远超过了马尔萨斯时代。基于过去的经验预测这种前所未有的变化是非常困难的。如果盲目相信自由市场体制中的技术，认为它具有克服

^① 有关化石燃料燃烧的许多技术，甚至在化石燃料枯竭之前就会被废弃。依赖于可枯竭资源的任何技术最终都会被废弃。

自然资本制约的能力，并且可以补偿已经枯竭的自然资源，那将严重危害当代和后代的生活质量。^①

对于不确定性，公平性要求我们采取强可持续性，直到被证实有替代资源为止。当替代资源被证实后，我们可以耗尽某些自然资源，但不是在被证实之前。只要当代人的生存受到威胁，他们就会无节制地使用资源来满足其需求，即使这样会危及后代的生存。那些生活在生存线以下的人群会争辩他们没有对后代负责的义务。最后这一点表明，代内公平的某些方面是代际公平的先决条件。自然资本中的自由获取资源服从先到先得的处理方式，没有适当的管理机构，那些到得太晚的人就什么也得不到了。几乎没有人不同意这种结果是既不公平也无效率的。

（二）空间和时间上国家之间的公平

理论上，在经济理论或正义理论中，公平性的定义不受地理的影响。然而，市场经济正处于以空前速率扩张的时期，它不仅对经济体制产生了前所未有的影响，对人类的其他体制也是如此。然而，只有当实际的市场机制与理论体系描述的一致时，市场的公平性才会存在。令人遗憾的是，目前的全球市场体系远不如一些发达国家的市场体系“完善”。经验数据表明，在市场自由化进程较快的国家，工资差距不断拉大，非技术工人的实际工资显著下降（Wallach and Sforza, 1999, p. 229）。1994—1998年，在拉美的那些追求市场自由化的国家里，生活在贫困线以下的人数猛增，在同一时期，全球生活绝对贫困的人口数量增加了20%（Faiola, 1999）。根据上述生活质量的有关标准，随着全球市场一体化程度的提高，生活状况最差的一部分人口的生活质量下降了。

此外，过度发达国家^②有责任为数百年来积累的环境破坏向欠发达国家进行补偿。过度发达国家对绝大多数自然资本的使用和废弃物的产出负有责任。即使许多资源的开发发生在欠发达国家，但正是过度发达国家的消费者最终应对此负责。过度发达国家的公众对污染的大声疾呼已经迫使许多工厂关闭，搬迁到环境法律不健全和管制松懈的欠发达国家中去。对自然资本

^① 核电站就是一个很好的例子。当核反应堆最初被建立起来时，人们还不了解其放射性的全部危险。20世纪50年代时认为，当核废料成为一个问题时，技术可以找出安全分解核废料的办法。铀的半衰期是24300年，与1950年相比，我们现今在解决核废料的处置问题上没有任何进步。此外，大量的历史证据表明，以前的一些文明已经毁于资源的过度开发。如果相信市场机制可以避免这种命运的话，我们就必须承认，盈利的动机比生存的动机要强有力得多。然而，对于大多数人来说，生存比金钱的占有要重要得多。任一种假设都是基于信念和诱导式的推论，而不是科学。

^② 我们将“过度发达国家”定义为，从消费和经济增长中获得的生活质量提高的净边际收益小于或等于零的国家，或者反过来说，这种消费强加于其他国家或后代的边际外部成本大于净边际收益的国家。

的过度消费不仅预示着留给后代的更少，而且对当代也是如此。到目前为止，几乎没有就过度发达国家环境破坏补偿问题进行过认真的对话，而且过度发达国家仍然主张将减少温室气体排放和替代耗减臭氧物质的技术卖给而不是转赠给欠发达国家。没有理由认为，在没有补偿的情况下，穷国应该接受过度发达国家给予他们的“应得的赏罚”。

四、公平性与生活质量之间的关系及其含义

（一）公平性与生活质量之间的关系

当私人实体占用了公共财产时，除了直接和间接地通过一系列反馈降低普通公众的生活质量外，还有下面这样一个次要的影响。根据上述生活质量的定义，个人状况与参照人群或理想状态之间的差距越大，他主观评价的生活质量也就越低。因此，如果一组人对财富和资源的不公平占用使他们比其他人更富有，那么，这笔交易中受损失的人们生活质量就会受到双重的负面影响。

这种可能性对政府的政策有着重要的影响。目前，世界上绝大多数国家的政府都在通过持续的经济增长提高民众的生活质量。如果它使人们的生活从贫穷上升到生存线以上，这种方法很明显地提高了生活质量，但对于那些基本需求已经得到满足的人口来说，这可能不是一个有效的政策。如果经济增长伴随着贫富差距的进一步拉大，我们就更不能简单地寄希望于通过增长来追求更高的生活质量。现在世界上相当数量地区的情况正是如此，经济增长实际上使一些穷人的经济状况更差了，即使他们的绝对收入有所增加。

而且毫无疑问，物质财富和资源的不公平分配，将导致政治权力分配的不平等，这可以用来积累更多的财富。当政治权力为既得利益而集中时，更严重的外部性和更高的补贴会通过政治行为而产生，从而导致更严重的污染和其他的不公平。由于这些联系，很明显在补贴、政治权力和贫穷之间存在着恶性反馈循环。而且这种循环很难改变。如果可以确信民主制度最有可能为满足其公民的需求提供条件，那么与不公平分配相关的这种对民主的侵蚀将进一步降低生活质量。经验研究（Walster, 1976）表明，人们对不公平性有强烈的负面反应，这直接影响了他们对生活质量的评价。而且，这些负面反应还会使频繁感受不公平的人们改变其价值观。

（二）公平性与生活质量之间关系的含义

那些经历了不公平对待的人们享有的生活质量，比经历公平对待的人们享有的要低。一般的理解是，降低不公平性也必定会降低受益于它的那些人的生活质量。富裕的和有权势的人们

担心财富和资源的更公平分配将不可避免地降低他们的生活质量。因为他们最有能力改变当前的分配制度，他们的这种恐惧是一国内部、国际和代际更公平分配的一个主要障碍。然而，从长期来看，财富和资源的更公平分配实际上不仅可以改进穷人的生活质量，也可以改进富人的生活质量。

1. 地位与财富

在某个水平以上，消费和财富就是“地位性的”，即我们通过将自己的地位与他人的地位相比较来评价生活质量。这使我们忙于永无止境的财富和消费竞赛，这种竞赛只是为了维持相对地位。由于现在的经济增长模式导致财富集中在少数人的手中，因此，绝大多数人在这种竞赛中日益落后。很明显，富人们只是在他们之间相比而不会与穷人相比，因此富人们也不会认为自己正在享受更高的生活质量。然而，盲目追求地位、财富和消费对我们的时间和资源提出了很大要求，几乎使我们没有能力去满足我们的其他需求。而且，由于所有的市场消费品必须用自然资本来生产，所以不可避免地降低了自然资本提供共用品的能力。因此，在这场地位竞赛中我们消费得越多，被消耗的自然资本就越多，我们能享受的生态服务就越少。最终，我们要冒支持生命的自然资本被破坏的危险，这威胁到人类的生存基础。基本的生存当然不是地位性的好处，而支持生命的自然资本的丧失将对全球的生活质量产生不可接受的负面影响。自然资源的过度消费是一种假满足品。而且，如果走向极端就会变成侵害品和破坏品。

既然某个水平以上的消费和财富拥有只是地位性的，那么，如果我们能设法将该水平以上的所有消费降低一定数量，譬如 50%，人们的生活质量可能只遭受到微小的直接变化。^① 然而，较低的消费水平可以使我们较少地劳累，使我们可以留出更多的时间去追求其他的人类需求。生态服务将会更加丰富，从而有助于人类所有需求的实现。我们将保持远离生态阈值，消除担忧自然资本退化的压力，并且更好地满足我们的保护需求。由于生态服务是共用品，这将对当代和后代都更为公平。

2. 贫富差距对生活质量的损害

生活质量概念最初是为了阐明在从未经历过的大规模经济生产中，日益增加的诸如犯罪率等问题而引入的。根据人类需求评价，犯罪（尤其是暴力犯罪）降低了社会满足安全需求的能力，因而降低了生活质量。很明显，绝对贫困提供了犯罪的刺激因素。然而，研究发现，即使在绝对贫困得以解决的情况下，贫富差距和暴力犯罪之间也有着较高的相关性（Walster, 1998；Hsieh and Pugh, 1993）。生活质量在医学领域也是一个重要的概念，健康不佳与贫富差距之间

^① 黄有光（Yew-Kwang Ng）教授在复旦大学主办的“2006 汇丰论坛”上也表示了这种观点。

有明显的相关性，健康不佳也会降低生活质量。此外，在发达国家中，并不是最富裕的社会拥有最好的健康状况，相反，那些贫富差距最小的社会才拥有最好的健康状况（Wilkinson, 1996, p. 255）。不公平和相对贫困都转化为较高的死亡率。贫富差距导致的社会内聚力的缺乏，促进了暴力的发生和不良的健康后果的形成。这提供了公平性对生活质量有贡献的另一个原因。

五、兼顾生活质量和可持续发展的政策变革

生活质量、公平性和可持续发展是高度相关和互补的。与生活质量、公平性和可持续发展最密切相关的问题，是财富和资源的分配与消费。物质资源的过度消费剥夺了其他人利用那些资源的机会，使环境退化，威胁到地球的生命支持功能，并且减少了对人类有益的生态服务。虽然高于某一水平的消费对提高生活质量贡献微小，但当今世界主流的经济模式以消费来衡量生活质量。在这种模式下，消费较少意味着生活质量较低。而且，政府也是依据这个目标的实现程度来衡量其政绩的。这种思想观念得不到现有证据的有力支持。然而，如果过度消费对生活质量不是必需的和不公平的，并且威胁到人类社会的可持续发展，那么，为什么日益增加生产和消费不仅是一个国家的困扰，而且也是全球性的困扰？更为重要的是，采取什么样的政策才能帮助我们实现兼顾生活质量的可持续发展目标？对于第一个问题，我们将给出两个原因。对于第二个问题目前还只能给出一些初步的政策性建议。

（一）全球性的困扰

经济增长和消费在全球范围困扰我们的第一个原因是，现代的社会、经济和政治制度，以及各种学科，都形成于自然资本相对于人类局部的、小规模的经济活动，几乎是无限丰富的时期，那时人造物品是提高生活质量的关键要素。从历史上看，市场非常擅长于促进消费品的生产和提高生活质量，这一点至少可以从人类寿命的延长和健康状况的改善中得到证明。市场在满足人类需求的同时，影响了我们的价值体系，促进了个人主义、竞争和唯物主义价值观的发展，反过来，这些因素又进一步促进了市场功能的发挥。然而，在一种情况下帮助我们实现理想目标的价值观，在另一种情况下好像又将我们引向不合需要的目标，而且文化价值观的改变是很缓慢的。相对于人类全球性的、大规模的经济活动，现在自然资本已经成为提高人类生活质量和可持续发展的紧约束条件，但是我们对这种变化的反应很迟缓。为了实现可持续发展，我们必须建立一个使经济均衡与生态均衡相容的系统。

经济增长和消费成为全球性困扰的第二个原因是，现有的市场体系妨碍了人们对生态服

务的需求和人类需要非市场满足品的思想的传播。相当多的人是通过受利益驱使的、依赖商业广告为生的媒体获取信息和思想。商业广告使人们在市场物品而不是非市场物品上花费更多的钱，因为商业广告已经改变了人们的思想，使人们相信消费市场物品是获得高生活质量的最好途径。遗憾的是，大量消费导致了自然资源的大量耗减和大量排放废弃物。本质上说，商业广告是在说服我们为了个人的获益而损害共用品。某些消费者对市场物品偏好的不可侵犯否定了其他消费者对共用品偏好的不可侵犯。因此，商业广告把我们的偏好从共用品转变为更依赖于私人物品，它通过说服我们追求实际上降低生活质量的的活动，而引导我们进入一个混合的社会陷阱。^① 由于多种原因，我们对自己长期的生活质量所作的决策不是最优的。而且，由于自然资本的特性，使得它特别倾向于成为社会陷阱。因此，当由商业广告引导的消费，达到威胁支持生命的自然资本的可持续性和减少共用品供给的程度时，商业广告就成为导致不公平的一个因素。

需求同时具有剥夺和潜能双重特征。如果我们能够更好地满足我们的需求，我们的生活质量就会提高；如果我们没有能力满足我们的需求，我们就有一种被剥夺的感觉，生活质量因此也会下降。商业广告不断地刺激我们产生新的需求，但却没有给我们更大的能力来满足需求。从这个意义上说，商业广告直接降低了我们的生活质量。

（二）政策建议

1. 抑制商业广告的影响

不可否认商业广告在提供商品信息方面发挥着巨大的作用。然而，大多数的商业广告并不是信息性的而是劝诱性的。大多数商业广告被设计成劝诱人们相信消费是满足需求和获得高生活质量的最好方法。然而，目前出现的情况是，全球相当多的人的消费水平与人类的可持续发展是不相容的。从这方面来说，商业广告具有“公共劣品”的性质，应该被抑制。有人可能会认为抑制商业广告是不可行的，它违反了言论自由的权力。然而，由商业广告引致的消费妨碍了后代生存的基本权利，那种认为不用限制商业广告就能减少消费的认识是无用的。事实上，

^① Costanza (1987) 将社会陷阱定义为：“支配个人行为的短期的、局部的强化措施，与个人和社会的长期全球最佳利益不协调的任何情形。”迄今至少已经明确了五种类型的社会陷阱。第一是时间延滞，在这种情形下好处很快获得而负面影响滞后。第二是无知，在这种情形下我们根本没有意识到长期的获益是有负面影响的。第三是持续强化 (sliding reinforcer)，在这种情形下好处是随时间变化 (减少) 的。第四是外部性问题。第五是合成推理谬误，由于某一原因对个体来说是对的，便据此而认为对整体来说也是对的。社会陷阱一般来说是混合型的，即这些类型的两种或多种同时并存。

言论自由的权利确实也是有限制的。^①

那么,什么是抑制商业广告可行而又有效的方法呢?这是一个颇具争论性的问题,在这里我们提出几种可能的解决办法。第一,取消对商业广告的税收豁免。目前,在许多国家商业广告费用被作为经营成本而享受免税。商业广告尽管也是共用品,但与同样是共用品的电视广播有着本质的区别,它的目的在于私人利益。取消对商业广告的税收豁免是可行的。第二,颁布要求商业广告“充分披露”的法律条款。税收可能减少商业广告的数量,但它不会引起对非市场满足品的关注。颁布要求商业广告充分披露的法律条款,或许是实现这一目标的有效选择。正如药品标签上必须注明其所有潜在副作用一样,商业广告也应列出所宣传产品对环境的负面影响及其含义的所有信息。这可以使人们意识到非市场物品的存在和他们的消费对这些物品的影响。此外,还需要教育消费者如何利用这些信息,也许这可以从所建议的商业广告税中得到资助。第三,媒体是改变消费者对满足品偏好的一种非常有力的工具。在电视广播节目中播放公益性广告,激发人们对非消费性满足品和维护生态服务的需求。

2. 促使企业走自然资本主义之路

我们认为,只要对人类的经营行为进行某些变革,借助于先进的科技提高资源的生产率,就能为当代和后代带来巨大的利益。通往自然资本主义的路径包括以下彼此相关的四个步骤。第一,大幅度地提高自然资源的生产率。企业通过对生产流程设计和生产工艺等进行根本性的变革,可使自然资源的生产率比目前提高若干倍。第二,使生产模式朝着生物链式的方向发展。企业实行“封闭式”的生产流程,这样的系统往往能够杜绝那些损害自然资本再生能力的有害物质产生。第三,变革现有的经营模式,由销售商品转为提供服务。例如,制造商以提供照明服务替代灯泡的供给,以使经营者和消费者都能从高效、耐久的灯泡工艺中获益。第四,对自然资本再投资,以保护、保持、进而拓展地球的生态空间。由于提高了自然资源使用效率、减少了废弃物排放,企业的收益提高了,自然资本主义被认为是成功的商业环保战略。

既然如此,为什么自然资本主义没有得到广泛的传播?提出这一问题的人实际上犯了合成推理谬误。随着人们环保意识的增强,企业面临的环保压力增大,但压力存在的同时也潜藏着巨大的先行收益。由于企业不可能整齐划一地一致行动,而且企业的技术创新能力也存在着差异,企业可从环保型生产技术研发中获利。在当前大多数情况下,自然资本主义可能确实不如密集的资源使用更能获取利润。但是,使这一方法具有竞争性要比限制商业广告来得简单,而

^① 许多国家已经限制了酒类和烟草的广告;澳大利亚消费者协会对在儿童电视节目中播放不健康食品的广告进行了公开抨击(Durning, 1992)。

且有許多成功的范例。当然，大多数人可能不会自愿地以更高的价格来购买那些不会对环境造成损害的商品。为了使自然资本主义更具竞争性，引进绿色税收^①——通过增加资源密集型和污染密集型产业的成本——就变得非常有必要了。

3. 实施税收并取消资源开采补贴

首先，绿色税收作为一种激励自然资本主义的方法，总体上它能提供一条通向高生活质量和可持续发展的途径。绿色税收将生产和消费的外部成本纳入到市场价格之中。如果人们不得不为他们的生产和消费引起的生态和社会损害付出代价，他们将减少生产和消费，或转向生产和消费负面影响较小的物品。价格上涨也将鼓励人们开发对环境不产生危害或危害较小的消费品。只有当市场价格能反映全部成本时，市场分配才是有效和公平的。

其次，高累进的消费税特别适合于有关地位财富和过度消费的问题。这种税收将显著抑制过度消费，并且大部分消费者不会因此而遭受生活质量的下降。过度消费和财富积聚的负面影响将得以缓解，而且将没有必要对收入强加不受欢迎的上限。

最后，许多政府对自然资源定价过低，甚至为了促进经济增长，对资源开采进行直接的补贴。这些隐性的和显性的补贴，实际上是将资源从公共部门直接转移给了私人部门，并且间接地减少了来自自然资本的共用品。因此，必须取消这些补贴，以消除自然资本分配的扭曲。

4. 实行公平分配以缩小贫富差距

在一个公平的社会里需要结束贫困。^② 结束贫困的传统解决办法就是把经济规模做大。可是，数十年，甚至数百年的经济快速增长也未能证明其自身的有效性，在这个自然资本有限的地球上，不可能无限地维持，有些方法甚至已产生了相反的结果。财富的更公平分配是经济增长的一种替代选择。然而，财富的更公平分配需要政治意愿。政治意愿是文化价值观的一种表达。^③ 因此，任何缩小贫富差距的政策前提是改变提供这种政治意愿的文化价值观。

在最贫穷的国家，经济增长和人口控制是结束绝对贫困所需要的。但也并非必然如此。比如，即使在全球最严重的饥荒期间，发生饥荒的国家也为饥民生产了足够的食物。饥荒是个权利问题，而不是一个丰富性问题。最贫穷的国家生产得越多，在当前的全球体制下，产生的绝大部分财富就会进入上层社会或流向国外，经济增长似乎并没有带来什么希望。所以这是个分

^① 这里，绿色税收被作为包括排污费、可交易许可和配额等一套环境规制机制的简称。对这些机制的详细论述，参见托马斯·思德纳：《环境与自然资源管理的政策工具》，张蔚文、黄祖辉译，上海人民出版社、上海三联书店，2005年，第107—198页。

^② 即基本需求的满足品都是不充足的。

^③ 即使在大多数国家它只是统治阶级的文化价值观。

配问题。富人和掌握权力的人有能力建立一个更公平地分配财富和资源的新体制。但由于惧怕这会降低他们的生活质量，新体制难以建立。这种惧怕，产生于财富占有和消费可以满足人类所有需求这样一种价值体系。这一价值体系同样限制了我们的消除其他贫困的能力。对财富占有和消费的迷恋，以及它们作为假满足品的本性，剥夺了我们的资源和我们追求需求的真正满足品的潜能。因而，消除贫困要求停止对财富占有和消费的迷恋，这又要求改变占主导地位的价值观。接下来的问题是，我们如何沿着可持续的、公平的和高质量的社会方向去改变文化价值观。

5. 实施广泛的跨学科和多意识形态的教育

教育对提高人们的生活质量发挥着关键作用，它直接深化了人们对需求的理解，极大地增加了人们对其他的人类需求满足品的利用。更重要的是，它是改变价值观所必需的一种方法。如上所述，价值体系随着制度、环境和文化的发展演化而变化，但是人类活动正在改变环境的速度的现实提醒我们，不能再无动于衷或消极等待。正在激起的价值观的快速变化将要求广泛的教育。目前存在的部分问题是，人们对人类活动对环境的影响了解得还不够。如果对生态过程没有广泛的了解，人们将不会认识到这些过程对人类发展的制约。教育人们认识到当前发展模式的负面影响，人们就会逐步成熟而接受替代选择。可是，目前提供的解决经济增长引起的环境损害的主要“办法”都非常狭隘。^①在大学里，教育是在很窄的学科范围内的一种典型灌输。如果一个人不懂生态学，他可以很容易地接受新古典经济学；如果一个人不懂社会科学，要将他的认识从生态学转向实际政策就会很困难。发展可持续的社会和保证人类与支持生命的自然资本之间的内在平衡，要求教育必须是广泛的跨学科教育。处于主导地位的消费主义意识形态在过去是适合的，但现在我们若继续倡导这种意识形态，将不再适应未来。因而，广泛的跨学科和多意识形态的教育，是在一个变化的世界中实现可持续发展所必需的适应性管理原则的要求。

6. 政治改革

减少贫困、限制商业广告或教育改革，都需要有政治意愿。为防止少数人对政治意愿的控制，在所谓民主国家需要进行运动式的财政改革，在其他国家需要采取限制富人对政治事务的影响的做法。文明社会不仅要在影响政府方面，而且要在发展我们的价值观和前景指向方面发

^① 一些论点认为，发达国家的空气和水的质量日益改善，经验证据表明，经济增长解决了环境问题。提出这一解决办法的那些人似乎忘记了热力学的规律，没有看到无数环境问题并没有改善，并且忽视了一个事实，即那些过度发达国家将他们污染最严重的产业转移到了第三世界国家。

挥关键作用。一个强大的文明社会可以帮助建立一个强大的分享式民主制，这是最有利于建立一个公平的、可持续的和高质量的社会政府形式。在分享式民主制中，人们对影响他们生活质量的问题进行公开讨论，并共同决定如何解决这些问题。这可以直接满足人们对参与和身份地位的需求，教育人们了解相关的问题和其他意识形态，帮助引导社会资源满足人类需求。当居民们聚集到例会上讨论问题并一起工作以解决问题时（即使还存在明显的冲突），就会产生社会资本的强有力结合，并且能在形成社区观念方面发挥重要的作用。

7. 创建一个共同愿景

实现兼顾生活质量的人类社会可持续发展，需要一个什么样的共同愿景？如何才能实现这一愿景？无限地增加物质消费这种现有默认愿景是不可持续的。实现可持续发展的先决条件是建立一个共同愿景，它是一个社会应当支持什么，以及表达我们希望未来怎样的共同价值观。这一愿景必须要体现多样性的观点、基于公平性原则和尊重个人人权。以可信的方式形成可持续发展的共同愿景，要求社会各阶层广泛的参与。否则，这一愿景将不具有广泛性。

可持续发展的共同愿景，必须立足于自然资本限定的条件内，而且还要认识到，现在的文化及其所强调的作为满足品的消费品所形成的限制条件，并不是那么具有刚性。建立一个可持续发展的社会，要求我们接受消费不是最终目标，而只是达到目标的手段观点。我们还必须认识到，消费不能无限地增长，生活质量并不仅仅取决于消费。必须重新定义效率，使它不仅能反映约束条件下的市场价值最大化，而且还能够反映以最少数量的自然资本满足最多的人类需求。不能简单地悲叹现有发展模式的负面结果，我们必须确定一个可持续的、理想未来的积极愿景，并共同努力来实现它。

参考文献

[1] Aldeman, Irma, 1975, "Growth, Income Distribution, and Equity-Oriented Development Strategies", *World Development*, 3, pp. 67 - 76.

[2] Barry, Brian, 1989, *Theories of Justice*, vol. I, Berkeley CA: University of California Press.

[3] Clark, Colin W., 1990, *Mathematical Bioeconomics: The Optimal Management of Renewable Resources* (2nd ed.). New York: John Wiley and Sons.

[4] Coase, Ronald H., 1960, "The Problem of Social Cost", *Journal of Law and Economics*, vol. 3, pp. 1 - 44.

[5] Costanza, Robert, 1987, "Social Traps and Environmental Policy", *BioScience*, Vol. 37,

No. 6 , pp. 407 - 412.

[6] Costanza , Robert and Herman E. Daly , 1992 , “ Natural Capital and Sustainable Development ” , *Conservation Biology* , vol. 6 , No. 1 pp. 37 - 46.

[7] Costanza , Robert and Sven Erik Jørgensen , 2002 , *Understanding and Solving Environmental Problems in the 21st Century* , Oxford : Elsevier Ltd.

[8] Durning , Alan , 1992 , *How Much is Enough ? The Consumer Society and the Fate of the Earth*. New York : W. W. Norton.

[9] Ekins , P. , 1991 , “ The Sustainable Consumer Society : A Contradiction in Terms ? ” *International Environmental Affairs* , vol. 3 , No. 4 , pp. 243 - 258.

[10] Faiola , A. , 1999 , “ Argentina s Lost World : Rush into the New Global Economy Leaves the Working Class Behind ” , *Washington Post* , December 8.

[11] Frank , Robert H. , 1999 , *Luxury Fever : Why Money Fails to Satisfy in an Era of Excess* , New York : Free Press.

[12] Gates , Jeff , 1999 , “ Statistics on Poverty and Inequality ” , Available on-line : [http : // www. globalpolicy. org/soecon/inequal/gates99. htm](http://www.globalpolicy.org/soecon/inequal/gates99.htm)

[13] Haas , Barbara K. , 1999 , “ A Multidisciplinary Concept Analysis of Quality of Life ” , *Western Journal Nursing Research* , vol. 21 , No. 6 , pp. 728 - 742.

[14] Hotelling , Harold , 1931 , “ The Economics of Exhaustible Resources ” , *Journal of Political Economy* , vol. 39 , No. 2 , pp. 137 - 175.

[15] Hsieh , C. , and M. D. Pugh , 1993 , “ Poverty , Income Inequality , and Violent Crime : A Meta-analysis of Recent Aggregate Data Studies ” , *Criminal Justice Review* , vol. 18 , No. 2 , pp. 182 - 202.

[16] Lane , Robert E. , 2000 , *The Loss of Happiness in Market Economies* , New Haven : Yale University Press.

[17] Max-Neef , M. , “ Development and Human Needs ” , in P. Ekins and M. Max-Neef , eds. , 1992 , *Real-life Economics : Understanding Wealth Creation* , London and New York : Routledge , pp. 197 - 213.

[18] Mishan , Ezra J. , 1967 , *The Costs of Economic Growth* , New York : Frederick A. Praeger.

[19] Munasinghe , Mohan , “ Towards Sustainomics : A Trans-Disciplinary Meta-framework for Making Development More Sustainable ” , in Mohan Munasinghe et al. , eds. , 2000 , *The Sustainability*

of Long-Term Growth : Socioeconomic and Ecological Perspectives. London : Edward Elgar , pp. 23 - 45.

[20] Phelps , Edmund , 1961 , “ The Golden Rule of Accumulation : A Fable for Growthmen ” , American Economic Review , vol. 51 , No. 4 , pp. 638 - 643.

[21] Phelps , Edmund , 1965 , “ Second Essay on the Golden Rule of Accumulation ” , American Economic Review , vol. 55 , No. 4 , pp. 793 - 814.

[22] Rand , Ayn and Leonard Peikoff , 1996 , Atlas Shrugged , New York : Signet Mass Market Paperback.

[23] Rawls , John , 1971 , A Theory of Justice , Cambridge , MA : Harvard University Press.

[24] Reynolds , D. B. , 1999 , “ The Mineral Economy : How Prices and Costs Can Falsely Signal Decreasing Scarcity ” , Ecological Economics , 31 , pp. 155 - 166.

[25] Schuessler K. and G. Fisher , 1985 , “ Quality of Life Research and Sociology ” , Annual Review of Sociology , 11 , pp. 129 - 149.

[26] Sen , Amartya , 1984 , Poverty and Famines : An Essay on Entitlement and Deprivation , Oxford : Oxford University Press.

[27] Sen , Amartya , “ The Concept of Development ” , in H. Chenery and T. N. Srinivasan , eds. , 1988 , Handbook of Development Economics. vol. I , Amsterdam : Elsevier Science Publishers , pp. 9 - 26.

[28] Snyder , Carl , 1936 , “ The Capital Supply and National Well-Being ” , American Economic Review , vol. 26 , No. 2.

[29] Solow , Robert M , 1974 , “ Intergenerational Equity and Exhaustible Resources ” , Review of Economic Studies Symposium , vol. 41 , pp. 29 - 45.

[30] Sugden , Robert , 1993 , “ Welfare , Resources and Capabilities : A Review of Inequality Reexamined by Amartya Sen ” , Journal of Economic Literature , vol. 31 , No. 4 , pp. 1947 - 1962.

[31] Ulrich , Roger S. , et al. , 1991 , “ Stress Recovery during Exposure to Natural and Urban Environments ” , Journal of Environmental Psychology , 11 , pp. 201 - 230.

[32] Wallach , Lori and Michelle Sforza , 1999 , Whose Trade Organization ? Corporate Globalization and the Erosion of Democracy , Washington DC : Public Citizen.

[33] Walster , Elaine , et al. , “ New Directions in Equity Research ” , in L. Berkowitz and E. Walster , eds. , 1976 , Advances in Experimental Social Psychology. vol. 9 , New York : Academic Press , pp. 1 - 42.

[34] Walster, Elaine, et al., 1998, "New Directions in Equity Research", Soc. Sci. Med., vol. 47, No. 1, pp. 7 - 17.

[35] Wilkinson, R., 1996, *Unhealthy Societies: The Afflictions of Inequality*, London: Routledge.

[36] World Bank, 2001, "Social Capital for Development: What is Social Capital", Available on-line: <http://www.worldbank.org/poverty/scapital/whatsc.htm>.

[37] [意] 尼古拉·阿克塞拉 (Nicola Acocella), 《经济政策原理: 价值与技术》, 郭庆旺、刘茜译, 北京: 中国人民大学出版社, 2001。

[38] [英] 朱迪·丽丝 (Judith Rees), 《自然资源——分配、经济学与政策》, 蔡运龙、杨友孝等译, 北京: 商务印书馆, 2005。

Natural Capital and Sustainable Development

Ma School

(Industrial Economics Department of Fudan University)

Abstract : Market mechanism is efficient and fair in the allocation of private goods. The production and consumption of the private goods need to consume the natural capital , which invisibly extends the market mechanism to the allocation of the natural capital. Because the natural capital belongs to public goods and the production and consumption leads to environmental negative externalities , the market mechanism can't allocate the natural capital efficiently or fairly. The existing social , economic , and political institutions evolved at a time when natural capital was vast relative to human impacts were relatively small and local. These institutions are not compatible with the actuality that the natural capital is scarce relative to global and large-scale economic activities. This threatens the sustainable development. On this analytical foundation , this paper makes policy suggestions , such as curbing the impact of business advertising , green taxes and educational reform , to help us achieve a sustainable future with a high quality of life for all.

Key Words : Natural Capital ; Quality of Life ; Sustainable Development

JEL Classification : D390 , I310 , O130

产品构造、文化禀赋与分工组织

——水平分工格局下贸易结构的形成机制初探

张捷*

摘要：本文通过对劳动分工理论的拓展来解释国际水平分工中的贸易结构问题，以弥补内生贸易理论缺乏产品选择机制的缺陷。笔者在同时考虑产品的工程构造和生产者的文化禀赋对分工组织的影响的基础上，构建了一个解释水平专业化的产品选择机制的理论框架。在该框架下，产品构造从技术上规定了分工组织的最优结构，但分工组织的选择和演进又受到生产者文化禀赋的影响；如果一国的文化禀赋支持特定结构的分工组织，该国生产者将在与这种组织结构相对应的产品上形成竞争优势，选择专业化于该类产品。与要素禀赋相比，文化禀赋具有更强的稳定性和异质性，依据其建立起来的竞争优势也更为持久。文化禀赋的相对性则决定了所有发展水平相当的国家均可以在与本国的文化禀赋相契合的产业中建立起自己的竞争优势。

关键词：产品构造；文化禀赋；劳动分工

一、导言

近年来，随着新兴古典经济学的兴起，传统的国际贸易理论受到了挑战。根据杨小凯等人（杨小凯，张永生，2001）的观点，贸易理论的发展有两条线索：一条是强调外生技术比较优势（李嘉图模型）和要素禀赋差异（H-O模型）的外生比较利益论；另一条是强调分工和专业化（古典与新兴古典理论）以及规模经济（D-S模型和新贸易理论）的内生比较利益论。前者关注资源配置和流向等非拓扑性质的变化，后者则关注分工网络、经济组织等拓扑性质的变化。笔者认为，从经济发展史的角度来看，外生比较利益论的确显得比较消极，发展中国家

* 张捷，暨南大学经济学院教授，副院长，经济学博士。通讯地址：广州市黄埔大道西601号暨南大学经济学院；邮政编码：51063。E-mail：tzjie@jnu.edu.cn。

如果完全遵从外生比较优势参与国际分工，很容易陷入“比较利益陷阱”；而内生贸易理论则更加强调人类的主观能动性，能更好地解释经济发展的动因。

不过，内生贸易理论（无论新兴古典理论还是新贸易理论）也有一根“软肋”：难以解释分工时谁生产什么的贸易结构问题。正如其批评者所指出的：新兴古典模型假设不同生产者的技术和要素禀赋相同，由交易费用的大小（或交易效率的高低）来决定一个国家是否分工及分工水平的高低，但其无法确定某个国家究竟出口和进口何种产品的贸易结构（鞠建东，林毅夫，王勇，2003）。内生贸易理论用林达贸易模式（Linder pattern of trade）的例子来诘难传统贸易理论拙于解释要素禀赋相似的发达国家之间的产业内贸易的基础，它们或者用高的交易效率，或者用规模经济来较好地解释了水平分工的产生基础，但由于缺乏外生条件作为分工的选择基准，内生贸易理论无法解决分工中谁生产什么的问题。有的教科书在触及该问题时只能使用“可以协议分工也可以自发形成分工”的含糊说法（海闻，P. 林德特，王新奎，2003）。这样一来，内生贸易理论中的贸易结构成为偶然的歷史产物，可以由“拈阄”产生，也可以在随机试错过程中通过“碰运气”产生。这一缺憾不仅影响了理论体系的严谨性，而且也与经济现实相悖。

在现实的国际贸易中，要素禀赋相似的发达国家之间的水平分工，在出口产品上往往显示出鲜明的国家特征，如意大利和法国的奢侈品、瑞士的高级钟表、日本的汽车和电子产品、德国的装备工业和化工产品、美国的航空工业和IT产品等。为什么这些国家在生产某些特定产品上出类拔萃？难道这完全是随机选择的结果吗？迈克尔·波特（2003）指出，一国在特定产业中的竞争优势既非偶然的巧合，也不能归因于运气，不同国家有其不同的竞争力形态。他用罗列各种因素的“钻石模型”来解释一国产业竞争优势的来源。在现实经济中，分工和贸易结构的形成原因十分复杂，可能既有外生因素，又有内生因素，两者在一定条件下还可能互相转化。笔者并不认为内生贸易理论与外生贸易理论之间完全是竞争的关系，两者也有互补的一面。但这并非本文要讨论的主题。本文的目的是：在接受专业化分工产生的比较优势是国际贸易基本动因的观点的基础上，通过对分工理论的拓展——这种拓展主要在劳动分工的自然属性和社会属性两个基本方向上展开——探讨在没有先天技术优势和要素禀赋差异的前提下，水平专业化的产品选择机制是如何形成的。

本文的第二部分阐述基于劳动分工的技术特征的产品设计构造与分工组织的关系；第三部分讨论生产者的文化禀赋对分工组织选择和演化的影响；第四部分在综合以上两部分分析的基础上进一步探讨水平分工格局下贸易结构的形成与演变机制；最后是基本结论。

二、产品构造与分工组织

劳动分工涉及生产过程中人与自然的关系到人与人之间的关系,因而劳动分工又可以分为技术分工和社会分工。劳动分工首先受劳动对象的自然属性——生产过程的物理特性(如可分解性)的影响。亚当·斯密在《国富论》中指出,农业生产由于季节性强,要对犁地、耙地、播种和收获等工序实行职业分工就很难,农业的劳动生产率之所以总是落后于制造业,根源就在于农业生产不可能像制造业那样实行完全的分工。人类进入工业社会以后,分工水平的提高促进了科技进步,科技进步又加深了人们对生产过程的自然属性的认识,促使生产者通过技术创新和组织创新进一步深化和细化分工。但无论技术如何进步,劳动分工始终摆脱不了生产的自然属性的制约。尤其是在研究制造业的分工问题时,我们必须考虑产品的工程设计构造(简称产品构造)对分工模式及其组织结构的影响。

产品构造可以概括为如何将一个产品的各种功能有机地配置到各个有形组件上的设计原理问题(Ulrich, 1995)。或者说,产品构造是生产者在生产的自然属性、产品功能和技术手段的约束下所作出的关于产品组件配置及其相互关系的技术决策的集合(Gulati and Eppinger, 1996)。它一般包含三方面内容:(1)功能元素的集合。产品功能产生于其物理特性,功能元素的集合及其相互连接的方式构成一个相对稳定的功能结构;(2)功能元素与有形组件的结合。一个可分解的产品由一个或多个组件构成,一个组件通常是一个可分离的有形部分或部件。功能元素与有形组件的结合形式大致可分为一对一式(one-to-one)、多对一式(many-to-one)和一对多式(one-to-many);(3)有机联系的各个有形组件之间界面(interface)的规定。从产品构造的角度,设计界面被定义为组件与组件之间相互连接(包括非接触式连接)时的依赖函数,通常包括组件之间彼此的几何空间约束,以及能量传输、信息表达和材质要求等影响产品功能的诸多方面。

根据不同的分类标准,产品构造可以分为多种类型。如果按照功能元素与有形组件的结合方式以及组件之间的界面结构,产品构造大致可以分为两大类:模块型构造(modular architecture)和整体型构造(integral architecture)。根据青木昌彦和安藤晴彦(2003)的定义,模块是指具有某种特定独立功能的半自律性的子系统,它可以通过标准界面结构与其他功能的子系统按照一定的规则相互联系而构成更加复杂的系统。通常,模块型构造的产品的功能元素与有形组件之间的结合方式是一对一式的,而且各个组件之间的界面是非耦合式的(de-coupled),属于标准化界面。整体型构造产品的功能元素与有形组件的结合方式则较为复杂,可能是多对一

或一对多式的，而且组件之间多为耦合式的（coupled）、难以标准化的界面。一些日本学者（藤本隆宏，延冈健太郎，2004）根据界面规则的适用范围又将产品的构造体系分为开放式和封闭式。若有关产品的界面规则在整个行业得到公认和执行，则为开放式构造；若该界面规则仅仅适用于某个企业内部，则为封闭式构造。

劳动分工本质上是将一个复杂的工作分解为若干较简单的次级工作的过程。因此，产品的设计构造可以被视为劳动分工的技术路线图，它直接关系到分工的细化程度、方式和组织结构。首先，产品构造决定分工的职能划分，在对生产过程实行分解时，各种工作职能的划分必须以产品构造为依据。其次，产品构造决定分工的组织结构和协调方式。对于复杂的产品来说，其构造往往是多层次和多类型的复合体，与之相对应的劳动分工也是一个多层级（包括个人、团队、企业乃至国家）的复杂系统。在这个分工体系中，分工组织内部各单位之间以及分工组织之间的协调方式和相互依赖程度，也是由产品构造内部的功能与组件之间的相互联系方式和联系的紧密程度所决定。

下面我们结合制造业的情况，将产品构造与分工组织的对应关系大致归纳如下：

（1）产品构造与组织结构的对应。一般来说，功能结构复杂和界面耦合度高的整体型构造产品，由于功能元素与组件的结合是一对多或多对一式的，且子系统之间联系紧密，分工者之间需要保持频密的协作与互动，适宜于在集中管理的科层组织内部实行分工；反之，功能结构简单一和非耦合式界面的模块型构造产品，由于组件之间相对独立，工序之间联系松散，更适宜于在不同企业乃至不同国家之间展开分工。

（2）产品构造与治理结构的对应。分工必然产生协调和整合问题。分工的治理结构反映对生产过程中资源配置和知识应用的协调方式。分工的协调方式主要有三种：依靠科层组织的行政协调；依靠价格机制的市场协调；依靠惯例、网络等非正式规则的社会协调。协调必然产生成本（包括管理成本、交易成本和社会关系成本），协调成本（coordination cost）是决定分工效率的关键因素。一般来说，协调成本与分工组织的复杂程度和协调密度正相关，与分工组织的信息生产能力及其弹性^①负相关。治理结构的作用之一就在于通过决策权和决策所需信息资源的合理配置来降低分工的协调成本。由于产品构造本质上是一个技术结构与社会结构的协调系统（奥野正宽，渡边泰典，2006），分工组织的治理结构必须与产品构造相匹配。其一般原则是：在稀缺资源的使用上，各分工单位的活动水平（职能与权限）以及相互之间的关系应当与产品构造的基本特征相匹配，同时又能较好地适应外部环境的不确定性。具体地说，当产品构

① 弹性是指分工组织在一定的制度结构下应对技术进步和市场变化等外部冲击的能力。

造的特征决定分工单位之间在资源使用上存在较强的竞争性时，决策权应当相对集中于科层组织的中枢机构；反之决策权可以相对分散，使各分工单位有较大的自主权以应对外部冲击。当产品构造的特征决定各分工单位在知识及信息的加工上存在较强的互补性（关联性）时，分工单位之间的职能界限（决策权边界）不宜划分得过细和过于清晰，应当留有足够的共同决策区域和信息共享通道；反之则可以使分工单位尽量各司其职，在信息加工上减少横向联系以节约协调成本。以上原则仅考虑了企业内部的分工，如果再考虑企业外部的分工，分工组织的治理结构会呈现出更加错综复杂的形态。

根据不同的标准，对分工组织的结构划分种类繁多。青木昌彦（2001）根据决策权分布和信息的联结模式，将除市场以外的分工组织分为八种结构类型。它们分别是：决策一体化的功能层级制（Decision-Integrated Functional Hierarchies）、网络一体化的功能层级制（Network-Integrated Functional Hierarchies）、层级控制型团队（Hierarchical-Controlled Teams）、水平层级制（Horizontal Hierarchies）、参与型层级制（Participatory Hierarchies）、日本的供应商系列（Suppliers Keiretsu）、意大利工业区（Cluster）和硅谷企业族群。在这八种结构中，前五种属于分工组织，后三种属于准组织（中间组织）。其具体特征在此不赘。

综上所述，产品构造与分工组织之间存在着紧密联系，对于每一种产品构造来说，在技术上应当存在某种最优（效率最高）的分工组织结构。英国学者对组织结构与技术系统关系的经验研究证明：“组织的特性、组织的技术和组织的绩效是联系在一起的……生产系统不仅是决定结构的一个重要变量，而且对于每一生产系统来说还有一个最适宜的具体组织形式。”（琼·伍德沃德，1965）至于在现实经济生活中，各国的生产者在生产同一构造的产品时，是否都选择了最优的分工组织结构，则是一个另当别论的问题。

三、文化禀赋与分工组织

经济学家在研究分工原理时，往往将生产者作为舍弃了社会关系的单纯的生产要素来看待，这种抽象虽然有利于理论的构建，但却使分工的起源和演进变得难以理解。就起源来说，劳动分工只能在已经存在协作关系的社会群体中产生，很难想像毫无社会联系的人们之间会发生分工。社会学的主要创始人涂尔干在《社会分工论》（2000）中指出：“只有在各个社会成员已经构成联系的前提下，分工制度才能得以实行”，“有了社会凝聚，分工才会产生，就本质而言，社会凝聚来源于共同的信仰和感情。”可见，基于共同文化的社会协作关系先于社会分工，正如产品构造是影响分工的自然基础一样，社会文化形态则是影响分工的社会基础。因此，经济

学对于分工原理的研究理应考虑生产者和生产组织的社会文化特征。

笔者将一国生产者和生产组织源于特定的自然条件、历史传统和发展路径而形成的社会文化特征称为“文化禀赋”(cultural endowment),以区别于劳动力、资本、自然资源和技术等要素禀赋。这里的文化是广义的概念^①,包括人类社会的习俗、惯例、道德、宗教、伦理等,近似于制度经济学中“非正式制度”。文化禀赋作为一个社会的“遗传基因”,浸透在人们的日常生活和生产活动之中,规范着社会和经济生活的秩序,并成为法律等正式制度的基础。分工作为一种自发产生和演进的经济制度,不可能不受到文化禀赋的影响。正如新经济社会学的创立者 Granovetter (1985) 所强调的:人们的经济行为总是嵌入在社会关系之中,所有的经济制度都应作为社会结构来理解。

文化禀赋也可以看做是生产者的偏好^②,即生产者擅长于生产什么和倾向于如何组织生产。引入文化禀赋的影响不仅有助于我们理解分工的起源,而且有助于我们解答这样一个问题:既然产品构造决定了最优的分工组织,那么在产品构造相同的产业中,各国的组织结构也应当相同。但事实上,在一些重要产业中,工业化国家的产业组织却不尽相同;而在一国内部某些产品构造不同的产业之间,该国的分工组织却呈现出某些相似的结构特征。分工组织的这种国别特征表明:产品构造并非决定分工组织的结构特征的惟一因素,分工组织的结构特征还受到其他因素的影响,除了要素禀赋的影响以外(本文假定要素禀赋相似),文化禀赋也应当是影响分工组织的一个重要变量。

首先,从整个社会的角度看,分工组织的选择可以视为在既定的社会环境中一种制度动态博弈(选择)的均衡结果。青木昌彦(2001)指出:在制度选择的过程中,“技术和生态因素固然重要,但不是选择特定均衡结果和特定规范的惟一决定因素,政治和社会因素也将发生作用。否则,制度只不过是技术和生态特征的机械性转换,那样我们就完全变成了制度发展的技术地理决定论者”,“我们拿供求因素决定均衡价格的形成作比喻……在决定均衡非正式规则的过程中,生态和技术因素决定了哪一种规则可能是有效率的(需求因素),但社会和历史条件将限制可行规则的供给。”对于分工组织的选择来说,按照产品构造的要求,某种组织结构的效率可能最优,但如果这种组织结构与特定国家的文化禀赋(如商业惯例)难以契合,在运行

① 根据 Hofstede (1993) 的定义,文化是一些心理程序的集合,它把一个群体的成员跟其他群体的成员区别开来。作为结构变量的文化体现在从家庭、组织到民族的各个层面上。民族文化是特定民族的人们所共享的价值观和行为规范;组织文化受民族文化的大背景的影响,但又存在着其相对的独立性。

② 产业内贸易理论在解释偏好和产品差异对分工的影响时,考虑的只是消费者偏好而忽略生产者偏好,这正是内生贸易理论无法解决贸易结构问题的一个重要原因。

过程中摩擦系数过大,带来过高的协调成本(含交易成本),那么该国的生产者可能不得不放弃这种最优结构,转而选择符合其惯例的次优的组织结构。

以汽车产业为例,由于汽车零部件数量众多,必须在企业内部和企业之间实行专业化分工。同时汽车的产品构造又是以整体型构造为主,核心零部件大多是专用零部件,参加分工的企业必须为此投入专用性资产。为防止涉及专用性资产的交易所产生的勒索(hold up)问题,企业之间需要签订长期化的交易合同。但任何合同都不可能完全消除未来的不确定性,这就需要企业在正式合同之外保持一种相互信任的合作关系。在具有个人主义文化传统的美国,受保持距离型(arms length)商业惯例的影响,汽车工业形成了垂直一体化的生产体制。在这种体制下,不仅企业内部等级森严、部门之间缺乏横向联系,而且总装厂与供应商之间也是短期交易。“总装厂将事先设计好的零部件图纸交给许多供应商投标承制,合同大多属于短期性质,如有可能总装厂会毫不犹豫地订给成本更低的供应商,而且会在需求疲软时期终止合同关系”,“这种安排不可能促进忠诚与信任,供应商也无兴趣投资于产品创新。”(迈克尔·德托佐斯等,1998)美国汽车厂商之间也曾经尝试建立长期合作关系,但成功者寥寥。一个典型案例是20世纪20年代通用汽车公司对费希尔车身公司的垂直一体化。当时通用与费希尔签订了一项排他性的长期交易合同,规定十年内通用只能购买费希尔的产品,且购买价格只能维持在竞争水平上。虽然有了这项保护费希尔不受勒索的长期合同,但由于缺乏信任关系,费希尔仍然不愿意按照通用的要求进行专用性投资,市场对车身需求的增长更使费希尔与通用保持距离,通用在反过来面临费希尔勒索的潜在威胁下,最后不得不兼并了该公司(斯科特·马斯腾,2005)。在日本,战后汽车工业的发展同样面临整体型构造产品的专业化分工与资产专用性交易的难题,但具有共同体文化传统的日本却没有模仿美国的垂直一体化结构,而是利用日本社会广泛存在的“信任资产”,通过“市场与组织的相互浸透”原理形成了以资本和人际关系为纽带、以长期合作为特征的系列化分工组织(今井贤一,伊丹敬之,1981)。在系列化结构下衍生出的精益生产和适时供应体制(JIT),使日本汽车工业的竞争力跃居世界前列。麻省理工学院工业生产率委员会的调查报告指出,组织结构的差异是造成美国汽车工业被日本赶超的一个重要原因。

