

国家资助哲学社会科学国家重点研究课题：
当代西方经济理论的新发展及
其与我国经济体制改革的关系
(第二册)
课题主持人：高鸿业

黄淳 何伟 著

信息经济学

经济科学出版社

国家资助哲学社会科学国家重点研究课题：
当代西方经济理论的新发展及其与我国经济体制改革的关系（第二册）
课题主持人：高鸿业

信息经济学

黄淳 何伟 著

经济科学出版社

责任编辑：吕亚亮 周秀霞

责任校对：杨晓莹

封面设计：张卫红

版式设计：代小卫 周国强

技术编辑：潘泽新

信息经济学

黄淳 何伟 著

*

经济科学出版社出版、发行 新华书店经销

中央民族大学印刷厂印刷

出版社电话：62541886 发行部电话：62568479

经济科学出版社暨发行部地址 北京海淀区万泉河路 66 号

邮编：100086

*

850×1168 毫米 32 开 11.5 印张 280000 字

1998 年 2 月第一版 1998 年 2 月第一次印刷

印数：0001—5000 册

ISBN 7-5058-1304-8/F·928 定价：16.30 元

图书在版编目 (CIP) 数据

信息经济学/黄淳, 何伟著. — 北京: 经济科学出版社, 1988.2
ISBN 7-5058-1304-8

I . 信… II . ①黄… ②何… III . 信息经济学 IV . F062.5

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (97) 第 28751 号

对本课题设计的说明

本课题的名称为：“当代西方经济理论的新发展及其与我国经济体制改革的关系”，其目的在于以马克思主义、毛泽东思想和邓小平理论为指针，从当代西方经济学的新发展中，寻求一些对我国经济体制改革有借鉴意义的内容，并对这些内容的应用加以论述。本课题的设计即是为了达到这一目的。在这里，本课题的主持人有必要进一步说明，为了达到这一目的，本课题的设计为什么采取了现在出版的三个分册的内容和形式。由于本课题所涉及的是西方经济学的新发展和我国体制改革这两个领域，所以设计的说明也涉及到这两个领域。

(一)

西方经济学的新发展

西方经济学是在西方世界居于正统地位的资产阶级经济学说。作为资产阶级经济学说，它是为资本主义服务的。具体地说，它在两个方面为资本主义服务，即：第一，它宣传资本主义的意识形态；第二，它总结西方市场经济运行的经验，为改善资本主义提出政策建议。因此，西方经济学的新发展不外乎指西方经济学由于时代的变迁而在这两个方面出现的新的说法和主张。

作为一个社会主义国家，我国以社会主义思想为指导原则。以此而论，上述第一点的资本主义意识形态与社会主义思想是对

立的。它不但对我国的经济建设无用，反而有可能带来意识形态上的混乱，从而发生有害的作用。例如，新自由主义，它无非是资本主义完善无缺论的现代版本；“科斯定理”不过把亚当·斯密的“看不见的手”的有效性扩大到原来被认为它是无效的“外部效应”（如环境污染）的范畴。

另一方面，以上述第二点而论，西方经济学的新发展中也含有很多的对西方市场经济的经验总结。由于资本主义市场经济和社会主义市场经济在市场经济这一点上具有共同之处，所以西方在市场经济上的经验总结值得我们加以借鉴。例如，西方国家通过宏观经济政策来对市场进行间接调节的经验，对企业管理中的委托代理关系的研究等。这种经验和研究对我国具有很大的参考价值，因为，在我国的社会主义市场经济中，也会出现类似的有待于解决的宏观调控和委托代理的问题。

然而，在西方经济学的新发展中，大多数的内容把上述两个方面交织在一起，很难将它们明确地划分开来。例如，理性预期的学说把人们在预期将来时的理性行为当作资本主义市场经济完善无缺的根据之一，从而构成目前的新自由主义的一个组成部分；但是，理性预期学说把人们的预期当作经济模型的一个内生变量，就这一点而言，它不但符合西方市场经济中的实际情况，而且在一定的限度内，也可以解释我国在执行宏观调控政策时所面临的“你有政策，我有对策”的问题。又例如，公共选择理论力图限制国家在管理经济运行上的职能，从而构成新自由主义的又一支柱；但是，它确实也对经济上的官僚主义作出一定程度的解释，从而也为我国避免经济上的官僚主义提供思考的线索。

