

马歇尔后的价格机制理论的发展述评

王万山 伍世安

摘要: 马歇尔的价格机制理论发展有一条主线和多条支线:主线是沿着埃奇沃思、希克斯等学者发展起来的新古典价格机制理论;支线沿着新制度经济学、公共经济学、博弈论和信息经济学为主体,对新古典价格机制理论提出了质疑、挑战和新命题。主线和支线理论间在突出研究侧重点的同时,互相交叉、补充和完善,对价格机制理论进行了创新和突破,使其越来越具有现实解释力

关键词: 新古典 新兴经济学 价格 机制

经济学的研究核心是市场机制,而市场机制的核心是价格机制。价格理论从狭义上可理解为价格决定理论,即商品交换中价格是怎样形成的,物物交换的“比例”确定的规律是什么等。广义上,价格理论包含着“经济人”产权交换全过程中的契约关系,具体体现在价格机制的作用上,即包含着价格形成(决定)机制理论,价格运行机制理论和价格管理(监控)机制理论。可以说,广义的价格理论就是价格机制理论。马歇尔前的古典学者们对价格机制理论的探索主要停留在价格机制理论的第一阶段,即价格(价值)是什么?价格是怎样形成和决定的。对价格运行机制进行开创性研究的学者是瓦尔拉斯和马歇尔,前者通过巧妙地设立一个“叫价者”机制来达到市场价格的一般均衡,后者则用供求力量形成的自由竞争机制来解释市场价格的形成、波动和均衡。马歇尔的价格均衡理论统一了古典价格形成机制理论的纷争,同时也建立起完全竞争的新古典价格机制理论,这成为现代微观经济学的基础。但马歇尔的价格机制理论包含着一系列假设的前提条件,如完全竞争、信息完全对称、没有第三方外部性、非公共品、产品同质、没有交易成本等,即马歇尔的价格机制理论建立在完全理性经济人和完全无摩擦市场的假设之上。在这种假设下,价格机制这双“看不见的手”将使市场自动达到完全均衡,无须政府干预和管理价格,这与现实市场运行存在着巨大的差距。马歇尔后的价格机制理论发展,正是在放松假设条件,增强现实市场解释力上不断取得突破。

马歇尔后的价格机制理论发展有一条主线和多条理论支线,主线是沿着由埃奇沃思、帕累托、希克斯、凯恩斯和萨缪尔森等学者发展起来的“新古典综合”主流经济学发展,可称之为新古典价格机制理论;支线沿着以新制度经济学、公共经济学、博弈论和信息经济学为主体的新兴经济学理论发展,对新古典价格机制理论提出了质疑、挑战和新命题。主支线理论间并非相互隔离,而是在突出研究主题侧重点的同时互相交叉、补充和完善,使价格机制理论越来越具有现实解释力。下按主支线理论对价格机制理论的主要创新和突破进行评述。

一、新古典价格机制理论的发展

新古典价格机制理论的发展首先由埃奇沃思取得突破。

埃奇沃思没有使用瓦尔拉斯“叫价者”(拍卖者)这一工具,而是从现实的交易分析入手,把价格的形成看作是交易双方“讨价还价”的结果。埃奇沃思认为:“每一个经济行为者只能为自利所驱使,他的行动与他所影响的其他人的同意与否无关;在竞争的领域,是由所有愿意并且能够对拟议中的条款重新签约的个人所组成,任何一个个人可以同无数单位或个人中的任何一个签订或重新制定契约,而用不着得到任何第三者的同意;如果任何一个 X 与数目无限的 Y 进行交易,那么,他一定能够给每一个 Y 提供一个无限小的份额 X,契约是可以无限可分的;一次清算就是一个契约,未经所有当事人同意不能改变;一个最终的清算,不能在竞争领域中通过重新签约而改变;在最终清算的数目不确定时,契约不是不确定的。”埃奇沃思这里所描述的清算,实际上是契约当事人的一个帕累托均衡点,清算是由无数个点的轨迹组成的,即契约曲线。在此基础上,埃奇沃思运用几何分析方法证明在一个以两个交易者、两种商品为基础的复合交易经济中,市场的最终交换结果趋于瓦尔拉斯均衡。埃奇沃思是第一个以重新签订契约的交易模型来解释价格运行和均衡的经济学家,并天才地提出了契约不确定性的思想,这成为后来阿罗-德布鲁范式的核心内容。但埃奇沃思的理论在当时并没有引起经济学学者们的注意,被埋没了将近一个世纪。

