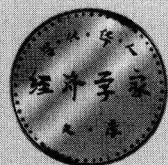




黄有光自选集



黄有光自选集

山西出版集团
山西经济出版社

图书在版编目 (C I P) 数据

黄有光自选集 / 黄有光著. —太原: 山西经济出版社, 2011. 1

ISBN 978 - 7 - 80767 - 367 - 5

I. ①黄… II. ①黄… III. ①社会科学 - 文集
IV. ①C 53

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2010) 第 248088 号

黄有光自选集

著 者: 黄有光
丛书策划: 赵建廷
责任编辑: 李慧平
特约编辑: 任永玲
复 审: 任 冰
终 审: 王宏伟
艺术监制: 陈永平
整体设计: 陈 婷
责任印制: 李 健

出 版 者: 山西出版集团·山西经济出版社
社 址: 太原市建设南路 21 号
邮 编: 030012
电 话: 0351 - 4922133 (发行中心)
0351 - 4922085 (综合办)
E - mail: sxjjfx@163.com
jingishb@sxskcb.com
网 址: www.sxjjcb.com

经 销 者: 山西出版集团·山西新华书店集团有限公司
承 印 者: 山西出版集团·山西新华印业有限公司

开 本: 787mm × 1092mm 1/16
印 张: 15.5
字 数: 237 千字
印 数: 1 - 3 000 册
版 次: 2011 年 1 月第 1 版
印 次: 2011 年 1 月第 1 次印刷
书 号: ISBN 978 - 7 - 80767 - 367 - 5
定 价: 28.00 元

当代华人

经济

名家文集

卷一

主编/胡必亮 赵建廷
编委/胡必亮 赵建廷
樊 纲



总序

改革开放以来,中国经济增长、社会转型与政治改革都表现出循序渐进、健康稳步发展的良好势头。工业化、城市化、信息化、全球化等多种力量在同一时期汇聚于中国发展的历史大舞台,为中国的加速发展创造了千载难逢的历史性机遇并直接提供了强劲的动力。中国的和平崛起已经成为新世纪人类历史发展新阶段的重大事件,并引起了全世界的普遍关注。

变革的时代必然产生创新的思想。在中国发生这场伟大的历史性变革过程中,中国大陆经济学家,香港、澳门和台湾经济学家以及旅居海外的华人经济学家共同见证和详细观察了这场具有革命性意义的伟大变迁甚至直接参与其中,根据中国国情并参照国际经验,创立了许多具有重大创新意义的经济学理论。这些经济学理论一方面源于中国改革开放的伟大实践,另一方面也对这一伟大实践起到了重要的理论指导作用。将这些经济学家独立创新的经济学理论梳理清楚,并整理出来,不仅有利于世界经济学界正确认识和理解中国经济学与中国经济学家,也有利于我们从一个侧面深入理解中国在这样一个特殊历史时期的一系列改革开放政策。

20世纪,山西经济出版社曾出版了一套《中国当代经济学家文丛》,收录了国内59位经济学家的选集,在中国经济学界产生了深远的影响。在此基础上,21世纪拟出版一套《当代华人经济学家文库》,收录全球华人中卓有建树的经济学家的代表作。与其他类似的图书相比,这套文库具有三个主要特点:一是强调理论性,即所选文章必须是理论性论文;二是强调独创性,所选论文要求理论观点鲜明,而且必须具有原创性;三是强调规范性,即所选论文的写作方式必须符合经济学研究的基本规范。

从本文库的编辑形式来看,也具有一定的独特性:首先,每篇作者

自选的论文后面都有一篇作者的自述短文或本研究领域学术权威(包括相关研究机构、学术报刊等)的评论文章,对该文的研究背景、创新意义及其学术影响做出实事求是的评论,以帮助读者进一步理解文章的学术价值;其次,不论作者创新的理论观点多寡,文章长短,著作厚薄,只要有5万字以上文字即可成书,重在原创性;最后,除文库主编(创意提出者与设计者)外,文库编委会成员皆由入选作者组成,为保证本文库较高的学术水准,每部候选著作都必须经编委会成员全数通过,方可入选。

经过近30年的改革开放,中国经济已经基本融入全球经济一体化过程之中。相应地,中国经济学与中国经济学家也正逐步走向世界。我们期待着,曾经产生过许多世界上最优秀的古代思想家的中华民族,也将在新的历史时代产生许多世界上最优秀的现代经济学家。

