

社会福祉与 经济政策

黄有光◎著 唐翔◎译



北京大学出版社
PEKING UNIVERSITY PRESS

社会福祉与 经济政策

黄有光◎著 唐翔◎译



北京大学出版社
PEKING UNIVERSITY PRESS

图书在版编目(CIP)数据

社会福祉与经济政策/黄有光著;唐翔译. —北京:北京大学出版社,
2005.5

(经济学名家论丛)

ISBN 7-301-07792-0

I. 社… II. ①黄… ②唐… III. 社会福祉-经济政策-文集
IV. F061.4-53

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2005)第 033106 号

书 名: 社会福祉与经济政策

著作责任者: 黄有光 著 唐 翔 译

责任编辑: 何耀琴 张 燕

标准书号: ISBN 7-301-07792-0/F·0924

出版发行: 北京大学出版社

地 址: 北京市海淀区成府路 205 号 100871

网 址: <http://cbs.pku.edu.cn>

电子信箱: em@pup.pku.edu.cn

电 话: 邮购部 62752015 发行部 62750672 编辑部 62752926

排 版 者: 北京高新特打字服务社 51736661

印 刷 者: 北京原创阳光印业有限公司

经 销 者: 新华书店

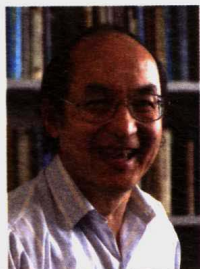
650 毫米×980 毫米 16 开本 17.5 印张 244 千字

2005 年 5 月第 1 版 2005 年 5 月第 1 次印刷

定 价: 32.00 元

未经许可,不得以任何方式复制或抄袭本书之部分或全部内容。

版权所有,翻版必究



作者简介

黄有光，1942年出生于马来西亚。1966年获新加坡南洋大学经济学学士学位，1971年获悉尼大学经济学博士学位。1974—1985年在澳大利亚Monash大学任教授（reader），1985年至今任Monash大学讲座教授。1980年被选为澳大利亚社会科学院院士。1986年成为入选**Who's Who in Economics: A Biographical Dictionary of Major Economists 1700–1986**的十名澳大利亚学者与全球十名华裔学者之一。

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、宏观与全面均衡的综观分析，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。

在经济学、哲学、生物学、心理学、数学等领域的学术期刊发表近两百篇论文。专著主要包括：**Welfare Economics**；**Mesoeconomics: A Micro-Macro Analysis**；**Specialization and Economic Organization**；**Efficiency, Equality, and the Foundation of Public Policy: With a Case for Higher Public Spending**；与 Kenneth Arrow（诺奖得主）、杨小凯合编 **Increasing Returns and Economic Analysis**。

内容简介

本书收集了黄有光教授有关福祉经济学与公共政策的理论基础研究方面的主要文章。主要观点包括：社会福祉函数（即社会最终所应该极大化的东西）必须基于个人的基数效用或福祉（即快乐），而且应该是每个人的福祉的无权总和。考虑到信息和行政成本的第三优政策与第一优政策非常接近，如果信息匮乏，则第一优法则适用。在个别问题上，应以效率挂帅，平等的目标由整体的平等政策来达致。相对收入效应使公共物品开支的最优规模比传统的公式所得出的要大。

