



李宗诚◎著

价值链、虚拟资本和 全球网络（上册）

——对冲均衡经济学和博弈组织协同学

Value Chain, Fictitious Capital and Global Network

——Hedge Equilibrium Economics and Game Organization, Synergetics

光明日报出版社



李宗诚◎著

价值链、虚拟资本和 全球网络 (上册)

——对冲均衡经济学和博弈组织协同学

Value Chain, Fictitious Capital and Global Network

——Hedge Equilibrium Economics and Game Organization, Synergetics



光明日报出版社

图书在版编目 (CIP) 数据

价值链、虚拟资本和全球网络：对冲均衡经济学和
博弈组织协同学 / 李宗诚著. -- 北京：光明日报出版社，
2013. 7

ISBN 978 - 7 - 5112 - 5084 - 1

I. ①价… II. ①李… III. ①虚拟经济—研究 IV.

①F019

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2013) 第 167875 号

价值链、虚拟资本和全球网络：对冲均衡经济学和博弈组织协同学

著 者：李宗诚

责任编辑：祝 菲

责任校对：张明明

封面设计：中联学林

责任印制：曹 净

出版发行：光明日报出版社

地 址：北京市东城区珠市口东大街 5 号，100062

电 话：010 - 67078248 (咨询)，67078870 (发行)，67078235 (邮购)

传 真：010 - 67078227，67078255

网 址：[http: //book. gmw. cn](http://book.gmw.cn)

E - mail: gmcbbs@gmw.cn zhufei@gmw.cn

法律顾问：北京天驰洪范律师事务所徐波律师

印 刷：北京天正元印务有限公司

装 订：北京天正元印务有限公司

本书如有破损、缺页、装订错误，请与本社联系调换

开 本：710 × 1000 毫米 1/16

字 数：975 千字

印 张：56

版 次：2013 年 8 月第 1 版

印 次：2013 年 8 月第 1 次印刷

书 号：ISBN 978 - 7 - 5112 - 5084 - 1

定 价：139.00 元 (上、下册)

版权所有 翻印必究

序 言

每一次大规模的经济衰退,都伴随着某些旧经济学理论框架的失败和某些新经济学理论框架的成功^{[1][2][3]}。1929 - 1933 年的大萧条宣告了古典主义经济学的土崩瓦解,随之而来的是凯恩斯主义长期处于主导地位。20 世纪 70 年代的供给冲击和滞胀宣告了凯恩斯主义退出经济学的中心,取而代之的是货币主义和供给主义。1987 年的股灾和 1990 - 1991 年的经济衰退使供给主义退出了历史舞台,货币主义转而与所谓的新凯恩斯主义合流,形成了本世纪初主宰大部分市场经济国家的新货币主义理论框架。

面对近几年发生的世界金融危机和经济大衰退,整个人类社会的学术知识水平都有些力不从心了。在社会经济领域,我们既要摒弃披着新古典主义外衣的新蒙昧主义^{[4]-[8]},又要摒弃披着新凯恩斯主义外衣的新蒙昧主义^{[9]-[12]},努力克服主流经济学的局限,弥补主流经济学的不足。

实质性的问题在于,兴起于二十世纪后二十年、但在经济学上从未得到充分研究的“知识经济”,实际上是服从于社会经济领域的丛林法则、资源的大规模掠夺和经济的大范围竞争,并且服务于金融资本对实质经济的统治、经济霸权在全球范围的控制和特殊利益集团在社会各个领域的全面掌握的特殊经济形态,是与网络技术、数字技术和虚拟资本密切相关的“旧知识”经济^{[13]-[15]}。

进入 20 世纪 90 年代之后,计算机网络(后来演化成为 Internet)的发展使得有关计算机网络的经济学问题成为“网络(产业)经济学”的一部分,最初是关于电子计算机的局域网、广域网的成本核算、收费标准的一些经济学讨论,后来逐渐增加到对 Internet 服务价格、税收和服务提供者竞争等的分析。这些在决定互联网资源的有效配置、提高互联网网络投资的获利能力、制定适当的政府政策方面的研究主题都被纳入了“网络经济学”(更具体地说,这是“网络产业经济学”)的讨论范畴。1999 年 3 月在荷兰鹿特丹召开的“网络经济学”国际研讨会上,列入的

议题就包括“网络理论”、“电讯”、“Internet”与“航空运输线”。在互联网以惊人的速度向前发展,拓展到世界的各个角落的同时,经济学家们逐渐认为继续将关于Internet的讨论放在“网络经济学”的总学科中进行,继续将互联网及其相关产业与电力、航空、电讯技术、广播电视、铁路等稍显传统的生产部门放在一起研究已经不合时宜了。

在现行社会经济政治体系未发生重大变化的情况下,经济泡沫、金融危机和网络泡沫破裂已经波及全球,造成全球性大灾难!全球性经济大灾难出现之时,就是主流经济学升级换代之日^{[16]-[19]}。

