



复旦大学新政治经济学研究中心
新/政/治/经/济/学/研/究/译/丛

M 政治经济学模型

Models of Political Economy

[芬] 汉努·努尔密 著
赵钟宜 王政之 译

复旦大学新政治经济学研究中心
新/政/治/经/济/学/研/究/译/丛

*M*odels of Political Economy

政治经济学模型

[芬] 汉努·努尔密 著
赵钟宜 王政之 译

格致出版社  上海人民出版社

图书在版编目(CIP)数据

政治经济学模型/(芬)努尔密(Nurmi, H.)著;
赵钟宜,王政之译. —上海:格致出版社:上海人民出版社,
2010

(新政治经济学研究译丛)

书名原文:Models of Political Economy

ISBN 978-7-5432-1813-0

I. ①政… II. ①努… ②赵… ③王… III. ①政治经济学-
经济模型 IV. ①F0

中国版本图书馆CIP数据核字(2010)第148596号

责任编辑 谷 雨

美术编辑 路 静

· 新政治经济学研究译丛 ·

政治经济学模型

[芬]汉努·努尔密 著

赵钟宜 王政之 译

出版 世纪出版集团 格致出版社
www.ewen.cc www.hibooks.cn
上海人民出版社

(200001 上海福建中路193号24层)



编辑部热线 021-63914988

市场部热线 021-63914081

发行 世纪出版集团发行中心
印刷 上海书刊印刷有限公司
开本 635×965毫米 1/16
印张 15.25
插页 2
字数 219,000
版次 2010年11月第1版
印次 2010年11月第1次印刷
ISBN 978-7-5432-1813-0/F·314
定价 28.00元

前言

模型有各种类型。有的模型用来描述一个对象、过程、系统或其他事物的简化形式。事物的简化形式至少在一定程度上取决于构造模型的人。有的模型具有更多的数学性质,有时它们被用来作为一个计算装置,例如在试图测定通货膨胀 1% 的增加量将对失业水平造成多大影响的时候。用于思维的模型和用于制定解决方案的模型是有区别的。前者的结构相对约束条件较少,用来分析、解释和预测正在发生的事物。而后者多被用来作为制定政策的工具。政治经济学为了研究政治学 and 经济学之间相互作用的现象、结构和过程,将同时使用这两种模型。在典型的情况下,制定方案的模型是思维模型的加强版本,因此在作为介绍性质的本书中,我们将把注意力集中于简单一级的模型。换句话说,我们将集中精力于着重描述和分析个人、机构及组织间相互作用的模型。

本书可作为政治经济学建模的初级教材。我试图在书中尽量保留模型的方法细节,并且着重于对不同模型的方法及其基本原则做相对宽泛的总览。至于要独立理解本书所需的数学能力,只需达到高中水平就够了。在第 8.7 节中我们利用了连续函数的一些结论,但即便如此,不懂微积分也不会对理解产生障碍。

本书可作为学时为一学期的政治经济学课程的教科书使用。由于本书是对模型的介绍,因此将会和对于政治经济学更实质性的介绍很好地相互匹配。

在写作相对较长的时间里,我得到了许多人和机构的热心协助,我

很高兴能够在此对以下的人和机构表达我真诚的感激：图尔库大学的同事 Hannu Salonen 和 Matti Wiberg 检阅了我的手稿并指出了早期版本中的一些错误；Tommi Meskanen 给了我类似的帮助，并且设计了第 6.4 节中的计算算法；我的研究助理 Juha Helin, Elina Kestilä 和 Maria Suojanen 仔细阅读了我的手稿并提出了一些改进措施；Antti Pajala 对手稿的一些部分给出了他的建议；还有 Rob Langham 和 Terry Clague 的鼓励和支持。本书能得以出版，还要归功于我所在的图尔库大学和芬兰科学院。

汉努·努尔密
(Hannu Nurmi)

