

知识何以可能

从经济学的关系论转向看

Zhi Shi He Yi
Ke Neng

冯燮刚 / 著



经济科学出版社
Economic Science Press

知识何以可能

——从经济学的关系论转向看

冯燮刚 著

经济科学出版社

责任编辑：初少磊
责任校对：王肖楠
版式设计：代小卫
技术编辑：邱 天

知识何以可能
——从经济学的关系论转向看

冯燮刚 著

经济科学出版社出版、发行 新华书店经销

社址：北京市海淀区阜成路甲 28 号 邮编：100036

总编室电话：88191217 发行部电话：88191540

网址：[www. esp. com. cn](http://www.esp.com.cn)

电子邮件：[esp@ esp. com. cn](mailto:esp@esp.com.cn)

北京天宇星印刷厂印刷

德利装订厂装订

850 × 1168 32 开 7.125 印张 150000 字

2007 年 4 月第一版 2007 年 4 月第一次印刷

印数：0001—2000 册

ISBN 978 - 7 - 5058 - 6160 - 2/F · 5421 定价：16.00 元

(图书出现印装问题，本社负责调换)

(版权所有 翻印必究)

图书在版编目 (CIP) 数据

知识何以可能：从经济学的关系论转向看 / 冯燮刚著.
—北京：经济科学出版社，2007. 4

ISBN 978 - 7 - 5058 - 6160 - 2

I. 知… II. 冯… III. 经济理论 IV. F0

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2007) 第 030099 号

摆脱知识的奴役，开启自由科学之门。

东西方文化的碰撞，回答知识何以可能的千古悬疑。

一本学者和求学者必读的书。

序 言

在当前中国的图书市场上，经济学书籍可谓面广量多。但是，专门研究经济学理论体系赖以构建的哲学、心理学和数学基础，或者说是从哲学、心理学和数学基础出发对经济学理论体系进行解构和重构的书籍，却少之又少。而我们现在看到的冯燮刚博士所著的《知识何以可能——从经济学的关系论转向看》正是这“少之又少”中的一本。

本书是冯燮刚博士在其博士学位论文的基础上修订而成的，虽然只有 15 万字，却历时 6 年之久（如果从冯燮刚博士最初给我提供有关研究手稿算起，应该是十多年了）。在此期间曾将有关内容以学术论文的形式在学术刊物上发表，《新华文摘》等曾将部分论文予以转载，受到一些著名的经济学家和更多的青年学者广泛的关注。正是这些关注和鼓励，使作者决定将它修订成书，尽管一些内容并不一定成熟，甚至难免存在谬误。如果能够引起更多读者的关注和研究，它的目的就达到了。

像大多数经济学理论书籍一样，本书也以对正统经济学的研究作为起点。正统经济学隐含着重要的基本假设——存在预先得到完备界定的选择集和基于其上的偏好关系，并在行为过程中保持一致。其理论体系赖以构建的基石是完全理性的自我，即在决策者和其环境之间发生的选择行为，由完全理性的自我决定。这种知识建构方式正是本书力图阐明的柏拉图—亚里士多德传统的单极化本质主义范式。行为经济学对正统经济学进行了系统的反

动，放弃了正统经济学的规范性理想，转向了描述性，由此建构了由理性和非理性组成的双系统模型，理性和非理性的自我取代了理性自我，成为行为经济学的理论基石，但因此仍然没能摆脱单极化本质主义的结构化陷阱。

正像经济学家目前所完成的大量研究揭示的那样，在人类行为中，既有人类深思熟虑的理性因素，也有人类情绪性、本能似的冲动因素，更有完全由物理背景、人文背景和历史背景激发的因素。后两方面的因素直接被决策者和环境之间的互动过程所决定。决策者和环境之间的互动无法单一地归于决策者的心理本质。试图依靠决策者本身的属性来为决策者与环境之间的互动行为提供一致的说明，这正是以主体为中心的单极化本质主义范式无法解决的一致性困难。要摆脱正统经济学身处的单极化本质主义结构化陷阱，必须迈出更为关键的一步，放弃以特定实体为中心的单极化本质主义，转向开放的、演进的关系论，立足关联互动的现实世界，以“公度性”为基本准则，在决策者和环境之间的互动过程中确定行为依据和对行为的描述框架，建构开放的、演进的经济知识体系。本书引入“关系论”术语来标识与本质主义不同的知识建构模式：不是透过现象看本质，而是在现象中、在自我和现实世界的关联互动过程中确定关系法则；不是违背公度性原则、拒绝学术竞争的封闭的、决定论的、绝对的臆构，而是严格遵循公度性原则、接受学术竞争的开放的、持续发展的建构。