与新旧古典主义、新旧马克思主义、新旧凯恩斯主义、新旧供给主义和新旧货币主义不同,本书作者一直致力于开辟全新的方向、全新的目标和全新的领域。二十多年来,我在社会经济的复杂性探索方面进行的全部工作,可归结如下^{[20]-[38]}:

不仅从经济简单性转向经济复杂性,而且进一步转向经济统一性,转向经济全球化,力图拓展主流经济学的分析基础,建立具有更大适应性的新理论和新方法,为在全球大力开展新知识经济系统工程而提供新的科学基础和技术支持。

在本书初步界定的概念体系和初步建立的分析框架下,在本书作者建立的资源配置动力学和系统功效价值论基础上,通过本书作出的全球价值链分析、生产网络体系分析、虚拟资本分析以及金融市场和大众赌博背后的资本博弈分析,利用本书建立的面向知识经济的对冲均衡经济学理论和经济大系统全球生态组织协调学分析模型,我们可以得出涉及管理创新、制度创新、组织创新的新战略和新政策。

将微观层级上有关少量理性人之间博弈行为的分析拓展到宏观层级上建立有关大量理性人之间博弈构成关系、博弈组织关系和博弈进化关系的分析,这是一项十分复杂而困难的探索,必定会涉及各种微观层级、中间层级和宏观层级上的各种经济行为人及其各种复杂的博弈系统动力学过程,涉及各种经济机制、各种博弈行为和各种委托代理关系之间的复杂系统联系,从而涉及微观的随机涨落因素和宏观的系统制约条件之间的复杂动力学关系。

通过一系列的工作,本书作者试图在简单性和复杂性之间面向统一性,在局部和整体之间面向本体性,进而在系统的内部和外部全息协同关系之间面向进化统一性,建立新的动力学基础、价值论基础以及新的经济学分析和元系统科学方法,既试图超越传统部门科学的局限,又试图超越现代系统科学的局限。在此基础上,本书进行系统性的逻辑推演和元系统性的逻辑汇总,向人们展示一个全新

的未来世界体系的图象,为人类在危机四伏、险象环生的现实中指明一条全新的光明大道。

由本书指出的崭新道路将导致这样的结果:

超越新国家主义^{[39][40]},超越新自由主义^{[41][42]},在政府和市场之间建立全新的经济协调组织,形成更为强大、更为合理、更为有效的社会公平正义力量。

面向价值链、虚拟资本和全球互联网络,进而面向厂商主导的市场配置、政府主导的规划配置和公众主导的网络配置,本书的全部分析与设计可归结为这样一个基本主张:只有通过先进的现代信息科学技术建立并引入网络配置机制,并在市场配置、规划配置和网络配置之间建立动态协同关系,从而通过先进的现代信息科学技术建立并引入社会公众权力,并在厂商权力、政府权力和公众权力之间建立动态协同关系,才能真正实现社会经济的可持续协调发展。

本书作者坚信,在从根本、关键、核心及总体上解决现代世界经济一系列重大问题和危机方面,本书将能够提供科学化的理论基础、技术化的分析体系和工程化的解决方案。

—

当代社会经济的复杂性集中体现在金融复杂性和网络复杂性上,为现代经济学及社会经济实践带来越来越多的问题和困扰。

自20世纪80年代以来,金融世界日趋复杂多样化。随着布雷顿森林体系的倒塌,国际上掀起金融自由化浪潮,对资本的跨国流动监管逐步放松,国际金融市场和金融产品及金融衍生产品迅速繁荣起来,资本运作的空间和实力都得到了极大扩张,少数金融机构通过股权融资和拆借拥有了空前的支配大规模资金的能力……。发生于2007年、持续到2009年以至更长时间的美国次贷危机本身是一个巨大的黑洞,其中一个又一个漩涡扑朔迷离,连漩涡中的人都不知底细^{[43][44][45]}。美国次贷危机的信用传导链条的核心是风险转移,上游机构不断将风险转嫁给下游,在每一个转嫁环节中,投资者都将评级作为决策的一个重要参考。次贷证券化过程涉及十多个参与机构,其中包括住房抵押贷款机构、住房抵押贷款经纪人、借款人、消费者信用核查机构、贷款转移人、特殊目的机构(Special Purpose Vehicle, SPV)、评级机构、包销人、分销人、保险公司、特别服务提供者、电子登记系统和投资者等。

当代世界金融体系处于一片混乱局面。金融市场泡沫、虚拟资本市场交易量过于庞大、房地产市场泡沫、金融市场投机过度、美元主导下国际货币体系的不合理性、世界流动性过剩、离岸避税港的黑色金融以及近几十年来的一系列金融危机等,都与主流经济学金融理论的偏差、相互冲突的建议和非现实的政策措施及所谓的金融创新工具有密切关系。