目录

第 1 章 导论/1

1.1 建议阅读材料/6

第 2 章 我们的目标是什么? /7

2.1 解释政治经济学/7

2.2 建立理论/11

2.3 模型/13

2.4 解释工作/15

2.5 规范模型和实际模型/16

2.6 建议阅读材料/18

第 3 章 理性经济人/19

3.1 假设在理论中扮演的角色/19

3.2 理性的各个方面/23

3.3 确定性情况下的选择/25

3.4 风险情况下的选择/29

3.5 不确定情况下的选择/33

3.6 理性行为的公理/37

3.7 建议阅读材料/46

第 4 章 受到抨击的经济人/ 48

- 4.1 经典悖论/ 49
- 4.2 预期理论/ 56
- 4.3 一些更进一步的例外情况/ 60
- 4.4 建议阅读材料/ 64

第 5 章 博弈:描述及方案/ 66

- 5.1 博弈、博弈的形式和战略/ 67
- 5.2 战略和博弈的扩展式/ 71
- 5.3 方案/ 75
- 5.4 子博弈和颤抖/ 85
- 5.5 特殊的博弈/ 89
- 5.6 声誉造成的区别/ 104
- 5.7 对信息质量的依赖/ 108
- 5.8 两人博弈理论所扮演的角色/ 111
- 5.9 建议阅读材料/ 114

第 6 章 讨价还价与合谋/ 115

- 6.1 古典解决方法/ 115
- 6.2 稳定性,核心和讨价还价集合/ 122
- 6.3 N 人博弈值/ 127
- 6.4 在欧洲机构中的应用/ 131
- 6.5 力量和偏好/ 134
- 6.6 建议阅读材料/ 137

第 7 章 委员会的决策制定/ 138

- 7.1 基本概念/ 138
- 7.2 聚集意见/ 139
- 7.3 新系统,新赢家/ 141

- 7.4 旧时代委员会投票理论/ 143
- 7.5 Condorcet 直觉问题/ 148
- 7.6 投票程序/ 149
- 7.7 选择步骤和绩效标准/ 154
- 7.8 两个社会选择理论/ 155
- 7.9 博弈投票/ 157
- 7.10 建议阅读材料/ 163

第 8 章 选举的设计和公共产品的提供/ 164

- 8.1 多数人规则/ 165
- 8.2 多数人和相对多数/ 168
- 8.3 单个可转移投票/ 170
- 8.4 配额和除数方法/ 173
- 8.5 什么的比例? / 175
- 8.6 一般性设计问题/ 177
- 8.7 最优化公共产品提供/ 179
- 8.8 建议阅读材料/ 184

第 9 章 什么样的政府? / 185

- 9.1 作为匪徒的州/ 185
- 9.2 合理的州/ 188
- 9.3 重新分布和寻租/ 190
- 9.4 建议阅读材料/ 192

第 10 章 政策评估方面/ 193

- 10.1 决定标准的数量/ 194
- 10.2 大多数,位置,权重/ 194
- 10.3 选择设定的改变/ 196
- 10.4 到目前为止的情况/ 197

4\政治经济学模型

- 10.5 多一个标准也无妨,真是这样的么? / 200
- 10.6 整体和部分/ 202
- 10.7 投票者与标准无异/ 206
- 10.8 建议阅读材料/ 207

第 11 章 理性经济人:我们是否应该放过他? / 208

注释/ 211

参考文献/ 216

第 1 章

导 论

本书探讨的是理解政治、社会和经济生活所需要的工具。按照一个广泛认同的观点,我们的主题政治经济学在 18 和 19 世纪成为了一个独立的研究领域,换句话说,这门学科早在系统的现代学科分类之前就已存在。政治经济学早期的实践者更多的是伦理学家而非经济学家和政治学家。经济学、社会学和政治科学从包罗万象的哲学中分离出来还是许多年前的事了,这可以追溯到亚当·斯密和大卫·休谟完成对政治经济学的构想之时。在亚当·斯密 1776 年的那篇经典的论文中,他是如下定义政治经济学的:

政治经济学,被视为一门关于政客和立法者的学科分支,提出了两个清楚的目标:第一是为人们提供丰富的财政收入和谋生之道,更确切地说是使人们能够为自己提供出这样的财政收入和谋生之道;第二则是提供给国家和政府一个足够用于公共服务的执政者预算。其目的是要使人民和执政者都能够富足。

大约 70 年之后,James Mill 采用了一个类似的定义:政治经济学对于政府的意义如同家庭经济对于家庭的意义……政治经济学有两个

宏大的研究对象：全社会的消费及消费所依赖的供给。

斯密的定义以一种与早期的现代政治学文献类似的方式表述。科学活动的主要任务是辅佐统治者 (Skinner, 1978)。现代政治学的起源可追溯至 15 和 16 世纪皇室家族中王子的辅导课程之中, 这些课程是为了教导他们寻求美德与崇高。以斯密的观点来看, 政治经济学的任务是为了辅佐统治者使其臣民安居乐业, 并且提供必要的手段来确保如今被称为公共部门的机构的运转。在 Mill 的定义中, 政治经济学和家政学的区别在于行为而非其行为。两者中经济好坏都决定于消费和需求供给的满意度。