埃奇沃思之后,希克斯在帕累托发展了瓦尔拉斯一般均衡交易模型的基础上,创建了一种宏观经济学的动态交易理论,他从分析个人均衡入手,推演了交易一般均衡、企业均衡和生产一般均衡,指出交易的一般均衡是其他均衡的基础。此后,阿罗和德布鲁在希克斯、萨缪尔森创立的一般均衡交易模型的基础上,进一步发展了一般均衡理论。他们运用当时两个最先进的数学工具——凸性和不动点定理,从数理上证明和解释了帕累托效率的分配与竞争均衡之间的相关性关系,研究了能在某一时点通过商品交换所能得到的那些均衡配置。阿罗-德布鲁模型的基点是创造了一个纯粹的阿罗-德布鲁或有商品的概念,即当进一步的分工可产生可想象得出的、能够提高经济行为者满足程度的配置时,那么这样的商品就被称作阿罗-德布鲁或有商品。阿罗-德布鲁模型,考虑了资源可获得性的不确定性和生产可能性的不确定性,也研究了信息不对称性和不完全性问题。但在阿罗-德布鲁模型中,在不确定性的环境下,要获得最优化结果,就

要求存在一组完全的自然或有商品,并假定代理人拥有信息的不同不会影响个人行动的结果,每个经济行为者只需要考虑他自己的目标(偏好或利润)和价格就足够了,每一个经济行为者完全有能力预测时间终点之前的所有未来价格。正是在这种意义上,阿罗-德布鲁模型严格依赖于理性预期,这使得现实中的市场与标准的阿罗-德布鲁模型中所要求的市场相差甚远。阿罗-德布鲁的价格运行均衡因此并没有从核心范式上超越马歇尔的新古典假设。

主线上另一线的发展同样来自对瓦尔拉斯和马歇尔的“自动均衡”的质疑。19世纪末20世纪初,西方国家经济发展过程中出现了明显的垄断现象,经济学者发现:市场竞争中的厂商并非完全是价格的接受者,规模大的厂商完全有势力和能力左右和影响市场的定价。面对“完全竞争”这一不现实假设,学者们开始研究“不完全竞争”下的市场价格运行机制。1926年,斯拉法发表《竞争条件下的收益规律》一文,首先触及垄断对价格影响的问题;1930年代,张伯仑发表《垄断竞争理论》,琼·罗宾逊发表《不完全竞争经济学》,开始系统地研究垄断竞争的价格决定和运行机制。张伯仑和琼·罗宾逊的垄断价格机制理论是马歇尔价格理论的一大发展,它使均衡价格理论第一次“贴近了市场”。张伯仑在其著作中指出:“纯粹竞争和纯粹垄断是两个极端,……实际的价格(决定)却不趋于任何一端,而是趋向于中间的地位,这个中间地位是决定于各种情况下两种力量的比较强度而定。”他最后得出垄断竞争的一般结论:第一,在垄断竞争下,竞争利润永远不会是竞争价格(决定),因为需求曲线永远不会在成本曲线的最低点相切;第二,垄断竞争的价格不可避免要高些,生产规模不可避免要小些;第三,市场价格趋于一致,并不能证明竞争中没有垄断因素存在。此后,经济学者们提出了各种模型解释在不完全竞争市场上厂商的价格行为,如斯威齐提出寡头市场中价格稳定的理论解释、即斯威齐模型,鲍莫尔等人研究了不同目标下的厂商价格策略,这些研究最终发展成产业组织理论。

几乎在同一时期,在垄断研究的另一边,凯恩斯在西方1929-1933年的经济大危机中发现了工资“价格刚性”的存在,并由此找到有效需求不足的根源。为对解决西方生产过剩危机提供“对口”政策,凯恩斯对“价格刚性”成因进行了系统深入的研究,并在1936年出版了奠定现代宏观经济学基础的《就业、利息与货币通论》(以下简称《通论》)一书,通过阐述经济的不确定性和三大心理规律——消费倾向递减规律、资本边际效率递减规律和流动偏好规律,提出了“价格刚性”的凯恩斯定理,从理论上否定了传统的基于“市场出清”的充分就业说、萨伊定律、投资等于储蓄定理和货币数量理论。凯恩斯“价格刚性”理论的建立在市场运行和宏观经济层次击破了“看不见的手”的完美神话,即马歇尔的均衡价格机制自动调节市场均衡只是一个完美的假设,现实生活中实际存在着诸多的价格非均衡,即价格刚性现象。《通论》的出版对于价格机制理论发展有着重要的意义:首先,《通论》的出版催生了系统的宏观经济产生,使政府管理层开始关注和重视宏观价格问题。在凯恩斯生活的年代,通货膨胀并不引人注目,但到了战后,宏观价格水平不断上升,从1960年代末开始演变成严重的社会经济问题。此时,凯恩斯所创立并为后人发展的宏观经济学在解释通货膨胀的原因、提供政策建议方面发挥了重要作用。其次,《通论》为国家干预市