困扰世界经济稳定与发展的金融、能源和粮食等三大危机都和美国脱不了干系。而美国之所以嚣张到让世界各国为它的金融烂账埋单,频频携美元以令诸侯,既是因为全球缺乏一个建立在制度化和持续性基础上的沟通与协调机制,更在于各国在美国的霸权逻辑下主动放弃了经济政策的独立性。有迹象表明^{[46][47]},几年前发生的那场空前规模的经济地震,尽管已使美国信誉大受损失并有可能动摇其在水世界经济体系中的地位,但实际损失最大的却是广大发展中国家。

信息化、网络化、全球化浪潮给现代社会带来了各种复杂性。网络复杂性在于经济信息化和信息网络化,而经济信息化是工业社会向信息社会发展的动态过程,它一方面依靠信息技术的产业化,另一方面依靠传统产业的信息化。其根本标志是信息成为社会经济的最重要的战略资源。信息网络化虽然以互联网络或信息高速公路为物质基础,但其内涵主要在于人类经济行为方式的变革:经济行为人上网交易;电子货币悄然兴起;网络金融蓬勃发展;网络管理渐成时尚;信息网络对资源配置的调节范围和调节作用逐渐加大。至于网络经济生成的根本原因,经济学界有两种说法,或者认为在于某些西方学者所说的数字化革命和信息传输效率的飞速提高,或者认为在于交易费用的差异和网络经济效应的存在。

通过理论分析可以证明,网络经济具有明显的外部经济性和复合经济效应。网络经济的外部经济性来源于网络自身的组织系统性、网络内部信息流的交互性和网络基础设施的长期垄断性。由于网络交易边际成本递减趋势的存在和网络信息价值的累积增殖及传递效应,使网络经济边际收益呈现出规模递增的趋势。从投入产出分析可以进一步在宏观上说明网络经济的乘数效应。从产业内部组织结构分析还可以总结出网络经济具有独特的范围经济性和复合经济效应。这些理论观点都突破了主流经济学的理论框架,为经济学注入了崭新的内容。

对于金融复杂性,新货币主义的核心理论很简单:经济周期归根结底是由货币供求引起的,货币供应量大于需求量即造成经济过热,供应量小于需求量即造成经济衰退。中央银行应该采取积极的反周期行动来控制货币供应量,在经济下滑的时候大量注入货币,使它们从银行系统源源不断地涌入实质经济,维持物价

水平和人民信心,最终导致经济的整体复苏。凯恩斯主义鼓吹的财政政策,在货币主义者眼中是劣等的、无效的、只有短期作用的政策,因为经济衰退不是由需求不足引起的,根本不需要政府增加额外的需求,政府通过增税和举债创造的需求将挤出私人需求,对长期经济发展毫无用处。

令人遗憾的是,主流经济学的基础理论不探讨或很少考虑与增加虚拟资本存量有关的投资、与价值链无关的二级证券市场和金融衍生产品及其交易,也不探讨或很少考虑国际资本流动对主权国家的经济带来一系列诸如通货膨胀、资产泡沫及破裂、货币贬值、股市震荡、房地产市场波动等的冲击。

迄今为止,对于企业、消费者、市场组织、分工、区域经济、国民收入、利率和汇率、增长和经济周期、产业结构、跨国公司、开放经济、全球一体化等一系列微观、宏观经济和世界经济问题,主流经济学尚未有统一的分析框架。即使对于微观经济和宏观经济问题,主流经济学也缺乏令人信服的统一分析和解释。在经济学家和金融专家中,做“事后”诸葛亮的人数远远大于做“事前”、“事中”诸葛亮的人数。

对于近三十年来发生的一系列金融危机,国内外的各种分析由于经济学缺乏适当的分析框架和理论基础而停留在某一层面或范围,主要有(1)最直接最简单最肤浅的分析:货币政策、企业盈利和股民心理^[48]; (2)进一步的分析:国内和国外借贷关系中的双重代理和共同代理^[49]; (3)虽然更为深刻但又适用于任何基本经济问题的分析:各种行为人的利益冲突(包括关系到国家利益的战争)^[50]; (4)虽然接近系统但又只适用于某种经济体系问题的分析:体制的不完善和政府无能^[51],等等。按照这些分析,人们对于金融危机只能得出“头痛医头”、“脚痛医脚”的被动补救方案,或提出看似面面俱到、但治标不治本的被动防范措施。

对于2007年以来的次贷危机以及由此引发的全球经济危机,各派经济学家都给出了答案,这些答案可以归为两大类——“暂时性”的答复,和“结构性”的答复。持有“暂时性”观点的人认为,次贷危机是由短期信心不足或投资需求不足导致的,全球经济发展的轨迹没有问题,根基没有动摇;金融创新和技术创新给经济带来的推动是真实的,次贷危机只是某些瑕疵的总爆发,不能抹杀过去十几年的创新成就。与此相反,持有“结构性”观点的人认为,1998年以来的全球经济增长和2003年以来的全球资本市场繁荣,在根本上是不可持续的,所谓金融创新和技术创新的效果是值得怀疑的。美联储和日本央行的低利率政策固然助长了资产泡沫,但上一轮经济繁荣的本质是亚洲发展中国家扩大供给,欧美发达国家扩大消费;发达国家向发展中国家借入债务以维持消费,这些债务最终压垮了发达经

