

当代经济学的行为 转向与中国契机^{*}

王国成

【提 要】逐步打开理性行为黑箱,多视角深入地研究行为属性及其在资源优化配置中的作用,是正在发生行为转向的当代经济学的显著特征之一。资源配置乃至一切经济活动,都是各类主体的行为过程和结果。因此有必要着重分析探讨基本行为假设形成的时代背景、理论动因、表现形式和演化过程,推广基本决策行为模型,展望经济学重新聚焦行为研究的必然趋势,把握其为中国经济理论建设和发展创造的良好契机。

【关键词】经济行为属性 理性假设 中国经济理论

〔中图分类号〕F01 **〔文献标识码〕**A **〔文章编号〕**1000—2952(2010)04—0049—08

在经济学理性行为假设逐步形成和完善的历史进程中,赫伯特·西蒙于20世纪50年代提出的有限理性思想和分析方法,在实践的检验中日渐显现其重要的里程碑意义;随后,以行为经济学和实验经济学为代表的新兴分支学科的异军突起和蓬勃发展,又将行为属性研究推向一个新的阶段。为什么经济学的行为基础会发生如此重大的转折,^①本文以基本行为假设的演变与理论发展的内在关系为主线,试图在较为深入的行为分析基础上,探讨行为的动因、表现形式及分类、内生化的必然趋势,推广基本决策行为模型,把握其为中国经济理论建设和发展创造的良好契机。

一、现代经济学的基本行为 假设及演变

现代经济学的引入,积极地推动了我国市场化取向的改革,也在试图为我国理论界提供主流的分析范式和工具手段,但要真正地认知和有效地应用一种理论体系,更重要的是尽可能地把握其本质特征。近年来国内出现了一些代表性文章:有的从理论体系本身论述,有的从方法论角度探讨,有助于人们更加深刻和全面地解读现代经济学。^②为了分析论述的方便,本文给出如下的描述

性界定,来刻画和突出现代经济学的某些主要特征。

现代经济学主要是指以自由市场经济为研究对象,以围绕理性人所形成的一系列基本行为假设为逻辑起点,着重研究稀缺性资源的有效配置及选择行为,运用前提假设~演绎推理的形式,借助数学和计算机等现代科技分析手段,以新古典经济学为主体的经济理论体系或由若干相关理论分支构建的学科家族。

1. 理论建设的行为起点

经过抽象、舍弃和隐含前提等形成的理论,毫无疑问要大大简化真实研究对象。经济学理论也必然如此:天经地义的禀赋,基因决定的偏好,结构化的信息分

* 基金项目:本文为中国社会科学院重大课题(YZDA2009)和国家自然科学基金课题(70971138)的理论支持部分。

① Smith V., 2003, "Constructivist and ecological rationality in economics", *American Economic Review*, 93 (3), June: pp. 465—508.

② 钱颖一:《理解现代经济学》,《经济社会体制比较》2002年第2期;田国强:《现代经济学的基本分析框架与研究方法》,《经济研究》2005年第2期。

布,最大化的利益目标,神奇的市场制度与机制,均衡的资源配置,理想的社会福利,自由、独立和平等的理念,而这一切都是建立在彰显科学特征的理性行为这一基点上,或者说现实经济世界中的行为主体,都被看做是先天具有足够计算能力进行理性选择的经济人(或理性人)。经济学诞生和成长于近代理性主义思潮涌动的年代,必然会带有明显的时代烙印,在其发展过程中经过凝练、演变和升华,逐步形成现代经济理论体系的核心假设:为经济人赋予理性行为特征是经济学的基本行为假设和科学化的关键点,是经济学理性主义^①的集中表现,基本含义发展至今更加丰富和完善。可以说,在现代经济理论体系中,只有针对特定研究对象所作的基本行为假设,才最典型地代表了经济学的学科特征和本质内容,是逻辑分析的起点;而几乎所有的分析方法、手段和工具,大都是吸收人类共同的文明成果,得益于数学、计算机和其他相关学科的交叉渗透。以基本行为假设为起点,再经过严谨的演绎逻辑推理得出理论结论,通过基于随机理论的计量分析等实证方法的检验;进而针对不同现实问题和需要,局部、表层地改变和放松前提条件,由完全信息放松到不完全信息,由静态扩展成动态,形成和衍生出不同的理论分支;众多相互关联的分支共同构筑起现代经济学宏伟壮观的学科大厦和支撑起理论殿堂。这就是理性人假设的重要作用和实践意义。

理性行为假设是经济学科学化最为关键的一步,是整个理论体系的根基,有了它,才能在商品集或可选目标集上建立序关系和效用函数,将经济活动中各类主体生动鲜活的行为,以效率为中心地统一为约束条件下个体效用(或偏好)最大化的选择和决策行为模型,使科学方法的应用具备了可行条件;以此为基础进行严谨的计算分析,可得出理论模型的最优解,实现自身利益最大化。规范化、同质化和原子化的个体行为假设,这样的假设具有外生给定性、自利完备性和共同一致性等,^②使得理论重心聚焦在市场运行机制条件下的资源优化配置上。如理性行为假设将人格资本化,为劳动力赋予商品属性,使得研究商品、货币和劳动力市场的一般均衡成为可能,正好迎合某些利益阶层的需要,理所当然、巧妙地在为特定制度辩护,完成了经济学的科学化包装,同时也显现出现代经济学中机械式行为主体、工具主义立场、唯理论的发展目标等特征,这些与产品价值衡量标准相对单一稳定的市场经济活动,与理性主义逻辑一致性的内在要求,存在着必然联系和对应关系。