责任编辑：何耀琴 张 燕

清水设计工作室 · 光君
COVER DESIGN QINGSHUI STUDIO — 63334841

目 录

导论/1

第一部分 经济学家在政策建议上的作用

价值判断与经济家的政策建议作用/13

第二部分 关于社会福祉的一些基本问题

效用、知情偏好抑或快乐？

——何为哈森伊之观点的逻辑终点/21

平等与效率抑或自由与公平

——一个内在矛盾/48

边沁抑或伯格森？

——有限敏感度、效用函数与社会福祉函数/69

第三部分 社会选择与效用理论

论社会福利函数、社会排序与社会决策函数的存在性/99

预期主观效用

——诺依曼-摩根斯坦效用是否就是新古典经济学的效用？/111

效用水平的人际可比性隐含效用差值的人际可比性/126

第四部分 第三优理论

第三优理论发凡/135

准帕累托社会改进/150

经济效率与平等权利/182

第五部分 公共政策

相对收入效应与公共支出的适用规模/205

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
税收负担/215

混合钻石性商品与消费者理论中的反常情形

——钻石性程度不变假设下斜率为正的补偿需求曲线/224

预算约束下的最优公用事业定价

——对两部计费法的一个探讨/232

公平、效率与财务可行性

——论公共事业尤其是市政供水的定价政策/246

导 论^{*}

本书收集了我在经济学期刊上发表的有关福祉经济学与公共政策理论基础方面比较重要的文章(1999年后发表的与其他方面的文章将收集在另外的译作中)。Welfare economics 向来被译为“福利经济学”,但是“福利”比较容易被误认为是指“福利开支”,或被误认为是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。

人们普遍认为,经济学家们就其职业身份而言,应该避免作出任何价值判断,这种看法使经济学家(乃至其他社会科学家)在政策建议上所能起的作用受到了极大的限制。在许多情况下,经济学家们不得不作出一些价值判断,但是他们通常对此深感不安。本书的第一篇文章《价值判断与经济家的政策建议作用》论述了,许多所谓的“价值判断”根本不是什么价值判断,而是对于事实的主观判断。既然经济学家们比其他许多人都更有资格作出那些与其研究领域紧密相关的对事实的主观判断,他们在这么做时就应该心安理得。如果此文观点能得到认同,经济学家所能发挥的政策建议作用就会大大加强。

诺奖得主哈森伊(Harsanyi, 1997)指出,社会福祉评价的终极尺度

* 很高兴看到本书即将出版,尤其是由才子唐翔翻译出来的。老实说,我对以前几本译作,除了高手易刚翻译的《专业化与经济组织》(杨小凯与我合著),都不是很满意。但对本书的翻译,我不但非常满意,而且是喜出望外。我于1999年在北京大学光华管理学院访问时,唐翔听我的课。我认为他是全班最好的学生,英文水平也是全班之冠,就请他替我翻译《效率、公平与公共政策》(本书出版社漏了译者的名字,特别一提),译得非常出色,所以我请他再译本书。又经过周海欧同学与我自己校对过。因此,翻译质量很高。——作者注。

应当是人们的知情偏好 (informed preferences), 而不是实际偏好 (actual preferences) 或者快乐 (happiness, 即福祉, welfare)。《效用、知情偏好抑或快乐?》一文试图阐明, 哈森伊用知情偏好来取代实际偏好的努力是不彻底的, 如果将他的逻辑贯彻到底, 我们将发现快乐才是最根本的。理由是, 纯粹对于他人福祉的关怀心理会导致主体的知情偏好与快乐发生分歧, 在此情况下, 使用前者进行社会评价就会造成重复计算。这种“关怀效应”(“concerning effect”, 或称非情感性利他主义, non-affective altruism) 不同于“关情效应”(“minding effect”, 或称情感性利他主义, affective altruism), 但可以与后者同时存在。所谓“关情效应”, 是指主体因看到或帮助他人获得快乐而自身感到快乐的心理现象。社会决策者应当考虑到关情效应而排除关怀效应。此文通过一个虚构的事例来有力地证明确实存在非情感性利他主义。正如实际偏好由于无知以及虚假偏好的影响而不能作为社会评价的最终依据, 由于人们具有种种先天或后天习得的非理性倾向, 比如对于未来的福祉不够重视, 以及追求生物适应性最大化而非自身福祉最大化的本能, 我们对知情偏好也必须同样打一个折扣。不过, 我认为哈森伊先前关于效用主义 (utilitarianism, 一般译作功利主义) 的结论是正确的, 并就过去发表的反对意见替它作了一个辩驳。

中国长期实行城乡居民隔离制度。这种制度显然是有悖于公平和自由的原则的。多年前, 一位中国学生为这一政策辩护说, 如果不实行城乡隔离, 那么农村人口就会涌入城市, 形成无法收拾的局面。我回答说, 之所以会这样, 就是由于城乡隔离政策, 加上政府在工资与价格政策上以及社会服务的供给上采取了拉大城乡生活水平差距的做法 (这一做法在 20 世纪 80 年代初及最近几年有所扭转)。此外, 还因为中国农村经济发展速度不够, 无法合理地吸收过剩劳动力。

