# 3 宏观经济学家、效率和不平等

3.1 经济学家、效率和不平等

实证经济学可够宏观经济学家研究好长一阵子了。做研究的宏观经济学家每天的工作往往都是丈量（从混乱的现实生活所提供的非实验数据中挖掘实证规律）和解释（对观察到的现象在数量和性质上进行记录，作为能够表征大多数经济活动的分散交易的均衡结果）世界。对于经济周期、劳动力市场和消费的研究都是典型的例子（如前所述，还包括股票溢价方面的研究，尽管这种尝试并没有完全成功）。

对政策建议做出积极评价是宏观经济实践的一个方面。资本所得税如何改变长期工资率？失业保险扩展收入对于延长失业时间起到多大作用？如果石油价格突然变动，不同的财政或货币应对政策会产生怎样的结果？重大金融监管改革会如何影响经济增长？类似的问题不胜枚举。

然而，在这些政策中有很大一部分其目的是为了维护公平并尽量避免市场结果给人们造成的不利影响。无论是通过对资本所得收税进行再分配，还是实施包括美国失业保险制度和医疗补助计划在内的各种社会保险方案，还是价格管制（比如最低工资和房租管制）和金融规定，这些政策的目的都在于改变“市场”所产生的结果。这些互不相干的政策时刻提醒我们人们是多么不愿意忍受不受限制的市场结果，即使是在美国这样一个显然“亲市场”的国家这种不情愿的态度仍然如此深刻且普遍。

但是，除了衡量或预测一个政策对于结果的影响程度之外，在政府部门或中央银行工作的宏观经济学家需要做更多的工作。他们常常建议政策制定者应该采纳还是拒绝这些政策。他们的这些判断是在什么基础上产生的？在应该对市场结果施加何种程度的影响的讨论中，宏观经济学家起到了什么作用？在本章和下一章中，我将具体向大家介绍ADM模型具体是如何指导我们改变市场结果的。学习了这两章内容之后，您会发现要理解第五章变得非常容易，而第五章中我们将学习一些目前正在应用的最重要的模型来讨论经济活动中“公共”干预的成本与收益问题。

随着我们学习的深入，我希望读者要记住这样一个事实：无论是宏观经济学家，还是牙医、钣金工、律师或者从事任何一项职业的人，在判断什么是“公正的”、“公平的”或者“正确的”的时候，他们的观点应该得到平等对待。宏观经济学家唯一的专业贡献（尽管这点很重要）就是为思考和衡量如何在不同政策之间作出权衡提供了一套工具。1

3.1.1 分散交易与不平等

   对于所有分散交易体系——主要指世界范围内使用越来越多的私人所有权（也就是“资本主义”）体系——最大的批评就是这种体系产生了不平等，然而更糟糕的是，只有存在不平等才能够保证这种体系正常运转。2作为研究总量经济的主要基准模型，ADM模型对于我们看待这些批评有怎样的影响呢？在考虑市场与不平等问题的时候，首先我们会想到以下一点：ADM模型告诉我们，结果的不平等往往体现了市场参与者来到市场之初所拥有的资源情况。这样想并不奇怪：如果我名下只有一把青豆和八个网球，这些东西的价格不太可能高到可以用来换一个房子、一辆车或者能够让我在我最喜欢的饭店美美地吃上一顿。

还有更严重的情况，比如您可以想象一下美国高中辍学生所处的窘境。目前情况下，以及在可以预见的未来，这些孩子的小时工资不会太高。那么，即使这些孩子幸运地生活在一个存在运转良好的WCH的社会，这一社会最终肯定不会给他们留下任何互利的交易机会，他们也不可能有机会按照双方都接受的价格将自己的劳动力卖出去。没有人可以保证他们会过上舒服的物质生活，而实际上他们往往不会衣食无忧。尽管要求结果必须是有效率的可能已经排除掉了很多结果，但是总会有完全高效却极其不平等的结果产生。如此，帕累托效率就成为了一个看似很弱的判断标准。

但是需要注意的是，不平等结果可能具有充分效率的这一事实告诉我们不能因为存在不平等就简单判断经济体系失灵，至少通过帕累托效率标准就不能如此判断。也就是说，如果市场参与者的初始能力和资源就不相同，从“已经不存在任何机会使所有人的情况都变得更好”的角度来说，交易安排也许已经做了它所能够做的一切。3因此，那些担心市场永远存在不平等的人根本就没有抓住问题的关键：市场只是人们为了从交易中共同获利而发明出来的工具。市场并不是为了让人和人之间变得更加平等而设置的机制。事实上，直觉告诉我们，如果人们在进入市场的时候能力更加平等，那么结果也会更加平等。这个直觉是正确的，我们将在下文中讨论。