其次,从微观角度看,单个企业或企业家完全可以通过组织设计和组织实验来寻求最优的组织结构。熊彼特把企业家的组织创新活动视为资本主义经济活力的源泉。杨小凯和黄有光(1999)用一个瓦尔拉斯序贯均衡模型来说明当社会通过价格制度做组织实验的效率足够高时,人类关于最优分工组织的知识就会自发演进,而当交易效率足够高时,组织信息的演进也会促使劳动分工的演进。

笔者同意组织实验可以导致分工水平与组织结构共同演进的观点。但必须注意,由组织实

验所推动的分工组织的演进，并不必然导致最优组织结构被广泛采纳。前者只是后者的必要条件而非充分条件。问题的关键在于：由于文化禀赋的影响，组织实验并不能保证由技术特征所决定的最优分工组织结构一定能够实现。理由如下：

(1) 从事组织实验的人和组织都是“有限理性”的，他们不可能事先精确地设计好所有的组织方案后才开始实验，而是从既有的经验和惯例出发开始实验，通过“干中学”来修正和完善实验方案。因此，任何组织实验既有理性设计的成分，同时也存在因经济主体的有限理性而产生的惯例的因素。惯例中包含着文化传统，具有路径依赖的特征。组织实验就是在惯例的结构惰性和源于竞争压力的创新努力之间寻求均衡的过程。青木昌彦（2001）指出，当事人的有限理性使组织实验无法完全摆脱传统的影响，有可能在最优组织结构实现之前，组织创新就停留在了某种新旧混合的均衡结构上。况且，研究经济演化的学者（杰克·弗罗门，2003）认为：即使市场竞争保证了组织实验中最有效率的结构会被选择，但这种市场选择机制却并不能保证最有效率的组织结构一定会被包含在组织实验者的方案集合之中。

(2) 组织实验中关于组织效率的知识演进有赖于当事人观察和处理信息的认知结构，而人类的认知结构总是带有文化倾向，这些文化倾向将影响当事人对组织信息的价值判断，进而影响到对组织结构选择的可行集。Greif（1994）将博弈当事人的认知结构倾向称为文化信念（cultural beliefs），并将基于当事人文化信念的博弈策略分为集体主义策略和个人主义策略。在制度博弈中，文化信念连同当事人相互作用而形成的历史过程，使得人们的预期趋向于多种可能的制度演化结构中的一种。青木昌彦（2001）则将认知结构称为心智程序，运用心智程序加工信息的能力构成一个组织的人力资产，其类型可分为背景取向型（context-oriented）人力资产和个人型人力资产。前者善于加工各分工单元共同面对的系统性环境的信息，通过意会知识的共享构建一个共同的决策基础；后者长于独立处理只与自己相关的环境部分的信息，并通过指令、公告等正式信号与其他单元传递决策信息。两者相比，背景取向型人力资产更具有组织专用性，而个人型人力资产的可转移性更强。个人心智程序的特征既受社会文化背景的影响，又与社会中占主导地位的组织结构对人力资本投资的个人决策的影响相关。同时，企业家对组织结构的选择也受到人力资产类型的人口分布的限制。青木昌彦用进化博弈模型证明：在组织演化的过程中，当事人的决策具有重要的决策互补性，当事人一旦偏离了主导的策略形式，他们将面临与组织信息结构或人力技能不相匹配的风险。由于策略互补性的存在，即使某种组织结构比其他结构更适合于特定产业的技术和市场环境，但该结构能否在这类产业中占据主导地位仍然是不确定的。假如信息处理技能的人口分布高度偏向于某种结构，即使它不是最优的，它仍有可能作为一种组织惯例而存续下去。

综上所述,文化禀赋从宏观和微观的角度影响着分工组织的结构及其演进,文化禀赋的存在及其路径依赖特征,成为制度演进产生多重均衡(即制度结构多样化)的一个重要根源,在产业分工组织的领域也不例外。

以上的分析仍然停留在封闭经济的层面上,在开放经济的条件下,情况会有变化吗?以下我们将进一步讨论:受产品构造和文化禀赋的影响,在要素禀赋相似的国家之间,国际贸易的特定结构是如何形成的。

四、水平分工格局下国际贸易结构的形成及演变机制

众所周知,国际分工不过是国内分工的延伸,它并不改变分工的基本原理。但是,在国际分工中,由于市场规模更大,竞争更加激烈,因而对分工组织的效率也就要求更高。

分工组织的效率主要表现为组织的协调能力、学习能力和创新能力。任何组织的能力都有特定的来源和指向。假设资源禀赋相同,组织能力的强弱将由组织结构和治理结构(制度结构)的功能所决定。前者主要受制于产品构造(技术结构),后者则受到一国文化禀赋的深刻影响(van Oudenhoven, 2001)。在国际分工中,分工组织的效率不仅取决于组织结构和制度结构的功能,更取决于两者的功能之间是否耦合。此即比较制度分析理论所提出的技术、组织、制度与文化之间的“战略互补性”(strategic complementarity)原则(青木昌彦,奥野正宽,1996)。根据该原则我们可以假定:在国际分工中,具有集体主义文化禀赋的国家的制度结构与基于整体型技术特征的组织结构相耦合,而具有个人主义文化禀赋的国家的制度结构与基于模块型技术特征的组织结构相耦合。

在国际市场竞争的压力下,战略互补性原则会导致各国自发形成与本国的文化禀赋相适应的分工组织,并在与该分工组织相匹配的特定产品上建立起本国企业的竞争优势。在国际贸易中,如果说基于要素禀赋的比较优势构成垂直分工的基础的话,那么对于要素禀赋相似的国家之间的水平分工来说,基于文化禀赋的组织竞争优势就构成了分工的重要基础。

笔者认为,要素禀赋主要影响企业的资源能力,而文化禀赋则更多地影响企业的组织能力。企业出于差异化战略的需要,可以在要素禀赋和技术水平相似的前提下设计出各种不同构造的产品,但只有当生产某类产品所要求的分工组织与企业的文化禀赋相匹配时,企业才能获得组织竞争力。换言之,某种特定结构的分工组织在组织能力上比其他结构的组织更适宜于生产某种特定构造的产品,而同时,组织的结构和能力在很大程度上又受到特定文化禀赋的影响。因此,如果在文化禀赋的支持下,一国的企业在特定分工组织的运作上拥有比他国更高的效率的

话，那么该国企业在参与国际分工时将选择那些能够发挥其组织竞争优势的产品进行专业化，这样就会自发形成产业内的贸易结构。此即由产品构造、组织结构和文化禀赋所共同决定的一国参与水平分工时的产品选择机制（参见图1）。

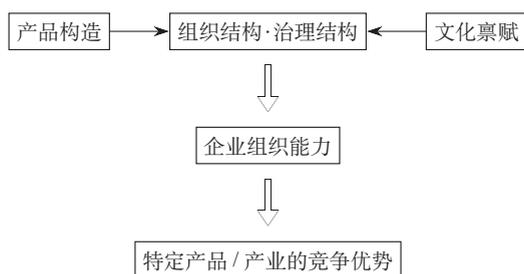


图1 国际水平分工中贸易结构的形成机制

与要素禀赋相比，文化禀赋具有更强的稳定性、异质性和难以模仿性，一旦生产者将文化禀赋的独特优势有机地融入与某种产品构造相适应的组织结构中，形成了独具风格的组织文化以至产业文化，即可能在该产业中建立起持久的竞争优势。

以上国际分工的结构形成机制是一个静态的分析框架。如果从动态的角度来考察贸易结构的演变机制，情况会变得更加复杂。由于技术进步和市场需求的变化，产品构造及其所对应的组织结构都不可能一成不变。产品构造原本就是建立在人类对自然和社会认识基础上的一种设计思想，它完全可以跟随需求变化和科技进步而不断加以革新（如行业标准的推广使越来越多的产品由整体型构造向模块型构造转变）。但产品构造的革新必须与分工组织的创新相辅相成、共同演进，因为两者之间存在着系统耦合关系。另一方面，在技术进步、市场压力和产品创新的影响下，组织也将通过学习和创新而发生变化（如信息技术的广泛运用使分工的协调成本下降，促使企业的组织结构朝着更加扁平化的方向演变）。但与产品创新相比，组织的创新往往更加缓慢，而且通常是沿着既有结构所规定的方向演变（Hannan, Polos and Carroll, 2002）。这是由于组织结构的演变受制于文化禀赋，后者作为人类社会的“遗传基因”，具有很强的自我复制功能。文化禀赋的稳定性使得组织结构的演进具有较强的路径依赖特征，并进而影响到产品创新的方式和方向。根据美国学者（Gulati and Eppinger, 1996）的研究，企业开发新产品时在产品构造上表现出的代际传承性，除了受资产专用性的影响以外，在很大程度上也是受到企业组织结构的情性的影响。

受文化禀赋稳定性的影响，一国在特定产业中的竞争优势往往具有持久性，除非受到重大的外部冲击，企业的技术创新和组织创新通常表现为既有产业中的进化型创新。该特征也可以

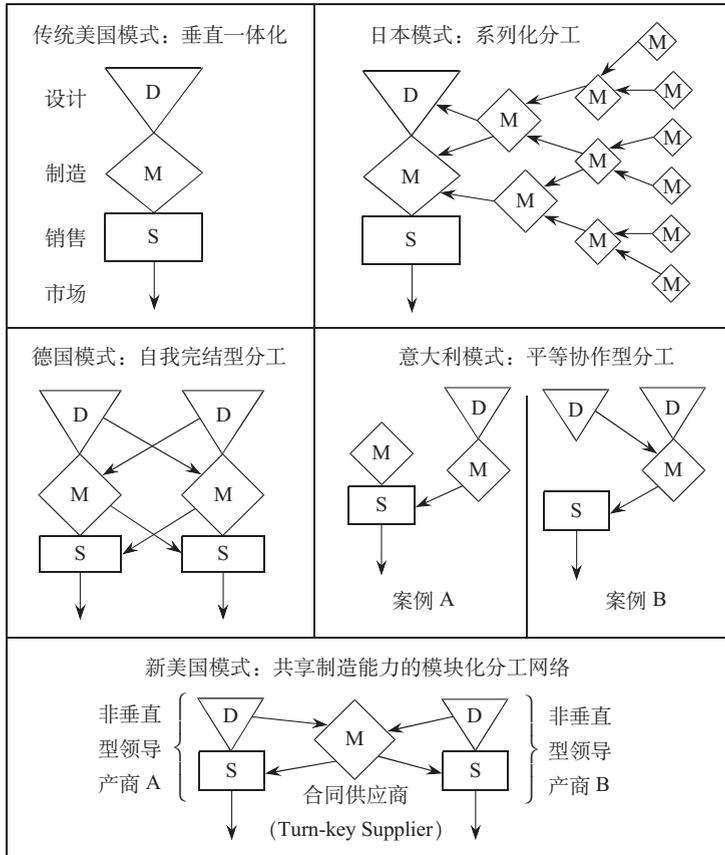
较好地解释如下现象：与垂直分工体系中各国的专业化水平和产业结构的较快变动相比，发达国家之间的水平分工体系总是显得更加稳定。英国学者 Redding (2002) 采用 7 个经合组织成员国 20 个制造业行业的数据，测度了 1970—1990 年这些国家的（贸易）专业化水平和产业分布结构的变化。结果发现它们的整体专业化水平并未上升；专业化的产业结构虽然有一定变化，但对于变化最大的国家日本来说，结构变动的主要原因来自于要素积累，即来源于资源禀赋的变化；其他国家专业化的结构模式变化不大，所发生的一些变化也主要来源于世界市场的价格变动和技术效率的改进。

不过，虽然文化禀赋具有较强的遗传性，但也很难说它是完全凝固的。从层次上看，国家（民族）层次的文化禀赋根深蒂固，但组织（企业）文化却较易发生变化。从结构上看，作为文化内核的价值观稳固性强，但作为文化表层结构的行为方式却具有较大的可塑性。在经济全球化时代，激烈的市场竞争会迫使企业有选择地学习和吸收他国高效的组织文化模式，在微观层次上诱发文化变革，进而使本国的文化禀赋在一定程度上发生诱致性变迁。

需要强调的是，文化禀赋还具有相对性（也称为价值中性）特征，即文化差异不能作为判断文化优劣的依据。任何一种文化，无论它具有多强的包容性和创造性，都不可能普遍适用于所有的产业组织，而只能在与它的禀赋相契合的个别产业中创造出竞争优势来。而且从动态角度看，这种竞争优势也是相对的。当技术和市场发生重大变化时，产业结构和分工组织也会相应发生大的调整，具有新兴产业的分工组织所要求的文化禀赋的国家/企业就可能在国际竞争中脱颖而出，取代过去在传统产业中领先的国家/企业的地位。这就是在文化禀赋影响下的国际产业分工调整机制。战后发达国家之间在一些支柱产业和新兴产业中发生的“三十年河东，三十年河西”的强弱易势现象，在很大程度上反映的正是这样一种机制。

在战后的经济发展过程中，受文化禀赋的影响，各国逐渐形成具有本国特色的分工组织结构（参见图 2），并在与之相适应的产业中建立起了本国的竞争优势（张捷，刘凤翔，2005）。例如，在单质文化的日本，深厚的集体主义文化传统使得建立在意会知识和关系型契约基础上的产业分工组织盛行（包括日本企业的团队作业方式和企业间的系列分工模式）。这种依靠文化惯例来降低协调成本的组织结构特别适宜于需要在上下游工序间保持紧密协作关系的整体型构造的产品，它使日本企业在汽车、机械、电子等产业中得以保持竞争优势。最近东京大学与日本经济产业省联合进行的一项实证研究表明，目前日本具有国际竞争力的产品仍然集中在具有高度整体型构造的组装类产业中（大鹿隆，藤本隆宏，2006）。而在移民国家美国，个人主义和多元文化导致意会知识的形成较为困难，为了尽量减少协调成本，美国制造业的产业组织往往强调专业化、标准化和更多地使用市场机制，分工单位之间职责分明，产品设计偏好模块

型构造，并形成了以“福特制”著称的大批量生产体制（Fujimoto, 2006）。20世纪80年代，日本和德国的崛起使美国制造业陷入严重的竞争力危机。在其后的产业结构调整中，美国把握住知识经济的大潮流，大力发展具有模块化构造的IT产业和服务业等新兴产业，并形成了一种新型的组织结构——共享制造能力的模块化分工网络，从而再度登上国际竞争力的榜首。



资料来源：Sturgeon, 2002（经作者改进）。

图2 制造业分工组织的典型国别模式

美国学者认为，美国之所以能够重拾竞争优势，一个基本原因是“美国的商业文化特别适应当今的挑战”。拙于传统制造业的美国企业在管理服务业工人和知识工人方面却比日本和德国更胜一筹。除了技术创新外，美国企业的强项在于赋予雇员较大的独立自主权并按业绩付酬。因此，“权力下放的网络商业时代就是美国时代”，“从制造业向服务业转变，全球化的飞跃发展以及信息技术的兴起，所有这些因素共同为美国创造了契机。”（塞巴斯蒂安，2006）可见，

崇尚独立性和多元化的移民文化与全球化时代信息产业及服务业发展的有效组织形式相耦合,是美国经济得以实现复兴的重要原因之一。

从更大的视野来看,文化禀赋是市场经济国家存在多样化的经济制度和产业结构的基础性因素。与要素禀赋相比,文化禀赋更加具恒久性和异质性,是推动一国实现产业创新的深层动力。可以说,国际竞争归根结底是一种文化竞争。在竞争压力下,虽然一国通过学习和吸收他国的优秀文化,可以使自身的文化禀赋得到一定程度的改造,并通过增强文化兼容性来适应技术和组织的变革。但由于文化所具有的继承性和相对性特征,一些西方学者提出的经济全球化终将导致各国的文化趋同,进而导致全球产业和生产组织向着某种单一模式收敛的观点,迄今尚未获得学术界的普遍认同和经验研究的有力支持(理查德·惠特利,2004)。

五、初步结论及其对中国的启示

本文在同时考虑产品构造和生产者文化禀赋对分工组织的影响的基础上,构建了一个解释国际水平分工条件下的产品选择机制的理论分析框架。概言之,产品的工程构造规定分工的组织结构,但分工组织的效率不仅取决于技术因素,还与生产者偏好即生产者的文化禀赋存在着紧密关联,如果一国的文化禀赋支持特定结构的分工组织,则该国的生产者将在与这种组织结构相对应的产品上形成竞争优势,专业化于该类产品。

需要说明的是,经济学和管理学对于组织结构的成因存在着多种解释,除了本文所分析的产品构造和文化禀赋外,要素禀赋、规模经济、企业战略乃至政策环境等因素都会影响组织结构的选择。本文虽然没有涉及这些因素,但并不意味着本文的理论框架排斥这些因素。笔者只是想强调:影响一国分工组织的技术、经济和管理等方面的因素,均不可能脱离该国的文化背景而发生作用;在构成一国产业竞争力的诸因素中,文化是一个不可忽略的重要因素。由于文化的相对性特征,任何经济发展水平到达一定阶段的国家,都有可能依据自身的文化禀赋在某些产业领域中建立起独特的竞争优势,关键是要正确认识本国的国情,形成一套与自己的要素禀赋及文化禀赋相耦合的分工组织与技术系统。

迄今为止,中国参与国际分工主要依赖于劳动力要素的优势。但初级要素的边际收益递减,资源、环境和贸易条件的恶化,迫使中国必须从垂直分工向水平分工的位置转移。那么,在产品构造和分工的组织形态上,中国产业的结构升级将遵循一条什么样的演化路径呢?

总体上看,中国的制造业正在由要素驱动阶段向投资驱动阶段过渡,越来越多的企业进入垂直专业化的国际生产体系,为跨国公司承担模块型产品的加工制造环节。这种分工形态一方

面是跨国公司将产业链中的低端环节转移到中国的结果，同时也与中国目前的比较优势和转型期的市场结构有关。在文化禀赋上，中国虽然素有集体主义的文化传统，但由于改革开放以来收入差距扩大和社会结构的剧烈变迁，导致集体主义文化逐渐式微。基于以上因素，中国的分工组织结构演化似乎正在趋近于重竞争轻协调的美国模式（参见图3）。作者认为，这一演化路径虽然有着现实合理性，但从长远来看对中国并不利。模块型的组织结构容易疏离外向型企业与本土企业之间的产业联系，难以在同一产业的企业之间建立起紧密的分工协作关系，并易导致过多的企业集中在下游制造环节进行价格竞争。更为重要的是，由于文化禀赋和制度结构的差异，大多数中国企业并不具备美国企业那种进行模块系统设计所必要的原创性和选择能力，因此在模块化的分工体系中很难攀升到领导者的地位，可能长期扮演替人“打工”的低端模块供应商的角色。中国企业要想创立自己的品牌和成为行业领导者，可能需要适当地转换路径，朝着更加一体化的产品构造和更加依赖协同文化的组织结构的方向演进。在这一方向上，中国具有进行组织创新所需的深厚土壤，只要政府坚持推进改革，真正转变职能，为企业营造一个自由、公正而有序的市场环境，企业就有可能选择长期策略，将自身的要素禀赋与文化禀赋的优势有机地结合起来，创造出具有中国特色的产业组织范式，在国际水平分工的网络中获得应有的地位。

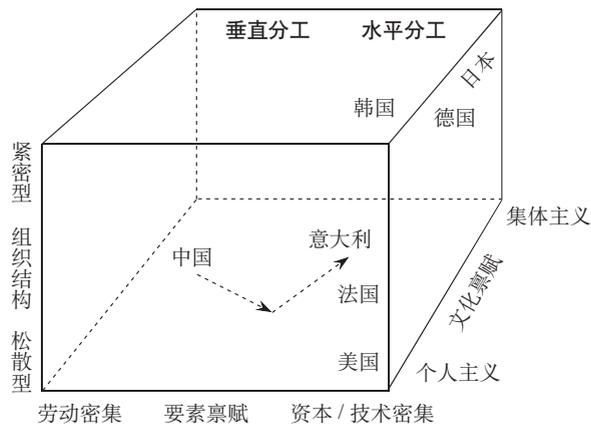


图3 中国制造业分工组织结构演化的可能路径

参考文献

- [1] Granovetter, M, 1985, “Economic Action and Social Structure : A Theory of Embeddedness”, American Journal of Sociology 91, pp. 481 - 510.
- [2] Greif, A. , 1994, “Cultural Beliefs and the Organization of Society : A Historical and Theo-

retical Reflection on Collectivist and Individualist Societies ,” *Journal of Political Economy* 102 , pp. 912 - 950.

[3] Gulati , R. K. and Eppinger , S. D. , 1996 , “ The Coupling of Product Architecture and Organizational Structure Decisions ” , Massachusetts Institute of Technology , Sloan School of Management , Working Paper 3906.

[4] Hannan , M. T. , Polos , L. and Carroll , G. R. , 2002 , “ Structural Inertia and Organizational Change Revisited I : Architecture , Culture , and Cascading Change ,” Stanford Graduate School of Business Trust , Research Paper 1732.

[5] Hofstede , G. , 1993 , “ Cultural Constraints in Management Theories ” , *Academy of Management Executive* 7 (1) , pp. 81 - 94.

[6] Redding , Stephen , 2002 , “ Specialization Dynamics ” , *Journal of International Economics* 58 , pp. 299 - 334.

[7] Sturgeon , T. , 2002 , “ Modular Production Networks : A New American Model of Industrial Organization ” , MIT IPC Working Paper 02 - 002.

[8] Takahiro , Fujimoto , 2006 , “ Architecture-based Comparative Advantage in Japan and Asia ” , Manufacturing Management Research Center , School of Economics , University of Tokyo , Discussion Paper No. 94.

[9] Ulrich , K. , 1995 , “ The Role of Product Architecture in the Manufacturing Firm ,” *Research Policy* 20 , pp. 419 - 440.

[10] van Oudenhoven , J. P. , 2001 , “ Do Organizations Reflect National Cultures ? A 10 - nation Study ” , *International Journal of Intercultural Relations* 25 , pp. 89 - 107.

[11] [日] 奥野正寛 , 渡辺泰典 (2006) コーディネーション・システムとしての製品アーキテクチャ RIETI Discussion Paper Series 06 - J - 007。

[12] [日] 大鹿隆 , 藤本隆宏 (2006) 製品アーキテクチャ論と国際貿易論の実証分析 RIETI Discussion Paper Series 06 - J - 015。

[13] [日] 今井賢一 , 伊丹敬之 (1981) 日本の企業と市場——市場原理と組織原理の相互浸透季刊現代経済夏季号 , 伊丹敬之等編 “日本の企業システム” 第4巻第1章 , 有斐閣 1993 年。

[14] [日] 青木昌彦 , 奥野正寛 (1996) 経済システムの比較制度分析東京大学出版会 , pp. 22 - 33。

[15] [日] 藤本隆宏, 延冈健太郎 (2004) 日本の得意産業とは何か: アーキテクチャと組織能力の相性, RIETI Discussion Paper 04 - J - 040。

[16] [法] 埃米尔·涂尔干, 《社会分工论》, 北京: 生活·读书·新知 三联书店, 2000, 第 232 - 239 页。

[17] 海闻, P. 林德特, 王新奎, 《国际贸易》, 上海: 上海人民出版社, 2003, 第 178 页。

[18] [美] 杰克·J. 弗罗门, 《经济演化——探究新制度经济学的理论基础》, 北京: 经济科学出版社, 2003, 第 77 页。

[19] 鞠建东, 林毅夫, 王勇, “要素禀赋、专业化分工、贸易的理论与实证: 与杨小凯、张永生商榷”, 《北大中国经济研究中心讨论稿系列》2003 年 12 月。

[20] [英] 理查德·惠特利, 《多样化的资本主义——社会制度的构建与商业体制的变迁》, 北京: 新华出版社, 2004, 第 174 - 203 页。

[21] [美] 迈克尔·波特, 《竞争论》, 中信出版社, 2003, 第 160 - 164 页。

[22] [美] 迈克尔·德托佐斯等, 《美国制造——如何从渐次衰落到重振雄风》, 北京: 科学技术文献出版社, 1998。

[23] [日] 青木昌彦, 《比较制度分析》, 上海: 上海远东出版社, 2001。

[24] [日] 青木昌彦, 安藤晴彦, 《模块时代: 新产业结构的本质》, 上海: 上海远东出版社, 2003。

[25] [英] 琼·伍德沃德, 《工业组织: 理论与实践》, 奥克斯福德大学出版社, 1965 年, 第 69 - 70 页。转引自弗莱蒙特·E. 卡斯特等: 《组织与管理: 系统方法和权变方法》, 北京: 中国社会科学出版社, 2000, 第 263 - 265 页。

[26] [美] 塞巴斯蒂安·马拉比, “为何美国企业正在赢得胜利”, 原载《华盛顿邮报》2006 年 3 月 27 日, 转引自《参考消息》2006 年 3 月 29 日。

[27] [美] 斯科特·E. 马斯腾主编, 《契约和组织案例研究》, 北京: 中国人民大学出版社, 2005, 第 209 - 225 页。

[28] [澳] 杨小凯, 黄有光, 《专业化与经济组织》, 北京: 经济科学出版社, 1999, 第 340 - 364 页。

[29] [澳] 杨小凯, 张永生, “新贸易理论、比较利益理论及其经验研究的新成果: 文献综述”, 《经济学季刊》2001 年第 1 期, 第 19 - 44 页。

[30] 张捷, 刘凤翔, “产品构造、文化禀赋与制造业的产业内国际分工”, 载郭重庆, 刘人怀主编, 《中国制造业企业国际化战略》, 广州: 暨南大学出版社, 2005, 第 338 - 367 页。

Product Architecture , Cultural Endowment ,
and Organization of Division of Labor

Zhang Jie

(School of Economics , Jinan University)

Abstract : Based on an expansion of the theory of division of labor , this paper intended to tackle the issue of trade structure in international horizontal specialization so as to shed light on the mechanism of product choice and supplement the endogenous theories of trade. By considering the effects of both product architecture and producer s cultural endowment on the organization of division of labor , the author has modeled a framework to account for the mechanism of product choice in the pattern of horizontal specialization. According to this framework , the optimal structure of the organization of division of labor is technically determined by product architecture , while its selection and evolution will be affected by producer s cultural endowment. If the cultural endowment of a nation is fit for a given organizational structure of labor division , this nation will obtain competitive advantages in products fit for this structure of organization , and specialize in producing these products. Compared with factor endowment , cultural endowment reveals a stronger feature of stability and uniqueness and thus guarantees more sustainable competitive advantages. Furthermore , relativity of cultural endowment ensures all nations at a close level of development attain competitive advantages in industries fitting their national cultural endowment.

Key Words : Product Architecture ; Cultural Endowment ; Division of Labor

JEL Classification : F14 , D20 , Z10

民主集中制下的主流观念与政策变迁的政治经济学

赵德余*

摘要：本文在研究民主集中制的性质与“政策人”假说的基础上，提出了两个重要的模型与命题。第一个命题是：政府领导决策层的主流观念决定了经济政策的目标与具体政策安排，但是，政策目标能否实现则取决于特定政策环境下治理机制的效率特征。我们将政府的主流观念定义为政府决策层绝大部分成员赞成或共享的价值观、效率认知以及相应的思想理论，实际上也就是政府的政策理念这一信念决定了政策的具体或实际安排。对这一命题的讨论分为两部分，首先是一个政党或政府或社会各阶层（公众）实际上在多大程度上持有什么样的价值观、正义观或信念，以及这种正义观又在多大程度上决定了政府的政策与社会制度的选择。其次，经济理论以其最简洁、最本质的思考方式与结论对政策决策层乃至社会公众的思维判断产生了深刻的影响。第二个命题是关于经济政策变迁的动态政治经济学，即：经济政策变迁过程的实质就是伴随着主流观念的变迁，政策不断搜索和调整，直至政府主流观念和社会主流观念相一致，并成为相关产业利益集团、社会公众以及政府合作博弈的共同信念，从而政策与治理机制才会最终演化成稳定的社会经济制度。

关键词：民主集中制；制度演化；政治经济学

一、引言

民主集中制作为共产党和政府的组织原则，既是党和政府制定政策及各类制度的规则，也是各类政策及制度得以实施和执行的保证。民主集中制已经被写入中共党章，并载入宪法之中，同时具有党纪和国家法律的地位，邓小平就曾指出：“民主集中制是党和国家的最根本的制度，”坚持和完善这一制度是关系我们党和国家命运的事情。民主集中制的最主要的体现是在政府政策的决策中，各种社会利益和要求都能够得到充分的体现。一个国家的民主的程度，最

* 赵德余，上海市复旦大学社会发展与公共政策学院；邮编，200433。E-Mail：deyuzhao@163.com。本项研究成果受到复旦大学亚洲研究中心资助。本文于2006年10月在杭州浙江大学经济学院召开的“中国新政治经济学论坛”上宣读讨论过，作者感谢浙江大学经济学院曹正汉教授对本文给予的评论和修改建议；同时，感谢上海交通大学管理学院顾海英教授、史清华教授在作者论文写作过程中给予的指导和帮助。

终是看其政府的公共政策，即政府向社会所提供的公共产品和服务，是否均衡合理地体现了有关阶层和群体的利益。如果在塑造政策过程中公民的意见和观点没有任何影响，有关阶层的利益在政策结果中得不到体现，如果普通公民的要求和愿望与政策结果没有任何关联，无论一个国家政治生活的其他方面看起来是多么民主，都只能是一个美丽的形式和装饰（赵成根，2000，第46页）。所以，研究民主集中制与政策决策的关系，发展一种以政策决策和政策变迁为核心的政治经济理论，是政治经济学研究的一个十分重要的视角和理论使命。

识别影响和决定政策变迁的变量因子（因素）对于政策研究来说至关重要。通常被人们（文献）提及和关注到的变量主要有：价值观（信念系统）、利益集团、政治周期环境（换届）、大众传媒和国民情绪、政治成本收益结构（财政预算约束）、寻租、外部冲击因素、异质（重大）事件、资源特性等等。其中，利益集团、政治成本收益结构、寻租以及外部冲击和不确定性等因素在制度变迁和公共选择经济学理论模型中会得到重点分析；而信念系统、政治周期环境（换届）、大众传媒和国民情绪、外部冲击因素、异质事件以及利益集团和寻租行为等绝大多数变量都是政治学和公共政策过程理论考察的对象。无论是经济学还是政治学，都对政策设计的理论基础（模型）本身对政策变迁过程的影响重视不够。在长期的经济变迁史中，理论模式本身就是一个解释政策变迁的重要变量。

解释政策变迁的经济理论常常忽视了价值观或信念的作用。虽然一些经济学家如 North 等已经意识到“意识形态及意识形态的变化在长期变迁中起着极为重要的作用”，甚至在经济政策的经验研究中也出现一些反映意识形态的变量，但是真正将意识形态纳入正式的政策变迁理论分析中去的研究工作还是很少。解释政策变迁的政治学或政治社会学理论涉及了意识形态以及政治周期环境、国民情绪、外部冲击因素、异质事件以及利益集团等影响变量，但是其缺陷在于：一是缺乏严谨的概念基础和个体行为模型，对各种影响因子在决定政策变迁的重要性程度方面的差异难以识别和确定；二是对政策变迁的后果，即政策约束下人类行为进行的政治分析，与经济学尤其是制度经济理论对人类行为的分析相比，缺乏解释力和预测力。政治学、社会学以及历史学在解释制度和政策变迁史中意识形态的作用时也面临同样的问题，过于强调特定人物的性格与社会文化因素的影响，而忽视了人类行为的模型构建和对政策（制度）本身的分析^①。现

^① 社会科学家不可避免地陷入价值问题之中，在政治科学领域尤其如此。因为，首先，“在政治科学一词的确切意义上，政治科学是一门政策科学。政治科学主要关心的是目标及实现目标的手段——政策，政治科学必须涉及政策，而政策必定涉及价值。”其次，“价值概念（如态度、意见和意识形态等）对政治科学的重要性。没有一位政治学家会否认价值在他的研究中所占的地位。政治学的绝大部分与政治活动者的价值观有联系，因此，政治学家必须研究价值。”（Alan C. Isaak, 1981/1987, p. 68）

有研究文献的另一个不足之处在于政策分析的正式模型都是建立在立宪民主与竞争性投票规则的基础之上的，但对中国政策过程之政治制度基础的民主集中制规则却避而不谈，这显然是现行政策研究的内在缺陷。

本文试图将政策变迁的经济学模型与政治学模型的基本要素综合起来，以建立在严谨的个人选择行为模式基础之上，并将意识形态（价值观、信仰）和思想理论模式等概念纳入到正式的经济分析之中，从而建立一个完整的解释民主集中制下政策变迁过程的政治经济学分析框架。在本文的分析框架中，我们将信念系统（价值观或意识形态）和思想理论模式作为最重要的两个维度来考察，由于价值观和思想理论模式之间存在的紧密关系，我们将这两者合并为一个变量，定义为主流观念，并试图以此解释长期的政策变迁过程。当然，在主流观念的政治经济学框架中，上述提到的所有变量（价值观、利益集团、政治周期环境、大众传媒和国民情绪、政治成本收益结构、寻租、外部冲击因素、异质事件、资源特性等）都以不同的方式被整合到模型或框架之中。因此，本文试图发展的解释性分析框架是和经济学中的制度变迁、公共选择理论以及政治学中的政策过程理论，甚至某些形式的意识形态理论相容的。

二、“政策人”假说与民主集中制的经济性质

（一）二分法与“政策人”假说

为了构建民主集中制下政策过程的分析模型，我们将政策过程中的人分为两类：一类是从事政策决策的人，称之为“政策人”，即中央的政策决策领导层成员；而在一定政策环境或约束之下的厂商与消费者仍然称为经济人。两类人的共同之处都是追求效用最大化，但两者最大的区别在于：经济人只是在一定目标导向下行动，追求给定目标下的效用极大化行为，目标本身是外生给定且不变的；但是，“政策人”则具有明显的目的性，且目的是受环境影响而不断改变的。政策人必须能够识别问题以及问题的性质或严重程度，据此确定政策的目标结构，并且对政策目标进行优先序排列，即政策人具有一定的信念系统或价值观偏好。我们假说的政策人仍然是经济人，只不过是有所目的的经济人。除了目的性的差异之外，政策人同样具有一定的理性程度和策略性动机，而且还面临信息和知识的不完备、不对称以及外部环境的不确定性问题。与经济人有限的信息处理能力一样，政策人的目的性或信念系统（价值观）影响着决策者对各种信息的获取、使用和整合。信念系统或决策者的目的性可能充当信息过滤器的作用，决策者可以阻止或者拒绝那些挑战他们核心价值（目的、信念）的信息，并且轻而易举地整合那些具有支持作用的信息。进一步说，从说服他人改正其个人立场到维持决策层成员的团结一致，

信息可能以各种各样的方式得以使用。

本文建立了两分法的行为人假设模型,即政策人-经济人假说。将政策人定义为有目的的经济人,并以此作为社会主义民主集中制下政策决策层的个体行为模型基础,从而可以使得个体主义和整体主义、规范分析和实证分析以及理论分析和经验研究等诸多方法很好地综合起来。我们将政策变迁领域的决策行为者从经济人中分离独立开来,并强化其目的性,作为本文政策决策研究的行为基础。不过,政策人的出现并不能取代“经济人”在经济分析中的地位,一方面,政策人本身也仍然是经济人;另一方面,在政策决策之外的领域,经济人假说还是广泛适用的,尤其是对政策环境约束下的企业和人的行为分析则是必需的。对政策人的行为本身的研究毫无疑问与经济学对人的目的性、理性、动机、知识信息以及外部环境状况的假定等密切相关。将人的各个方面区别开来,并不意味着精神分裂的假定。各个方面可能是不同的,但它们既不是独立的,也不是完全隔绝的,它们同样属于人类的活动(Horvat, 2001)。

(二) 民主集中制的实证性质

民主集中制的最本质的规定性是什么呢?王贵秀认为就是作为根本组织原则的“少数服从多数”。因为只有“少数服从多数”作为内在基础才能使民主集中制成为真正意义上的、名副其实的民主集中制,而不是别的什么东西,从而也才能使它从根本上与专制集中制、无政府主义区别开来。这主要体现在两个方面:第一,就领导机构和领导人的产生来说,只有在实行民主选举的条件下,按照少数服从多数的原则作出选择,才能说实行了民主集中制。第二,就重大问题(如政策的设计)的决定、决议和决策来说,只有通过集体讨论,按照少数服从多数的原则制定,才能说实行了民主集中制(王贵秀,1995,第139页)。而民主集中制的其他三个原则,如“个人服从组织”、“下级服从上级”、“全党服从中央”,具有明显的规范性质,而且也是由“少数服从多数”的原则决定和制约的。以下,我们用经验实证的方法重新检验民主集中制的规范性内容及其经验上的含义。

1. “个人服从组织”一方面假设了个人是服从型的,如果个人在表决时反对由“少数服从多数”(多数投票)规则决定所形成的政策方案,或者说少数或个人的利益在多数规则形成的政策下受到损害,个人是否应该服从政策规定下的行为规范?或者说,少数受害的个人在实际行动中是否真的会严格遵守组织制定的规则?这又是一个实证问题。该问题既取决于个人的动机,又取决于组织政策方案的约束、监督与惩罚机制,还涉及组织意识形态对个体行为的内化程度等。另一方面,如果组织的规模(N)过于庞大,个体数目众多,西方民主社会公众投票率过低的问题在组织集体行动或政策决策过程中也会出现,这个问题在组织内

(如领导人选举)将体现为个体参与(投票、发表意见等)积极性可能很差。随着组织规模(N)的增大,公众或党组织成员会倾向认为无论政策会最优还是恶化,他们的政治参与贡献都将于事无补,无法影响和改变最终的政策格局。根据Olson(1965)的观点,一个理性的个人会倾向于把参与政治(投票和政策偏好评论)活动的边际收益视为零,但公众个体参与政治活动的成本却是不菲的,如实际参与党组织和政府政策意见提出所需的时间,参与组织与政策活动相关的资金开支负担(如路费等开支)、信息成本,包括收集参与政治活动所需要的信息(例如不同的观点以及影响的概率)的成本(时间和金钱),这些成本是很容易被公众所清楚地意识到的,而且上述成本的总和总会大于零。社会公众和组织成员对政策(或领导候选人)的偏好信息对于制定政策方案至关重要,如何获取和揭示公众或组织成员对政策问题的真实的个人信息就不仅是一个理论问题,而且也是一个政策实践问题。

2. “下级服从上级”隐含的假设是下级的利益和上级的利益是强烈一致和激励相容的,而且下级作为一个组织的行为动机也是服从型的,同时,作为组织,下级对一个特定目标的执行能力被视为与一个个体的人一样是有效率的。其规范的含义是下级(或党委、常委会)政府制定的政策与决议不得与上级的政策相违背或相抵触,同时下级政府应当提供上级政府决策所需要的有关信息。但是,对于“下级服从上级”,当在下级(党组织与地方政府)与上级之间存在激励不相容时,下级也有可能缺乏提供政策信息的激励,甚至还会提供虚假信息,造成上级政策决策的信息扭曲。例如在以政绩作为考核和提拔干部的标尺时,地方基层管理干部就会倾向于追求“政绩”最大化,在这一目标函数下,凡是对于显示其“政绩”不利的信息,比如该地方资源环境保护失职的信息、农民“闹事”反映不满的信息、社会治安秩序差的信息都难以被揭示,更没有激励主动向上级汇报。当存在多层代理时,党的组织与政府层级结构中的信息扭曲与代理问题是否存在差异?作为政党,各级组织从地方到中央自身是否有独立利益追求还不太清楚。但是,随着中央政府和地方政府的财政与行政分权,地方政府作为一个独立的利益主体地位日益加强,地方政府官员与领导追求“政绩”最大化的行为动机也已经十分明显。这种情形下,下级政府服从上级政府的民主集中制原则实际只是确立了上级与下级之间的一种委托代理关系^①。这种代理关系意味着上级政府与下级政府拥有不同种类和数量的信息。在多数情况下,这种信息不对称是不可避免的,虽然上级政府

^① 虽然根据宪法,各级政府同本级的人民代表大会之间也存在类似的代理关系,但是在实践中,上级政府与下级之间的委托代理关系更为重要,尤其考虑到上级政府有选择确定下级政府的领导人选的能力时更是如此。

不需要，也不想要下级政府机构掌握的全部信息。但更为关键的问题是上级政府是否了解自己需要什么信息以及是否能够及时获得这些信息。由于信息不对称，作为委托人的上级政府和作为代理的下级政府之间的隐性合约中，存在严重的逆向选择和道德风险问题。

3. “全党（或各地方政府）服从中央（党或政府）”原则隐含的假设也是十分明显的，即各地方之间的利益不存在冲突，或者存在冲突也可以或已经在多数规则下形成的中央政策决议中得到化解（利益补偿机制），而且各地方和中央的利益是一致的、激励相容的。同时，各地方组织的行为能力类似于一个人的情形，自身不存在代理或激励问题。全党或各地方政府服从党中央或中央政府与下级服从上级在原则上是一致的，只是这一原则更强调突出中央政府的地位。但是，不同之处在于各地方党委或地方政府之间可能存在利益的不一致性或竞争性问题，这一点尤其适用于地方政府层面。从宪法规定的授权合法性来看，地方政府由地方人民代表大会选举产生，而地方代表大会的代表由当地公众直接或间接选举产生，所以，地方政府有义务为当地社会公众谋福利。考虑到地方政府的主要领导人实际上一般是由上级政府任命的，以及地方服从中央的原则，可能在一定程度上有助于抑制地方领导人过分追求保护地方利益却有损全国或其他地方的政策行为。不过，也不能高估这种抑制作用，地方之间的利益冲突与竞争事实上不仅反映在实际的国家政策决策过程中，更体现在各地方自主实施政策法规上。这一点可以从各地方保护主义和市场封锁以及“跑部钱进”等种种现象中得到某种证实。在中国的民主集中制下，虽然不存在立法市场的投票竞争，但是，各地方政府在争取中央政府的政策倾斜、“优惠”以及公共工程项目等方面的竞争也是十分普遍的，所谓“跑部钱进”、“驻京公关”也说明了政策决策需要考虑不同地方、不同利益集团的影响。

作为组织原则的“四个服从”并没有揭示出民主集中制的政府政策行为的本质特征以及决策与制定的政治过程。事实上，任何民主制度下政策决策都要面临三个问题：

（1）社会公众个体缺乏显示政策偏好信息的激励问题；（2）地方政府或利益集团存在隐藏信息或扭曲信息以及道德风险问题；（3）各不同地方政府或不同利益集团之间存在利益分歧（冲突），如何加总和折中不同利益集团的政策偏好，以形成政策方案的问题。

尽管不同程度地存在以上问题，但是由于民主集中制的组织原则的存在，党的中央组织和中央政府在制定和实施经济政策方面毕竟还是具有相当大的权威。综上所述，民主集中制下的政策逻辑有两个特征，即决策者的意见一致（多数同意）与议行合一，以及政策的决策与执行的统一，这两个特征决定决策者的政策观念（或价值观与思想理论）或主流观念对政策的决策与制定起了根本决定性作用。

三、民主集中制下的政策决策与主流观念：一个静态简化模型

民主意味着人人有权平等地实现自己的权利，这是民主的题中应有之义。在立宪民主下，公众通过投票选举能够代为自己的政策意愿的代表（议员），并通过代议制或政治市场的竞争决定政策的供给。而在社会主义民主集中制下，公众通过 Voice 或者产业利益集团的政治活动，或者参与决策者的政策调研活动等方式将自己的利益偏好信息传达给中央政策决策层，而政策决策层则通过达成一致观念或“少数服从多数”来确定政策目标与方案。在现实生活中人们处于不同的地位，不同的公众或利益群体之间既有长远的共同利益，又存在利益的差别和冲突。如果根据全体一致原则，每个人虽都可以充分表达自己的利益要求或政策意愿，但却很难达成一致同意的政策方案，以满足 Pareto 有效标准。如果依据多数同意原则，那么如何才能形成一种人们广泛接受的多数规则下达成的政策方案呢？在缺乏投票竞争和代议制下的政治立法市场的情形下，民主集中制显然就是一种可替代的规则。在决策者群体或委员会内实现简单多数规则，即“少数服从多数”来确定政策方案，但方案的提出与形成则由专门的政策研究部门提出，并在决策委员会内讨论以形成一种共识即集体理性，或主流观念。政府的主流观念在很大程度上决定了政府政策的目标与依据。

现在，关键的问题是在民主集中制下政府的主流观念是如何形成的？以及利益集团或产业部门和社会公众个人的政策偏好信息是如何在政府的主流观念中得到反映的？换句话说，是否以及如何影响政府的主流观念？我们首先界定主流观念的含义，然后描述本文构建的政策决定之主流观念模型的结构。

（一）主流观念内涵的界定

本文将主流观念视为政治文化的一部分，广义的政治文化可以包括政治系统内国民的心理、认知、情感以及习俗、道德伦理、社会规范甚至正式法律制度。如 Almond（1956）将政治文化定义为每个政治系统包含的特定模式的政治行为取向。Pye 等（1965）也认为政治是政治体系是一种有秩序的、主观性的领域，它构成政体的内容、机构的规范以及个人行为之间的社会联系。同时，Pye 还对政治文化在对象规定上给出两个标准：首先，并非人们所有的政治态度和情感都可以归于政治文化，只有那些经常地、明显地影响基本政治发展的态度和情感，才属于这个范畴；其次，有许多非政治性的信念，比如对人际关系的基本信任感，对时间和进步的可能性的行为取向等，它们深刻地影响到政治发展，也属于这个范畴。

不过,我们将在狭义的概念上使用“政治文化”,把“政治文化”理解为一个特定的群体共享的价值观、效率认识以及相应的思想理论^①。为了区别于广义的政治文化,本文将狭义的“政治文化”称之为主流观念。根据特定群体的不同可以区分两类不同主体的主流观念:一类是政府决策(领导)层的主流观念,本文还将在更为具体的某一项政策的决策与实施背景下讨论政府的主流观念,即政府决策层绝大部分成员赞成或共享的价值观、效率认知以及相应的思想理论,实际上也就是政府的政策理念决定了政策的具体或实际安排。另一类是社会主流观念,即除了政府决策领导之外,社会各阶层的利益集团和社会公众流行的或大部分人赞同认可或共享的价值观、效率认识以及相应的思想理论。用 Kingdon (1997) 的多源流术语来说,社会主流观念可以理解为国民(公众)情绪,即某一既定国家中的相当数目的个体都倾向于沿着共同的方向思考,并且这种情绪会随着时间的变化而改变。意识到公众情绪(观念)变化(可以通过媒体或民意调查方式获得)的政府通常会采取一些措施(如政策的边际调整)以淡化对公众观念不利的他人(或其他利益集团)的希望来作出反应。显然,对某一政策,政府主流观念和社会主流观念相一致时,就意味着政府的该项政策能够获得社会大部分公众的支持,并且可能与大部分公众的利益应当一致,但又不必然相一致。只有当社会主流观念主要受利益集团和公众的效率认知支配时,即大部分利益集团和公众确信某一项政策或政治行为符合自身利益且这一确信是正确的时候,在与社会主流观念相一致的政府主流观念支配下的经济政策才是真正符合社会大部分人利益的。否则,如果社会主流观念主要是受狂热的价值观(或信仰)或错误的效率认识支配,即使政府的主流观念或政策理念得到社会大部分公众与利益集团的支配,也不一定给社会带来经济福利的增加(如社会主义运动高潮时期的经济政策及西方的早期的经济管制与国有化就是例证)。

与主流观念相对应的概念是非主流观念或边缘观念。类似的,也有政府边缘观念和社会边缘观念之分,前者是指在政府领导决策层中不占多数的对政策决策与实施不产生决定性影响的一部分人持有的价值观、效率认知以及相应的思想理论。后者则是指在社会中非主流或非多数、非流行的价值观、效率认知以及相应的思想理论。值得注意的是持有的非主流或边缘观念的人可能与持主流观念的人存在几种不同情形的差异:一是两者持有共同的价值观,但两者对效率认知存在分歧;另一种情形是两者持有相同的效率认识,但持有不同的价值

