

经济学

大逃亡

——
摆脱知识的奴役

冯燮刚 著

在本书中轰然坍塌的不仅是
正统经济学，也不仅是方兴
未艾的行为经济学……

在本书中逐渐展开的不仅是
关系论经济学，也不仅是关
系论哲学……



经济科学出版社
Economic Science Press

经济学大逃亡

——摆脱知识的奴役

冯燮刚 著

经济科学出版社

图书在版编目 (CIP) 数据

经济学大逃亡——摆脱知识的奴役 / 冯燮刚著. —北京:
经济科学出版社, 2009. 10

ISBN 978 - 7 - 5058 - 8563 - 9

I. 经… II. 冯… III. 经济分析 - 研究 IV. F0

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2009) 第 157286 号

责任编辑: 龚 勋 初少磊

责任校对: 王凡娥

版式设计: 代小卫

技术编辑: 李长建

经济学大逃亡

——摆脱知识的奴役

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: 100142

总编部电话: 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

华丰装订厂装订

787×1092 16 开 24 印张 380000 字

2009 年 10 月第 1 版 2009 年 10 月第 1 次印刷

ISBN 978 - 7 - 5058 - 8563 - 9 定价: 38.00 元

(图书出现印装问题, 本社负责调换)

(版权所有 翻印必究)

知识的奴役远甚于暴君的专制。

——题记

序 言

当我拿到《经济学大逃亡——摆脱知识的奴役》书稿时，首先对书名打了个大大的问号——以此为书名，是否有哗众取宠之意？而当我读完全部书稿，以及将本书与作者已经出版的两本著作联系起来看，感到本书以《经济学大逃亡》为名，还是恰当的。正统经济学仍然身陷本质主义陷阱，就是本书所称的“亡地”；而逃离本质主义陷阱，转向开放、演进的关系论，就是本书所谓的“大逃亡”。

为什么要逃？人类一直在孜孜不倦地求是求真。本质主义也好，关系论也好，都涉及一个久远、也是永恒的话题，即人类知识何以是、何以真。本质主义何以不是、何以不真？关系论何以是、何以真？本书的哲学基础及后续内容对此有系统的论述，读者阅读本书并结合自己的学习实践一定会有所体会。我不是专门做哲学研究的，不便评论本书的哲学基础研究内容，但从全书的内容来看，人类如何处理好自我和其身处环境之间的关系，确实是人类文明的一个基本问题。在近代之前，当“上帝”成为我们思想世界的中心的时候，人类像奴仆一样皈依彼岸世界的“上帝”，丧失了自我。在近现代，上帝死了，人“活”了，但自我却过度膨胀，取代了上帝，占据了世界舞台的中心。在欧洲的理性时代，“人是万物的尺度”这句话是人类自我膨胀最好的体现。从本书内容来看，无论是作为救世主的“上帝”，还是作为“万物尺度”的人，都是人类在本质主义指引下造神运动的组成部分。既不要对自我和环境之外的“第三者”顶礼膜拜，也不要过度膨胀将自我置于世界的中心，而是

要多一点平衡，多一点现实，对未知和未来持有审慎的敬畏之心，在自我和环境的关联互动中，按照开放、演进的关系论原则求是求真，我想这就是本书要力图阐明的关系论的要义。

怀着对自然科学理想的追求，正统经济学一直按照理性原则建构经济学体系，完全理性的自我成为其选择行为理论的心理基础，并成为选择行为的根本依据。但是逻辑上完备、一致的理性原则无法面对不遵循传统理性原则、高度可变的情绪性、本能似的冲动因素和由物理背景、人文背景与历史背景激发的因素，正统经济学选择行为理论与行为现实产生了严重背离。行为经济学由此对正统经济学的选择行为理论进行了系统反动，并最终系统解构了正统经济学的完全理性，放弃了规范性理想，转向了描述性，建构了由理性和非理性系统组成的有限理性。描述性的有限理性正是行为经济学家在解构了正统经济学规范性的完全理性后，在主体的一端为主体和其身处的环境之间的互动行为寻找的新的原因。