3.1.2 经济学家对于“效率”的痴迷

在整本书中我一直在强调帕累托效率这一概念。在谈到政策的时候，帕累托改进就成为了我们要关注的中心概念。这一术语的内涵与它的字面意思相符：它就是指所有家庭都希望它出现的一种改变。这些改变其实是很难实现的，因为几乎任何一项政策都有可能对一些人有利而却对其他人不利，这样就没有办法达到帕累托改进。经济学家往往比政策制定者更痴迷于这一概念，他们认为一项政策哪怕只能实现潜在的帕累托改进也是好的，这时政策变动的受害者可能会通过其他方式进行补偿。事实上，即使有些政策也许会导致更大的不公平，只要它们够实现潜在的帕累托改进，我们至少表面看起来仍然愿意进行改进。经济学家不厌其烦地建议政策不应该干预市场，这就是一个常见的例子——比如，不要干预受灾地区的生活必需品价格，废除最低工资法，或在宏观领域停止对资本所得或奢侈品收税——这些政策都是社会为了进行再分配而制定的。

那么，经济学家与普通（中间）选民的再分配目标是否一致呢？有一些当然不一样，但是大部分经济学家之所以认为帕累托效率如此重要还有其他一些原因，而且所有这些原因都包含在我们的ADM框架中。首先，最重要的原因是：一旦（宏观）经济学家开始为非帕累托改进游说，他们就是在对社会成员之间的福利分配进行主观判断。在这个问题上，经济学家的观点就不能比其他人群得到更多的关注。然而，我们的工具只适合完成一个更加平凡的工作：它们可以分析交易安排或政策，也可以分析这两者的组合，并判断这样做对（模型）经济体中不同类型的参与者到底是浪费的还是有成效的。4这是宏观经济政策分析的主要工作，能够帮助人们用最节约的方式实现社会所追求的再分配目标。5

经济学家如此关注效率还有第二个原因：一项政策应该努力寻求帕累托最优的结果。如果不这样做，就相当于承认这项政策下所得到的最终结果对于所有人来讲都不是最优的。但是要实现帕累托最优配置是非常困难的，因为想要做到这一点政策制定者需要知道关于消费者和生产者的一切情况，而我们之前讨论过想要做到这一点根本就不切实际。更何况，由于必须保证（这样做显然不现实）政策制定者不可以使用所掌握的信息操纵或裹挟市民，他们肯定没有动力获取足够数量的信息。如此，我们能够选择帕累托效率结果的能力是非常有限的。除非我们能够通过政策实现福利经济学第一定理的预言：在这种情况下，实行分散交易，获得瓦尔拉斯结果，这就是我们将会得到的帕累托最优结果。但是这一结果的实现并没有考虑到初始禀赋，因此它很有可能是极其不平等的。

除了极其幸运的情况，一般来说政策制定者所选择的结果即使也许会比目前的状况更加公平也一定没有穷尽所有可以互利的交易。这里，信息障碍为政策制定带来了一个严重问题，尤其是在再分配方面：除非我们确信无效率的成本主要是由相对较贫穷的人来承担的，政策所产生的分配结果可能事与愿违（我将在下文中进一步讲述一些教材里的例子，比如租金管制与“奢侈”税）。结果，经济学家总是或多或少地担心那些缺少切实的潜在帕累托改进的干预措施，以及那些不符合福利经济学第一定理的前提条件的政策。

造成宏观经济学家对不平等问题的普遍看法的第三个原因是：在一些情况下（这里要强调并不是全部情况下），不平等是由市场失灵导致的，此时政策权威可能不会有太大的作为。举例来说，让我们想象家庭面对个体层面的劳动力市场风险，而他们不能够通过保险将这些风险完全排除。假设他们意图从某保险公司购买一份保险，这份保险会在他们被裁员的时候派上用场。如果没有这样的保护措施，那么也许您就需要攒点钱以备不时之需。但是这意味着，随着时间的推移，那些没有被裁员的人的银行余额比那些真的被开除了的人的银行余额要多。结果，工人们自己的工作经历将会导致他们在财富上的不平等。