经典的观点基本上相当于将成功的家政原则拓展到一个新的领域, 即政府事务。政治经济学被视为治国之道中的一个重要方面。关于消费和其所要求的供给的决策决定了看待相关行为人的运作和组织的角度。除了对治国之道的强调, 古典时期的作者并未对统治者这一角色做太多描述。从政府角色独立出来后, 私有经济行为人 (消费者、生产者、商人等等) 的目的被假定为追求其整体的利益最大化。因此, 市场就被假设能够同时为政府和人民的利益进行自我调节。事实上, 传统的作者都避免在政治经济学中谈论“政治”。

这一方法受到了马克思的强烈反对, 他十分质疑古典观点中包含的进化机制。亚当·斯密主张市场的产生是行为人追求利益最大化的结果, 并且市场可以被视作实现这一追求的手段。马克思质疑了这一理论的“arrow of casualty”, 即对个人利益的追求导致了称作市场的经济结构 (Marx, [1939]1973)。在马克思看来是经济结构和生产关系共同决定了个人的利益, 而生产关系又是由生产力的发展所决定。马克思的分析方式涉及的政治经济学范围非常之大, 更重要的是, 社会的阶级结构在此被视为政治经济学中必不可少的一部分。

在将经济视为社会的一个可分析的独立子系统方面, 新古典主义的政治经济学观点与古典主义相同, 但是加入了新的哲学和技术方面的元素, 即在解释经济的运作时加入了用功利主义和边际效用衡量经济行为基础的方法 (Caporaso and Levine, 1992: 79~99)。随着用效用来表示结果以及产生此结果的行为, 政治经济学的研究从古典意义上的范围扩大到几乎所有的人类行为。

在 200 多年的历史中,政治经济学的概念因此而获得了几种完全不同的含义。当然大部分的定义都是关于两个性质上完全不同的社会子系统,即政治性的和经济性的是如何相互作用的。因此使用这种定义作为兴趣的焦点来概括政治经济学这一概念的适当范围似乎是可行的。然而不幸的是,政治学同样有多方面的概念,在不同的时期和地方,政治学代表着政府、权利、公共事务、稀缺资源分配和管理冲突的治理艺术(例如,Heywood, 1997:4~12)。

同样,经济的概念也有几种意思。其不但可以作为一般性用语,而且也可以作为极为权威的政治经济学教材中的用语。斯密的古典政治经济学强调的是将经济从政治中分离出来,前者似乎和市场及市场交易者的行为更有关。但是斯密的经济学除此之外还有另一个意思(在马克思的经济学中同样是),从这种意思上说,经济学包括了市场活动的特殊类型,即那些和商品生产与服务有关的活动(Caporaso and Levine, 1992:24),生产和交换因此是经济学的最基本特点。经济学还有一个更为宽泛的隐含之意,它和经济活动潜在的推理性有关。正是这样的慎重和精明使得其成为经济学(Caporaso and Levine, 1992:21~24)。将慎重融入经济学的是成本与收益的重要性和手段到目的的适用性,经济学在这个意义下可以很显然地延伸到远大于生产和交换的范围。

即便经济学的概念很少受争议,但由于人们对政治学的理解千差万别,以至于很难描绘出作为两门合理定义的子系统的结合的政治经济学的研究范围。一个更有前景的方法也许是将注意力集中于政治经济学涉及了哪些种类的行为和活动。Caporaso 和 Levine(1992)在对政治经济学不同的观点中看到了共同的核心,即满足需求的系统方式。这显然同时包括古典和新古典的观点,甚至马克思经济学的概念也包含在这一抽象的描述范围之内。另一方面,满足需求的系统方式可能包含那些我们不愿将其归入政治经济学的方面,比如,一个家庭可能会建立一个“系统”,允许吸烟者在指定的房间里放纵一把,这样可以在不剥夺吸烟者短期快乐的前提下最小化不吸烟者的不便。虽然这一系统毫无疑问与需求满足有关,但它从直观感觉上却不包含于政治经济学中,原因是例子中讨论的系统并不是公共性的,而这正是政治的主要方