场价格机制运行的合理性提供了理论依据。凯恩斯宏观经济学建立后,国家管理市场的“混合经济”逐渐形成,在价格领域,国家开始利用经济、行政、法律等手段直接管制价格和控制社会物价总水平,从而促使价格管理机制理论的形成和发展。此外,《通论》的政府干预主张和经济运行的不确定性分析方法,为后来公共经济学和经济不确定性研究提供了理论基础。凯恩斯后,其学术传承者继续探索“价格刚性”的原因,并在1980年代初形成新凯恩斯理论;而其主要反对者——以弗里德曼为代表的货币主义学派和以卢卡斯为代表的理性预期学派,则从理论上反对凯恩斯所主张的政府调控“价格刚性”以调整供需均衡的“政府价格机制”,坚持主张要回归瓦尔拉斯和马歇尔的自由市场价格机制理论。非完全竞争价格分析论和价格刚性论从核心命题、分析框架和理论基础上看也并没有超越马歇尔的均衡价格论,因此,主线上的价格机制理论的核心依然是马歇尔的均衡价格论。

二、新兴经济学理论对价格机制理论的发展

在价格机制理论研究的支线上,几个相对独立的新兴经济学理论在20世纪、特别是50年代后在不同的领域得到迅速的发展,其共同点是在某一方面或领域放松了马歇尔“完美价格和完全市场”的新古典假设,以某一“现实”的假设去解释现实市场的价格机制。

(一) 公共经济学对价格机制理论的发展

公共经济学是以公共品的供求机制为研究核心的经济学学科,其发展弥补了新古典自由市场仅仅限于纯私人品假设的不足。一般认为,现代公共经济学的研究自林达尔开始,他把赋税理解为个人或组织、集团为取得公共产品所支付的价格,于1919年提出被称为林达尔公共市场模拟的“自愿交换模型”(林达尔模型)。这是一个以马歇尔均衡价格理论为基础的公共品局部均衡模型,第一次从理论上提出如何确定公共品供应水平和如何运用价格系统为公共品筹资这两个问题的解决“办法”,因而在公共品领域对马歇尔均衡价格机制理论的创造性扩展。林达尔模型诞生次年,庇古的《福利经济学》一书问世,提出了公共品社会供给最优的命题:社会资源在公共品和私人品之间的配置以达到公共品边际正效用和边际负效用相等的状态时为最优。1948年,鲍文以个人需求曲线的纵向求和,以及总需求曲线与供给曲线的匹配,建立了“鲍文模型”,并主张以多数裁定制表决机制来决定公共品的供应水平,解决揭示个人偏好的难题。在此基础上,萨缪尔森1954年发表了《公共支出纯理论》一文,以新古典的价格机制理论对公共品的供求做了系统的综合:他对公共品概念作了其后被广为接受的表述,将序数效用、无差异曲线、一般均衡分析和帕累托效率等运用到公共品最佳供应的分析上来,建立了一个关于资源如何在公共品与私人品之间最佳配置、实现社会福利最大化的一般均衡模型,即萨缪尔森模型。萨缪尔森后,公共品供求机制理论引起西方经济学界的高度关注,研究文献相继涌现,重要的成果如,1956年蒂布率先考察了地区性公共品与居住地选择之间的关系,提出了“以脚投票”的公共品供求机制理论;1968年,约翰逊通过引入公共品的需求曲线去补充林达尔模型,形成“约翰逊-林达尔模型”;1980年,穆斯格雷夫夫妇借鉴林达尔的思路,提出了公共产品的预算模型。