济体,发展中国家也面临着巨大的产能过剩,整个经济发展模式难以持续。

既然货币主义的宏大实验已经以失败告终,现在登上舞台的所有理论无非都是对货币主义的反动。“传统的货币主义”认为现在的货币主义早已走上歧路,货币供应量的增长率应该是恒定的,中央银行应该由某种精密的电脑程序取代,不应该承担反商业周期的职能。凯恩斯主义认为货币供应量决定经济活动的逻辑已然失败,现代市场缺乏自我平衡机制,政府应该承担更多的指导经济的职能。然而,以上两种观点都在历史上得到过实验的机会。新凯恩斯主义早已与新货币主义合流,政策制订者在平时是货币主义者,在危机到来时又变成了新凯恩斯主义者,这里面没有任何新意可言。

奥地利学派对本次危机的许多解释,比货币主义和凯恩斯主义似乎更加精确。新古典主义的解释也很有说服力,但他们没有什么积极的政策建议。古典主义、马克思主义、凯恩斯主义、供给主义和货币主义都在历史上获得了实践的机会,而奥地利学派却从未获得主流的承认,更不要说主宰国家政策。

对发达国家和发展中国家实行双重标准的新自由主义经济思潮,其目标是建立以发达国家为主导的全球经济秩序和资本主义的全球扩张。其结果,一方面拓展了资本主义生存和发展的空间,在一定程度上使资本主义的基本矛盾有所缓和;另一方面又造成了世界资本主义体系新的矛盾和危机,特别是加剧了发达国家内部以及发达国家和发展中国家之间的贫富两极分化,引发了国家层面的反对新自由主义经济思潮的斗争。

种种迹象及分析结果表明:

肇始于2007年、爆发于2008年的世界金融危机和经济大衰退已经加深并扩大,世界经济的复苏在比较长的时期之后。

近几十年来发生的一系列金融危机及不久前发生的世界金融危机和经济大衰退,已经并将进一步宣告:

在经济领域,披着新自由主义外衣的现代蒙昧主义和披着新国家主义外衣的现代蒙昧主义正在将现代社会经济引向歧途。

二

按照本书的分析来看,根本问题在于,当代世界经济的制度安排和金融体制基本上已远远滞后于经济的信息化、网络化、全球化发展^{[52]-[60]}。不论对于新凯

恩斯主义还是对于新货币主义,都需要我们作出全面改进^{[58]-[68]}。进而言之,不论对于新国家主义还是对于新自由主义,都需要我们进行全面超越^{[66]-[73]}。

本书作者一直认为,对于首先发生于虚拟资本市场的一系列金融危机,我们必须面向价值链、虚拟资本和全球互联网络,进而面向厂商主导的市场配置、政府主导的规划配置和公众主导的网络配置,将体现实质经济的全球价值链联系起来进行全面、深入、系统的分析。

在当代社会复杂经济体系中,随着价值链及其再生产体系不断地由产品价值链及其再生产体系扩展成为企业价值链及其再生产体系、产业价值链及其再生产体系,进而扩展成为国民价值链及其再生产体系,乃至扩展成为全球价值链及其再生产体系,各级各类商品市场的基本模式或格局发生了一系列的变化:在不改变新古典经济学有关市场类型的基本假设的前提下,不论新古典经济学所研究的完全竞争市场,还是新古典经济学所研究的垄断竞争市场,或是新古典经济学所研究的完全垄断市场,它们都从纯粹的简单性类型向变异或混合的复杂性类型转化。随着经济信息化、网络化和全球化的不断推进,多层级的价值链上的合作和竞争与商品市场上的竞争和合作有着越来越密切的联系。

在当代社会复杂经济体系中,不仅价值链在不断扩展而成为多层级的全球价值链及其再生产体系,而且融资链也在不断扩展而成为多层级的全球融资链及其金融衍生体系。

在本书作者看来,以新古典为主流的现代经济学基本上是以独立于价值链的经济行为人及其所面对的市场为研究对象,缺乏对处于价值链上的经济行为人及其所面对的市场进行深入、系统的分析和研究。不论从实践的进一步发展还是从学术本身的进一步提升来看,都需要将多层级的价值链上的合作和竞争与商品市场上的竞争和合作有着越来越密切的联系起来,将多层级的价值链分析与市场分析紧密结合起来,进而将独立于价值链分析的市场均衡分析拓展成为基于价值链分析的完备市场均衡分析。