“人事有代谢,往来成古今。江山留胜迹,我辈复登临。”我们希望,这套文库成为当代华人经济学家贡献给历史和后人的一处独特的学术风景,为构建中国经济学繁荣与发展之大厦起到铺路石的作用。

主 编

2006年6月10日



学术小传

黄有光,经济学博士,蒙纳士(Monash)大学讲座教授(personal chair; 1985-)。1942年出生于马来西亚,毕业于槟城韩江中学(1961)、新加坡南洋大学(1966)、悉尼大学(PhD 1971)。于1971年任University of New England 讲师与高级讲师,1973年到1974任牛津大学Nuffield学院访问研究员(Visiting Nuffield Foundation Fellow),1974年任蒙纳士大学教授(reader)。先后访问过中、英、美与新加坡等地多所大学。于1980年被选为澳大利亚社会科学院士。于1986年被选为“Who's Who in Economics: A Biographical Dictionary of Major Economists 1700-1986”中的十名澳大利亚学者与全球十名华裔学者之一。于2007年被澳大利亚经济学会选为杰出学者(Distinguished Fellow)。在经济学、哲学、生物学、心理学、数学等学术期刊(包括American Economic Review, Economica, Economic Journal, Journal of Economic Theory, Journal of Political Economy, Review of Economic Studies, Social Choice and Welfare)发表两百余篇审稿论文。兴趣与贡献包括:中国经济问题,福祉经济学与公共政策,提创综合微观、宏观与全局均衡的综观分析,提创研究动物福祉的福祉生物学,与杨小凯合作发展以现代数理方法分析古典的分工、专业化与经济组织的新兴古典经济学。专著包括:Welfare Economics, London: Palgrave/Macmillan 2004 (中译《福祉经济学》,东北财经大学出版社,2005); Mesoeconomics: A Micro-Macro Analysis. London: Harvester, 1986 (中译《综观经济学》,中国社会科学出版社,1996); Specialization and Economic Organization, Amsterdam: North Holland, 1993 (与杨小凯; 中译《专业化与经济组织》,经济科学出版社,

1999); *Increasing Returns and Economic Analysis*, ed., London: Macmillan, 1998, 与 Kenneth Arrow (诺奖得主) 及 Xiaokai Yang; *Efficiency, Equality, and the Foundation of Public Policy*, London: Macmillan and New York: St. Martin's Press, 2000 (中译《效率、平等与经济政策》)(社会科学文献出版社, 2003); 《千古奇情记》(作家出版社, 1993); 《经济与快乐》, 东北财大出版社, 2000; 《金钱能买快乐吗?》(四川人民出版社, 2002); 《社会福祉与经济政策》(北京大学出版社, 2005); 《黄有光看世界》(经济科学出版社, 2005)。即将出版 *Increasing Returns and Economic Efficiency* (London: Palgrave/Macmillan, 2009) 及与张定胜合著的《高级微观经济学》(上海格致出版社, 2008)。



自序

感谢樊刚、本文库主编与山西经济出版社给我出版本书的机会。我从 1965 年在 Journal of Political Economy 发表学术论文以来,已经有 40 多年的历史。要从这许多文章中选出有代表性的 10 篇,也不容易。结果选出 10 篇,从 20 世纪 70 年代到 21 世纪,刚好每 10 年各两三篇,在时间上也有代表性。

既然每篇文章前面都写了自述,这里不必多说。文章由不同译者翻,都经过我大略看过与修改。有一些修改没有得到译者的同意,尤其是两位我不认识的译者(刘晓芳,胡芸)所译的,因为不知道如何联系译者。刘晓芳译的《东亚快乐鸿沟》发表在《信息空间》创刊号(2003 年 12 月),50~58 页。胡芸译的《从偏好到快乐》发表在 2005 年 4 月《新政治经济学评论》第 1 卷第 1 期,110~149 页。本书收集的都经过我修改。