以上对公共品的研究虽然取得了系列成果,但都没有在

理论上突破马歇尔均衡价格机制理论的新古典框架。新的突破是来自另一视角的公共品理论——公共选择理论。公共选择理论的起点在于应如何在理论上解决公共品供求中的个人真实偏好显露(揭示)问题,对这个难题的求解引致了对政治程序在公共决策上作用的大量研究。1940年代以来,公共选择理论在这一问题上的研究为公共品供求机制理论注入了新的内容,重要的进展包括:1948年,布莱克提出了多数裁定制投票的“中间投票者定理”,即中间投票人的需求决定投票的结果;1951年,阿罗论述了没有哪一种投票规则能尽如人意,能保证一个民主社会做出前后一致决策的“阿罗不可能定理”;1957年,唐斯提出选民的“理性麻木”现象;1962年,布坎南和塔洛克合著出版了《一致的计算》一书,对公共选择理论加以系统整理和深化等等。此后,塔洛克、唐斯、尼斯卡宁等学者对政府官员行为与动机进行了大量深入的研究。这些研究揭示了不同于林达尔市场模拟的公共品供求的另一机制——公共产权安排、缔约和执行的公共产权选择机制,从理论上超越了新古典的“自由市场”框架,即公共品的价格机制包含着公共(政治)选择的均衡过程。

实际上,在价格管理机制的理论发展方面,贡献最大的是把公共选择理论和新古典市场理论紧密结合的、目前正从公共经济学中脱颖而出的市场规制理论。1970年前,经济学对市场规制理论的研究主要集中在考察某些特殊产业的价格和进入的控制上,这些产业包括公用事业(电力、管道运输、通讯、交通)与金融(银行、保险、证券)。理论研究的大部分注意力都投向规模技术递增收益情况下的定价问题之上。对这些研究成果的集大成者是卡恩教授1970年的经典教科书《规制经济学:原理与制度》^⑩,卡恩由此被视为现代市场规制理论的创始人。卡恩后,市场规制理论研究的对象范围不断扩大,迄今已经历了三个发展阶段理论:一是市场规制的公共利益理论,认为市场规制发生的原因是存在着市场失灵,包括自然垄断、人为垄断(行政垄断)、外部性、信息不对称等市场领域,在这些情况下,政府对市场规制具有经济学上的合理性。二是市场规制俘虏理论,认为政府对市场规制是为了满足产业对市场规制利益的需要而产生的(即立法者被产业所俘获),而市场规制机构最终会被产业所控制(即执法者被产业所俘获)。三是市场规制经济理论,认为在国家控制资源、各利益主体具有最大化自己效用的有限理性的假设前提下,市场规制应在防止市场失灵的同时,防止规制机构运行的失灵。第三阶段的市场规制理论把公共经济学、新制度经济学、信息经济学等当代经济学理论和新古典市场理论、特别是在此基础之上发展起来的产业组织理论结合起来,已初步建立起与“私有”市场相对应和相融合的“公共”市场价格机制体系,使新古典经济学的价格机制论向着“混合”价格方向发展。

综上所述,公共经济学对新古典价格机制理论的发展主要有下列方面:(1)认识到价格机制不仅包含着私人交易私人品的价格过程,同时包含着他们交易公共品的价格过程。(2)指出公共品的价格机制包含着公共(政治)选择的均衡过程。(3)提出由于市场的非完全性,价格机制不仅包含着价格的决定(形成)过程和价格机制的运行过程,也包含着价格的管理过程。

(二) 制度经济学对价格机制理论的发展

在市场最基础的运行层面,使马歇尔均衡价格机制理论

重新回到市场分析起点的是新制度经济学。制度经济学的发展分两个阶段,第一阶段是从19世纪末到20世纪60年代的旧制度经济学阶段,主要代表学者是凡勃伦、康芒斯和加尔布雷思、缪尔达尔。第二阶段主要是从1960年代至今的新制度经济学阶段,主要代表学者有科斯、诺斯、阿尔钦、德姆塞茨、威廉姆森、张五常等。旧制度经济学基本沿袭古典经济学的分析传统,以政治经济学的方法从“整体”上研究历史和经济问题,其主要贡献是引入制度作为经济分析的核心要素,并引入权利、组织、法律、伦理、交易分析等创新的经济分析学方法,这些都为新制度经济学的发展产生了启蒙作用和准备了理论基础。