如何超越“知识论”的博弈分析范式(框架)、超越“进化论”的博弈分析范式(框架)并进而超越“主观论”的博弈分析范式(框架),从自然因素、技术因素和生态环境因素等方面探讨复杂经济大系统的动力效应基础,从而在建立资源配置动力学、系统功效价值论和对冲均衡经济学的基础上建立有关大量理性人互动行为及组织的全新博弈分析,这是本书部分章节主要探讨的问题和内容。

面向价值链、虚拟资本和全球互联网络,进而面向厂商主导的市场配置、政府主导的规划配置和公众主导的网络配置,本书作者试图超越主流经济学的“交易

成本—博弈收益”分析框架,进而超越博弈论的分析框架,首先从自然因素、技术水平和生态环境等方面探讨分析复杂经济大系统的基础动力问题。对于复杂经济大系统,本书作者探讨从基本动力效应关系、基础动力效应关系、系统状态变量和系统响应行为上建立分析原理。由此基础出发,本书作者揭示出经济复杂性现象的基本性质和因果关系,探讨建立经济大系统完备协同因子动力学理论,进而探讨建立经济大系统博弈组织协同学理论。

在同类产品的同一价值链内部,相关经济行为人之合作在于共同努力增加产品的价值总量,即相关经济行为人为共同做大“蛋糕”而合作;相关经济行为人之竞争在于各自争取获取产品的最大附加值,即相关经济行为人为各自切取“蛋糕”而竞争。

在同类产品的各个价值链之间,虽然提供同类产品的经济行为人在商品市场上为各自切取“蛋糕”而处于某种竞争关系之中,但是,它们在各自的价值链上由于处于同等环节或同等层级,为共同做大“蛋糕”而共同努力扩大本环节或本层级上的附加值比重,因而在双方的国民价值链上又处于某种合作关系之中。

当代社会经济既不是可以简单归结为与生产和技术密切相关的实物经济,也不是可以简单归结为与投机和金融密切相关的货币经济。在现代国际分工孕育下的全球价值链体系中,各国、各地区、各产业、各厂商处于全球价值链体系的不同端点而获取差别极大的利润;关键的是,拥有国际货币发行权就拥有吞噬全球财富、并通过另一通道而不断增加流动性的黑洞。资本证券化使得现代金融体系分解为两部分:一是直接参与全球价值链体系循环运动过程、因而与价值创造有密切关系的实体性金融部分;二是脱离全球价值链体系循环运动过程、因而与价值创造没有直接关系的虚拟性金融部分。资本虚拟化的证券资本市场一方面源源不断地向全球价值链体系注入流动性,另一方面又脱离全球价值链体系而不断进行毫无节制的自我扩张。

全球价值链体系内的资金流量与全球虚拟资本流量没有可比较性(一种流行的可笑做法是非要用虚拟资本流量与GDP做比较),不过,全球虚拟资本流量保持一定规模对于不断增加全球价值链体系内的资金流量是有好处的。但是,当全球虚拟资本流量远远大于全球价值链体系内的资金流量时,风险程度也就越来越大。所有为规避风险而做的种种努力往往使总的金融风险越来越大。

在各种“伟大”的博弈、乃至在各种庞大赌博的强行推动下,资本虚拟化的金融体系越来越庞大。而虚拟资本市场体系越庞大,泡沫就越大,风险也越大。美元发行机制是不断增加流动性、催生一系列金融泡沫的总动力源。越来越庞大的

虚拟资本市场体系对全球价值链体系的影响越来越大。金融危机一旦发生,大量资本会在转瞬间消失,意味着财富遭遇大规模洗劫,而且,这种洗劫往往具有跨国性质。在金融危机的巨大冲击下,实质经济的资金链条遭到破坏,社会信用体系受到重创,社会经济活动受到严重影响,民众心理受到极大摧残,政府威信和信心受到严厉打击……

由美国战略学家迈克尔·波特(Michael E. Porter)提出的价值链分析法^[74](Value Chain Model)为我们对企业的价值创造活动进行广泛而深入的分析提供了一个很好的工具。不过,这种分析法还只是一种分析技术(体系),是管理学或工程学方面的分析方法。它还需要适当的资源配置理论或系统科学的动力学和经济学价值理论或系统科学价值理论作为自己的基础。显然,对于价值链,尤其对于全球价值链,古典经济学的劳动价值论和现代经济学的边际效用价值理论都不是适当的基础。

全球价值链需要相应的经济学价值理论作为基础。全球价值链与全球融资链的对应关系越来越模糊。融资链实际上早已分成两部分:一部分是以未证券化的资本为主,另一部分是以证券化的资本为主。前者进入价值链,参与价值创造过程;而后者脱离价值链,与价值创造没有直接关系。金融工程、金融创新越是迅猛,金融产品的种类和数量就越多,虚拟化的融资链离开价值链就越远。游离于价值链创造体系的跨国流动性是产生金融危机的温床。全球巨大的资产泡沫存在,表明国际货币体系不合理。

以本书的分析来看,当代社会经济一方面可以归结为以价值链系统为基础、以技术和产品市场为基本构成的“实在功效经济”,另一方面可以归结为以融资链系统为基础、以货币和资本市场为基本构成的“虚拟功效经济”。实在功效经济包括实物经济、电子虚拟技术经济和网络信息经济。虚拟功效经济包括金融产品市场经济、房地产市场经济和金融衍生产品市场经济。

以本书的分析来看,现代社会经济的结构性问题既不是单纯的实在功效经济的结构性问题,也不是单纯的虚拟功效经济的结构性问题,而是广义经济的结构性问题——对冲均衡经济的结构性问题;现代社会经济的周期性问题既不是单纯的实在功效经济的周期性问题,也不是单纯的虚拟功效经济的周期性问题,而是广义经济的周期性问题——对冲均衡经济的周期性问题。既要研究技术、政治经济体制、自然资源对实在功效经济的冲击,又要研究资本、金融市场体制、信息资源对虚拟功效经济的冲击。

本书作者在1996年曾系统地建立一种全新的价值理论——系统功效价值理

论^[13,14]。这种理论既可以看作全新的经济学价值理论,又可以看作首次建立的系统科学价值理论。

而系统功效价值理论又有自己的动力学基础。这就是本书作者在1996年曾系统地建立的一种全新的、可看作系统科学动力学的理论——资源配置动力学理论^[13,14]。

在知识化、网络化和全球化背景下,本书作者从资源配置静力学研究,转向资源配置动力学研究;从产品价值论(劳动价值论和边际效用价值论)研究,转向系统功效价值论研究;从简单系统经济研究,转向将内部功效经济和外部功效经济结合起来的系统组织对冲均衡经济研究;从简单产品经济研究,转向将高端产品经济和低端产品经济结合起来的价值系统对冲均衡经济研究;从简单实物经济研究,转向将实在功效经济和虚拟功效经济结合起来的完备组织对冲均衡经济研究;从简单市场经济研究,转向将竞争组织经济和合作组织经济结合起来的博弈组织对冲均衡经济研究;从制度安排研究,转向完备因子协同学研究;从制度变迁研究,转向博弈组织协同学研究。通过这些努力,初步创立由“资源配置动力学”、“系统功效价值论”、“对冲均衡经济学”和“完备组织协同学理论”等构成的后现代经济科学的理论基础体系。

基于独立自主建立的资源配置动力学和系统功效价值论,本书作者试图建立一种可称为“对冲均衡经济学”的全新经济学理论。这种新经济学内容主要包括:在内部功效经济和外部功效经济之间形成的系统组织对冲均衡经济,这种经济与制度创新有关;在高端产品经济和低端产品经济之间形成的价值系统对冲均衡经济,这种经济与技术看创新有关;在实在功效经济和虚拟功效经济之间形成的完备组织对冲均衡经济,这种经济与金融创新有关;在竞争组织经济和合作组织经济之间形成的博弈组织对冲均衡经济,这种经济与组织创新有关。

价值链及全球价值链体系是一种十分复杂的体系,对这种复杂系统的研究需要相应的方法论基础。本书作者曾试图将非线性随机动力学和博弈论及非线性规划论结合起来,建立一种适用于复杂系统及其组织的新协同学^[14-28],可称之为完备组织协同学,或博弈组织协同学。这个理论可作为价值链和融资链研究的科学方法论基础。

在整个科学发展的过程中,那些早先发展起来的成熟科学总是成为晚近得到发展的后起科学的典范;前者在研究方法、研究纲领、分析框架、分析手段和评价标准等方面为后者提供范例,后者则在前者的示范效应下亦步亦趋,逐步获得进步。经济学就是这样一个亦步亦趋、正在逐步发展的后起科学,虽然在社会科学

领域它是一个比较成熟的科学。在整个科学发展的历史长河中,经济学发展的主流与整个科学发展的总潮流并不总是一致:它们时而相近,时而相远;时而相合,时而相左;呈现纷繁复杂的局面。

二十多年来,本书作者在努力探索经济及金融复杂性问题的同时,总是致力于探讨创造基于西方思维和东方智慧的崭新知识体系问题。这种探讨涉及自然观和社会观、价值论和逻辑学、科学方法论和复杂性科学,涉及数学工具和分析技术、部门科学和横断科学、交叉科学和综合科学,还涉及思维方式和基本理念、科学基础和文化体系、社会规范和价值体系,等等。

在当代社会历史条件下,经济科学的创新与社会经济中出现的各种新关系、新过程和新趋向有密切关系。当代社会经济新关系将会涉及:虚拟经济关系、联盟经济关系、知识经济关系和生态经济关系。当代社会经济新过程将会涉及:经济的电子化、经济的网络化、经济的衍生化和经济的智能化。当代社会经济新趋势将会涉及:城镇经济一体化、区域经济一体化和全球经济一体化。面对当代社会经济中不断出现的各种技术创新、管理创新、组织创新和体制创新,整个经济科学需要拓展并深化自己的理论基础,需要改进并扩充自己的研究框架,需要更新并丰富自己的研究内容。