本书在系统阐述了经济学的关系论转向后，进一步对计量经济学进行了研究，并给出了在关系论框架下使用计量分析工具建构经济学知识的方法框架，力图为建构关系论经济学知识体系提供可靠的路径。揭示问题、指出方向、提出途径，构成了《知识何以可能——从经济学的关系论转向看》的基本内容。

图书讲究分类。如果一定要分类，应该将本书归入哪一类？

毫无疑问，它属于“经济学”，属于经济学中的“经济学理论”，属于经济学理论中的“经济学基础理论”。为什么？由上述可以看到，本书讨论的是经济学理论体系赖以构建的基础问题。也许有人认为它属于“经济学研究方法论”，虽然有一定道理，但不是作者的本意。如果一定要将它归入“方法论”，应该是“经济学理论体系赖以构建的方法论”。当然，本书的研究并不仅限于经济学的专业领域。在本书中，对经济学“关系论转向”的专业研究和“知识何以可能”的哲学研究相互支撑，使得本书在经济学方法论和更为广义的科学方法论领域取得了重要的研究成果。

作为冯夔刚博士的指导教师，在他的论文研究过程中，我曾经与他反复讨论，也曾联名发表学术论文。但是，从问题的提出、全书的构思，到完成每一部分具体研究工作并形成文字，都是作者独立完成的。他知识面之广泛、刻苦学习与钻研之精神以及对理论研究的执着，都体现于本书的字里行间。相信读者阅读本书既是知识的探求，也是精神的享受。

李子奈

2006年9月于清华大学

幻灭的第三者（自序）

孔子东游，见两小儿辩斗，问其故。一儿曰：“我以日始出时去人近，而日中时远也。”一儿以日初出远，而日中时近也。一儿曰：“日初出大如车盖，及日中，则如盘盂，此不为远者小而近者大乎？”一儿曰：“日初出沧沧凉凉，及其日中如探汤，此不为近者热而远者凉乎？”孔子不能决也。两小儿笑曰：“孰为汝多知乎！”

人类的生活现实塑造了个体千差万异的思维视角和思维模式。光学现实塑造了一小儿的光学视角和光学模式，所以“远者小而近者大”；热学现实塑造了另一小儿的热学视角和热学模式，所以“近者热而远者凉”。太阳只有一个，但对太阳的观察却有千万种。面对诸多有坚实的现实基础、而众说纷纭的专家或非专家意见，要去伪存真，何其难也！西方哲学史上有句至今对人类思想有强大冲击力的话——“人是万物的尺度”。无论是普罗泰戈拉的怀疑论，还是康德的先验论，只要将渺小的个体——无论是圣贤的孔子还是幼稚的小儿——置于我们所建构的知识世界的中心，就永远无法解决人类关于知识真伪的分歧，人类也无法走出特定思维模式的结构化陷阱。

对真理的信仰和追求，是人类生生不息的精神动力。当这个世界不再可能有个体可资依赖的法则的时候，你将会怎样？当大部分个体都丧失了对真理的信仰和追求的时候，世界将会怎样？但是，任何人都不可能在现实或思想的真空中裁决真伪，对真伪

的辨别无法摆脱对“评判参考系”的依赖。人类关于真伪的纷争，归根结底产生于学者对评判参考系的分歧。

在漫长的文明进程中，人类文明中隐含的评判参考系有着深厚的现实基础，并随着现实世界的演变而持续演变。远古时期的自然交换经济形态，塑造了单向决定关系主导的封闭社会形态：每个个体都处于单向决定关系链条固结的封闭社会金字塔中，要么被决定（当其处于封闭社会金字塔的较低层次时），要么决定别人（当其处于封闭社会金字塔的较高层次时）。在单向决定关系主导的封闭社会中，人与人之间的关系发生割裂，稀缺的交易撮合机会限制了个体“以脚投票”的权力，求之于第三方仲裁是自然交换参与双方追求交易公平的基本方式。远古时期封闭社会的生活现实塑造了人类循着决定性链条追寻其命运主宰的思维视角。正是在这样的思维视角下，古希腊学者们隐含地引入了视觉模式关系结构假设，把自我定位于超然世外的观察者，割裂了自我与其身处的世界的关联，由此塑造了西方传统哲学中追寻第三者的本质主义思维模式。因此，在远古时期的现实生活中，交易的公平性不由交易活动本身决定，而由交易之外的第三方仲裁——行政或宗教力量——来决定。人类知识几乎完全与此同构，人类在自我和现实世界之间的互动过程中形成的知识，其可靠性也不由自我和现实世界提供，而由人类和其身处的现实世界之外的第三者——神秘的本质——来提供。

自从人类在现实生活和知识世界中引入第三者开始，第三者就一直笼罩在神秘的光环之下，但却从未摆脱过第三者悖论（为了证明较低层次第三者的合法性，必须引入更高层次的第三者，从而陷入死循环）对其合法性的致命质疑，第三者的合法性问题也因此长期成为人类现实生活和知识世界中挥之不去却又无法破解的问题，“知识何以可能”也成为人类文明史上未解的千古悬疑。

几千年以来，无论是君权神授也好，还是天子也好，都无法阻碍人们质疑以皇帝或者教皇为核心的行政或宗教体系的公正性。正是这种质疑和反抗导致专制强权在残酷争斗中交替的血腥历史。暴力机器并不足以长期维系专制强权至高无上的终极地位。同样地，以各种最高本质为逻各斯中心的本质主义知识体系的盛大与繁华也不能减弱人们对最高本质的质疑。从亚里士多德的不动的神，到中世纪天国的上帝，到康德的先验自我，到近现代各种形式的心理自我，隐身于人类文明之中的神秘的第三者的形象一直在发生变化。几千年以来，学者们呕心沥血，孜孜不倦地追寻最高本质，不断改变第三者的内涵和形象，旨在为赖以判断真伪的评判参考系提供可靠的、绝对的支点，并为人类文明提供真伪判断的绝对的终极仲裁。但是，上帝早就死了，先验自我也被现代科学的发展消解了，各种形式的心理自我则在现代哲学和本研究中丧失了合法性和必要性，学者们更没有从神秘的第三者那里找到对真伪的可靠的裁决。在近现代，自然科学放弃了绝对的、“私人性”、“本质主义”的第三者，转向了开放的、演进的关系论框架：按照“公度性”原则——符合逻辑、经验工具体系可测度——界定的研究目标和其所处的环境及学者之间的关联互动关系网络。该关系论框架随着现实世界的演变、人类的逻辑和经验能力的发展而不断演进。自然科学的学者们正是在关系论框架下，基于现实世界的关联互动确定知识依据，并据以建构开放的、演进的知识体系。随着自然科学系统地采用开放的、演进的关系论框架并迅速取得辉煌成就，裁决知识真伪的第三者——本质主义的绝对的终极仲裁——渐渐幻灭了。

伴随着自然科学在近现代的快速发展，商业文明快速兴起并推动社会形态从封闭社会转变为开放社会，选择和被选择的双向选择关系逐渐取代了决定和被决定的单向决定关系，在自然交换条件下仲裁交易公平的绝对的行政或宗教力量也逐渐丧失了绝对

性，不再是决定意义的第三者，而演变为市场交换的参与者，既是选择主体也是被选择对象。如果不能提供人类社会所需要的公平裁决等公共服务，作为仲裁者的行政或宗教力量必将迅速被开放社会淘汰。正是在优胜劣汰的社会选择过程中，作为仲裁者的行政或宗教力量向社会开放并持续演进。这样，长期在各种暴力机器维护下、以第三者身份裁决公平的行政或宗教力量——专制主义的绝对的终极仲裁——也渐渐幻灭了。

无论是本质主义的第三者——各种“私人性”、不符合“公度性”原则的实体，还是本书力图阐明的关系论框架，其作为人类赖以推断真伪的参考系，总是相对的。如果对在人类文明中无处不在、人类永远无法摆脱但却因为先入为主而易被忽视的评判参考系的相对性缺乏认识，思想就会僵化，人类文明就会固步自封。

纵观人类文明史，相对稳定的思维模式是人类应对纷纭复杂的生活问题和行为问题的强大工具，是文明进步的伟大结晶。而僵化的思维模式则是文明进步的最大敌人。从彼岸天国的“救世主”，到“上帝在我心中”，西方宗教信仰的历史转变是对人类文明史上两种主流思维模式非常形象、高度浓缩而极其准确的描述。与宗教信仰的变化相应，以笛卡尔和康德为代表的西方思想家在近代提出“认识何以可能”这一先于世界本原问题的基本问题，推动哲学完成了从本体论向认识论的转变。认识论倡导“人是万物的尺度”，旨在用“自我”取代“上帝”在人类文明结构中的终极地位，这完全不同于古希腊思想家在远古时期借用同样一句话表达的怀疑论。直到今天，至少在社会科学领域，“自我”在社会科学的知识结构中，其终极意义的中心地位仍然得以保留，正如在欧洲中世纪人类文明结构中的上帝那样占据着舞台中心。两者均是笔者力图摆脱的单极化本质主义。为了推动人类文明更加坚定地扬弃单极化本质主义思维模式，转向关系

论，认识论的基本问题“认识何以可能”也相应被替换为关系论的基本问题“知识何以可能”。把“认识”改变为“知识”，旨在使学者们认识到，以“认识者”自居而把自己定位于超然世外的第三者，割裂自我和现实世界的关系，只会使学者和人类文明陷入画地为牢的窘境。学者们摆正参与者的位置，转向关系论，向现实世界和未知世界开放，强调“知识”建构的公度性，打破依靠包括“自我”和“上帝”在内的任何绝对中心来为人类文明提供终极依据的幻相，才能走上“前有古人，后有来者”的持续发展之路。

从“世界的本原是什么”，到“认识何以可能”，再到“知识何以可能”，以及未来不可预见的变化，人类思维模式总在持续的演进中。但万变不离其宗，都将服务于人类求索真理的不懈奋斗，服务于人类生生不息的现实生活。为追求真理提供正确的思维视角和探索路径，并赖以塑造开放的、演进的思维模式和人类文明，坚定对真理的信仰，排除无谓的纷争，是笔者进行关系论经济学研究的基本出发点。

笔者对作为西方文明集大成者的经济学的研究，深深地得益于博大精深的东方文明。总体来看，东方文明比西方文明具有更多的关系论内涵，而西方文明具有更多的建构性贡献。但两者均非偏废一方，只是各有侧重而已。为使读者有所增益，并更正确地把握关系论内涵的实质，笔者将对作为东方文明集大成者的太极拳的一些理解附上。由于笔者不是太极拳的专家，才疏学浅，不免贻笑大方，但相信能够增进读者对东西方文明互补性的理解，也能增进对本研究的理解。

冯夔刚

2006年9月于北京

目 录

第1章 引 言	1
1.1 现实—学者—知识：人类文明的三重结构	1
1.1.1 交易公平性与第三方仲裁悖论	2
1.1.2 学者形象的对照和知识建构的第三者悖论	5
1.1.3 物理知识结构的对照	6
1.1.4 经济学知识结构的对照	7
1.2 本书的结构安排	9
第2章 修补完全理性：行为经济学的心理现实化	14
2.1 决策理论概览	14
2.2 主观价值判断的心理现实化	19
2.2.1 价值载体的相对性	19
2.2.2 期望价值的心理现实化	21
2.3 概率判断的心理现实化	24
2.4 信息和时间因素	27
2.4.1 选择评价的第三维度——模糊性	27
2.4.2 对时间因素的处理	29
2.5 本章小结	30
第3章 放弃完全理性：行为经济学对正统经济学 微观理论基础的解构	32
3.1 结构化效应与相对价值判断	33