新制度经济学主要运用哲学、法学、社会学和心理学方法分析制度结构及运行的古典经济学框架,用成本-效益分析、制度供求及交易均衡分析等新古典经济学的分析方法去研究制度形成和运行问题,并力求考察和研究在制度非中性环境下如何实现制度经济学与新古典经济理论的耦合。在价格机制理论方面,新制度经济学在产权、交易、组织、契约、信息等诸多方面都丰富和拓展了新古典价格理论,把新古典经济学强力拉回到现实市场的假设和研究中。新制度经济学在价格机制理论上对新古典经济学的突破主要有下列方面:(1)在交易的经济人假设上跃进了一大步。新古典经济学把交易中的经济人假设为公正无私、遵守道义、信息知识完备的完全理性的经济人;新制度经济学则从现实出发,把交易中的经济人假设为自私趋利、有机会主义倾向和信息知识不完备的有限理性的经济人。从这一假设出发,新制度经济学修正和拓展了新古典的“价格机制自动运行”命题,提出了“价格机制包含着经济人在交易过程中争权夺利,博弈运行”的新命题,较好地解释了价格运行过程中出现的垄断、信息隐瞒(欺骗)、违背交易协议等经济人的“策略性行为”现象。(2)引入交易成本概念,突破了市场价格无摩擦均衡形成的简化框架。新古典价格论把市场假设为同质、完全竞争、信息对称等的完美市场,因而价格在交易过程中形成是无需成本的,并能达到最优化的均衡;新制度经济学否定了这种不切实际的假设,引入交易成本来模拟市场交易和价格形成过程中的种种“阻力”,包括信息搜寻、组织、签约、履约、惩罚等成本费用,不仅为价格的形成和运行提供了良好的机理解释,而且提供了如何提高现实市场中的交易效率、降低交易成本以求达到帕累托次优均衡的可行性理论。(3)引入产权、组织、契约等经济分析方法,使价格机制的作用要素逐步完善化。新古典价格论把价格视同为供需均衡时的边际交换价值,把交易物品的产权安排、交易者的组织形态及契约关系等都假设为既有的“黑箱”,从而使价格的内涵仅仅限定为交易物品之间的“数量关系”。新制度经济学则从“黑箱”的制度要素分析入手,从更微观的层次去研究交易的制度过程和产权体系,从而更准确地从一般意义上揭示了价格的性质和内涵。新制度经济学研究表明,交易的效率与产权安排紧密相关,交易过程也是组织过程,交易关系实质上是一种产权契约关系,即价格实质上是产权交易契约的安排解^⑪。由此,新制度经济学把新古典的价格理论从静态和瞬间的数量关系上升到动态的、包含瞬间和长期的产权契约关系。总之,新制度经济学把新古典价格理论看作是外生变量的制度因子引入到其价格理论中,使之成为价格机制模型中的内生变量,从而使新制度经济学的价格机制理论不仅仅是

反映物物交换的关系,而且更多的是人与人之间“讨价还价”的交易关系,是凝结在物品中的产权契约关系。

(三) 博弈论和信息经济学对价格机制理论的发展

博弈论和信息经济学为马歇尔以后的价格机制理论发展提供了“升级换代”的经济分析工具和方法论,有力地促进了新制度经济学、公共经济学等当代经济理论流派与新古典经济学的耦合。一般认为,博弈论开始于1944年由冯·诺依曼(Von Neumann)和摩根斯坦恩(Morgenstern)合著的《博弈论和经济行为》一书的出版,至1950年代进入鼎盛期^①,此时期非合作博弈论也开始产生^②。1960年代,泽尔腾(1965)改善了纳什均衡的概念,引入了动态分析;海萨尼(1967-1968)把不完全信息引入博弈论的研究。1980年代后,博弈论在经济中的运用走向成熟,并出现了一些较有影响的经济学者,如Kreps和Wilson等^③。博弈论对新古典价格机制论的突破不仅是数学方法上的突破,而且更是价格行为过程的认识上和分析上的突破。首先,博弈论突破了新古典价格论中把交易者的所有行为都假定在一个价格参数里、交易行为似乎只是单向选择的局限^④,把交易者的价格行为扩展为双边互动行为,即交易者最优选择面对的是依赖于他人(交易方)选择的函数。其次,博弈论把新古典的“合作”价格机制发展为符合现实的合作和非合作的价格机制。由于设定了完全理性人和完全竞争市场的假设,新古典价格机制理论中的交易者都是完全“合作”者,因为在此假设条件的约束下,交易者只有选择完全合作,才能获得最大收益。这显然与现实生活严重相左。博弈论则主要专注于人们在交易过程中的“非合作博弈”,这更符合现实经济过程中人们在信息不对称、存在机会主义倾向和未来的不确定性等条件下的价格行为模式,开创了“现实”价格行为的机理研究。最后,新古典价格机制理论中,不仅交易者是单向分离的,而且生产、交换和分配也是单向分离的,即新古典价格机制中的供求机制是独立分离的,就像马歇尔比喻的“一把剪刀的双边刃”,只有在价格形成时才互相“交叉”。这使新古典经济学成为“卖”者和“买”者被严格界分开,只专注于研究“理性人”生产配置如何优化的科学。博弈论的一大特色是很大程度上弥补了新古典经济学的“单向价格”不足和在“纯粹性分配”配置优化研究上的缺位,引入既可以是“卖”者,也可以是“买”者的“局中人”假定^⑤,使“卖”者和“买”者的价格行为同一和互动,形成“交互”的对策均衡机制^⑥,价格机制不再是单向串联在一起,而是双向互动的网状并联。在对策均衡机制下,博弈论实现了价格机制在生产、交换和分配过程的统一,即三者并没有互相分开,也没有先后之分,三者的过程都是产权契约的交易过程,只有长与短的契约之分。由于信息的稀缺性和人的机会主义有限理性,博弈论的价格研究更多关注于分配领域的争夺。当然,博弈论与新古典经济学是“统一”发展的,两者的研究范式基本相同,即都强调个人理性,在给定的约束条件下追求“经济人”的效用最大化。