^① Sabatier (1988, p. 139) 将信念系统视为一整套基本价值、因果假设和问题认知。其中的因果假设即类似于这里的思想理论,而问题认识和“政治文化”中的效率认知相对应。信念系统(而不是情境的特点)决定着个体的选择和行为。在信念的基础上,个体采取行动并结成联盟,进而力图在公共政策中实现这些信念(Sabatier, 2004, p. 331)。

观；还有一种情形是两者不仅对价值观，而且对效率认知及其思想理论都存在分歧。

从内容来看，主流观念主要包括三方面的基本要素：

1. 信仰或价值观

价值观是个人偏好的一部分，即个人对好坏、善恶、正义与非正义的判断标准，它影响个人对不同目标的评价和排序，故价值观引导人们优先追求某些特定的价值目标（曹正汉，2002）。由于价值观涉及价值的判断，是关于作出这些判断的人的意向状态的陈述，它们一般不能被证伪，即不是用“真实的”这一尺度作为衡量价值判断的标准，而是用“公正的”或“正义”、“对的”这些理由为价值判断作辩护。

但是，价值观不仅是个人的，也是社会的或团体的（如政党或政府）；价值是主观的，但也是客观的，因为它能满足确定（团体）的人类的需要，其客观性就是由个人的需要和意志的一致性组成。客观化的价值成为一个团体或政党的行为准则，并以这种资格成为对这一团体中个人行为的要求。评价是主观的，但有效性是客观的。也许描述这种现象的更合适的方法是把它表示为公认的。一个价值判断的公认有效性符合一个实证判断的客观有效性。（Horvat，2001，p. 268）。所以，政治哲学伦理学发展了各种正义或价值理论，既具有规范性，也可以具有实证性质。当评判一个政府或社会应当持有什么样的正义理论，以及基于什么样的正义理论建立的社会制度将会充分满足社会大部分公众的需要，或者说什么样的正义理论和社会制度是最理想最合意的，这样的命题显然具有更多的规范性。但是，如果我们关心的重点在于判断一个政党或政府或社会各阶层（公众）实际上在多大程度上持有什么样的价值观、正义观或信念，以及这种正义观又在大多程度上决定了政府的政策与社会制度的选择，这样的问题就有更强的客观实证性了，尽管我们不可能完全排除价值判断在其中分析的影响，但却可以将这种判断降到最低限度。Mannheim（2002）倾向于采用一种经验说明的方法，强调需要新的学科来揭示认识现象和社会现象之间的因果联系，提醒人们要反对满足于对各种意思之间的和谐作出解释性说明的倾向。卢卡奇认为理论化是对社会世界进行实践干预的必要组成部分，通过在一个复杂总体中揭示阻碍社会发展的物化的基础和功能，就能消灭这些物化，有助于构建注定要推动进一步发展的社会角色，从而对下一个步骤起促进作用（Mannheim，2002）。

公共政策的正义性或价值观意味着两层含义：一是什么样的政策目标必须或应当值得优先考虑，即对政策目标结构进行优先序排列；二是不同的正义理论确定了对特定价值目标进行优先考虑的正当性或规范意义上的（合理）公正性。在具体问题中，价值目标除了上述重点讨论的收入与分配目标之外，还有安全目标也是经常列入政策的价值讨论之中的。安全通常涉及公

共社会安全、产品供给安全以及社会经济稳定性安全等。当特定程度的安全目标得到优先考虑时，效率目标可能会与安全问题存在冲突，这样就必须要以一定的效率损失为代价，才能保障一定水平的安全目标。

2. 思想理论

经济理论以其最简洁、最本质的思考方式与结论对政策决策层乃至社会公众的思维判断产生了深刻的影响^①。如美国在学术上最没有经过训练的议员至少都会觉察到凯恩斯主义的政策处方，尽管他们并不了解其理论基础。凯恩斯的思想，特别是在20世纪40—60年代，渗入到了美国和其他地方的大多数知识机构。实际上，这些都是由于凯恩斯的思想被较早地引入了一本自马歇尔的《经济学原理》以来当代最成功的教科书^②：保罗·萨缪尔森的《经济学》（1948年第1版）。经济思想理论在多个方面影响了经济政策的制定，一是经济政策的目标设定，政策目标不仅受价值观与信念的决定，而且也受思想理论的影响，经济（思想）理论可以检验政策目标的可行性及其实现代价；二是经济政策具体方案的设计必须以一定经济思想理论作为指导，如保护贸易政策与自由贸易政策就分别受不同的经济理论指导，前者通常是与中心—外围学说、累积依附不发达以及快速工业化等国家干预学说联系在一起的，而后者则与新古典经济学密切相关；三是对政策方案实施的效率认知与评价也受经济思想理论的影响和制约。Schultz（1968）强调，政策分析在一种相互作用过程中的作用，是指出一种“效率目标”，效率可能不是惟一的公共利益，但它肯定被广泛看做良好政策普遍有的一种特点（Nelson and Winter, 1982, p. 414）。对社会经济政策或制度运行的效率认知可能既不同于社会公众，也不同于社会经济研究者。但是，显然社会公众对效率的感知和认知是十分重要的，公众的不满或满意状况可以通过Hirschman的“退出”、“呼吁”机制对政策决策者产生压力和影响，如不利的经济政策、社会与企业绩效普遍下滑引起的工人罢工、社会游行与骚乱等。专业的社会科学研究者如经济学家对经济政策与经济效率的研究成果或认知对社会的主流观念会产生重大影响，经济科学界的研究既影响了经济政策决策者的思想，又影响或引导社会公众的观念。正如Ruttan所声称的，社会科学知识有助于增加制度的供给，降低制度的运行成本。又如新制度经

^① Wiles 区别了思想意识和方法论，他认为思想意识是指总的、一致的世界观。人们能强烈地感受到它的存在，它不易改变。当思想意识所依据的神圣命题与实际情况相悖时，就会产生一种特殊的方法论，使神圣命题得以继续存在下去（艾克纳，1990，p. 11）。

^② 所有这一切不应该暗示着凯恩斯主义经济学分析没有被修正、精练、重塑和诬蔑。正如将在19章中详述的，特别是20世纪70年代和80年代早期，货币主义作为一种对凯恩斯主义世界观的本质的和重大的挑战而出现了。（R. B. Ekelund and R. F. Hebert, 《经济理论和方法史》，第401页）

经济学揭示了价格制度的有效性必须有供给方和需求方各自出于自身利益的讨价还价，以及在价格信息透明且能迅速沟通条件下进行的竞争。若上述条件不能得到满足，那么，理想的价格制度的效率就不可能实现。茅于軾（1998）总结计划经济的灾难性试验时指出：“如果50年前我们对制度的经济理论知识能达到今天的水平，计划经济的那场灾难或许是可以避免的。”

20世纪以来，人们深刻地认识到了经济思想（理论）的力量。如Stiglitz（1998）所指出：“对经济体制持不同信仰的人们都坚持认为自己的理论可以带来更幸福的生活，这些信仰对它的信徒行为的支配力量并不亚于宗教信仰，这些宗教信仰曾激励它的信徒在欧洲宗教改革余波未尽的宗教战场上为实现其最终拯救世界的誓言而英勇奋战。”各种思想理论通常是以一种特定的模型形式存在的，就像经济思想理论中影响广泛而深刻的马克思主义经济学、新古典经济学以及制度经济学模型一样。在马克思经济学指导下的国家里，伴随经济发展的过程中形成了许多共同的信念（如平等、计划）与政策目标，如重工业化、基本生产资料的公有化和强迫性的高储蓄率等。而新古典经济学则是以市场经济有一种自我调节的机制为基础的，这种观念认为除了最低限度以外，政府对经济的任何干预都是不必要的。但是，制度经济学一反新古典经济学最小政府的主张，认为不是弱化政府的功能，而是要重新定义政府的功能，尤其是在转轨经济中，政府制定经济政策的作用更是至关重要的。多样化的经济思想理论扩大了可行的可供选择的经济政策的集合边界，过于迷信某一种经济思想（理论）显然会大大限制政策方案的设计与选择空间。

（二）政策决策之主流观念模型的结构描述

为了发现规律和因果关系，必须简化世界。为了这个目的，我们建立了模型。在一个模型（如立宪民主制）里是真实的东西，在另一个模型（社会主义）里并不一定就是真实的。具有基本相似性质的一类模型组织一个范式，范式是我们对世界的基本观察。我们把民主集中制下的政策决策过程简化为以下模型^①：“领导决策层——多元利益集团（产业部门）——公众个体”。

^① 刻画这样一个分析性模型，我们运用的是理论实证的方法，但是，考虑到价值观问题，又不可避免地掺杂了规范的逻辑。正如Alan C. Isaak所言：“工具性的或应用性的价值标准常常与规范的价值标准相混淆。然而，它们有一种基本的区别，即工具性的标准体现的只是达到特定目的的最佳方法，而并不是证明目的本身。这就是交换符号的手段和目的的分析的意义所在。因此，工具性的标准是一种科学与经验的活动，因为它在实际中是用来解释为什么某些条件或行动会导致所期望的目的的实现。但是，一旦认识到政治哲学家把规范的和工具性的标准放到一起使用，混淆也就不难理解了，即：他们既指出了最高目的和价值，又描绘了达到该目的最有效的方法。如Hobbes不仅认为和平应该是政治系统的目的，而且讨论了达到这个目的的手段——即绝对的政治主权——利维坦。”严格地说，第一种类型的分析是规范的，第二种则是科学的（实证）（Alan C. Isaak, 1981/1987, p. 7）。

在公共政策的多源流修正模型中, 国民情绪、利益集团和换届等三个政治源流维度被整合为一个概念变量, 即政党的意识形态。这样的整合对于那些拥有相对集权的政治系统和有强有力政党的国家, 如社会主义国家来说, 是很有意义的。在无产阶级专政的社会主义国家, 作为执政党的中国共产党在限制政策选择中的作用相对较大, 并且, 政策过程也是十分集权的。党主导着所谓的政治源流, 对政策选择进行严格的控制, 主要体现在共产党的意识形态或主流观念能够限制提上议程的问题类型, 界定着能够被接受的解决办法 (政策方案) 的类型 (P. A. Sabatier, 2004)。

1. 领导决策层

在我们的模型里, 考虑到政府的首脑即总理也是党的中央政治局以及政治局常务委员会成员, 所以, 党的中央委员会和国务院政府组织之间保持高度的一致性, 统称为政策的中央 (领导) 决策层。具体来说, 领导决策层包括党的领导决策层和政府领导决策层, 前者以党的中央委员会和常务委员会为组织权力中心, 决定重大的政策问题的类型与性质, 以及政策目标确立依据优先序 (原则), 乃至解决方案的审定和批准。而政府领导决策层则具体负责落实党的政策精神 (目标) 与原则, 并据此制定具体的政策方案。政府领导决策层一般意指国务院常务会议。对于涉及重大政策决策问题尤其是关系到国务院多个部门时, 必须由国务院全体会议或常务会议来讨论。在政策决策时, 也必须实行少数服从多数的原则, 在实际决策中, 国务院决策层对重要政策议案进行表决前一般都已经进行过广泛意见征求调研讨论和协商, 所以, 最终都会在最大程度上达成一致共识, 从而在表决时基本上都会全数通过。这就意味着民主集中制下的政策决策层通常都是高度意见一致的。这种一致性即是政府的主流观念或集体意志 (思想), 也正是政府 (领导决策层) 的主流观念决定了政策的目标与具体政策方案的设计。

2. 利益集团

从政府决策需要面对和处理的利益这样一个视角来看, 社会经济利益一般是以群体 (集团) 利益的形式存在的, 也就是说, 一项政府政策所涉及和影响的总是社会一定群体的利益, 即在某一方面具有共同特征或需求的一群人的利益。正是群体利益的一致性和不同群体之间的利益冲突, 构成了利益集团组织形成的基础。多元利益集团形成了对国家政府的社会制衡, 塑造了政府和社会之间均衡的权力关系, 既监督着政府的决策过程, 又汇集和表达分散的、模糊的民意, 进行政治沟通延缓和减少政治冲突等方面发挥着重要作用。多元利益集团对政策过程的参与和影响是现代民主决策过程的一个基本特征 (赵成根, 2000, 第 52 页)。一旦各个不同利益集团存在明显或潜在的利益冲突时, 领导决策层通常会倾向于维持各利益方之间的利益平衡。为了达到这一目标而进行的政策调整也就是必要的, 但是, 政策不可能完全会平等地照顾

到每一个利益集团的利益，同时，也不是以立宪民主制下各个政党竞争投票的形式决定政策变迁。在民主集中制下利益集团是如何以及在何种程度上决定政策变革，这可以从多个层次上展开讨论，一是不同的利益集团根据在特定政策下受益情况发出呼声状况，即通过社会观念来影响领导决策层对政策变迁的决策；二是利益集团由于自身的收益成本结构变化对政府收入或对财政预算产生影响或压力，从而对政策调整产生影响；三是利益集团通过议案、报告等形式直接影响甚至改变领导决策层的价值观念或主流观念，来决定政策的变迁。但是，不是所有的利益集团都能够通过上述三种渠道或其中的一种对政策产生影响。一般而言，利益集团可以根据其自身的性质、是否具有政策提议权（或决策权）以及组织化程度来区分为以下几类。

如表 1 所示，具有政策草案起草和提议权的高度组织化的国有部门对政策决策与变迁的影响力最强，通常这样的部门可以称之为强势集团，是由中央或国务院直接主管的，其部门负责人也由中央任命，具有行政级别和职位。而无提案决策权的国有部门对政策的影响力是不确定的，属于一般性政策压力集团。有政策提案决策权的非国有部门在建国初期特定的短暂时期或许存在过，但是，在社会主义改造运动之后，这种情形或利益部门已经不可能存在了。至于非国有部门包括企业或社会公众个体，无论其组织化程度如何都是社会的弱势集团，尤其是根本缺乏组织的社会群体，如农民与消费者，一般被认为是最弱势集团。弱势群体对政策的偏好或意愿一般只能通过媒体等间接途径发出呼声，但是，在特殊或极端的情形下，弱势集团也可以通过“上访”、“信访”、“投诉”、“游行”和“静坐”甚至骚乱等形式反映其政策意愿。

表 1 强势利益集团与弱势利益集团

	国有性质		非国有性质	
	高度组织化	缺乏组织化	高度组织化	缺乏组织化
有议案提议决策权	强势集团	×	×	×
无议案提议决策权	一般利益集团	×	弱势集团	最弱势集团

高度组织化的国有部门或强势集团在转轨经济国家是名副其实的压力集团，能在政策过程的任何阶段对决策施加影响，并就政策起草的任何细节进行讨论和谈判，影响政策执行过程并有可能会控制政策的结果。但是，这些部门或压力集团最终能在多大程度上影响和决定政策方案还是要取决于中央政策决策层的主流观念，当压力集团的政策倾向或利益诉求与决策层的主流观念相一致时，压力集团的影响效果就明显；反之，则不明显。不过，考虑到中央政策决策层成员对特殊性质的问题具备细致的相关知识的人数有限，绝大多数决策层成员之所以具备一定的知识，是因为相关的国有利益部门或压力集团在事先向他们不断简要地加以汇报或介绍。

而且，政策起草工作的许多细节都是政策研究者和来自国有利益部门的代表们或负责人共同讨论进行的。

3. 社会公众个体

社会主流观念或公众信念，这是一个相对模糊的概念，关键的问题在于社会主流观念到底包括什么？社会公众又是指哪些？这是一个很难用明确的指标来衡量的概念，即缺乏操作性。而且，社会大多数人的政策观念或信念并不一定就是社会上反响最强烈或呼声最大的观念，这可能既受媒体倾向的影响，也是一定政策下利益受损最大的群体观念，还可能是其他意外或偶然因素冲击引发的某种社会观念占上风。总之，社会公众的主流观念是不断变化的，如何知道社会观念在什么时候会发生什么样的改变，是十分困难的事。政策领导决策层通常更多地受社会主流观念的影响，还是受呼声最强的（边缘）观念影响呢（如果两者不一致的话）？

四、政策变革的政治经济学：从主流观念到制度演化的动态模型

（一）主流观念与政策变革的政治过程（第一层次）

在 North 的模型里，政府可以被视为一个新古典的利益极大化者（但不一定是经济利益极大化，准确地说是效用极大化者）。这样，政府决定政策的目标是在追求统治者租金最大化的同时降低交易费用，以使经济增长和税收最大化。虽然 North 注意到了“在使统治者（和他的利益集团）租金最大化的政策（所有权结构）与降低交易费用和促进经济增长的有效体制之间存在着持久的冲突”，但是，这一模型的缺点是显然的。正如 North（1991）后来所指出的，“社会价值的改变，即意识形态的变更是政策或制度变革的主要因素，没有意识形态理论，新制度经济学将是不全面的。”^①

不过，North 没有提供一个正式的意识形态理论，他对制度变迁和稳定的探讨至今还停留在很大程度上属外生决定要素的变迁或稳定上。民主集中制的“少数服从多数”规则与政策决策者委员会的特性或权力控制结构与主流观念在政策制定过程中的作用尚缺乏足够的研究。本文给定的决策委员会、决策者的主流观念主要受以下因素决定和影响：除了价值观（信念）和思想理论之外，还受社会公众的 voice（呼声）的压力与政府财政能力（盈余—赤字状况）的约束，如图 1 虚线所示。

^① North 最终突出了意识形态作为人类行为推动力的重要意义，这个推动力常常不允许用严格的新古典术语来解释。历史的变迁和稳定要求有一种意识形态理论来说明对新古典个人主义理性计算的偏离。

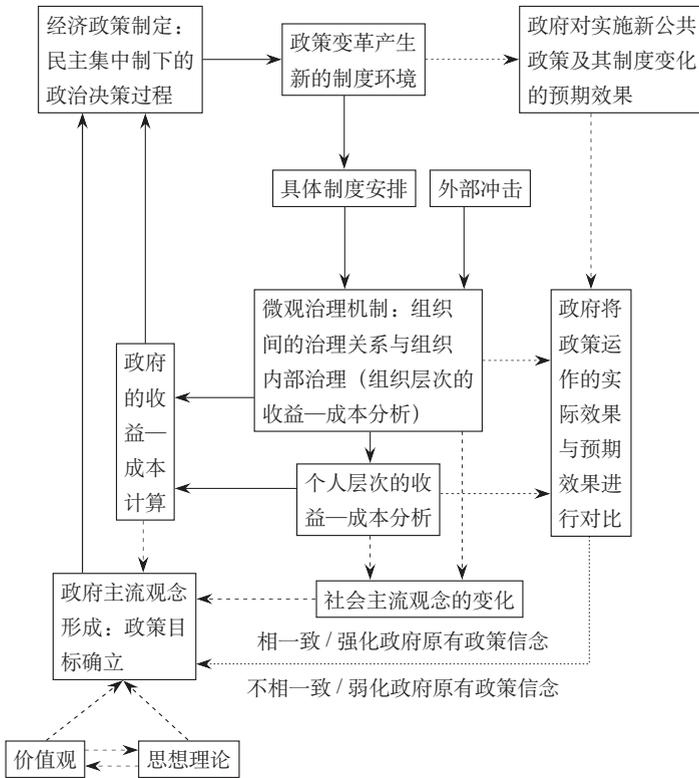


图1 政策变迁的政治经济动力学模型

我们的模型具有较强的包容性，既考虑到了意识形态理论，又包含了 North 所假定的政府对租金和税收收入的追求，此外，还涉及利益集团和社会公众的 voice 的压力。为了和前文的讨论以及 North 的模型保持一致性，我们对 North 的模型结构作如下两种拓展，第一种拓展称为 North 意识形态新古典标准模型（I）：

（1）假设政策的决策委员会成员意志保持高度的一致，此时，政府政策的决策委员会可以被视为一个效用极大化者，简称为“政府”；

（2）政府选择一个政策设计（安排），以使自身效用最大化；

（3）政府的主流观念决定政策安排。政府随机地确定政策目标集合， $PO = \{PO_1, PO_2, PO_3, \dots, PO_n\}$ ，再根据其持有的价值观或信念、思想理论以及利益集团和社会公众的 voice 压力，给予不同政策目标以不同的权重， $\beta = \{\beta_1, \beta_2, \beta_3, \beta_4, \dots, \beta_n\}$ ，然后，依据思想理论设计具体的政策方案；

（4）政策的成本约束条件。政府选择政策目标集合并且赋予权重集合，以及最大化选择政策方案，必须在政府财政支付能力（承受）之基础上进行。

第二种扩展我们称之为 North 意识形态（非新古典）扩展模型（II）：

（1）政府政策决策层（委员会）意志难以高度一致，只能实行简单多数原则，即“少数服从多数”；

（2）政府决策层大部分成员赞成或共享的价值观、效率认知以及相应的思想理论，即政府的主流观念决定了政策的目标与具体安排；

（3）政府主流观念除了由价值观和思想理论决定或构成之外，还受利益集团压力和社会公众的 voice（包括媒体）等社会主流观念的影响。政府主流观念既受政策决策层的权力结构与宪法安排的影响，又具有相对的历史稳定性。产业利益集团可以通过影响（“公关”）决策层成员的观念，从而影响甚至改变政府主流观念；

（4）当简单多数原则得不到有效坚持时，政策决策层的主流观念具有不稳定性，尤其是当决策层出现“政治权威”时，威权主义者的个人意志可能会取代或演化为主流观念，决定政策目标与政策安排；

（5）政策选择并不必然是为了某个决策者或政府决策层的整体效用极大化，新古典方法对政策变迁的解释不适当；

（6）当政府对政策运行进行实际评价的效果与预期的效果保持一致时，政府决策层的主流观念会倾向于得到强化，反之，政府主流观念会被弱化。

主流信念类型与公共政策模式是互相促进和共同演化的。主流信念的形成既受一定的现有政策（制度）结构的制约，又受政治家对主流信念赖以确立的理论模型的认同和选择。由于政策与微观治理环境的互补性和相容性的存在，即使某种政策安排比其他政策设计更能适合某些特定产业的市场与技术环境，更能与这样的环境相容而可以自我实施，这样的政策安排能否在这些产业中得到确立仍然是不可知的。如果作为政策设计者的政治家更偏好于某一种主流信念以及建立于这一信念基础上的政策安排，那么，即使政策结构不是最优的，它仍然有可能作为一种政策惯例而持续存在。

（二）产业组织与社会公众个体：治理机制

一旦一项政策安排被制定实施以后，我们进入分析性模型的第二层次和第三层次，即治理与个人层次。一项政策的实施会产生新的制度环境，则制度经济学理论发展出的各种模型，如产权/交易费用方法、信息模型、不完全合约模型以及信任与合作博弈模型等都可以帮助我们分

析和认识在新的环境或政策约束下一个产业内各种治理关系和制度安排发生的变化。通过这些经济模型，我们可以检查在即将发生的市场交易中政策的福利效果以及政策约束下消费者和生产者（企业）的决策是如何决定资源配置结果的。政府对政策的预期结果将反映在消费者、生产者和中间组织利益集团对政策制定、实施的参与行为上。最终被选择的政策将反映消费者、生产者或企业对市场均衡结果的关心。选择政策的政治过程在立宪民主制下具有讨价还价的特征，通常可以用博弈的经济模型来表示，但在民主集中制下，我们采用历史制度分析的方法选择了主流观念决定政策和制度演化的模型。

管制政策如果要起作用的话，它就必须对人们的实际行动产生约束，而且也只有对人们的行为产生约束的政策才能形成制度安排。通常有效的（价格管制）政策都是十分复杂的，一种（管制）政策可能与另一种不同，很显然我们不一定能够正确地估计出实际的约束，而且，利用虚构的约束很容易导致构建特别的理论。在说明（价格管制）政策作用时，所有实证经济研究面临的中心问题都是共同的：一方面只有通过现实调查才能发现详细描述的限制；另一方面调查本身又必须受到理论框架的指导和限制（Cheung, 1974）。例如根据信息经济学模型，不完全信息在政策实施过程的各个阶段上都扮演着重要的角色。政府在制定政策时，必须以关于企业技术、制度结构和消费者特征的不完全信息为基础。尽管对市场参与者行为的监督要支付成本，政府仍然必须执行政策和强制性实施法规。另外，市场参与者本身在诸如价格、产品特征、技术或卫生安全风险等不完全信息下活动的。关于他们的交易对象的底细，市场参与者获得的只是些不完全信息。政府政策的效果在很大程度上取决于政策是减轻还是加重了市场信息的不完全。

在各种有约束性的政策形成的制度环境下，各种制度安排与产业组织之间以及组织内部的治理机制也就形成了。一种特定的治理机制也就是一种契约安排，其效率特征是由治理机制内生决定的。消费者、生产者以及各种中间组织的治理机制形成一个产业竞争结构。在这种产业组织结构中，各种利益集团（企业或消费者群体）的社会经济福利状况既可能对政府的财政税收收入或财政支出产生影响，又可能决定了各自对政府政策决策层施加各种影响的动机，如图1实线所示。在现行政策约束或制度环境下，获得市场势力的企业可能获得利益好处，并因此也增加了政府的税收，从而倾向于支持该项政策。相反，处境不利的企业、消费者群体则会通过各种途径，如行业协会、环境保护协会、传播媒体以及向政治协商会议乃至人民代表大会提交议案等等表示对现行政策的不满和反对。如果政策造成了国有企业部门出现巨大的经营亏损，也可能造成政府的财政补贴负担过重，从而对政策决策层的主流政策观念产生影响。

对政策不满的社会公众的 voice 可以通过多种渠道对政策决策层施加影响,既可能是通过传播媒体的报道引起社会的共鸣和决策层的关注,如“打白条”、“下岗职工”问题;也可能是利益受损群体的集体行动,如游行、静坐等引起了严重的社会问题,对政治社会安定产生不利的影响令决策层忧虑;最后,还有可能是通过专家学者形成改善不利群体的政策议案。当然,经济学家们提出的各种改革方案之间的差异,并不一定都反映了不同集团的不同利益,或许是由其他种种原因造成的,但我们也不能否定,某一经济学家可能受到某一利益集团的更多的影响,或者他恰巧更多地听到了某一集团的 voice,更多地注意到了某一方面利益的重要性。

命题 1: 在民主集中制下,政府领导决策层的主流观念决定了转轨经济政策的目标与具体政策安排,但是,政策目标能否实现则取决于特定政策环境下治理机制的效率特征。

(三) 政策变迁的动态经济学:从主流观念到制度演化

这一模型存在一个因果反馈(循环)机制,长期的演化博弈过程既有“自然选择”性,又有适应性学习的特点。一种政策安排约束下的治理机制的效率特征要接受政策环境下的企业、消费者以及生产者个人的满意和理性反应(检验)。否则,企业或社会公众个体不满意现行政策下的状态,政策安排难以自我实施,即经济主体不接受政策决策者(设计或控制)的主流观念。当社会 voice 产生的压力足够大时,政策决策层就会被迫改变政策安排。这时,新的政策约束下经济主体之间会形成新的治理机制,演化的过程又会继续下去。政策将缓慢地适应经济社会的“急剧”变化,但是这一适应过程存在时滞,以及存在不适应社会经济生活而作为过去的残余保留下来的政策。制度最终将是无数互动的个体行为以及集体行动的无意识的结果。同时,作为政策的决策者以及社会公众个体都存在一个适应性学习的问题(Vromen, 2003, p. 153)。

如图 2 所示, V 代表政府决策层的主流观念, P 为一定主流观念下政府选择的政策安排,而 a_i^i 则表示特定政策安排下各有关经济利益相关方或主体采取的行动空间(集合), $g_t^{a_i}$ 就表示一个博弈结构或各个相关利益主体之间的交易协调方式或合约结构,也就是一种交易治理机制(关系)。在一个给定的治理机制($g_t^{a_i}$)下,就存在一个效率特征(e_i^i)与之对应, e_i^i 表示各个经济相关主体在采取行为的情形下或者说在治理机制的结构 $g_t^{a_i}$ 里获得的收益(矩阵)。以 t 表示时间的动态性、 t_0 为基期的情形,假设 t_0 期,政府的主流观念为 V_{t_0} , 政府集体选择的政策安排为 P_{t_0} , 在 P_{t_0} 和特定的外部宏观经济环境或冲击,以及特定资源环境禀赋约束的条件下,形成的治理机制关系为 $g_{t_0}^{a_i}$, 各经济相关主体采取的行动空间和收益矩阵为 $(a_{t_0}^i, e_{t_0}^i)$ 。当下述情

形的任何一种发生时，政府的主流观念将会变化。可能的情形有：(1) 政府决策层的信仰或价值观发生变化；(2) 政府决策层作出政策决策的经济思想理论（依据）发生了改变；(3) 现行政策安排下社会公众和利益集团对效率不满而发出的 voice 或政治活动对政策决策层产生足够大的压力；(4) 由于上述压力，政府对现有政策安排下的治理机制与效率的认知发生了变化；(5) 现行政策约束下政府的成本收益结构发生变动造成政府财政负担过重而难以维持已有政策的运行；(6) 由于其他意料不到的外部冲击造成上述任何一种情形的出现。当政府政策决策层主流观念由 V_{t_0} 变为 V_{t_1} 时，政策安排也必定通过集体行动选择产生新的政策安排 P_{t_1} ，于是，在新的政策下，各个经济利益相关方或主体采取的经济行动空间以及相应的收益矩阵发生改变为 $(a_{t_1}^i, e_{t_1}^i)$ 。于是，在新的政策安排下，各经济主体间形成的新的治理机制则演化成 $g_{t_1}^{a_i}$ ，相应的收益矩阵为 $e_{t_1}^i$ 。

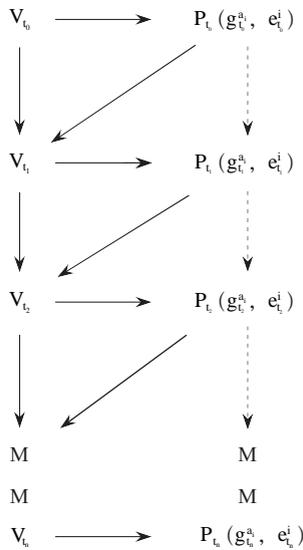


图2 一个政策变迁的演化博弈模型

同样，在期 t_1 ，如果再一次出现上述所列六种情形之一或几种时，政府政策决策层的主流观念将会进一步变化，即由 V_{t_1} 演化成 V_{t_2} 。类似地，在 t_2 期，政府的政策必须再次调整，比方说为 P_{t_2} 的形式，以适应新改变了的主流观念，于是，在新的政策安排之下，就又形成了新的治理结构 $(g_{t_2}^a)$ 以及该治理关系下的各行为主体新的行动空间 $(a_{t_2}^i)$ 和收益矩阵 $(e_{t_2}^i)$ 。这种变化将一直继续下去……直到某个时期比如 t_n ，在政府的主流观念及其政策安排之下，某一特定的治理机制中各个相关经济主体包括政府在内在其所选择的行动空间以及相应的收益矩阵感到

满意，达到一种 Nash 均衡，不再强烈要求改变现状的情形。或者即使存在一些经济主体对该政策下的现状感到不满意，但其 voice 或政治活动并不足以达到影响政府政策决策层改变主流观念的程度。我们称这样的状态为主流观念——政策 Nash 均衡，这种均衡可以表示为： $V_{t_i}^* - P_{t_i}^*$ ($g_{t_i}^a, e_{t_i}^i$)。

值得注意的是，上述 Nash 均衡可能存在三种很不相同的情形：

第一种情形是最（优）理想的 Nash 均衡，即在这种政府主流观念及相应的政策安排之下，各个经济相关主体对该政策环境与治理机制下的行为空间和收益矩阵感到十分满意，不再有改变现状的动机。此时，政府的主流观念也是政府、产业利益集团与社会公众个体相互之间合作博弈的共同信念。

第二种情形是次优的 Nash 均衡，即在这种政府主流观念及其相应的政策安排之下，绝大多数经济相关主体对该政策环境与治理机制下的行为空间和收益矩阵都感到十分满意，不再有改变现状的动机。但是，也有少数部分群体则表示不满且发出 voice 和进行政治活动，不过，这样的 voice 和政治活动并不足以达到影响政府政策决策层改变主流观念的程度。于是，在这种主流观念——政策 Nash 均衡中，存在“多数压迫少数”的情势。

第三种情形是最劣的 Nash 均衡，即在这种政府主流观念及其相应的政策安排之下，只有少数经济相关主体对该政策环境与治理机制下的行为空间和收益矩阵都感到十分满意，不再有改变现状的动机。但是，绝大多数群体则对该政策环境与治理机制下的行为空间和收益矩阵感到十分不满意，且有改变现状的强烈动机。只是，这样多数人的动机与 voice 以及政治活动仍然不足以达到促使政府政策决策层改变主流观念的程度。在最劣的 Nash 均衡中，一般至少存在两个必要条件：一是政策决策层存在严重的威权主义者，社会公众与威权主义者缺乏有效的信息沟通渠道；二是政策决策层的主流观念强烈地受某特定的价值观（信念）或思想理论的支持，却不易受该政策下的公众对效率认知与呼声的冲击。

只要政策实施能产生一个令人满意的结果（包括生产者、消费者和政府），政府决策层就倾向于坚持维持现行的政策。反之，如果政策实施的结果不能令生产者或消费者或其他社会中间组织满意，并且这种不满意形成的社会 voice 对政府影响足够大，政府决策层就有压力或倾向于改变现行的政策安排。但是，一定政策实施后，社会产业组织内的治理机制与竞争状态发生的变化及其对效率与社会福利格局的影响应当受到足够的重视和分析。在一定时期内，政策自身转化成社会经济的制度约束。政策环境约束下的产业组织的治理与竞争关系又是否以及如何演化成某种制度安排？

在这里，长期来说，存在两种类型的制度形式，一类是政策型制度，一类是商业契约型制

度（卢现祥，2003）。Menger（1883/2001）把人为设计的制度称为“务实”的制度，而把自发出现的制度称为“有机”的制度。务实解释就是“从人类社会联盟或其统治者的意图、观点以及可利用的手段等方面来解释社会现象的性质和起源”。这可能牵涉到单个有权威的个人（君主、独裁者或领袖）或者一群人（委员会或立法机关），在现代社会，主要是指政府的“积极立法”。社会学家给出的许多功能性解释的主要问题是，没有搞清楚当制度只提供潜在功能时制度为什么会持续。功能演化理论的困难之处在于难以规定个人行为和相关社会现象之间的令人满意的联系。功能/演化主张一般在试图解释导致制度发展、延续、传播或变迁的个人行为时，通常要么相信有预期的过程，要么倚赖标准的看不见的手的过程（Rutherford，1999）。

不过，对政策和政策约束下的经济制度的选择存在很大的区别，政策不像一种社会制度或惯例可以在群众（社会）中不同经济个体或主体之间进行选择、复制和传播。但是，在一个长期的历史背景中，政策却可以在不同的时期被修正、复制或选择。不同时期的利益集团、公众的压力与政府决策层主流观念的变化对政策的改变，同通过市场对企业进行的“自然选择”在选择论的因果反馈认识上是相似的。当然，选择的压力机制不同，前者是主流观念的改变和社会 voice 的压力，而后者则是生存斗争决定的压力。

在我们的模型里，治理机制可以联结个人的行为和政策决策层，并且通过个人或企业对绩效的感知发出的 voice 而对社会政策决策施加影响或压力。但是，价值观和思想理论的改变却作为外生变量，充当了决策选择机制的关键因素。信念和理论反映了政策决策层对政策或制度的审慎的设计意图。当然，问题并没有解决，信念和思想理论是如何为政策决策层成员所接受并产生影响的，还需要细致的政治经济心理学研究。

命题 2：经济政策变迁过程的实质就是伴随着主流观念的变迁，政策不断搜索和调整，直至政府主流观念和社会主流观念相一致，并成为相关产业利益集团、社会公众以及政府合作博弈的共同信念，从而政策与治理机制才会最终演化成稳定的社会经济制度。

五、来自中国粮食部门的政策经验

中国粮食部门改革的基本经验是政策决策层的主流观念决定了政策演变与反复的历程，也就是说，政策决策层持有的价值观与思想理论模式的变化引起了政策目标组合偏好序列乃至政策具体安排的变革。至于政策决策层的主流观念自身又是因何而变化的，则是由经济发展过程中的一系列内生或外生的随机因素决定的。

首先，长期以来，在粮食部门的改革与政策变迁中，价值取向的产量增长和安全目标、农

民收入增长目标以及市场价格稳定目标等起了十分关键的作用。当上述价值目标在政府决策层的主流观念中占据主导地位时，粮食政策就倾向于非市场方向的变革；但是，一旦维持上述目标的成本或代价太高，即造成的效率损失如政府财政补贴和国有粮食企业亏损过于高昂时，效率目标以及相应的市场经济思想理论就会在政府决策层的主流观念中获得主导地位，粮食又会向市场化方向演进。

其次，政策确立的经济思想理论模式在政策研究以及被政策决策层认同的程度具有十分重要的意义。从中央计划经济理论到重视价值规律的商品经济理论，再到新古典市场价格理论，直至市场失灵与演化制度观点的转轨经济理论，都在特定的历史时期体现于政策决策层的主流政策观念之中。计划经济理论支撑了中国粮食统购统销政策长达30年之久，而当政府决策层代之以重视价值规律的商品经济思想理论时，粮食市场和双轨制政策就正式出现了。

政策决策层持有的价值观与思想理论模式的变化对政策目标和政策安排变革的影响有时是交互作用，难以明确区分。

——双轨制政策的代价与90年代初价格自由化的经验。双轨制下的粮食价值政策目标的实现造成了沉重的政府财政补贴负担和国有粮食企业的亏损，于是，追求效率的强烈动机恰好迎合了1992年邓小平南巡讲话以及党的十四大确立的“建立社会主义市场经济体制的目标”。随着新古典市场经济思想理论实际上已经为决策层所认可，1993—1994年价格自由化政策的尝试也就是必然的了。但是，市场治理机制的严重缺陷与宏观经济环境的恶化使得那场自由化改革迅速失败，政府意识到了市场不是万能的，也会失灵。

——后双轨制政策的代价与1998年粮食政策改革逆转的经验。“市场神话”破灭之后，由于布朗的中国粮食危机论与国际粮食安全理论的广泛讨论与传播，中国政府决策层对粮食政策目标的政治经济考虑变得更加复杂了。价值取向的粮食安全与产量目标以及农民收入增长目标开始占据了政策设计的主流观念。于是，具有“反市场”倾向的后双轨制政策开始从1995年一直运行到1998年新粮改政策出台为止。终于，到了双轨制政策运行成本高到难以维持和国有粮食企业效率低下（损失）到难以忍受的地步了，但是，1998年的粮食改革政策却令人惊奇地并没有出现过去经验显示的那样以效率和市场为导向，却消灭粮食收购市场，并赋予国有粮食企业以垄断收购的特权，以试图既达到通过保护价增加农民收入、刺激粮食生产、保障粮食安全的目标，又达到国有粮食企业扭亏为盈，摆脱政府财政支付的沉重的政策成本的目的。1998年粮改的失败既反映了价值取向的政策目标与效率目标以及相应的经济思想理论之间存在的严重冲突，同时也反映了产业利益集团对政策决策的影响力。

表2 中国粮食政策变迁的政治经济学解释

	周期说	制度变迁说	冲击说	公共选择说	主流观念政治经济学	
	①生产与价格波动的周期性压力	②财政补贴负担压力（政策变迁成本说）	③外部冲击与政治经济约束因素	④利益集团因素（农民呼声与国有部门寻租）	⑤决策层价值观（优先考虑的政策目标）	⑥政治经济思想理论基础的變化
(1953—1982) 统购统销政策	粮食供给长期短缺性偏紧	降低政府直接从市场采购粮食的成本	社会主义和资本主义两大阵营的对立	国有粮食部门的建立扩张和政策运行的惯性	公有化、平等主义和产量目标至上主义	马克思主义计划经济理论
(1983—1985) 合同制市场化改革	粮食短期压力开始缓解	财政压力急剧上升（统派购政策运行成本的上升压力）	/	农民“卖粮难”与呼声的出现	减轻财政负担压力目标、缓解粮食流通不畅目标	充分利用价值规律的商品经济思想理论
(1986—1991) 价格双轨制	粮食产量与供给徘徊	财政补贴压力再次上升（双轨制政策运行成本高昂）	通货膨胀压力和宏观治理整顿	国有部门亏损、寻租和农民对“打白条”不满的呼声	产量目标、控制通货膨胀目标和农民收入目标	商品经济理论与新古典价格理论并存
(1992—1994) 价格自由化改革	粮食生产上新台阶，供给宽松	/	苏联、东欧剧变与邓小平南巡讲话（十四大召开）	国有粮食部门抢购与惜售等寻租行为	价格市场化目标、减轻财政负担压力目标	新古典市场经济理论占主导
(1995—1997) 后双轨制时期	粮食连年增产	财政补贴压力继续增加	布朗风波和中国粮食危机论	国有粮食部门亏损和寻租	粮食产量与安全目标	市场失灵理论与新古典价格理论并存
(1998—2001) “三项政策”改革	粮食产量开始滑坡	财政补贴负担迅速膨胀	党的十五大召开与加快国有企业改革战略提出	国有粮食部门亏损、寻租与农民增收困难而发出的呼声	增加农民收入目标、减轻财政负担和国有部门亏损以及粮食安全目标	市场失灵理论与新古典价格理论并存
(2001—今) 最近的市场化政策改革	粮食产量持续减产	财政补贴压力得到控制	加入WTO与党的十六大召开	社会公众（媒体）与农民对国有粮食部门低效率和市场垄断不满的呼声	增加农民收入与粮食安全目标、价格市场化目标	新古典价格理论、产权制度演化的转轨经济理论

——当前正在进行中的粮食政策改革的经验判断。从2001年开始，在1998年粮改政策多项目标落空以及农民和社会广泛 voice 的压力之下，政府终于再一次调整政策改革方案，一方面开始逐步放开粮食收购市场，另一方面，加快了国有粮食企业的政企分开与自身的改革。改革的重大进展是明确将政策的多重目标进行了剥离，在全面引入竞争和实现资源配置的效率目标的同时，通过实施农民粮食生产直接补贴计划来实现收入分配（增长）目标，再通过健全完善垂直的粮食储备管理体系来实现粮食安全与市场稳定化目标。当前正在进行的改革与政策变革采用了分权化和渐进式的策略。这一次改革政策的设计既体现了政府决策层的效率与公正、安全等价值目标兼顾的信念，又赋予了政策运作以坚实的经济思想理论基础。目前的改革政策很大程度上体现了渐进转轨的演化制度观点，包括注重市场竞争与产权改革的作用、市场组织与组织之间的治理机制（粮食产业化）的培育，以及政府在减少信息不对称、硬化预算软约束、强化市场功能等方面发挥了积极的作用。

最后，表2总结了本研究对中国粮食政策变迁史的完整的解释。已有的研究不仅分散而且缺乏一致性和完整性，或者片面地强调生产供给周期的重要性，或者过于依赖政府财政支出压力因素（制度变迁成本），或者突出利益集团和国有部门寻租的作用。本文的解释不仅具有较强的包容性，考虑了上述所有方面的因素，而且还特别强调了“政策人”的主流观念（价值观偏好和经济思想理论模式）变化对政策变迁的主导作用。这一政治经济学解释具有很强的包容性，不仅突出了政策决策层即政策人的主流观念，包括价值观目标偏好和经济思想理论模式对政策变革的主导性或决定性作用，而且还包容了生产供给周期、制度变迁成本因素、利益集团压力和外部冲击等各种流行的理论学说的解释变量。这一解释大大克服了以往研究的片面性和表层化的缺陷和不足，深化了对转轨经济和政策变迁史的经验实证研究。

六、结论性评述与理论讨论的延伸

本文在民主集中制的性质与政策人假说基础上，提出了两个重要的模型与命题。第一个命题是：政府领导决策层的主流观念决定了经济政策的目标与具体政策安排，但是，政策目标能否实现则取决于特定政策环境下治理机制的效率特征。我们将政府的主流观念定义为政府决策层绝大部分成员赞成或共享的价值观、效率认知以及相应的思想理论，实际上也就是政府的政策理念这一信念决定了政策的具体或实际的安排。对这一命题的讨论分为两部分，首先是一个政党或政府或社会各阶层（公众）实际上在多大程度上持有什么样的价值观、正义观或信念，以及这种正义观又在大多程度上决定了政府的政策与社会制度的选择。其次，经济理论以其最

简洁、最本质的思考方式与结论对政策决策层乃至社会公众的思维判断产生了深刻的影响。第二个命题是关于经济政策变迁的动态政治经济学，即：经济政策变迁过程的实质就是伴随着主流观念的变迁，政策不断搜索和调整，直至政府主流观念和社会主流观念相一致，并成为相关产业利益集团、社会公众以及政府合作博弈的共同信念，从而政策与治理机制才会最终演化成稳定的社会经济制度。

（一）关于历史上低效率的经济政策与制度长期能够存在的原因^①

历史上低效率的经济政策与制度长期存在的根本原因在于政府政策决策层维持某种政策的主流观念没有发生实质性变化。具体来说，首先，政策决策层追求的价值观或信仰主导的政策目标占据了主导地位，而由此引出的效率损失并不足以引起政策决策层动摇或放弃主流目标的价值取向。其次，政策决策层制定和维持的政策赖以确立的思想理论虽具有非效率的特征，但却或者继续为决策层所深信不疑，或者虽被决策层认识到，但却难以找到更好的思想理论以替代之。最后，在低效率的政策或制度安排下，社会公众或某些相关产业利益集团的不满和 voice 或者缺乏有效的沟通传播渠道，或者虽能传播并产生社会影响，但并不足以达到影响决策层并促使其改变主流观念和政策安排的程度。

（二）关于社会主义市场化改革的条件与动力

社会主义市场化改革的基本条件与动力有以下几个可能的方面：一是社会公众或某些相关产业利益集团对效率低下或损失发出强烈的不满和 voice，从而产生足够大的压力以迫使政策决策层开始动摇和改变原来的主流观念；二是政府维持现行政策或制度的成本—收益结构（即财政状况）发生了不利的变化，使得政策运行的成本足够高到难以维持的局面；三是政府决策层的价值观或信仰发生了变化，从而使得现行的某些政策目标变得不合时宜，或不再必要了，或者说政策的目标结构发生了变动；四是现行政策目标与方案设计赖以确立的思想理论基础在政策决策层受到怀疑、动摇甚至被放弃，政策设计的新的思想理论在决策层开始占据重要直至主流的地位。其中，一、二两点为市场化改革的必要条件，而后两点才是改革的动力和充分条件。

^① 曹正汉（2001）博士对本命题以及（二）的论题作过类似的讨论，不过，师兄曹博士的论证是建立在广东崖口村庄的个案经验上，而本文的讨论是基于理论模型的若干推论。并且，本文的研究经验基础是来自中国粮食部门转轨的政治经济学分析，但限于篇幅，本文省略了粮食政策个案的经验细节部分，只是给出了经验研究的基本结论。更多的相关研究可以参考赵德余（2005；2006）。

（三）论社会主义市场化改革与政策变迁不断反复逆转的原因

社会主义市场化改革与政策变迁常常出现反复或逆转的原因有：首先，政策决策层的主流观念或政策目标与社会公众所普遍认知的博弈规则或社会观念不一致，政策方案难以自我实施。也就是说，政策实施后治理机制的效率特征与政策目标不一致，结果政策决策层被迫要么修改政策目标，要么修改政策方案。其次，市场化改革政策通常是建立在新古典价格理论的基础上。由于新古典理论自身的缺陷，由此产生的政策方案倾向于忽视治理机制的培育与演化过程的动态长期性。迅速的价格自由化常常会产生强烈的市场波动与通货膨胀，在特定宏观经济环境下的微观治理机制不能有效地消除通货膨胀的侵蚀与压力时，政策的退却也就是必然的了。再次是多重政策目标的不一致性或冲突问题。在市场化改革的过程中，政策设计常常涉及多重目标，尤其是由价值观派生的公共安全（如粮食安全）目标、就业目标、收入目标与效率导向的资源配置目标之间通常存在不一致时，同时考虑上述目标的政策就难以一致连贯地执行下去。当其中的一项目标得到突出强调时，政策的其他目标就难以保障了；而难以保障的目标的重要性随后也突出起来时，政策就必须重新调整，以适应变化了的政策目标优先序或主流观念。最后，在市场化改革的过程中，某些特殊的利益集团由于受到了利益损失，而强烈阻碍进一步市场取向的改革，甚至是“说服”政策决策层改变主流观念，以迫使政策变革在市场化方向上逆转或退却。

（四）关于社会主义市场化改革政策决策的民主规则问题——兼论宪政转轨的若干观点

历史上低效率的政策或制度之所以能够长期存在的根本原因是政策决策的政治结构高度集权化以及由此产生的决策层的威权主义。当然，高度集权的政治结构并不一定会出现威权主义的后果，但却大大提高了独裁与威权主义出现的概率。社会主义的民主集中制原则几乎在各国的历史都出现过政策决策的威权主义，从而使得价值观导向的如“公有化”、“平等主义”政策目标占据了绝对的主流地位，而对由此产生的治理机制及其效率低下（损失）引起的社会公众不满响应十分迟钝。但是，政策失败并不是社会主义民主集中制下的特有现象，同样，立宪民主制下由于利益集团的政治院外活动以及政党竞争的影响，政策失败或者说缺乏效率的政策也是经常出现的。因此，从政策决策与实施的效果来看，民主集中制与立宪民主投票规则还难以简单地加以评判，也就是说，仅仅从效率角度，是否应该进行“宪政转轨”，即从民主集中制规则向立宪民主过渡，似乎还不能作出简单的结论。

支持“宪政转轨”一般有两个理由：一是公民投票选举能够表达自己的政策意愿或与之相

近的代表（议员），并通过代议制或政治市场的竞争决定政策的供给。公民拥有这样的民主权利本身就具有终极的价值；二是民主集中制与“一党制”下的市场化改革容易产生国家机会主义与大规模的腐败（杨小凯，2002）。对上述两点理由，我们认为第一点是可以部分接受的，即公民的民主权利应当具有终极的价值，这与社会主义的目标纲领本身也是一致的。但是，关于公民能否最终实现以及在多大程度上实现这样的实质性权利，却不可能一蹴而就。不过，承认这一点已经足够了，仅此就足够可以认为宪政是值得追求的价值目标。关于第二点理由，我们认为不当过分夸大社会主义市场经济改革进程中的国家机会主义与大规模腐败的程度及其消极作用。但是，市场化改革又的确不仅仅是改进经济效率的过程，同样也是不断消除和控制国家机会主义与寻租腐败的过程。对此，仅仅停留在经济改革与政策设计的层面上是不够的，进一步的经济改革与政策变革必须有赖于适当的宪政制度建设的支持。

但是，从实证的角度看，宪政转轨事实上是否以及何时、以何种方式发生则是一个未知的难题，这难题类似于早期社会主义国家的市场化改革。宪政转轨是否会以及如何发生关键还是取决于政府的领导决策层的主流观念，即对公民民主权利终极价值的信念以及相关的政治思想理论的转变。显然，目前，对于多党竞争与投票竞争制度的信念还不可能占据政策决策层的主流地位，并且，与宪政转轨的政治思想理论的研究还远没有达到足够成熟的地步，不过，这并不意味着在朝向宪政制度的建设方向上就无所作为。目前，在强化宪法和人民代表大会的政治地位，控制政府依法行政，以及探索政府政策议案的竞争性与决策的公开听政辩论制度将是通往政策决策的宪政方向上迈出的重要一步。

（五）再论经济改革、宪政转轨与社会主义改革的前途

考虑到实施了宪政转轨的一些东欧国家并没有取得经济改革的显著成功，而一些没有进行宪政转轨的社会主义国家却取得了经济改革的重大成功。所以，宪政转轨既不是社会主义经济改革取得成功的必要条件，也不是社会主义国家经济改革取得成功的充分条件。

从以上的讨论，我们可以推断出社会主义改革将会面临两种方向和两种前途。一是巩固民主集中制原则，走向非宪政制度下的社会主义市场经济社会；二是走向宪政制度下的自由市场制度。前一种情形是政府决策层的主流观念及其相应的思想理论信仰没有发生根本改变，在社会基本政治结构与政策决策的民主集中制规则保持不变的前提下，积极推进社会主义市场经济的市场化改革。这一改革成功的关键条件是社会主义的政治制度结构必须能够有效地调整到将国家机会主义和腐败控制在足够保障经济市场化改革的效率改进的限度之内。第二种情形是政府领导决策层的主流价值观及其相应的思想理论信仰发生了根本的变化，出现民

主集中制向立宪投票竞争制度的转变，如前苏联与东欧各国的经济改革与宪政转轨的经验便是一例。

参考文献

[1] Almond , Gabriel , “ Comparative Political Culture ” , Journal of Politics , 1956 , (18) : 396.