主观上肯定是要修正,但难免有些地方反而修歪,尤其是我可能根据新加坡与马来西亚的华语习惯用法来修改,可能在国内被认为不恰当。希望译者原谅。

在我的学术生涯中,福祉经济学及与之有关的公共政策问题是我主要感兴趣的研究领域。(福祉经济学向来译为福利经济学^①。但是“福利”比较容易被误为是指“福利开支”,或被误为只限于有关物质利益的福利。把 Welfare 译为福祉,比较会被正确地理解为幸福或快乐。)本书所收集的 10 篇文章,有 9 篇是关于这方面的。中国对现代经济学的研究,近年已经有了很大的进展,但在福祉经济学及公共政策的理论基础方面,还差强人意。由于生产不是最终目标,福祉或快乐才是最

终目标,有关福祉的研究是非常重要的。希望本书的出版,能略微增加人们对这些重要问题的兴趣。

黄有光

2007 年 4 月 9 日于墨尔本蒙纳士(以前译为莫纳什)大学



目录

边沁抑或伯格森？

——有限敏感度、效用函数与

社会福祉函数 1

自述之一 23

论社会福利函数、社会排序与社会决策函数

的存在性 25

自述之二 34

第三优理论发凡 37

自述之三 48

基于典型企业的微观—宏观经济分析 49

自述之四 70

准帕累托社会改进 74

自述之五 99

钻石乃政府之至友：对仅因其价值而为人

所喜好的商品征税不会造成负担 102

自述之六 110

年老者有更高的价值:随着年龄增长生命 效用价值和货币价值的背离	111
自述之七	123
福祉生物学初探:动物意识与痛苦的进化 经济学	125
自述之八	155
东亚快乐鸿沟:对其原因与含义的推测 ...	156
自述之九	167
从偏好到快乐:通向一个更加完整的福祉 经济学	169
自述之十	205
参考文献	207

边沁抑或伯格森？

——有限敏感度、效用函数与社会福祉函数

唐翔 译

一、引言及概述

自从伯格森 1938 年的著名论文引入社会福祉函数(SWF)的概念以来,这一概念在福祉经济学中所扮演的角色虽然愈来愈重要,但基本上还是非常形式化的。典型的做法是,所有涉及人际效用比较的问题都被认为必然牵涉伦理性的考量,而被移交给一个抽象的形式未定的社会福祉函数来处理^①。另一方面,寻找一个合理的由个体偏好导出社会排序的法则的努力至今尚无结果,对于阿罗 1951 年著名论文(Arrow 1951)所揭示的社会选择悖论也依然没有解决。我们能否由一系列公认的价值判断推导出一个特定的形式完全确定的社会福祉函数呢?社会选择的悖论能不能在理论上也得到解决呢?本文试图对这两个问题作出肯定的回答。

本文使用的核心概念是有限敏感度,它反映了这样一个事实,即人类感官的分辨力不是无限的^②。举例来说,假设某人喝咖啡时喜欢加两匙糖(x 方案)甚于加一匙糖(y 方案),如果从一匙的量开始逐渐地增加糖的量,我们将达到一点 y' (比如 1.8 匙),使得该人觉察不出 x 与 y' 之间的差别。此外,可能存在另一点 y'' (比方说 1.6 匙),该人认为它与 y' 无差别,但是他可以感觉到 x 优于 y'' 。因此,给定有限敏感度,一个完全理性个体的偏好无差异可能是不传递的。

有限敏感度的概念并不是笔者首次提出的,早在 1781 年与 1881 年这个事实就分别为德勃达(deBorda)与埃齐沃斯(Edgeworth)所提

① 我(在第一章)已经阐明,涉及效用人际比较的判断并不是价值判断,而是对事实的主观判断。此外,由于这种判断与其研究领域密切相关,经济学家们较之一般人士更有资格做出这种关于事实的主观判断。

② 无限感知力假设既有悖于人们的常识,也不符合心理学研究的结果。

出。埃齐沃斯称之为“最小可感知量”(minimum sensible),并把如下命题当作是一个公理,或者用他的话来说,是“一个无从证明的基本原理”,这个命题是说,就所有人的所有形式的快感而言,“最小可感知量”即恰好可感的快乐增量都可以视作等同的(Edgeworth 1881, pp. 7ff., 60ff.)。此外,阿姆斯特朗(Armstrong 1951)对一个他称之为“边际偏好”的类似概念作了一番更为细致的探讨。在心理学领域,这一概念通常被称为“恰好可感知的差异”^①。