要想对西方经济学的新发展中大量交织在一起的上述两个方面加以区别和分析，必须以马克思主义、毛泽东思想和邓小平理论为工具，对西方经济学中的有关资料进行研究。只有这样，才能判别其中哪些是有用的，哪些又起着不利的作用。只有这样，才能达到我们一般所说的“洋为中用”的目的。

但是，完善地达到这一目标远非易事。它要求结合现实对有关的正反两方面的材料进行详尽的分析和研究。限于本课题的人力和物力，虽然我们尽力以求，可是，其结果仍然难于符合我们的愿望，不完善之处大量存在，有待于将来加以补充和改正。

(二)

我国体制改革的需要

第二次世界大战以后，特别是近二三十年以来，西方经济学出现了为数众多的新观点和新说法，因此，体现这些新观点和新说法的西方经济学的新发展具有庞大的内容。例如，在西方的文献中，对新发展的内容进行系统总结的专著就已有数种之多，其中之一把西方经济学的新发展概括为九个领域，即：“1. 不肯定性下的决策；2. 行业经济学；3. 劳动经济学；4. 福利经济学；5. 宏观经济理论；6. 货币经济学；7. 国际贸易；8. 宏观经济政策；9. 国际货币经济学”。^①要想全面涉及这九个领域，一个课题显然是不可能做到的。因此，必须在其中加以选择，而本课题的选择标准为我国体制改革的需要。当然，我国体改所需要加以参考的西方经济学素材是多方面的，但是，我们认为，本课题的三个分册所包含的三个方面却是必不可少，其理由可以述之如下：

我国体改的一个重要内容是在一定的限度内，把市场经济逐步引入我国原有的计划体制之中。和计划体制不同，在市场经济中，每个参与的单位^②各自按照自己的意愿从事经济活动，而通过市场的作用把各个单位的活动连系在一起并使得它们协调一致。因此，每个参与单位必须考虑至少三个方面的问题：

① 马劳内：《经济学的新内容》，曼彻斯特大学出版社，英国曼彻斯特城，1992年，第V页。

② 即西方经济学中的“Economic agent”。

第一，在市场经济中，参与单位的利益最大化的意愿只有通过竞争才能被调节和引导到对社会有用的提高效率和促进经济发展的渠道。因此，马克思主义和西方经济学都指出竞争在市场经济中的重要性。

根据马克思主义经济学，企业之间的竞争迫使价值规律得以运行，商品必须按社会必要劳动时间进行交换。这样，效率较高、劳动消耗低于社会必要劳动时间的企业便会得到较多的剩余价值，从而获得发展的优势，而效率较低、劳动消耗高于社会必要劳动时间的企业便会受到惩罚，甚至为竞争所淘汰。正是在这一过程中，竞争在相当大的程度上提高企业的资本有机构成，培植企业的大胆进取精神，从而提高企业的效率。正是由于这些原因，马克思把竞争称为“资产阶级经济的重要推动力”。^①

以西方经济理论而论，作为其鼻祖的亚当·斯密认识到竞争可以降低商品的成本 and 价格，从而使整个社会得到企业效率提高而导致的益处。从斯密以来直到目前，竞争能提高效率并使社会得益的观点一直贯穿于整个西方经济学之中。竞争被认为是降低商品价格、改善商品质量和创造新产品的动力。正是由于竞争的有益作用，所以在完全竞争的条件下，西方微观经济学声称，整个社会会达到理想的帕累托最优状态。

然而，正如列宁在《帝国主义论》中指出的那样，自从 19 世纪末 20 世纪初以来，日益严重的垄断现象对竞争起着越来越大的破坏作用。针对这一问题，西方社会制定了一系列反垄断政策。而结合反垄断政策，西方学者对垄断和寡头进行了研究。这里必须指出，由于西方经济学把垄断的定义局限于为“单一的卖者”，所以根据这一定义，它所指的垄断仅出现于个别的事例之中而并不普遍存在。因此，我们所说的一般意义上的垄断主要属于西方经济学的“寡头”范畴。由于这一原因，对一般意义上的