2. 理性行为的认知与演进

经济学理性主义的演进,以及选换视角探讨不同环境条件下各类主体的特征,是对人类行为本质属性及表现形式从未停顿、不断深化的认知过程。从基本行为假

设的演变与理论发展的内在联系角度,勾连以下三个阶段和特征,能较清晰地追溯、透视和预见经济行为理性特征和基本属性研究的一条主脉络和引证线索。

(1) 个体理性及演变。从完全理性、有限理性再到生态理性,由于注意到不完全信息和不确定条件下主体认知能力有限等特征,关于经济行为基本属性的研究是在不断发展和演进的,但其明显特征是以个体中心主义为轴心和主线的延展。^③由于人类社会发展和需求的阶段性,理论观念与认知工具的局限性,也只能是历史地选择围绕个体理性中心的发展演变路径。然而,个体偏好逆转的发现及其被许多研究所证实,^④对于消费者和决策者所面临的各种具体的策略选择,到偏好不稳定、不具备传递性等情景依赖性,理性行为公理化的愿望受到前所未有的、而且是越来越强烈的冲击和置疑;随之创造性地提出的自适应、异质性期望和信念等新视角和概念等,^⑤使得人们对自身经济行为的认识和研究不满足于理性行为黑箱的桎梏,这是逻辑力量使然,更是历史发展的必然。与其说是对某种经济行为属性的发现,倒不如说是对将经典的基本行为假设试图公理化这类愿望的考验、检验、冲击和置疑。

(2) 交互影响的博弈行为。博弈论从新的视角研究主体之间相互影响的策略行为及均衡结果,囚徒困境与公共地悲剧等,揭示了个体理性与集体理性的复杂关系;群体行为并非总是关于个体行为在属性一致前提下数量上的增减变化,还可能出现与个体行为性质完全相反的结果。作为一个很好的过渡,行为研究重心的迁移,把视线由相对独立的个体决策引入到相互影响的策略行为,或许这正是博弈论存在的重要意义之一。但仅沿经典博弈论研究策略行为,还是基于个体理性,还是以个体为中心;只有而且是必须同时考虑所有博弈参与

① 汪丁丁:《经济学理性主义的基础》,《社会学研究》1998年第2期。

② 王国成:《理论无偏性检验与数据品质提升——基于实验经济学的视角》,《统计研究》2006年第11期。

③ Smith V., 2003, "Constructivist and ecological rationality in economics", *American Economic Review*, 93 (3), June: pp. 465—508.

④ 参见 Grether & Plott, 1979, *Economic Theory of Choice and the Preference Reversal Phenomenon*, *American Economic Review*, Vol. 69, No. 4 (Sep.), pp. 623—638等。

⑤ Arthur, B. W., 1995, *Complexity in Economic and Financial Markets*, Complexity, Vol. 1 (1): 20—25; Arrow K., 2004, In: D. Colander, R. P. F. Holt and J. Barkley Rosser (eds.), *The Changing Face of Economics: Conversations with Cutting Edge Economists*, The University of Michigan Press, Ann Arbor, p. 301.

者的总量变化特征，才能从个体与群体行为的内在关系中找到它们之间理性的一致性。^① 博弈论还注意到，在当今越来越复杂的市场经济环境和博弈局势中，策略行为使得个体选择结果更多地充满了不确定性（而且这类不确定性往往是难以用随机规律表述），因而这也是个体理性并不必然导致集体理性的原因之一。

（3）回归行为本原。特定现实需求下提出的基本假设是为相应的理论体系服务的，不可能将它们割裂开来偏倚或孤立地单论其合理性、科学性和普适性。主流经济学也感受到了原有假设和视野的局限性，试图用外部性来解释个体行为对他人和社会的溢出效应，或者用制度在一定程度上调节个体行为可能的外溢，然而，如此只是单向地考虑了个体行为对他人和社会的影响，没能同时考虑他人和社会对个体的反向影响，不足以解释个体行为的社会性；经典博弈论也主要是基于个体理性研究策略行为；它们都未能跳出个体中心主义方法论这一圈子，难以从行为本质上找到问题的根源。在人类社会和人文社会科学研究中，不能仅满足和局限于某一种基本行为假设，应该全方位、多视角、全面深入地考察主体行为和本质属性，明确辨识行为的个体属性和社会属性的共生性与差异性，引入诸如社会偏好（social preference）、社会理性之类的概念，研究区分自利与利他动机、纯个体自利理性与社会理性、客观事物变化与主观行为的不确定性等，将从社会性视角建立的新概念与博弈论、实验经济学等研究方法相结合，进行理论模型构造和实证检验分析。

经济理论的核心内容和主要目标是研究人类行为与自然界的相互作用及结果。抽象出代表性个体行为进行普遍性研究的做法，是经济学初始阶段实现科学化的路径之一。理性行为可以说是对完全（不完全）竞争环境中一般性商品交易主体行为的抽象描述，而对特定问题的探讨，还需要设定一些具有特殊属性的功能性 agent，如零智力交易主体 ZIA 或 ZIT、^② 管理 agent，选举 agent 等，为检验对比和深化研究主体行为特征开辟可行途径。时代发展提出的新需求和酿造的有利时机，现代科技进步与相关学科领域的相互渗透及推动提供了切实可行性，经济理论观念发生的重大转变，个体的差异性、主体之间的相互影响、行为主体和制度及生存环境（自然的与社会的）的共生演化（co-evolution），表明经济研究与自然科学研究方法既有共性相通又有明显不同；因而，既要借鉴渗透，又要各有侧重。