自二十世纪80年代中后期以来,主流经济学开始在某些局部改进自己的分析框架,开始在个别方面调整自己的发展方向。面对技术进步、生产率的提高、个人间相互作用和相互依存程度的增长、整个人类社会所拥有的知识的迅速增加、市场一体化程度和市场容量的增大、资产重组、产权组织创新、电子商务的兴起以及个人专业化程度和全社会职业多样化程度的提高等,先后出现一些无法用新古典分析框架限定的经济理论。这些经济理论起初小心翼翼地主流经济学之外徘徊,后来逐渐走向或汇入经济学主流。从较早的文献“经济史中的结构与变迁”^[75]、“人类行为的经济分析”^[76]、“集体行动的逻辑”^[77]、“宏观经济学:非瓦尔拉斯分析方法导论”^[78],到Hart. O, Stiglitz. J.的“契约经济学”^[79]、Demsetz. H.的“所有权、控制与企业”^[80]、Dietrich. M.的“交易成本经济学”^[81]、杨小凯-黄有光的“专业化与经济组织”^[82]、平乔维奇斯的“产权经济学”^[83]、Williamson. O.的“反托拉斯经济学”^[84]、Stevens. B.的“集体选择经济学”^[85]等国际上新近出版的经济学文献;从海闻、林德特. P.的“国际贸易”^[86]、陆懋祖的“高等时间序列经济计量学”^[87],到其他经济学者的“中国的过渡经济学”、“现代经济增长中的结构效应”、“低效率经济学:集权体制理论的重新思考”和“经济体制效率分析导论”等^{[88]-[91]},都从不同方面、不同范围改进新古典经济分析框架,扩充主流经济学的内容。

对于全球价值链、虚拟资本和国际货币,经济学理论和方法的创新与发展任重而道远。在这里,容易引起歧义和分析混乱,但对于经济学重建又是必需加以厘清的两个概念:“实质经济”与“虚拟经济”。实际上,经济领域有三重虚拟化:源于虚拟资本交易的经济虚拟化;源于电子信息和网络技术的经济虚拟化;源于用新技术模拟真实世界的经济虚拟化。第一种虚拟化越来越远离全球价值链创造体系,后两种虚拟化进入全球价值链创造体系并为全球价值链注入新的因素——信息、知识和智能。在经济的三种虚拟化之间有一种相互拉动、相互激发、相互推动的关系。为避免引起歧义和分析混乱,本书作者将不采用“虚拟经济”这个概念,而只分别探讨“虚拟资本交易”、“虚拟资本市场”或“证券市场”、“金融衍生产品”及“金融衍生产品市场”,等等。

我们还必须搞清“价值链”及“全球价值链”、“跨国流动性”、“市场有效性”和“政府有效性”及“跨国共同体有效性”、“利益共同点”及“全球共同体组织”、“知识产权”与国际货币制度,等等问题。

本书第三章将从复杂经济大系统的内外部协同关系上深入、系统地探讨复杂经济大系统组织合理化机制问题,提出如下两类协同组织机制设计:

ISM——复杂经济大系统的内部集中、分散和集散机制设计

ESM——复杂经济大系统的外部集中、分散和集散机制设计

在复杂的社会经济大系统中,复杂经济大系统的内部集中、分散和集散机制与复杂经济大系统的外部集中、分散和集散机制,这两种类型的协同组织机制具有相互替代或相互补充的关系。

进一步地,本书第三章将从经济基础结构上深入、系统地探讨产业技术构成合理化机制问题,提出如下四种资源配置机制设计:

满足协调优先原则的产业技术构成最优竞标选择机制设计

满足效率优先原则的技术主导模式评审有效选择机制设计

满足协调优先原则的社会知识构成最优竞标选择机制设计

满足效率优先原则的知识主导模式学术评价选择机制设计

在复杂的社会经济大系统中,满足协调优先原则的产业技术构成最优竞标选择机制、满足效率优先原则的技术主导模式评审有效选择机制、满足协调优先原则的社会知识构成最优竞标选择机制、满足效率优先原则的知识主导模式学术评价选择机制,这四种类型的经济技术动力配置机制具有相互替代或相互补充的关系。

三

作为发展经济学的完全拓展与创新,同时作为微观经济学、宏观经济学和世界经济学的系统综合与统一,本书将要建立的“对冲均衡经济学”和“博弈组织协同学”,以知识经济为背景,面对全球价值链(价值创造体系)和全球融资链(价值转移体系)。