下面考虑这样一种情况：由于保险公司无从知晓其被保险工人在失业之后为找到新的工作付出了多少努力，结果经济中缺少由私人部门提供的综合收入保险。这就是我们所说的道德风险。如果保险公司将针对失业提供一份能够完全补偿失业者收入损失的保险合同，其所提供的价格也许对工人并没有吸引力。在这种情况下，任何出于好意的由公共资助的政府失业保险计划都会切实帮助被保险人，而且这一计划的实施让人们觉得没有必要再进行“预防性”储蓄，因此社会福利和消费就会变得更加公平。然而，由于从社会整体层面来讲，这一计划可能会降低人们的工作积极性，最终会导致社会总收入的降低，而因此对很多人造成间接伤害。当然，对于大多数人来讲，做出这样的权衡也许是有价值的，而且全世界范围内普遍存在的公共资助的安全网络也表明我们必须这样做。不过这样做也不可能没有负面影响。这类保险的存在很可能会使整个经济蛋糕变小。

在考虑这样一种情况：通常来讲一个普通人不能够以较低的利率取得贷款，因为贷款人不相信他的偿还能力。政府当然可以帮助这类人，而且通过均衡信贷准入政府还可以平衡家庭生活标准。然而，这样的帮助会导致其他信用更好用户的信用流失而且必然会致使贷款违约率上升并产生消极的副作用，尤其是采取补贴方式的时候，因为补贴会直接导致贷款人放松信贷标准。

以上例子向我们展示了经济学家所认为的市场失灵的两个主要来源：私人占有的信息和/或缺少像一开始承诺的那样去行动的能力。除非我们认为政策制定者拥有某些特权可以获取更多信息或者有能力对严肃惩戒违反合同的行为，否则他们就没有办法改进这些由私人交易在处理这类问题（有时只是部分成功）中所形成的组织机制。

因此，在所有现实情况下，几乎都存在公平与效率的权衡。6第五章将讨论一些被宏观经济学家用来量化这种权衡的模型，到时候我们还会看到这一研究领域是非常活跃的。但是目前我们仅仅指出这种权衡的存在会降低包括经济学家在内的大多数人对于再分配的评价。

公平的实现也许会以牺牲效率为代价，也可能对社会上所有人都造成一些损失，对于这一现象我已经给出了几点理由。那么获得帕累托有效结果——或者至少是追求帕累托改进——这一目标相对于那些直接寻求改变不平等现象的政策更深入人心。对于那些担心一味追求效率会造成重大损失的人们来说，他们听到改善效率有时会促进公平的消息一定会非常开心。在这种情况中，处理公平问题的最好方法就是追求效率。我们在第五章中将会看到，目前有大量研究表明我们平时所观察到的很多不平等现象都是市场缺失的象征或结果，特别是在那些为了抵御某些风险而提供保护或保险的市场中。这类情况包括易得的针对失业（尤其是残疾）的私人保险的缺失，对无担保消费信用市场的干预，以及成为贫穷或不合格的父母。而在一个刚刚步入社会的新人看来，最后一种风险大概是目前来讲最重要的一个。

显然还有这样的情况，一些市场的缺失可能会导致其他市场长期存在不平等。举例来说。对于某些风险来讲，如果缺少一个保险市场，社会上相对富裕的行为人就更愿意承接一些高风险高收益的项目，而那些相对较贫穷的人就不会这样做（比如，为了让孩子获得学历并在未来得到更高的收入，一些富裕的家长会选择借钱让没有完全准备好的孩子去念大学，而贫穷的家长也许无法承担这样的风险）。长期来讲，当所有其他条件都相同时，前者也许会变得相对（绝对）更加富有。实际上，正如第五章中将会讨论到的那样，即使给定余下市场的有限能力，瓦尔拉斯结果也不会是有效率的。这被称为“约束无效性”，这一理论主张一种自由放任的消极观点，这比我们通常的推理更加复杂一些。

在某些情况下，交易不受道德风险的影响（正如前文中所提到的失业的例子），而是受到一些不参与市场的力量的阻碍，这是公共政策就起作用了。比如，如果大多数人都了解自己失业的风险，而保险公司却不了解，那些几乎不存在失业风险的人就不会购买任何失业保险，这样那些需要保险的人群相对来讲风险就会变得更高。私人保险公司要想实现收支平衡就需要获得更高的溢价，而更高的溢价降低了那些留在保险市场中的人群中相对风险较低的人继续留在该市场中的意愿，事情就这样循环往复。这种情况被称为逆向选择，如果某项政策能够强迫参与者留在保险计划中，那么就能够实现效率。这就是我们常常在汽车保险（还有医疗保险）中所看到的一些规定的基本思路。同样的，如果我们知道对于合同义务的有限承诺是导致某一给定市场中一些互惠交易无法实现的原因，我们也许就能够在政策方面提供一些帮助了。比如，对于贫困家庭来讲，无抵押贷款是非常昂贵的，通过公共政策的实施也许就能够保证效率。一种直接的方法就是用严刑峻法来约束贫苦家庭。当然，这些干预措施都要根据具体情况而定。7有趣的是，在这两个例子中，虽然政策反应的目的都在于提高效率，而不是特意为了消除不平等，但是实际上这两种政策都有一个潜在的作用，那就是让家庭之间变得更加平等。

在以上的两个例子中，因为存在不能保险的风险，也因为人们倾向于通过储蓄或使用信用来进行“自保险”，所以最终人和人就会变得不平等。因不同家庭的劳动力市场经验所产生的财富和债务方面的不平等肯定会被我们所有人看作是无效率市场体系的投影。

认为不平等现象显示了某一给定交易体系的无效率运行的观点是一个强有力的观点，对于这一点我将在第五章中进行讲述。在我看来，那些表面上看来只是出于再分配考虑的政策在本质上是保险安排，因为所有人都同意这样做，因此它们也是帕累托改进。虽然纯粹的再分配可能反映了腐败的政治程序或对于不同公民福利重要程度的武断判定，“先于事实”的观点提供了一个不同的视角。读者可能在前文中读出了哲学家John Rawls（1971）的观点，这些观点有一部分是正确的。Rawls提出的最大化最小值理论认为除非一个社会中最贫穷的成员的生活水平得到了提高，否则一次政策变化是不能带来社会生活水平的提高的。在本文中，我们将按照John Harsanyi（1975）的版本来进行讲解，虽然这种观点将Rawls的理论当作一个极端案例，却没有对这一理论有所提及。

以上整个推理过程意味着在对那些不是出于效率考虑的大规模再分配政策投出赞成票之前我们必须要认真想好。这使宏观经济学家将注意力集中在解决市场失灵问题上，而不是像社会上很多其他人那样直接关注不平等问题。而且，即使在宏观经济学家明确表示支持再分配目标的情况下，他们通常不会制定政策来影响市场价格，而是要通过改变人们带入交易市场的“初始”禀赋来实现公平目标。我们所说的福利经济学第二基本定理就表明了这后面一种策略的可行性，关于这一点我们将在下文中进行讲解。然而，我们首先要了解一下通过税收改变单一市场中购买者和销售者所面临的价格的做法错在哪里，要回答这个问题有一些直觉是非常有用的。

3.1.3 税收导致的无谓损失

经济学中有一个基本观点认为任何随着人们或企业所采取决策而改变其水平的税收都会导致无谓损失。饭店营业税就是一个典型的例子，通常这种税是按照您所消费总金额的百分比收取的，所以消费的越多交的税也就越多。“公共财政”理论的中心思想是说：在这种情况下，对参与者征收收入税所带来的经济损失（用美元表示）几乎永远都大于税收所得，之间的差额就是无谓损失。换言之，永远都不要认为一次总付税仅仅是纯粹的财富转移。8

对于经常参与讨论如何收税、对什么收税、对谁收税等这些问题的宏观经济学家来说，无谓损失是一个极其重要的概念，尤其是在一个给定的税收政策会产生潜在的间接影响的情况下。举例来说，家庭将收入所得用在所有他们认为有价值的商品和服务上，我们现在准备对这部分收入征税，如果我们向一个宏观经济学家咨询这个“平的”税收制度的好处，他就会构建一个模型，这个模型中会有一部分产出向我们揭示关于整个市场体系中所产生的无谓损失的情况。因此，无谓损失可以用来衡量某一税收政策的“附带”伤害，这里狭义的说就是，面对税收，市场参与者宁可简单地支付一次总付税，也不愿意使其选择受到扭曲。那么是否不管要收多少税，政府都能够根据这一理由征收一次总付税呢？我们马上就会看到事情并不是这样的。但是在对这种税收方式提出质疑之前，让我们先来看一个正好需要使用一次总付税的例子。

3.2 福利经济学第二定理

除了效率，人们还关心公平问题，那么首先自然就会提出这样一个问题：一个使用“自由市场”（或者一个运转良好的WCH！）的社会可以通过哪些帕累托最优配置来促进交易呢？如果存在完全竞争市场，那么所有配置都可以。福利经济学第二定理正式阐述了这一观点。