在以行为主体为中心的单极化本质主义范式之下，正统经济学也好，行为经济学也罢，行为主体自主判断、自主选择。正确也好、错误也罢，一个判断和选择的自我是我们自己行为的主人，也是经济学为丰富多变的现实确定的终极依据。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。后两方面的因素是行为主体和环境之间的互动行为，在行为主体和环境之间的互动过程中被决定，无法单一地归于行为主体的“本质”。事实上，只要我们坚持在我们的行为主体一端寻找行为的所有原因，这两方面就只能归于理性所不及的启发、直觉、潜意识、本我或其他类似的神秘过程。无论是完全理性，还是有限理性，试图依靠行为主体的“本质”属性来为行为主体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，即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，在行为主体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。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、决定性的、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、演进的建构。

但逃离“亡地”只是漫漫征途的开始。重构关系论经济学理论体系需要广泛的参与和漫长的过程。本书在系统阐述了经济学的关系论转向后，亦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，力图建构关系论经济学知识体系提供可靠的路径。计量经济学运用随机数学工具进行统计推断，建立起符合无偏性、有效性、一致性的或然知识，成功地回避了休谟指出的“从经验到的过去、特殊、局部推论到未经验到的未来、一般、整体”的逻辑矛盾。但统计推断逻辑的严密性，只能尽可能防止在统计推断过程中出现新的错误，并不足以以为计量经济学知识提供依据。对计量经济学知识依据的追问，仍然要溯及统计推断的前提——总体界定。正统经济学贫瘠的理论基础，直接导致了计量经济学的方法论混乱——在先验理论导向和数据关系导向之间摇摆。转向主体关系导向，严格遵循经验工具体系可测度的公度性原则，在理论分析上清除本质主义的误导，转向外在于主体的动力学关系分析，为功能强大的计量方法提供可靠的逻辑前提，将可实现先验理论导向和数据关系导向的综合。由此，计量经济学将在理论、工具、数据的互动过程中，不断发展，不断融入现实世界，不断深入未知世界。

尽管建立关系论经济学体系依然在探索过程中，但在对中

国房市转轨、宏观经济转型和危机管理等现实问题的研究过程中，关系论的新视界彰显出深刻的洞察力和实用的价值。本书在这些实际经济问题的研究过程中，也对关系论经济分析的基本理论框架进行了有益的探索，初步形成了“经济自律、市场约束和政治和谐”的关系论分析框架。这样的框架不同于正统经济学在微观层面侧重于经济人的“本质主义”分析和在宏观层面侧重于统计规律发现的总体分析，而关注经济主体之间的利害关系和基于经济主体之间关联互动的动力学过程，如经济主体的行为是否自律，市场约束是否有效，经济主体的行为取向是否导向和谐共赢等。

冯燮刚博士本科毕业于清华大学水利水电工程系，研究生就读于清华大学经济管理学院，现在中信银行从事风险管理工作。学历和工作经历为他从事经济理论和实际经济问题研究奠定了很好的实践基础、知识基础和方法论基础。他本人是关系论经济学研究的拓荒者，在正统经济学解构、行为经济学解构和关系论经济学建构方面，已经取得了一些研究成果，已经出版了《知识何以可能——从经济学的关系论转向看》和《中国安居之路——走出房地产迷局》两本专著。本书是他在前两本专著的基础上，加上哲学研究内容^①后的一次系统的综合。把哲学分析、关系论经济学理论探索、关系论经济分析应用三者整合在一起，尝试对关系论经济学作一个整体的刻画，突出经济学逃离没有希望的“亡地”——本质主义囚笼的主题，为关系论经济学的发展提供一个相对完整、系统的框架，相信对于推动关系论经济分析理论和方法的研究会有重要作用。从相关研究成果来看，新加入的哲学研究成果也能为包括社会科学和自然科学在内的科学整体的发展提供非常好的土壤。作为冯燮刚博士的指导教师，就本书中的相关问题，我曾经与他反复讨论，

^① 作者注：哲学研究内容早在上述两本专著研究内容完成之前即已经完成，并指导了相关研究工作的推进。

也曾联名发表学术论文（均收录到本书中）。他知识面之广泛、学习之刻苦，以及对理论研究的执著，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。若能借本书吸引更多的人投身到关系论经济学研究上来，推动关系论经济学及其他相关科学的发展，既是我所期望的，也是冯燮刚博士撰写本书的初衷。

李子奈

2009年6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别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。学者也好，求学者也罢，在追寻神秘的第三者的过程中，都不免陷入特定第三者的结构化陷阱，而对第三者的神秘光环顶礼膜拜。但不论第三者的光环多么美丽、玄妙，永远无法摆脱第三者悖论对其合法性的致命质疑：为了证明较低层次的第三者的合法性，必须引入更高层次的第三者，从而陷入死循环。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了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，并为人类文明提供判断真伪的绝对的终极仲裁。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来确定知识依据，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，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，不再是有决定意义的第三者，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所淘汰。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，人类文明就会故步自封。

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对应，以笛卡尔和康德为代表的西方思想家在近代提出了“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”，旨在使学者和求学者们认识到，无论是以“认识者”自居而把自己定位于超然世外的第三者，还是臣服于彼岸天国的“上帝”，只要割裂了自我和现实世界的关系，就只会使学者、求学者和人类文明陷入画地为牢的窘境，并无怨无悔地沦落为人类自己臆造的神的奴隶。学者和求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象，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。这个演进过程相对个人生命周期如此漫长，以至于人类逃离本质主义“囚笼”的历史过程如此艰难，如此漫长。但不管如何漫长，如何艰难，正是在持续打破特定的思想“囚笼”的过程中，神化“第三者”的绚丽光环逐渐退去，人类不断摆脱特定知识模式的奴役，不断解放自己，不断推动文明的进步。

冯雯刚

2009年5月 北京

目 录

引 言 挥之不去的第三者	(1)
--------------------	-------

第 1 部分 三千年“囚笼”：哲学大逃亡

第 1 章 本质主义“囚笼”：孤独的迷路者与神秘的第三者	(15)
------------------------------------	--------

1.1 期待第三者：囚徒困境与理念之光	(15)
1.2 追寻第三者：纷争与一统	(17)
1.2.1 古希腊思想家的意见纷争	(17)
1.2.2 亚里士多德的综合	(19)
1.3 第三者“照亮”的入“笼”之路	(20)
1.3.1 本体论与世界的结构	(21)
1.3.2 认识论与认识的结构	(23)
1.4 “囚笼”中的演义	(25)
1.4.1 奥古斯丁—阿奎纳的神学本体论	(25)
1.4.2 笛卡尔—康德的认识论转向与自我本体论	(26)
1.5 小结	(27)

第 2 章 第三者幻觉与虚幻的本质主义“囚笼”	(30)
-------------------------------	--------

2.1 本质主义“囚笼”素描	(30)
2.2 观察者视觉模式与世界的割裂	(31)
2.3 “全知万能”的第三者	(33)
2.4 完备性幻觉（一）：无法跨越的因果关系悖论	(37)

经济学大逃亡

2.5	完备性幻觉（二）：无法跨越的内涵性悖论	(41)
2.6	小结	(43)
第3章 关系论转向：逃离本质主义“囚笼”		(45)
3.1	逻辑的力量：终结本质主义	(45)
3.2	第三者幻灭：从封闭社会到开放社会	(49)
3.2.1	自然经济与封闭社会：决定性的第三者	(51)
3.2.2	开放的商业社会：第三者幻灭	(52)
3.3	曲折的逃亡之路	(54)
3.3.1	维特根斯坦分析哲学的突破与陷落	(54)
3.3.2	后现代主义哲学的突破与陷落	(56)
3.4	关系论转向：摆脱知识的奴役	(58)
3.4.1	自然科学的突破	(59)
3.4.2	开放的知识方法论：向现实世界和 未知世界开放的新哲学	(60)
3.5	小结	(64)
第4章 文明转型：从封闭社会到开放社会		(65)
4.1	自由与强制的对照	(65)
4.2	哈耶克的理想：基于自发秩序的自由保障	(66)
4.3	回归奴役之路：二分法的幻象与文化本体论	(68)
4.4	关系结构转型：基于开放社会的自由保障	(70)
4.5	小结	(73)
	参考文献	(75)

第2部分 经济学大逃亡

第5章 修补完全理性“囚笼”：行为经济学的心理现实化		(80)
5.1	人们如何选择：决策理论概览	(80)
5.2	从综合选择到局部选择：主观价值 判断的心理现实化	(84)

5.2.1	价值载体的相对性	(84)
5.2.2	期望价值的心理现实化	(86)
5.3	可达性启发: 概率判断的心理现实化	(88)
5.4	信息和时间因素	(91)
5.4.1	选择评价的第三维度: 模糊性	(91)
5.4.2	对时间因素的处理	(92)
5.5	小结	(93)
第6章 逃离完全理性“囚笼”: 行为经济学对正统经济学 微观理论基础的解构 (96)		
6.1	参照系问题: 结构化效应与相对价值判断	(97)
6.2	程序问题: 思维惰性与度量相容性	(99)
6.3	参照系的随机漂移: 占有效应与选择 基准的随机塑造	(102)
6.4	多元参照系: 资源中性幻觉与思维会计	(104)
6.5	小结	(108)
第7章 逃离有限理性“囚笼”: 经济学的困境与行为 经济学的解构 (110)		
7.1	大脑理性无法应对的弈局: 行为博弈	(111)
7.2	裁缝为谁缝衣: 永无休止的社会 效用和个人效用之争	(113)
7.3	无限可能的明天	(116)
7.4	飘忽不定的情感	(118)
7.5	描述性幻觉: 行为经济学的有限理性“囚笼”	(121)
7.5.1	直觉和推理双系统模型的基本结构	(122)
7.5.2	可达性启发与判断偏差	(123)
7.5.3	双系统选择行为理论: 反射机制和适应机制	(124)
7.5.4	描述性转向: 从完全理性到有限理性	(125)
7.6	将逃亡进行到底: 逃出柏拉图“囚笼” 与行为经济学解构	(126)
7.7	小结	(127)

第8章 新视界：经济学的关系论转向 (129)

- 8.1 结构化陷阱 (130)
- 8.2 心理现实化、现实心理化、现实化 (131)
- 8.3 描述性和规范性二分法幻觉 (134)
- 8.4 情感与黑熊反应问题 (135)
- 8.5 真正的不确定性 (136)
- 8.6 行为试验的局限与测不准原理 (138)
- 8.7 小结 (140)

第9章 经济学何以可能? (143)

- 9.1 正统经济学范式 (144)
 - 9.1.1 作为经济原子的经济人 (144)
 - 9.1.2 在经济世界中的经济原子 (146)
- 9.2 正统经济学知识的性质 (147)
- 9.3 经济学本质主义、唯理主义和经验主义的不可能 (150)
- 9.4 开放的经济学方法论与开放的经济学知识体系 (152)
- 9.5 小结 (155)

第10章 主体关系导向的计量经济学：通向关系论 经济学的途径 (156)

- 10.1 引论：计量分析的基本结构 (156)
- 10.2 经典模型：先验理论导向的计量分析 (159)
 - 10.2.1 经典计量经济学知识的性质 (159)
 - 10.2.2 经典计量经济学知识的依据 (161)
- 10.3 非平稳性：时间序列数据的动态结构 (164)
 - 10.3.1 时间序列分析的理论基础 (164)
 - 10.3.2 单整、协整与误差修正 (167)
 - 10.3.3 数据关系：主体关系的影子 (168)
- 10.4 基于统计相关性的综合：动态计量经济学 (170)
 - 10.4.1 衍生误差与关注参数臆构 (171)
 - 10.4.2 基于统计相关性的约化 (172)
 - 10.4.3 动态计量经济学知识的性质 (176)