Globethics Repository



主流经济学在理性假说上的尴尬[the embarrassment of Mainstream economics in rational hypothesis]

This page was generated automatically upon download from the Globethics Repository. More information on Globethics see https://www.globethics.net. Data and content policy of Globethics Repository see https://repository.globethics.net/pages/policy.

Item Type	Preprint
Authors	左, 大培
Publisher	中国社会科学院经济研究所
Rights	With permission of the license/copyright holder
Download date	2026-11-15 21:19:38
Link to Item	http://hdl.handle.net/20.500.12424/182571

左大培：主流经济学在理性假说上的尴尬

左大培

一年前的2004年8月，郎咸平教授尖锐地指责少数“著名企业家”利用“国有企业产权改革”来瓜分国有财产，掀起了有关国有企业产权改革的大论战。关心和参与这场论战的网民几乎一边倒地支持郎咸平，围攻表态反对郎咸平的中国“主流”经济学家们。

而在这场论战刚开始的时候，几乎没有哪个有点名气的中国经济学家出来回应郎咸平的批评。这被媒体说成是“经济学界集体失语”。当媒体对郎咸平言论的报道不断升温并持续了一个时期之后，主流经济学家们终于不再“集体失语”，某些人开始发表种种言论对郎咸平进行回击。而这时他们评论国有企业产权改革大论战的典型话语，就是指责网民群众“非理性”，“情绪化”，把人民群众对前些年“国有企业改制”的批评都说成是“头脑发热”的“非理性”行为。

可是这样一来，“主流”经济学家们就将他们自己置于自相矛盾的尴尬境地：他们现在把大批民众都说成是“情绪化”的“非理性”一群，这就等于承认现实经济生活中的人并不具有完全的理性，而他们自己的经济学模型却全都以“完全理性”为分析的前提条件，他们的经济理论从来就把所有的人都看成是完全理性的。

主流微观经济学的完全理性假说

在主流经济学的微观经济理论中，一个最基本的假设前提是，所有经济活动的当事人都具有完全的理性，是“理性的经济人”。到目前为止，主流微观经济学的几乎每一条理论原理都是依据这个假设前提推导出来的。

我们不要忘记，主流经济学历来强调，它的微观经济理论首先是“实证”的，是阐述现实世界“是”怎样的。这就等于说，主流经济学的微观经济理论中描述的最优化行为，也就是现实生活中普通老百姓的经济行为，而作为这些理论分析前提的“完全理性”，也就是普通老百姓的实际情况。这就意味着，主流经济学的微观经济理论把普通老百姓都看成是具有“完全的理性”。

一个透彻的思考可以说明完全理性假设是如何不合乎实际。主流微观经济理论的最优化分析表明，主流微观经济学假设的完全理性意味着完全的推理和判断能力、完全的计算能力，以及毫无遗漏地利用现有的一切信息作出正确预见的能力。完全理性中蕴含的完全的计算能力不仅意味着可以立刻解出任何最难的问题，而且意味着计算不需要耗费成本，特别是人的精力。现实生活中的任何人都不具有这样的计算能力。我敢说，有这样完全计算能力的人过去从来没有出现过，将来也不会有。

想一想完全的计算能力意味着什么：不管多烦复多困难的计算都能够马上完成，而且没有错误；任何数学问题都能够立刻解出，或者明白它无解，以及为什么无解。现实生活中的“数学天才”可能接近了这个境界，但是肯定也没有达到这个境界，否则我们就不会还有那么多数学难题没有得到解答，就不需要陈景润耗费了毕生精力去证明那个恼人的“哥德巴赫猜想”了（那个猜想到现在也没有得到一个圆满的解答）。

任何人如果仔细想过他自己的计算能力是如何有限，明白还有多少数学问题自己不能解答，就应当承认自己的理性并不完全。在现实经济生活中，我们还可以发现许许多多的“笨人”，他们的计算能力差到极点，连自己的可支配收入足够购买什么样的消费品组合都说不清——这就是说，他们没有能力搞清楚自己面临的“预算约束”。而这个预算约束是微观经济学描绘的消费者能使自己的消费最大化个人效用的前提条件。经营企业比个人的消费需要更为高得多的计算能力，在这方面，人们在计算能力和理性程度上的局限性表现得更为明显。

正因为如此，以“完全理性”为假设前提的主流微观经济模型存在着根本的致命缺陷，对许多现实经济生活中的个人行为和经济现象都不能作出正确的解释。为了弥补这种缺陷，正确地指导管理者们的决策实践，美国教授赫伯特·西蒙（Herbert Simon）在研究经济管理中的“决策程序”时使用了“管理人”和“有限理性”的假说。1978年西蒙由于他对经济管理中的“决策程序”的研究而获得了诺贝尔经济学奖。西蒙的有限理性假说认定人们的理性是有限的，其根源在于计算能力有限。

尽管依据有限理性假说进行的经济管理研究早就获得了诺贝尔经济学奖，但是主流的微观经济理论依然毫不动摇地固守它的完全理性假说。张维迎教授的几句“警句”最典型地代表了主流经济学家们固守完全理性假说的坚定态度。

那还是1993年或1994年，张维迎教授刚从英国留学获得博士学位归来回到国内，在我们中国社会科学院经济研究所作了一场有关当代企业理论的学术报告。本人是这场报告的忠实听众，还在报告后参加了进一步的小范围讨论。这首先是因为本人虽然在联邦德国作过博士后访问研究，但是毕竟没有在西方大学里正式留学过，对在西方大学留学获得博士学位的人总存着几分敬意，想听他们简要地谈谈他们在西方大学中新学到的和自己研究出来的学术成果。另外我也一直对“剩余索取权假说”与科斯的企业理论之间的关系感到困惑，十分虔诚地想就此向张维迎请教。

在报告后的小范围讨论中，我问了张维迎几个问题。也记不清怎么就谈到了主流微观经济理论的缺陷，我忍不住说出了一直憋在内心的一个想法：经济学的理论要想能够正确地解释现实的经济，就应当放弃其“完全理性”的分析前提，使用赫伯特·西蒙的“有限理性”假说。

不想这一句话招来了张维迎的尖锐抢白：“什么叫‘Boundary Rationality’（有限理性）？那能叫经济学吗？是理性就不能是有界限的！”

我当时对他的这顿当头棒喝哑口无言。但那并不是由于已经被他说服，而是因为张维迎是到我们所来作报告的客人，我觉得出于礼貌的态度，不应当对客人挑起一场不会有什么结果的论战。

当时我还有许多东西没有想透，对张维迎那番话不服气主要是出于外行的普通人都会有的想法：赫伯特·西蒙得了诺贝尔经济学奖，这表明他的观点得到了西方主流经济学家们的认可；你说他的观点“不算经济学”，那你的观点就算经济学了吗？说你的东西比西蒙的东西更配得上经济学的名称，你却没得到诺贝尔经济学奖，而且在可预计的未来你也不象能得诺贝尔经济学奖的样子。

当然，一个经济学家的经济学说是否正确、是否能有效地解释经济实际，不应当以是否得了诺贝尔经济学奖来判定。可是正如本文前边的论述所指出的，“完全理性”的假说明显地不合乎实际，而赫伯特·西蒙与“有限理性”假说有关的全部学说却正确地描述了成功的企业管理行为。这难道还不应当使我们认真考虑“完全理性”假说给经济分析带来的危害吗？

完全理性假说给主流微观经济学带来的尴尬

中国的主流经济学家们也几乎都象张维迎教授那样极端教条地坚持“完全理性”的假说，在分析经济问题时总是认定人们都是理性的。而2004年郎咸平掀起的国有企业产权改革大论战，却使主流经济学家们在理性假说问题上陷入了自相矛盾的尴尬境地。

前边已经指出，这场论战使主流经济学家们在理性假说问题上陷入了尴尬境地的第一个地方，是主流经济学阵营中的许多人指责坚决反对“经营者持大股”式私有化的网民是“非理性”的，而坚决反对“经营者持大股”式的私有化的人在参加国有企业产权改革大论战的一般群众中却占大多数。这就是说，在私有化这样的经济问题上，主流经济学阵营中的许多人都把相当多的一般群众看成是“非理性的”；可他们在其经济理论分析中却一直认定，所有的经济活动当事人都具有“完全的理性”！

附带说一句，我认为任何人都不具有完全的理性，许多人的理性更是极为有限的。但是在去年的这场国有企业产权改革大讨论中，群众情绪化的言辞背后却大都隐藏着十分理性的思考：人们大多是出于对利益关系的清楚计算而反对“经营者持大股”式的“企业改制”的，情绪化的激烈言辞恰恰是他们基于理性考虑而反对这样改制的武器。反对这样改制的群众之所以是理性的，是因为在对个人福利影响很大的问题上、在有足够时间和经验来认识最终的结果时，绝大多数人还是很有理性的；而被“经营者持大股”式的“企业改制”严重伤害的群众已经足够多，这些人及其亲友也已经有足够的时间和经历来体味“改制”的这些伤害。

不过，中国的主流经济学家们在理性假说问题上之所以陷入尴尬境地，更重要的原因却在于：他们的私有化主张严重依赖对少数企业家的崇拜，而如果真象他们宣称的那样人人都具有“完全理性”，崇拜个别企业家的主要理由就消失了，他们的私有化主张也丧失了依据。

中国的主流经济学家们坚决主张实行 经营者持大股 式的公有企业私有化，其最主要的理由是：靠优秀的 企业家 才能搞好企业经营，因此需要把企业变为归这些优秀企业家自己所有，以鼓励其努力经营企业。张维迎教授最详尽地按这条思路论证了 企业应当归企业家私有 ，并把自己的整套理论称为 企业的企业家理论 。

但是为了说明优秀的企业家为什么对经营好企业有如此决定性的重要意义，中国的主流经济学家们就必须说明优秀的企业家到底与其他的普通人有什么不同。如果企业家与普通人没有任何差别，企业家经营的企业就不可能比普通人经营的企业有更好的业绩，企业家们也不会有任何经济上的重要性。

美国的奈特及其追随者强调风险和不确定性对企业的决定意义。与这一思想传统相对应，西方的主流经济学家们常常强调，企业家比一般人更敢于冒风险，这是企业家与其他人的一个主要差别。有些经济理论模型甚至干脆就以对风险的态度来区别企业家与非企业家：敢于冒风险的是企业家，厌恶风险的是非企业家。

这样把企业家的特点归结为敢于冒风险，其不合乎实际之处显而易见。如果一个真正的企业家与其他人的差别只在于他比其他人更乐于冒风险，那我们可以一点不差地把企业家描绘成一个赌徒，这样就会使一切颂扬企业家的理论学说都变成赌徒的颂歌。更糟糕的是，现实当中的赌徒往往会象李逵那样鲁莽，但是真正的企业家却恰恰是鲁莽的对立面 现实当中的企业家给人们留下的印象，往往是处事高明、精明和工于算计。

中国的主流经济学家们所颂扬的 企业家 的高于常人之处，主要是他们的 经营能力 ，而这种 经营能力 ，应当主要体现在企业家们比其他人考虑和处理问题更周密、更正确、更有预见性。张维迎教授更进一步将企业家的特殊之处归结为特别的 反应力 、 想象力 和 判断力 等。当然，真正的企业家所具有的这些能力，应当是正确地 判断 、 想象 和 反应 的能力，或是作出对自己最有利的 判断 、 想象 和 反应 的能力。而企业家们的所有这些不同于常人的 能力 ，其实可以归结为一个能力：比其他人更能理性地思考和处理经济问题的能力。

但是，一旦把企业家的能力和优于一般人的特殊之处归结为更理性地考虑和决策，对企业家的全部颂扬就与主流经济理论的 完全理性 假说相冲突：既然 完全理性 假说意味着人人都有完全的理性，那么根据 完全理性 假说，企业家与其他人就应当同样都具有 完全的 理性，企业家就不可能比其他人更理性。 完全理性 假说等于假定了企业家没有什么特别的能力。大概正是由于西方的主流经济学家们十分清楚 完全理性 假说的这一层含义，他们才把企业家的特点归结为比其他人更敢于冒风险，从而把企业家们贬低成了赌徒。

这样，在有关 权贵私有化 的论战中，中国的主流经济学家们在理性假说问题上陷入了真正的尴尬。这不仅是因为，说广大网民 不理性 直接就违反了每个人都完全理性的假设；而且更是因为，以 企业家具有常人没有的能力 为理由来为 经营者持大股 的私有化辩护，这更是与 人人都有完全理性 的观念不相容。

用不完全理性来解释企业的存在

我们之所以要在这里强调 完全理性 假说给主流经济学造成的尴尬，是因为正是这个 完全理性 假说使主流的微观经济理论丧失了对企业的认识和解释能力。

要正确地认识市场经济中的企业存在的原因和决定企业内部治理结构的因素，我们就必须放弃完全理性的假说，承认任何人都会在实际经济生活中看到的现实：没有任何人能够具有完全的理性、完全的计算能力，而单个人的理性虽然都不完全，但是不同的个人理性不完全的程度极不一样，个人之间在理性思考和正确计算上的能力有重大差别；人的理性是最珍贵也最稀缺的资源，有效率的企业制度甚至其他许多社会制度的功能之一就是最有效地配置人的理性这种最稀缺的资源。

先说一个有利于张维迎教授等中国主流经济学家的论点：只要我们承认单个人的理性都不完全，但是不同个人的理性程度不一样，我们就可以对企业内部的治理结构甚至企业存在的理由作出一个很合乎多数人经验的解释 有效率的企业应当让理性程度高的人作经营者和领导，而让理性程度低的人作被领导者和一般工作人员；而企业的功能之一是有效地配置非常稀缺的人的理性，通过企业内部的分工让理性程度低的人退出需要高度理性的经营性工作，让经营性的工作完全由理性程度高的人即企业家来从事。

对企业制度的这种解释并不是我的独创，发达西方国家的经济学家对此早有论述。问题

在于中国的主流经济学家们似乎不知道这一类的论述。当然， 企业使理性程度高的人与理性程度低的人达成了最有效的分工 这一观点，是与 完全理性 假说不相容的。但是它合乎许多中国人的经验和关于企业管理的观念。比起主流经济理论的 完全理性 假说来， 企业使人按理性程度高低达成了最有效的分工 这一观点给了 企业家 的地位一个相对合理得多的解释。

当然，中国的主流经济学家们不肯放弃完全理性假说，也是因为他们有许多不可言说的隐蔽苦衷。

中国的主流经济学家们一直主张不顾一切、不择手段地将国有企业私有化，为此而不惜把国有企业所有权白送给现在在职的国有企业经营者。他们为这种私有化作辩护的唯一理由是可以因此提高效率。可是谁都知道，如果企业经营者的经营能力差，企业是不可能有经营效率的。这样，如果承认许多人的理性程度不高，能够提高企业效率的国有企业私有化就必须满足一个条件，那就是变成了私营企业所有者的那个企业经营者是个真正的 企业家 ，他思考和决策的理性程度应当比其他人高。而中国国有企业改革中的问题之一恰恰在于：谁能正确地挑出这个 最理性 的企业家来持有企业的决定性股权？

正是中国主流经济学家们主张的那些私有化方式，把决定私有化了的企业由谁控制的权力全部交到了少数几个政府官员手中。而正是这同一些中国的主流经济学家，又一贯宣扬政府对企业事务的任何干预都只会将企业搞坏。现在让政府在决定企业由谁永远拥有、永远经营这样决定性的问题上如此强地干预企业，难道这样的政府干预反倒会搞好企业吗？而为了能替这样不公平的私有化辩护，中国的主流经济学家们确实需要抹煞人的理性的不完全，以便回避 变为原国有企业的新所有者的那个人是否有足够理性 这样一个致命的问题。

承认人的理性不完全、理性是最稀缺的资源之一，使我们可以发现许多人共同工作的企业存在的一个根本原因。而中国的主流经济学家本能地排斥对企业存在原因的这样一种解释。

在现代的工业化经济中，高度发达的分工在技术上有较高的效率。这样高度发达的分工往往导致同一件有效用的物品由许多个人分工生产，单个的劳动者并不独立完成生产该物品的全部工作，而只是专门从事这整个生产过程中的某道工序，就象一个流水线上的工人只在每辆汽车上拧上几个螺丝钉，而并不生产整个汽车。

但是，为了有效地进行这样高度分工的生产，生产完整的产品的整个生产过程应当得到合理的安排，在每道工序上工作的工人都必须与这整个生产过程保持适当的联系和数量比例关系。

如果每个工人都通过自己经营的一个企业来加入这个生产过程，每个工人就不仅要筹划如何完成自己这道工序的工作，而且要了解和考虑相邻的上道工序、下道工序以致整个生产过程的情况，以免自己由于不清楚相邻工序的情况而在采购和销售上吃亏。人人都超出自己工作的工序而去考虑整个产品生产过程的全局，就使得一个生产过程的全部参加者所作的考虑和筹划在相当大的程度上是互相重复的：他们都在费心费力地考虑和筹划同一个生产过程。

如果人的理性是完全的，如果人的理性不是一种极其稀缺的资源，同一个生产过程的各个不同参加者的这种相互重合的考虑和筹划不会给人类带来任何危害。但是可惜，人的理性是一种最稀缺的资源，理性地思考和筹划不仅耗费人们大量的精力和时间，而且给人们带来巨大的痛苦；而且即便如此，人们也无法达到完全理性的境界。这样，能节省人们的计算工作、节约使用人们的理性的机制、组织之类的 制度安排 ，就可以极大地提高人类经济活动的效率。

由这种有限理性的观点出发，我们可以极容易地解释为什么许多人会在同一个内部有高度分工的企业中工作：这样的企业由其内部等级制组织的最上层这同一个中心考虑和筹划生产同一个产品的整个生产过程，而在该企业中工作的每一个职工理论上都可以只考虑和筹划他自己从事的那道工序的工作，不必再费心费力地考虑和筹划自己从事的工序之外的事情。这样，就一个企业的整体来看，可以大大减少人们所必须进行的计算工作，极大地节约使用人的理性思考，使极为稀缺的人的理性得到有效的利用。

由于形成企业是为了节约使用人的理性，避免在考虑同一生产过程中上下工序衔接上的许多重复劳动，因此现实生活中的企业所一体化的，大多是生产同一产品的相互连接的各道不同工序。

中国的主流经济学家们为什么固守完全理性假设？

中国的主流经济学家们固守完全理性的假设，当然想不到需要企业的上述原因。张维迎教授更是放弃了科斯对企业存在原因的 交易费用 解释，坚持更为古老的奈特论点，认为企业存在的必要性来源于不确定性。这样把需要企业的原因归结为对付经济生活中的不确定性，当然有利于强调张维迎教授的核心观点：企业家的特殊经营决策能力极其重要，因此企业应当归企业家私人所有，因为对企业本身的需要其实来源于对企业家的需要。

还有一些更重要的原因，使中国的主流经济学家们不会愿意放弃完全理性假设。

一个原因是完全理性的假设有利于神化企业家，有利于把他们说成是永远不会犯错误的 既然人人都具有完全的理性，企业家当然更是毫无疑问地具有完全的理性。于是我们就可以把企业家们看成是永远不会犯错误的人，他们在给定的可利用信息范围内所作出的决策必定是完全正确的。如果他们作出了不利于整个企业的决策，那只能是因为这个企业不属于该企业家自己。要使企业家不作出对企业不利的事情，就只能把企业变成企业家自己的私有财产。

这样， 完全理性 的假设就自然而然地导向了一个结论：只要解决了企业的 产权问题（让企业归其经营者私有），靠企业家 企业领导一个人就可以正确地解决一个企业的一切问题，不需要别人参与决策，更不需要员工们发挥参与管理的积极性，外界的其它任何干预也都是多余的，只会不必要地多耗气力。于是神化企业家的事业大功告成，除了需要把企业送给其经营者私人所有之外，对企业家的任何约束都被说成是有害无利。

以 完全理性 假设来神化企业家的方式只有一个弱点：它需要所有的人都忘记，这个假设也假定任何其他人都与企业家一样有完全的理性，因而我们可以用任何一个普通老百姓来替换任何一位大企业家，不必把这些永远正确的企业家看得多么金贵。

完全理性的假设还有一个重要的作用：它使主流微观经济学可以把任何市场交易都说成是有利于交易的任何参加者。而只要人的理性不完全，市场上的交易就可能变成 双方都自愿 的掠夺，理性程度较高、计算能力较强的人从这种交易中发财，而理性程度较低、计算能力较弱的人则由于交易而状况变得更坏。

近些年中国的许多金融把戏，就是这种 聪明人骗傻子钱 的诡计。成千上万理性程度不够的股民相信了 股票投机一定赚钱 的神话，在股市中被那些更为理性的庄家们骗得倾家荡产。所谓的 国有企业产权改革 更是放纵那些较具理性（比较狡猾）的企业家们，打着 自愿交易 的旗号欺骗理性程度低一点的企业职工、人民群众和政府官员，以 交易为名侵占人民的公有财产。

简单的逻辑推理已经足以说明，坚持完全理性的假设，把所有人都说成是完全理性的，就可以抹煞一个许多人都已经看惯了不觉得奇怪的事实：市场上的交易往往会最终伤害交易中的某一参与者。按照完全理性的假设，既然任何人都是完全理性的，就没有人会自愿地同意一笔最终会损害自己的交易，也就不可能达成使某个交易参与者受害的交易。而如果人的理性有限且在个人之间分布不均匀，理性程度较高的人就完全可能使理性程度较低的人 自愿 接受一笔最终损害他的交易 那个理性程度较低的人完全可能由于在交易中 算错了账 而吃亏。

由此观之，一贯相信市场万能的中国主流经济学家们当然会非常喜欢完全理性假设，因为它有助于否认 聪明人 所作的交易损害交易对方的可能性。

由于上述的种种考虑，看来中国的主流经济学家们还会在其经济分析中继续坚持使用完全理性的假设。

文章来源：中国学术论坛网 http://www.frchina.net/data/detail.php?id=10096

/