面。因此,虽然需求的满足这一概念体现了政治经济学的重要因素,但在提供一个好的定义方面却太过宽泛而不能成为一个好定义。

在本书中我们采用了一种对政治经济学的描述方式,这种方式主要依赖于我们上面所提到的经济学概念中的一个,即强调行为下潜在的推理的方式。我们应当将政治经济学定义为在公共领域中,从手段到目的的推理在行为方式中的应用,换句话说,我们可以在经济或政治行为人在政治经济生活里所诉诸的算计中看到这个定义的特点。如果能理解这层含义,就自然会认为政治经济学的概念应该包括公共选择理论(Mueller, 2003:1),后者通常被定义为经济推理在非市场环境下的应用,特别是在政治决策方面。因此,从本质上说政治经济学比公共选择理论在应用相似的推理于经济学和政治学时的范围更加广大,但我们的主要关注点使得公共选择理论和政治经济学之间的差别变得相对不那么重要,因为重点是以经济学的方式进行推理,在我们的分析中它被应用于政治学还是经济学这一点是次要的。

将经济推理的方式拓展到非市场环境中是非常有诱惑力的,这主要是因为推理的原理可以用简洁的方法表述。对于这些原理的具体说明和分析是理性选择理论的首要贡献,这个理论的开端处主要将精力集中在比较稳定的环境下设置行为的原理。因此在古典政治经济学中,市场中的利润最大化被视为理性行为的重要例证,与此同时斯密及其后继者们探讨了市场作为制度的性质。当今的政治经济学不仅对市场行为的原则感兴趣,而且同样关心人类行为的其他领域中的类似原则,当然制度的性质与行为的原理一样受到了很大的关注。这是如下情形的自然结果,即我们观察到在不同制度环境中对理性所赋予的准则不同。行为的某一给定类型也许会在一定的制度环境下产生合意的结果,但在其他制度环境下却不然。因此如果我们的兴趣集中于确保某一类结果的类型,就必须同时考虑主要的制度和可能伴随的行为原理。实际上,从获得某一确定行为类型的可能性的角度考虑,我们可以在由目的到手段的意义下讨论那些合理的制度。因此理性原理可以在一定条件下扩展到制度和行为原理的情况中。

我们的讨论将如下进行:在下一章中我们会介绍一些自然科学中的基本概念,以此说明政治经济学的最新研究是如何同科研最共同的

目标相联系的。虽然政治经济学可以被视为一门自成一体的完整学科,但用标准的自然科学语言来表述其研究或许更加合适。接下来一章介绍政治经济学的基本行为人(agent),即理性经济行为人(homo oeconomicus)。理想的行为人是政治经济学的基本要求,例如在新古典主义的方法中,研究的主体对象抽象为在不同类型的约束条件下进行选择的结果。而选择又被视为精确计算后的结果,即一般所说的决策(decision making)。这样的讨论是基于消极环境这一假设之上的,而这却与政治经济学选择环境的直观看法相悖,因此后一章介绍了其他合理的行为人,并且概括介绍了现代政治经济学的最主要工具之一——博弈论的基本元素。

集体决策理论(group decision theory)可以看成是博弈论在集体成员作出一致决策时的一个拓展,例如公共品的供给。然而,这一理论却基本上是独立于博弈论而产生的,并且构成了一个连接市场行为和机制设计的桥梁,这两个主题将在不同章节中介绍和分析。在公共选择的评价和正义理论(theory of justice)的章节,主要讨论了博弈论和集体选择理论在政治经济学中的基本应用,前者利用了其他领域的结论,特别是来自多重标准决策理论(multiple criterion decision theory)以及总量理论(the theory of aggregation),而正义理论则介绍了新的概念给政治经济学理论,即与公正(fairness)有关的概念。虽然大部分博弈和决策的理论文献强调效率,但将公正考虑进政治经济学的制度设计和评价显然也很重要。

本书中的一个关键概念是决策。政治经济学由结构、事件、发展和模式构成,在这些构成中,人们的决策扮演了重要的角色,因此关于政治经济学模型的书必须主要关注于分析决策的基本元素。我们必须首先将焦点集中于稳定且独立环境中的决策,以此来熟悉基本的用语和重要的行为标准,因此第一个模型是关于一个积极的行为人的,即决策者(decision maker,简写为DM)积极的使用可行的手段设法达到特定的目标,接着我们通过介绍其他有相似或不同目标及选择的行为人来讲解策略环境。在集体选择环境下新的元素是选择所属的制度框架,策略行为人在具体的制度约束下进行决策,在这种情况下我们便有了构建政治经济学模型的基本工具。最后一章中,我们将这些工具扩展