二、主体行为分析

1. 是公理还是假设

一切经济活动都是人类与自然世界进行物质交换的行为

过程和结果。新古典经济学在特定的社会经济发展背景下，抽象出理性经济行为作为基本假设并在不断地演进和改善，形成了现代经济学的核心假设和理论硬核。^③ 然而，是将理性行为作为公理还是作为假设？至今并未给出、今后也不可能给出明确的正面回答，但又是必须要始终面对的一个问题。若是公理，为什么会受到来自行为经济学和实验经济学等新的分支学科强烈的冲击和挑战？^④ 若是假设，就必须在经过科学检验后方能判定是接受还是拒绝。^⑤

不仅仅是假定或赋予一种固定不变的行为属性，而是要研究和揭示哪一种行为属性如何影响资源配置，以此为基础再研究因素变量之间的关系，揭示各种不同行为属性及演变在配置资源中的传导机理和作用效果。只假定单一的价值取向、明确稳定的行为方式，仅以一种行为属性为基点建立起重点研究资源配置和选择的理论体系，可看成是对多属性复杂行为截取的一个侧面上获取的认知成果，不足以作为认定主流与非主流的判据，更不能说是经济学的全部。由于研究对象的多样性和复杂性，决定了经济理论多元化的本质属性，孕育了多视角深化行为属性研究的必然趋势和发展空间。无论是完全理性、有限理性还是非理性，需要根据研究问题的需要，在对现实经济活动深入客观地观察的基础上，着重研究主体真实的行为特点、方式和它们之间相互联系影响的行为关系，由此检验理论、发现规律、发展理论。这是当代经济学新的觉醒与更始。

作为利益主体的人，在资源配置选择和与其他主体及外部环境的交互行为过程中，具有主观意志、个体差异、学习适应、交互多变等特性，不可能是机械地、固定的反应模式，舍弃了鲜活丰富的行为属性，经济理论就好像没有了灵魂，就失去了最应该研究、最有价值的内容。同质的代表性理性行为主体的做法，其方法论特

① 王国成：《交互行为视野下博弈论与当代经济学的交汇及发展》，《经济研究》2007年第12期。

② 参见 Gode, Dhananjay K & Sunder Shyam, 1993. Allocative Efficiency of Markets with Zero-Intelligence Traders: Market as a Partial Substitute for Individual Rationality, Journal of Political Economy, University of Chicago Press, vol. 101 (1): 119-37, February; Othman, 2008, Zero-Intelligence Agents in Prediction Markets, Computer Science Department, Carnegie Mellon University, J. 4 [Social and Behavioral Sciences] .

③ 张建伟、胡乐明：《西方主流经济学的理性主义“硬核”剖析》，《中州学刊》2005年第4期。

④ Camerer, C., G. Loewenstein and M. Rabin Ed. (2004). Advances in Behavioral Economics. New York: Russell Sage.

⑤ 王国成：《经济行为基本假设检验与实证逻辑》，《数量经济技术经济研究》2007年第11期。

征是个体中心主义,在一定程度上借鉴了现代(自然)科学的做法,显现出原子化、外生化与恒定化等特征,在历史的长河中经受过逻辑的和经验性的分析检验。然而,行为假设和人们的认知水平不可能是一成不变的公理,虽然基本行为假设也在不断拓宽和放松,但还都是一脉相承的。理性的含义是广泛的,根据现实问题和学科发展的需要,截取一个行为基准面、构建相应的理论分析参照系是必需的基础前提;而发生突变和转折,说明理性行为假设更需要深化、丰富和发展,这是时代特点和科学的本质要求。或许单一行为假设比较适用于研究常规经济的特征和规律,而多属性行为假设在探讨非常态的复杂经济问题时能发挥更好的作用。各类复杂多变的现实问题,都能从行为根源上找到诱因,行为特征和属性与宏观形态和演变轨迹必然存有内在的对应关系,是可认知的。

2. 行为分析基本方法

市场规律实质上是行为规律:完全竞争条件下适用于同质的理性行为假设,不完全竞争条件下千姿百态的行为表现是异质的和多属性的,很难概而论之。设定一种特征和视角,获取一个行为截面,在学科分工框架内经过演绎推理建立的理论体系,可作为分析现实经济和深化行为研究的参照系。行为分析就是侧重在微观层面上,寻求主体行为特征和属性及其与复杂经济现象的内在对应关系。

与常规的因素变量、因果关系和随机关系等不同,可将行为变量看成是软变量(Soft variables),行为与现象的关系是软关系。行为分析主要是着眼于这些软变量和软关系,其基本内容和逻辑关系是:环境条件—行为动因—行为状态—行为关系—行为过程—行为结果。其中:环境部分主要包括对主体生存的外部环境条件和各种影响因素的描述分析;行为动因主要是指目标取向、价值判断、偏好函数等禀赋属性和行为的诱发原因;状态分析包括行为表现、典型特征和形成机制;行为关系主要考虑的是主体之间、主体与外部环境之间的联系方式和结构;行为过程涉及到推动和影响行为变化的因素及相互关系、动力学原理、传导途径和机理;行为结果是指行为对资源配置效率的影响和表现形式,对外部环境条件和下一轮行为可能产生的效应;等等。建立起这样的行为分析链条,遵循先验式的贝叶斯决策原理,有助于寻找和框定引起某种特定复杂经济现象的行为原因。

毫无疑问,经济行为的量化研究和直接的统计检验相比而言会更加困难,然而行为分析是经济学的本质要求,是理论分析的先导和不可或缺的重要组成部分,本身就是一种可行的科学检验方法;然后才是进一步研究传导机理和对经济运行与资源配置的影响方式及效果;