经济学说到底关于人的选择和决策优化的学科,而其核心的价格机制理论说到底就是产权契约的解。选择、决策、谈判、履约等人类的经济行为过程无不涉及到信息的利用,因而信息在经济学中显得特别的重要,从广义上甚至可以说,经济学就是一门依据信息做出决策的“信息学”。但由于新古典经济学把交易者和交易市场都假设为信息完全并作为研究的前提条件,使信息经济学只在博弈论和新制度经济

学发展后才得到充分重视、研究和发展。实际上,直至1970年代中期经济学家开始转向强调个人理性、特别是强调对个人最基础效用函数的研究之后,他们才发现信息是一个非常重要的问题,信息问题才成为经济学家关注的焦点。由于信息的稀缺性和人们知识、专业、文化等固有的差异,使信息完备的假设在现实经济生活中缺乏解释力,信息经济学正是针对新古典经济学的这一缺陷作为研究的出发点,主要研究在信息不完备的条件下人类交易行为和策略行为的经济理论。^⑦信息经济学最早的研究是奈特1921年对不确定性所做的创造性研究,40年后,斯蒂格勒于1961年发表了其著名论文《信息经济学》,被公认为现代信息经济学研究的起点。该文中,斯蒂格勒研究了信息的成本、价值和信息对价格、工资及其他生产要素的影响,首次将信息作为经济活动的要素和经济运行的机制加以研究。进入1970年代以后,美国经济学家乔治·阿克洛夫提出旧汽车市场分析的“柠檬”理论,标志着信息经济学由产生形成进入到发展阶段,阿罗、詹姆斯·米尔利斯、格罗斯曼、施蒂格利兹、赫伯特·西蒙等学者对不完全信息条件下的市场经济行为进行了广泛分析,研究的内容涉及到:信息搜寻及搜寻成本;不完全信息条件下的经济行为分析;非对称信息和激励机制的设计;信息与经济组织理论等领域。^⑧

信息经济学是一门研究交易中的契约人在不确定、信息不对称条件下,如何寻求一种契约和制度安排来制约和防范交易者之间由于“信息租金”^⑨的存在而采取有损效率的策略性经济行动,或是激励交易者主动拒绝(或减少)这种行动的学问。^⑩信息经济学研究的核心是因事前信息不对称而导致的“逆向选择”问题和因事后信息不对称而导致的“道德风险”问题,这对新古典经济学的价格机制理论是全面性的革新。第一,在新古典价格理论里,价格是“极点”(均衡点)价格,价格所包含和传递的信息也是“极点”信息,其作用的机制是传递“物物交换”的结果;而在信息经济学看来,价格是“全程”(交易过程)价格,价格所包含和传递的信息是“全程”信息,或反过来说交易全程中的“信息机制”才是价格机制的全部内涵,其作用的机制是首先传递着“人与人交易”的结果,然后才是“物与物交换”的结果。弗里德曼曾归纳,价格机制有三大功能:一是信号传递功能;二是经济刺激功能;三是分配功能。新古典价格理论认为,价格的这些功能都是从“极点”信息发出的;而信息经济学的价格理论认为,价格的这些功能是由交易过程中各个信息点连成的“信息集”所共同起作用的。所以,信息经济学的发展使新古典经济学的价格机制理论从极点论跨越到全程论,从结果论转变到过程论,从物与物的作用转变到人与人的作用。第二,在新古典价格理论里,价格所凝结的信息只是市场瞬间交易的“量比”,是与交易者契约关系无关的量;而在信息经济学里,价格所凝结的信息是交易者契约规定的浓缩载体和契约履行的结果,反映着交易者产权契约性交易的生产合作及分配的关系,即信息经济学不仅仅把物与物交换的结果信息看作价格,而是把市场扩大到所有的人与人之间的产权交易里,并把契约规定及产权交易结果的信息都看作“价格”。所以,信息经济学的发展使新古典经济学的价格机制理论从非组织型交易的价格论跨越到组织型交易的价格论。简言之,信息经济学的发展使价格机制理论进入“信息机制”为主导的“契约论”阶段。