第二天, 我对这个问题进行了仔细的思考, 以确保我的答案无误, 结果我却对自己的观点产生了怀疑。虽然它能说明问题的大部分, 但也许不是全部的答案。假定交易成本与报酬递增等因素使城乡生活有显著的差异, 即使在价格、收入、社会服务与经济发展等方面采取理想的政

策,包括实现城乡居民收入的边际社会福祉价值相等这一平等条件(即使抽象掉税收对激励的打击而使这条件成为可能),我们也无法保证城乡人口的自由流动不会造成城市人口过度密集的结果。有人会认为,也许可以通过适当的税收/补贴方案来使城市的人口密度保持在可以接受的水平,不过这种方案可能会导致边际城市人口的收入过低,以至于无法满足平等条件。

中国由于城乡隔离政策与农村发展不够等原因,城市居民的收入大大高于农民,人们很难想像城市(而非农村)人口的收入过低的可能。考虑像印度这样有自由选择的情形,如果忽略搬家的成本等因素,则同样能力的人居住农村与城市的效用相等。但城市有较多的工作与娱乐机会,吸引人们入城。不过,多一个人进城,不但增加拥挤与污染,而且降低其他类似人们找到工作的或然率(当失业是一个问题时)。如果根据总外部成本向他们课税,以达致效率(城市人口不会太多),则可能会导致这些边际城市人口的收入过低,不但无法满足平等的条件(每个人收入的边际社会福祉价值相等),甚至可能会有饥饿等不人道的情况出现。

自由与公平的要求是,在边际上,个人认为在城市和在农村居住是无差异的(即两者总效用相等,不会有更多人要入城),而平等则要求城乡居民收入的边际社会福祉价值相等(使收入的人际无成本重分配不会增加社会福祉),这两个条件只有在偶然的情况下才会同时满足。这两者可能总是会发生冲突,因为即使在收入相等的条件下绝大多数人也会选择在城市中生活,而且城市居民能从消费中取得更大的效用,除非城市变得如此拥挤,以至于足以抵消其好处,但这又使效率很低下。这种效率与平等和自由与公平之间的冲突,我简称为 E-F 冲突(从英文的 Efficiency and Equality versus Freedom and Fairness 得来)。这种冲突在强制性兵役问题上,尤其明显,详论见《平等与效率抑或自由与公平——一个内在矛盾》一文。(参看《经济学家茶座》第 19 辑的拙著)

《边沁抑或伯格森?——有限敏感度、效用函数与社会福祉函数》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,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总和,并讨论这

一结论以及上述价值先设的伦理可取性,而且论证了,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。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,以及明确引入时间因素所涉及的各种问题,此文也讨论了这些困难以及解决它们的方法。

只用个人序数效用的伯格森-萨缪尔森式的社会福祉函数(Social Welfare Function, SWF)已经成为福祉经济学的标准分析工具,《论社会福利函数、社会排序与社会决策函数的存在性》一文(与 Kemp 合写)的主要目的却是要对这种社会福祉函数的存在性提出质疑。如果个人偏好组合的多样性足够大,并且社会备择状态集满足一些较弱的条件,那么就不可能找到一个普遍适用的伯格森-萨缪尔森式的社会福祉函数,以“合理”地由个人偏好排序导出社会排序。简言之,对于伯格森-萨缪尔森式的社会福祉函数,存在与阿罗式的社会福祉函数极为相似的不可能性结论。但是,这并不意味着社会福祉函数这一概念本身应该被取消。对于任何希望充当伦理观察者的人来说,只要他接受基数个人福祉值及其人际可比性,他就可以构造出一个社会福祉函数,作为方便其社会评价的工具。