[2] Cheung , S. , 1974 , “ A Theory of Price Control ” , Journal of Law and Economics , 17 , pp. 53 - 71.

[3] Eggertsson , Thrainn , 1990 , Economic Behavior and Institutions , Cambridge : Cambridge University Press.

[4] Hirschman A , 1970 , Exit , Voice and Loyalty , Cambridge : Cambridge University Press.

[5] Kingdon , John , 1984 , Agendas , Alternatives , and Public Policies , Boston : Little Brown. (中译本 , 《议程、备选方案与公共政策》 , 北京 : 中国人民大学出版社 , 2004.)

[6] Nelson , Richard R. and Sidney G. Winter , 1982 , An Evolutionary Theory of Economic Change , The Belknap Press of Harvard University Press. (中译本 , 《经济变迁的演化理论》 , 商务印书馆 , 1997.)

[7] North. D. C. , Structure and Change in Economic History , New York : Norton company , inc. 1981. (中译本 : 《经济史中的结构与变迁》 , 上海三联书店、上海人民出版社 , 1994.)

[8] —— , 1978 , “ Structure and Performance : The Task of Economic History ” , Journal of Economic Literature 16 (sep) , pp. 963 - 978.

[9] —— , 1984 , Three Approaches to the Study of Institutions , In Neoclassical Political Economy , ed. D. Colander , pp. 33 - 40 , Cambridge , Mass. : Ballinger.

[10] —— , 对制度的理解 , 载于 R. Coase 等著 《制度、契约与组织 : 从新制度经济学角度的透视》 , 北京 : 经济科学出版社 , 2000.

[11] Pye L. W. and S. Verba , Political Culture and Political Development , Princeton University Press , 1965.

[12] Sabatier , Paul A. , 1987 , “ Knowledge , Policy-Oriented Learning , and Policy Change ” , Science Communication , vol. 8 , No. 4 , pp. 649 - 692.

[13] Sachs , Jeffrey , Wing Thye Woo and Xiaokai Yang , “ Economic Reforms and Constitutional Transition , ” Annals of Economics and Finance , vol. 1 , No. 2 (Nov. 2002) , pp. 435 - 491.

[14] Samuel P. Huntington , 1991 , The Third Wave : Democratization in the Late Twentieth Century ,

Norman : University of Oklahoma Press. (中译本,《第三波:20世纪后期民主化浪潮》,上海三联书店,1998。)

[15] Schumpeter, Joseph, 1942, *Capitalism, Socialism and Democracy*, New York: Harper and Row, Chapter 22 - 23. (中译本,《资本主义、社会主义和民主》,北京:商务印书馆。)

[16] Sen, Amartya, 1999, *On Ethics and Economics*, Blackwell Publishers Ltd. (中译本,《伦理学与经济学》,北京:商务印书馆,2001。)

[17] Stevens, Joe B., 1993, *The Economics of Collective Choice*, Westview Press, Inc. (中译本,《集体选择经济学》,上海:上海三联书店、上海人民出版社,1999。)

[18] Vromen, Jack J., 1995, *Economic Evolution*, Routledge Ltd. (中译本,《经济演化:探究新制度经济学的理论基础》,北京:经济科学出版社,2003。)

[19] Bromley, 《经济利益与经济制度:经济政策的基础》,上海:上海三联书店、上海人民出版社,1996。

[20] [美] 艾伦·C·艾萨克,《政治学:范围与方法》,郑永年等译,浙江:浙江人民出版社,1987。

[21] 曹正汉,“文化因素对经济制度以及制度变迁之影响机制:对一个村庄公社个案的博弈论分析”,《中国社会科学评论》,2002,第384-401页。

[22] ——“将社会价值观整合到制度变迁理论之中的三种方法:凡勃伦、哈耶克、诺斯的理论之比较”,《经济科学》,2001年第6期,第96-105页。

[23] [美] 罗伯特·达尔,《论民主》,李柏光、林猛译,北京:商务印书馆,1999。

[24] [美] 小罗伯特·B·埃克伦德,《经济理论和方法史》,北京:中国人民大学出版社,2001,第405页。

[25] [克罗地亚] 勃朗科·霍尔瓦特,《社会主义政治经济学:一种马克思主义的社会理论》,长春:吉林人民出版社,2001,第268页。

[26] 卢现祥,《新制度经济学》,北京:中国发展出版社,2003。

[27] [德] 卡尔·曼海姆,《保守主义》,北京:译林出版社,李朝晖等译,2002。

[28] 茅于軾,“新制度经济学译丛”序言,经济科学出版社,1998。

[29] Menger, 《国民经济学》,上海:上海三联书店、上海人民出版社,2001。

[30] Olson, Mancur, 《集体行动的逻辑》,上海:上海三联书店、上海人民出版社,2001。

[31] Rutherford M., 《经济学中的制度主义》,北京:中国社会科学出版社,1999,第66页。

[32] Stiglitz,《社会主义向何处去》,长春:吉林大学出版社,2003。

[33] 王贵秀,“以完备的制度保障党内民主”,《中国党政干部论坛》,1995年第12期,第29-32页。

[34] ——,“试论实行民主集中制的过程”,《理论前沿》,1994年第2期,第11-14页。

[35] 赵成根,《民主与公共决策研究》,哈尔滨:黑龙江人民出版社,2000。

[36] 赵德余,“粮食订单的缔约难题及其合约改进”,《中国农村观察》,2005年第4期。

[37] ——,“多重目标下政策变迁与国有部门寻租的政治经济学”,《制度经济学研究》(第12辑),北京:经济科学出版社,2006。

The Political Economics of Dominant-opinion and the Policy Change Under the Democratic Centralism

Zhao De-yu

(Fudan University , The School of Social Development and Public Policy)

Abstract : This paper puts forward two important models (propositions) , based on the study of the normative nature and the constitutional foundation of the economic polices , as well as the study of the normative and empirical nature of the democratic centralism. The first proposition is that the dominant-opinion of the policy-makers of government leaders decides the aim and the concrete policy arrangement of economic policies , however , whether the aims of economic policies can be achieved depends on the efficiency character of the governance mechanism in particular policy situation. Here , the dominant-opinion of the government is defined as the value , the thought of efficiency , as well as the corresponding thought theories approved or shared by the overwhelming majority of the government policy-making members. in fact , that is to say , the belief of the government policy thought decides the concrete or actual arrangements of economic policies. The second proposition focuses on the dynamic political economics with regard to the change of economic policies. The essence of the economic policy changing process is that economic polices , accompanied with the change of dominant-opinion , adjust and change continuously until the prevalent opinion is in line with the publican opinion and becomes the common belief of the interrelated industry interest group , the public and the government. Thereby the economic policies and the governance mechanism evolve into stable social economic system.

Key Words : Democratic Centralism ; Institution Evolution ; Dominant-opinion

JEL Classification : B51 , C72 , D78

长期购买力平价：来自南亚的证据

李志宏*

摘要：单一时间序列单位根检验表明南亚与东南亚诸国中几乎任一国的货币与美元之间的真实汇率在 1970—2003 这一时期内都不是稳定的，而单一时间序列协整关系检验表明这些国家中几乎任一国的货币与美元之间的名义汇率与相应的相对价格水平之间在所考察的时期内均不存在协整关联性。另一方面，面板数据单位根检验实证分析结果表明，南亚诸国作为一个整体而非东南亚诸国或南亚及东南亚诸国作为一个整体，其货币与美元之间的真实汇率在所考察的时期内可以被认为是稳定的。考虑到相关宏观经济变量之间的样本关联性的面板数据协整关系检验实证分析给出了与此一致的结果，即南亚诸国作为一个整体而非东南亚或南亚及东南亚诸国作为一个整体，其货币与美元之间的名义汇率与相应的相对价格水平之间在所考察的时期内存在着稳定的协整关联性。由此推知，时间序列变量的相对跨度固然重要，但是其并非检验购买力平价的一个决定性因素，而长期购买力平价本质上可以被视为内生经济收敛的一种结果。实证分析还表明，时间趋势并非相关名义宏观经济变量之间的长期内在关系中的一个关键因素。由此观知，若时间趋势构成了某一特定宏观经济变量的长期走势的一个显著因素，则此变量必定包含有某种真实的成分。

关键词：面板数据；单位根检验；购买力平价

一、引言

自 20 世纪 70 年代以来，针对购买力平价理论的实证分析多如繁星，形成了蔚为壮观的研究文献。尽管研究方法与所采用的分析工具不尽相同，实证发现多种多样，还是有两点共同的

* 李志宏，中国科学技术大学。作者通讯方式：中国科学技术大学人文学院，230026；E-mail：lzh@ustc.edu.cn。作者感谢美国乔治城大学（Georgetown University）经济学系 Matthew Canzoneri，John Cuddington，Robert Cumby 和 Martin Evans 的非凡的建议。本刊编辑及匿名审稿人提供了宝贵的意见与评论。当然，文责自负。

经验分析结果从这些实证研究中显现出来。其一，从短期来看，购买力平价理论并不可靠。可能的解释包括价格在短期内的刚性、短期内的名义冲击、运输成本、关税与非关税壁垒、贸易商的面向市场定价的政策，等等；其二，从长期来看，购买力平价理论只能说在一定程度上是可靠的。可能的正面意义上的解释包括价格刚性效应与名义冲击效应随时间推移的逐渐减弱、稳定与成熟的跨国自由贸易，等等。可能的负面意义上的解释包括非贸易商品的存在、消费偏好的跨国差异、运输成本、关税与非关税壁垒、相对富裕国家在可贸易商品方面相对较高的生产率、相对富裕国家较高的人均资本、跨国贸易经常项目收支的变化、各国政府的支出状况等等。^①

采用最新发展起来的计量分析方法，本文旨在给针对购买力平价理论的实证研究注入新的活力。我们对真实汇率、名义汇率、价格水平等宏观经济变量时间序列数据的稳定性特质以及名义汇率与价格水平之间的关联性进行了全面与透彻的分析。为更好地比较购买力平价理论在短期内的表现和在长期内的表现，我们分别针对相关单一时间序列数据以及由相关单一时间序列数据汇聚而成的面板数据进行了实证分析。

我们的实证分析结果可以这样来简明地概括。南亚诸国作为一个整体而非东南亚或南亚及东南亚诸国作为一个整体，其货币与美元之间的真实汇率在长期内呈现稳定状态。相应的，南亚诸国而非东南亚或南亚及东南亚诸国作为一个整体，其货币与美元之间的名义汇率与相应的相对价格水平之间在长期内存在着稳定的内在关联性。这一发现意味着时间序列变量的相对跨度固然重要，但并非是检验购买力平价的决定性因素，而长期购买力平价本质上可以被视为是内生经济收敛的一种结果。经验分析还表明，时间趋势并非相关名义宏观经济变量之间的长期内在关系中的一个关键因素。由此推知，若时间趋势构成了某一特定宏观经济变量的长期走势的一个显著因素，则此变量必定包含有某种真实的成分。

本篇文章的第二部分给出了相关名义汇率与价格水平之间的长期关联性的经验分析模型。第三部分阐明相关计量分析方法。第四部分简明介绍相关数据并给出实证分析结果。第五部分提供总结性评论。

二、模 型

\$ 为美元符号， ¥ 为日元符号。以 $q_{t,s}$ 代表美元（假定为本国货币）与日元（假定为外

^① Rogoff (1996) 提供了关于购买力平价的理论与实证分析的一个出类拔萃的文献综述。

国货币)之间的真实汇率,即相当于日本一篮子商品的美国一篮子商品的日元价格, $E_{\$/\text{¥}}$ 代表美元与日元之间的名义汇率, P_{US} 代表美国的价格水平, P_{JPN} 代表日本的价格水平,则有:

$$q_{\$/\text{¥}}(t) = E_{\$/\text{¥}}(t) \cdot P_{\text{US}}(t) / P_{\text{JPN}}(t) \quad (1)$$

假定真实汇率(略去下标中货币与区域符号)的变动遵从

$$q(t) = q_0 \cdot e^{\lambda \cdot t + v} \quad (2)$$

其中, q_0 为常数,代表基期的真实汇率水平, λ 为汇率的时间趋势参数, v 为一随机变量,代表影响真实汇率的不可测度因素。长期内真实汇率是否保持稳定,取决于 λ 与 v 。

对方程式(1)两边求自然对数(略去下标中货币与区域符号,同时以*标识外国),我们有:

$$\ln q(t) = \ln E(t) + \ln P(t) - \ln p^*(t) \quad (3)$$

同理,对方程式(2)两边分别求自然对数,我们有:

$$\ln q(t) = \ln q_0 + \lambda \cdot t + v_t \quad (4)$$

将方程式(3)代入方程式(4)并适当调整,且放宽对价格的系数限制,我们有:

$$\ln E(t) = \ln q_0 + \lambda \cdot t + \alpha \cdot (\ln P^*(t) - \ln P(t)) + v_t \quad (5)$$

由此,对长期购买力平价的检测可以归纳为依据方程式(5)来检测长期内名义汇率与本国价格水平及外国价格水平之间是否存在长期协整关联性(Long Run Cointegrating Relationship)。类似的表述已经在先前的相关实证研究中被详细地分析过了。不过,先前的研究多少都存在一些不足。其一,很多研究工作所关注的是对单一国家或地区的汇率数据进行实证分析。然而,单一国家或地区可用数据的典型时间跨度一般在20—30年之间。这样时间跨度的数据不足以用来可靠地检测宏观经济变量之间的长期关系;其二,即使存在为数不多的面板数据分析,相关的单位根检验过程普遍没有考虑到相关面板数据的跨横截面性质;其三,在进行相关时间序列数据之间的协整关系检验时,处于考察中的各时间序列数据之间的样本关联性(Sample Variable Correlation)普遍没有被考虑到。为此,基于新发展起来的计量分析方法,我们将所有单一国家或地区的数据汇集成面板数据,考虑面板数据的跨横截面性质以及相关时间序列数据之间的样本关联性,来考察真实汇率的长期稳定性以及名义汇率与价格水平之间的长期协整关联性。

现在,假设有跨度为T年、覆盖N个国家的数据,将方程式(5)稍作扩展以适应面板数据的要求,我们可以得到如下的分析方程式:

$$\ln E_{i,t} = \sum_{i=1}^N \eta_i \cdot D_i + \sum_{i=1}^N \lambda_i \cdot D_i \cdot \text{Trend} + \alpha \cdot (\ln P_{i,t}^* - \ln P_{i,t}) + v_{i,t} \quad (6)$$

表1 真实汇率之单位根检验（单一时间序列，南亚及东南亚14国）

$$\Delta z_{i,t} = \rho_i \cdot z_{i,t-1} + \sum_{j=1}^k \phi_{i,j} \cdot \Delta z_{i,t-j} + \varepsilon_{i,t} \quad \text{①}$$

国家	单位根检验 ^②		国家	单位根检验	
	t_p	统计值 ^③		t_p	统计值
BGLD	- 2.351		BRNE	- 1.970	
BUTN	- 0.619		CMBD	- 0.451	
INDI	- 0.751		INDO	- 0.776	
NEPL	- 0.749		MALA	- 0.441	
PKTN	0.539		PLPN	- 0.923	
SRLK	- 2.282		SNGP	- 3.184 ^b	
			THAI	- 0.469	
			VITM	- 0.964	

注：①检验假设为 $\rho_i = 0$ ，即被考察的每一组单一时间序列数据都被假设为存在单位根过程。否定这一假设的1%、5%和10%的显著性水平分别由^a、^b和^c来标识。

②单位根检验之临界值：1%，-3.536；5%，-2.872；10%，-2.551。对应于每一单位根检验 t_p 统计值之临界值是通过10000次蒙特卡洛模拟实验得到的。无论相关虚拟数据生成程序是否考虑到被考察中的每一组真实时间序列数据之标准偏差（Standard Deviation），经由蒙特卡洛模拟实验所获得的临界值相同。相关GAUSS程序可向作者索取。

③相应的单位根检验 t_p 统计值为运用增广型迪基-福勒（ADF）单位根检验方法对每一时间序列进行单位根过程检验所获取的一个统计值。在ADF检验之前，每单一时间序列 $z_{i,t}$ 均被减去其各自的平均值，即 $z_{i,t} = z_{i,t} - \bar{z}_i$ 。

其中， D_i 是一组虚拟数据——对应于第 i 个国家其值为1，而对应于其他国家其值为0，Trend为一扩展的时间趋势序列——是将一简单时间趋势序列 $1, 2, \dots, T$ 重复 N 次而得到的。 η_i 是各国初始特征系数， λ_i 是各国时间趋势特征系数。 α 是价格水平系数——假定各国的 α 系数都相等。

方程式（6）是本篇文章的基本分析方程式。我们的研究兴趣主要在于五个方面。第一，考虑到相关面板数据的跨横截面性质，长期内真实汇率是否稳定；第二，考虑到相关面板数据之间的样本关联性，长期内名义汇率与价格水平之间是否存在协整关联性；第三，就协整关系检验而言，我们想知道回归分析结果在多大程度上对各国独特的时间趋势因素和各国独特的初始特征因素产生敏感；第四，就协整关系检验而言，我们想弄明白哪一种样式的表述最恰如其分地表述了动态的名义汇率变化；第五，我们想知道是否存在适合于所有国家的名义汇率与价格水平之间的长期关联性。

表2 名义汇率之单位根检验 (单一时间序列, 南亚及东南亚 14 国)

$$\Delta z_{i,t} = \rho_i \cdot z_{i,t-1} + \sum_{j=1}^k \phi_{i,j} \cdot \Delta z_{i,t-j} + \varepsilon_{i,t} \quad ①$$

国家	单位根检验 ^②		国家	单位根检验	
	t_p	统计值 ^③		t_p	统计值
BGLD	- 1.394		BRNE	- 1.491	
BUTN	- 1.122		CMBD	- 0.125	
INDI	- 1.145		INDO	- 0.243	
NEPL	- 1.071		MALA	- 0.772	
PKTN	0.901		PLPN	- 0.481	
SRLK	- 0.946		SNGP	- 1.508	
			THAI	- 0.103	
			VITM	- 0.942	

注: ①检验假设为 $\rho_i = 0$, 即被考察的每一组单一时间序列数据都被假设为存在单位根过程。否定这一假设的 1%, 5% 和 10% 的显著性水平分别由 $\hat{\rho}_i^*$, $\hat{\rho}_i^{\dagger}$ 和 $\hat{\rho}_i^{\ddagger}$ 来标识。

②单位根检验之临界值: 1% , - 3.549; 5% , - 2.812; 10% , - 2.499。对应于每一单位根检验 t_p 统计值之临界值是通过 10000 次蒙特卡洛模拟实验得到的。无论相关虚拟数据生成程序是否考虑到被考察中的每一组真实时间序列数据之标准偏差 (Standard Deviation), 经由蒙特卡洛模拟实验所获得的临界值相同。相关 GAUSS 程序可向作者索取。

③相应的单位根检验 t_p 统计值为运用增广型迪基 - 福勒 (ADF) 单位根检验方法对每一时间序列进行单位根过程检验所获取的一个统计值。在 ADF 检验之前, 每单一时间序列 $z_{i,t}$ 均被减去其各自的平均值, 即 $z_{i,t} = z_{i,t} - \bar{z}_i$ 。

三、计量分析方法

因为我们的目标是估计和度量如方程式 (6) 所表述的名义汇率与价格水平之间的长期动态关系, 单位根检验方法与协整关系检验方法是比较适宜的分析工具 (Engle and Granger, 1987)。另外由于本文所考察的是单一国家的数据汇集而成的面板数据, 我们必须对标准的协整关系检验方法加以扩展以适应面板数据的要求。

具体来讲, 我们所采用的计量分析方法是以李 (2004, 2006) 所做的研究工作为基础的。李基于先前的研究成果 (Engle and Granger, 1987) 而最新发展起来的面板数据单位根检验方法考虑到了相关面板数据的跨横截面特质 (Cross-section Properties), 其面板数据协整关系检验法则不仅考虑到了相关面板数据的跨横截面特质, 还考虑到了相关面板数据之间的样本关联性 (Sample Variable Correlation)。这些方法已经在近期的诸多相关实证分析中获得了成功运用 (Sweeney 和李, 2004; 李, 2005)。我们将这些方法应用于我们的面板数据单位根检验及面板数据协整关系检验并将其稍加拓展以运用于我们的单一时间序列数据的单位根检验以及单一时间序列数据之间的协整关系检验。

表3 价格水平之单位根检验（单一时间序列，南亚及东南亚 14 国）

$$\Delta z_{i,t} = \rho_i \cdot z_{i,t-1} + \sum_{j=1}^k \phi_{i,j} \cdot \Delta z_{i,t-j} + \varepsilon_{i,t} \quad ①$$

国家	单位根检验 ^②		国家	单位根检验	
	t_p	统计值 ^③		t_p	统计值
BGLD	0.382		BRNE	-1.731	
BUTN	-0.284		CMBD	-0.577	
INDI	-0.231		INDO	-0.593	
NEPL	-0.097		MALA	-1.294	
PKTN	-1.374		PLPN	-0.835	
SRLK	-0.311		SNGP	-0.417	
			THAI	-2.277	
			VITM	-0.410	

注：①检验假设为 $\rho_i = 0$ ，即被考察的每一组单一时间序列数据都被假设为存在单位根过程。否定这一假设的1%、5%和10%的显著性水平分别由 $\hat{\rho}_i^*$ 、 $\hat{\rho}_i^{\dagger}$ 和 $\hat{\rho}_i^{\ddagger}$ 来标识。

②单位根检验之临界值：1%、-3.470；5%、-2.845；10%、-2.519。对应于每一单位根检验 t_p 统计值之临界值是通过10000次蒙特卡洛模拟实验得到的。无论相关虚拟数据生成程序是否考虑到被考察中的每一组真实时间序列数据之标准偏差（Standard Deviation），经由蒙特卡洛模拟实验所获得的临界值相同。相关GAUSS程序可向作者索取。

③相应的单位根检验 t_p 统计值为运用增广型迪基-福勒（ADF）单位根检验方法对每一时间序列进行单位根过程检验所获取的一个统计值。在ADF检验之前，每单一时间序列 $z_{i,t}$ 均被减去其各自的平均值，即 $z_{i,t} = z_{i,t} - \bar{z}_i$ 。

四、数据与经验分析结果

本篇文章考察的数据为覆盖6个南亚国家与美国之间的真实汇率、名义汇率及相应的相对价格水平等一组宏观经济时间序列变量。同时，为巩固我们的实证分析结果，我们还将所考察的国家样本扩大到包括东南亚8个国家在内的14个国家。时间跨度为从1970—2003年的34年。所有的数据均来自于美国农业部（USDA），而其又转录自国际货币基金组织（IMF）。其中，价格水平为各国的消费者价格指数（CPI）。以1985年为基准，每一国家的每一组宏观经济时间序列变量均被换算成为各年份的数值与1985年的数值的比率。

如上文所述，本篇文章的目标是检测相关名义汇率与相应的相对价格水平之间可能存在的长期关联性，从而我们考察的是由南亚与东南亚各国及美国的相关单一宏观经济时间序列数据汇聚而成的面板数据，采用的是面板数据单位根检验方法与面板数据协整关系检验方法。不过，为比较相关经济变量在短期内的表现与其在长期内的表现，我们首先全面分析了对应于所有被考察的国家的每一组单一时间序列数据的稳态特质以及相关经济变量之间可能存在的内在关联性。

(一) 单一时间序列数据

表1给出了针对14个南亚及东南亚国家的货币与美元之间的14组单一时间序列真实汇率之单位根检验的实证分析结果。由表可见,在10%至5%的显著性水平上,只有新加坡这个国家的货币与美元之间的真实汇率可以被认为在所考察的时期内呈现稳态,从而这个国家的货币与美元之间的名义汇率基本上正确地反映了其货币的相对购买力。在1%的显著性水平上,没有一个国家的货币与美元之间的真实汇率可以被认为在所考察的时期内呈现稳态。由此,从严格的意义上来讲,南亚及东南亚地区只有极少数国家的货币与美元之间的真实汇率可以被认为是稳定的,从而购买力平价理论并不具有普遍的经验依据。

表2给出了针对14个南亚及东南亚国家的货币与美元之间的14组单一时间序列名义汇率之单位根检验的实证分析结果。表3相应的给出了针对相关的相对价格水平之单位根检验的实证分析结果。由表可见,在所考察的时期内,无论是就名义汇率而言还是就相对价格水平而言,任何一个国家的任何一组单一时间序列数据均不可以被认为呈现稳态。这一实证分析结果正是我们所需要的。紧接下来,我们准备依据方程式(5)并运用协整关系检验方法来检测名义汇率与相对价格水平之间可能存在的内在关联性。协整关系检验方法要求所有被考察的相关时间序列数据都必须呈现单位根过程或非稳定状态(Engle and Granger, 1987)。

表4给出了依据方程式(5)而进行的针对名义汇率与相对价格水平的协整关系检验的实证分析结果。由表可见,在10%至5%的显著性水平上,只有新加坡和巴基斯坦的货币与美元之间的名义汇率与其相对于美国的价格水平之间可以被认为存在内在的协整关联性,从而这两个国家的货币与美元之间的名义汇率基本上正确地反映了其货币的相对购买力。在1%的显著性水平上,没有一个国家的货币与美元之间的名义汇率与其相对于美国的价格水平之间可以被认为存在内在的协整关联性,从而没有一个国家的货币与美元之间的名义汇率正确地反映了其货币的相对购买力。针对名义汇率与相对价格水平的协整关系检验所获取的这一实证分析结果基本与针对真实汇率的单位根检验所获取的经验发现保持了一致,些微的差别完全可以由真实汇率的计算误差或其他无关紧要的误差来解释。

这里,我们有必要特别强调一个相当重要的发现。由表4可见,时间趋势对名义汇率与相对价格水平之间的协整关系存在与否不具有决定性的影响。换句话说,时间趋势并非相关名义宏观经济变量之间的长期关系中的关键因素。^①在下文针对面板数据的实证分析中,我们会有

^① 巴基斯坦看上去是个例外。一种可能的解释是有别于名义因素的某些真实因素对巴基斯坦货币与美元之间的汇率产生了影响。

更激动人心的类似经验发现。

表4 名义汇率与价格水平之间的协整关系检验（单一时间序列，南亚及东南亚14国）

$$\ln E(t) = \ln q_0 + \lambda \cdot t + \alpha \cdot (\ln P^*(t) - \ln P(t)) + v_t \quad ①$$

国家	协整 检验 ^②	α	标准差	R^2	协整检验
					t_p 统计值 ^③
BGLD	$\lambda = 0$	2.264	0.378	0.667	-2.479
	$\lambda \neq 0$	-1.347	0.102	0.976	-3.206
BUTN	$\lambda = 0$	1.554	0.099	0.980	-2.337
	$\lambda \neq 0$	1.974	0.094	0.982	-2.562
INDI	$\lambda = 0$	1.865	0.145	0.956	-2.040
	$\lambda \neq 0$	1.153	0.103	0.978	-2.863
NEPL	$\lambda = 0$	1.759	0.102	0.982	-2.210
	$\lambda \neq 0$	1.201	0.071	0.991	-3.277
PKTN	$\lambda = 0$	1.831	0.171	0.944	-2.767
	$\lambda \neq 0$	0.748	0.122	0.972	-4.056 ^b
SRLK	$\lambda = 0$	1.444	0.331	0.864	-2.295
	$\lambda \neq 0$	-0.763	0.113	0.984	-2.648
BRNE	$\lambda = 0$	0.504	0.096	0.781	-2.143
	$\lambda \neq 0$	0.250	0.090	0.807	-2.345
CMBD	$\lambda = 0$	2.532	0.385	0.903	-2.543
	$\lambda \neq 0$	1.948	0.388	0.902	-2.524
INDO	$\lambda = 0$	1.588	0.318	0.915	-2.722
	$\lambda \neq 0$	0.635	0.275	0.936	-2.929
MALA	$\lambda = 0$	-0.442	0.172	0.059	-1.123
	$\lambda \neq 0$	1.089	0.126	0.494	-3.372
PLPN	$\lambda = 0$	1.157	0.136	0.966	-2.248
	$\lambda \neq 0$	1.028	0.137	0.965	-2.357
SNGP	$\lambda = 0$	0.840	0.119	0.662	-3.400 ^b
	$\lambda \neq 0$	-0.273	0.095	0.787	-2.120
THAI	$\lambda = 0$	1.878	0.165	0.556	-1.862
	$\lambda \neq 0$	0.143	0.123	0.754	-1.854
VITM	$\lambda = 0$	26.756	2.927	0.590	-1.973
	$\lambda \neq 0$	7.431	1.538	0.887	-1.426

注：①对应于协整关系检验而言，相应的检验假设为每一方程式所表述的名义汇率与相对价格水平之间为非协整关系。否定这一假设的1%、5%和10%的显著性水平分别由^a、^b和^c来标识。

②协整检验之临界值： $\lambda = 0$ ：1%、-3.953；5%、-3.253；10%、-2.942。 $\lambda \neq 0$ ：1%、-4.341；5%、-3.719；10%、-3.384。对应于每一 t_p 统计值之特定临界值是通过10000次蒙特卡洛模拟实验得到的。如文中所述，我们的虚拟数据生成程序已经考虑到被考察中的每一组回归分析剩余之标准偏差（Standard Deviation）并体现出处于考察中的相关经济变量之间的样本关联性（Sample Variable Correlation）。

③如文中所述，对应于每一方程式，协整检验是通过对其回归分析剩余进行单位根过程检测来完成的。相应的 t_p 统计值即为运用增广型迪基-福勒（ADF）单位根检验方法对相应的回归分析剩余进行单位根过程检测所获取的一个统计值。在ADF检验之前，每一组回归分析剩余均被减去其各自的平均值。

我们针对真实汇率的单位根检验及针对名义汇率与相对价格水平的协整关系检验的实证分析结果表明,就所考察的从1970至2003年的34年而言,南亚及东南亚地区只有极少数国家的货币与美元之间的真实汇率可以被认为是稳定的,相应的,也只有极少数国家的货币与美元之间的名义汇率与其相对于美国的价格水平之间可以被认为存在着协整关联性。由此,从严格的意义上来讲,就所考察的国家与时期而言,购买力平价理论并不具有普遍适用性。可能的解释包括34年的时间跨度的检测力度不足以可靠地验证购买力平价理论,购买力平价理论是一种长期理论而非短期理论,购买力平价理论的成立条件因过于严格只能在极少数国家中得到满足而不能得到普遍意义上的满足,等等。接下来,为增强检测力度,我们将相关国家的所有单

表5 相关面板数据的单位根过程检验(南亚6国)

$$\Delta \tilde{z}_{i,t} = \rho_i \cdot \tilde{z}_{i,t-1} + \sum_{j=1}^k \phi_{i,j} \cdot \Delta \tilde{z}_{i,t-j} + \varepsilon_{i,t} \text{ ①}$$

	\bar{t} 统计值 ($\rho_i \neq \rho_1, \phi_{i,j} \neq \phi_j$ $i \neq 1; i, j = 1, \dots, 6$) ^②	t_p 统计值 ($\rho_i = \rho_1, \phi_{i,j} = \phi_j$ $i \neq 1; i, j = 1, \dots, 6$)
ln q ^③	-2.494 ^a	-6.395 ^a
ln E	-1.995	-4.953
ln P* - ln P	-1.543	-2.420
各面板数据单位根过程检验的临界值 ^④		
ln q	1%	-2.415
	5%	-2.138
	10%	-1.997
ln E	1%	-2.604
	5%	-2.268
	10%	-2.099
ln P* - ln P	1%	-2.449
	5%	-2.152
	10%	-2.014

注:①作为整个单位根检验过程的一部分,每一组原始面板数据 $z_{i,t}$ 均被进行了相关数据转换。具体来说, $z_{i,t} = z_{i,t} - \bar{z}_i, \bar{z}_{i,t} = z_{i,t} - \bar{z}_i$,其中 $\bar{z}_i = \left(\sum_{t=1}^T z_{i,t} \right) / T, \bar{z}_i = \left(\sum_{t=1}^N z_{i,t} \right) / N$ 。相关检验假设为 $\rho_i = 0$,即每一组被考察的面板数据都被假设为存在单位根过程。否定这一假设的1%,5%和10%的显著性水平分别由^a,^b和^c来标识。

②括弧中标明的是 t_p 统计值和 \bar{t} 统计值之获取方法的不同。如李(2004)所述, t_p 统计值是经由对相关面板数据进行一次性回归分析而得到的一个针对 $\rho = 0$ 的t检验统计数据,而 \bar{t} 统计值则是经由对构成相关面板数据的每个时间序列数据分别进行回归分析而得到的一个针对所有 $\rho_i = 0, i = 1, 2, \dots, N$ 的N个t检验统计数据的平均值。

③ln q, ln E, ln P*, ln P分别代表真实汇率q、名义汇率E、外国价格水平P*、本国价格水平P的自然对数。后继表中相同标识的含义与本表中的完全相同。

④对应于每一组 t_p 统计值和 \bar{t} 统计值之临界值是通过10000次蒙特卡洛模拟实验得到的。相关虚拟数据生成程序已经考虑到被考察中每一组真实面板数据之跨横截面性质(Cross-Sectional Properties)。相关GAUSS程序可向作者索取。

一时间序列数据汇聚成面板数据，并运用面板数据单位根检验方法和面板数据协整关系检验方法来考证购买力平价理论在长期内的正确性。

（二）面板数据

为增加实证分析结果的可靠性，我们共考察了三组面板数据，第一组覆盖6个南亚国家，第二组覆盖8个东南亚国家，而第三组则覆盖所有14个南亚及东南亚国家。我们关注的是随着横截面数量的增加从而面板数据跨度扩大，购买力平价理论的正确性是否更容易被确认。若数据的相对跨度在针对购买力平价理论的检验中起着重要作用，覆盖更多国家的面板数据所给出的经验分析结果应该更倾向于支持购买力平价理论。

在运用面板数据协整关系检验方法检测名义汇率与相对价格水平之间可能存在的长期内在关联性之前，我们首先必须要运用面板数据协整关系检验方法来验证一下相关各组宏观经济变量时间序列数据是否呈现非稳定状态。一方面，我们需要检测由所有单一时间序列汇聚而成的面板数据形式的真实汇率是否呈现稳态。另一方面，协整检验方法要求所有处于考察中的相关经济变量都必须呈现非稳定状态（Engle and Granger, 1987）。如上所述，我们的计量分析方法是基于李（2004，2006）。

表5给出了针对由6个南亚国家的单一时间序列数据汇聚而成的相关面板数据的单位根检验结果。由表可见，在所考察的时期内，这6个南亚国家作为一个整体，其货币与美元之间的真实汇率可以在1%的显著性水平上被认为是稳定的，从而购买力平价理论可以在1%的显著性水平上被认为是正确的。

另一方面，表7给出了针对由8个东南亚国家的单一时间序列数据汇聚而成的相关面板数据的单位根检验结果，而表9则给出了针对由所有14个南亚及东南亚国家的单一时间序列数据汇聚而成的相关面板数据的单位根检验结果。由表可知，就真实汇率而言，无论是就8个东南亚国家还是就全部14个南亚及东南亚国家而言，相关各组面板数据所提供的实证分析结果均表明，真实汇率不可以在10%的显著性水平上被认为是稳定的，从而购买力平价理论不可以在10%的显著性水平上被认为是正确的。换句话说，没有证据可以表明真实汇率是稳定的，从而购买力平价理论的正确性没有获得证实。由此我们初步确认，时间序列数据的相对跨度对于购买力平价理论的检验并非起着决定性的作用。

表5、表7与表9还给出了针对相关的名义汇率与相对价格水平的单位根检验结果。由表可见，无论是就名义汇率而言还是就相对价格水平而言，针对任何一组面板数据的单位根检验之实证分析结果表明，名义汇率与相对价格水平不呈现出稳态。这一经验分析结果正是我们所

需要的。接下来,我们准备依据方程式(6)并运用协整关系检验方法来检测名义汇率与相对价格水平之间可能存在的长期关联性。如上文所述,协整关系检验方法要求所有被考察的相关时间序列经济变量都必须呈现单位根过程或非稳定状态。

表6给出了针对由6个南亚国家的单一时间序列数据汇聚而成的相关面板数据之间的协整关系检验之结果,表8给出了针对由8个东南亚国家的单一时间序列数据汇聚而成的相关面板数据之间的协整关系检验之结果,而表10则给出了针对由所有14个南亚及东南亚国家的单一时间序列数据汇聚而成的相关面板数据之间的协整关系检验之结果。就任一组面板数据而言,对应于方程式(6),考虑到是否包含时间趋势以及是否允许各国拥有不同的初始特征系数或时间趋势特征系数,我们共考察了6种不同样式的回归分析方程式。其中,方程式(6a)不包含时间趋势且假定各国拥有相同的初始特征系数,方程式(6b)不包含时间趋势但允许各国初始特征系数存在差异,方程式(6c)包含时间趋势并假定各国拥有相同的初始特征系数和时间趋势系数,方程式(6d)包含时间趋势并假定各国时间趋势系数相同但允许各国初始特征系数存在差异,方程式(6e)包含时间趋势并允许各国时间趋势系数存在差异但假定各国初始特征系数相同,方程式(6f)包含时间趋势并允许各国时间趋势系数和各国初始特征系数均存在差异。如上文所述,我们假定各个国家拥有同样的相对价格水平系数,并且此假设不随回归分析方程式的变化而改变。

我们的协整关系检验是基于对相应的回归分析剩余进行单位根过程检测来进行的。对应于每一种样式的回归分析方程式,相应的检验假设是该方程式所表述的名义汇率与相对价格水平之间的关系不是一种协整关系,也就是说相应的回归分析剩余被假设为呈现非稳定状态。对应于每一分析方程式,我们运用李(2004,2006)倡导的检验方法来检测相应的回归分析剩余是否呈现非稳定状态。若经验分析发现存在足够的证据能够否定相关回归分析剩余呈现非稳定状态这种假设,那么相应的分析方程式所表述的名义汇率与相对价格水平之间的关系就可以被视为是一种协整关系。换句话说,名义汇率与相对价格水平之间存在着长期稳定的如相应的回归分析方程式所表述的那种购买力平价关系。特别需要强调的是,在获取相关检验统计值之临界值的过程中,我们的蒙特卡洛实验程序考虑到了由相应的回归分析方程式所表述的名义汇率与相对价格水平之间的样本关联性(Sample Variable Correlation)。

由表6可见,第一,对应于方程式(6a)、(6b)、(6c)和(6d)而言,其回归分析剩余可以被认为在5%的显著性水平上呈现稳定状态,从而由相关方程式所表述的名义汇率与相对价格水平之间的关系可以被认为是一种长期稳定的购买力平价关系。进一步,针对这些方程式所获得的经验发现在定量意义上的差别非常细微。无论是否假设各国具有独特的初始特征或具

有共同的时间趋势特征，名义汇率与相对价格水平之间的长期内在关联性不受影响。由此推知，初始特征的跨国异质性及共同的时间趋势特征长期内对南亚各国的货币相对于美元的购买力平价关系不具有关键性的影响。第二，对应于方程式（6e）和（6f）而言，没有证据表明其回归分析剩余呈现稳定状态，从而由相关方程式所表述的名义汇率与相对价格水平之间的关系不可以被视为是一种长期稳定的购买力平价关系。方程式（6e）与（6f）区别于其他方程式的特别之处在于其假定各国具有各自独特的时间趋势特征。由此推知，就南亚各国而言，各国独特的时间趋势特征本质上不是其名义汇率与其相对价格水平之间的长期内在关联性的一个因素。换句话说，我们不能认为时间趋势会对长期内南亚各国的货币相对于美元的购买力平价产生独特的、有着显著差异的影响。

另一方面，由表8与表10可见，无论是就东南亚各国作为一个整体还是就南亚及东南亚各国作为一个整体而言，第一，对应于被考察的任一方程式，没有可靠的证据表明其回归分析剩余呈现稳定状态，从而由相关方程式所表述的名义汇率与相对价格水平之间的关系不可以被认为是一种长期稳定的购买力平价关系。由此我们进一步确认，时间序列数据的相对跨度对于购买力平价理论的检验并非起着决定性的作用。第二，就方程式（6a）、（6b）、（6c）和（6d）而言，针对这些方程式所获得的经验发现在定量意义上的差别非常细微。无论是否假设各国具有独特的初始特征或具有共同的时间趋势特征，名义汇率与相对价格水平之间的长期内在关联性不受影响。由此观知，初始特征的跨国异质性以及共同的时间趋势特征长期内对东南亚各国或南亚及东南亚各国货币相对于美元的购买力平价关系不具有关键性的影响。第三，就方程式（6e）和（6f）而言，没有证据表明其回归分析剩余呈现稳定状态，从而由相关方程式所表述的名义汇率与相对价格水平之间的关系不可以被认为是一种长期稳定的购买力平价关系。方程式（6e）和（6f）区别于其他方程式的特别之处在于其假定各国具有各自独特的时间趋势特征。由此看来，各国独特的时间趋势特征本质上并非名义汇率与相对价格水平之间的长期内在关联性的一个因素。

需要特别指出的是，我们所采用的由李（2004，2006）倡导的面板数据单位根检验方法与面板数据协整关系检验方法分别考虑了相关面板数据的跨横截面性质及相关面板数据之间的样本关联性，并据此获得了对应于相关单位根检验统计值及协整关系检验统计值之特定临界值（Specific Critical Value），从而相关实证分析建立在非常稳固的基础之上。为了验证这一点，在没有考虑到相关面板数据之跨横截面性质及相关面板数据之间的样本关联性的前提下，我们运用蒙特卡洛大样本实验获取了对应于本篇文章所考察的相关面板数据之样本范围的面板数据单位根检验或面板数据协整关系检验之通用临界值（General Critical Value）。

表11给出了相关通用临界值。比较表11中的通用临界值与表5、表6、表7、表8、表9和

表 10 中的特定临界值我们可以发现, 特定临界值的绝对值要大于通用临界值的绝对值。这就意味着通用临界值的使用可能会导致面板数据的非稳定状态这种假设被不恰当地否定。换句话说, 由于通用临界值的使用, 一组非稳定状态的面板数据有可能被错误地判定为是稳定的, 而一组本质上毫不相关的时间序列经济变量有可能被错误地判定为存在着长期稳定的协整关系。

现在我们来详细地考察一下若不恰当地依据通用临界值, 我们的经验结论是否会发生变化。就所考察的 6 个南亚国家的面板数据而言, 若依据表 11 给出的通用临界值, 由表 5 可知, 真实汇率在高于 1% 的显著性水平上可以被认为是稳定的。与此相对应, 由表 6 可知, 对应于方程式 (6a)、(6b)、(6c) 和 (6d) 而言, 名义汇率与相对价格水平之间的长期内在关联性是在 1% 而非 5% 的显著性水平上被确认, 从而购买力平价理论获得了更高层次的证实。特别的, 对应于依据特定临界值被判定为并非名义汇率与相对价格水平之间的长期协整关系之表述的方程式 (6e) 和 (6f) 而言, 若依据通用临界值, 则会分别在接近 5% 与接近 1% 的显著性水平上被错误地判定为是名义汇率与相对价格水平之间的一种长期协整关系之表述。由此我们可以判定, 通用临界值的使用会产生对实证分析结果的不准确解读。

另一方面, 就所考察的 8 个东南亚国家的面板数据或全部 14 个南亚及东南亚国家的面板数据而言, 若依据表 11 给出的通用临界值, 由表 7 与表 9 可知, 依然没有任何证据表明真实汇率可以被认为是稳定的, 而这与依据特定临界值所获得的经验结论保持了一致。不过, 由表 8 与表 10 可知, 对应于先前依据特定临界值被判定为并非名义汇率与相对价格水平之间的长期协整关系之表述的方程式 (6f) 而言, 则会在接近 5% 的显著性水平上被错误地判定为是名义汇率与相对价格水平之间的一种长期协整关系之表述。由此我们进一步确认, 通用临界值的使用可能会产生对实证分析结果的不准确解读, 而李 (2004, 2006) 倡导的计量分析方法是基于前人研究基础之上的适用于面板数据单位根检验与面板数据之间的协整关系检验的可靠方法。

五、总结性评论

为增强检验购买力平价理论的力度与可靠性, 基于最新发展起来的面板数据单位根检验方法与面板数据协整关系检验方法, 本文分别考察了覆盖 6 个南亚国家、覆盖 8 个东南亚国家、覆盖全部 14 个南亚及东南亚国家等三组面板数据。实证分析表明, 就南亚诸国作为一个整体而言, 长期内其货币与美元之间的真实汇率可以被认为是稳定的, 而相关的名义汇率与相对价格水平之间可以被认为存在着长期稳定的内在关联性, 从而证据表明相关各国货币与美元之间的汇率真实地反映出其相对购买力。然而, 就东南亚诸国作为一个整体甚至于南亚及东南亚所有

各国作为一个整体而言，长期内其货币与美元之间的真实汇率不可以被认为是稳定的而相关的名义汇率与相对价格水平之间不可以被认为存在着长期稳定的内在关联性，从而没有证据表明相关各国货币与美元之间的汇率真实地反映出其相对购买力。