在此过程中,会越来越认识到行为分析的重要性,也自然会随之找到更加有效的行为分析方法和手段。

三、当代经济学的行为转向

经济学的主旨是分析人与自然的依存关系以及伴生的人与人(或群体)之间的利益关系。现代经济理论建立在理性人(具有同质行为属性的代表性主体)假设的基础之上,着重研究资源配置效率及相关问题。该假设关键性的隐含前提之一是个体行为差异可以忽略不计(只有在通过给定显著性水平下的统计检验等才得以成立)。然而,利益和财富来自人与自然界的物质交换,人与人的关系根本上是一种经济利益关系,随着人类行为在社会经济活动中的主导作用日益增强,人类与自然界、人与人之间的相互联系和影响越来越复杂,面对微观个体行为的差异性和交互性等所导致宏观经济形态的复杂性,迫切需要对行为研究的深化和回归,而这般需求在现代科学技术(尤其是计算模拟)的支持下是可实现的。

1. 行为转向的基本特征

进入21世纪以来产生诺贝尔经济学奖的研究领域有:微观经济计量学、行为经济学与实验经济学、时间序列分析、非合作与合作博弈的融合、基于微观主体的宏观经济政策分析等,这毫无疑问在预示着经济学的发展方向;^① 博弈论、激励、契约、产业组织、公共选择、认知经济学(Cognitive Economics)、神经元经济学(Neuro-economics)、行为金融和行为博弈论、新制度经济学和新政治经济学以及社会经济学等迅速生长起来的新的理论分支和活跃的研究领域,近年来出版的有代表性的教科书,国际专业会议上的热门议题……,它们有共同的特征和指向,深入地刻画微观主体行为本质,或者是在研究微观行为的方法上有突破和创新,是科学精神在新的历史阶段新的表现形式。^② 自卡尼曼等人开创性地提出不确定决策情况下的前景理论以来,到如今已全面展开了对经济行为本质属性的深入探讨并置于经

① Heckman J., 2001. "Micro Data, Heterogeneity, and the Evaluation of Public Policy: Nobel Lecture," *Journal of Political Economy*, vol. 109 (4): pp. 673—748; Kahneman D., 2003, "Maps of Bounded Rationality: Psychology for Behavioral Economics," *American Economic Review*, 93 (6), December: 1449—1475; Smith V., 2003, "Constructivist and ecological rationality in economics" · *American Economic Review*, 93 (3), June: pp. 465—508.

② Bowles S., 2004, "Microeconomics: Behavior, Institutions, and Evolution", NJ: Princeton University Press; Camerer, C., G. Loewenstein and M. Rabin Ed. 2004. "Advances in Behavioral Economics" · New York: Russell Sage.

济理论框架内，由此发展成为行为内生化的主要研究内容和方法：考察公平正义与效率的关系等价值观的确立和演变，对财富效用、风险和时间因素的偏好的形成及演进；深入考虑信息处理、方案分析计算比较等行为能力；全面考虑行为的交互性和外部性等边界属性；对群体中的个体之间共生一致性的改进和修正的变异性分析，等等；进而由于微观经济计量学、博弈论和经济实验等分析方法的蓬勃兴起并逐步推广应用，使内生化的研究行为的异质性和交互性（社会性）成为可能，也使在研究人类行为这一共同点上整合社会科学成为美好的、而且能够不断接近的理想前景。

由此看来，经济学的当代发展正在步入以行为转向或复归为显著特点的新阶段，或者说是回到预定的行为本原轨道上来，即理论研究更加注重具有主观能动性的人类行为主导的经济活动特点和规律。行为假设是经济理论的逻辑分析起点，深入的行为分析能促使经济理论发展进入一个新的阶段。概括出当代经济学发生行为转向的几个显著标志如下：

(1) 基于单一行为假设建立的经济理论，难以解释当今人类社会经济活动的多样性和演化性，与现实产生了系统性偏差 (bias)，尤其是面对金融危机等复杂现象的冲击，其局限性日益突显；

(2) 行为经济学和实验经济学等侧重行为研究的前沿分支的蓬勃兴起，创立了基本行为假设检验、多视角量化研究经济行为的可行方法以及由此引起的方法论变革；

(3) 复杂科学理论打开了新的视角、促进思维观念和方式的转变，高性能计算的突飞猛进等科技进步提供了有利支持，心理学、生物学和物理学等其他相关学科的交叉渗透，形成全人类认知的大趋势和融合氛围。

2. 行为研究内生化的必然趋势

将经济行为属性研究纳入理论体系的内生化处理方法，引发的方向性转变和调整，或者说是行为复归，是当代经济学发展的必然趋势。纵观经济学发展历程，古典经济学坚持劳动价值观，主要研究商品与资本等要素特征、结合方式和流通规律，行为与制度的关系，以及利益集团之间的经济关系等，可以说是经济行为视角的观察分析；而新古典经济学在理性人假设基础上，将个体决策活动抽象为利益最大化模型，并外生给定制度、信息分布等市场条件，从而使现代经济学的理论重心聚焦在选择行为的结果上，主要围绕稀缺资源配置研究价格和各种投入要素及结构关系的变动对经济运行的影响，与此同时理性行为假设也在不断接受实践的检验和遭受质疑中得以修正和发展；而基于异质性行为，由集中于行为结果扩展到更加注重行为特征和过程，深入研究经济活动的现象和规律，只要经济是在经济行为驱使下运