3.2	偏好关系的程序依赖——偏好的引出效应	36
3.3	动态演进的偏好——占有效应	39
3.4	经济资源的不可替代性——思维会计	42
3.5	本章小结	46
第4章	放弃有限理性：经济学的困境与 行为经济学的解构	49
4.1	行为博弈论	50
4.2	社会效用	53
4.3	未知世界中的决策理论	56
4.4	情感分析	59
4.5	行为经济学在当代的综合——描述性选择 行为理论框架	63
4.5.1	直觉和推理双系统模型的基本结构	64
4.5.2	可达性启发与判断偏差	64
4.5.3	双系统选择行为理论：反射机制和适应机制	66
4.5.4	描述性转向：从完全理性到有限理性	67
4.6	重归柏拉图——经济学的困境与 行为经济学解构	68
4.7	本章小结	70
第5章	经济学的关系论转向：问题、途径与未来	72
5.1	结构化陷阱	73
5.2	心理现实化、现实心理化、现实化	75
5.3	描述性和规范性二分法幻觉	78
5.4	情感与黑熊反应问题	79
5.5	真正的不确定性	81
5.6	行为试验的局限与测不准原理	83
5.7	本章小结	85

第6章 经济学何以可能	88
6.1 正统经济学范式	89
6.1.1 作为经济原子的经济人	90
6.1.2 在经济世界中的经济原子	91
6.2 正统经济学知识的性质	93
6.3 经济学本质主义、唯理主义和经验主义的不可能	95
6.4 开放的经济学方法论与开放的经济学知识体系	98
6.5 本章小结	102
第7章 主体关系导向的计量经济学： 通向关系论经济学的途径	103
7.1 引论：计量分析的基本结构	103
7.2 经典模型：先验理论导向的计量分析	107
7.2.1 经典计量经济学知识的性质	107
7.2.2 经典计量经济学知识的依据	110
7.3 非平稳性：时间序列数据的动态结构	113
7.3.1 时间序列分析的理论基础	114
7.3.2 单整、协整与误差修正	116
7.3.3 数据关系——主体关系的影子	118
7.4 基于统计相关性的综合：动态计量经济学	121
7.4.1 衍生误差与关注参数臆构	121
7.4.2 基于统计相关性的约化	123
7.4.2.1 基于格兰杰非因果性的边缘化	124
7.4.2.2 基于外生性的约化	125
7.4.2.3 常数性、动态完整性与函数形式	127
7.4.3 动态计量经济学知识的性质	128
7.4.3.1 本质主义的关注参数臆构—— 计量分析的不归路	129

7.4.3.2 抹去动态性的动态计量经济学	130
7.4.3.3 概率结构约化数据生成过程	131
7.5 主体关系导向: 基于动力学关系的综合	131
7.5.1 计量经济学的理论基础问题	131
7.5.1.1 统计推断知识的逻辑和依据	132
7.5.1.2 因果关系界定	133
7.5.2 基于动力学关系的综合	136
7.5.3 基于中心极限定理的主体关系导向模型建构	140
7.6 本章小结	144
第8章 知识何以可能	146
8.1 引论: 西方传统哲学的基本结构	147
8.1.1 洞穴隐喻与西方传统哲学的基本问题	147
8.1.2 西方传统哲学隐含的公设体系	149
8.2 本质主义的不可能	152
8.2.1 内涵悖论与理性知识体系的完备性	152
8.2.2 因果关系问题与经验知识体系的完备性	155
8.3 关系结构的转型: 从封闭社会到开放社会	158
8.3.1 视觉模式关系结构假设的现实基础	160
8.3.2 现实基础的变化与关系结构的转型	162
8.4 现代哲学的突破与陷落	164
8.4.1 维特根斯坦分析哲学的突破与陷落	165
8.4.2 后现代主义哲学的突破与陷落	168
8.5 知识建构的关系论转向与开放的知识方法论	171
8.5.1 关系论转向: 自然科学的突破	171
8.5.2 开放的知识方法论	174
8.6 本章小结	179
第9章 结 论	180
跋	184