我们的这些有别于先前经验发现的最新实证分析结果蕴含着两点重要的含义。其一，时间序列数据的相对跨度固然重要，但是其并非检验购买平价理论的决定性因素。问题的关键在于相关各国之间是否经由某种或多种必须的因素的作用而使得其货币之间的汇率恰如其分地反映了其相对购买力，而非时间跨度的长短。当然，我们并不否认各种必须的因素对各国货币之间的相对购买力平价的作用产生效果是需要时间的。其二，就我们所考察的南亚各国而言，其货币与美元之间的汇率在所考察的时期内正确地反映出其相对购买力，从而这些国家与美国之间拥有形成购买力平价所必须的某种或多种因素。但是，就我们所考察的东南亚各国而言，其货币与美元之间的汇率在所考察的时期内未能正确地反映出其相对购买力，从而这些国家与美国之间缺乏购买力平价的形成所必须的某种或多种因素，或者说这些必须因素的影响并非强大到足以维持相关各国货币之间的购买力平价。

那么，促成相关各国货币之间购买力平价的形成所必须的因素是哪些呢？我们知道，购买力平价理论的成立是有着其严格的前提条件的，即相关各国之间存在着通畅的贸易渠道以保证货物的跨境自由流动及不受限制的商品市场的套利活动。推此而广之，我们认为，只有当相关各国之间存在着经常性的、稳定与成熟的包括不仅商品贸易而且技术、文化、企业管理、政府运作等方面的交流与合作，从而各国之间不仅具备畅通的商品自由贸易渠道与人员自由往来渠道而且各国的消费偏好、技术水平、企业生产与管理方式、政府运作程序等逐渐趋同，从而对购买力平价理论的正确性可能会产生负面效应的非贸易商品的存在、跨国消费偏好差异、生产率差异、人均资本差异、政府的运作模式差异等因素随时间推移而逐渐减弱，从而购买力平价理论成立所必须的各种各样的前提条件获得充分的满足，长期内各国货币之间的名义汇率才能够正确地反映出各国的相对价格水平从而其货币的相对购买力，购买力平价理论的正确性才能够得到保证。换句话说，只有当相关各国之间存在着经由有意识的各种各样的跨境交流从而形成某种程度的内生收敛（Endogenous Convergence）态势的情况下，购买力平价理论的正确性才会更容易获得确认。根据这一理论猜想，在所考察的时期内，南亚各国与美国之间的内生的、有意识的商品贸易及其他形式的交流应该要比东南亚各国与美国之间的商品贸易及其他形式的相应交流更加成熟与稳定，各种汇率影响因素所产生的针对购买力平价的正面效应在整体上要大于相应的负面效应，从而南亚各国而非东南亚各国的货币与美元之间的汇率在所考察的时期内基本上正确地反映了其相对购买力。

表 6 名义汇率与价格水平之间的协整关系检验 (南亚 6 国)

$$P_{t-1} = \sum_{j=1}^p \eta_j P_{t-j} + \sum_{j=1}^q \lambda_j D_{t-j} + \alpha \cdot (P_{t-1} - P_{t-2}) + v_{t-1} \quad (1)$$

	方程式 ^①	方程式 ^②	方程式 ^③	方程式 ^④	方程式 ^⑤
α	0.1480	0.0466	0.0441	0.0441	0.0441
标准差	0.1331	0.1331	0.1331	0.1331	0.1331
ρ^2	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
名义汇率与价格水平的协整关系检验 ^③					
统计值	1.13407	1.13407	1.13407	1.13407	1.13407
统计值	1.01007	1.01007	1.01007	1.01007	1.01007
协整关系检验之特定临界值 ^④					
τ_{α}^*	1.13406	1.13406	1.13406	1.13406	1.13406
对应于 τ_{α}^* 统计值的临界值	1.13406	1.13406	1.13406	1.13406	1.13406
τ_{β}^*	1.1304	1.1304	1.1304	1.1304	1.1304
对应于 τ_{β}^* 统计值的临界值	1.01000	1.01000	1.01000	1.01000	1.01000
τ_{γ}^*	1.1304	1.1304	1.1304	1.1304	1.1304
对应于 τ_{γ}^* 统计值的临界值	1.01000	1.01000	1.01000	1.01000	1.01000

注：①对应于协整关系检验而言，相应的检验假设为每一方程式所表述的名义汇率与相对价格水平之间为非协整关系。否定这一假设的 α^* 、 β^* 和 γ^* 来标识。

②括弧中标明的是各组估计方程式之间的差异。譬如说， $\eta^1, \eta^2, \dots, \eta^6$ ，意味着我们假设相应估计方程式中所有国家具有同样的初始特征系数，而 $\eta^7, \eta^8, \eta^9, \eta^{10}, \eta^{11}, \eta^{12}$ ，则表明我们允许各国拥有独特的初始特征系数。同样道理， $\lambda^1, \lambda^2, \dots, \lambda^6$ 意味着我们假设相应估计方程式中所有国家具有同样的时间趋势特征系数，而 $\lambda^7, \lambda^8, \lambda^9, \lambda^{10}, \lambda^{11}, \lambda^{12}$ ，则表明我们允许各国拥有独特的时间趋势特征系数。其他限制性条件以此类推。

③如文中所述，对应于每一组方程式，我们的协整关系检验是通过对其回归分析残差进行单位根过程检测来完成。作为整个检验过程的一部分，在检验之前，每一组回归分析残差均被进行了相关数据转换。相应的 τ_{α}^* 统计值和 τ_{β}^* 统计值即运用李 (1985) 倡导的方法对相应的回归分析残差进行单位根过程检测所获取的一组统计值。

④对应于每一组 τ_{α}^* 统计值和 τ_{β}^* 统计值之特定临界值是通过 10000 次蒙特卡洛模拟实验得到的。如文中所述，我们的虚拟数据生成程序已经考虑到被考察中的每一组回归分析残差之跨截面性质并体现出处于考察中的诸宏观经济变量之间的样本关联性。

非常重要的、得益于最新的面板数据协整关系检验方法的一个连带的经验发现是时间趋势及独特的国家特征并非相关各国名义汇率与相对价格水平之间的长期内在关联性的一个决定性影响因素。特别的，独特的跨国时间趋势特征本质上就不是名义汇率与相对价格水平之间的长期内在关联性的一个因素。从特定意义上看，这一发现表明时间趋势及国家初始特征对南亚或东南亚各国货币与美元之间的汇率不应该、也确实不具有关键性影响，而独特的时间趋势特征根本就与南亚或东南亚各国货币与美元之间的汇率无关。从广泛意义上看，这一发现蕴含着时间趋势并非相关名义宏观经济变量之间的长期关系中的一个关键因素。由此推知，若时间趋势构成了某一特定宏观经济变量的长期走势的一个显著因素，则此变量必定包含有某种真实的成分。

表7 相关面板数据的单位根过程检验（东南亚8国）

$$\Delta \bar{z}_{i,t} = \rho_i \cdot \bar{z}_{i,t-1} + \sum_{j=1}^k \phi_{i,j} \cdot \Delta \bar{z}_{i,t-j} + \varepsilon_{i,t} \text{ ①}$$

	\bar{t} 统计值 $(\rho_i \neq \rho_i, \phi_{i,j} \neq \phi_j)$ $(i \neq 1; i, 1 = 1, \dots, 8)$ ②	t_p 统计值 $(\rho_i = \rho_i, \phi_{i,j} = \phi_j)$ $(i \neq 1; i, 1 = 1, \dots, 8)$
ln q	- 1. 113	- 2. 963
ln E	- 0. 991	- 2. 778
ln P* - ln P	- 1. 064	- 2. 398
各面板数据单位根过程检验的临界值 ③		
	1%	- 8. 137
ln q	5%	- 6. 877
	10%	- 6. 282
	1%	- 8. 011
ln E	5%	- 6. 819
	10%	- 6. 203
	1%	- 6. 820
ln P* - ln P	5%	- 5. 909
	10%	- 5. 491

注：①作为整个单位根检验过程的一部分，每一组原始面板数据 $z_{i,t}$ 均被进行了相关数据转换。具体来说， $z_{i,t} = z_{i,t} - \bar{z}_i$ ， $\bar{z}_{i,t} = z_{i,t} - \bar{z}_i$ ，其中， $\bar{z}_i = \left(\sum_{t=1}^T z_{i,t} \right) / T$ ， $\bar{z}_i = \left(\sum_{t=1}^N z_{i,t} \right) / N$ 。相关检验假设为 $\rho_i = 0$ ，即每一组被考察的面板数据都被假设为存在单位根过程。否定这一假设的1%，5%和10%的显著性水平分别由^a、^b和^c来标识。

②括弧中标明的是 t_p 统计值和 \bar{t} 统计值之获取方法的不同。如李（2004）所述， t_p 统计值是由对相关面板数据进行一次性回归分析而得到的一个针对 $\rho = 0$ 的 t 检验统计数据，而 \bar{t} 统计值则是经由对构成相关面板数据的每单个时间序列数据分别进行回归分析而得到的一个针对所有 $\rho_i = 0, i = 1, 2, \dots, N$ 的 N 个 t 检验统计数据的平均值。

③对应于每一组 t_p 统计值和 \bar{t} 统计值之临界值是通过 10000 次蒙特卡洛模拟实验得到的。相关虚拟数据生成程序已经考虑到被考察中每一组真实面板数据之跨横截面性质。相关 GAUSS 程序可向作者索取。

表9 相关面板数据的单位根过程检验（南亚及东南亚 14 国）

$$\Delta \bar{z}_{i,t} = \rho_i \cdot \bar{z}_{i,t-1} + \sum_{j=1}^k \phi_{i,j} \cdot \Delta \bar{z}_{i,t-j} + \varepsilon_{i,t} \text{ ①}$$

	\bar{t} 统计值 ($\rho_i \neq \rho_1, \phi_{i,j} \neq \phi_j$ $i \neq 1; i, j = 1, \dots, 14$) ^②	t_p 统计值 ($\rho_i = \rho_1, \phi_{i,j} = \phi_j$ $i \neq 1; i, j = 1, \dots, 14$)
ln q	- 1.239	- 3.905
ln E	- 1.188	- 3.708
ln P* - ln P	- 1.068	- 2.813

各面板数据单位根过程检验的临界值 ^③		
	1%	- 2.233
	5%	- 2.025
	10%	- 1.909
	1%	- 2.270
	5%	- 2.058
	10%	- 1.944
	1%	- 2.205
	5%	- 2.002
	10%	- 1.894

注：①作为整个单位根检验过程的一部分，每一组原始面板数据 $z_{i,t}$ 均被进行了相关数据转换。具体来说， $z_{i,t} = z_{i,t} - \bar{z}_i$ ， $\bar{z}_{i,t} = z_{i,t} - \bar{z}_i$ ，其中， $\bar{z}_i = \left(\sum_{t=1}^T z_{i,t} \right) / T$ ， $\bar{z}_i = \left(\sum_{i=1}^N z_{i,t} \right) / N$ 。相关检验假设为 $\rho_i = 0$ ，即每一组被考察的面板数据都被假设为存在单位根过程。否定这一假设的 1%、5% 和 10% 的显著性水平分别由^a、^b 和^c 来标识。

②括弧中表明的是 t_p 统计值和 \bar{t} 统计值之获取方法的不同。如李（2004）所述， t_p 统计值是由对相关面板数据进行一次性回归分析而得到的一个针对 $\rho = 0$ 的 t 检验统计数据，而 \bar{t} 统计值则是经由对构成相关面板数据的每单个时间序列数据分别进行回归分析而得到的一个针对所有 $\rho_i = 0, i = 1, 2, \dots, N$ 的 N 个 t 检验统计数据的平均值。

③对应于每一组 t_p 统计值和 \bar{t} 统计值之临界值是通过 10000 次蒙特卡洛模拟实验得到的。相关虚拟数据生成程序已经考虑到被考察中每一组真实面板数据之跨横截面性质。相关 GAUSS 程序可向作者索取。

表 10 名义汇率与价格水平之间的协整关系检验 (南亚及东南亚 14 国)

$$P_{t-1} = \sum_{j=1}^z \eta_j P_{t-j} + \sum_{j=1}^z \lambda_j D_{t-j} + \sum_{j=1}^z \alpha_j (P_{t-j} - P_{t-j-1}) + v_{t-1} \quad (1)$$

	方程式 ^①	方程式 ^②	方程式 ^③	方程式 ^④	方程式 ^⑤
α	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
标准差	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
η	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
λ	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
α	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
名义汇率与价格水平的协整关系检验 ^⑥					
统计值	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
统计值	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
协整关系检验之特定临界值 ^⑦					
η	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
λ	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
α	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
对应于统计值的临界值	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
η	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
λ	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
α	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
对应于统计值的临界值	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
η	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
λ	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
α	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000

注：①对应于协整关系检验而言，相应的检验假设为每一方程式所表述的名义汇率与相对价格水平之间为非协整关系。否定这一假设的 η 、 λ 和 α 的显著性水平分别由 η 、 λ 和 α 来标识。
 ②将弧中标明的是各组估计方程式之间的差异。譬如说， $\eta_1 \neq \eta_2, \lambda_1 \neq \lambda_2, \alpha_1 \neq \alpha_2$ ，意味着我们假设相应估计方程式中所有国家具有同样的初始特征系数，而 $\eta_1 = \eta_2, \lambda_1 = \lambda_2, \alpha_1 = \alpha_2$ ，则表明我们允许各国拥有独特的初始特征系数。同样道理， $\lambda_1 \neq \lambda_2, \alpha_1 \neq \alpha_2$ ，意味着我们假设相应估计方程式中所有国家具有同样的时间趋势特征系数，而 $\lambda_1 = \lambda_2, \alpha_1 = \alpha_2$ ，则表明我们允许各国拥有独特的时间趋势特征系数。其他限制性条件以此类推。
 ③如文中所述，对应于每一组方程式，我们的协整关系检验是通过对其回归分析残差进行单位根过程检测来完成的。作为整个检验过程的一部分，在检验之前，每一组回归分析残差均被进行了相关数据转换。相应的统计值和统计值即为运用李 (1997) 倡导的方法对相应的回归分析残差进行单位根过程检测所获取的一组统计值。
 ④对应于每一组统计值和统计值之特定临界值是通过蒙特卡罗模拟实验得到的。如文中所述，我们的虚拟数据生成程序已经考虑到被考察中的每一组回归分析残差之跨截面性质并体现出处于考察中的诸宏观经济变量之间的样本关联性。

表 11 相关面板数据单位根检验之通用临界值

		针对 \bar{t} 统计值的通用临界值	针对 t_p 统计值的通用临界值
N = 6 T = 34	1%	- 2. 315	- 5. 375
	5%	- 2. 074	- 4. 748
	10%	- 1. 951	- 4. 408

N = 8 T = 34	1%	- 2. 220	- 5. 856
	5%	- 2. 006	- 5. 169
	10%	- 1. 889	- 4. 809

N = 14 T = 34	1%	- 2. 033	- 6. 803
	5%	- 1. 867	- 6. 192
	10%	- 1. 785	- 5. 879

注：本表中的临界值是通过 10000 次蒙特卡洛模拟实验获取的。如文中所述，我们假设构成相关面板数据的每单一时间序列数据的扰动项之间具有同质性并且不存在相互关联。若现实世界中的相关面板数据能够满足这种理想假设，本表中所给出的临界值既可以运用于面板数据单位根过程检验，也适用于基于回归分析剩余的面板数据之间的协整关系检验。

参考文献

- [1] Engle , Robert F. and Granger Clive W. J. , “ Cointegration and Error Correction : Representation , Estimation and Testing , ” *Econometrica* , 55 , March 1987 , pp. 251 - 276.
- [2] Rogoff , Kenneth , “ The Purchasing Power Parity Puzzle , ” *Journal of Economic Literature* , June 1996 , 34 , pp. 647 - 668.
- [3] Sweeney J. Richard 和李志宏 , “ 跨国生产函数之普适性的实证分析 ” , 《经济学 (季刊)》 , 2004. 1。
- [4] 李志宏 , “ 面板数据单位根检验的一个简明蒙特卡洛实验框架 ” , 《数量经济技术经济研究》 , 2004. 11。
- [5] 李志宏 , “ 跨国经济增长：同质性或异质性 ? ” , 《新政治经济学评论》 , 2005. 4。
- [6] 李志宏 , “ 面板数据协整关系检验的一个简明蒙特卡洛实验框架 ” , 《数量经济技术经济研究》 , 2006. 7。

Long Run Purchasing Power Parity : Evidence from South Asia

Li Zhihong

(USTC)

Abstract : Single time series unit root tests reveal that almost none of the real exchange rates between the currencies of South and Southeast Asian countries and the U. S. dollar is stationary during the 1970—2003 period , while single time series cointegration tests report that there is no long run cointegrating relationship between almost any of the nominal exchange rates between the currencies of South and Southeast Asian countries and the U. S. dollar and any of the relevant relative price levels during the period considered. On the other hand , panel unit root tests reveal that as to South Asian countries as a group but not Southeast or South and Southeast Asian countries as a group are concerned , the real exchange rate between their currencies and the U. S. dollar is stationary during the period under consideration , while panel cointegration tests accounting for the underlying sample variable correlation report consistent results , i. e. , as to South Asian countries as a group but not Southeast or South and Southeast Asian countries as a group are concerned , the nominal exchange rate between their currencies and the U. S. dollar is cointegrated with the relevant relative price level in the long run. Accordingly , although the span of time series data is important , it does not seem to be the crucial factor in testing purchasing power parity theory , and long run purchasing power parity can be fundamentally viewed as a result of endogenous economic convergence. Furthermore , empirical analyses reveal that time trend is not a key factor in the long run relationship between relevant nominal economic variables. Hence , if time trend constitutes a significant component in the long run movement of a specific economic variable , the variable must embody something real.

Key Words : Panel Data ; Unit Root Test ; Purchasing Power Parity

JEL Classification : F31 , C15 , C23

产权安排、经营者特征与企业效率

——关于中国制造业的实证研究

赵世勇*

摘要：企业经营者的能力和激励对企业的效率和竞争力是至关重要的，解决这个问题是国有企业改革的关键所在。本文运用中国社会科学院经济研究所的企业调查数据，以制造业为研究对象，对企业的产权安排、经营者的特征和企业的效率进行了研究。本文的研究验证了两个假说：其一，国有企业的经营者选择机制与效率是背离的；其二，国有企业经营者的激励机制与效率是背离的。也就是说，国有企业经营者的能力和努力水平都低于非国有企业。文章指出，这些都是国有企业的产权制度内生的结果。所以，成功的国企改革不是“改进”，而是“改变”，即民营化。

关键词：产权安排；经营者选择机制；经营者激励机制

一、引言

改革开放以来，中国近30年的经济自由化、价格市场化和企业民营化的改革，给中国的社会经济结构带来了巨大的变化。改革开放之初，国有经济一统天下；新世纪之初，国有、民营和外资“三足鼎立”（中华全国工商联，2005；赵世勇，2006b）。国有企业的改革一直处于中国经济体制改革的中心环节，特别是20世纪90年代中后期以来，国有企业的产权改革（民营化）步伐加快，国有资本在“抓大放小”方针的指引下逐渐从竞争性行业退出，非国有资本特别是私人资本和外商资本（包括港澳台资本）以相当快的速度进入了大部分竞争性的制造业领域，制造业出现了多种产权类型企业并存的局面。

大量不同产权安排企业的并存和发展，为人们观察、理解不同产权制度的效率含义提供了

* 赵世勇，中国社会科学院经济研究所微观经济学研究室。通讯地址：北京西城区月坛北小街2号经济所微观室，邮编，100836。作者感谢中国社会科学院经济研究所微观经济学研究室的课题资助。本文的写作得益于微观经济学研究室诸位同事的评论意见，在此表示感谢。文中可能的错误和疏漏由作者本人承担。

绝好的机会。在计划经济体制下，人们对国有企业的低效率有切肤之痛；改革开放以来，人们发现，虽然有各种各样的改革措施，国有企业的效率低于各类非国企仍是不争的事实。这在国有企业民营化和非国有企业蓬勃发展的大背景下格外明显。为了验证国企效率低于非国企这个假说，大量的学者投身到这一领域，出现了浩如烟海的文献（姚洋，1998；刘小玄，2000，2004；赵世勇，2006b；胡一帆等，2006）。这些实证研究证实了国企低效率的假说，使国企效率低于非国企成为一个现象。

既然是一个现象——而且这个现象在中国经济转轨的过程中具有非常重要的理论和现实意义，那么就需要给出经济学上的解释。因为，作为一门科学，经济学的主旨是解释现象，而国企低效率这个现象已经肯定地存在了。所以，也不难理解，解释这个现象的文献也是汗牛充栋，得到的理论假说也是异彩纷呈。比如，有学者从根本上否认国企低效是一个制度问题，认为国企低效是因为国有企业存在政策性负担，从而面临的是一个不公平的竞争环境（林毅夫等，1997）。有学者则从新制度经济学的视角出发，指出国企低效是因为国企不是私产的拥有者自由选择的结果，而且权利不能自由转让，导致国有企业的交易费用非常高昂，从而效率低下（张五常，1987）。也有学者更具体地指出，国有企业的效率低下是因为国有企业的制度安排无法有效解决经营者选择机制和激励机制，从而无法使真正具有经营才能的人占据经营者岗位，并努力工作；这个解释隐含的假定是经营者对企业效率具有根本的决定性作用（张维迎，1999）。当然，不同的假说会推出不同的政策建议，这不是本文的重点，故不赘述。

上述理论假说的争论更多的是在自然语言和政策层面上进行的，对上述假说进行严格的数学论证和严谨的实证分析的文献尚不多见。数学论证方面，赵世勇（2004，2006a）模型化了张维迎（1999）的假说，得出了国有企业的经营者选择机制和激励机制与企业效率背离的假说，并进一步细分为两个逻辑推论。其一，国有企业经营者的能力低于非国有企业；其二，国有企业经营者的工作努力程度低于非国有企业。实证研究方面，刘德强（2002）利用自己调查所得的钢铁行业的数据，验证了国企经营者能力和努力不足的假说。

国有企业经营者的能力和努力水平低于非国有企业的假说背后的逻辑来自新制度经济学。新制度经济学的核心结论是“制度是重要的”；其逻辑链条是：制度安排（产权）决定激励机制，激励机制决定人的行为，人的行为决定经济效率或绩效。因此，产权安排首先决定了人的行为（或特征），然后通过人的行为来决定企业效率或绩效。国企效率低必定是人的行为的内生结果。在与企业有关的各类人员中，经营者对企业而言当然是最重要的人，其类型和行为（与普通员工相比）对企业效率具有决定性。

因此，如果我们能够验证国企经营者的能力和努力水平低于非国企，那么国有企业的经营者选择机制和激励机制与企业效率背离的假说就能得到证实。这正是我们这篇文章希望做的工作。我们在整理文献的过程中发现，验证这一假说的文献非常少，只有上面提到的刘德强（2002）利用独自调查的钢铁行业的108家企业5年的数据，验证了这个假说。

受数据的限制，刘德强（2002）只研究了钢铁工业企业，所得到的结论是否具有普遍性还有待于用更多的样本、对更多的行业进行研究。并且，刘德强（2002）的研究数据截止到1999年，距我们的数据截止的2004年，已有5年的时间，不同产权类型企业之间是否还存在较大的差异，也是一个需要验证的问题。

我们通过使用独自调查的制造业数据，对不同产权安排的企业的经营者特征对企业效率的影响做了实证研究。我们的研究结果强烈支持刘德强（2002）的结论，从而通过不同的数据库验证了同样的假说：国有企业的经营者选择机制和激励机制与企业效率是背离的，也就是说，国有企业经营者的经营能力和工作努力低于非国有企业。这是产权内生的结果。

本文下面的安排如下。第二部分是数据来源及其说明；第三部分展现不同产权类型企业经营者的特征；第四部分提出假说；第五部分使用柯布-道格拉斯生产函数进行分析，验证假说；第六部分是本文的结论。

二、数据来源说明与控制变量分析

我们的数据来源于中国社会科学院（CASS）经济研究所微观经济学研究室2005年开展的企业问卷调查（企业填报的是2004年的数据）。这次调查采用随机抽样的方式，在江苏无锡（长三角）、辽宁沈阳（东北）、四川成都（西南）、河南郑州（中原）和广东江门（珠三角）五个城市各抽取了200多家企业，共同组成了一个由1022家企业组成的数据库，这个数据库就是我们在本文中进行分析的数据来源（以下简称CASS数据库）。

我们研究的目的是考察不同产权类型企业的经营者特征对企业效率的决定作用，所以区分产权变量很重要。根据国家统计局现行的统计口径和我们问卷的设计，共有14种工商注册类型。为了简化分析，我们把相同或接近的注册类型进行了合并，由原来的14种合并为5种。具体如下，（1）国有企业（包括国有企业、国有独资公司）；（2）集体企业；（3）股份企业（包括股份合作企业、其他有限责任公司、股份有限公司）；（4）私营企业（包括私营独资企业、私营合伙企业、私营有限责任公司、私营股份有限公司）；（5）外资企业（包括港澳台商投资企业和外商投资企业）。工商注册为“联营企业”和“其他企业”的样本量极少，我们在研究

中排除了这两种相对不重要的产权类型的企业。最终我们有 997 个样本。我们在文中的产权安排变量就是根据合并之后的五种注册类型定义的 (参见表 1)。

表 1 样本企业的注册类型分布

企业类型	样本量 (家)	百分比 (%)
国有企业	119	11.9
集体企业	90	9.0
股份企业	294	29.5
私营企业	357	35.8
外资企业	137	13.7
全部企业	997	100.0

资料来源：CASS 数据库。下同。

为了更好地检验在不同产权制度企业中，经营者的特征对企业效率的影响，我们需要控制一些与企业特征有关的变量。根据问卷的设计，我们试图控制的企业变量有两个：企业规模和企业投产年数。

我们根据问卷设计将企业规模分为大型、中型和小型企业。样本企业中，国有企业有接近 20% 的企业为大型企业，另外中型和小型各占 40% 左右。集体企业和私营企业中，大型的比重低于 1%，而小型的比重均高于 85%。股份企业和外资企业中，有 30%—40% 的企业为中型企业 (参见表 2)。在回归模型设计中，我们以小型企业为参照系，考察大型和中型对企业产出效率的影响。因为集体企业和私营企业中大型企业的比重微不足道，所以对这两类产权企业进行回归时，我们只考察了中型企业对企业产出的影响。

表 2 样本企业的规模分布 (%)

企业类型	企业规模		
	大型企业	中型企业	小型企业
国有企业	18.5	40.3	41.2
集体企业	0	13.3	86.7
股份企业	8.2	33.0	58.8
私营企业	0.6	14.3	85.1
外资企业	2.2	41.6	56.2

企业的投产年数在一定程度上反映着企业的技术与制度，对国有企业而言，还在一定程度上反映着企业的政策性负担。样本企业的描述统计发现，样本中国有企业的平均投产年数为 36 年，集体为 20 年，股份为 16 年，私营为 12 年，外资则不到 10 年 (参见表 3)。需要指出的是，对于改制企业来说，因为存在着理解上的问题，对这一问卷问题的回答未必十分准确。因为投

产年份可以理解为改制之前企业的投产年份，也可以理解为改制之后企业的投产年份。不过，因为样本中改制企业比重很小，而且作为连续型的控制变量，这个误差影响不大。而且，从企业分产权类型的平均投产年数来看，基本符合人们的直觉，甚至在一定程度上反映了中国改革开放以来的企业制度变迁。

表3 样本企业的平均投产年数

企业类型	平均投产年数（年）
国有企业	36.41
集体企业	20.09
股份企业	15.87
私营企业	12.57
外资企业	9.71

三、样本企业经营者的特征及变量选取

描述企业经营者的特征有很多方面（维度），但文献中特别关注的是两个维度：一个是经营者的能力（或企业家能力），另一个是经营者的努力程度（钱颖一，2002）。经营者的能力主要指经营决策能力，尤其是在激烈的市场竞争中捕捉市场机会的能力，或者一般地概括为处理不确定性的能力。它在很大程度上取决于个人的“机灵”（Kirzner，1979）、“想像力”（Shackle，1979）、“判断力”（Casson，1982）以及“创新”^①（Schumpeter，1934）等。努力则主要指经营者尽职尽责工作的程度，包括个人的责任心和职业道德等因素。根据新制度经济学的研究结论，经营者的能力和努力水平决定于企业的经营者的选择机制和激励机制，而后者内生于企业的制度安排，也就是产权安排。由于企业经营者的能力和努力都很难直接观察，所以在做实证研究的时候，我们不得不采用与经营者能力和努力有关的间接指标来分析。

实际上，严格来说，经营者本身都不是一个很好定义的概念。广义地讲，企业经营者包括董事会和监事会在内的决策层和管理层人员。^②无疑，这些人员之间也有分工，他们对企业效率的作用也不尽相同，那么经营者到底指谁？为了避开这个困扰，同时也为了实证研究的方便，

^① 熊彼特所指的“创新”包括“引进新的产品，新的技术，新的生产方法，控制原材料的新供应来源，实现企业的新组织”。

^② 包括 CEO、总裁、董事会主席、首席运营官（COO）、常务副总裁（EVPS）、高级副总裁（SVP）、首席财务官（CFO）、首席技术官（CTO）以及首席信息官（CIO）等。

中国社会科学院经济研究所微观经济学研究室在进行问卷设计时，巧妙地用“一把手”作为企业的经营者代表。“一把手”这个词在中国的语境中有特定的含义，首先它表示一个人（而不是一个团队）；其次这个人“说了算”的人，也就是重大决策最后拍板的人，无疑也是对企业决策和效率影响最大的人。在不同产权类型的企业中，甚至在同一产权类型的不同企业中，这个“一把手”在企业中的职位可能不同，他可能是企业的总经理（厂长）、董事长（董事局主席）、党委（支部）书记，或者是一身兼二任甚至三任。无论如何，一把手应该是企业中最重要的人，也是对企业决策影响最大的人。我们在本文的分析中，经营者一律指的是问卷中的“一把手”，而不是指整个经营管理层。

（一）经营者的年龄和在职年数

样本企业经营者的年龄 80% 集中在 40—59 岁，正所谓年富力强。相对而言，国有企业经营者的年龄更加集中，有近 90% 的国企经营者集中在 40—59 岁。60 岁以上的经营者所占比重，国有企业最低，集体企业最高。因为长期以来，国企经营者一直按国家干部对待，国企的经营者大多是由政府部门来任命（所谓“党管干部”的原则）。国企经营者年龄层相对集中，而且 60 岁以上所占比重最低，这表明选拔干部的“四化”标准^①中“年轻化”得到了较好的贯彻。在 40 岁以下的年龄组中，私营企业所占比重最高，这也说明私营企业有较多的青年才俊（参见表 4）。从国际比较的视角看，我国企业的经营者相对还是比较年轻的（刘德强，2002）；当然这也与我国企业（特别是私营企业）的年龄相对较短有关系。

表 4 样本企业经营者年龄的分布

	经营者年龄（%）				
	20—29 岁	30—39 岁	40—49 岁	50—59 岁	60 岁及以上
国有企业	0	7.6	47.5	41.5	3.4
集体企业	2.2	5.6	37.8	42.2	12.2
股份企业	1.0	10.5	43.9	39.1	5.4
私营企业	1.1	15.1	43.7	35.3	4.8
外资企业	1.5	11.0	43.4	36.0	8.1
全部企业	1.1	11.5	43.6	37.9	5.9

经营者年龄可以看做是反映经营者激励机制和努力程度的一个重要指标。一般而言，在任何产权类型的企业中，年轻人往往有更强的事业心，都希望闯出一番事业，获得周围人和社会

^① 选拔干部的“四化”标准是“革命化、年轻化、知识化和专业化”。

的认可或承认。年轻人有更长远的预期，也有更多的晋升机会，所以逻辑上，年轻人有更强的积极性努力工作，把企业做好。相对来说，年龄偏大的经营者更保守。或者说，年轻人创业的倾向高一些，而年纪较大的人守成的倾向大一些。创业有风险，守成也可能失去市场机会。所以，如果不指明特定情况，我们无法肯定创业和守成哪个对企业更好；或者说，在一般意义上，我们不能肯定年龄对企业效率的影响方向。

经营者的努力程度从根本上内生于企业的激励机制和产权制度。如果企业经营者享有合法的剩余索取权，那么经营者的偷懒行为将在很大程度上得到抑制。在私有产权制度下的企业，其经营者享有的剩余索取权往往随着经营者年龄和业绩的提升而增加，而且退休还可以因为拥有企业股权而继续得到好处。所以我们推测，私营企业经营者的年龄与其激励和行为之间并不敏感。但是，如果制度不能保护事业心，那么年轻人的事业心、职业道德和奋斗精神会随着时间推移而递减，而攫取控制权收益（如在职消费等）的倾向会上升。因为在我国国有企业的制度安排中，经营者不享有合法的剩余索取权，而在没有特殊情况下经营者60岁必须退休，这使得国有企业经营者的年龄与其激励和行为较为敏感，乃至出现众所周知的“59岁现象”。因此，我们有理由在模型中把企业经营者年龄作为描述经营者工作激励的一个指标。

经营者的在职年数是一个反映经营者能力的重要指标。根据人力资本理论，一个人获取知识和能力大致可以通过两个途径：其一是学校的正规教育和培训；其二是所谓“干中学”（learning by doing）。^①两个途径对一个人知识和能力的提升，不同行业有不同的程度。具体到企业经营者而言，在职时间越长，其对市场和企业的情况了解也就越多、越深，经验也就越丰富，那么他的经营能力应该越好，至少不会更差。也就是说，逻辑上，经验至少不会降低一个人的能力，但经验是否会显著提升经营者的能力，我们不敢肯定。因为现代企业理论表明，与生产一线员工相比，经营者的经营能力中先天的因素更重要，干中学的因素相对次要一些。所以，其他条件不变的情况下，经营者在职年数与企业效率之间的关系是否显著，我们无法事先肯定。但无论如何，我们有理由把经营者的任职年数作为衡量其经营能力的一个指标。

从样本企业的描述统计来看，样本企业经营者的任职年数平均为7年。其中，国有企业最短，为5.7年，集体企业最长，为10.1年；其他类型企业大致在6—8年。显然，相对而言，

^① 除了学校教育和“干中学”外，李新春（2000）还指出，“转工（turn over）或在职学习”——通过在职或转换工作而观察实习企业家经营管理的知识——也是企业家能力增加的途径；我们认为，转工和在职学习可以归结为教育和干中学，不必单列。

国有企业的经营者更换频率最高（参见表5）。

表5 样本企业经营者的在职年数

企业类型	在职年数（年）
国有企业	5.7
集体企业	10.1
股份企业	6.3
私营企业	7.6
外资企业	6.0
全部企业	7.0

（二）经营者的政治面貌和文化程度

样本企业中有近63%的经营者是中共党员；这个比重国有企业最高，达94%。这说明国有企业经营者的任命标准中，中共党员是重要的标准。国企经营者94%是中共党员，表明选拔干部“四化”标准中“革命化”得到了较好的贯彻。近几年来，国有企业开展的“四好”领导班子创建活动，也把“政治素质好”摆在头等重要的位置。^①值得关注的是，私营企业也有超过半数的经营者是中共党员；我们猜测，这可能是因为2002年中共十六大通过的党章修正案决议允许私营企业主入党，另一方面也反映了政府和政治对经济活动的影响不容低估（参见表6）。我们认为，虽然政府部门在任命国企经营者时大多会考虑党员这一因素，并且私营企业主也希望加入中共共产党，但这基本反映了我国的政治制度和政策环境，而与经营者个人的能力和努力并没有什么逻辑上的关系。

表6 样本企业经营者中中共党员比重

企业类型	是中共党员的比重（%）
国有企业	94.0
集体企业	70.0
股份企业	70.2
私营企业	52.0
外资企业	43.7
全部企业	62.9

根据人力资本理论，我们有理由把经营者的学历作为衡量其能力的重要指标，毕竟学校教

^① “四好”指的是“政治素质好、经营业绩好、团结协作好、作风形象好”。具体说，就是在国企领导人“四好”创建活动中，要求选拔那些政治上靠得住、工作上有本事、作风上过得硬、职工群众信得过的优秀经营管理者（详细参见《经济日报》2007年1月19日第一版）。

育是获取知识的重要途径，比如 MBA 教育就是为企业培养职业经理人。一个人所受的教育越多，他的思维能力和分析能力应该越好，知识面应该越宽。当然，逻辑上是如此，但是经营者的学历和企业效率有没有显著的关系，还需要实证研究的检验。

从样本企业的描述统计来看，经营者的学历水平基本都在大专以上，本科及研究生的比重也已经占到了 36%。相对来看，国有企业经营者的学历层次显然高于其他产权类型企业；国有企业经营者大专及以上学历的占 92%，本科及以上学历的占到了 60%；国企经营者学历高中以下比例最低，不到 1%，本科以上最高，接近 1/4。这反映了选拔干部“四化”标准中的“知识化和专业化”得到了较好的贯彻。当然，学历和知识并不能完全画等号，但是在知识不可直接观测的情况下，学历是最直接的、也是最可操作的指标（信号）。经营者中高中及高中以下的学历主要集中于集体企业和私营企业，这也跟我们的直觉一致（参见表 7）。

表 7 样本企业经营者的文化程度

	经营者文化程度（%）				
	初中及以下	高中	大专	本科	研究生
国有企业	0.8	6.8	32.2	36.4	23.7
集体企业	7.8	30.0	44.4	14.4	3.3
股份企业	6.5	15.7	35.2	27.0	15.6
私营企业	11.4	32.2	34.2	15.4	6.7
外资企业	2.9	11.0	33.8	34.6	17.7
全部企业	7.2	21.2	35.1	23.8	12.5

注：这里的研究生包括硕士研究生、博士研究生和 MBA。

（三）经营者的报酬激励制度

经营者的激励机制有很多，比如内部晋升、控制权收益等，但报酬激励无疑是最根本也是最重要的激励机制之一。报酬包括工资收入和剩余索取权的分享（股权和期权等）。根据美国行为科学家赫茨伯格（F. Herzberg）的双因素理论，工资收入属于保健因素，而剩余索取权则属于激励因素。我们这里重点考察的是激励因素。

比较来看，国有企业对经营者的报酬激励制度与其他产权类型企业有明显不同（参见表 8）。国有企业采用最多的报酬激励制度是“根据对企业当年各项绩效指标的综合考核来确定当年的浮动工资额”，这个综合考核毫无疑问比较模糊。与之相比，其他四类非国有企业最主要采用的报酬激励制度都是“根据年度利润的增长情况提取一定比例的奖励”。这说明国有企业的经营者基本上还没有合法的剩余索取权，参与分享利润的经营者不到 20%。

表8 样本企业对经营者实行的报酬激励制度

	报酬激励制度实行的百分比 (%)						
	制度 (一)	制度 (二)	制度 (三)	制度 (四)	制度 (五)	制度 (六)	制度 (七)
国有企业	19.7	12.3	45.9	0.8	4.9	0.8	15.6
集体企业	37.3	26.5	26.5	0	1.0	2.9	5.9
股份企业	35.3	14.9	34.8	0	1.4	1.4	12.2
私营企业	42.2	18.3	20.0	0.9	1.6	5.5	11.5
外资企业	43.4	13.8	30.2	1.3	1.3	1.9	8.2
全部企业	37.5	16.8	29.1	0.6	1.8	3.0	11.2

注：制度 (一) 根据年度利润的增长情况提取一定比例的奖励；

制度 (二) 根据销售额的增长情况提取一定比例的奖励；

制度 (三) 根据对企业当年各项绩效指标的综合考核来确定当年的浮动工资额；

制度 (四) 按未来 (如离任后几年内) 企业利润的增长率提取奖励；

制度 (五) 按脱困减亏指标的实现情况确定奖励；

制度 (六) 上缴固定的费用或租金后获取企业的全部净盈余；

制度 (七) 股权、期权及其他。

(四) 经营者在企业中的任职情况

根据前面的交待, 我们的问卷用“一把手”代表企业的经营者, 具体到一把手在企业中的任职, 根据样本企业的描述统计, 平均而言, 企业的一把手在企业中的任职为总经理或者董事长兼总经理, 分别接近 37% 和 30%。具体来说, 一把手是党委书记或者兼任党委书记的比例国有企业最高, 为 38%; 外资企业最低, 不到 4% (参见表 9)。这实际上反映了在不同产权安排的企业中, 实质的控制权在企业不同职务之间的分布情况。企业的控制权到底应该集中在一个人手中, 还是应该分散制衡, 理论上没有定论, 实际情况也是因具体企业的具体情况而定。另外, 有一点可以肯定的是, 如果经营者兼任党委书记, 那么他一定是中共党员, 所以经营者任 (包括兼任) 党委书记与他是中共党员必定高度相关, 为了避免多重共线性, 二者不可以同时进入模型一起回归。

表9 样本企业经营者 (一把手) 的任职情况

企业类型	任职情况 (%)			
	董事长	总经理	董事长兼总经理	党委书记 (包括兼任)
国有企业	8.6	43.1	10.3	37.9
集体企业	5.6	59.6	12.4	22.3
股份企业	17.7	26.5	33.3	22.4
私营企业	13.2	37.0	34.2	15.7
外资企业	24.3	38.2	33.8	3.6
全部企业	14.8	36.8	29.1	19.3

（五）经营者的来源和选任方式

逻辑上，企业经营者的来源对企业效率有影响，这也是不难理解的。因为跟“空降帅”相比，一般来源于企业内部（比如内部晋升等）的经营者对企业的情况大都比较了解，而且也往往更有感情，所以从客观的能力和主观的激励上都比外部的有优势。当然，这只是逻辑上的推理；实际上能否成立还要看实证检验的结果。

因为问卷设计比较详细，为了分析方便，减少模型中变量的个数，我们进行了归纳合并。我们把“前任经理留任”、“高管人员晋升”和“创业者自任”三种类型合并为“来源于企业内部”，以区别于来源于外部的“空降帅”。从样本企业的统计描述来看，有超过70%的企业经营者都是来自于企业内部，这个比例在不同的产权类型企业中区别不是很大。来源于企业内部的比例最高的是私营企业，为86%；最低的是外资企业，为53%。可见，外资企业中“空降帅”的比重最高，私营企业中聘用职业经理人的情况最少——当然这在一定程度上和我国私营企业的发展历史和阶段有关。

值得指出的是，集体企业中经营者是创业者自任的比重高达35.6%，仅低于私营企业，远高于国有企业，这说明同为公有制企业，集体企业经营者的来源、行为与国有企业经营者会有显著的差异，进而企业的效率也会有显著的差异（邹至庄，2005）。^①而且我们猜测，这些集体企业中很大部分是“红帽子”企业（具体请参见表10）。

表10 样本企业经营者的来源

	来源于企业内部（%）			三类加总
	前任企业经理留任	企业高管人员晋升	企业创业者自任	
国有企业	18.6	44.9	4.2	67.7
集体企业	7.8	25.6	35.6	69.0
股份制企业	18.7	18.0	32.3	69.0
私营企业	14.8	6.7	65.0	86.2
外资企业	6.7	14.1	31.9	52.7
全部企业	13.7	17.3	40.7	71.7

注：来源于企业内部包括“前任企业经理留任”、“企业高管人员晋升”以及“企业创业者自任”；企业外部包括“政府官员调任”、“其他企业调任”、“从社会上招聘”、“控股大股东派遣”以及“外部自然人大股东自任”。

企业经营者的选任方式也是决定经营者能力的一个重要因素，在这方面，国有企业与非国

^① 关于这一点，洪银兴和袁国良（1997）曾做过乡镇企业和国有企业的比较研究。虽然不是所有的乡镇企业都是集体性质的，但是二者重合的比例很高。

有企业存在很大的区别：国企经营者的政府主管部门任命制度和非国有企业的投资者（或董事会）任命是两个不同的制度安排，二者的效率含义从理论上来说是明显的。根据样本的描述统计，仍然有 90% 以上的国有企业的经营者需要主管部门任命或批准，其中超过 3/4 的国企经营者需要主管部门任命；在这方面，同样作为公有制企业的集体企业也有 70% 以上的经营者需要主管部门任命或批准。其他产权类型企业的经营者的选任方式则主要是由董事会、控股股东或者主要出资人决定，无需主管部门批准。此外，外资企业中控股大股东派遣经营者的比重为 27%，国有企业中政府官员调任为经营者的占 7%^①（参见表 11）。

表 11 样本企业经营者的选任方式

企业类型	主管部门任命或批准 (%)	最主要的选任方式及比重 (%)
国有企业	90.6	主管部门任命 (75.2)
集体企业	71.1	主管部门任命 (55.6)
股份企业	27.8	董事会聘任, 无需主管部门批准 (33.3)
私营企业	6.8	控股股东或主要出资者决定 (49.6)
外资企业	16.2	董事会聘任, 无需主管部门批准 (40.4)
全部企业	30.1	—

注：主管部门任命或批准的情况包括“主管部门任命”、“董事会聘任，主管部门批准”、“职工代表（大会）选举，主管部门批准”。不需主管部门批准或任命的情况包括“控股股东或主要出资者决定”、“董事会聘任，无需主管部门批准”、“职工选举，董事会批准”、“职工代表（大会）选举，无需主管部门批准”以及其他情况。

四、假说的提出：理论逻辑与推论

日常观察和普通常识告诉我们，“好”的企业往往有一个“好”的一把手。前一个“好”指的是效率高、竞争力强；后一个“好”指的是能力强、工作努力。也就是说，“好”领导内生了“好”企业，经营者能力强、工作敬业是企业有竞争力的必要条件。那么，又是什么内生了“好”领导呢？这是一个现代企业理论的问题。

现代企业理论认为，企业制度或者所有权安排要解决两个问题：其一，给定企业生产是技术上不可分的团队生产^②，有什么办法使每个人都有积极性努力工作，而不是偷懒；其二，给定经营者能力不可直接观测，有什么制度安排能使最有经营才能的人（而不是庸才）占据经营者岗位。现代企业理论把前者叫做“激励机制问题”，后者叫做“经营者选择机制问题”（张维

① 为了减少篇幅，我们没有把 27% 和 7% 这两个数据放在表 11 中。

② 这个视角来源于 Alchian 和 Demsetz (1972)。他们认为，企业的特征是团队生产 (team production)，团队生产的特征是技术上不可分 (technological un-separable)。

迎, 1999)。其实, 这两个问题都可以归结为激励机制问题, 区别在于, 前者解决的是代理人(经营者)的激励机制问题, 后者解决的是委托人(股东或政府官员)的激励机制问题。所谓委托人的激励机制问题, 就是让有权选择、任命经营者的人有积极性去选择那些高能力、高素质的经营者。因此, 我们可以一般地说, 企业所有权安排要解决的核心问题是一个激励机制问题。

上述企业所有权安排要解决的两个问题并不是同等重要。由于经营工作的性质, 我们认为对一个企业来说, 经营者的“能力”往往比“努力”更为根本、更为重要。毕竟, “只要有适度的激励, 每一个人都会努力工作, 但只有少部分人才能成为称职的企业家或管理人员”(张维迎, 1999, 第113页)。换句话说, “努力”可以通过适当的激励实现, 但“能力”却往往“可遇不可求”——所谓“千军易得, 一将难求”^①。从这个意义上来说, 我们认为对企业所有权安排要解决的这两个问题而言, 解决经营者的选择机制比解决经营者的激励机制更为根本、更为重要。实际上, 如果我们把视角从企业转向其他类型的组织, 我们会发现“如何选人”和“如何激励人”是所有经济组织都存在从而都需要解决的两大问题。

现代企业理论表明, 企业所有权安排是通过“剩余索取权和控制权的对应”来解决上述两个问题的; 也就是说, 企业剩余索取权和控制权的对应是企业效率最大化的必然要求(Harris and Raviv, 1989; Milgrom and Roberts, 1992)。那么在实际的制度安排中, 这个对应的原则是如何实施的呢?