在全新的经济学分析中,我们应当按照经济行为人与价值链的联系程度,将各种经济行为人分为两类,即:独立于价值链的经济行为人和处于价值链上的经济行为人。与此相应地,我们可以将经济行为人所面对的各种市场分为两类,即:独立于价值链的经济行为人所面对的市场和处于价值链上的经济行为人所面对的市场。

对于不同组织类型的市场,我们应考虑如下四个层级的问题:(1)基于产品价值链,由部门内外部既合作、又竞争的关系衍生出企业价值链;(2)基于企业价值链,由厂商内外部既合作、又竞争的关系衍生出产业价值链;(3)基于产业价值链,由区域内外部既合作、又竞争的关系衍生出国民价值链;(4)基于国民价值链,由国家内外部既合作、又竞争的关系衍生出全球价值链。

对于本书将要建立的对冲均衡经济学和博弈组织协同学,分析框架必定是一种复杂而丰富的概念及范畴体系。大体上看来,此分析框架至少包括三个部分,即:总体分析框架、基础分析框架、基本分析框架和组织分析框架。

作为本书建立的新经济学总体分析框架的基本组成部分,概念及范畴体系至少包含四个层系,即:基础层系、基本层系、核心层系以及关键层系和行为层系。基础层系既涉及资源配置动力学体系及其趋向函数和约束条件,又涉及系统功效价值的实体及其社会必要的均衡条件;一般层系涉及全球价值链(价值创造体系)和全球融资链(价值转移体系),它极大地扩展了主流经济学的研究领域;核心层系涉及“跨国共同体”及其有效性或“全球共同体”及其有效性;关键层系涉及信用本位制向知识本位制变迁的必要性和可能性;行为层系涉及源于电子信息技术和网络技术、并通过资本的跨国流动性而不断得到强化的虚拟化,源于以现代技术模拟或虚构真实世界、并通过资本的跨国流动性而不断得到强化的虚拟化,以及源于资本的虚拟化(如证券化)、并通过资本的跨国流动性而不断得到强化的虚拟化。

作为本书建立的新经济学总体分析框架的基本组成部分,概念及范畴体系涉及影响控制参量、涨落和序参量的基本动力学关系和因素。这种基本动力学关系和因素由“资源配置力”与“资源荷载”、“系统功效”与“系统损耗”构成。资源配置与资源荷载之间关系对比的变化最终影响各个子系统采用何种组织类型和何种运动模式的可能性(基本动力条件和可行性)或最终影响整个复杂大系统以何种组织类型为主导和以何种运动模式为主导的可能性(基本动力条件和可行性),而系统功效与系统损耗之间关系对比的变化最终影响各个子系统采用何种组织类型和何种运动模式的必要性(基本效应条件和有效性)或最终影响整个复杂大系统以何种组织类型为主导和以何种运动模式为主导的必要性(基本效应条件和有效性)。

作为本书建立的新经济学总体分析框架的基本组成部分,概念及范畴体系涉及内部功效经济和外部功效经济之间的系统组织对冲均衡性、高端产品经济和低端产品经济之间的价值系统对冲均衡性、实在功效经济和虚拟功效经济之间的完备组织对冲均衡性以及竞争组织经济和合作组织经济之间的博弈组织对冲均衡性。我们不仅要考虑增加实际资本存量的投资,而且要考虑增加虚拟资本存量的投资;提出具有灵活性偏好的“博弈性偏好”,探讨与价值链有关和无关的本原货币需求、衍生货币需求以及本原货币供给和衍生货币供给;探讨实质经济的均衡国民收入与虚拟资本市场的均衡投资收入,进而探讨本原及衍生货币、资本价格和总体经济收入之间的关系;在此基础上,探讨对 IS-LM 模型(Hansen-Hicks 模型)的拓展,进而探讨对 M-F 模型(Mundell-Flemming 模型)的拓展。

作为本书建立的新经济学总体分析框架的基本组成部分,概念及范畴体系涉及“跨国共同体”及其有效性或“全球共同体”及其有效性,因而涉及博弈规则协同学分析基础、博弈模式协同学分析基础和博弈组织协同学分析基础。早期博弈规则协同学变量的整个空间由早期博弈群组构形、早期博弈趋向参数和早期博弈态势矢量构成。产业博弈规则协同学变量的整个空间由产业博弈群组构形、产业博弈趋向参数和产业博弈态势矢量构成。现代博弈规则协同学变量的整个空间由现代博弈群组构形、现代博弈趋向参数和现代博弈态势矢量构成。

当代市场体系是由实在功效产品市场与虚拟功效产品市场交叠对冲而形成的复杂体系。在实在功效产品市场方面,既有完全竞争型的消费产品市场、竞争垄断型的消费产品市场、垄断竞争型的消费产品市场、完全垄断型的消费产品市场,又有完全竞争型的生产要素市场、竞争垄断型的生产要素市场、垄断竞争型的生产要素市场、完全垄断型的生产要素市场;在虚拟功效产品市场方面,既有完全