《预期主观效用——诺依曼-摩根斯坦效用是否就是新古典经济学的效用?》一文利用一系列不比证明诺依曼-摩根斯坦(Neumann-Morgenstern)预期效用假说所需假设更强的公理,以及有限敏感度原理证明,与某些著名经济学家所持的观点相反,通过 N-M 方法导出的效用函数正是新古典经济学的主观效用函数。这一结论涉及效用的可量性和社会选择等诸多问题,因为社会选择的依据是主观效用。此文还就个体的风险厌恶心理与社会福祉函数形式之间的关系,以及“纯粹”风险厌恶是否理性的问题作了探讨。

一般认为,效用水平的人际比较(比如在适用罗尔斯的最小最大化原则时就需要进行这种比较)并不涉及效用差值的人际比较(后者需要用到基数效用)。这就是说,如果我们只限于进行效用水平的人际比较,就没有必要引入基数效用。《效用水平的人际可比性隐含效用差值的人

际可比性》一文证明,在一些非常一般的条件下,效用水平的普遍人际可比性蕴涵着效用差值的人际可比性(即效用单位的人际可比性,如果采用适当量标的话)。因此,认为单凭序数效用就足以进行效用水平的人际比较的看法是不能成立的。

福祉经济学的绝大多数分析都有一个简化假设,即第一优条件成立,或者至少“在经济的其余部分”是如此。但是,所有的经济学家都知道现实经济中充满了各种各样的扭曲。根据次优理论,即使只存在一个无法消除的“次优类型”的扭曲,也会导致经济中的所有部门偏离第一优法则。这是不是意味着任何基于第一优假设的分析都是无用的呢?

要解出次优解,不但需要知道相关的目标函数和约束函数的一阶导数,还需要知道其二阶导数。显然,在存在多种扭曲的现实经济中,要取得次优条件下的最优值,信息和行政的成本都太过昂贵。次优解通常被称为“最优可行的”,但是,如果我们考虑到信息和行政成本,它实际上既不是最优,也是不可行的。真正的最优可行解被我称为第三优。有些出人意料的是,我的第三优理论表明基于第一优假设的分析并非是无用的,这是因为,正如《第三优理论发凡》一文所论述,第三优政策与第一优政策非常接近,并且肯定没有次优政策那么复杂。如果信息匮乏,则在第三优世界适用第一优法则。

帕累托原则被普遍认为是社会福祉改进的一个充分条件。如果某种社会变革的结果是有人受益而无人受损,那么似乎找不到什么理由来反对这种变革。然而,在现实世界中,如果不是全部的话,至少绝大多数社会变革的结果是有些人受益而有些人(不论其人数如何之少)受损,因此帕累托原则本身的实际利用价值很有限。在《准帕累托社会改进》一文,我提出一个有望获得普遍接受的超越帕累托原则的福祉标准,其实质是将著名的卡尔多-希克斯-西托夫斯基双重补偿试验加以修正,要求它对每个群体(通常是按收入水平划分的群体)都成立,从而使它可以克服来自社会分配方面考虑的主要批评意见(例如,劫贫济富的社会变革通常不会被人们当做一件好事)。如果将这一标准跟关于平等与激励问题的第三优理论结合起来,我们就会得出一个非常有力的原理,即应当

对所有收入群体的单位货币收入都一视同仁的“一元即一元”原则,这就使一般意义上的(对于社会变革、政策等的)经济评估,而尤其是成本效益分析大为简化。即使在涉及次优因素及其他复杂因素的情况下,也应当将平等与效率两方面分开来处理。

《经济效率与平等权利》一文论述了,背离经济效率原则的两个最重要的理由是程序偏好和所得税体系失效。随着经济效率原则,特别是上段所述“一元即一元”观点得到越来越多人的理解与支持,程序偏好的重要性也许会降低,但是它不大可能消失。随着一个国家在法制、自觉纳税意识和税收监察方面的发展,其所得税体系的效力也许能有很大程度的提高,于是再分配目标就可以较少地依赖有损效率的政策来实现。到那时,经济效率计算的支配领域就可能相应地得以扩展。有许多人为那些本来排斥交易与经济计算的领域不断地被经济帝国所吞并而哀叹,然而,照此文的分析来看,这很可能是一个值得庆贺的过程的标志与结果。