^① 《马克思恩格斯全集》，第 46 卷下，人民出版社，1980 年版，第 47 页。

垄断现象而言，西方经济学中的寡头理论比它的垄断理论具有更为重要的适用性和现实意义。正是出于这种考虑，所以本课题第一分册的标题具有“寡头”而没有“垄断”的字样。

尽管西方学者很早就开始对寡头进行研究，但是，却并没有取得很大的进展，因为，寡头之间既有勾结又有斗争的关系使得他们的行动难于捉摸，从而，对他们行动的后果不能得到肯定的结论。只有在假设的行动准则下，才有得出结论的可能，但是，由此而得到的结论，由于假设条件远离现实，所以很难解释实际的事例。

第二次世界大战以后，特别是近年来的对策论在西方经济学中的广泛应用，使寡头理论取得一定的进展。与此同时，西方对反垄断政策也积累了更多的经验。这些新进展和新经验与过去原有的加在一起，构成西方一整套有关寡头理论和反垄断政策的行业经济学领域。

我国社会主义市场经济要求竞争，存在着破坏竞争的现象，也需要建立公平竞争的立法和司法体系。因此，上述的西方经济学领域的知识对我国的体制改革具有重大的参考价值。这样，《西方寡头市场理论与中国市场竞争立法》便成为本课题第一分册的内容。

第二，在市场经济中，参与单位的行动不是为行政命令所支配，而是来自根据市场提供的信息而作出的决策。大致说来，一般人士所说的“以市场为导向”即指此而言。例如，在计划体制中，厂商的生产量取决于计划规定的指标；而在市场经济下，生产量的多寡要依靠销售量的大小。换言之，厂商要根据市场向它提供的销售量的信息作出生产多少的决策。由此可见，信息在市场经济中是至关重要的决策因素。

在过去，传统的西方经济学依靠“完全知识（或信息）”的

假设条件^①，该假设条件意味着市场可以向每个参与单位提供它决策时所需要的全部信息。这一假设条件实际上把信息问题从西方经济学中排除掉，从而使决策成为参与单位的追求利益最大化的问题。

大致在 60 年代，西方学者开始对“完全知识”的假设条件进行研究。他们认为，某些信息，如将来的事态，是市场所不能提供的；某些信息，如技术知识，是有代价的；而某些信息，如商品的功能和质量系以不对称的数量分配于买者和卖者之间；如此等等，所有这一切被称为信息的不完全性。由于信息的不完全性，所以决策必须在不肯定性下进行。因此，决策的结果也和过去在完全知识下的结果有所不同。很显然，不肯定的假设条件比完全知识的假设条件较接近于现实，从而根据后者而得到结果要比前者的结果也较为符合于现实情况。

在社会主义市场经济中，信息问题也会出现，也同样会影响参与单位的决策。因此，借鉴西方信息经济学的研究成果是有必要的。信息经济学构成本课题的第二分册的内容，其理由即在于此。

第三，在市场经济中，参与单位（企业或其他形式的组织）要想在上面第一分册论述的竞争中求得生存，必须使自己的经济组织系统能够充分利用上面第二分册提到的市场信息及其他资源和因素，因为，经济组织的优劣关系到参与单位在竞争中的成败，而竞争中的成败又在一定程度上取决于对市场信息的利用。由此可见，在市场经济中，经济组织的完善与否是一个很重要的问题。

然而，传统的西方经济学却忽视了这一问题。在传统的说法中，每个参与单位都被看成是完全相同的事物，不论参与单位规模如何，不论参与单位采取何种组织形式，不论参与单位的组织

^① 原文为“Perfect Knowledge”。

方法是否合理，它们一概都被认为是最大利益的追求者，而且都能够达到追求的目标。换言之，参与单位的工作效率与组织形式无关。这样，传统的西方经济学就把经济组织问题排除在研究的范围以外，即根本不研究经济组织问题。

这种做法在第二次世界大战以后，特别在近数十年来，有着很大的改变。很可能由于西方经济组织规模的扩大、组织方法的改善等原因，西方经济理论开始涉及企业管理、经济组织等问题。特别在企业管理和企业组织行为理论的领域，西方学者已经取得了不少的成果。关于这一点，世界银行首席经济学家斯蒂格利茨写道：“在过去的 50 年中，学者们也对经济学和企业经营之间的界限重新加以考察。像公司财政和企业管理那样的学科在过去是被置之于商学院的范围，而在那里，这些学科以不涉及经济理论的方式进行讲授。在今天，我们已经知道，要想了解市场经济如何在现实中发挥作用，我们必须了解厂商的财政和管理。”^①

我国的社会主义市场经济理所当然地需要一切有关企业管理和组织方面的知识，但是在目前，我们认为，对经济组织方面的知识，需要似乎更加迫切。在我国过去的集中计划时期，判别我国经济组织优劣的主导思想很可能是偏向于对行政效率的考虑，而在目前，为了适应市场经济的需求，经济组织的设计应以经济方面的效率为主要考虑点。因此，尽管西方经济组织理论现在尚处于不成熟的阶段，本课题的第三分册仍然把有关这一理论的论点综合在一起，而把综合的结果应用于我国的外贸组织，希望能为在对外开放政策中居于重要地位的外贸组织的改善提供参考。

本书是本课题的第二分册。

课题主持人：高鸿业

1997 年冬，于人民大学

① 斯蒂格利茨：《经济学序言》，诺顿公司，纽约，1993 年，第 37 页。

目 录

对本课题设计的说明	(1)
第一章 引论	(1)
第一节 信息经济学与西方经济理论	(1)
第二节 信息经济学的思想和方法	(3)
第三节 信息经济学与中国	(15)
第一编 决策理论与价格制度	(25)
第二章 决策、理性与信息	(26)
第一节 完全竞争理论的有效性	(26)
第二节 个体理性：理性假设与理性问题	(29)
第三节 现代决策理论的基本特征	(34)
第四节 知识：命题与判断	(41)
第五节 概率与信息	(45)
第六节 实证与规范：因果判断与价值判断	(54)
第七节 工具论：科学技术与生产力	(59)
第三章 不确定条件下的选择理论	(68)
第一节 不确定条件下的选择对象	(71)
第二节 期望效用理论	(75)
第三节 风险理论	(77)
第四节 信息与不确定条件下的选择	(82)
第五节 风险、信息与市场的完善	(89)
第四章 寻找理论：市场与企业	(97)
第一节 寻找理论概述：完美信息与完全信息	(98)
第二节 寻找与价格分散	(105)
第三节 交易费用与市场形成	(110)
第四节 企业理论：交换与生产	(123)

第五节	承包及企业规模等问题	(135)
第五章	财富：产品特征与产权	(138)
第一节	产业组织：产品空间与产权	(139)
第二节	分工理论	(143)
第三节	寻租理论	(147)
第四节	特征理论	(153)
第五节	空间战略与经济改革	(157)
第二编	对策论与非价格制度	(167)
第六章	经济社会与非价格制度	(170)
第一节	价格制度与非价格制度	(170)
第二节	个体理性与价格制度	(172)
第三节	个体理性与集体理性	(175)
第四节	对策论：利益的冲突与一致	(179)
第五节	集体理性与非价格制度	(188)
第七章	非合作对策：逆向选择与道德风险	(197)
第一节	策略与纳什均衡	(197)
第二节	对策论中的信息	(206)
第三节	信号与逆向选择	(219)
第四节	机制设计与道德风险	(226)
第五节	非价格制度：风险与法律	(231)
第八章	合作对策：公正与分配	(235)
第一节	两人合作对策：谈判与分配	(236)
第二节	n人合作对策：联盟与分配	(245)
第三节	分配与经济制度	(252)
第三编	系统科学与经济规律	(261)
第九章	信息经济学与历史	(264)
第一节	新古典经济学的局限性	(265)
第二节	古希腊：人与社会	(269)
第三节	资本主义：从身份到契约	(276)
第四节	马克思：价值规律	(283)
第五节	经济学的科学性	(291)

第十章 系统科学与经济规律 (293)

第一节 科学的基本问题与本体论 (293)

第二节 特征与关系 (296)

第三节 事件与法则 (301)

第四节 信息与时空 (308)

第五节 输入与输出 (316)

第六节 组织与被组织 (321)

第七节 符号与意义 (324)

第八节 全面认识经济规律，促进经济健康发展 (334)

第十一章 经济学与意识形态 (341)

参考文献 (344)

后记 (347)

第一章 引 论

本书的目的是对信息经济学进行介绍和讨论，并试图说明它对我国经济改革与经济科学发展的意义。在这里，我们先对信息经济学在经济学中的地位，其基本内容以及本书的结构作一些介绍。

第一节 信息经济学与西方经济理论

1961年，斯蒂格勒（George. J. Stigler）在政治经济学杂志上发表了“信息经济学”的论文。同年，维克利（William Vikrey）在财金杂志上发表了“反投机、拍卖，和竞争性密封招标”的论文。这两篇论文的发表标志着信息经济学的诞生。