三、结论

上述经济学新理论的发展都为马歇尔的均衡价格机制理论带来了新的突破和发展,同时似乎离它越来越远。许多经济学家曾经尝试建立新的均衡体系来替代传统的新古典价格机制理论,如在信息经济学发展中,马尔萨克创立的最优信息系统选择理论和施蒂格勒开创的信息搜寻理论至今依然没有找到与一般均衡理论相衔接的途径,部分信息经济学家由此设想和努力寻求以“信息机制”一般均衡去替代传统的供求价格一般均衡。新古典的价格机制理论是否有一天将被全盘抛弃,笔者认为不至于此,虽然新古典构建的价格机制过程过于完美,需要经济学家们一步一步将其拉回到“肮脏”和充满“无知”的现实,但新古典价格机制理论完美的结局却是经济学家们永远追求的目标。而且,新古典经济简洁的数学假设和严密的推理也是后来经济学家必备的理论基础和必须遵循的研究途径。正如弗里德曼所说,在假设基础上建立起来的假说十分重要,如果它能以少释多,能从环绕着待解释现象周围大量混沌且零碎的事物中抽象出普遍而又紧要的因素,并可据此来预测实际的话,那么这些假说就是有意义的。与理论假设有关的问题并非是这些假设在描述上是否现实,因为它们从来不现实,而在于它们对正在考虑的问题是否具有良好的近似性。^①实际上,现代经济学的发展在局部独立的同时,更多时候是各门分支理论学科互相融合和互相促进的过程,并且往往最终回归到新古典经济的基础轨道。如信息经济学研究中,罗斯柴尔德、斯蒂格利茨和格罗斯曼等学者,目前依然致力于从一般均衡角度分析信息经济学问题,并获得了丰硕的学术成果。^②又如,法国经济学家泰勒尔 1988 年出版的《产业组织理论》一书,被认为是新一代产业组织理论著作,作者把传统的产业组织理论和最新发展的经济理论,如博弈论和信息经济学、契约经济学、规制经济学、法律经济学等很好地结合在一起,形成了“再综合”的产业组织理论。再如,华裔经济学家杨小凯目前正致力构造的“超边际分析”新兴古典经济学,也没有离开边际分析的基础,而是在边际分析的基础上,结合最新的新制度经济学研究成果,引入新的数学分析工具——非线性规划的“角点解”分析,以求从由于分工而产生的众多“现实”均衡点中找出最优均衡。看来,新古典的价格理论假设框架尽管与现实相去甚远,但它们提供了近似性的说明工具,当变量越来越多,外生变量逐一变为内生变量时,经济模型就越来越接近现实。新的经济理论正是在新古典价格理论的分析框架内,将许多外生变量,例如产权、交易费用、信息、交易序次等视为内生变量加以分析,并试图运用修正后的新古典工具来解释经济生活,改写新的价格机制理论。新的经济学正朝这个方向努力和发展。

价格机制理论是经济学理论中的“心脏”,任何一种新的经济理论的发展,都能够为价格机制理论的发展带来新鲜的血液。除上述的经济理论外,法律经济学、心理经济学等经济分支学科的发展也给马歇尔后的价格理论发展注入新的内容和活力,使价格这双“看不见的手”越来越看得见和摸得着,成为经济学家维护市场良好运转的工具。

注释:

Edgeworth, F. Y., 1881. *Mathematical Psychics*. London: C. Kegan

Paul & Co., pp. 16 - 20. 转引自科斯、哈特、斯蒂格利茨等:《契约经济学》,中文版,10 页,北京,经济科学出版社,1999。

熊彼得认为,埃奇沃思对经济学分析工具的贡献不亚于甚至超过了马歇尔《经济学原理》所作的贡献。参见熊彼得:《经济分析史》,中文版,第 3 卷,120 页,北京,商务印书馆,1984。