在私产制度下, 以股份公司为例, 作为委托人的资本所有者(股东)拥有选择和监督经营者的权力——通过董事会, 股东是自己投入企业的非人力资本的所有者, 所以从自身利益出发, 肯定有积极性选择自己认为合格的经营者的。从剩余索取权和控制权对应的角度看, 股东天然拥有剩余索取权, 那么他们所拥有的任免经营者的权力则是企业的最终控制权。所以, 剩余索取权和控制权在委托人(股东)一方是对应的。因此, 从经营者选择机制来看, 私产制度下的股份公司基本不存在问题: 委托人既有积极性, 也有权力去选择、任命真正具有经营能力的经营者。

经营者天然拥有控制权——企业的经营决策权, 如果经营者不享有合法的剩余索取权, 那么他的控制权就是廉价的。私有产权下的股份公司的安排是让经营者分享剩余索取权——给经营者股权和期权等, 剩余索取权和控制权在代理人(经营者)一方是对应的, 这使得经营者从自我利益激励的角度有积极性努力工作。此外, 私产制度下, 企业剩余索取权是可以转让的,

^① 资本所有者把钱借给企业而不是自己亲自经营, 并不是相信别人比自己更能干, 而是相信别人比自己更有经营能力, 从而自己能获得更大的回报。

股东在资本市场上“用脚投票”可以有效地监督经营者。这使得经营者从被监督激励的角度有积极性努力工作。

在国有产权制度下，国有企业的经营者选择权力落在政府官员手中，政府官员拥有选择、任命和监督国企经营者的权力。但是，国有企业的剩余索取权和控制权在政府官员一方是不对应的：政府官员拥有企业的最终控制权——他可以任免国企经营者，但是官员不享有企业合法的剩余索取权，合法的索取者是国家，而不是某一个或某些具体的官员。这意味着官员手中的控制权是廉价的控制权，他没有积极性“任人唯贤”；更进一步，因为官员没有来自国有企业的合法的剩余收入，所以他追求的是控制权收益，而获取控制权收益的最便捷的方式是“任人唯亲”，即任命自己的亲信。另一方面，即使政府官员有积极性任人唯贤，作为社会管理者，他缺乏充分的信息、能力和精力来识别潜在的经营者的能力，从而很难使真正具有经营能力的人被选拔到经营者岗位上去。虽然市场竞争会在一定程度上抑制政府官员任人唯亲的倾向，但是无法根本解决这个问题（赵世勇，2006a）。因此，我们得到第一个假说：国有企业的经营者选择机制与效率是背离的。其逻辑推论是，国有企业经营者的经营能力低于非国有企业。

在国有产权制度下，放权让利改革之后，国企经营者拥有了相当的控制权——经营决策权（中国企业家调查系统，1996，1998，1999，2000），但是绝大部分的国企经营者依然不享有企业合法的剩余索取权（参见本文表8），虽然有些国企实行年薪制，但是与真正的分享剩余索取权还不是一回事，其效果也值得怀疑（李由，2000）。因此，剩余索取权和控制权在经营者一方是不对应的，这使得经营者手中的控制权是廉价的。既然不享有合法的剩余索取权，那么追求控制权收益（在职消费等）就是必然选择了。^①控制权收益与剩余索取权收益不同，后者是合法的，只要不转让并且企业不倒闭就是永久的；而前者不同，虽说不一定是非法的，但有一部分是灰色的，并且控制权不是终身的，一旦离开经营者的岗位，就立刻失去控制权收益。这样的制度安排使得国企经营者的短期行为非常明显——所谓“有权不用，过期作废”！这就是为什么国企频繁发生所谓的“59岁现象”。因此，我们得到第二个假说：国有企业的经营者激励机制与效率是背离的。其逻辑推论是，国有企业经营者的努力水平低于非国有企业。

我们本文的重点是验证上述的两个假说。我们需要解释的是，国有企业和私营企业是两种

^① 有研究表明，国有企业经营者在职浪费和化公为私，瞒报和虚报资金、产量、利润，大全独揽，逃避监督和推诿扯皮、无人负责等成为企业经营中的突出问题。经营者的渎职行为和贪污腐败是造成企业经营不善以致亏损的重要原因（李由，2000）。

不同的企业制度，它们内生于不同的产权制度。两种企业制度的根本区别在于：私营企业是私产的拥有者跟其他人的资产组合而成的，是一个自由选择的结果，为的是要减低交易费用以增加私人的收入。而且更重要的是，私营公司的股份拥有者可将股份出售，作为制裁经营者行为的最佳保障。国有企业是政府强制力的结果，不是自由选择的结果，而且权利也不能自由转让，从而使得国有企业的交易费用非但没有减少，反而增加。这里的核心在于权利的拥有和权利的使用是两回事。国有企业的经营者选择机制和激励机制是国有企业产权制度的内生安排，二者与效率的背离是内生的。

五、假说的检验：模型、方法与估计结果

（一）模型与方法

为了分析不同产权安排的企业经营者特征对企业效率的影响，验证第四部分提出的两个假说，我们构造柯布 - 道格拉斯（Cobb-Douglas）生产函数模型（简称 C - D 模型）。柯布 - 道格拉斯生产函数在大量的实证研究中被广泛应用，特别是用于研究制造业的生产效率（Tybout, 2000）。建立 C - D 模型的关键是选取投入和产出变量；然而，不同研究在不同投入产出指标的选择上并不一致。

涂正革和肖耿（2005）以及刘德强（2002）采用工业净产值（增加值）作为产出指标，固定资产净值和就业人数作为资本投入和劳动投入指标。谢千里等（1995）、朱钟棣等（2005）采用工业总产值作为产出指标，固定资产净值、就业人数和中间投入作为投入指标^①。这一类研究主要是为了计算企业的全要素生产率（TFP）。还有一类研究采用销售收入作为产出变量，固定资产净值和就业人数作为投入变量（姚洋，1998；刘小玄，2004；赵世勇，2006b），这些研究大多是利用了国家统计局的工业普查或者基本单位普查数据；当然，用销售收入作为产出指标建立的 C - D 模型，在衡量企业技术效率的同时，还反映了企业的销售能力、市场预测能力以及库存管理水平等。理论上，上述方法都是可行的，不同指标体系的选取在很大程度上取决于研究的目的和分析的需要，并且受制于数据的可获得性。

^① 根据《中国统计年鉴》的定义，“工业总产值是指企业在一定时期内以货币表现的工业企业生产的产品总量，也就是全部工业产品价值的总和。它既包括在生产过程中物质消耗转移的价值，也包括新创造的价值；工业增加值是指工业企业在一定时期内工业生产活动创造的价值，是国内生产总值的组成部分，工业增加值就是工业总产出中扣除中间消耗以后的价值。”

我们研究的是制造业的企业效率,为了便于测度原材料和能源消耗对产出的贡献,我们决定采用工业总产值作为产出指标,年末固定资产净值作为资本投入指标,年末从业人数作为劳动投入,直接材料消耗和能源消耗^①作为中间投入,来构造柯布-道格拉斯生产函数模型。具体形式如下:

$$Y = AK^{\beta_1} L^{\beta_2} M^{\beta_3} E^{\beta_4} \text{EXP} \left(\sum_i d_i X_i \right) \quad (1)$$

方程(1)两边同时取自然对数,得

$$\ln Y = c + \beta_1 \ln K + \beta_2 \ln L + \beta_3 \ln M + \beta_4 \ln E + \sum_i d_i X_i \quad (2)$$

这里,K为固定资本净值,表示资本投入;L为从业人数,表示劳动投入;M为原材料投入;E表示能源消耗。 $\beta_1, \beta_2, \beta_3, \beta_4$ 分别表示资本、劳动、原材料和能源投入的产出弹性。 X_i 表示各种影响企业生产效率的其他变量。这些变量有两大类,第一类是与企业特征有关的控制变量,具体包括:

(1) 企业规模(以小型企业为参照系)。

大型企业:规模为大型的企业为1,其他为0;

中型企业:规模为中型的企业为1,其他为0。

(2) 企业投产年数:企业投产的年数。

第二类是与企业经营者特征有关的变量,具体包括:

(1) 经营者的年龄(以40岁以下为参照系)。

40—49岁:经营者年龄在40—49的企业为1,其他为0;

50—59岁:经营者年龄在50—59的企业为1,其他为0;

60岁及以上:经营者年龄在60岁及以上的企业为1,其他为0。

(2) 经营者的学历(以高中以下为参照系)。

研究生:经营者学历是研究生的企业为1,其他为0;

本科:经营者学历是本科的企业为1,其他为0;

大专:经营者学历是大专的企业为1,其他为0;

高中:经营者学历是高中的企业为1,其他为0。

(3) 经营者的来源:经营者来自企业内部^②的企业为1,其他为0。

^① 能源消耗的单位是“吨标准煤”。

^② 具体包括前任经理留任、企业高管人员晋升和企业创业者自任。其他情况包括政府官员调任、其他企业调任、从社会上招聘、外部自然人大股东自任、控股股东派遣等。

(4) 经营者的选任方式：经营者须主管部门任命或批准^①的企业为 1，其他为 0。

(5) 经营者的在职年数：经营者在该企业担任一把手的年数。

(6) 基于利润的报酬激励：经营者能根据年度利润的增长情况提取一定比例奖励的企业为 1，其他为 0。

我们的研究目的是分析不同产权安排的企业中，经营者的特征对企业效率的影响，从而验证假说。我们使用的是 2004 年的横截面数据，采用最小二乘法（OLS）进行回归。为了进行比较，我们对五种不同的产权类型，分别进行 OLS 回归。

需要说明的是，我们为什么没有控制市场结构变量。市场结构（比如垄断程度或市场集中度）有两种：一种可以称之为内生的市场结构，是在没有行政垄断和进入壁垒的基础上，由于企业竞争力较高导致较高的市场份额（集中度），在这种情况下，不能把集中度作为解释变量，因为这种情况下的市场集中度是企业较高效率和较强竞争力的结果，而不是原因。当然，较高的效率和较强的竞争力可以是较高的利润率的原因。因此，集中度是作为连接效率和利润之间的一个中间变量，它是效率的结果，同时是利润率的原因；也就是张五常（2001）所说的，“垄断可能是竞争的结果”。因此，在我们的效率模型中内生市场结构不能作为解释变量。

另一种市场结构为外生市场结构，也就是由于政府行政垄断造成的市场集中度的差异。这种情况下形成的市场集中度差异就不是企业效率和竞争力的结果，而是影响企业效率和竞争力的一个外生变量了。垄断一方面是提高产出效率的有利因素，比如人为造成供不应求的市场环境；另一方面又会形成不利于技术效率的多层级的管理体制，以及寻租、冗员、浪费和决策失误等。这是企业无法控制的外生变量，理论上需要在模型中进行控制。

上述两种类型的市场结构在转轨时期的中国都是存在的。因此，区分外生和内生的市场结构是必要的。如果存在外生的市场因素，我们就需要在模型中进行控制。考虑到目前绝大多数制造业企业可以被看成是具有相同的外生结构，因此，在我们的回归模型中不需要控制市场结构因素。当然，我们完全可以在制造业进行细分，加入具体行业（纺织、机械等）虚拟变量，但考虑到样本的数量有限，并且我们的研究目的是看不同产权安排下，企业经营者的特征对企业效率的影响，所以我们决定不在模型中添加具体行业虚拟变量。

还需要说明的是，因为我们用的是横截面数据，因此异方差性和多重共线性是不得不考虑的问题。根据计量经济学理论，如果存在严重的异方差性或多重共线性，那么 OLS 回归结果就不是最优的。我们进行了通常的 OLS 回归，进行了异方差性的检验。采用 White 异方差性检验，

^① 具体包括三种类型：主管部门任命；董事会聘任，主管部门批准；职代会选举，主管部门批准。

我们发现国有企业、集体企业和外资企业的回归模型中没有异方差,而股份企业和私营企业的回归中存在异方差。幸运的是,计量经济理论的发展使我们在出现异方差时不需要放弃 OLS,我们只需报告异方差 - 稳健性标准误或 t 统计量(伍德里奇,2003)。在我们的研究结果中,对于出现异方差的股份企业和私营企业回归,我们报告的是异方差 - 稳健性 t 统计量。

对于可能存在的多重共线性,我们采用 Klein 判别法则进行检验。我们首先给出解释变量两两间的简单相关系数矩阵,然后找出最大的简单相关系数,把它和回归模型的决定系数(R^2)进行比较,如果低于 R 平方,则认为没有严重的多重共线性。我们判别的结果是,五个模型都没有严重的多重共线性问题(我们报告了每个模型和决定系数和解释变量间最大的简单相关系数)。

(二) 回归估计结果

表 13 给出了五个回归模型的估计结果。从投入对产出的贡献来看,原材料和劳动对产出的贡献最大,原材料对总产出的贡献率达 60%—80%,^①劳动的贡献大约在 10%—30%,并且在统计上都极其显著。这从整体上反映了我国的制造业的加工性质和劳动密集的特征。资本和能源对总产出的贡献在不同产权类型企业中却出现了分歧。资本投入在国有、私营和外资企业中都有 10% 左右的贡献率,且统计上很显著,但在集体和股份企业中却是负的,统计上不显著。这反映了集体和股份企业(特别是股份合作制企业)的劳动密集型特征,资本对这些企业的产出贡献微不足道。能源对国有和私营企业的产出有 3%—8% 的贡献率,且在统计上比较显著,对其他类型企业产出的贡献则不显著。

企业的投产年数在所有产权类型企业中都有负效应,不过只是在国有和股份企业中具有显著的负效应。这意味着企业建立的越早,效率越低。对国有企业来说,企业建立越早,可能意味着企业的政策性负担越重,预算约束就越软,从而效率越低;对股份企业来说,建立越早,可能技术越落后,从而效率越低。企业规模对技术效率的影响也不尽相同,回归结果显示,股份和私营企业中存在着显著的规模经济效应。在股份企业中,相对于小型企业,中型和大型企业都对产出有显著的正效应。在私营企业中,相对于小型企业,中型企业对产出有显著的正效应(因为私营样本中没有大型企业,所以没有大型企业的规模效应)。其他类型企业中,规模

^① 不难理解,原材料价格的上涨对中国企业的成本压力、从而对中国企业竞争力的挑战是巨大的。正泰集团董事长南存辉介绍说,2005 年其公司的销售额增长三成,但利润却没有寸进;其中最主要的原因是原材料成本涨得太凶(参见周其仁《挑灯看剑》,北京大学出版社,2006,第 15 页)。

对产出没有显著的影响。

经营者的任职年数在国有和私营企业中的系数为正，并且分别在5%和1%的水平上显著。这意味着在国有和私营企业中，的确存在着“干中学”的效应。可能的解释是，国有企业一般规模较大，经营者需要一个积累经验的过程；私营企业需要面对严酷的市场竞争，经营者更需要一个摸爬滚打熟悉市场的过程。而集体企业和股份企业的规模相对较小，经营者需要面对的不确定性也相对较少；外资企业内部的制度和外部的环境相对稳定，经营者干中学的效应不明显。

反映经营者学历的虚拟变量在国有企业的回归中出现了与人力资本理论相反的结果。本科和研究生的系数皆为负，分别在10%和5%的水平上显著。在股份企业中，本科学历对产出有显著的正效应，这是与人力资本理论相一致的。除此之外，学历在另外三种产权类型的企业中都没有显著的效应。根据人力资本理论，接受教育可能不会增加一个人的能力，但至少不会降低能力。而根据企业家理论，经营能力在一定程度上是天生的，而不是后天教育所得。综合这两个理论，经营者学历对产出有正效应或者没有显著效应都是与理论相一致的，但是学历与产出有显著的负效应却需要寻找进一步的解释。

我们认为，这种结果内生于国有企业的经营者选择机制。其一，政府任命国企经营者的“四化”标准中“知识化”和“专业化”的要求使得高学历炙手可热。为了达到一定的学历标准，不少人可能不择手段获取高学历，并且可能能力越低的人越有积极性获得假学历。其二，正如前面分析的，政府官员任命国企经营者的权力是廉价的控制权，理性的官员更有积极性任人唯亲，那么任命高学历的亲信则可以堵住别人的议论之口。其三，即便政府官员是大公无私的，因为缺乏信息，所以给定他作为社会管理者的能力和精力，并不胜任国企经营者选择者的角色（赵世勇，2006a）。国企经营者高学历（本科及以上）对产出的系数为负，验证了我们的第一个假说：国有企业的经营者选择机制与效率是背离的，国企经营者的能力低于非国有企业。

在国有企业的回归结果中，年龄出现了很有意思的结果。50—59岁年龄段的经营者对企业效率具有显著的负效应，但是60岁以上年龄段的经营者对产出具有显著的正效应，其他年龄段没有显著的效应。并且年龄在其他产权类型企业中产出没有显著的效应。如果企业激励机制合理，那么年龄不应该与产出有显著的关系。因为经营者的事业心和积极性得到了制度的保证，其行为是不会随时间推移而有显著变化的。

如前所述，因为没有合法剩余索取权的保护，加上大部分的国企经营者到60岁要退休，国企经营者的努力很大程度上来自事业心和责任感，但是没有制度保护的事业心和责任感往往是不能持久的，所以国企经营者的事业心会随着年龄增长而递减，到59岁跌入低谷。这解释了为什么国企中50—59岁年龄段的经营者对产出是负效应。因此，我们验证了第二个假说：国有企

业经营者的激励机制与效率是背离的，国企经营者的努力水平低于非国有企业。

60 岁以上的经营者对产出有显著的正效应，这让人想起曹孟德的“老骥伏枥，志在千里；烈士暮年，壮心不已”。按规定，一般国企经营者 60 岁要退休；大型国企可以到 65 岁。不管怎样，如果国企老总到 60 岁以上还在任，一般是因为该老总长期执掌这家企业，他的去留对企业影响甚大，所以政府主管部门不敢轻易撤换，当然，他的身体和精力还必须能够胜任。不管出于什么原因，到了这个年龄，他的事业心和责任感可能远远超过了对物质利益的追求，^①但这不是由制度来保证的。

经营者的来源和选任方式对企业产出效率的影响也是我们关心的问题。我们想知道的问题是：其一，经营者来源于企业内部是不是对效率有显著的正效应；其二，经营者需要主管部门任命或批准是不是对效率有显著的负效应。回归结果显示，集体企业经营者来源于企业内部对产出效率具有显著的负效应，其他企业类型则无显著效应。这意味着大致上经营者的来源对效率没有显著的影响，集体企业的负效应很可能是因为集体企业的内部人控制问题比较严重，使得外部较有能力的人很难进入。回归结果表明，私营企业中，经营者需要主管部门任命或批准对产出效率具有显著的负效应，其他企业类型则不显著。这意味着政府机构对私营企业的干预有更显著的不良影响。

我们预期，基于利润的报酬激励对产出效率有显著的正效应，因为这意味着让经营者分享合法的剩余索取权。回归结果显示，只有在私营企业中，基于利润的报酬激励对产出有正效应，并且在 5% 水平上显著，在其他企业类型中不显著。这可能是因为，受制于问卷的设计，我们无法知道各类企业经营者根据年度利润增长情况提取奖励的程度（百分比），所以该变量的系数在多数企业类型中不显著也在情理之中了。

表 12 生产函数的估计结果

因变量：总产值	国有企业	集体企业	股份企业	私营企业	外资企业
固定资产净值	0.134*** (3.05)	-0.007 (0.21)	-0.010 [-0.24]	0.102*** [2.75]	0.117** (2.07)
职工人数	0.113** (1.88)	0.209*** (3.58)	0.197*** [3.67]	0.163*** [3.27]	0.355*** (3.77)
原材料	0.667*** (18.10)	0.818*** (19.30)	0.731*** [15.40]	0.581*** [7.80]	0.477*** (9.90)

^① 比如中国青春宝集团有限公司（国企）的董事长冯根生执掌企业长达 34 年，72 岁仍在一线工作。很难用物质方面的激励机制来解释。

续表

因变量：总产值	国有企业	集体企业	股份企业	私营企业	外资企业
能源	0.077** (2.27)	0.040 (1.19)	0.026 [0.96]	0.036* [1.65]	0.014 (0.34)
投产年数	-0.005* (-1.78)	-0.004 (-0.90)	-0.005* [-1.79]	-0.002 [-0.71]	-0.001 (-0.08)
大型企业	0.110 (0.52)	—	0.478** [2.31]	—	0.091 (0.17)
中型企业	-0.038 (-0.28)	-0.180 (-1.07)	0.243** [2.46]	0.255** [2.31]	0.211 (1.09)
中共党员	-0.140 (-0.72)	0.008 (0.07)	0.088 [1.32]	-0.025 [-0.31]	0.198 (1.33)
40—49岁	0.055 (0.27)	-0.246 (-1.28)	0.014 [0.11]	-0.101 [-0.94]	0.227 (0.98)
50—59岁	-0.014** (-2.28)	-0.159 (-0.81)	-0.144 [-1.04]	-0.090 [-0.69]	0.300 (1.26)
60岁以上	0.043** (2.27)	-0.065 (-0.29)	-0.023 [-0.17]	0.005 [0.02]	0.165 (0.52)
高中	0.353 (0.69)	0.127 (0.71)	0.112 [1.03]	0.012 [0.10]	-0.050 (-0.12)
大专	0.329 (0.66)	0.032 (0.19)	0.041 [0.37]	0.144 [1.44]	0.156 (0.40)
本科	-0.83* (-1.78)	0.279 (1.43)	0.194* [1.65]	0.034 [0.27]	0.315 (0.81)
研究生	-0.95** (-2.05)	—	0.152 [0.82]	0.058 [0.43]	0.381 (0.92)
任职年数	0.025** (2.14)	-0.003 (-0.44)	0.007 [1.12]	0.024*** [2.81]	-0.011 (-0.66)
内部留任或晋升	-0.157 (-1.56)	-0.216** (-2.25)	0.094 [1.43]	0.039 [0.28]	-0.194 (-1.34)
主管部门批准或任命	-0.21 (-1.13)	0.028 (0.28)	0.014 [0.14]	-0.229* [-1.88]	—
基于利润的报酬激励	-0.128 (-1.02)	-0.019 (-0.21)	0.076 [1.08]	0.159** [2.23]	-0.007 (-0.05)
N (样本量)	112	86	266	335	125

续表

因变量：总产值	国有企业	集体企业	股份企业	私营企业	外资企业
F 值	120.56	46.63	277.22	122.34	32.24
R ²	0.9614	0.9210	0.9148	0.7910	0.8456
解释变量最大偏相关系数	0.7854	0.4838	0.7670	0.5981	0.6727
异方差怀特检验 (P 值)	0.4556	0.4493	0.000	0.000	0.4579

注：***、**和* 分别表示单尾检验结果在 1%、5% 和 10% 的水平上显著 (括号内为 t 值)。

六、结束语

我们在本文中利用中国社会科学院经济研究所微观经济学研究室独立调查的企业数据，分析了中国制造业不同产权安排的企业中，经营者的特征对企业产出效率的效应，重点检验了国有企业经营者的选择机制和激励机制与效率的关系。我们有如下结论。

其一，国有企业的经营者选择机制与效率是背离的，国企经营者的经营能力低于非国有企业。前面已经分析过，拥有国企经营者选择任命权的政府官员不拥有企业合法的剩余索取权，他拥有的是廉价的控制权。这种控制权“不伤身，不入肉”，任人唯亲的倾向大大增加。在缺乏鉴别经营者能力的客观标准的情况下，过度重视学历导致一些有高学历但没有经营能力的人走上国企经营者岗位。

其二，国有企业经营者的激励机制与效率是背离的，国企经营者的努力程度低于非国有企业。这主要是因为国企经营者不享有合法的企业剩余索取权，而作为激励机制的控制权收益则会随着经营者的离任而烟消云散，所以这种制度安排使得国企经营者的短期行为特别突出，特别是在临近退休的时候。我们需要指出的是，非国有企业（特别是私营企业和外资企业）的激励机制是用制度来保护事业心和责任感，让经营者从自身利益出发（不管是自愿的还是被迫的）兢兢业业，而国有企业则没有制度来保护事业心，而是用事业心来维持无效率的制度和安排。

经济学研究的对象是作为普遍情况的现象，但不否认有小概率事件的发生；研究基于人是自私的这一假定，但不否认大公无私的人的存在。我们不否认，国有企业的经营者中也有不少具有很高的经营能力，而且大公无私，几十年如一日任劳任怨地工作；我们也不否认某些拥有国企经营者选择权的政府官员一心为公，任人唯贤、惟才是举。问题是，给定国有企业的产权制度和治理结构，我们无法保证绝大多数的政府官员都有积极性和能力任人唯贤，也不能保证绝大多数的国企经营者兢兢业业。有效率的行为需要制度内生出来，巧妙的制度安排能产生

“四两拨千斤”的效果，而仅靠道德、责任感和事业心虽然可以产生几个典型，但效果往往与初衷背道而驰。冯飞等（2006）的案例研究也表明，依靠国企经营者的道德激励所能产生的效果具有偶然性和不可持续性，而明晰的产权制度则能提供具有自我执行功能的制度保证。结论明显不过，国有企业是无法通过改“进”的办法来达到高效率的，成功的国企改革不是改“进”，而是改“变”（即民营化）——这是产权的效率含义了。

参考文献

- [1] Alchian, A. and H. Demsetz, 1972, "Production, Information Costs, and Economic Organization," *American Economic Review*, vol. 62 (50).
- [2] Casson, M. 1982, *The Entrepreneur: An Economic Theory*, Oxford: Martin Robertson.
- [3] Harris, M. and A. Raviv, 1989, "The Design of Securities," *Journal of Financial Economics*, vol. 24, pp. 255 - 287.
- [4] Kirzner, I. M., 1979, *Perception, Opportunity and Profit*, Chicago: University of Chicago Press.
- [5] Milgrom, P. and J. Roberts, 1992, *Economics, Organization and Management*, New Jersey: Prentice-Hall International, Inc.
- [6] Schumpeter, J. A., 1943, *Capitalism, Socialism and Democracy*, London: Unwin University Books.
- [7] Shackle, G. L. S., 1979, "Imagination, Formalism and Choice," in Rizzo, Mario, J. (ed.), *op. cit.* p. 19.
- [8] Tybout, James R. 2000, "Manufacturing Firms in Developing Countries: How Well do They Do, and Why?" *Journal of Economic Literature*, 38 (1), pp. 11 - 44.
- [9] 陈勇, 唐朱昌, "中国工业的技术选择与技术进步: 1985—2003", 《经济研究》, 2006年第9期。
- [10] 迟福林, 唐新林, 陈宝敏, "建立经营者激励机制摆正八大关系", 《中国改革》, 2000年第3期。
- [11] 冯飞, 张永生, 张定胜, "企业绩效与产权制度", 《管理世界》, 2006年第4期。
- [12] 洪银兴, 袁国良, "乡镇企业高效率的产权解释", 《管理世界》, 1997年第4期。
- [13] 李新春, "企业家过程与国有企业的准企业家模型", 《经济研究》, 2000年第6期。
- [14] 李由, "经营者的激励约束与制度创新", 《中国改革》, 2000年第3期。

[15] 刘德强,“国有企业的经营者:是能力不足还是努力不足”,《经济学(季刊)》,2002年第2期。

[16] 刘小玄,“中国工业企业的所有制结构对效率差异的影响”,《经济研究》,2000年第2期。

[17] ——,“民营化改制对中国产业效率的效果分析”,《经济研究》,2004年第8期。

[18] 钱颖一,“现代经济学在美国”,《比较》,2002年第1辑。

[19] 涂正革,肖耿,“中国的工业生产力革命”,《经济研究》,2005年第3期。

[20] [美] 伍德里奇,《计量经济学导论:现代观点》,北京:中国人民大学出版社,2003。

[21] 谢千里等,“改革以来中国工业生产率变动趋势的估计及可靠性分析”,《经济研究》,1995年第12期。

[22] 姚洋,“非国有经济成分对我国工业企业技术效率的影响”,《经济研究》,1998年第12期。

[23] 张维迎,《企业理论与中国企业改革》,北京:北京大学出版社,1999。

[24] 赵世勇,“企业所有权安排与企业效率”,未出版博士论文,中国社科院研究生院经济系,2004。

[25] ——,“国有产权制度下资本市场对国企经理约束机制的无效性”,《河北经贸大学学报》,2005年第6期。

[26] ——,“国有企业的经营者选择机制与效率的背离”《新政治经济学评论》,2006年第一卷第二期。

[27] ——,“产权结构与中国制造业的产权效率——2001年第二次全国基本单位普查数据的实证分析”,《新政治经济学评论》,2006年第二卷第二期。

[28] 中华全国工商联,《中国民营企业发展报告(2004)》,北京:社会科学文献出版社,2005年。

[29] 中国企业家调查系统,“中国企业家成长与发展专题调查报告”,《中国经济年鉴1996》,第954-960页,1996。

[30] ——,“素质与培训:变革时代的中国企业经营管理者”,《管理世界》,1998年第4期。

[31] ——,“迎接知识经济挑战:世纪之交的中国企业经营者”,《管理世界》,1999年第4期。

[32] ——，“中国企业经营者队伍制度化建设的现状与发展”，《管理世界》，2000年第4期。

[33] 朱仲棣等，“中国工业行业资本形成、全要素生产率变动及其趋异化：基于面板数据的研究”，《世界经济》，2005年第9期。

[34] 周其仁，《挑灯看剑》，北京：北京大学出版社，2006。

[35] [美] 邹至庄，《中国经济转型》，北京：中国人民大学出版社，2005。

Property Rights Arrangements , Manager Characteristics ,
and Firm Efficiency : An Empirical Study on
Chinese Manufacturing Industry
Zhao Shiyong

(Institute of Economics , Chinese Academy of Social Sciences)

Abstract : The manager's ability and working incentive are of critical importance to the efficiency and competitiveness of a firm , and the reform of SOEs should first of all solve these two problems. This paper utilized the unique dataset of the Center of Microeconomics , Institute of Economics , Chinese Academy of Social Sciences , and analyzed the relationship between property rights , manager characteristics and firm efficiency. The regression results proved the two hypotheses of the paper : one is that the management selection mechanism of SOEs is inefficient ; the other is that the management incentive mechanism of SOEs is inefficient. The paper shows that these inefficiencies are endogenously determined by property rights arrangements. The implication of the research is that successful SOE reform is to privatize them.

Key Words : Property Rights Arrangements ; Management Selection Mechanism ; Management Incentive Mechanism

JEL Classification : L200 , L190 , L120

读书笔记

知识，秩序，悟性浅说

——一份不断重写的读书笔记

汪丁丁*

“对于一个浅薄的观察者来说，科学的真理是无可怀疑的；科学的逻辑是确实可靠的，如果科学家有时犯错误，那只是由于他们弄错了科学规则。……怀疑一切和相信一切，二者同样是方便的解决办法，每一个都使我们不用思考。”

——昂利·彭加勒，《科学与假设》，1902年

我推测，为了与我周围的数目惊人的科学主义者对话并试图说服他们反思科学方法的局限性，或许，我应当从罗素的知识分类开始叙说。

古希腊哲学家们划分人类知识为：(1) 物理的，(2) 心理的，(3) 历史的。与此不同，罗素曾根据知识的来源划分人类知识为：(1) 直接知识，(2) 间接知识，(3) 内省知识。此外，罗素（《西方哲学史》）还根据知识的内涵将（西方的）知识分为：(1) 科学的，(2) 神学的，(3) 哲学的。

古希腊人的知识分类表明，他们注意到了“物”的世界与“我”的世界之间的本质差异。蔡元培曾指出（在北京大学的一次公开演说）：西方人“物我两执”，中国人则“取中庸”，这是西方思维与中国思维的本质差异。哈贝马斯也曾指出（在1996年与我的谈话中）：人类认知世界的两种基本方式，其一是区分出主体性与客体性，从而使主体对客体的认知成为可能；其二是不区分主体性与客体性，从而使“体悟”成为可能。古希腊人的知识分类还表明，他们关注知识的发生过程，即“历史知识”——对物理世界和心理世界以往发生的一切事件的记录与理解。

按照罗素的分类，知识，只要来自个人体验——以往的和当下的，都是“直接知识”。另一方面，来自他人体验的知识，文字的和传授的，都是“间接知识”。这一划分表明，罗素关

* 汪丁丁，北京大学中国经济研究中心教授，浙江大学跨学科社会科学研究中心学术委员会主席。

注知识陈述的权威性。一切基于自我体验的知识，对自我而言，其权威性难以质疑。一切间接知识，凡已经启蒙了理性能力的人，皆可以质疑其权威性。这是一种“启蒙理性”的看法，后来，哈耶克在《致命的自负》中对这一看法有最具摧毁性的批判，这一思想批判将把我们引导到“演化理性”的路径上去。

第二次世界大战之间和之后，先是受到维特根斯坦的严厉批评，其次，很大程度上是受了詹姆士思想的影响，罗素在晚期著作（1948年英文版）《人类的知识》中，转向了古代希腊人的知识分类和知识发生学。他的这部作品，成熟且厚重，在科学哲学意义上的重要性超过了他早期的著作《我们关于外间世界的知识》，不亚于他的老师怀特海晚年作品《思维方式》在形而上学意义上的重要性。

一些重要的批评者指出（参阅 H. A. Prichard, 1915, “Mr. Bertrand Russell on Our Knowledge of the External World”, *Mind*, vol. 24, no. 94, pp. 145 - 185），罗素早期著作《我们关于外间世界的知识》的基本立场是“前批判”哲学家们的经验主义立场——知识的可靠来源是“感觉”（the immediate data of sense）。

罗素的认识论立场，在他晚期著作中有很大的转变。罗素在《人类的知识》的第六部分第十章，明确探讨了“经验主义的限度”。在那里，康德的“先于经验”的那些普遍主义论述（“先天的”和“先验的”两类），被罗素转化为关于“全称命题”（带有“变项”且变项的值域不是经验域或大于经验域）的论述，而康德的“后天经验”论述则被转化为关于“特称”和“存在”命题的论述。这意味着，在写这部著作时，罗素已充分注意到康德对“前批判”哲学的批判。

在这一章的另一段落，关于我们相信一些“先验命题”的理由或根据，罗素写道：“如果经验可以提供这样的理由，那么它一定要由那些将使某些种类的概括具有先在的可信性的因果律作出补充。这些原理……我们关于这些原理的知识——如果这可以称为‘知识’的话——最初仅仅以趋近那一类提供合理根据的推论的倾向的形式而存在。通过对于这类推论的思考我们才得以明确说出这些原理。在它们已被明确说出之后，我们就能使用逻辑技巧改进叙述它们的形式，并去掉多余的东西。”（中译本，商务印书馆，2003，第605页）

在这一章的结尾处，罗素对经验主义有更明确的批评：“我们必须承认，从这一意义上说，经验主义作为一种认识论，已经证明是不适当的了，尽管它比以前任何一种认识论都更好。的确，我们在经验主义身上找出的这类不适当之处是由于严格遵守一种唤起过经验主义哲学的学说而产生的，即认为人类的全部知识都是不确定的、不准确的和片面性的。对于这一学说我们还没有发现任何一种限制。”（中译本第606页）另一例证来自罗素1950年发表的论文“逻辑

实证主义”（参阅罗素文集《逻辑与知识》，商务印书馆，1996，第445—463页），他写道：“关于科学推断的问题是一个自休谟时代以来始终很尖锐的问题。……大致可以肯定：（1）相对于演绎推论的科学推论只能做出具有或然性的结论；（2）要做到上面这一点只能通过假定一些或一个公设，对此并不存在或不可能存在经验的证据。对于经验论者来说，这是一个很棘手的结论，但这似乎是不可避免的。”

更进一步，在《人类的知识》第六部分第四章，他批评了逻辑实证主义学派的武断的“知识”定义，他倾向于接受詹姆士的看法。他相信，存在着“超越经验”的知识。在罗素列举的实例当中，我认为下面这一个最具说服力：命题“曾存在过没有生命的世界”，不能通过任何可操作的定义加以证实（因为任何观察者都必须是有生命的），但没有谁不相信它不是真的。也就是说，存在着超越直接经验和间接经验的知识，这部分知识的真或伪，不依赖于人类经验，它们是先验的或先天的。而且，人类确实相信这类知识的真理性。这就意味着，如果我们仍沿用罗素的知识分类，获取这部分知识的惟一方式，是“内省”，以及，通过内省而达到的极限知识——康德在深思熟虑之后提出的“信仰”。

为什么，罗素在经历了那样广泛和深刻的人生体验之后，从启蒙理性主义的立场转变为倾向于——至少是以同情的态度关注——伯格森、詹姆士、怀特海的神秘主义的立场？这是一个有趣的思想史问题（特别需要探讨的，是罗素在自述中概括的他自身生命的三大要素——对知识的渴求，对爱的崇拜，对人类状况的悲悯），在我阅读的范围内，我尚未看到对这一问题的研究和回答。须知，这一问题对中国当代思想研究格外重要。因为，或许，罗素和杜威是对“民国时期”中国知识界影响最大的两位西方思想家。有证据表明，杜威大约与罗素同时或稍晚，基于更东方式的知识结构和生活体验（亚历山大的养生法），也转向神秘主义。总之，这应当是另一篇文章的主题。我们在这里折回，继续介绍关于“知识”的哲学。

我们看到，罗素对康德知识论和经验主义知识论的转述和批评，更明确地导向“演化知识论”——即奈特教授大约在罗素发表这部著作之前五年已撰文阐明了的那种知识论。罗素的演化知识论，最清晰地表达在他自己的这一段文字里：“……我们的全部认识生活是对于事实的适应过程的一部分。这一过程是一切生物在不同程度上都具有的，但是除非它发展到一定的阶段，一般并不把它叫做‘认识的’过程。因为在最低级的动物与思想最深刻的哲学家之间并没有一道分明的界线，所以非常明显，我们不能准确说出我们是在什么地方从完全动物的行为过渡到配得上‘知识’这一珍贵名称的阶段。”（上引中译本第177页）

许多读者都知道，1998年以来，我最关注的科学领域是“脑科学”。在中国的社会科学界，我大约是最初几位关注和介绍这一领域的最新进展的学者之一，如果不是“惟一”的话。我已

在一系列文章里说明了我关注脑科学的理由,这里列出其中最主要的两项:(1)人类科学努力和研究资源配置的主要方向,在1980年代以后,从基本粒子和外太空,逐渐转向医学与意识科学;(2)所谓“意识”的科学研究,将为我们提供某种“极限视野”,在这一极限之外,科学无能为力。

为科学划界的努力仍在继续。基于我在认知科学、神经网络与意识科学、演化心理学、认知考古学、心灵哲学等领域的阅读,大致上,我可以提出一些较中肯的见解,来说明知识与秩序的关系。不过首先要说明的,是当代知识论者对“知识”的看法。

知识,可定义为“由信仰担保的真信念”(true belief warranted by faith)。这一定义的根据,是普兰丁格(Alvin Plantinga)的知识论。在提出这一定义之前,普兰丁格指出,存在着一个至少可上溯到柏拉图“泰阿泰德篇”的历史悠久并广受尊重的“知识”定义——“知识是有根据的真信念”(参阅Plantinga, 1986, “epistemic justification”, *Nous*, vol. 20, No. 1, pp. 3 - 18; 以及Plantinga, 1992, “justification in the 20th century”, *Philosophical Issues*, vol. 2, pp. 43 - 77)。

柏拉图“泰阿泰德篇”接近结尾的部分,我们看到,在苏格拉底的“思想催产术”的帮助下,泰阿泰德的第一次尝试性解答是:“感觉就是知识”。作为第二次尝试性解答,泰阿泰德指出:“知识就是真正的信念”(Benjamin Jowett 英译本为“knowledge is true judgement”)。然后,在苏格拉底的追问下,他提出了第三次尝试性解答:知识就是真实的信念加上(逻各斯)解释(中译本,《柏拉图全集》第二卷,王晓朝译,人民出版社,第736—737页)。“逻各斯”这个希腊单词的原初含义是“对话”和“计量”,后来引申为“解释”和“逻辑”。在赫拉克利特的残篇里,逻各斯是大众分享着的,所以,它可以通过对话呈现自身。不过,大众的常态犹如在梦中,见到逻各斯却不认识它的真相。于是,逻各斯又有“真理显现”的意思。这样,我们看到,信念是否与真实相符,关键就在于通过对话让真理呈现自身。

接下来需要澄清的,是“有根据的真信念”——justified true belief 的含义(Benjamin Jowett 英译本为“knowledge is true judgement with an account”),首先是“根据”的含义。上面的解释意味着,“根据”是从对话中产生的。通过对话,如果逻各斯呈现自身并且持有信念的对话者在对话中确立了相信这一信念的理由,那么,信念就是有根据的并且被确信是真实的。

不过,在“泰阿泰德篇”的结尾,苏格拉底总结说:“所以,泰阿泰德,感觉(Benjamin Jowett 英译本为“perception”)、真实的信念、真实的信仰加上解释,都不会是知识”(中译本第752页,《人类的知识》)。这就是柏拉图留给西方人的知识论遗产,它提出“知识问题”,它不提出“知识定义”。

由于是逻辑学家,罗素的知识论叙述十分精确。同时,不可避免地,罗素的叙述受着他那

一时代的进化论哲学的影响。在《人类的知识》的第四部分和第六部分，罗素赞赏并批评了凯恩斯对概率和可信度的解释。他提出了知识的另一个出发点：在事物之间存在概率关系之前，先有关这些事物的陈述或描述性命题的可信度。用罗素自己的文字表达：“……我主张把信念当做某种可以是先于理智并且可以表现在动物行为上的东西。我还认为有时一种完全属于身体方面的状态也可以称得起是一种‘信念’。……信念是身体或心理或两方面兼有的某种状态。简单来说，我将把它叫做有机体的一种状态，而不去区分身体的与心理的因素。”（中译本，《人类的知识》，第178—179页）

对我的科学主义朋友们而言，只要他们不愿意停留在古代的知识论水平上，我推测，对他们而言最可信的知识定义应当是罗素的。如果我能说服科学主义者接受罗素的知识定义，那么，我有希望继续说服他们接受，至少是同情普兰丁格的定义。然后，他们将不得不放弃他们最初的科学主义立场。

罗素在《人类的知识》的“引论”的开篇批评了康德的主观认识论的立场，他是这样批评的：“康德认为自己完成了一次‘哥白尼式的革命’，但是如果他说自己完成了一次‘托勒密式的反革命’那就更为确切，因为他把人又恢复到哥白尼废黜他以前的地位。”（上引中译本第3页）

在《人类的知识》第六部分第九章，罗素列出了“科学”之为“知识”的五大公设，在我的转述里，第4公设的表达稍有不同：（1）准永久性公设；（2）因果链条的可分离公设；（3）因果链条的时空连续公设；（4）同因导致不同主体所感的结构相似公设；（5）类推公设。这些公设，我认为，是理解晚年罗素的知识论的关键所在，也是《人类的知识》的论证主旨。

罗素在《人类的知识》第二部分第五章表达了这样的看法：“知识基本上是由对于这类推迟的反应做出的准备所组成。这类准备一般都可以叫做‘信念’，但是只有在它们引起成功的反应时才能叫做‘知识’，或者至少显示出它们本身与它们所处理的事实之间有着某种关系，这种关系使得这些准备有别于那些可以叫做‘错误’的准备。”（上引中译本第115页）

最后，罗素似乎相信这一判断：知识就是“合情理地论证了的真实信念”（reasonably justified true belief）。此处，“合情理”是一个重要修饰词，它比“理性”（rationality）弱得多。法律学家们常用的短语“beyond reasonable doubt”（不考察那些在合情理的怀疑之外的情形）来排除他们的法学论证不适用的场合。不论中文还是西文，似乎都满足“情境理性”命题——“情理”是特定社会和特定处境中的实践者们自然形成的对“理性”的修正。

假如我的科学主义朋友们甚至不打算接受罗素的这一定义，那么，他们要么没有能力思考“知识”问题，要么，我替他们设想，只能放弃逻辑自洽性，为了保留他们对科学主义的信仰。

这样，他们可以接受的最接近科学主义立场的，将是亚里士多德提出的知识定义。亚里士多德相信：“知识就是与真理相符合”。

这里必须澄清的，是“真理”的含义。如果真理就是逻各斯，那么，亚里士多德的知识定义让我们回到出现在“泰阿泰德篇”里的知识定义——“知识是真信念”（true belief）。此处的“真”，是“符合事实”，故应译为“真实”。引用罗素提供的一个例子，假如你偶然路过教堂，看到顶楼的大钟显示“12”，那么你可以产生这一信念——“现在是中午12时”。不过这信念未必真。因为，那口大钟可能是坏的。

由于真信念是符合事实的信念，于是必须解决“事实”（fact）的定义问题。确切地说，这是一个“后现代”问题，它在启蒙理性那里不会发生。波普的看法是——如果我对他的哲学的理解是正确的话：没有给定的事实（datum），只有相互竞争着的各种假设之中的事实。或者，用尼采的语言表达：没有就是如此的真理，只有在特定视角下成立的真理。不论如何，关于“事实”的正确的定义，按照普特南的看法，应依赖于某种被知识共同体承认为“合情理”的根据或标准，在这一共识的基础上，任一陈述，要么被相信是事实，要么被相信不是事实。这一看法，也可用罗素的术语表达，在全体“事实”的集合A与全体“信念”的集合B之间存在某种已达成一致的“关系”R，使得 $\forall b \in B, \forall a \in A, aRb \vee \neg aRb$ 恒成立。

为了避免休谟的基于“因果性联想”的批评，我们必须把知识定义得足够客观（例如晚近知识论所要求的“主体间”客观性），从而它可以帮助我们区分诸如“幻觉”与“真实”这样的概念——从功能主义的立场看，“知识”定义必须至少细致到足够区分幻觉与真实，这可以说是我们对“知识”概念的最弱的要求。否则，在人类的演化中，这一概念就是毫无用处的，从而是没有生存理由的。这时候，让我们把一项事实a与一项幻觉b加以区分的可靠的方法，就是比较我们相信a与相信b所得的体验是否有显著差异。一个人如果坚信他能飞翔并因此而跃出窗外，这类体验的结果显著地不同于如果他不相信他能飞翔。在漫长的生物演化过程中幸存下来的物种，在它们的个体身上，引用詹姆士的观点（值得注意的是，这也是罗素的观点），或多或少积累了一些有用的知识，使它们不会轻易丧失生命。

这样，我们同意泰阿泰德第二次提供的知识定义——“知识就是真信念”，把我们的头脑可能产生的无数正常的和奇怪信念当中“符合真实”的那一类信念叫做“知识”，至少，我们认为这是“知识”的必要条件（未必是充分条件）。符合真实，这一条件要求命题能被证实或以足够高的可能性被证实。它不仅要求，甚至不必要求逻辑的真。这一点，我在介绍金岳霖先生的知识论时还要详述。沿着罗素和金岳霖的思路，可以抵达普特南和普兰丁格的当代立场。

此处，需要澄清的是难度不亚于“知识”的“真理”概念。亚里士多德是柏拉图的学生，但他不愿接受柏拉图的真理观念。柏拉图视真理为绝对客观的——所谓“共相”，就像“洞穴”外面的“太阳”那样客观，而人类能够获得的“经验”只不过是阳光在洞穴里的投影。亚里士多德对这一看法持有批评，因为他毕竟是那一时代的大科学家。显然，他提出的“符合论”真理观，一方面不违背老师的定义，另一方面，又承认了人类经验的真理性——尽管如柏拉图相信的那样，这一真理性被“洞穴虚幻”包围着。沿着这一思想路线，黑格尔提出一种综合了柏拉图和亚里士多德的更复杂的“真理”定义，那就是“逻辑与历史的统一”视角下的真理观。此处不赘。

亚里士多德的“符合论”真理观，是西方认识论的主流，流行了2000年，在康德那里被终结了。通俗地说，康德论证了这样一个命题：“理性为自然立法”。不过康德的“理性”定义是基于逻辑自洽性的从而是“先验的”，它不能容纳经验世界里的人与人之间在理性能力方面的主观差异。上述的黑格尔的真理观，是黑格尔为超越康德而做的努力。这一努力，至今仍在继续。例如，我推荐过的普特南1981年的著作《理性，真理与历史》，标题已很明显，继承了黑格尔的“逻辑与历史辩证统一”命题，尽管作者不被认为是黑格尔主义者。

另一方面，西方的经验主义哲学传统也有长足发展。例如，美国实用主义三大哲学家们，尤其是詹姆士和杜威。前者辞世较早，后者是罗素的同时代人。

詹姆士的真理观，用他自己的术语表达，是“极端主观主义的”，用金岳霖先生《知识论》第一章讨论的术语表达，是“唯主的”，不是“非唯主的”。根据詹姆士的看法，真理最终是信仰问题。你确信命题A是真的吗？如果你确信，它就是真的。关键在于，詹姆士和杜威是在美国实用主义传统内解释“确信”的。詹姆士解释说，任一观念，如果“你相信它是真的”这件事情，将显著改变你的生活世界，那么你相信它之真，就是有理由的。否则，你是否相信它，就是无关紧要的，因为你的世界反正不因此而有所改变。詹姆士的这一基于“差异性”的无差异原理，经过莱布尼兹，可以上溯到中世纪晚期重要的思想家“尼古拉的库萨”。后者写了一本小册子，《论有学识的无知》，我已介绍过了。

中国学者当中，金岳霖先生的知识论修养，最受推崇。不过，与许多深刻的思想家一样，金岳霖先生的知识论立场，是在唯主与非唯主之间徘徊着的。惟其如此，他写的《知识论》成为我们“无偏地”学习论辩双方的观点的出色教材。我的科学主义朋友们不妨先读金岳霖先生的《知识论》，以求得对西方科学家们在1940年代之前大致认同的主流的知识理论有所了解。不仅如此，结合金岳霖的另一作品《论道》来研读《知识论》，我们还可以熟悉中国知识分子在融合中西思想传统时所做的艰难努力。

罗素 1948 年《人类的知识》在思想史中的位置,按照时间,居于黑格尔与普特南之间,但在詹姆士之后。如前述,罗素思想,明显地受了詹姆士经验主义哲学的影响。这一哲学传统的最让我信服继承者是普特南——我认为,他是詹姆士和杜威之后美国出现的第三位具有世界影响的哲学家。

这样,我们看到,科学主义者们,与其接受亚里士多德的真理观,为了保持他们的科学主义立场的逻辑自洽性,还不如接受罗素的“知识”定义——知识就是有根据的真信念。

自从哲学家们充分注意到人类语言与语言所表达的意思之间的复杂关系以来,我推测,主要是由于晚期维特根斯坦的批评,罗素给出的“知识”定义对他自己而言,也发生了问题。罗素在《人类的知识》的不同章节,以不同形式表达过这样的怀疑:我们应当给“真信念”加上一些什么样的条件,这些真信念就成为知识呢?这里,“有根据的”是否应与“生物演化的”具有同一含义?