信息经济学自诞生以来，得到了迅速的发展，至今已在西方经济学主流学派中占据着十分重要的地位：“回顾过去，很清楚地看到，信息是丰富、扩大和推进经济理论发展所需要的自然的组成部分。信息的增添使得经济学家能够增加他们工作的细节和准确。从最近理论文献的角度上看，信息不仅是在丰富理论而且在理论中占据着中心的地位。信息还在经验和实验文献的实质内容中发挥着作用。例如，Vernon Smith（1994）在他的‘实验室里的经济学’一文的开头一段提到实验的四个方面，其中包括‘支配信息交换的规律’。学术会议和教科书都把很大一部分注意力放在了各个领域上。对信息经济学如此大的努力也是（200多年来）正统理论彻底研究的部分结果。然而，这种注意正确地预

示了信息经济学在经济理论中的核心位置。”^①

信息经济学成为西方主流经济理论的核心内容之一，这标志着西方主流经济理论已经并且正在发生着深刻的变化。这种变化在西方经济学和教科书中也得到了充分的体现。美国著名的经济学家斯蒂格利茨(Joseph E. Stiglitz)在他的《经济学》一书中写到“作为经济学入门课程的教师，我感到没有一本教科书提供了对现代经济学原理的理解——既包括现代经济学家如何思考世界的原理，又包括理解现代经济问题所需要的原理。当我们走向 21 世纪时，我们需要超越马歇尔和萨缪尔森的原理。”^② 在斯蒂格利茨的这样一本试图超越过去面向 21 世纪的经济学基础教程中，我们可以看到，信息经济学的影响和所占比重也是十分明显的。

总之，无论是在学术文献中还是在西方经济学的教课书中，信息经济学已经成为西方经济理论重要的组成部分。成为它时代的基本特征。因此，当我们了解西方经济理论时就不能不了解信息经济学的内容。

从内容上看，信息经济学几乎渗透到西方经济学的各个领域。在 David K. Levine 编辑的论文集中把信息经济学的内容分为了 10 个部分。从这 10 个部分我们大致可以看到信息经济学的基本内容。

1. 开端 (The Beginnings)
2. 信息的价值 (The Value of Information)
3. 寻找和价格分散 (Search and Price Dispersion)
4. 投机 (Speculation)
5. 信息和法律 (Information and Law)
6. 信号和逆向选择 (Signalling and Adverse Selection)

① “信息经济学”论文集，David K. Levine and Steven A. Lippman 编辑，1995 年出版。

② 《经济学》，斯蒂格利茨，中国人民大学出版社，第 17 页。

7. 机制设计、合同和道德风险 (Mechanism Design, Contracting and Moral Hazard)

8. 拍卖 (Auctions)

9. 声誉模型 (Reputation Models)

10. 产业组织 (Industrial Organization)

信息不仅仅在经济学中具有核心的或者重要的地位，而且在当今社会生活的方方面面也已经或正在占据着核心的或重要的地位，因为人类社会毕竟正在进入一个所谓的“信息时代”。

对于经济理论而言，信息的闯入并不仅仅意味着经济学家开始关注计算机，卫星通讯等“信息产业”了，由于人类社会信息产业的发展，在经济学中出现了“信息经济学”，就像农业经济学、工业经济学那样。对信息产业进行研究或者对现代经济活动的信息化的研究也是属于现代经济学的重要内容。但是，本书介绍的信息经济学的内容不涉及对信息产业的分析。为了区别起见，我们可以把对信息产业的经济分析称为“信息产业经济学”，而把经济理论中对信息的研究称为“信息经济学”。当然，这种区分仅仅是为了说明这本书所要介绍的内容而设立的，作为现代经济理论，它的研究对象不可能不涉及到现代产业信息技术的特征。

第二节 信息经济学的思想和方法

一、信息经济学的基本思想

为什么信息经济学会成为现代西方经济理论核心的或重要的组成部分呢？要了解这个问题就不能不涉及到新古典经济理论中的传统经济思想，以及信息经济学的产生对传统思想的冲击是什么。

经济理论的核心内容是对市场经济制度或价格机制进行分析。我们知道，在经济学的发展史中，亚当·斯密及李嘉图创立