行、经济行为又是在自身利益导向下实施的，只要个体利益需求呈多样化（或者非单一）趋势、个体之间不存在惟一通行的价值标准（效用不可能完全等价转移），异质性经济行为就会普遍存在并产生显著影响，经济学也就永远不可能纯科学化。而转变观念，转换视角，突破传统框架，打开原有的理性行为黑箱，正视经济行为的异质性，检验理性行为假设、分类深入地分析探讨行为的本质特征和发展演变过程的规律性，就能构建更接近现实、更加科学的经济理论体系。经济学的理性决不会停留在行为假设阶段，一旦方法、工具和手段有了创新，就可能突破理性行为假设的阶段性和局限性。行为内生化方法是科学理性的延伸和新的表现形式，是经济学内在规定的必然发展趋势，是经济学科学化和真正理性的体现。

为能够持续深入地认知行为本质、修葺经济理论大厦，经济学家从未放弃寻找深化行为属性研究的突破口和有效工具的努力。从奥曼等学者用演进博弈的观点对理性的混乱与动摇的论述来看，若局限在传统理论的视野之内，博弈局势中理性、有限理性与非理性在实现纳什均衡方面并无本质的、严格的区别，^① 或许理性经济人 (Homo economicus) 真的会被现实行为人 (Homo behavioralis) 取代，由此受到启发，我们应该坚持的是科学理性而并非是某种已有的理性表述形式，用彻底的实证理性——行为与实验经济学等倡导的经济实验等科学方法，研究经济行为从而完善经济理论是不可逆转的发展趋势。多视角、深入细致、量化的行为分析，是经济学的应有之义，是最能体现学科特色、最有力地推动经济学发展的主要内容。毋庸讳言，按正统的分析框架和思维模式来看，现在没有，而且在未来可预见的时期内也不可能有一种全新的行为假设来完全取代理性行为假设作为经济学的基础，^② 或者说是用社会人、现实人和行为人来替代经济人，但关注行为主体的适应性和交互性或研究“适应性的关乎他人的行为” (Adaptive and other—regarding behaviors)，显然已成为当代经济学发展最闪耀的亮点之一。无论是理性与非理性（感性）行为描述上的差异，利己与利他行为动机假设的不同，纯自利的经济动物与具有自然和社会双重行为属性的观点的分野，还是个体中心主义与整体综合主义方法论的分歧，都阻挡不住经济学在现实需要和科学本质的推动下沿自身发展规律的推进和变革。

① Aumann R. J., 1997, Rationality and Bounded Rationality, *Games And Economic Behavior*, 21: 2—14.

② Bowles S., 2004, *Microeconomics: Behavior, Institutions, and Evolution*, NJ: Princeton University Press.

四、超越个体理性

简化和析取经济行为的理性特征,为新古典抽象奠定了良好的基础,但还需要进一步研究经济行为的多方面属性及其复杂的作用机理和结果,防止过度固守一种行为假设导致经济学蜕变成机械、僵化的理论体系;需要突破原有观念和框架、超越个体理性,基于主体的多元化价值取向、多样化功能和多种行为方式,区分和剖析不同行为类型,概括异质主体相互联系和作用的基础关系结构,推广基本决策行为模型,通过行为内生性、采用经济实验方法细致刻画并尽可能获得真实行为特征,运用复杂系统建模将多种类型的模型综合集成或一体化,采用系统(动态)仿真工具和方法,推广实际应用并加以检验,由此可揭示个体行为与集体行为的内在关系和传导变化机理。

1. 微观主体行为类型分析

经济活动过程和结果是主体与外界环境(包括主体之间)的相互作用,即为给定环境或条件集下的{主体集}·{客体集}→{产出或结果集},以行为分析为起点,由于人的主观意志的作用,仅仅用确定型、随机型两个层面或类型来刻画经济主体行为是不够的,还应该考虑可能存在的第三个层次或类型——复杂型,以便推广基本决策行为模型。三种类型分别对应行为认识的三个层次;不同社会发展时期,经济学的不同发展阶段,主要选择其中一种为逻辑分析起点和行为基础。^①将特定环境中的每一活动主体或 agent 看成是一个行为发生器(behavioral generator)或转换器(convertor/transformer),考虑到现实表现与理论需要的结合,大体上可将经济行为概括成如下的三种基本类型:

(1) 确定型,投入与产出唯一确定的 1-1 对应关系,如生产活动中类似于成本加成的作业行为等。

(2) 随机型,一种投入对应的是可能的产出集,相互之间是概率意义上服从某种分布的随机关系,与完全竞争市场上的交易行为相应。

(3) (权且称为)复杂型,或许更贴近现实,力图表现复杂环境中人的真实行为,同时考虑差异化(具有主观意识和能动性)的多主体的交互行为,与产出结果的关系既不是确定型也不宜划归为随机型。

粗略地说,确定型行为,适合研究特定的自然或物理的对象,大体上与古典经济学发展时期相应;随机型行为,是新古典经济学或现代经济学赖以建立的行为基础,给定产出或结果集上的概率分布,由此衍生出主体依据期望效用进行决策,主要研究(完全)竞争市场环境中的资源配置,如图 1 所示,显然(b)是由(a)类行为推广而来;而由于主体行为的异质性和交互性等,行为反应结果是不

确定的但并非遵从某种概率分布或随机关系,同时还需要将若干不同主体的行为联系在一起描述,以(c)类行为作为理论基础和分析起点,催生新的超越新古典的经济学,能更好地解释探讨个体行为与集体行为的内在复杂关系。现实经济行为的复杂性,迫使人们寻求更加适用的方法工具来探讨,逐步推进地打开行为黑箱,具体要研究现实问题中的行为究竟更符合哪一种假设,需要检验判断和选择。

图 1 (a) 确定型行为发生器

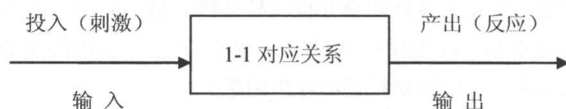


图 1 (b) 随机型行为发生器

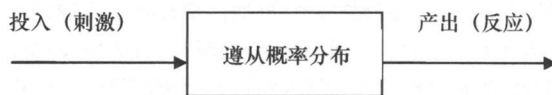
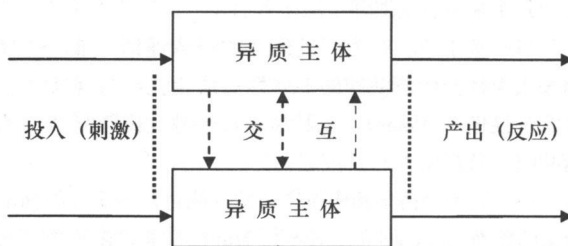


图 1 (c) 复杂型行为发生器



而对于复杂经济中异质性主体的交互关系和结构,可概括为如图 2 所示的基本网络形式,基于如此的网络结构(可扩展到多维多层次),有助于从基本的微观层面入手,通过逐层(群组)涌现,^②直至对经济系统特有复杂现象的形成、形态及演变形成总体认识。无论现实经济问题多么复杂,由众多差异性的微观个体,经相互作用和若干层次的传导积聚,最终涌现出整体现象的机理是类似的。

一个简化的包含两个差异性主体、由两个不同的利益群体(社会阶层)组成的基本网络关系见图 2',可作为对主体相互关系进行理论分析的基准形态。

图例说明:实心或空心的圆点各代表具有不同行为特征的主体;包含若干主体的六边形、矩形和椭圆等图形表示不同的类群或子系统(同类行为、社会阶层或利益群体);各类箭头表示主体之间和群体之间不同的联

① 对经济行为加以简化抽象作为基本行为假设是理论发展之必需,但应该注意到的是,与此同时也相当于设置了行为“黑箱”。

② Clower, R & Howitt P., 2000, The Emergence of Economic Organization, Journal of Economic Behavior and Organization, 41, pp. 55-84.

系方式、相互关系和结构类型。^①

图2 异质主体的基本网络关系

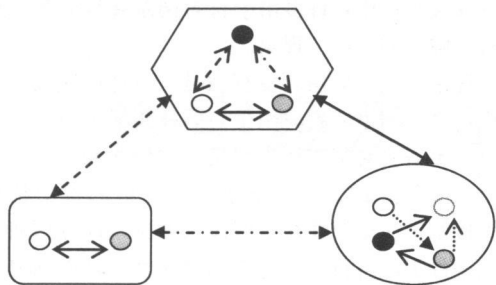
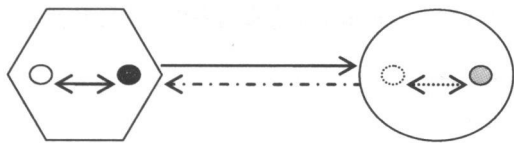


图2' 两主体两群组的网络关系



2. 基本决策行为模型的推广

从分析认识个体的差异性、私有信息产生的根源和发挥作用的条件，到交互行为中形成的个体与集体的行为关系来揭示社会经济活动特有的复杂性，逐步深化和更有针对性地处理由个体差异和交互性造成的主观不确定性，有望更好地解决互为因果和共线性等经典难题。基于异质性和交互性，我们提出构建主体行为的自利性与社会性相结合、个量和总量双重约束条件下的一种新的基本行为模型。

假设一经济体 ϵ 中有 n 个行为主体（消费者、生产者、银行和政府等）和 m 种商品，可用实验方法测定行为特征参数以表现主体 i 的差异性，记为 λ_i ，主体的行为特征集 $S_b = \{ \text{自利理性, 利他动机, 合作愿望, 公平倾向, 互利意愿, 社会偏好, 反应模式和类型等多行为属性} \}$ ，记 i 的效用函数为 $u_i = U_i(x_1, x_2, \dots, x_n; \lambda_i)$ ， $x_i = (x_{i1}, x_{i2}, \dots, x_{im})$ 是一个 m 维商品组合向量；就消费行为而言，仍可沿用 x_{ij} 表示消费者 i 购买商品 j 的数量， X_j 和 P_j 分别表示市场上商品 j 的总量和价格， I_i 为消费者 i 的可支配收入，于是：

$$\text{Max} u_i = U_i(x_1, x_2, \dots, x_n; \lambda_i)$$

$$s. t. \sum_{i=1}^n x_{ij} \leq X_j \quad (S-1)$$

$$\sum_{j=1}^m P_j x_{ij} \leq I_i \quad (S-2)$$

$$i=1, 2, \dots, n; j=1, 2, \dots, m.$$

在如此的多主体联合决策的基本行为模型(MAJDBM: Multi-Agent Joint Decision Behavioral Model)中，(S-1) 是总量或相互关系约束，(S-2) 是个量约束， n 个行为主体都是在个人预算和外部环境的双重约束条件下进行效用最大化决策，既注重个体理性，也考虑到集体理性，有望使一般均衡与纳什均衡同时实现。在实际决策

时，每一个主体面临两个约束条件中约束性较强的一个，或者同时满足 (S-1) 和 (S-2)；而现代经济学中单一主体的效用最大化标准模型只是在上述模型 MAJDBM 中不考虑主体的异质性、不考虑总量或交互性约束 (S-1) 时的特例，此时该模型简化或退化为经典的个体决策行为模型：

$$\text{Max} u_i = U_i(x)$$

$$s. t. \sum_{j=1}^m P_j \leq X_j \\ i=1, 2, \dots, n; j=1, 2, \dots, m.$$

其中 $x = (x^1, x^2, \dots, x^m)$ 为 m 种商品的组合。

选择不同的微观基础和基本假设，就会得出不同的理论结论，对现实经济问题就会有不同的解释。相比而言，MAJDBM 有一些新特点：主体是异质的和交互的，行为特征是内生的和演变的，同时考虑个体理性和社会理性，是多主体联动决策等。面对此类模型，借助计算机模拟手段，有望更合理、深入地展现和解释复杂经济的微观成因、内在联系和演变过程，平行地建立起一套理论体系，更有成效地研究解决现实经济问题。^②

五、中国经济理论发展的契机

科学精神在不同条件下和不同学科领域中的表现方式会有所不同，在经济学发展历程中是一以贯之的、广泛适用的：不断地加深和丰富对理性行为的阐释，修正和改变对行为本质特征的认识与表述，增强理论对现实的解释力和预见性；从逐步地、局部性地放松和改变假设，到全面地将经济行为特征研究内生化的，可以大大扩展和丰富经济学研究视野与内容，这无疑也是中国经济理论建设和发展的一个良好契机，具有重要的借鉴和启发意义。

在研究中国经济问题时，更需要继承理性行为假设的合理内核，更加注重运用科学的分析方法和手段，而不是想当然或盲目地接受已有的特定假设和理论结论。中国许多现实问题冲击着现代经济学的隐含前提和基本假定，因而在设定基本行为特征时，需要更多地考虑总量与人均的关系、结构性问题、交互性、传统观念、文化背景等特定的经济环境因素。如：当总量约束的影响大于个体收入预算的约束时，当交互行为明显影响使每个人的选择机会减少或交易成本过大时，由此导致个体偏好实现不充分、不完全等，即难以完全按照自身偏好来决定自己的选择行为；现实社会中的人际关系网，讲求和合、集体精神与“天时、地利、人和”的传统文化

① 现代经济学的“科学化”趋势试图使图中的圆点、图形和箭头连线同质化、稳定化和规范化。

② 建模的流程方法与特征比较及应用可参见王国成 2009 年中国管理学年会大会交流论文“管理复杂性的微观分析建模及模拟应用”。

理念都会对独立的个体行为产生显著影响；现实中在一定质量水平上的商品（就业机会）不充足，实际供消费者（劳动者）选择的范围小于理论上的偏好定义域，其影响程度使约束条件发生明显改变时，行为特征和模式就会发生相应变化……。从上述行为差异的任何一点切入，放松、改变甚至重设基本行为假定，并通过考察其受经济活动的影响所发生的改变，将基本行为特征的研究内生化，都会得出有全新意义、更具针对性的理论结论，就可能将中国经济问题的研究更加规范进而形成理论体系。贯通于经济学发展历程的科学精神与中国现实需要有机结合，必将有力地推动中国经济理论的建设和发展。

又如，分析中国经济环境中的问题时，应该对个体行为的社会性给予足够的重视，因为相当多的人不仅追求总量和绝对量上的边际正效应，实现帕累托改进（即绝对量意义上的帕累托有效），还希望个人所得份额会有所扩大，至少保持不缩减，这就是相对意义上的帕累托有效性。结构性问题的长期困扰和存在恶化的可能，收入差距拉大、马太效应等，这些势必加大结构调整优化、理顺相对比例上的难度，这类结构的僵化不利于预期目标的实现，甚至会朝着相悖的方向发展，往往是个体行为的社会性造成的，是很典型的应该从行为根源上寻找原因的问题。若总是沿个体理性的路子发展，是不可能产生类似于帕累托相对有效性这类概念，也就难以从根本上揭示和解决结构性问题。尤其是认识中国现实经济问题深层的根本原因，更需要从行为层面逐步展开，探索诸如：市场经济的个体激励理念和产权组织方式与社会经济基本制度、核心价值观、传统文化和主流道德的相容性；个体行为能力及适应性与市场经济基本要求和目标实现之间所需要的磨合与创新；个体行为与公共制度的协调适应性等，这些无疑是中国经济学理论研究中不可或缺的重要基础。

运用实验经济学方法，我们研究了我国高校毕业生的个性化和多元化择业行为，对劳动力就业尤其是高端人才市场的影响；基于投资者真实行为，着重考察股民的冲动行为与股市波动之间的复杂关系，这些对我们关

于深入研究行为属性的理论探索给予了一定程度上的实证支持。^①可用本文所述的观点和方法，分析和解释在我国现实经济中，许多由于行为偏差导致的难以用正统经济学解释的“怪”现象。

当理论形成与应用环境有别时，当将现代经济学从发达市场经济国家移植应用于不同社会经济条件的其他国度时，更需要对基本行为假设进行检验和分析。根据实际背景和问题的需要，秉承经济理论的科学精神实质，直接修正甚至改变初始假设，更深入地分析研究各种环境条件下经济行为的特点和异质性，是中国经济理论建设应该足够重视和尽可能充分利用的良好契机和具体的切入点，敏锐地捕捉这一契机并力促其向纵深发展，是我国经济理论工作者责无旁贷的责任和使命。

结语

基本行为假设的多样化、精深化和演化性，是当今经济发展鲜明的时代特征。通过异质化、内生化等方式和途径，打开理性黑箱、拓展行为研究是现实的需要、逻辑的自延、可行的方法手段及有利的时机和条件共同作用的结果，定会使经济学的内容大大丰富，科学化进程加快，发展方向进一步调整和校准；以此为契机，也必然会有力推动中国经济理论的建设和发展。

本文作者：中国社会科学院数量经济与技术经济研究所研究员，中国社会科学院研究生院数量经济与技术经济系教授、博士生导师

责任编辑：赵俊

① 参见王国成、葛新权《高校毕业生择业行为的实验经济学分析》，《中国劳动经济学》2009年第5卷第2期；刘飞“基于股市投资行为的微观动机与市场效率研究”，中国社会科学院研究生院硕士论文，2009。

Behavior-orientation of Contemporary Economics and Chinese Opportunity

Wang Guocheng

Abstract: Assumption of rational behavior is the keystone of modern economics, and it should be tested for keeping the scientificity of economics. There is a tendency in economics from exploring resources allocation as behavioral results to exploring the characters and process of economic behavior through considering the relation between behavior assumption and economic theory. This paper analyzes the historical background, theoretical cause, as well as manifestation forms and evolution process through which the assumptions of basic behavior are made. It also looks forward to the inevitable trend that economics devotes itself to behavioral model study again, and concludes this trend creates a good opportunity for the construction and development of China's economic theory.

Key words: economic behavior characteristics; rationality hypothesis; economic theory of China

王国成教授



王国成, 1956年11月生于河南许昌; 经济学博士(数量经济专业, 1996), 工学硕士(管理类专业, 1988), 理学学士(数学专业, 1982); 现任中国社会科学院数量经济与技术经济研究所研究员, 研究生院教授、博士生导师。

1997年评聘为教授, 1998年~2001年任中央社会主义学院学报编委会常务副主任、主编、编辑部主任等职, 2006年调入中国社会科学院工作, 2007年转为研究员; 兼任中国数量经济学会常务理事、全国博弈论与实验经济研究会理事长、北京改革和发展研究会理事; 曾受聘担任燕山大学博弈论与决策应用研究所所长, 吉林大学商学院博弈论与竞争合作研究所所长等。

王国成教授受国家留学基金杰出学者项目资助(2003年8月—2004年12月), 作为高级研究学者先后在北京外国语大学接受出国培训, 在美国北卡罗莱纳大学夏洛特分校作访问教授(涉及数理统计和数量金融领域), 在乔治·梅森大学的经济学跨学科研究中心(ICES, 由获得诺贝尔经济学奖的Smith教授创建), 从事与博弈论和实验经济学有关的博士后研究工作; 实施美国国务院国际领先者项目(2008年9—10月), 到美国财政部、美联储、IMF和SFI等部门就经济研究前沿方法和金融危机等有关问题进行专项考察; 执行中国社会科学院与英国学术院的双边协议(2009年6—7月), 作为交流学者到英国的财政研究所(IFS)等教学研究机构调研访学; 赴荷兰中央计划和政策分析局(CPB)、奥地利IIASA等学术机构进行微观分析模拟的专题学术交流访问(2010年3—4月); 并与其中的专家和项目团队建立友好的合作关系, 保持长期稳定的学术联系。

王国成教授具有跨文化跨大门类的教育背景、交叉学科的知识结构和多年的学术积累, 自1982年起为

高等学校的工科专业和管理类的本科生、研究生讲授《高等数学》及延伸课程; 近年来主要从事博弈论及应用、实验经济学、数量经济理论与方法等领域的研究教学与咨询工作, 为中国社会科学院研究生院、北京交通大学、吉林大学和燕山大学等有关高校的本科生和研究生讲授《博弈论》、《实验经济学》、《产业组织》、《规制经济学》和《契约理论》等课程及讲座; 并多次为清华大学、北京大学、中国人民大学和中央财经大学等高校及办学机构的研究生、MPA、CEO现代项目管理、公共管理高级研修、中美合办的工商管理博士(DBA)等班次, 围绕博弈论及应用开设学术讲座和培训课程; 开创性地提出设置“博弈论与宏观经济微观分析”的博士生专业方向。

王国成教授是我国第一位以博弈论及其在中国经济中的应用为主题撰写博士论文的学者, 长期以来致力于博弈论与数量经济学的基础研究、理论进展和应用领域的探索, 尤其是在现代经济学与中国经济理论建设的结合方面付出了不懈努力; 出版《企业治理结构与企业家选择——博弈论在企业组织行为选择中的应用》等五部个人专著, 合著十多部, 合作主编《博弈论与实验经济学论丛》1—4卷(2006~2009), 译著四部, 在国内权威杂志及相关学术报刊上发表研究论文数十篇, 多次在国内外国际会议上进行学术交流; 作为项目负责人、首席专家主持和完成国家自然科学基金、社科基金两项, 省部级重大课题和一般项目多项, 参与主研国际合作、国家级和省部级等项目数项, 部分成果获奖; 多次受邀参与国家有关部委、地方政府的决策和企业管理的调研咨询服务; 坚持经济理论研究服务于祖国繁荣富强的基本立场和学术观点, 在教学中注重思想性与技术性相结合的方法, 提出的双向委托代理模型、企业家选拔聘用博弈均衡模型、公司多元化契约治理、基于实验方法的基本行为属性研究、经济复杂性的微观分析建模以及企业保健理论等学术见解, 得到国内外同行专家好评和良好的社会反响。

(马光)