本文的主旨是,借助有限敏感度的概念与一个比一般帕累托标准还要弱的价值先设,以及其他一些常规的技术性假设,证明社会福祉函数应该取边沁提出的形式即个体效用的无权加总(第4节)。第5节将讨论这一结论以及上述价值先设的伦理可取性。第6节论证的是,至少从理论上讲,我们可以合理地构造出完全基数性且定义了零点的效用和福祉函数,以实现某些目的。第7节将对本章提出的若干论点略作评论。虽然我们提出的社会福祉函数应取加总形式的结论并不依赖于对单位边际无差异的数目进行度量的实际可能性,但是,我们同时提出的社会福祉函数的无权性却依赖于这一点。然而,要实际进行这种度量却面临许多困难,这包括,可能出现虚假的偏好显示,不存在可行的替代方案,以及明确引入时间因素所涉及的各种问题,这些困难以及解决它们的方法将在最末一节予以讨论。

加总形式的社会福祉函数在伦理上可能不大受人欢迎,持平等主义伦理观的人往往偏爱具有严格准凹形式的社会福祉函数,这种形式的社会福祉函数所对应的福祉等高线凸向效用空间的原点。

在下面一节,我将阐明这种对非线性社会福祉函数的偏爱一般源于我所谓的“效用幻觉”,即对富人的收入的社会价值权数作重复打折的倾向。

① 我们下面(第3节)将会看到,在通常的连续性假设下,任给某个备选方案 x ,并不一定存在一个在边际上恰好优于 x 的方案 y 。在此情况下,虽然无法适用“最小可感量”、“边际偏好”或者“恰好可感差异”等概念,但是我们可以使用与之相仿的“最大不可感量”、“边际无差异”以及“恰好不可感差异”等姊妹概念。

二、效用幻觉

经济学家们认为一般公众有货币幻觉，而他们自己却有效用幻觉。

我们只要稍微浏览一下福祉经济学方面的文献，就会发现，如果不是全部的话，至少绝大部分作者所采用的社会福祉等高线的形状是凸向效用空间原点的。如果效用函数只被当作是偏好的一种序数表征的话，那么，在某种意义上说，福祉等高线的形状无关紧要。这是因为，只要对效用函数作适当的严格递增变换，就可以将凸状的福祉等高线变成凹状的。不过，福祉等高线几乎无一例外地被作成凸状的事实一定有其原因。我认为，这个原因就是平等主义的伦理观。如果我们不仅仅把效用当作是偏好的一个序数表征，而使得它在某种意义上是基数可量且人际可比的，大多数人依然会认为穷人的一单位效用比富人的一单位效用重要。这种观点要么是基于某种对于效用平等本身的终极偏好，要么是由于“效用幻觉”所导致。

如果我们不是在一个效用平面，而是在一个各坐标轴分别表示不同个体的收入水平（比如在一组给定的产出与定价法则下）的收入平面上作福祉等高线，绝大多数人都会同意这些等高线应凸向原点。其理由是这样一种观点，即就任何一个给定的个体而言，边际的一元钱在其收入较低时与其收入较高时相比，所满足的需要更为重要。因此，随着个体收入的增加，社会赋予其边际收入的权重应不断下降。因此，不论我们是否假设个体的享受能力相同，我们导出的福祉等高线（在收入空间中）都应是凸向原点的。如果我们不仅仅把效用当作一个序数表征来使用，那么可以认为，对每个个体，收入的边际效用都是递减的。如果我们进一步假设效用是人际可比的并且个体的享受能力相同，那么在给定总收入额的条件下，不平等的收入分配会降低社会的总效用，因为如此一来较迫切的需要就得不到满足。然而，这一平等主义的伦理观点可能会被粗率地套用在效用的分配问题上。因为收入分配的不平等往往意味着效用分配的不平等，所以这两者有时被当作是一码事。于是，收入分配不平等的恶名也会连累到效用分配的不平等。

试举一个简单的例子，假设个体的享受能力相当，给定 100 元的总

收入,我们可能认为(50元:50元)的方案(即将这100元平均分给两个社会成员)优于(70元:30元)。如果我们假设上述分配方案所涉及的是效用值而非收入值,我们可能会认为(50个效用单位:50个效用单位)优于(70个效用单位:30个效用单位),理由是前者是对同一数额的总收入较为平等的一种分配方案。但是,在收入的边际效用递减且个体享受能力相似的假设下,前一种分配方案涉及的总收入一定较小。如果我们赞成对给定总收入进行平等分配的依据是收入的边际效用递减律,那么这并不表示,分配上虽较不平等但涉及总收入较大的方案一定不可取。