《相对收入效应与公共支出的适用规模》一文论述,由于相对收入效应(即个人的福祉不但取决于其绝对收入水平,还取决于其本人收入与其他人收入的相对水平)的存在,公共物品开支的最优规模可能比传统的 $\sum MRS = MRT$ 公式所得出的结论要大。相对收入效应的存在意味着公共支出的帕累托最优水平应该比传统结论更高这一点似乎是一目了然的。纯公共物品的益处是每个人都能享受的,因此,就衡量相对收入效应的目的而言,它似乎可以被排除在个人独有的私人收入之外。用于提供私人物品的资源在给该私人物品的消费者带来益处的同时,还通过相对收入效应给他人造成了外部成本;而公共支出没有这种负外部性。因此,相对收入效应的存在会降低私人支出的最优水平。

更严格的分析表明,这个问题并不是这么简单。私人物品为消费者提供的效用不仅来源于其固有的消费功用(例如食物能解除饥饿感、为身体提供能量,等等),同时也来源于相对收入效应,因为它们提高了该个体的相对收入。因此,相对收入效应一方面固然增加了私人物品的外部成本,但在另一方面也增加了内部收益。因此,相对收入效应并不一

定会降低私人支出的最优水平和提高公共支出的最优水平。但是,通常所采用的估测最优公共支出规模的办法(利用 $\sum MRS^i = MRT$ 或者 $\sum MV^i = MC$)却可能导致非最优的结论。在比较公共支出与私人支出的边际效益时,对后者(即私人支出的边际效益)的估计很可能同时包括了私人物品的固有消费效应和内部即直接的相对收入效应(因为这两种效应之和构成了个人对一件私人物品的效用评价),却没有包括外部或间接的(通过导致他人相对收入下降而引起的)相对收入效应。

诚然,如果进行公共决策的个人或中央当局完全理性且具有完备的信息,又能领会此文的要旨,就不会发生这种错误,但是我认为眼下各国决策机关的实际情形距离这一理想还太远。随着一国人均收入的提高,相对收入效应相对于固有消费效应将变得越来越重要,因此,在估算最优公共支出水平时出现的上述偏差也会越来越严重。各国公共支出在国民收入中所占的巨大比重引起了普遍的忧虑。但是,考虑到上述偏差,我认为这种忧虑的理由是不够充分的。由于公共支出在不同项目之间不太可能分配得恰到好处,公共物品的提供也不太可能做到没有一点效率损失,人们可以轻易地找出浪费和供给过剩的例子来,即使公共支出的总规模并没有过度。不过,一旦你考虑到那些公共物品的提供非常不足的领域,那种认为现今各国公共支出规模已经过大的论调就不再那么令人信服了。(这并不表示现在属于公共部门的某些领域不能被转给更有效率的私人企业来经营。)当然,要衡量公共支出的适用规模,还需要考虑到其他许多因素(包括国有企业可能出现的效率低下、政府部门的扩张行为,以及税收负担,等等)。(参看 2003 年 *Social Choice and Welfare* 上的拙著:“From preference to Happiness”,中文译文将收集在《社会福利与经济政策》第二辑。)

绝大多数经济学家认为,税收(矫正性税收除外)不但会造成一个与税收等额的负担,而且会扭曲个体的选择而造成超额负担,这尚不包括税收的行政、奉行和稽查成本(以下不严格地统称为交易成本)。没有超额负担的定额税仅仅是一种理论上的可能。然而,《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税收负担》一文论述,至少有一类这样的商品,对它们征税非但不会造成超额负担,而且根本不会造成任何负担(此处我们对交易成本忽略不计)!这种说法听起来像是天方夜谭,其实它的道理却非常简单,只要你认识到有些商品为人们所需要的原因并不在于其固有的消费功用,而是在于其价值。对这类商品征税无疑会提高其价格,但是消费者可以减少消费量以维持其总价值不变,因而不会蒙受任何效用上的损失。因此,对这类商品征税不会有任何负担,更不用说超额负担了。例如,如果钻石的市价上涨一倍,以一颗价值一万元的钻石馈赠他人依然会被当做价值一万元的礼物收下,尽管钻石的重量相应地减小了。钻石性商品的价格变动对其自身的价值和其他所有商品的消费量没有影响,因而对消费者的效用水平也没有影响,因此最优的政策是对钻石性商品课以任意高的税收,因为这种税既不会造成负担也不会造成超额负担。一个附带的推论是钻石性商品的需求曲线是一条处处价格弹性为1的矩形双曲线。