埃奇沃思的这一理论在 20 世纪中叶终于得到马丁·舒比克(1959)、德布鲁和赫伯特·斯卡夫(1963)以及罗伯特·奥曼(1964)的发掘、证明和发展。转引自李纪荣、杨春学:《对新古典经济学中市场交换理论的批判——兼评经济核心理论》,载《经济科学》,1999(6)。

张伯伦:《垄断竞争理论》,中文版,61、82 页,上海,上海三联书店,1958。

伍世安、杨林枫:《西方价格理论的发展》,载《当代财经》,1992(7)。

在凯恩斯进行不确定性经济分析前,奈特于 1921 年开创性地进行过不确定性的经济分析,凯恩斯是在其基础上发扬光大。

新兴经济学理论对新古典经济学提出的质疑和挑战是全面的,并非仅仅针对新古典价格机制理论,实际上,新兴经济学很少直接研究价格机制问题,其价格理论只能从其新经济理论观中“间接”总结,本文中其价格机制理论及其对新古典价格机制理论提出的新命题是笔者的推理和总结。

Samuelson, P. A., 1954. "The Pure Theory of Public Expenditures." *Review of Economics and Statistics*, November 1954, pp. 387 - 396.

郑榕:《公共产品论的发展历程》,载《财政研究资料》,1998(19)。

① Kahn, A. D., 1970. *The Economics of Regulation: Principles and Institutions*. New York: Wiley.

② 马克思曾多次强调应把价值(价格)理解成为人们交换劳动的关系,这是一个突破,只是马克思的“劳动关系”定义太窄。

③ 1950 年代,纳什(1950)和 Shapley(1953)采用博弈分析发表了“讨价还价”模型, Gillies Shapley(1953)提出关于合作博弈中的“核”的概念,还有其他一些学者在博弈论研究中也做出了贡献。转引自张维迎:《博弈论与信息经济学》,6 页,上海,上海三联书店、上海人民出版社,1996。

④ 纳什在 1950 年和 1951 年发表了两篇关于非合作博弈的重要文章, Tucker 于 1950 年定义了“囚徒困境”的概念。他们两个人的著作基本上奠定了现代非合作博弈论的基石。

⑤ 参见张维迎:《博弈论与信息经济学》,6 页,上海,上海三联书店、上海人民出版社,1996。

⑥ 这样,一个人做出决策时他面临的似乎是一个非人格化的参数,而不是面临着另外一个人,另外一个决策主体来做出他的决策。他既不考虑自己的选择对别人选择的影响,也不考虑别人选择对自己选择的影响。

⑦ 王国成:《冲突与挑战:对策论与经济学基本行为假定》,载《学习与探索》,1996(2)。

⑧ 对策均衡是以纳什创立的均衡概念(Nash, 1951)为基础逐步发展起来的一套概念体系,包括子对策完美均衡、颤抖的手均衡、序列均衡和贝叶斯均衡等一系列策略性均衡。转引自张维迎:《博弈论与信息经济学》,13 页,上海,上海三联书店、上海人民出版社,1996。

⑨ 对信息经济学的解释,由于其研究的内容和目标不同而引起较多的争论。笔者认为,接近百年来信息经济学研究的目标和功能分,信息经济学可明确分为两大研究领域:以交易者因争夺“信息租金”而在信息不对称条件下采取策略性行为为研究目标的“信息机制”研究和以人们使用信息产品去提高和优化生产配置为研究目标的“信息产品”的生产、交换、分配和服务等的研究。本文中的信息经济学指前一种含义的信息经济学。

⑩ 从研究内容上看,信息经济学包含了博弈论、理性预期理论和不确定性分析理论等经济学分支理论。见陈昆玉:《信息经济学评述》,载《情报理论与实践》,2001(3)。

⑪ 信息租金指交易双方中一方因拥有更多的信息和采取隐藏信息的行为而取得超出合理交易的利润。

⑫ 因此,信息经济学又常称为不对称信息经济学或契约理论。

⑬ 转引自易宪容:《新制度经济学与中国研究》,载《社会科学战线》,1999(6)。

⑭ 陈禹、谢康:《信息经济学及其应用》,载《改革》,1998(2)。

(作者单位:江西财经大学工商管理学院 南昌 330013)
(责任编辑: S)