到制度也在变化(或进化)或可以为某一目的而人为设计的设定情况下。

1.1 建议阅读材料

除了已提及的 Caporaso 和 Levine(1992)的教科书,还有一些旨在涵盖政治经济学的整个领域的论文, Hillman(2003)和 Mueller(2003)是其中杰出和覆盖面广的相关文献概述者,同时这两位作者也对政治经济学领域的研究做出了重要贡献。Dahl 和 Lindblom(1976)以及 Lindblom(1977)通常被视为政治经济学中的当代经典, Freeman(1989)提供了一个关于几个政治和经济体系的系统性比较以及主要理论方法的简洁说明, Przeworski(2003)的介绍性教科书也很有用。如果需要进一步了解, Austen-Smith 和 Banks(1999, 2005)及 Persson 和 Tabellini(2000)是很优秀的教科书,前者强调政治理论而后者注重经济政策的决定因素。此外还有两份主要的政治经济学期刊: *Journal of Political Economy* 和 *European Journal of Political Economy*, 其他一些期刊如 *Social Choice and Welfare*, *Public Choice*, *Homo Oeconomicus* 和 *Economics of Governance*, 也经常会有此领域的文章。

第2章

我们的目标是什么？

人们对政治经济学的研究有着许多不同的理由：一些作者的目标是做政策建议，一些作者为了指出经济政策中的正确或错误，一些作者为了解释过去发生的经济现象的意义，还有一些作者致力于预测未来的情况，最后还有些作者从学术文献和其他日常政治及经济事件中选择他们的研究对象。进一步的观察可以将以上的种种动机归结为科学探索中的几个较小的基本目标，即解释、预测、归因和理论结构，这些在自然科学中被广泛使用。本章中我们将聚焦于了解这些研究的领域告诉了我们哪些学科工作的基本目标。诚然，科学著作中也许还有些仅仅是个人目的，比如作者关注的是自己的学术生涯或为了受同行瞩目，这些动机属于社会学和心理学的领域，超出了本书的讨论范围^[1]。

2.1 解释政治经济学

同其他领域的研究一样，在政治经济学中学者和外行的兴趣常常

不一样,虽然有些问题双方都认为很重要,即那些典型的和主要政治经济事件有关的问题,比如主要的政策主张,发展趋势中未预期到的变化和新制度的出现。因此很少有人会质疑美国总统罗斯福 1941 年 12 月 8 日宣言的学术和现实重要性,在这次二战的宣言中,美国宣布加入对抗日本和德国的队列。阿兰·格林斯潘(Alan Greenspan)和 Jean-Claude Trichet 的有关美联储和欧洲中央银行的货币政策的宣言同样使研究者和市民都非常感兴趣,虽然各自的原因不同。类似的还有安然(Enron)事件过程中的主要角色的决策,即相关的 CEO 和 CFO,他们导致了史上最大的公司破产案——2001 年 12 月安然公司的倒闭(参见 Bryce, 2002 等)。还有欧盟委员会(European Council)于 2001 年 12 月中旬在比利时 Laeken 的关于设置例会来启动构建欧盟(European Union)宪法框架的决定,此决定也同时具有学术和现实的重要性。在 2004 年这一例会发布了其关于欧盟宪政条约的建议,这一建议概括了欧盟成员国公民的基本权利、欧盟的法律权限、基本制度和基本原则,还有欧盟的资金供给和其他更具体的规章。成员国的审批过程开始于 2005 年,一些国家以全民投票来决定结果,在 2005 年初夏,有两个成员国的投票结果否决了此建议,即法国和荷兰。

考虑到以上描述的决策和事件,读者很自然要问它们是如何被决定的,又是如何发生的,对此问题的回答通常被称为对相关决定或事件的解释。因此当一个历史学家在谈论发生于 1941 年 12 月珍珠港的空袭和次日美国政府对日宣战的政策方案时,后者即是为了对前者这一事件进行解释。类似的,发生在美联储和欧洲中央银行会议室中的讨论也是为了给予一个各自主席所做决定的解释,同样的观点还可应用于造成 2001 年安然股票市值暴跌的高层决策所给予的解释。

初一看,不同的人对同一事件和决策的解释可能不同,一个可以说服 5 岁小孩的解释可能很难使一个大学毕业生信服,反之亦然。解释中似乎有固有的主观因素,这是一个合适的社会学和心理学课题,而自然科学,特别是其分析的传统特性,所要做的是为有效的解释提供一个客观且一般的标准。这其中 Carl Hempel(1965)的一个项目特别重要,在此项目中他致力于设定一个所有领域中的所有解释都适用的普遍要求准则,以确认一个解释是否该被认为是科学的。