如果我们反对对给定总收入作不平等分配的理由仅仅是基于收入的边际效用递减律,那么认为一个分配上更为平等但涉及总效用较小的方案优于一个涉及总效用较大的方案一定是由于重复计算(或重复打折)的缘故。在收入的边际效用递减和效用人际可比的假设下,当我们以效用而非收入形式来表示一个分配较不平等但涉及总收入较大的方案时,对个体的收入已经打了折。如果对不平等的效用分配又打一次折扣,这种第二层次的打折就不能再次用收入的边际效用递减来支持。

当然,你可以坚持认为,不但收入的平等分配可取,而且效用的平等分配也是可取的,并且把这种主张当作一个无须作进一步解释的基本价值判断来持有。诚然,我们也无法证明一个价值判断是对还是错。不过,我们可以证明某些价值判断隐含另一些价值判断,或者某些价值判断含示对另一些价值判断的否定(Sen 1970a, pp.59ff.; Pattanaik 1971, pp.20-24)。在后面的几节里(特别是在第四节),我将证明,只要我们接受一个非常温和的价值先设以及别的一些合理假设,我们就应认为对给定总效用的不同分配方案是没有优劣之分的,即我们只需要关心个体效用值的总和^①。

① 上述反对效用幻觉而赞成加总式 SWF 的观点并不表示我主张对收入作更不平等的分配。诚然,莫里斯(Mirrlees, 1971)及其追随者采用边沁式 SWF 所作的最优所得税研究表明,最优的所得税累进率比现代西方国家所通行的要低得多。不过,这一结论有赖于某些假设,这些假设在给定收入边际效用递减的速率以及工作激励程度的条件下给效用函数规定了特定的形状。更要紧的是,我认为,这些研究者都忽略了个体效用对于其他人收入水平的依赖性(以简化数理讨论)。如果考虑到这个因素,边沁式的 SWF 也许并不排除较高的所得税累进率。

三、不可传递的偏好无差异与效用函数的存在性

在证明作为本文核心结论的加总定理之前,我们尚需要解决效用的表征问题。给定有限敏感度以及与之相关联的无差异的不可传递性,是否对每个个体都存在一个刻画其偏好的实值效用函数呢?此问题及相关的一些问题已有不少学者作过探究。具体来说,路斯(Luce, 1956)定义了一个半排序,斯哥特与苏普斯(Scott 与 Suppes, 1958)证明定义在一个有限集上的半排序可以用闭区间来刻画(参见 Fishburn, 1973a, p.92)。……费什本(Fishburn, 1973a, 定理 6)提供了若干用闭区间来刻画半排序的必要和充分条件,不过,这些条件涉及某些含义不是很直观的密度及可数性方面的要求。本文证明表征定理的途径是,利用关于显性偏好和显性无差异等传统概念的标准假设,来证明“隐性偏好”也必定满足某些学界所熟知的足以保证存在一个效用函数的条件。此外,如此得到的效用函数可以作适当的量标变换以满足如下约定:

约定 A: $(\forall i, \forall x, y) \{yPx \leftrightarrow V^i(y) - V^i(x) > a; xRy \leftrightarrow V^i(y) - V^i(x) \leq a\}$, 其中 a 是对所有个体都相同的一个正的常数。(证明略去, 详见拙著 Ng, 1975a, pp.548-552, 566-567。)

四、从个体效用函数到社会福祉函数

在为每个个体构造了一个相应的效用函数 V^i 之后,我们现在来推导社会福祉函数。为达此目的,我们需要更多的假设。如果我们将社会福祉定义为应当追求或者加以最大化的某个目标,那么这些假设就是一些价值先设,虽然它们可能非常弱。另外,我们也可以将这些假设仅仅当作定义一个新的概念即“社会福祉”的一些法则。后一种解释不会涉及任何价值判断,但是由此得到的社会福祉函数在不引入某些价值判断的前提下却没有任何指示性的含义。显然,我们感兴趣的是前一种解释,而本文所采用的也是这一种解释。

关于社会福祉的假设: