|  |
| --- |
| **田国强：哈耶克对赫维茨经济思想的影响及二者异同（《文汇报》）** |
| 发布日期：2017-06-09 |
| 哈耶克对赫维茨经济思想的影响及二者异同来源：《文汇报》2017.6.9 文汇学人版面 作者：田国强http://econ.shufe.edu.cn/kindeditor-4.1.10/attached/image/20170609/20170609170629_78597.png学生时期的田国强与赫维茨的合影赫维茨曾言，观点看似差别很大的经济学家常常在许多方面拥有共识。赫维茨与哈耶克的经济思想有很多共同点，如对分散信息、有限理性等的确认，对经济自由选择、市场机制、分散决策的偏爱，政府主要的作用是维护和服务等。不过，无论是从思想还是从方法论上，二人也存在一些显著的差异。2017年是机制设计理论奠基人赫维茨的百年诞辰。赫维茨开创的机制设计理论对现代经济学几乎所有领域的发展都有深远重大的影响，特别是与之紧密相关的信息经济学、激励理论、最优合约理论、拍卖理论和市场设计理论，已成为现代经济学中极为重要和活跃的研究领域，诞生了20多位诺贝尔经济学奖得主，并且近些年来获奖密度越来越高，10年中居然有5年的诺奖都与之相关。由于信息不对称和个体自利性这两大无处不在的最大客观现实约束，旨在解决这两个问题的机制设计理论有着广泛应用。2016年首届中国经济学奖的两位获得者钱颖一和许成钢，就是通过运用激励机制设计理论的基本原理和思想研究中国经济体制转型和改革做出贡献而获奖的。在赫维茨的经济思想形成和发展过程中，有一个经济学家的影响不容忽视，那就是同样作为20世纪最伟大经济学思想家的哈耶克。哈耶克对现代经济学的发展及现实政治经济制度的选择也影响重大，特别是对经济转型国家及其改革发展，起到了不可估量的现实指导作用。有评价称20世纪是哈耶克的世纪，21世纪可能是熊彼特的世纪。的确，前者对于市场在配置资源上的效率优势的揭示，已为后世转型经济国家的实践所验证，而后者对于创新和企业家精神在市场经济中核心地位的揭示，则更加指引着当今许多国家的经济发展。哈耶克的一生中有两次影响深远的论战：一个是20世纪30年代与凯恩斯关于货币理论的论战，另一个论战是20世纪二三十年代与兰格、勒纳之间关于计划经济可能性的大论战，被称为社会主义大论战。本文主要关注后一次论战，因为这次论战对赫维茨的经济思想生发和演变具有重要意义，也深远影响了现代经济学的发展。米塞斯、哈耶克对于社会主义计划经济的批评，不是针对社会主义理想是否合理，而是从信息和激励的角度对计划经济的弊端进行了较为彻底的批判，认为社会主义计划经济不可能及时全面地获得维持经济有效运转的信息。中央计划机构需要知道消费者的偏好、企业的生产技术条件，且要有构建和解出数以百万计以上的供给和需求联立方程组的能力。即使能知道这些信息并能构建和解出这些方程式，由于收集信息和计算供求结果需要花费很多时间，待解出方程式时人们的消费偏好、企业的技术条件也许早已发生变化，会出现刻舟求剑的现象。所以，他们认为经济社会不可能获得社会主义计划所需要的信息并合理地使用这些信息。而兰格、勒纳却认为可以通过边际成本定价来解决信息要求过多的问题，但他们并没有解决由此又产生的激励不相容的问题，也就是企业怎么会有激励真实显示其边际成本。哈耶克强调以自由、竞争和规则为基本要素的自生自发社会秩序的重要性，他的这种超前的内在逻辑判断在他去世之前就得以验证。下面，笔者主要谈一谈哈 耶克的思想对机制设计理论这一领域主要是赫维茨经济思想的影响及其异同。在很大程度上，也就是谈奥地利学派对机制设计理论的影响及其异同。主要谈三点看法。赫维茨1938-1939学年在伦敦政治经济学院学习期间曾上过哈耶克的课，他在多个场合坦承哈耶克的思想对他的经济学思维形成方面所起到的主要作用。确实，哈耶克关于信息分散的讨论是启迪赫维茨在机制设计理论创设之初重点考察经济机制的信息效率问题的重要思想原点。前面提到，在上世纪二三十年代的社会主义大论战中，哈耶克对于中央计划经济体制的挑战，不仅在于当时对于海量计算求解能力瓶颈问题，更重要的在于他所提出的“知识问题”，也就是如何将形成方程所必需的分散存在的信息有效收集到中央机构手上去。“由于在一个经济中信息是高度分散的，将所有相关信息汇集到单个机构中的难度是巨大的”，“要么是不可能的（许多信息将会丢失），要么是为了达到既定的精准性要求的成本太大”（Leonid Hurwicz“The Design of Mechanisms for Resource Allocation”， American Economic Review, 1973，63，Papers and Proceedings， p5），要么就是没有激励真实显示私人信息，从而缺乏资源配置效率。这样，信息有效性、激励相容性及资源配置效率是大论战中的关键词，也是当前现代经济学中许多领域讨论的关键词或主题，更是衡量一个经济制度（如计划经济、市场经济或转轨经济）好坏的重要标准。这恰恰也正是机制设计理论所关心的中心主题，更是当下中国改革中制定一个制度或政策所必须加以考量和作为评价准绳的。但是，由于当时辩论双方在论战中对许多关键性的经济概念（如分散决策、自由市场、激励）都缺乏一致定义，内涵和外延常常不相一致，尤其是奥地利学派没有给出形式化的具有严格数理逻辑支撑的明确结论及其成立范围，其结果就是谁也说服不了谁。哈耶克曾批评“与他同一时期的数理经济学家对于忽略市场体制中沟通的重要性负有重大责任”（转引自罗杰•B.迈尔森《制度的基础理论：致莱昂尼德•赫维茨的演讲》，王少国译，《经济社会体制比较》，2007年第6期；Roger B.Myerson“Perspectives on Mechanism Design in Economic Theory”，The American Economic Review， 2008，98（3）： 586-603）。尽管此时的赫维茨尚年轻，还置身于论战之外，但这一理论挑战还是在后来触发了赫维茨对于构建一个基于基础性数学模型的且更加综合的新的经济理论的理论雄心，以使之能够对不同的经济制度进行分析比较，并且早期赫维茨也是从信息维度切入来研究机制设计的。现实中许多人，包括许多中国经济学家，常常将现代经济学中许多学派的差异和争论及对一个经济学家的推崇或贬低盲目扩大到耸人听闻的地步。其实完全不是这么回事。赫维茨曾言，观点看似差别很大的经济学家常常在许多方面拥有共识。经济学家在大多数方面观点是一致的，从而不会去讨论。要讨论或在争论的只是大家的分歧部分，但由此给外人的感觉就好像其分歧是巨大的。的确如此，经济学的讨论必须建立在一些最基本的共识的基础上。赫维茨与哈耶克的经济思想有很多共同点，如对分散信息、有限理性等的确认，对经济自由选择、市场机制、分散决策的偏爱，政府主要的作用是维护和服务等。不过，无论是从思想还是从方法论上，二者也存在一些显著的差异。首先，关于制度是如何产生、如何变迁的认知差异。哈耶克比较强调自然演化的社会发展机制，强调要尊重个人自由，尊重一般性规则，尊重竞争，强调整个社会秩序是以自生自发的方式形成的，而不是刻意地去创造一种人为干预的自发社会秩序，对夸大理性作用和人为社会设计持批判和反对的态度。这与亚当•斯密“看不见的手”的意涵相近，即人们出于自利本性参与市场经济活动，形成社会劳动分工，是市场交换过程中自发形成的产物，并未意图创造某种秩序，却在客观上起到了增进社会福利的效果。赫维茨原则上认同这些观点，但认为市场是有其适用边界的，一旦超出就会出现失灵，因而不能盲目相信自由放任市场，而市场失灵也正是机制设计的一大必要性之所在。笔者在这里想指出的是，市场失灵作为现代经济学的一个公共术语，有其准确定义：当出现信息不对称、非完全竞争、外部性或政府角色越位或缺位时，有可能市场会导致帕累托无效配置。国内一些经济学家否定新古典经济学的作用，是通过篡改经济学中市场失灵的定义而否定市场失灵的。这种偏离学术共同体的基本术语来谈问题的做法，容易造成鸡同鸭讲，失去讨论问题的共同语言，引起不必要的争论。因而，赫维茨并不主张政府要完全停止指导或干预经济，只是更倾向于一个有管理的经济而非一个受控制的经济。实际上，经济学说史上对制度如何产生这一问题的认识历来有两类思维进路：一类是门格尔一脉（往前可追溯至亚当•斯密）的制度演化生成观，另一类是康芒斯一脉的将制度解释为“集体行动控制个人行动”的制度设计生成观。如果说哈耶克的自发社会秩序理论属于前一种路径的延续的话，那么赫维茨的机制设计理论显然可以被其归类于后一种路径的延续。前者偏重实证分析的“演化范式”，后者则偏重基于现实经济制度环境下规范分析的“设计范式”。如笔者在“中国经济学奖颁奖盛典暨第二届思想中国论坛”上的发言《机制设计理论及其对中国改革、发展和治理的重大意义》中所指出的那样，这两种范式都只是部分而非全部解释了客观现实。http://econ.shufe.edu.cn/kindeditor-4.1.10/attached/image/20170609/20170609170711_13209.png制度设计的图示不少中国经济学家根据奥地利学派代表人物米塞斯-哈耶克社会发展秩序及其机制是演化的观点，否定制度设计的重要性。这样的观点是以偏概全，很值得商榷的。从人类社会发展的现实来看，一些制度的确是演化而来的，尤其是社会习俗、风俗和文化这样的非正式制度安排都是演化的结果，而正式制度安排大多是设计的成果，如宪法的制定，制度的制定，体制的选择，改革措施等都基本是基于现实政治、经济、社会、文化等基本制度环境而设计的。比如，美国建国初期基本宪法，就不是演化的，而是制定出来的，它使得美国在短短100多年的时间成为世界上最强盛国家，是制度设计导致了好的市场经济的典型例子。经济体制的选择，如中国建国后走计划经济道路的选择和改革开放后走市场经济道路的选择，包括改革开放之初的包产到户，如果得不到政府的默许继而合法化，最终作为国家层面的制度安排确定下来，也就没有现在的局面。因此，对“设计范式”和“演化范式”不能以偏概全，完全肯定一方而否定另外一方的做法不可取。这些经济学家之所以有这样的误区，是他们想当然地认为制度设计是任意的，而不清楚制度设计的前提是基于政治、经济、社会、文化、初始禀赋等基本、基础制度环境，好的制度设计要充分考虑信息、激励和效率，将它们作为考量的基本准绳。下面机制设计理论的著名图标说明了此点。其次，关于理论进路和方法论立场的差异。对于奥地利学派，赫维茨最大的批评是方法论层面的。他认为，奥地利学派基于个体主义的描述性方法存在概念定义的模糊性，对于理论边界的界定不是很清晰，特别是对于自由市场的概念及其适用范围的界定存在混淆不清的地方，这就为该学派学者埋下了盲目相信自由市场、完全杜绝人为制度设计的病根。这也是笔者对国内一些经济学家过度热衷于奥地利学派的经济学说，忽视其严谨性不足，不重视基础经济理论尤其是新古典经济学等基准经济理论，而提出的警示和批评。由于经济学又是一门外部性特别强的社会学科，具有很大的正负外部性。不像医生，医术不好，受损或医死只是个别人，而一旦用错理论，制定出错误的经济政策和制度，影响和危及的就不仅是个体，有可能是整个国家层面的经济发展。与之不同的是，赫维茨虽然也崇尚市场，但不迷信市场，认为市场在一些情况下会出现失灵不能完全靠演化理性的自发秩序，需要有意识地进行替代或补充机制的设计，他更加推崇新古典经济学所用公理化的逻辑推理方法来提升经济研究的科学性、逻辑性和严谨性，从而给出体制机制的适用边界。机制设计理论就是赫维茨等人从新古典经济学发展而来，其中有他对新古典经济学局限性的反思，但他没有停留于反思或批判，也没有否定新古典的基准点和参照系作用，而是对其修正发展出了具体广泛应用的机制设计理论。所以，赫维茨的理论雄心是建立一个具有足够一般性的经济分析框架，以覆盖从自由放任到乌托邦的完整政策频谱。在他的分析框架下，奥地利学派显然属于自由放任的一极，但一个社会经济的发展常常需要在中间地带而非极端处寻找解决方案。将一件事情或事业做成是如此，让中国改革成功更加是如此，任何情况下不能走极端，需要权衡处理，综合治理。比如对中国的改革措施的提出和实施，笔者就提出了需要处理好改革、发展、稳定、创新及治理五位一体的辩证互动关系，进而合理界定政府与市场、政府与社会之间的治理边界，让市场在资源配置中起决定性作用和让政府发挥更好而不是更多的作用。正是由于机制设计理论具有足够的一般性，使得其应用也非常广泛。不仅从国家层面上的制度选择上具有明道的指导作用，同时也有优术的作用，既可用来研究大到整个国家层面上的顶层制度设计问题，也可用来研究小到企业或家庭的机制设计问题，设计出可执行既定目标的机制或过渡性制度安排。机制设计理论既重视目标，更重视执行问题和过程。比如，市场设计研究就是经济学家运用机制设计理论等工具，对许多传统市场失灵情形下（如不可分商品的配置和公共品的提供），主动地去设计新的市场制度（如对拍卖、匹配机制的设计），扩展市场的各种功能而兴起的一个热门研究领域，在通讯频谱拍卖、排污权交易、公交线路运营权拍卖、汽车牌照拍卖、网络拍卖、择校系统、器官捐献分配系统等中有很多应用，并起到很好的效果。从上面两点的讨论，可以看出哈耶克对赫维茨的影响更多还是思想倾向和哲学层面的，不过赫维茨所推崇的分析工具和研究方法基本还是新古典和当前主流经济学所倡导的数理演绎推理式的，而非哈耶克及其奥地利学派基于个体主义的描述性方法。哈耶克和赫维茨在高等教育阶段都曾经历过跨学科的学术训练。赫维茨本科期间在波兰华沙大学主修的是法律，因为偶然机会选修了经济学课程，才发现自己的真正兴趣所在，随后到伦敦政治经济学院修读经济学，但是他一生并没有任何经济学的正式学位，除了后来的一些荣誉学位。哈耶克1921年在奥地利维也纳大学获得的学位也是法学学位，大学期间却花了大量的时间和精力在心理学和经济学上，最终选择了经济学作为专业方向。当然，哈耶克著述所涉及的学科远不止这些，还包括政治学、哲学、社会学和人类学等。毫无疑问，求学过程中的多学科学术训练，极大地开阔了他们的观察视野，为他们后来在经济学上的学术创新创造奠定了良好基础。其实，经济学家中这样的经历过学科转向或接受过跨学科训练的例子还有很多。例如，在众多诺贝尔经济学奖得主中，丁伯根、麦克法登是学物理出身的，希克斯、德布鲁、纳什、阿罗、莫里斯、赫克曼等都是学数学出身的，萨缪尔森是学文学出身的，卢卡斯是学历史出身的，理性预期学派另一代表人物托马斯•萨金特是学工程学出身的，他们都对现代经济学的发展做出了巨大的不可磨灭的贡献。如今活跃在国际学术舞台上的很多有影响力的华人经济学家也是跨学科训练的受益者，并且很多是理科出身，如钱颖一、陈志武、白重恩、笔者本人等许多上世纪80年代留学美国的华人经济学家原来都是学数学的，黄明、王江、洪永淼等是学物理出身的。之所以有“经济学帝国主义”的提法，一个很重要的原因是经济学在将自然科学的研究方法和工具引入研究的学科交叉方法创新上走在其他社会科学前面，其基本分析框架、研究方法及其工具也适用于研究其他社会科学，如政治学和社会学。我们在人才培养上也要非常强调跨学科的训练，强调理论、历史和统计对于经济科学素养形成的重要性。由于研究经济社会问题不能轻易拿现实社会做实验，否则代价太大，因而既需要有内在逻辑推断的理论分析，往往也需要有历史的大视野、大视角来进行纵横向比较，从中汲取经验教训，以及还需要运用统计和计量经济学等工具手段进行实证量化分析或检验，三者缺一不可。现代经济学在作经济分析或给出政策建议时，往往同时从理论、历史和统计三位一体进行学理性分析，既有内在逻辑的理论分析，也有历史视角的比较分析，同时还有数据统计的实证计量分析加以检验和考察。的确，在最终的分析中，所有知识皆为历史，所有科学皆为逻辑，所有判断皆为统计。**（作者为上海财经大学经济学院、高等研究院院长）** |
|  |