

为什么“ 边际效用递减 ”？

为什么边际效用递减？这个问题我从十年前做学生时就想，说也奇怪，问了不少老师和同事，就只有与我同在香港大学经济系任教的霍尔（Chirstphor Hall）告诉我说他也在思考这同一个问题。霍尔是个勤于思考但‘不务正业’的微观经济理论家，早年发表了两篇小有名气的论文，就一直‘优哉游哉’着。去年暑假结束碰到他，他说他刚从秘鲁高原上回来。最近更‘看破红尘’，放弃终身教职，驾着自己心爱的游艇航行太平洋去了。

消费的‘边际效用递减’律，这还不明白吗？正常人吃‘正常’的东西，在单位时间内吃得越多，就越吃不下去。这是人情。再者，生理心理学教程早就有‘韦伯定律’——神经元对等量外界刺激的条件反射强度随刺激次数的增加而递减。人还不就是神经元拼起来的，微观上正确的定律，反映到了人体宏观层次想必就是‘边际效用递减’律了。这

条规律也许有例外，例如吸毒和酗酒，单位时间内摄入的量越大，消费者所欲望的摄入量就越大。所以对“边际效用递减”效应的最粗浅解释首先就应当返回到“韦伯定律”。像吸毒和酗酒这类消费行为，其目的在于产生‘刺激’，所以和‘正常’消费不同，“边际效用递减”律不成立。但是这仍然符合“韦伯定律”，因为正是‘刺激’本身随着刺激次数的增加而递减，所以为了消费同等强度的刺激就必须消费得越来越多。

这就带出了同样可以认为是经济学基本问题的另一个相关的问题：为什么人们喜欢“新鲜”事物？换句话说为什么人们有‘好奇心’？这后一个问题可是非同小可，整个东西方哲学的发展据雅斯贝斯说，就是起源于（轴心时代）人的好奇心，“哲学’的希腊语词就是‘爱(philo-)智(sophy)’”。不过雅斯贝斯的这个看法是否适合中国哲学就值得探究了。老子说“常有欲以观其妙，常无欲以观其徼”，你要看到宇宙本质就得断绝一切欲望。“爱智”，我说不准是不是应当算做‘欲望’的一种（例如唯识宗讲的‘阿赖耶识’），反正这里边儿东西哲学的差异大了去啦。

经济学需要“边际效用递减”的假设，在方法

论上是因为（我想我以前一定说过许多遍这个道理，所以现在总想省略了它），如果没有这个假设，消费行为就可能不稳定。所谓‘稳定’的消费行为是指在收入不变的情况下，消费者选择的消费品种类和数量不会随着物价的轻微波动而发生跳跃性的（间断性的）变化。试想象你自己是两类物品（例如广东菜和四川菜）的消费者，假定你每月用于这两类菜肴的总开支以及菜的价格是固定不变的。边际效用递减，就意味着如果你死盯着一类菜吃 1 个月甚至更长久，你肯定觉得越来越难吃，觉得这钱花的越来越不理性的。奥地利学派的创始人门格尔最早系统地整理了消费心理，提出奥地利学派价值理论。按照他的理论，你的消费最后可以调整得充分理性，使你觉得把花在广东菜上的 1 块钱改花在四川菜上，或反过来把四川菜的钱放在广东菜上，对你没有什么大不了的差别。但是这绝不意味着你觉得把消费在广东菜上的大部分钱放在四川菜消费上（或反过来）没有什么差别。所以上述的‘无差别’是在‘边际’意义上的无差别，不是对消费的大规模变化的无差别。同样道理，如果你请朋友到饭馆吃饭，你点的菜大体上应当是荤素相配，而不应当是满桌子的东坡肘。总而言

之，边际效用递减就意味着“什么都来点儿（do everything a little）”。而边际意义上的‘无差别’，意味着什么都来点儿直到所有东西的边际效用（以任一样东西的边际效用做尺度）都相等。这个最佳消费组合是稳定的，因为当任何一样东西的价格发生轻微变化时，相当于在最佳消费组合中花费在这种东西上的开支现在可以购买‘更多’的这种东西，但是这个‘更多’仅仅是一点点，因为价格变化是轻微的。更重要的是，当你实际上消费了“更多”的这种东西时，由于边际效用递减律，这个“更多”的消费并不产生‘更多’的边际效用，在通常的情况下，它只能带来这个东西对你而言的减少了的边际效用，从而你的意志不会被调动起来去追求消费更多的这种东西。因此，边际效用递减保证了消费均衡是稳定的。

不过当消费品是可以‘上瘾’的东西时，更多的（不论是‘边际’的还是整体的）刺激导致更强烈的追求刺激的意志，消费就不是稳定的了。这在数学上表现为边际效用递增。所以消费理论通常假设所消费的是‘正常’的东西，不是可以‘上瘾’的东西（关于可以‘上瘾’的东西的消费，参见我为《经济研究》1996年写的一篇文章《知识互补性，

专业化与传统》)。边际效用递增的消费和生产导致了专业化。虽然专业化意味着规模收益从而经济发展,但是专业化也意味着在自己专业之外的全部领域里依赖别人,依赖那些你从来不认识的人的努力和道德意识。我为什么要相信今天夜里我住的楼房不会因为当年打地基的那个工人的粗心和质量检验的疏忽而突然倒塌呢?我为什么要相信刚才上街时那个迎面而来的汽车的司机不会突发奇想把我轧死呢?我为什么要相信这个刚刚从安徽农村来的小姑娘不会在我喝的汤里下毒药呢 若登斯在他关于‘现代性’的著作里把专业化带来的这类风险说得更加邪乎,说成是‘时空的断裂’(参见黄平《解读现代性》,《读书》1996年6月)。不论如何,当你觉得没有人可以依赖时,你是绝不会‘专业化’你自己的,因为那无疑意味着自杀。同样,当人类面对着大自然的变化无常和不可信赖时,人类不应当使自己‘专业化’在某种生活方式里。

经济学需要‘边际效用递减’假设,是因为经济学是关于理性选择(即选择的一致性,稳定性,可预期性)的学问。如果沿着演进观点来解释消费行为,是否就可以放弃这个理性假设呢 我在另一

篇文章里(《从交易费用到博弈均衡》，《经济研究》1995 年 9 月)介绍过，艾智仁(A. Alchian)最早提出猜想：理性假设与演进观点在解释经济行为时是等价的。我和霍尔经过讨论提出这样一个演进观点来解释‘边际效用递减’现象(注意，我们是要解释这个现象，而不是以这个现象做为理论的前提假设)如果一群生物，它们的口味(偏好)不是‘边际效用递减’的，那么根据上面的讨论，它们一定会消费某种物品直到‘上瘾’的状态，形成难以改变的消费习惯。这样的物种能否适应残酷的生存竞争呢 按照主流的演进理论(非主流的理论包括‘内因突变’说)，这个物种是要灭亡的。因为自然环境一旦改变，食物供给结构也跟着改变，这个生物群体的消费‘习惯’就必须随之改变，否则就面临灭种的前途。此所谓‘天若有情天亦老，人间正道是沧桑。’习惯或传统，既不能没有，又不能不变。否则物种是生存不下来的。所以，从演进观点来看，那些最初存在过的不符合“‘边际效用递减’假设的种群经过了漫长的演化大多灭种了，剩下来的，我们今天观察到的物种一定是符合‘边际效用递减’律的种群。

这个演进观点的解释进一步意味着：那些行

为与“边际效用递减”律相符合的物种，它们的传统必定具有某种“灵活性”，它们必定具有不断创新的能力。否则，“一条道儿走到黑”（也叫“上癮”），哪里生存得到现在呢？

从上面关于“创新原则”的推论进一步推论，就回到文章开始就提出来的第二个问题了：为什么人们有好奇心？从演进观点对这个问题给出的解答与上面的几乎一样：那些完全没有好奇心的物种必定没有任何创新的能力，从而在很久以前就从地球上消亡了。

康德《道德形而上学》导言）说：人之所以为“人”，是因为人具有“持续存在(being)”的能力（我的翻译必须不同于出现在康德以后的“存在哲学”的术语）。什么叫做“持续存在”的能力呢？从生物求生的本能经过长期演化发展出来的“人”的持续存在的能力，人的不固守传统的能力，不正是上面说的“灵活性”吗？不正是对人的生存发展至为重要的“好奇心”吗？

我的这些超出了经济学范围的“解释”，从来没有同霍尔交流过。我和他的交谈，以及和任何人的交谈，最有意义的事情只是启发我自己的思考。我相信这个判断同样适用于读者诸君与其他人交

谈的场合（参见我在《读书》1996年3月的文章《不可能的思考》，笔名‘安力’）。但是颇为重要的是，那些思想比较深刻的人，不论‘分工’在哪一个领域内，他们的交谈总能‘超越’他们讨论的专业题目。因为任何‘超越’都必须发生在专业领域的“初始点”也叫‘边界’，而所谓‘深刻’至少应当包括思考了专业领域内部的全部问题及至这一领域的边界。霍尔走了，飘泊在太平洋上。我也走了，游荡在欧洲大陆。我们没有互相留下地址，就好像苍穹中两颗偶然相遇又擦肩而过的流星。

谨以此文纪念世上所有这一类的‘交流’。记住：在经济学一个最基本假设的背后永远跃动着的，是人的创新精神。那是普罗米修斯带给我们的“火”，是希腊人的‘爱智’，也是中国人的‘天问’。