《混合钻石性商品与消费者理论中的反常情形——钻石性程度不变假设下斜率为正的补偿需求曲线》一文论述,对混合钻石性商品(mixed diamond goods,指那些部分是由于其固有的消费功用,部分是由于其市场价值而带给人们效用的物品),即使我们对收入的边际效用的变化忽略不计,要对消费者剩余作出正确的估计,也必须用固有边际效用占总边际效用的比重对马歇尔度量(Marshallian measure)予以打折。遗憾的是,即使在理想的信息条件下,也无法由市场统计数据直接求得这一比重。罗伊等式(Roy's equality,也称罗伊恒等式)在钻石效应存在的情况下也不能成立。更令人惊讶的是,不具有任何劣等品性质的混合钻石性商品,其需求曲线竟然可能斜率为正,即使我们假定其钻石效应的程度保持不变。人们对混合钻石性商品的消费可能达到这种程度,以至于其固有的消费效应为负,这就使得负担(而不是超额负担)为负的税收成为可能。这是否是天方夜谭?请看一个例子。A先生请B女士共进晚餐,目的是要给B女士留下一个深刻的印象,使她愿意与自己共度当晚余下

的时光。菜价越高,目的越可能达到(交换价值影响效用部分),然则需要迟睡,需要吃更多(消费量影响效用部分),因而可能多叫菜。需求曲线可能是向上倾斜的。而且,如果喝酒是为了展示经济能力,而不喝完会被认为是浪费,则有人会喝酒喝到伤身的程度。酒价上升,这些消费者的效用反而提高(减少伤身)。

最优两部计费所要解决的问题是:在总收入必须等于总成本外加某一给定的利润额(该利润额可以为负)的预算限制下,单位价格应该比平均成本低多少,以及在此价格下所必须征收的执照费的数额。相当多的学者似乎不假思索地认为单位价格应该等于边际成本。这种观点之所以不能成立,是因为以边际成本作为单位价格的两部计费会将某些潜在的用户排除在外。虽然将单位价格定得高于边际成本就其本身来看似乎有损效率,但是在给定预算约束的前提下,这就使我们可以相应地降低执照费,从而减少被执照费的门槛排除在外的用户。《预算约束下的最优公用事业定价——对两部计费法的一个探讨》一文对单位价格与执照费之间的最优平衡进行了探讨。一个有些出乎意料的结果是,如果边际用户的消费量大于平均消费量,那么最优单位价格可能低于边际成本。可能导致这种结果的一种情况是,大量的次边际用户是小用户,并且其需求曲线非常陡峭,这样就拉低了平均消费量,而消费量较大的用户则具有较为平坦的需求曲线。在此情况下,由于边际用户都是大用户,他们对单位价格下降就比对执照费的降低更为敏感,于是,最优方案可能要求用单位价格低于边际成本来吸引这些边际用户,以取得他们缴纳的执照费。不过,尽管有上述可能,更有可能的情况依然是单位价格高于边际成本。

《公平、效率与财务可行性——论公共事业尤其是市政供水的定价政策》一文论述,公共企业制定价格与投资政策应该以效率为准绳,这是因为通过一般性政策来调节收入分配能更好地实现公平目标。按短期边际成本定价并不一定会造成长期赤字,不过,如果投资规模较大且需求呈上升趋势,那么这种定价策略就会形成一轮轮的价格及盈余/赤字

周期,因为价格一方面受到需求抬升的作用,另一方面又随着生产能力的逐次扩大而下降。考虑到政府税收的稽征成本与整个经济中大致的平均价格成本比,这种第三优的定价政策可能会形成长期盈余,从而对公平、效率与财务可行性这三重目标的兼顾效果比人们一般所认为的要好得多。这一结论尤其适用于市政供水,因为从历史经验上看,新增供水能力的成本是递增的。

黄有光

2005年4月22日于莫纳什大学