经历了“分析哲学”兴衰的西方学者们,对语言与语言所要表达的思想之间的扭曲关系保持着充分的自觉。在这一背景下,从 1960 年代到 1990 年代,关于知识定义的问题,哲学论争从未间断。例如,读者可参阅: E. L. Gettier, 1963, “is Justified True Belief Knowledge?” *Analysis*, vol. 23, No. 6, pp. 121 - 123; G. Dawson, 1981, “Justified True Belief is Knowledge”, *The Philosophical Quarterly*, vol. 31, No. 125, pp. 315 - 329; C. Sartwell, 1992, “Why Knowledge is Merely True Belief?” *The Journal of Philosophy*, vol. 89, No. 4, pp. 167 - 180。

在西方的知识论叙述传统中,“知识”首先是作为动词“知道”而不是作为名词“知识”出现的。例如,“知识是真信念”这一陈述通常被展开为:“P 知道 K 当且仅当 (1) K 是事实, (2) P 相信 K 是事实。”若再增加一项条件——(3) P 有充分理由相信 K 是事实,则此陈述成为“知识是有根据的真信念”。

上引 Gettier 1963 年发表的那篇只有三页纸的论文,对“知识是有根据的真信念”提出了颠覆性的批评。这里,Gettier 提出的例 I 和例 II 表明:存在某些场合,使上列的条件 (1)、(2)、(3) 成立,而 P 仍未必“知道”K,由于信息不完全或由于偶然因素的影响。所以,“有根据的真信念”不是“知识”的充分条件。

Gettier 的反例可以被表达为更有说服力的形式:(甲) P 在信息不完全的情境 S1 内产生对命题 K——“P 已患胃癌”的真实性的信念 B1,并且有充分的理由 R1 来支持 B1,而且, K 是真实的;(乙)在信息更完全的情境 S2 内, P 用来支持 B1 的理由可能显得不充分,或由充分理由支持着的信念 B1 可能显得不真实,但 K 仍是真实的;(丙) K 是真实的,不过, P 在 S1 内关于 K 的真实性的信念 B1 及其充分理由 R1 在任何不是 P 的人看来都是虚妄的。

首先，当（丙）发生时， $K, P, B1, R1$ ，满足“有根据的真信念”，但 P 并不知道 K 。其次，当（乙）发生时， $S1$ 内的 $R1$ 其实不能支持 $B1$ ，故 P 在 $S2$ 内知道 P 在 $S1$ 内并不知道 K ，虽然（甲）满足“知识是有根据的真信念”故 P 在 $S1$ 内是“知道” K 的。

上面的分析意味着，“知识定义”的条件（3）发生了一个关键问题：什么是信念的“充分理由”？这一问题可分解为两问题：（A）理由的充分性是“情境依赖”的吗？（B）理由是“客观”的吗？

换句话说，泰阿泰德在第三次尝试中给出的解答——“知识是有根据的真信念”，需要有更多的解释，否则就不能成为“知识”的定义。这些当代的“更多的”解释，是围绕着上列（A）和（B）两条线索展开的。

这样，我们就可以理解普特南 1981 年这本著作的主旨了。首先，这部著作标题里的“理性”，是“reason”而不是“rationality”。前者，王国维先生主张译为“理由”，后者则译为“理性”。理由比理性宽泛得多，它更接近“智慧”，可以带有“情理”之内的理，可以是“历史理性”的理。普特南试图寻找的，我认为，就是这样的理。所以，在这样的理之后，有一对范畴“真理”（truth）与“历史”（history）。普特南论证，真理的“真”，是有合理根据的真。而这一合理根据的重要部分，是历史的，或者，“演化论的”。

普特南自己认为他的知识论和真理观更倾向于是“内在论”的，而不是“外在论”的，但他又不能完全同意内在论的立场。他试图表达的，是超越内在论（唯主的）和外在外论（非唯主的）知识论和真理观，所谓“内在论的实在论”。

非常粗略地概括，普特南为一切知识的合理性找到的根据，最终是在黑格尔所说的“逻辑与历史统一”视角下的根据。这一根据的奈特式的解说是：被特定社会的特定知识共同体的被承认为“重要成员”的那些人感受为“重要”的那些规范，为既有的知识存量提供了合理性与批判的基础，也为新的知识提供了选择标准（偏好）。

但是，这些知识共同体之间的竞争关系，以及人类社会与其他物种之间的竞争关系，对上述的知识结构有足够大的选择压力，从而，长期演化可以淘汰“不合理的”规范与偏好。当然，人类如此演化，究竟可能走到何处？这是一个很令人悲观的无法解答的问题。

在这部著作第三章结尾有一段文字：“对于内在论者来说，这是无可非议的。为什么有时不可以存在几种同样好的与我们的经验信念相符合、同样的融贯（自治）但又不相容的概念框架呢？如果真并不是惟一的符合，那么就展现了某种多元论的可能性。”

我们知道，科学主义的逻辑前提是假设“真理惟一”，因为“上帝不掷骰子”。所以，他们相信一种“符合论”的真理观和知识论，他们相信人类有一种无限接近客观真理的“科学”能

力，因为真理是客观地永恒地存在于某个地方的……说白了，他们始终未能解释清楚他们的实质主义的世界观的前提，那个永恒且惟一的真理，究竟是什么。西方人很明智，黑格尔宣称“上帝已死”之后，再也没有必要像牛顿那样假设科学研究者有“上帝的眼睛”并接受柏拉图的真理观，他们大多已经放弃了亚里士多德那样的古典真理观，接受了实用主义的真理观。李泽厚指出，中国文化传统原本有一种深厚的实用哲学。这样，中国知识分子接受并融合西方的实用主义思想，原本是更具优势的。

人类依靠自己的有限理性能力，试图把生命体验整理为“知识”——有根据的真信念，这样获得的概念系统，金岳霖先生要求它满足“真”和“通”。所谓“通”，就是逻辑自洽性，即上引普特南文字中的“融贯”。所谓“真”，金先生在西方哲学的逻辑“自洽性”之上，更融入了中国思想，他称之为“真正感”——浑然的“如如”。借用佛学的“如如”概念，这是金岳霖试图超越西方哲学的局限性的一种东方式的努力。

知识的理论很多且繁复，我在这篇不算短的随笔中，或许只能提供上面这样的论述了。这一论述把我们引导到这篇随笔的题目的第二个关键词——“秩序”。

首先，字源学考证表明，“秩序”（order）是比“制度”（institution）远为宽泛的一个概念。制度的起源，与人为的各种设置有关，例如查士丁尼法典，是一套“institutes”。又例如疯人院，是一种“institute”。虽然，在诺斯的著作里，“非正式制度”也包含着规范与习俗。秩序，可以是人为的，也可以是人不能意识到的。例如自然秩序，在人类之前已经存在。又例如脑神经网络的秩序，在意识之前已经存在。

其次，我们需要考察“秩序”与“结构”的关系。粗略而言，结构是在特定时空被感受到并且被呈现给意识的秩序。也因此，结构主义是社会科学研究的基本方法，不可轻易放弃。结构是静止的，故而可以有符合逻辑的表达。静止的结构，在不同时空可以有不同形态。我们对不同形态的结构联想，可以产生结构的流动感，称为“演化”。

再次，秩序的未被感受到的或感受到而无法表达出来的部分，或许远比结构要广阔和深远。苏格兰启蒙思想家们，例如亚当·斯密，对秩序的隐秘部分表示出最高的敬畏。在斯密看来，人类渺小的理性能力只能“发现”秩序的一些片段，无法洞察全部秩序，更无法“设计”秩序。

最后，在神秘主义哲学的论述中，我们看到，神秘感可以被定义为“有限的个体生命与更高的秩序相接或融入于一个更高秩序时的感受”。这里出现的，是“秩序”，不是“结构”。因为结构是可以被表达从而被理性所把握的，此时，神秘感无从发生。

爱因斯坦在1932年发表的“我的信念”中这样写道：“人所能具有的最美的和最深刻的经

历是一种对奥秘事物的感受。这种奥秘感是隐藏在宗教以及一切认真严肃的艺术和科学活动背后的基本原则。在我看来，凡从来没有过这种体验的人似乎已经变得盲目失明，倘若不是已经死亡的话。感受到在我们所能经历的一切事物的背后存在着某种我们的心灵无法把握的事物，它的美和崇高只能间接地而且以其微弱的反影达到我们的心灵——这就是宗教虔诚性（religiousness）。在这一意义上，我是‘虔诚信教的’。”（中译文引自林同奇“人、自然、超越者：忆老友本·史华慈——希·普特南教授访谈录”，《史华慈论中国》，新星出版社，2006年11月第1版，第488页）

我们对于秩序的感受，绝大多数是难以表达的。也因此，我曾试图在演化论视角下给“制度”一种最宽泛的定义——所谓“隐含定义”，它是这样的：如果当前的行为被感受到由以往的行为所约束，那么，存在着制度。

康德曾问：自然何以可能？康德回答：自然之所以可能，因为理性为它立法。康德又指出，由于理性本身的局限性，理性为自然立法的结果，只是概念中的自然。至于自然本身，则是人的理解与智性不能把握的，故而，才应排拒知识，为信仰留余地。不过，这是一种主观与客观截然两分的认知理论，已被今天的哲学超越了。齐美尔曾问：社会何以可能？齐美尔回答：社会之所以可能，因为人具有“可社会性”（sociability）——抽象掉一切利益关系之后仍存在的人与人之间的本质性的情感关系。这是一种主观与客观无法截然两分的认知理论，因为情感关系只能是社会的。

今天，在奈特和普特南之后，在理性自我消解的时代，我们询问：秩序何以可能？

对这一问题，我的回答是：秩序之可能，因为人有感悟秩序的能力——这一能力又称为“悟性”。注意，悟性，通常对应于康德所谓的“理解力”。不过，在汉语中，“悟”这一概念的内涵远比康德赋予“理解力”的内涵更丰富和深刻。也因此，我这篇笔记的标题，只有悟性“浅说”，而不能有“悟性论”。

秩序不同于结构，大致已如前述。现在，我试图强调的，是秩序的非静止的性质，即“演化秩序”。在这一论题上，就我的阅读范围而言，怀特海晚年作品《思维方式》，算是当代哲学能够提供的最具启发性的论述了。我可以补充的内容，或许要基于当代的脑科学与认知科学研究成果。

怀特海是罗素的老师，他们两人曾合著《数学原理》，试图将数学基础完全表述为逻辑命题。经过了1925—1929年期间的思想转型（即从《科学与现代世界》到《过程与实在》的转型），哈佛时期，所谓“第三期”怀特海的哲学努力，是试图将世界表述为“过程”并且把“实体”表述为无数过程的聚散显隐。下面的叙述，首先基于我的《制度分析基础讲义II》和我

对怀特海《思维方式》（其中收录的是他1934—1938年期间的讲义）的理解。其次，也算是对《制度经济学三人谈》的补充。

逻辑与历史的统一，这是思想者所追求的黑格尔式的理想。怀特海（晚期）似乎是西方思想者当中最明确地要继续黑格尔这一理想的，他努力将“过程”（历史）与“实在”（逻辑）置于统一的视角下，他的这一努力，今天被称为“过程哲学”（process philosophy），被融入演化理论的学术传统中。（参阅“斯坦福哲学百科”——“过程哲学”条目）

作为对数学基础和数理逻辑有着最透彻理解的为数不多的学者，怀特海在《思维方式》第三讲里写道（我只引述最相关的文字和段落）：“第一，如果把逻辑建立在不相容性概念的基础上，那肯定引入了关于有限者的概念。……第二……从这个不相容性概念中可以得出否定概念和推理概念。这样就为整个逻辑运动做了准备。……第三，逻辑的这种基础启发了我们对于过程的理解，而过程是我们经验中的一个基本事实。”（中译本，《思维方式》，刘放桐译，商务印书馆，2004，第48页）

这里，所谓“不相容性”（inconsistency）概念，是说，A不能不是A，或者说：“A并且非A”是自相矛盾的陈述。语言是思想的家园，处于自相矛盾的语言中，思想将变得十分艰难，尽管这绝不意味着不能有思想。不论如何，人类在改善自己的思想家园方面取得的第一项进步，就是语言的进步，它逐渐演化为更符合逻辑的语言。于是，当我说“这只天鹅是白色的”时候，你很难认为我是在说“这只天鹅不是白色的”，除非你和我之间不存在任何共同语言的传统。

怀特海说，一旦我们承认“相容性”为一项基本的逻辑规则，我们事实上就隐含着接受了“有限性”概念——任何可以逻辑地表达的事物，都是有限的，不是无限的。这当然不是说，我们没有关于“无限性”的语言。我们可以说，例如，“上帝无限”，“世界无限”，“精神无限”。不过，我们将很难逻辑地表达我们所说的这些具有无限性的事物。

可是，我们关于“无限性”的感受确实很重要，它是我们生活的重要部分，是我们信仰的终极来源，也是我们的一些最重要的价值判断的基础。所以，我们感受到要将被感受到的无限可能性表达出来的冲动。我曾详细阐述过怀特海《思维方式》第一篇“创造的冲动”的章节顺序的意义。第一讲“重要性”，第二讲“表达”，第三讲“理解”，在怀特海思想中，这意味着对重要性的感受先于表达，后者又先于理解。这又意味着，为了有所理解，必须有所表达。

那么，我们怎样表达不能被逻辑地表达的那些重要性呢？怀特海的解决方案是“过程”，把具有无限性的事物表达为“过程”，因为过程可以包容许多互不相容的实体。惟其不相容，故而它们不能同时存在，但它们可能不同时存在。不同时存在，就可能在时间中先后存在，于

是就有了过程。

换句话说，我们可以把我们关于无限性的重要感受表达为许多不同时空的“实在”——逻辑地自洽的事物，虽然这些表达不很确切，但我们在理解中总可以把这些实在融贯为“过程”，从而我们可以感受到这些表达的真实性。此处“融贯”，是普特南的术语，对应于金岳霖先生所谓“浑然的真实感”。

为什么静态的、逻辑的、非历史的，或者实在论的对无限性的表达，我说它们“不很确切”呢？因为从“A”的先在性到“非A”的后在性，包含了这样一个重要问题：“A”怎样演变为“非A”？这是一个巴门尼德式的问题。如果A存在，那么A存在是永恒的，不会有“A不存在”。如果你感觉到“A”确实演变为“非A”而且这一感受对你而言至关重要，那么，巴门尼德可以追问你：在你的感受中，从“A”到“非A”，究竟有哪些因素在改变？这些因素是怎样改变的？如果是渐变，例如，“汪丁丁”这个人逐渐地变为“不是汪丁丁”这个人，那么，这些改变了的因素是否决定了当初的“汪丁丁”的本质？如果本质只有一丝改变，显然，“汪丁丁”这个人不会被认为不再是“汪丁丁”，只有当本质发生了显著改变之后，“汪丁丁”才不被认为是“汪丁丁”了，可是这“本质”是什么呢？这里引出的，就是所谓“同一性”问题，或者，“同一与差异”问题。它是一个当代哲学问题，读者可以参阅诺齐克《哲学解释》，此处不赘。

继续引述怀特海：“现在我们必须回到关于‘不相容性’和‘过程’这个论题上来。两个命题（我们可称之为P和Q）不相容这种说法的意思是：按照以某种预先假定的环境所勾画出的结合方式，命题P和Q的意义不可能都显示出来。……于是过程就成了宇宙借以避免排除不相容性的方式。”（上引中译本第49页）这里的最后一句，怀特海英文原版的表述是：“Now process is the way by which the universe escapes from the exclusions of inconsistency.”（N. Whitehead, *Modes of Thought*, Free Press, 1968, p. 54）也就是说，被我们感受为特别重要的那些不相容性，我们不能回避或排除它们，所以，我们应当寻求表达它们的途径。“宇宙”或“世界”，是我们关于无限性的概念表达，而“过程”则是宇宙表达这一无限性的途径。

以上引文另一应予解释之处，是“某种预先假定的环境”这一短语，它是两个不能相容的命题P和Q的合取式所发生的环境，它使得P和Q的意义的合取，很难被我们理解。例如，“此时此地下雨”与“此时此地不下雨”，若合取，则引发我们的理解困难。不过，我必须补充说明，并非不能合取，或者合取的意义不能被理解。例如，“我爱你”与“我恨你”这两命题的合取，可融贯于“爱恨交加”这一短语内，并且表达一种远比单纯的爱和单纯的不爱更复杂并且往往更重要的人类情感。引发争论的问题是，此处的“恨”是否为“爱”的一种形态？

我们不仅感受到“无限”的重要性，我们更经常地感受到重要的有限性。例如，我们对“我”之外的每一个人的感受，是有限的，但重要。这些感受不能仅仅表达为逻辑的，因为每一个人都有矛盾之处，几乎没有一个人是完全不包含矛盾的。关于“矛盾”的感受，是无法逻辑自洽地表达的。可是，我们不会简单地把不具有逻辑自洽表达的感受看做是关于不同的个人的感受，我们关于这一个矛盾的人，仍有“浑然的真实感”，他肯定不是“不是他”的另一个人。也就是说，我们借助于悟性，超越了逻辑表达的层次，建立了关于一个真实的人的真实感。

怀特海指出，任何抽象都是一定层次上的抽象，于是都不能不预先假设某种抽象环境。最抽象的环境，例如“宇宙”，没有不相容性，因为没有另一无限性与它对峙。不过，这样的抽象环境失去了具体意义，它缺乏对任何特殊事物的界定，一切都包含于宇宙之内，无差异，也无从把握。实践和理论的进展，总要求一定的界定性，即“分殊”。一旦有了分殊（依赖于“认知”的水平），科学就可以发端。“只要我们满足于高度的抽象，就可以达到一种不难的理智的相容性。……科学的对象扩大了，它对于宇宙的关联性就会缩小。因为它预先假定了一种更为严格限制了的环境”（上引中译本第50页）。此处“不难的理智的相容性”原文为“an easy intellectual consistency”，含有少许贬义——相对于更深刻与更优越的智力而言。

也就是说，足够严格界定了环境之后，我们总可以有有关感受的逻辑自洽的表达，不论这些表达是否会因脱离“浑然的真实感”而显得苍白和缺乏创造性。所以，怀特海说：“有限的科学的清晰性和其外的黑暗的宇宙之间这种决然分裂本身就是一种撇开了具体事实的抽象。”（上引中译本第51页）

上面的引文还意味着，对于表达被我们感受到的重要性而言，最重要的不是要不要抽象——因为一切表达都只能是对“浑然的真实感”的抽象，而是寻求某种恰当的抽象——在浑然的真实感与逻辑自洽之间实现恰到好处的折中的表达的艺术。

那么，我用隐含方式界说的最广义的制度，或者我在此处探讨的“秩序”概念，它是怎样显现给我们并被我们理解的呢？在《思维方式》接近第三讲的结尾处，怀特海写道：“逻辑的理解是对于允许有这种抽象的统一的抽象的细节的享受。随着享受的发展，就会发现结构的统一。”（上引中译本第56页）这里，结构的统一感，就是被感受到的“秩序”，尽管每一单独的“结构”，为了逻辑自洽性而必须表达为有限的、静止的、非历史的、依赖于特定环境的从而其意义容易被理解的命题的集合。

在正式转入“秩序”概念的探讨之前，我希望读者玩味怀特海在《思维方式》第三讲结尾的文字：“离开细节，离开体系，哲学观是思维和生活的真实基础。我们所注意的那些经验以及我们推到不必注意的背后的那些观念支配着我们的希望、我们的恐惧、我们对行为的控制。

只要我们思想，我们就活着。这就是为什么哲学观念的收集超出了专家的研究范围，它铸造了我们的文明的类型。”（上引中译本第57页）

我们说“秩序”是一个比“制度”远为丰富的概念，意味之一，是说秩序是一个自发创造的过程（奈特所谓“procedure”），而制度则只是这一主动过程的被动显现——外显的过程（奈特所谓“process”）。

时至今日，人类对她赖以生存和繁衍的这套秩序的理解，还十分肤浅，还停留在斯密和哈耶克为我们阐述的理解中。甚至斯密和哈耶克的阐述，也只是在最近几年，由于脑科学与认知理论的突破性进展，才再度引发了我们的关注。

在科学研究的基础上，我们开始赞同哈耶克早年对“自生自发秩序”的推测——人脑内的神经网络秩序与人类社会的市场秩序之间的同构性。这一同构性的当代表述是：脑神经网络的拓扑结构，与一种叫做“友好关系网络”（friendship network）的社会网络的拓扑结构具有最相似的特征。交易，哈耶克和布坎南都强调，它的古代希腊语词根含有“分清敌友”的意思。布坎南解释说，交易总是与朋友的交易，不是与敌人的交易。如果与“敌人”成功地发生了交易，那么，敌人就不再是敌人，此即苏格兰启蒙思想家们的著名口号“经济的文明化影响”的含义——人与人之间敌对关系的“文明化”。

更进一步，脑科学研究表明，每一个人的脑结构，从低级层次到高级层次，被感受到的重要性可以自发涌现，从低层次凸显到高层次中，成为被感受到的更高的重要性。最后，那些最重要的，呈现为“自我意识”。可是，这些表达了各种重要性的神经网络，它们之间的日常关系，是竞争性的。这里，没有一个中央计划单元来协调竞争着的无数重要性。因此，更准确地说，每一个人的脑内，存在着一个神经网络的社会，从而存在着类似阿罗“不可能性”定理所刻画的社会理性选择的困境。在这一意义上，我们可以认为，脑内的社会秩序与脑外的社会秩序，具有某些重要的同构性。

秩序比制度有远为丰富的内涵，也体现在史密斯教授关于实验经济学成果（诺贝尔奖演说）的论述中。史密斯发现，一般均衡理论（市场制度的逻辑自洽的表达）在太强的假设下得到的均衡存在性与均衡的资源配置的最优性，在市场实验中同样可以显现出来，但在这些实验中，完全不需要“信息完备性”假设，以及与此相适应的其他一般均衡假设。事实上，在参与人数很少（例如只有5人），而且参与者完全不知晓他人偏好和交易物品的真实价值的条件下，交易仍可在有限时间内收敛到某一均衡状态。通常，这类均衡的效率损失——以理论效率为衡量标准，不超过25%，经常低于10%，这意味着在实验室条件下，无需假设完备信息，没有瓦尔拉和德布鲁一般均衡模型所假设的全知全能的拍卖者，市场自发地使资源配置达到90%有

效。如果当真如此,那么,我们完全可以推测,许多旨在获取多于实验室市场的信息的努力,例如政府和精英群体的努力,只不过是浪费资源。因为,这些努力所耗费资源,以及因此而发生的效率损失,肯定超过10%,如果不是超过35%的话。

换句话说,一般均衡理论在太强的逻辑前提下推导出了自由市场的丰富内涵的最肤浅的那些性质,这些逻辑前提,作为一般均衡存在性的充分条件,显然超过“必要条件”太多,所以无法解释史密斯教授在经济学实验室里发现的那些市场性质。

即便如此,对于市场的研究,一般均衡模型仍是经济学家公认的最有价值的模型。注意,经济学家之所以公认这一点,是因为他们自己生活在市场社会里,从而对市场已经有了“浑然的真实感”。在这一感受的基础上,他们公认,一般均衡理论为“市场”所限定的“环境”是一种恰当的抽象,它保持着与真实感的恰到好处的距离并且刻画了市场运作的核心性质——“价格”。根据这一理解,那些没有在市场里生活过或者缺乏关于市场的“浑然的真实感”的学者,未必认为一般均衡模型是对市场生活的恰当抽象。这一点,在相当程度上可以解释经济学家与其他学科的专家之间的日常冲突。

为什么对秩序的最意味深长的阐述来自斯密和哈耶克这样的经济学家?难道其他专业的学者没有对秩序的更意味深长的阐述吗?我的回答是:有,少数具有深刻洞察力且思维未被限制在“形而上学”之内的神学家的阐述,但在“后神学”时代,斯密和哈耶克的阐述最令人信服。

事实上,斯密深受苏格兰“长老派”神学的影响,同时,斯密深受斯多亚学派关于神的“先定和谐”思想的影响(参阅斯密《道德情操论》“序言”,斯密的私人信件,以及,格拉斯哥大学版斯密“法学讲义”的课堂笔记“LJA”和“LJB”)。对斯密“神秘主义”秩序思想的解读,最充分且最明确者,不是哈耶克,而是奈特在1940年代发表的一系列论文和演说中(Frank Knight, 1942, “Science, Philosophy, and Social Procedure”, *Ethics*, vol. 52, No. 3, pp. 253 - 274; 1944, “the Rights of Man and Natural Law”, *Ethics*, vol. 54, No. 2, pp. 124 - 145; 1944, “Human Nature and World Democracy”, *American Journal of Sociology*, vol. 49, No. 5, pp. 408 - 420; 1946, “the Sickness of Liberal Society”, *Ethics*, vol. 56, No. 2, pp. 79 - 95)。

市场作为“人类合作的扩展秩序”,哈耶克引用先贤名言:只能被发现,不能被设计。那么,市场的局内人是否有制度创新(即“企业家创新”活动),并且,他们的制度创新活动怎样被逻辑地表达出来呢?这是目前制度理论必须回答而尚未回答的问题。

怀特海说:“逻辑和美学都关注封闭的事实。我们的生活则是在关于发现的经验中度过的。一当我们失去了这种发现感,我们就会失去心灵所是的那种活动方式。我们就会沉落到仅仅与

过去的平均值相符合。完全的符合意味着生命的丧失。剩下的是荒芜的无机界的存在。”（上引中译本第56—57页）此处，“美学”不同于“审美”。后者是感性的活动，不是逻辑的。

换句话说，秩序的自生自发的创造性，与局内人的主动创新活动，二者之间具有怎样的关系呢？这是最广义的制度理论必须回答而尚未回答的问题。

我自己解答这一问题的努力，把我引至“悟性”概念——这篇笔记的标题中最后一个概念。

仍引用怀特海《思维方式》的文字（第二篇第五讲）：“只要过程的概念得到了承认，潜在性概念对于理解存在就是根本性的了。如果根据静止的现实事物的观点来解释宇宙，那潜在之物就消失了。……直接事实中的潜在之物构成了过程的推动力。”（上引中译本第89页）

根据汉语的日常语用学，“悟性”，首先是一种洞察事物潜在性的能力。其次——关于这一点存在着争议，它可以指人类的某种潜在能力，这种能力使每一个人可能感悟到比人类更高级的存在。

在西方思想传统中，对应于“悟性”的，是“理解”，对应于英文是“understanding”，对应于德文是“Verstand”。不过此处仍有争议，例如，阿伦特不同意把Verstand译为understanding，她坚信这一概念应译为“intellect”。

综合上述，汉语“悟性”一词的含义中，既有西语的“理解”，又有西语的“直觉”。不过，此处还有争议，例如笛卡尔对“直觉”的定义（参阅笛卡尔《探求真理的指导原则》）。

不论如何，让我们把“悟性”界说为理解与直觉，于是，与悟性关系最密切的，不再是康德所谓“理性”，而是康德未能充分解释的“判断”。阿伦特曾对康德的判断力批判有极重要的批评，与此相关，她有一篇未写完的“卷三”（以“附录”形式辑入《精神生活》）。在《精神生活》“思维”卷中，她注意到康德的一个常被启蒙理性主义者忽略的看法：“一切思维只不过是到达直观的一种手段。”（中译本，江苏教育出版社，2006，第68—69页）。康德所说的“直观”是带有神秘主义色彩的，因为“……想获得这种能力的要求‘通常被叫做愚蠢’，这样的一种失败是无可避免的”（《纯粹理性批判》第二版，李秋零译，华中师范大学出版社，187页）。阿伦特这样解释“判断力”：“始终作为心理结构的一般和始终倾向于感官经验的特殊得以整合在一起的精神的神秘能力，是一种‘特殊的能力’……”（《精神生活》“思维”，中译本第75页）。

悟性或者判断力的开发，第一要求足够丰富的生活体验——足以发生“浑然的真实感”，第二要求足够深刻的理性洞察——恰到好处地表达具有本质重要性的东西，这些东西往往是潜在的包含在现象中的。第三，悟性的充分发展往往与思维对它自身所得结论的不断否定（扬

弃)有关。根据我的观察,完全没有自我批判精神的人,几乎从未有过充分发展了的悟性,尽管他们先天的资质里可以包含非常好的悟性的种子。

或许由于悟性的这些特征,那些悟性得到了充分开发的人被认为具有“智慧”——悟性的外显,可谓之“智慧”。因为,首先,他们能够比不具有智慧的人更多地看到事物的潜在可能性,并足够准确地预测未来。其次,虽然更多地看到事物的潜在可能性,有智慧的人,为了智慧自身的缘故,往往不追逐目光短浅者所追求的功名利禄。

人类一般而言是从具有较低的智慧向着具有较高的智慧演化的,因为智慧,根据上面的解释,应能使智慧所在的人类群体更适应环境的变动,后者需要长远的目光和宽广的视野。注意,我强调,智慧的受益者不是智慧者而是智慧所在的群体。因为,智慧者为了智慧自身的缘故往往不追逐自身利益,他们的功用是群体性的。苏格拉底可以被雅典人处死,而他的智慧却保存在源于雅典的诸人类群体之中并造福于这些群体。

在这样的演化论视角下,更具智慧的人类成员,他们据以判断任一真信念的合理性的标准,比具有较低智慧的人类成员所据的判断标准,或许更经常地取得成功——不是更有利于个体生存竞争而是更适应“群体选择”的文化环境。用罗蒂的话说,就是“……找到一条把我们从祖先那里继承下来的世界观和道德直觉,与新的科学理论或社会政治制度及其理论或其他新奇事物结合在一起的途径。”(罗蒂,《真理与进步》,杨玉成译,华夏出版社2003年版,“导言”第5页)这样的理解,将把秩序与对秩序的领悟,引导至一种政治学的论域之内。

综上所述,我觉得应当有一个能够把“知识”、“秩序”、“悟性”融合在一起的演化论的陈述,作为我这篇笔记的结语,它大致是这样的:由最初偶然发生的秩序,自然选择的力量筛选出一些更具智慧的人群,每一群人按照他们达成共识的合理性规范,不断把他们的信念的一部分转化为知识。这些群体当中,有一些群体积累了更适应环境变动的知识。某一阶段的知识演化的成功,未必意味着未来任一阶段的知识演化的成功。比较优越的秩序——仍是偶然发生的,更可能产生智慧的人群及其知识积累过程。如果这一向上的演化不被群体内更常发生的政治困境所中断的话,那么智慧程度的增长迟早可以达到使秩序内的人群借助于他们的悟性,洞察到他们赖以生存的秩序。

个人权利和社会评价：一个概念框架

Prasanta K. Pattanaik and Kotaro Suzumura*

汪蓉 译

我们将个人偏好序作为信息基础，针对惯例上定义的社会可选方案和社会决策机制的组合，提出了一个分析社会选择和福利的框架。我们特别探讨了当社会决策机制成为用博弈形式表达的权利格局时的情况。我们用这个分析框架阐释了在授予的权利中个人偏好扮演的角色，权利被授予的过程和权利的实际内容。进而我们探讨了此概念框架对社会选择中两个颇具争议的命题——社会选择的一致性和 Sen 的帕累托自由主义的矛盾的意义。

一、引言

这篇文章的目的在于提出一个扩展了的概念框架以分析社会选择和福利。不用传统的将惯例定义的社会可选方案集 X 上的个人偏好序作为社会选择之信息基础的做法，我们提出要扩展这个概念结构，从而将信息基础扩展到 X 和 U 的笛卡尔乘积上的个人偏好序，其中 U 代表社会选择得以实现的社会决策机制集合。^① 定义社会成员 i 的扩展了的个人偏好序为 Q_i ， (x, m) 和 (x', m') 是 $X \times U$ 上的两个元素，那么 $(x, m) Q_i (x', m')$ 就意味着，在 i 的判断中，通过 m 实现 x 至少和通过 m' 实现 x' 一样好。^②

* Prasanta K. Pattanaik, Department of Economics, University of California, Riverside, CA 92521, USA. Kotaro Suzumura (铃村兴太郎), The Institute of Economic Research, Hitotsubashi University, Naka 2 - 1, Kunitachi, Tokyo, 186 Japan. 汪蓉, 浙江大学竺可桢学院。

① 事实上，为了将各种不确定性都考虑进来，我们应该定义一个更加广义的概念框架，将个人偏好序建立在 A 和 U 的笛卡尔乘积上，其中 A 是 X 的所有非空子集的集合。

② 一个很可能出现的状况是 $(x, m) \in X \times U$ 不可行，即 x 可能无法通过决策机制 m 获得。基于此，我们将这种要在 $X \times U$ 的交叉空间上定义个人偏好的问题排除出去。请见第四节（四）对这个概念框架面对具体个人权利时的可行性的定义。

社会成员似乎确实想对 $X \times U$ 上的元素作比较和判断。实际上,一个人可能会做出这样的判断,也就是自由市场机制下获得的任何商品束都优于中央计划分配的商品束,甚至当后者商品束更大时也是如此。也有人做出这样的判断,需要更多的面包和葡萄酒,越多越好,而不管通过什么样的机制来获得。前者优先考虑社会决策机制,而后者则优先考虑结果。当然,如此极端的偏好在现实中肯定不存在,但我们依然可以作出一个更加贴近现实的假设,也就是社会成员同时关心社会决策的过程和结果,并且时刻在二者之间作权衡。这就是我们将要在这篇文章中采用的基本观点。

尽管这个扩展了的概念框架很具有一般性,能够在多种不同的具体情境下讨论,为了让我们的分析更加合理,我们将在假设决策机制集为可预见的权利格局集的前提下展开探讨。

本文结构如下。我们将在第二部分解释权利格局,在第三部分介绍扩展了的社会可选方案的概念和扩展了的社会可选方案的社会评价,在第四部分中分析对权利格局进行社会选择的几个步骤,在第五部分将这个扩展了的分析框架应用于个人权利的争议性命题、社会选择的一致性和帕累托效率的分析中,在第六部分以对此文献的评论和观察结束。

二、权利格局

我们首先定义权利格局。令:

$$N: = \{1, \dots, i, \dots, n\}$$

其中 $2 \leq n < \infty$ 表示社会成员, X 表示依惯例定义(或狭义定义)的社会可选方案集合,而一个惯例上定义(或狭义上定义)的社会可选方案集是对排除社会决策机制的社会的完全描述。令 \mathcal{A} 表示 X 的一切非空有限子集的集合, \mathcal{A} 中的每一个元素 A 代表一个事件,即特定条件下的 X 的一个物理可能的子集,下文通称事件。一个社会的决策机制通常包含了一系列复杂的规则,他们中的一些与个人权利有关,而另一些与个人权利无关。为了集中讨论那些仅仅与个人权利有关的问题,我们在这里假设那些与个人权利无关的规则为给定不变。

前人研究中存在着两种方法定义个人权利。一是由 Sen (1970; 1970a) 提出的众所周知的依据偏好的方法,另一种是 Nozick (1974) 中提出的博弈形式法。跟随 Gärdenfors (1981), Sugden (1985) 和 Gaertner 等 (1992) 的研究,本文将采用博弈形式法来定义权利。^①

^① 关于个人权利的偏好表示法及其运用,请参阅 Sen (1970; 1970a; 1976; 1983; 1992; 1994), Gibbard (1974), Suzumura (1983, Ch. 7)。

定义 1：对每一个事件 $A \in \mathcal{A}$ ，定义一个基于 A 的博弈形式 G_A 为 $(n+2)$ 维的 $(N, S_{1A}, \dots, S_{nA}, g_A)$ ，其中，对每一个 $i \in N$ ， S_{iA} 代表 i 的可实施策略集， g_A 是结果函数，负责将每个策略的 n 人联盟 $s^N = (s_1, \dots, s_n) \in S_A^N := \times_{i \in N} S_{iA}$ 映射到 A 。一个权利格局 G 就是一个基于事件 A 的博弈形式 G_A 的具体化，对于每一个 $A \in \mathcal{A}$ ，满足 $G = \{G_A \mid A \in \mathcal{A}\}$ 。用 \mathcal{G} 表示一切可预见的权利格局的集合。

这个定义所包含的意义在于个人权利能够被一个博弈形式作最准确的表达，这个博弈形式能够给每个社会成员一束可行策略，并且赋予每束可行策略一个可能的社会结果。对任一 $A \in \mathcal{A}$ ，一个权利格局 G 确定了一个基于 A 的博弈形式 G_A 。既然博弈形式 G_A 依赖于具体事件 A，那么由 G_A 赋予每个个体 $i \in N$ 的可行策略集 S_{iA} 和相应的结果函数也依赖于具体事件 A。要解释为什么可行策略集与结果函数都必须依赖于具体的“事件”或可行的可选方案集，我们只需看这样一个简单的例子，在不缺水的天气里主人可能会随心所欲地灌溉他的花园，而在干旱季节就不会这么做。

在个人权利的表达中， i 的个人权利意味着他的权力，而 i 的个人权利则被反映在由权利格局 G 根据每一个 $A \in \mathcal{A}$ 而赋予社会成员 i 的可行策略集中。同时， G_A 也可能让其他人承担义务，譬如 $j \in N$ ，这种义务也被反映在 G_A 赋予社会成员 j 的可行策略集中。具体来说，社会成员 i 被赋予了信仰自由的权利，那么他自由选择任何宗教信仰的权利就会反映在他的可行策略集中。社会成员 i 行使他宗教信仰自由的权利也意味着其他社会成员不干涉他自由选择信仰和相应行为的义务，表现为干涉 i 信仰自由的行为将不会出现在其他社会成员的可行策略集中。^①

给定事件 $A \in \mathcal{A}$ 和一个基于 A 的博弈形式 G_A ，一旦社会成员 $i \in N$ 选择了一个可实施策略 $s_i \in S_{iA}$ ，那么结果 $g_A(s^N) \in A$ ，当 $s^N = (s_1, \dots, s_n) \in S_A^N$ 就被结果函数 g_A 决定了。然而，要解释社会成员具体会选择那一种可行策略，我们必须在结果 X 的集合上具体分析社会个人偏好。

对任意给定的集合 K ，定义 $\mathcal{R}(K)$ 为 K 上一切逻辑可能的序列的集合。 $\mathcal{R}(K)$ 的 n 重笛卡儿乘积 $\mathcal{R}^n(K)$ 中的每个元素，都意味着 K 上的个人偏好序的一个格局。

一个博弈形式 G_A 和一个人偏好序的格局 $R^N = (R_1, \dots, R_n) \in \mathcal{R}^n(K)$ 共同构成了一个博弈 (G_A, R^N) 。

^① 关于用博弈形式的方法解释个人权利的更多解释，请见 Deb (1989; 1993)，Gaertner 等 (1992)，Gaertner (1993)，Hammond (1993; 1994)，Pattanaik (1994; 1994a)，Sugden (1978; 1985)，Suzumura (1990)。

三、扩展了的社会可选方案和扩展了的社会福利函数

$x \in X, G \in \mathcal{G}$ 中的一对元素 (x, G) 定义为扩展了的社会可选方案, 简称扩展了的可选方案。x 是对不包括社会决策机制的社会状态的完整描述, (x, G) 则是依惯例定义的社会可选方案 x 和权利格局 G 的组合。从而, (x, G) 表示了一种同时包含被认可的社会选择结果 x 和普遍执行的权利格局 G 的状态。定义 X_+ 为 $X \times \mathcal{G}$, 即 $X_+ = \{(x, G) \mid x \in X, G \in \mathcal{G}\}$ 。

如果我们仅仅关注扩展了的可选方案的社会评价, 而忽略权利格局的社会选择或扩展了的可选方案的实现过程, 那么我们可以直接通过扩展阿罗定义的社会福利函数来建模。但是, 正如前文所述, 我们所感兴趣的社会是其社会成员不仅关注社会结果, 而且关注广义的社会决策机制和具体的社会成员的权利格局。在此激励下, 我们很自然地将扩展了的可选方案的社会评价建模为扩展了的可选方案的个人评价的集结。我们假设, 对所有 $i \in N$, 社会成员 i 对 X_+ 中元素的评价由偏好序 $Q_i \in \mathcal{R}(X_+)$ 决定^①。那么我们由下面的定义引出扩展了的社会福利函数的定义——在此假设下的阿罗社会福利函数的自然的衍生物。

定义 2: 一个扩展了的社会福利函数 (ESWF) 是函数 F , 满足对每一个 $Q^N = (Q_1, \dots, Q_n) \in \mathcal{R}^n(X_+)$, 都存在这样一个序 $Q \in \mathcal{R}(X_+)$ 。

给定一个社会福利函数, $Q = F(Q^N) \in \mathcal{R}(X_+)$ 被称为对应于格局 $Q^N \in \mathcal{R}^n(X_+)$ 的扩展了的社会福利序。扩展了的社会福利序体现了社会对扩展了的可选方案的评价, 而扩展了的社会福利函数则负责将扩展了的社会可选方案上的个人偏好序的每一个格局集结为一个扩展的社会福利序。

X_+ 上的个人偏好构成了 X_+ 上扩展了的社会福利序的基础, 区分对它的两种理解是必要的。根据第一种理解, Q_i 表示社会成员 i 得知事件哪个 A 将出现之前的偏好格局, 称为事前观点; 根据第二种理解, Q_i 表示社会成员 i 在得知哪个事件 A 将出现之后的偏好格局, 称为事后观点。我们认为无法对这两种观点作孰优孰劣的区分。如果我们选择采用事后观点, 那么 Q_i 必定是事件依赖的, 即 A 变 Q_i 必变。具体来说, 对 $A, B \in \mathcal{A}, G, G' \in \mathcal{G}$, 如果 G_A 比 G'_A 为社会成员提供更多的自由, 而 G_B 比 G'_B 为社会成员提供更少的自由。那么不管自由如何度量, 令 $x \in A \cap B$, 事件 $A \in \mathcal{A}$ 发生时, 更看重自由的社会成员 i 必然评价 (x, G) 优于 (x, G') ; 事件 $B \in \mathcal{A}$ 发

^① 在此我们将 $Q_i, (i \in N)$ 作为一个给定概念, 而在后文第四节 (三) 中, Q_i 由社会成员 i 的更加基础的二元弱偏好关系推导所得。

生时，他则必然评价 (x, G') 优于 (x, G) 。在接下来的分析中，我们显然没有必要对究竟选择 $Q_i \in \mathcal{R}(X_+)$ 两种理解的哪一个作取舍。

四、权利格局的社会选择

如果只想寻求扩展了的社会可选方案的社会评价，那么我们可以就此搁笔。具体来说，我们根本无需引入博弈论的均衡概念评价扩展了的社会可选方案，尽管博弈形式确实实现了对社会可选方案的完全描述。然而，我们还想为扩展了的社会可选方案的实现过程提供一个形式化的表达，于是问题变得复杂起来。原因很简单。根据权利的自然属性，社会必须首先决定一个权利格局（它是扩展了的社会可选方案的第二要素），然后个人自由行使他们在此权力格局中被赋予的权利，进而产生我们依惯例定义的社会可选方案。总的来说，个人和社会对权利和依惯例定义的社会可选方案都同样重视，所以社会在选择权力格局时必须考虑到个人行使如是权利后所可能产生的依惯例定义的社会可选方案。从而，社会必须认真考虑 X 上的个人偏好，同时预测在此偏好指引下的个人将如何行使他们在权力格局中被赋予的权利。在后文中，我们就将具体分析社会如何选择权利格局。鉴于本文的概念框架较传统社会选择理论复杂得多，我们在从第四节（一）到（四）部分首先介绍这个概念框架的不同组成部分，从而在（五）中给予综合。

（一）对权利行使结果的预测

假设事件 $A \in \mathcal{A}$ 和权利格局 $G \in \mathcal{G}$ 。给定权利格局 G ， X 上的个人偏好序格局为 $R_G^N \in \mathcal{R}^n(X)$ 。^① 在权利格局 G 给定的情况下，社会选择的结果将依赖于博弈 (G_A, R^N) 的结果。让 $T(G_A, R^N)$ 的值域非空，对于一切 $x \in A$ 将 x 定义为博弈 (G_A, R^N) 的一个可能结局。显然，博弈的均衡在这里很重要。用 ε 表示相应的均衡，在我们的分析中，相应的均衡的意义固定不变。令 $E_\varepsilon(G_A, R_G^N)$ 为博弈 (G_A, R_G^N) 的纯策略均衡，将这个纯策略均衡集表示成 $H_\varepsilon(G_A, R_G^N) := g_A[E_\varepsilon(G_A, R_G^N)]$ ， g_A 依然是博弈形式 G_A 的结果函数。根据 ε ， G_A ， R_G^N 的不同， $H_\varepsilon(G_A, R_G^N)$ 可能惟一，可能多重，也可能为空。假设如下：

$$\text{如果 } H_\varepsilon(G_A, R_G^N) \neq \phi, \text{ 那么 } T(G_A, R_G^N) = H_\varepsilon(G_A, R_G^N) \quad (1)$$

^① 在后文的（三）中我们将假设 X 上的个人偏好序和 X_+ 上的个人偏好都由一个我们事先给定的不同空间上的个人偏好序得出，我们也将解释 X 上的个人偏好序如何依赖于给定的权利格局 G 。然而在这里，我们依然在给定的权利格局 G 中讨论具体的格局 R_G^N 。

我们还不得不讨论 $H_g(G_A, R_G^N) = \phi$ 时, $T(G_A, R_G^N)$ 将如何变化。有多种不同的假设。

当博弈 $T(G_A, R_G^N)$ 不存在纯策略均衡时, 我们可能会认为 A 中的所有元素都可能成为社会结果从而无法在不同的可选方案中作区分, $T(G_A, R_G^N)$ 就应该是 A 本身。然而, 这种想法并不合乎情理。即便纯策略均衡消失 (或者即便混合策略均衡消失),^① 我们依然有理由剔除 A 中的一些可选方案而将 $T(G_A, R_G^N)$ 限制在剔除后的 A 的子集中。剔除的多种方法如下:

1. 当不存在纯策略均衡而存在混合策略均衡时, $T(G_A, R_G^N)$ 可以被定义在一切 $x \in A$ 的集合, 其中 x 在混合策略均衡中成为结果的概率为正。

2. 存在混合策略均衡之外的其他解决此问题的方法。譬如, 我们可以使用占优策略均衡的方法, 即使博弈不存在占优策略均衡, 我们依然可以自信地剔除 A 中不可能成为博弈 (G_A, R_G^N) 的非占优策略的 n 人联盟之结果的每一个 $x \in A$, 从而将 $T(G_A, R_G^N)$ 锁定在剔除后的 A 的子集中。同理, 如果这里的均衡是占优可解^②而博弈 (G_A, R_G^N) 为非占优可解, 我们依然可以反复利用占优法则将概率集缩小到剔除后的 n 人联盟策略集合的选择集上, 然后将 $T(G_A, R_G^N)$ 定义在这个剔除后的策略集上。

3. 根据 Bernheim (1984) 和 Pearce (1984), 可以完全不用均衡概念而将博弈 (G_A, R_G^N) 的可能结果的集合 $T(G_A, R_G^N)$ 定义为 $x \in T(G_A, R_G^N)$, 当且仅当可以被合理化或谨慎地合理化的格局 σ^N 满足 $x = g_A(\sigma^N)$ 。这个对 $T(G_A, R_G^N)$ 的定义能够比那些只盯着角点的均衡概念更好地处理古典博弈 (G_A, R_G^N) 的问题^③。这种方法恰恰对应了 1., 限制了占优策略的偏离, 也对

① 当我们讨论博弈 (G_A, R_G^N) 的一个混合策略均衡或理性策略行为时, 我们假设个人偏好序的格局 $R_g^N = (R_{1g}, \dots, R_{ng})$ 由冯·诺依曼-摩根斯坦效用函数 $u_g^N = (u_{1g}, \dots, u_{ng})$ 的格局来表示。

② 占优可解 (dominance solvability) 的概念请见 Moulin (1983)。Farquharson (1969, Ch. 8 and Appendix 2) 较早提出了我们应该用重复博弈的办法剔除一切弱占优策略, 从而只将注意力集中在剔除后的可能策略中的想法。

③ 例如, 假设 (G_A, R_G^N) 为性别之争, $N = \{1, 2\}$, 支付矩阵如下

	B	F
F	(0, 0)	(2, 1)
B	(1, 2)	(0, 0)