（原载《经济学消息报》1996年8月2日，
这里作了修改）

为什么“平均成本递增”？

与前一个“为什么”一样，这也是我十年前做学生时思考过的问题。不过这一次我的对话者不是活着的任何人，我的对话者是希克斯 (J. R. Hicks)。

“平均成本递增”是指当产出规模增加时，单位产出的价值成本上升。新古典经济学对这个问题只提供过一个几乎不着边际的解答：在任何给定的时期，当产出规模不断上升时，必定会有某些“要素”变得供不应求，成为生产的“瓶颈”，从而导致对其它投入的收益递减（收益是以产出的单位度量的）。我自信我所概括的这个新古典解答要比我见过的那些新古典教科书上相关的讨论更全面更“新古典”。不过它仍然是“几乎不着边际的”。

现在的经济系研究生，动辄就画出一条澡盆形“平均成本曲线”，然后再加上一条相应的“边际成本曲线”，就可以讨论微观供给行为了。不过大

部分学生在大多数场合讨论的问题只涉及这条平均成本曲线的‘定常规模收益’阶段,因为只有那一段曲线是与新古典完全竞争假设完全一致的。你若是追究到曲线的其它段落,例如平均成本下降的阶段(规模收益递增),涉及劳动分工与专业化的根本原因时,学生们(只知道背书的学生)会不知所云地瞎说一通或者干脆就不知道问题的意义是什么。读者如果要试试自己的经济学训练是否超过美国一些大学和香港大学的大部分研究生的水平,不妨追究一下对应于平均成本曲线上升的阶段,边际成本高于平均成本的经济学涵义,并且把这一分析同李嘉图的地租理论结合起来讨论。不过这都是‘家庭作业’,这里不再赘述。

严格地说,这条所谓的‘平均成本曲线’根本就不应当这么画!本世纪 20 和 30 年代是西方经济学‘大师辈出’的年代,也许因为市场经济体制的大变革‘呼唤着伟大的经济学家’吧。不论如何,当时在世界经济学盟主的英国经济学刊物上争论的主题之一,就是到底应不应当把造成平均成本下降,定常,和上升的三种不同因素,联合地画在同一条‘平均成本曲线’中。具体文献我是记不得了(应当是在美国计量经济学学会 1930 年代编的

一本经济学阅读文集中),不过我记得是斯拉法的观点:如果使单位成本下降的因素主要是分工与专业化,那么就不应当把‘平均成本下降’划在总产量和成本构成的平面坐标中,因为总产量作为自变量,几乎与专业化分工无关。你可以大搞总产量扩张的计划或指令经济,但却不会带来分工和专业化的深入发展,也不会有持续降低平均成本的经济绩效。亚当·斯密《原富》第一册论证的‘市场限制了分工’,那只是说明了总产量(背后是市场需求总量)是分工和专业化得以深化的‘必要条件’,但这并不是分工和专业化的‘充分条件’。前者是技术经济的,后者是制度经济的。

希克斯在 1940 年代末接着讨论上面的题目,他注意到‘利润’或者阿尔佛莱德·马歇尔的“准租(quasi-rent)”概念对企业理论的重大意义。“准租”就是只在‘短期’内存在的租(在‘长期’内则由于资源重新配置而归于消失)。希克斯的问题是:为什么在长期内‘平均成本上升’?如果一个企业能够以单位成本 C 在单位时间内生产出 Q 单位的产品 A ,那么直觉上只要再‘复制’一家这样的企业(复制需要一定的时间,相当于新古典的‘长期’生产能力调整),就应当能够在单位时间内生

产 2Q 同时保持单位成本仍然是 C。依此类推,不断复制这家企业就可以不断扩大生产规模,同时保持单位成本不变。基于这个直觉的理解,怎么会 出现“平均成本上升”呢?这个问题意味着:(1)希克斯相信在长期内存在着“平均成本上升”的现象,(2)希克斯认为新古典经济学直到本世纪四十年代末仍然没有能够解释长期平均成本上升的现象,(3)希克斯要寻找的并不是李嘉图的地租,而是马歇尔的“准租”能够长期存在的原因,但是这两类租也许有着同一个原因。

长话短说,希克斯考查的结论是:企业家能力限制了企业“复制”自身的次数,从而更大规模的生产会受到企业家经营能力的“瓶颈”限制,发生对其它投入的“规模收益递减”。所以关键在于经济学对企业家能力的理解。这个“能力”不是可以在商学院里传授的知识,否则只要培养成千上万个企业‘经理’就能解决这个‘瓶颈’问题。对奥地利学派经济学家(例如熊比特)来说,企业家能力是人身上潜在着的处理“不确定”情况的能力。企业的日常经营也许有常规可循,那是企业经理的工作,可以雇用一些经理人员,像将来可能出现的机器人那样管理企业。但是企业运作的核心不在

于遵循常规，而在于创新。这就需要企业家才能了。创新的不确定性使得任何契约注定是不完全契约，并且约定将处理不确定性所产生的利润（或亏损）归给企业家所有。因此在这样的制度之下，企业家能力可以定义为“对潜在的盈利机会的敏感性”。

既然企业家能力的‘稀缺性’是长期内平均成本上升的原因，一个有效率的经济制度就必须能够激发人的最大限度的企业家能力。古典经济学提倡的竞争原则当然是一个有效途径。因为对利润的竞争以及竞争失败的后果，在许多情况下确实激发人的企业家能力。这个题目容我另外讨论。这个竞争原则在现代经济中还有另一方面的意义，那就是监督‘企业家-企业所有者’契约。由于熟知的理由，现代企业的契约性质往往使所有权与经营权在一定程度上分离，于是发生了企业家“怠工”的可能。资本市场的重要功能就是监督企业家。

激发企业家能力的制度，在一定程度上必须与‘平等’相联系。因为谁也无法事先知道谁身上潜藏着什么样的企业家才能。如果契约事先赋予某些人不适当的权力，就可能扼杀了其他人在未

知的‘不确定性’场合发挥企业家才能的机会。最典型如传统的计划经济体制,几乎扼杀了所有‘被计划’的人的企业家才能。名义上最‘平等’的是市场——“天生的平等派”,一切人,不论能力差异大小,都在追逐利润的角斗场上竞争。但是‘市场’几乎马上就开始异化,在头几轮竞争中获得胜利的人,本着人的天性,总是要以其实力去控制未来的竞争。因此,许多人主张政府干预市场,以求维持“竞争机会的平等”。

“机会”的平等,在这里就是‘盈利机会’的平等。谁能辨识‘盈利机会’呢?显然,如果负责维持平等的机构真能看到这些机会,那也就用不到激发什么企业家才能了。事实上任何负责维持‘机会平等’的机构,最终都只是在控制经济资源的分配。资源平等是不同于机会平等的。许多人拥有资源但看不到机会,因为他们不是那方面的企业家。在这个意义上,资源平等很可能会破坏机会平等,例如让一个天才与一个傻子分享同等的资源就等于浪费了一半的天才和 50% 的机会。

我不相信在‘道德’以外,人类能够找到其它途径走出上述的困境。市场经济越是发展到高级阶段,就越需要坚实的道德基础。关于“道德”,只

好另做文章讨论了。

我当学生时最经常与之默默对话的智者，约翰·希克斯，在几年以前作古了。他在临终前的几个月里曾经接受一位经济学家的采访（发表在 JEP 上）。他说，他作为经济学家的贡献，也许诺贝尔委员会的奖励这一次是中肯的，是努力从一个会计的角度来理解经济问题。这让我想起盛洪回忆科斯时写过：科斯总试图从律师角度来理解经济问题。可见实践出真知。希克斯临终前又说，他一生努力而未能得到满意解决的问题是利润问题，利润是怎样发生的问题。大师毕竟是大师，与马克思一样，他在这个神秘的‘利润’面前驻足不前。这也不奇怪，因为在马克思和希克斯之间还有整个奥地利学派关于‘利润’问题的努力（庞巴沃克，熊比特，米塞斯，哈耶克，……），这些努力至今仍然等待着新的努力来接续。这篇“随笔”的主题——上升的平均成本曲线，其实是‘利润’这个经济学基本问题的一个方面。我试着在“家庭作业”里讲给诸君听了：那一段上升的曲线对应着“边际成本高于平均成本”的情况，也就是说，如果竞争的市场价格等于边际成本，那么在这一阶段上的企业就获得了高于单位成本的收益——

“租”，也叫做“利润”。

企业家能力-利润-上升的平均成本曲线。谨
以此文纪念我的素不相识的老师希克斯。

（原载《经济学消息报》1996 年 8 月 9 日）

为什么“供求分析” 是经济学看家本事？

这是我做学生时思考的第三个经济学问题。所谓“看家本事”，通常不是最后一招，而是基本的一招。经济学最基本的招法就是供给需求分析，不论解释什么问题，总是先从供求分析入手，在这个基本招法之上，可以千变万化地做文章。所以，思考着的经济学家，必须对供求分析的根基做一番追究。遗憾，当学生是正在学习“规范化”的时期，许多文献的出处都不仔细记，因为不晓得那是写规范学术文章的基本功。现在要想“凭空”回忆，为读者提供这些“学生问题”的文献索引，就只有“四顾空屋而兴叹”了。这里连着出现两次的“空”字，涵义颇复杂，其最后一层意思是我刚刚搬完这个家，举目四顾，空空如家也。其它的意思以及又引申出来的意思，还是留给有心人去想吧。

须知，现在的经济学家们信手画出一条“向下