F: 足球, B: 芭蕾

存在三个纳什均衡: 两个纯策略纳什均衡 (2, 1), (1, 2) 和一个混合策略纳什均衡, 博弈者 1 以 2/3 的概率选择足球和 1/3 的概率选择芭蕾, 博弈者 2 以 2/3 的概率选择芭蕾和 1/3 的概率选择足球。根据等式 (1) 我们能够定义这里的 $T(G_A, R_G^N)$ 为 $\{(2, 1), (1, 2)\}$, 意味着社会预言博弈者总是选择纯策略纳什均衡达成合作。但是, 理性却作了一个更弱的判断, 也就是不带有任何歧视地纳入了混合策略均衡。在性别之争中, 是合理性让社会语言博弈者可能在 (F, B) 达成合作, 收益 0。

应了谨慎合理化方法中的占优可解性。

在我们的研究中，采取以上哪个步骤来定义 $T(G_A, R_G^N)$ 并不是关键问题，关键是，即便当博弈 $T(G_A, R_G^N)$ 不存在纯策略均衡时，社会都无论如何会基于事件 A 形成一个对均衡的预期。这是隐藏在假设条件下的直觉判断告诉我们的，对一切 $A \in \mathcal{A}$, $G \in \mathcal{G}$ 和给定的 $R_G^N \in \mathcal{R}^n(X)$, $T(G_A, R_G^N)$ 必非空，尽管 $T(G_A, R_G^N)$ 确实对一些 $A \in \mathcal{A}$, $G \in \mathcal{G}$ 和一些给定的 $R_G^N \in \mathcal{R}^n(X)$, $E_p(G_A, R_G^N)$ 及相应的 $H_p(G_A, R_G^N)$ 可能为空。

(二) 不确定性和扩展了的社会福利函数

由 4.1 的分析得， $T(G_A, R_G^N)$ 可能不惟一。例如，博弈 (G_A, R_G^N) 的均衡不惟一；即我们可能有 $\#H_p(G_A, R_G^N) > 1$ ，给定 (1)，则 $\#T(G_A, R_G^N) > 1$ 。^① 如果 $T(G_A, R_G^N)$ 只有一个元素，如 x ，给定事件 $A \in \mathcal{A}$ ，社会对权利格局 $G \in \mathcal{G}$ 的选择就必然会导致一个狭义的社会可选方案 x ，从而产生一个扩展了的社会结果 (x, G) 。但如果 $T(G_A, R_G^N)$ 不惟一，这种对应于 G 的扩展了的社会结果的确定性就被打破了。假设 $T(G_A, R_G^N)$ 包含两个元素 x 和 y 。给定事件 A ，如果社会选择了权利格局 G ，社会就会面临一个不确定的未来状态：对 G 的选择既可能产生一个狭义定义的结果 x ，继而生生成扩展了的社会可选方案 (x, G) ，也可能产生一个狭义定义的结果 y ，继而生生成扩展了的社会可选方案 (y, G) 。除非有明确的限制对一切 $G \in \mathcal{G}$ 和 $R_G^N \in \mathcal{R}^n(X)$ ， $T(G_A, R_G^N)$ 必须惟一，只要给定一个事件，社会就必须在多个可替代的权利格局间作出取舍，就必须衡量各种权利格局所可能带来的相应的社会结果。然而，扩展了的社会偏好序的理论只解决存在惟一扩展了的社会可选方案的问题，却无法对多重结果进行排序。显然，我们需要一个包容性更强的理论来解释这个问题。

对一切 $B \in \mathcal{A}$, $G \in \mathcal{G}$, G 为给定的权利格局， B 中的任何社会可选方案都是狭义定义的最终社会结果，用 (B, G) 表示这样一种期望的社会状态。与前文的假设不同，在 (B, G) 所表示的社会状态中， $B \times \{G\}$ 中的每个元素都可能是社会最终的扩展了的可选方案，从而最终被社会选择的扩展了的社会可选方案必是 $B \times \{G\}$ 中的一个元素。用 X_{++} 表示 $\mathcal{A} \times \mathcal{G}$, $X_{++} = \{(B, G) \mid B \in \mathcal{A}, G \in \mathcal{G}\}$ 。 X_{++} 中的元素为生成的扩展了的可选方案。我们把社会成员的偏好序假设在 X_{++} 上，从而在 X_{++} 上集结社会的偏好序。

定义 3：一个生成的扩展了的社会福利函数是函数 $\mathcal{R}^n(Z) \rightarrow \mathcal{R}(Z)$ ，当 Z 为 X_{++} 的非空子集。

^① 对任意集合 Z , $\#Z$ 表示 Z 的基数。

生成的扩展了的社会福利函数是将 Z 上个人偏好序 J^N 的一个格局映射到 Z 上的社会偏好序 J , Z 为 X_{++} 的非空子集。我们在定义中没有假设 $Z = X_{++}$, 从而: (i) 扩展了的社会福利函数是生成的扩展了的社会福利函数的特例, 当 $Z = \{(\{x\}, G) \mid x \in X, G \in \mathcal{G}\}$; (ii) 阿罗社会福利函数也是生成的扩展了的社会福利函数的特例, 当存在某些确定的 $G \in \mathcal{G}, Z = \{(\{x\}, G) \mid x \in X\}$ 。而在下文中, 我们将假设 $Z = X_{++}$, 从而生成的扩展了的社会福利函数的定义域和值域分别为 $\mathcal{R}^n(X_{++})$ 和 $\mathcal{R}(X_{++})$ 。

(三) X_{++} 上的个人偏好序与 X_+ 、 X 上的个人偏好序的相互关系

我们将 X_{++} 上的个人偏好序的格局 $J^N \in \mathcal{R}^n(X_{++})$ 作为分析的基础。假设第 3 部分中介绍的、构成扩展了的可选方案的社会选择基础的 X 上的个人偏好序 $Q_i \in \mathcal{R}(X_+)$ 由 X_{++} 上的个人偏好序 $J_i \in \mathcal{R}(X_{++})$ 推导得, 即:

$$\forall i \in N, \forall (x, G), (x', G') \in X_+ : (x, G) Q_i (x', G'), \\ \text{当且仅当 } (\{x\}, G) J_i (\{x'\}, G') \quad (2)$$

同理, 我们在前文中已经假设 X 上的个人偏好序的格局 R_G^N 给定不变, 现在做一个小小调整。给定 $J_i \in \mathcal{R}(X_{++})$ 和 $G \in \mathcal{G}$:

$$\forall i \in N, \forall x, y \in X : x R_G^N y, \text{ 当且仅当 } (\{x\}, G) J_i (\{y\}, G) \quad (3)$$

(3) 的意思很明确。既然我们将 $J^N \in \mathcal{R}^n(X_{++})$ 设为模型中的初始条件, 那么给定权利格局 $G \in \mathcal{G}$, 就很自然地假定 X 上的个人偏好序的格局由 J^N 通过 (3) 推导得。^① 这里要注意的是 X 上的个人偏好序的格局依赖于 G 和 J^N 。

(四) 生成的扩展了的可选方案的可行性

我们现在引入生成的扩展了的可选方案的可行性的定义。

定义 4: 给定事件 $A \in \mathcal{A}$ 和偏好格局 $J^N \in \mathcal{R}^n(X_{++})$, 一个生成的扩展了的可选方案 $(B, G) \in X_{++}$ 具有可行性, 当且仅当

^① 这个定义使产生的偏好 R_G^N 依赖于给定的权利格局 G 。我们实际可以通过 X_{++} 上的个人偏好来从另一个角度理解 X 上的个人偏好, 从而避免 X 对 G 的依赖。例如, 我们可以将 X_{++} 上的个人偏好理解为 Harsanyi (1955) 和 Pattanaik (1967) 中的社会伦理偏好或 Sen (1977) 中的判断。相反, 我们也可以将 X 上的个人偏好理解为 Harsanyi-Pattanaik 意义上的主观偏好或 Sen 意义上的个人兴趣。显然, 尽管我们对个人偏好有多种不同的理解, 但不会出现 X 上的个人偏好直接依赖于权利格局 G 的情况。

$$B = T(G_A, R_G^N) \quad (4)$$

其中, $R_G^N = (R_{1G}, \dots, R_{nG}) \in \mathcal{R}^n(X)$ 由 J^N 通过 (3) 得到。

因为 A 是一切可行的、狭义的社会可选方案的集合, 所以通过 (4) 运算得出的 B 中的所有可选方案一定是可行的。进而, 由于 $(B, G) \in X_{++}$ 可行, B 作为一切狭义的可选方案的结合就一定是博弈 (G_A, R_G^N) 的结果。

举个例子来说。给定事件 $A \in \mathcal{A}$, 假设权利格局 $G \in \mathcal{G}$ 赋予每个社会成员以完全的自由来决定是否吸食毒品和吸食什么毒品。假设 x 为一个狭义的可选方案, 其中每个社会成员都选择不吸食任何毒品。令 X_{++} 上的个人偏好序 J^N 满足 $H_\varepsilon(G_A, R_G^N) \neq \emptyset$, 其中 ε 代表均衡, $R_G^N \in \mathcal{R}^n(X)$ 由 J^N 通过 (3) 得到。进一步假设在 $H_\varepsilon(G_A, R_G^N)$ 中每一个狭义的社会可选方案中都有一些人选择吸食毒品, 那么通过 (1) 可得

$$T(G_A, R_G^N) = H_\varepsilon(G_A, R_G^N) \neq \{x\}$$

因此, 给定事件 $A \in \mathcal{A}$ 和 $J^N \in \mathcal{R}^n(X_{++})$, $(\{x\}, G)$ 不可行。很显然, 由于能够生成 X 上的偏好格局 R_G^N , 所以 X_{++} 上的个人偏好格局 J^N 的具体化在生成的扩展了的偏好格局的可行性的判断中扮演着非常重要的角色。^①

(五) 权利格局的社会选择的步骤

基于前文的分析, 我们现在可以描述社会选择过程如下。给定 $A \in \mathcal{A}$ 和 $J^N \in \mathcal{R}^n(X_{++})$:

第一步 (社会评价生成的扩展了的可选方案): 给定个人偏好序 $J^N \in \mathcal{R}^n(X_{++})$ 的格局, 生成的扩展了的社会福利函数 U 可以确定一个生成的扩展了的社会偏好序 $J = U(J^N) \in \mathcal{R}(X_{++})$ 。

第二步 (预测每个偏好格局下可能出现的狭义的社会可选方案): 给定 $J^N \in \mathcal{R}^n(X_{++})$, 对每一种权利格局 $G \in \mathcal{G}$, 通过 (3) 得出格局 $R_G^N \in \mathcal{R}^n(X)$ 。对每一个 $G \in \mathcal{G}$, 社会定义了博弈

① 这里我们冒重复描述的险, 再次引用 Sen (1970, 1970a, Ch. 6) 中“查泰莱夫人的情人”的例子来说明这个问题。两个人 Prude (P) 和 Lewd (L), 拥有选择是否阅读的权利, 阅读 R, 不阅读 N。这样的权利格局 $G \in \mathcal{G}$ 和事件 $A = \{(R, R), (R, N), (N, R), (N, N)\} \in \mathcal{A}$, 将他们的偏好格局具体化为

$$P: (N, N), (R, N), (N, R), (R, R)$$

$$L: (R, R), (R, N), (N, R), (N, N)$$

从左到右, 偏好的程度递减。如果采用占优策略均衡概念, 那么通过 (1) 我们可以得到

$$T(G_A, R_G^N) = H_\varepsilon(G_A, R_G^N) = \{(N, R)\}$$

因此, 给定事件 A 和偏好格局 J^N , $\{(N, N), G\}$ 不可行, 其中 $N = \{P, L\}$, 会生成 R_G^N 。

(G_A, R_G^N) 的可能结果 $T(G_A, R_G^N)$ 。如果博弈 (G_A, R_G^N) 的均衡集 $H_e(G_A, R_G^N)$ 非空, $T(G_A, R_G^N)$ 就表示为 $H_e(G_A, R_G^N)$ 。如果集合 $H_e(G_A, R_G^N)$ 为空集, 那么社会就不得不采用我们在 4.1 中介绍的方法来获取 $T(G_A, R_G^N)$ 。

第三步 (定义可行的生成的扩展了的可选方案): 由上一步得出对应于每一个 $G \in \mathcal{G}$ 的 $T(G_A, R_G^N)$, 从而社会将一切可行的生成的扩展了的可选方案 (B, G) 定义为集合 D , (B, G) 可行当且仅当 $B = T(G_A, R_G^N)$ 。

第四步 (定义最优的可行的生成的扩展了的可选方案): 第一步中已经给定 $J = U(J^N)$, 第三步中给定 D , 将最优的可行的生成的可选方案定义为:

$$\bar{D} = \{(B, D) \in D \mid (B, G) \text{ 是 } D \text{ 中最大的 } J \text{ 元素}\}$$

第五步 (确定权利格局): 定义了 \bar{D} 后, 社会就可以对一些 $B^* \in \mathcal{A}$ 和 $(B^*, G^*) \in \bar{D}$ 选择权利格局 $G^* \in \mathcal{G}$ 。通过选择 G^* , 社会将从可能出现的不确定的选择集 D 中选择一个最优的可行结果 (B^*, G^*) , 当然, 原则是一旦权利被赋予, 人们就能够完全自由地行使他们的权利。

从步骤 1 到步骤 5 完成了对社会选择权利格局 G^* 的过程的完整描述。如果 B^*, G^* 都是单元素集合, 如为 $\{x^*\}$, 那么当人们在博弈 (G_A, R_G^N) 中自由行使他们被赋予的权利, 社会就有百分百的把握来确定 G^* , 从而 x^* 最终成为社会选择的结果。另一方面, $\#B^* > 1$ 意味着依照我们当前对于人类行为的有限的知识, 社会还不能完全准确的预测博弈 (G_A, R_G^N) 的结果。所以, 社会在选择权利格局时一定会面临不确定性, 而这种不确定性会在博弈 (G_A, R_G^N) 真正开始、 B^* 中可选方案成为最终的社会选择结果后被解决。

这样我们就完成了对社会选择过程的简要描述。在我们的概念框架中, 社会评价和社会选择都不是针对 Arrow (1963) 和 Sen (1970a) 中所指的依惯例定义的社会可选方案, 而是针对扩展了的社会可选方案。建立这个概念框架的目的是为了阐明, 社会选择理论所要研究的不是社会选择的结果, 而是如果选择进行社会选择的规则, 把社会选择的结果留给在这些特定规则中博弈的人们。显然, 这与委托代理模型很相似。^① 社会中的决策者, 为了履行他们将社会价值转变为社会决策的职责, 成为社会中决定权利格局 G 的代理人, 而在 G 给定之后, 由社会成员决定如何行使他们在 G 中被赋予的权利、最终生成的社会可选方案和狭义的社会结果。如果代理人, 也就是社会决策者能够准确的预测委托人 (即社会成员) 将如何在特定的 G 下行动, 那么权利格局的选择就等同于扩展了的社会可选方案的选择。相反, 如果社会决策者无法做出

① 关于委托-代理模型的更多分析, 请见 Rees (1985; 1985a)。

准确的预测（即 $T(G_A, R_G^N)$ 对一些 G 来说不惟一），那么权力格局的选择就不得不在预期中进行，至少其中的一些将会不确定。

五、个人权利、社会一致性和帕累托效率

前文努力建构的分析框架将有可能推动对权利和社会福利的分析。我们就将在下文讨论三个相关命题来论证所建构的理论框架的可行性。

（一）权利和个人偏好

对个人偏好被运用于分析自由与权利，长久以来争议不断。Sen（1970；1970a；1976；1983；1992）提出的基于偏好的分析，论证了个人权利总是意味着对社会决策函数的某些限制，个人偏好总是定义在狭义的社会可选方案上。相反，那些提出博弈形式和相关方法的研究者，诸如 Nozick（1974），Bernholz（1974），Gardenfors（1981），Sugden（1978；1985；1985a）都坚持个人权利不会与个人偏好发生任何森所定义的矛盾关系。

以前人的研究为基础，我们认为明确区分三组概念是非常重要的：（1）被赋予的权利的内容；（2）为什么会被赋予这些权利；（3）反映这些权利的社会选择的结果如何被决定。个人偏好在用博弈形式理论对权利的论证中并没有扮演任何角色，因为权利的实际内容仅仅被阐释为选择可行策略的全部自由和不选择不可行策略的义务。然而，当涉及权利的赋予和社会选择时，形式博弈理论确实赋予了个人偏好两个相当重要的角色。第一是在第四节（五）中阐述的权利格局的决定过程。 X_{++} 上的个人偏好 J^N 在生成的扩展了的可选方案的社会选择中扮演着重要角色（第一步）。同样， X 上的个人偏好 R_G^N 在预测可能出现的狭义的社会结果时（第二步）和确定生成的扩展了的可选方案的可行性时（第三步）也扮演着重要角色。第二，给定事件 A ，一旦权利格局 G^* 确定，由 J^N 决定的 R_G^N 就决定了博弈 (G_A, R_G^N) 。从而最终的狭义的社会选择结果 x^* 就会出现在博弈结局中。

因此，在我们所使用的博弈形式的方法中，个人偏好在决定权利格局的赋予和社会选择时扮演了重要的角色。但是，通过每人一个的可行策略集表示的个人权利的实际内容，却并没有与个人偏好发生任何森所定义的矛盾关系。

（二）个人权利和社会一致性

以社会偏好关系的可传递性为形式的关于社会一致性（social consistency）的假设构成了对

以阿罗不可能性定理为基础的社会选择理论的关键争论中的焦点之一。在关于这个主题的研究中,人们一直试图弱化这个假设,但一直没能打破阿罗不可能性定理的核^①。然而,Sugden (1985) 却提出即使是关于社会一致性的最弱的假设本质也是上不成立的。我们的下一个任务就是要搞清楚 Sugden 这个有趣的命题的真正含义。

Sugden 的批评首先根据对个人权利的广义的尊重,如自愿答应求婚的异性并与其结婚或拒绝与对方结婚。他的争辩在下面这个例子中展开。

例 1: 结婚案例 (Sugden, 1985a)。三个人,安妮、比尔和查理,三种社会状态: $x =$ 谁都不跟谁结婚; $y =$ 安妮嫁给比尔,查理单身; $z =$ 安妮嫁给查理,比尔单身。根据婚姻自由的最普通的定义,每个人都有权利保持单身,如果他或她想这么做的话,同样,每个人也有权利选择与异性结婚,只要他与她都还未结婚,且不是近亲。

假设安妮、比尔和查理在 $\{x, y, z\}$ 上有以下的偏好序^②:

安妮: y, z, x

比尔: x, y, z

查理: z, y, x

在这种情况下,比尔和查理每人都会有两个可实施策略: $n =$ 不求婚, $p =$ 向安妮求婚。而安妮,站在她的角度,能够有五个可实施策略: $r =$ 拒绝任何人的求婚, $b =$ 仅接受比尔的求婚,拒绝查理; $c =$ 仅接受查理的求婚,拒绝比尔, $b | c =$ 如果比尔求婚则接受比尔,仅有查理求婚才接受查理, $c | b =$ 如果查理求婚则接受查理,仅有比尔求婚才接受比尔。

用 $g(\alpha, \beta, \gamma)$ 表示社会选择的结果,当安妮、比尔、查理分别从他们的可行策略集中选择策略 α, β, γ , 那么

$$(i) \quad g(r, n, n) = g(r, n, p) = g(r, p, n) = g(r, p, p) = g(b, n, n) = g(b, n, p) \\ = g(c, n, n) = g(c, p, n) = g(b | c, n, n) = g(c | b, n, n) = x$$

$$(ii) \quad g(b, p, n) = g(b, p, p) = g(b | c, p, n) = g(b | c, p, p) = g(c | b, p, n) = y$$

$$(iii) \quad g(c, n, p) = g(c, p, p) = g(b | c, n, p) = g(c | b, n, p) = g(c | b, p, p) = z$$

首先我们将这种情况看做一个非合作博弈,很容易就发现其中的可解决占优和均衡解 ($b | c, p, p$), 从而产生结果 y 。第二,如果我们将它看做一个合作博弈,那么 y 就是核的惟一结果。

① 森 (1977) 对此进行了大量的研究和深刻的评价。见 Suzumura (1983) 和 Sen (1993)。

② 例如,安妮偏好 y 胜于 z 胜于 x , 意味着她最想嫁给比尔,但如果比尔不愿与她结婚,她也会接受查理的求婚。

因此，认为 y 是博弈的结局是合理的。

现在假设查理不是博弈中的合法成员；他可能已婚，从而不能向安妮求婚，如果不想冒重婚罪的险。从而博弈中只剩下安妮和比尔两个合法的博弈者。这时，博弈的惟一占优策略均衡是 x ， x 也是核。这样，在第二个博弈中，假设 x 是博弈结果也是合理的。

Sugden 所举例子的实质在于假设存在这样一种现实中完全可能出现的情况，一个尊重权利的群体决策过程可能对事件 $\{x, y, z\}$ 产生结果 y ，而对事件 $\{x, y\}$ 产生结果 x ，其间个人偏好序和决策过程都没变。这便打破了我们众所周知的选择一致性条件 α (Sen, 1970a; 1993)， α 要求已经被一个集合拒绝选择的可选方案 x 不应该被选择，当新的可选方案加进原有的集合中后。^① 正是这个反例构成了 Sugden 观点的基础，促使他提出了一定情况下社会选择的一致性条件不成立的论断。

但是，尽管 Sugden 的问题很有意思，我们也需要很谨慎地加以理解。如果社会代表个人权利为程序或博弈形式赋予一个内在的价值，而不是为程序或博弈生成的社会选择结果赋予一个价值的话，社会就要真正面临一个选择生成的扩展了的可选方案而非选择依惯例决定的可选方案的问题。讨论还远没有结束：很有可能出现的情况是，当社会在选择依惯例决定的可选方案时遇到选择的逻辑不一致问题时，换成选择自我生成的扩展了的可选方案时依然无法突破逻辑不可能的困境。

用 \bar{G} 表示 Sugden 的权利格局， \bar{g}_A, \bar{g}_A 表示博弈 \bar{G}_A, \bar{G}_A 的结果函数，其中 $A = \{x, y, z\}$ ， $A' = \{x, y\}$ 。在 Sugden 的例子中，给定 \bar{G} 和格局 $R \frac{N}{G} \in \mathcal{R}^n(X)$ ，均衡定义依然沿用 ε ，从而

$$\{y\} = H_\varepsilon\left(\bar{G}_A, R \frac{N}{G}\right) = T\left(\bar{G}_A, R \frac{N}{G}\right), \{x\} = H_\varepsilon\left(\bar{G}_A, R \frac{N}{G}\right) = T\left(\bar{G}_A, R \frac{N}{G}\right) \quad (5)$$

所以，给定事件 A 和格局 $J^N \in \mathcal{R}^n(X_{++})$ ，社会就会从不包括 $(\{x\}, \bar{G})$ 的生成的扩展了的可选方案的可行集中选择 $(\{y\}, \bar{G})$ （因为通过 (5) 的运算 $T\left(\bar{G}_A, R \frac{N}{G}\right) \neq \{x\}$ ，我们得出生成的扩展了的可选方案的可行集不包括 $(\{x\}, \bar{G})$ ）。同理，给定事件 A' 和格局 $J^N \in \mathcal{R}^n(X_{++})$ ，社会就会从不包括 $(\{y\}, \bar{G})$ 的生成的扩展可选方案的可行集中选择 $(\{x\}, \bar{G})$ 。因此，当社会选择被看做是对生成的扩展可选方案的选择时，Sugden 的例子事实上并不能构成对条件 α 的任何突破，或是任何社会选择一致性的合理条件。

因此，在生成的扩展社会可选方案的社会选择中，Sugden 的例子并不构成对社会选择一致

^① 此性质见 Chernoff 定理。

性的有效批评, 尽管这一批评能够在依惯例定义的社会可选方案的社会选择中奏效。

(三) 个人权利和帕累托效率

我们现在将目光转向帕累托效率的福利原则和个人权利的社会评价的相容性的重要命题。自从 Sen (1970; 1970a) 明确提出这一逻辑矛盾, 即所谓的帕累托自由的不可能性后, 这个问题已经聚焦了很多学者的关注。^① 依然值得我们回味的是 Sen 提出了这一逻辑矛盾作为他著名的以正义批评福利主义的里程碑。

给定事件 $A \in \mathcal{A}$, 偏好格局 $J^N \in \mathcal{R}^n(X_{++})$, 社会选择权利格局 G^* , 并假设 x^* 为博弈 (G_A, R_G^N) 的狭义的社会选择的结果, 其中 R_G^N 由 J^N 推得, G^* 为给定。既然社会选择的结果 x^* 是通过自由行使基于 A 的博弈形式 G_A^* 体现的权利实现的, 那么在这种情况下就不存在任何侵犯个人权利的可能。为了考察用博弈形式表达的个人权利是否依然维持帕累托与自由的矛盾, 我们还要检验行使用博弈形式定义的权利时社会选择的结果是否符合帕累托效率的原则。

必须看到, 对于格局 $R_G^N \in \mathcal{R}(X)$, x^* 确实有可能帕累托无效, 即: 存在 A 中的一个元素 x 对一切 $i \in N$ 满足 $x P_{iG^*} x^*$, 其中 P_{iG^*} 是 R_{iG^*} 的非对称运算。我们在下列运算中验证这种帕累托无效的可能性。

例 2: 给定事件 A, 权利格局 G, 基于 A 的博弈形式 G_A 和权利格局 $J^N \in \mathcal{R}^n(X_{++})$, 从而, 对所有的 $i \in N$:

$$G_A = (N, s_{iA}, \dots, s_{nA}, g_A); A: = g_A(S_A) = \{g_A(s) \mid s \in S_A\}; S_{iA} = \{a, b\}$$

同样, 对所有的 $i \in N$:

$$\forall S_{-i} \in S_{-iA}: = \times_{j \in N - \{i\}} S_{jA}; g_A(b; s_{-i}) P_{iG} g_A(a; s_{-i}) \quad (6)$$

n 次 n 次

$$g_A(a, \dots, a) P_{iG} g_A(b, \dots, b) \quad (7)$$

$$\forall B, B' \in A, \forall G \in \mathcal{S}h\{G\}: (B; G) P(J_i)(B', G) \quad (8)$$

其中 $(a; s_{-i}) = (s_1, \dots, s_{i-1}, a, s_{i+1}, \dots, s_n)$, $(b; s_{-i}) = (s_1, \dots, s_{i-1}, b, s_{i+1}, \dots, s_n)$, $P(J_i)$ 是 J_i 的非对称运算。还有一点值得我们注意的就是博弈 (G_A, R_G^N) 实际上是 Sen (1969) 中定义的 n 人囚徒困境模型。

假设生成的扩展了的社会福利函数满足帕累托原则。对一切 $B, B' \in \mathcal{A}$ 和一切 $G \in \mathcal{S}h$

^① Sen (1976) 和 Suzumura (1983, Ch. 7) 提供了 80 年代上半期以前对此问题的大量论述。同样见 Pattanaik (1994a)。

$\{G\}$, 对所有 $i \in N$ 给定 $(B; G)P(J_i)(B', G')$ (见 (8)), 存在 $(B; G)P(J)(B', G')$, 其中 $P(J)$ 是 J^N 的非对称运算。我们很容易能够看到, 如果社会按照第四节 (五) 所述的步骤行事, 那么社会就会选择权利格局 G 。

下面我们将这里的均衡假设为占优策略均衡, 那么给定博弈 (G_A, R_G^N) , 其中 R_G^N 由 J^N 推得, 每个博弈者都会选择策略 b , 社会选择的结果根据 R_G^N 将在 $g_A(a, \dots, a)$ 达到帕累托占优。

这个例子很清楚地告诉我们在扩展了的理论框架中博弈形式下的权利与社会选择的帕累托有效之间的矛盾依然以一种较以往研究有少许不同的方式存在着。这也证明了 Sen 的关于福利主义帕累托原则与非福利主义个人权利之间的逻辑矛盾依然存在, 尽管我们采用了博弈形式这一完全不同的方式来阐述权利。

六、结 论

这篇论文提出了一个分析社会选择和福利的扩展了的概念框架。不同于以往的研究只考察依惯例定义的社会可选方案上的个人偏好序, 我们将个人偏好序建立在一个同时包含了社会决策机制和依惯例定义的社会可选方案的更加复杂的空间上。为了尽可能具体地解释这一新方法, 我们又将社会决策机制定义到通过博弈形式表达的个人权利格局上。为了运用这一概念框架, 我们将这一扩展的信息基础放到一系列颇具争议的情境中加以解释, 包括个人偏好在权利中扮演的角色、个人被赋予的权利和权利的实际内容。我们又将此框架运用到社会选择的一致性、帕累托效率的福利主义要求与个人权利的非福利主义之间的冲突等情境中给予了进一步证明。

尽管此概念框架为我们的创新, 但值得指出的是此框架的起源, 如同社会选择理论的其他基础研究一样, 也能够追溯到 Arrow (1963, pp. 90 - 91) 中的一段陈述: “在决定社会状态的诸多要素中, 决策过程显然是非常重要的一个, 尤其当决策机制本身被社会成员赋予了一定的价值判断时。举例来说, 一个社会成员可能更加偏好在自由市场机制中获得的商品而非由政府计划机制分配的商品。如果社会选择能够被我们赋予更加广泛的理解以至于包括影响社会成员作选择的整个社会心理氛围, 那么这些偏好的现实性和重要性, 相比于对产品分配的偏好来说, 是显而易见的。”

我们的努力应该被看做是在个人权利的背景下对阿罗深刻洞见的一个小小发展。显然, 在我们所提出的扩展的概念框架中还存在着诸多有关社会选择和社会福利的新问题值得我们进一步探索。我们所完成的无异于在个人权利的背景下提出一个未来研究的方向, 并身体力行迈出了第一步。

参考文献

- Arrow , K. J. , 1963 *Social Choice and Individual Values* , 2nd ed. Wiley , New York , NY.
- Bernheim , B. D. , 1984 , “ Rationalizable Strategic Behavior , ” *Econometrica* , 52 , pp. 1007 - 1028.
- Bernholz , P. , 1974 , “ Is a Paretian Liberal Really Impossible ? ” , *Public Choice* , 20 , pp. 99 - 107.
- Deb , R. , 1989 , “ Rights as Alternative Game Forms : Is There a Difference of Consequences ? ” , Working Paper , Department of Economics , Southern Methodist University , Dallas , TX.
- Deb , R. , 1993 , “ Waiver , Effectivity and Rights as Game Forms ” , *Economica* , forthcoming.
- Farquharson , R. , 1969 , *Theory of Voting* , Basil Blackwell , Oxford.
- Gaertner , W. , 1993 , “ Rights and Game Forms , Types of Preference Orderings and Pareto Inefficiency ” , in D. D. Diewert et al. (eds) , *Mathematical Modeling in Economics* , Springer-Verlag , Heidelberg.
- Gaertner , W. , Pattanaik , P. K. and Suzumura , K. , 1992 , “ Individual Rights Revisited ” , *Economica* , 59 , pp. 161 - 177.
- Gärdenfors , P. , 1981 , “ Rights , Games and Social Choice ” , *Noûs* , 15 , pp. 341 - 356.
- Gibbard , A. , 1974 , “ A Pareto-Consistent Libertarian Claim ” , *Journal of Economic Theory* , 7 , pp. 388 - 410.
- Hammond , P. J. , 1993 , “ Aspects of Rationalizable Behavior ” , in K. Binmore. A. Kirman and P. Tani (eds) , *Frontiers of Game Theory* , The MIT Press , Cambridge , MA.
- Hammond , P. J. , 1994 , “ Social Choice of Individual and Group Rights ” , in W. A. Barnett , H. Moulin , M. Salles , and N. Schofield (eds) , *Social Choice , Weequare , and Ethics* , Cambridge University Press , Cambridge.
- Harsanyi , J. C. , 1995 , “ Cardinal Welfare , Individualistic Ethics , and Interpersonal Comparisons of Utility ” , *Journal of Political Economy* , 63 , pp. 309 - 321.
- Hausman , D. M and Mcpherson , M. S. , 1993 , “ Taking Ethics Seriously : Economics and Contemporary Moral Philosophy ” , *Journal of Economic Literature* , 31 , pp. 671 - 731.
- Moulin , H. , 1983 , *The Strategy of Social Choice* , North-Holland , Amsterdam.
- Nozick , R. , 1974 , *Anarchy , State and Utopia* , Basil Blackwell , Oxford.
- Pattanaik , P. K. , 1967 , “ Risk , Impersonality , and the Social Welfare Function ” , *Journal of*

Political Economy , 76 , pp. 1152 - 1169.

Pattanaik , P. K. , 1994 , “ Some Non-welfaristic Issues in Welfare Economics ” , in B. Dutta (ed.) , Welfare Economics , Oxford University Press , Delhi.

Pattanaik , P. K. , 1994a , “ On Modelling Individual Rights : Some Conceptual Issues ” , forthcoming in K. J. Arrow , A. K. Sen , and K. Suzumura (eds) , Social Choice Re-examined , Macmillan , London.

Pearce , D. G. , 1984 , “ Rationalizable Strategic Behavior and the Problem of Perfection ” , Econometrica , 52 , pp. 1029 - 1050.

Rees , R. , 1985 , “ The Theory of Principal and Agent : Part I ” , Bulletin of Economic Research , 37 , pp. 3 - 26.

Rees , R. , 1985a , “ The Theory of Principal and Agent : Part II ” , Bulletin of Economic Research , 37 , pp. 75 - 95.

Sen , A. K. , 1969 , “ A Game-Theoretic Analysis of Theories of Collectivism in Allocation ” , in T. Majumdar (ed.) , Growth and Choice , Oxford University Press , London.

Sen , A. K. (1970). “ The Impossibility of a Paretian Liberal ” , Journal of Political Economy , 78 , pp. 152 - 157.

附录 社会选择理论及福利经济学的新思路

——铃村兴太郎访谈录*

摘要：铃村兴太郎教授扩展阿罗不可能性定理的基本思路包括决策过程中的结果主义和同情共感天性。本文首先对结果主义、非结果主义及机会集合的定义展开讨论，指出其与森提出的情境理性相呼应，对极端结果主义和强结果主义的划分实现了对阿罗结果主义社会选择理论的扩展；由同情共感引出了对博弈论动态决策的讨论，根据 Gardenfors 对权利的定义，动态决策可能消除森提出的福利改善与最小自由之间的矛盾，这将成为未来的研究思路。基于民主在东方和西方的不同表现形式，本文在最后就民主自由在日本的发展给予讨论。

关键词：结果主义；机会集合；同情共感

汪：铃村先生，您好！非常高兴能够来到一桥大学对您做面对面的采访。我受到汪丁丁教授的鼓励来到这里，感到非常荣幸。

铃村：非常高兴您和您的教授对社会选择理论及我的研究感兴趣。我看了你的问题，准备得很周到，我想我们可以以此为纲，然后聊些更加广阔的问题。从现在起，我们有将近三小时时间。

汪：是的，非常感谢！我们知道，您的研究主要是基于结果主义和非结果主义，从而发展阿罗不可能性定理与森不可能性定理。可以这样说吗？能否对结果主义和非结果主义进行进一步的解释？

铃村：让我来尝试举几个例子。第一个是森的例子，关于他女儿卧室的墙壁是否刷成粉色。到底由谁决定这个小女孩卧室墙壁的颜色，结果可能一样，但必须有一个人作出决策。第二个例子是我自己的。我有一个蛋糕要分给三个女儿，现在有两个方案。可以把分配权交给她们自己，那么她们一定会平分这个蛋糕为三份。但是我想实施我父亲的权力，于是就由我给她们分蛋糕，我成了独裁者。但我为了取悦她们，我也会平分蛋糕。你看看，我用独裁权分蛋糕的结果与她们自己分的结果是一样的，但在这个过程中，权力确实发生了变化，所

* 采访由汪蓉于2006年7月24日在日本东京国立一桥大学经济研究所铃村研究室进行。

以结果主义不能说明一切问题。这样我们看出，光对结果作出定义是不够的，我们需要对个人偏好格局进行重新定义，这就是我在文章中的一系列证明。从机会集合 A 中选择了 x 作为结果比从机会集合 B 中选择 y 作为结果要优。我构造了集合 {x} 作为 A 的子集，而不是直接从 A 中选择 x^①，通过这些数学处理让机会集合（opportunity sets）的重要性表现出来，从而体现结果主义和非结果主义。第二是关于同情共感的作用。人有这样一种能力，我能够将我换位至你的位置而对你的经历有所感悟，试图理解你的情感体悟，这个因素同样影响了我们在决策时的选择集，这是很有意思的，我们需要考虑在内。这就是我在 2004 年那篇文章中的两个基本思路。

汪：您提到的两个例子正是反映了森的“情境理性”（context-rationality），是不是？

铃村：是的，可以这么说（笑）。

汪：我记起他在一篇文章中引用的一个例子，他被邀请去参加一个朋友的聚会，收到一张卡片……

铃村：让我来帮你复述这个例子。他接受邀请去了宴会，开始非常高兴，然后发现有人吸食可卡因，于是就对这个宴会的主人有了新的判断，邀请吸食可卡因客人的主人一定也不是什么好人，随即决定离开宴会^②。这就是森的情境理性。

汪：您所说的同情共感是不是亚当·斯密在他的著作《道德情操论》中提到的同情共感？

铃村：是的，确实是（笑）。

汪：据我所知，博弈论也在用这个定义，利用同情共感做一些突破囚徒困境的证明。说到您女儿的例子，请问能否用权利（rights）来理解这个问题？正如我在信中所提到的，代表我的老师汪丁丁教授请教您关于 Gardenfors 1981 年的那篇在博弈论框架下讨论权利和社会选择问题的文章，Gardenfors 采用了 Nozick 对于权利的哲学定义，把权利定义于福利之上，说明一定的社会背景诸如意识形态、宗教信仰，会对权利束产生约束，约束过的权利束不会导致违反帕累托改善的社会福利选择结果，从而森所认为的福利改善与最小自由之间的矛盾是荒谬的。您怎样看待这个问题？

铃村：是的，这是一个很好的问题，我也很关注这篇文章。1981 年 Gardenfors 突然冒出了这样一篇文章，没有前面的铺垫，也没有后人继续研究。实际上，这是一篇非常有创造性的文

① 详细论证参见 Suzumura, Xu (2006)。

② 铃村先生的复述与森原文中的例子是有出入的，但他坚持这样说，可能鉴于森曾亲口告诉他这个例子而非从文献中获得。

章,但是很奇怪,后续的思路断了,20年来,竟然没有人关注这个问题。我最近正在沿着 Gardenfors 的这个思路尝试做一些发展。

汪:所以说 Gardenfors 的思路很可能成为未来发展的一条路径,是不是?

铃村:是的,很可能。我正在做这方面的工作。

汪:Gardenfors 用博弈论来证明福利改善与最小自由之间不存在冲突,从而反驳了森所认为的福利改善和最小自由之间存在矛盾。博弈论的策略选择路径是博弈论在证明问题时特有的优势,它似乎解决了不可能性定理中的一些问题,您如何看待博弈论在您现在和未来工作中的作用?

铃村:是的,博弈论用动态的过程,用策略选择的过程,这是我近来一直关注的问题,也是我和徐永胜走到一起的原因。他和 Pattanaik 一直都是走博弈论这条路的,我不是。但是我们在一些路径分析上找到了共同点,而且我们用相同的数学工具,并且他来一桥访问过一年,我们就此作了一些共同的研究。

汪:可以说博弈论将成为突破阿罗不可能性定理,或者说社会选择理论的未来发展的一个可能途径吗?

铃村:是的,应该是这样。

汪:请问关于阿罗不可能性定理的证明为什么会走上结果主义和非结果主义之路?

铃村:这个问题很容易回答。一直以来,社会选择理论讨论的都是结果主义,也就是在只注重人们福利结果的情况下采取。阿罗和森的定理已经把假设做到非常精确了,我们要做的就是在这个现有的框架内做一个小小的突破,看看能否突破不可能性定理。我们不能直接进入非结果主义,把假设做得太强,我们只要在原有的框架内碰一碰,看看怎么改才能突破,这就是当前以及今后一段时间的基本思路。

汪:这正是磐田(Iwada, 2006)对您和徐永胜工作的最新发展,是吗?他把结果主义分为极端结果主义和强结果主义,从而只要社会存在着多元化,就可能存在弱帕累托改善,这样就有了一个突破的途径。但是强帕累托改善无法达到。

铃村:是这样的。磐田是我的研究生,这是他在今年春季我举办的日本经济年会上的文章,确实是这个思路,我们还在继续。

汪:可以谈谈您对程序正义(procedural justice)的看法吗?突破阿罗不可能性定理的两条途径分别是机会集合和程序,这样就专门有一组学者研究程序正义的问题。

铃村:这也是一个思路。Pattanaik 等人比较倾向于这个思路,可以看看他们的文章。

汪:您能否谈一谈西方民主与东方民主的区别?日本是亚洲为数不多的实行民主政治的国

家，能否根据您的经验谈一谈对日本式民主的看法？

铃村：我认为这个分类太笼统，即使是东方式民主，中国、韩国、日本也是不同的。就拿日本来说，你知道，日本的历史很复杂，战前的传统和战后的美军占领是要分开来看的。

汪：是的，是这样。似乎日本的经济学家非常喜欢用传统分析问题，譬如青木昌彦的演化博弈论学派。但民主政治是不是美军占领的结果呢？

铃村：这要分开来看。我们来看汉字的演化。明治天皇维新时，日语里没有权力（power）、权利（rights）、意志（will）、自由（freedom）等词，这是在西学东渐时首创的。一开始创造时，明治天皇觉得难听，“权”、“利”都是我们的文化里很避讳的词，很难听，但只有它最恰当，我们不得不用，也就慢慢接受了，所以说，这些东西是移植过来的，但也有上百年的时间了。但平等（equality）这个词是有的，我印象中是这样。给你说个故事。农业社会时，一个村落几十家或几百口，要作人口统计，要求承担村里的义务，就要有一个花名册。若是写在一张纸上，必有孰先孰后，孰上孰下，这样就不平等、不民主了，于是他们就把名字写在伞上，你知道，古时候的折伞是一绺一绺的，这样，名字就是转着写的，没有开头与结尾，大家都一样。由此可以看出古代日本就已有民主平等的传统，这些因素在古代社会里已经存在了，所以不需要移植。但自由（liberty）没有，这点我确信，自由是美军占领带来的。

汪：铃村教授，您的 seminar 已经要迟到了，我们已经讨论了三个多小时了，非常抱歉耽误了您的课。非常感谢您接受我的采访，受益匪浅。

铃村：非常感谢你的来访，希望你在日本过得愉快。

参考文献

[1] Gardenfors, Peter, 1981, "Rights, Games and Social Choice", *Nous*, vol. 15, No. 3. (Sep.), pp. 341 - 356.

[2] Iwata, Yukinori, 2006, "Consequences, Opportunities, and Arrowian Theorems on Consequentialist Domains", *Version*, June.

[3] Pattanaik, Prasanta K. and Kotaro Suzumura, 1996, "Individual Rights and Social Evaluation: A Conceptual Framework", *Oxford Economic Papers* 48, pp. 194 - 212.

[4] Sakai, Toyotaka and Masaki Shinmoji, 2006, "Dichotomous Preferences and the Possibility of Arrowian Social Choice", *Social Choice and Welfare*, 26, pp. 435 - 445.

[5] Sally, David, 2001, "On Sympathy and Games", *Journal of Economic Behavior & Organization*, vol. 44, pp. 1 - 30.

[6] Sen , Amartya , 1970 , “ The Impossibility of a Paretian Liberal ” , Journal of Political Economy , vol. 78 , No. 1 (Jan. - Feb.) , pp. 152 - 157 .

[7] Suzumura , Kotaro and Yongsheng Xu , 2004 , “ Welfarist-consequentialism , similarity of attitudes , and Arrows general impossibility theorem ” , Social Choice and Welfare , 22 , pp. 237 - 251 .

[8] Suzumura , Kotaro and Yongsheng Xu , 2006 , “ Consequentialism and Non-Consequentialism Axiomatic Approach ” , Version , June .

New Development of Social Choice Theory and Welfare Economics

——An Interview with Kotaro Suzumura

Abstract : Kotaro Suzumura's work about Arrow's social choice theory is featured by two points : consequentialism and sympathy. In this paper , we first talk about consequentialism , non-consequentialism and opportunity sets. They also match Amartya Sen's definition of " context rationality " . Iwada , a follower and student of Suzumura , defining extreme consequentialists and strong consequentialists , proves the coexistence of both types would break Arrow's General Impossibility Theorem. On the other hand , work about sympathy relates to game theory. Dynamic decision making process is possible to handle out the theoretical conflict between Pareto Principle and the libertarian claim , which is argued by Amartya Sen and Peter Gardenfors. We consider it as a path for future research. At last , based on the practically diverse forms of democracy in eastern and western world , the development of democracy in Japan is discussed.

Key Words : consequentialism ; opportunity sets ; sympathy

JEL Classification : C70 , D60 , D63

稿约

由浙江大学经济学院、浙江大学民营经济研究中心、浙江大学跨学科社会科学研究中心联合主办，汪丁丁教授任主编的《新政治经济学评论》，是一份综合性的经济学理论刊物，刊登经济学各个领域的理论和经验研究论文。藉此之际，向海内外学者同仁广纳贤言，感谢赐稿！

《新政治经济学评论》设“综述”、“论文”、“评论与回应”、“书评”四个栏目。“综述”栏目发表关于某一领域最新学术动态的综述性文章；“论文”栏目发表原创性的理论和经验研究文章，文章长度不限，欢迎10000字以上的论文；“评论与回应”栏目发表对已在本刊发表过的论文的评论和原作者的回应；“书评”发表通俗、可读的中文经济学新书的介绍和评论。以下为投稿体例。

一、稿件一般使用中文，作者投稿时应将打印稿一式三份寄至：

杭州市浙江大学经济学院《新政治经济学评论》编辑部

邮编：310027

或通过电子邮件寄至：cec_dyq@zju.edu.cn

二、稿件的第一页应该包括以下信息：

(1) 文章标题；(2) 作者姓名、单位，以及通信作者的通信地址和电子邮件地址；(3) 感谢语（如有最佳）。

稿件的第二页应提供以下信息：

(1) 文章标题；(2) 200字以内的中文摘要；(3) 3个中文关键词；(4) 文章的英文标题、作者姓名的汉语拼音（或英文）和作者单位的英文名称；(5) 200字以内的英文摘要；(6) 3个JEL (Journal of Economic Literature) 分类号。

三、文章正文中的标题、表格、图、等式编号必须连续。

一级标题用一、二、三等编号，二级标题用（一）、（二）、（三）等，三级标题用1、2、3等，四级标题用（1）、（2）、（3）等。一级标题居中，二级及以下标题左对齐。前三级独占一行，不用标点符号，四级及以下与正文连排。

四、每张图必须达到出版质量，并打印在单独的一张纸上。行文中标明每张图的大体位置。

五、文章正文的脚注必须每页重新编号，编号格式为：①，②，③……

六、文章中的定理、引理、命题和定义等单独成段。定理、引理和命题的证明（如果有的话）安排在文末的附录。

七、翻译外国人名请附原文或直接采用原文。专业术语的翻译请尽量规范化，在较为生僻或可能引起歧义的情况下请附原文。

八、所有参考文献必须出现在文章的末尾，并按作者姓名的汉语拼音（或英文名字）顺序编号排列。体例如下：

[1] Acemoglu, Daron and Thierry Verdier, 2000, "The Choice Between Market Failures and Corruption," *American Economic Review*, 90 (1), pp. 231 - 257.

[2] Barro, Robert and Xavier Sala-i-Martin, 1995, *Economic Growth*, New York: McGraw-Hill.

[3] 林毅夫, 蔡昉, 李周, "论中国经济改革的渐进式道路", 《中国的过渡经济学》, 上海: 上海三联书店, 1994年。

[4] 汪丁丁, "行为、意义与经济学", 《经济研究》, 2003年第9期, 第14—20页。

文中对文献的引用采用如 "Becker (1968, pp. 168) 指出……"、"报酬递增…… (Romer, 1986)", 或 "正如琼斯所言: '……' (琼斯, 2003, 第18页)" 的形式。

九、本刊在收到稿件后的三个月内给予作者是否录用的答复, 在三个月之内没有接到本刊录用通知者即可另投他刊。稿件如被录用, 作者须将文章用与中文 Microsoft Word 兼容的软件录入, 并将软盘寄至编辑部, 或将文件通过电子邮件寄至: cec_dyq@zju.edu.cn。本刊因人力财力有限, 恕不退稿。请作者自留底稿, 并不要在信中夹带现金或邮票。

十、稿件发表前, 本刊将把排版清样寄给作者, 由作者校对稿件。稿件发表时, 本刊将向作者提供3本样书, 作者如需更多本, 请付费购买。