该定理告诉我们，在某些“合理的”条件下，每一个帕累托有效配置“看上去好像都是”因为存在这样的家庭和企业而产生的：他们都是利己主义者，在进入完全竞争性市场之初都具有一系列禀赋和所有权，并且面对由这些初始条件产生的瓦尔拉斯价格。因此，如果我们知道家庭的偏好和企业的技术能力，在进行任何交易之前都能够指派初始禀赋，并且自由交易像完全市场WCH一样运转，那么我们就能够保证获得有效率的配置并且能够确保这些配置的不平等水平是社会总体所能够接受的。9

为了说明这一定理，让我们回到第一章和第二章中两个农民的例子，并重新学习一下埃奇沃思盒形图（见图3.1）。现在，我们假设（不管出于什么原因）一个仁慈的政策制定者想得到一个如图中点A1或A2那样的有效率却缺乏公平的结果。他能同时实现两个目标吗？福利经济学第二定理告诉我们如果这位政策制定者能够在交易发生之前向个人收取一次总付税，他就能同时实现这两个目标。他只需要将交易前的分配点移动到连接禀赋点和想要得到的帕累托效率结果点之间的直线上的任何一点就可以了。比如，如果经济中存在一个WCH，将初始（交易前）禀赋点移动到点E1，结果就会像我们想要的那样，使交易结果移动到瓦尔拉斯均衡点A1。如果想要实现点A2的瓦尔拉斯结果作为帕累托有效结果，由于这两个农民的无差异曲线在A2相切，政府可以在通过A2的两条无差异曲线的切线上任意寻找一点（比如E2），再为这一点重新设置禀赋即可。因为我们只需要改变禀赋就可以实现这一切，所以我们可以交换那些最容易转让的商品或者选择一个最容易实现的商品转让集合，却不需要将交易前的禀赋直接移动到我们想要实现的帕累托最优结果处。对于任何帕累托最优配置我们都可以这样做，而不管这种配置是多么公平或多么不公平。

Josef的玉米

Jaco的小麦

图3.1

福利经济学第二定理

福利经济学第二定理的意义至少有以下两点。首先，它告诉我们，在定理规定前提下，坚持追求有效率的结果仍然会使所有配置都在处在瓦尔拉斯价格之下。我们不需要使用那些能够产生低效结果的方法去实现我们的分配目标。换种说法，在定理规定的前提下，并不存在公平与效率之间的权衡。我们可以得到任何效率结果，不管它距离（有效率的）纯粹自由主义的结果有多远。只是通过“正确”征收一次总付税和禀赋转移来改变初始（指支付了一次总付税之后）禀赋，就能够在家庭进行交易的时候得到我们想要的瓦尔拉斯结果。

每当宏观经济学家在审视那些为实现分配目标而设置的复杂繁琐的程序的时候，福利经济学第二定理都让他们惊慌失措。想一想美国复杂的税务法律，比如公司税、新颁布的医改法案，等等。10在这一定理的前提下，这些政策确定不能够实现帕累托效率。换言之，混乱的、非一次总付的方法肯定会给我们的社会带来浪费。当然，受分配偏好影响，人们也许会支持以上政策中的一部分或者全部，而且正如我所强调过的，这样做是非常合理的。但是我们必须承认，这样做几乎一定会造成社会浪费，而福利经济学第二定理告诉我们事情为什么会这样。

这里包含了这样一层意思：如果政府在一开始就参与其中，那么仅仅通过“写支票”它就可以实现社会再分配目标，而在此过程中政府不需要参与任何实际生产和分配。政府也不需要实施那些必然会导致无谓损失的税收政策（比如任何使买方支付价格和卖方得到价格不相等的税收）。基本上，大多数人都将融资和生产划分的非常清楚，而且都希望政府只是扮演现存竞争性市场中的一个“个人购买者”的角色而并不插手商品和服务的实际生产。福利经济学第二定理提醒我们政府的核心优势可能在于它们具有税收和转移能力。

按照这些原则，在个体层面上该定理向我们揭示了以下含义：如果不管工作内容和条件怎么样，您都会将工作做好，那么最好是选择对您的付出出价最高的人（或者获得有价值的技能），不停地工作，并向其他人进行一次总付性转移。但是我要告诫那些一心想要帮助别人、成为正直的市民的人们，他们的职业选择首先应该出于自身考虑，其次才能惠及他人。

福利经济学第二定理告诉我们的另一个具有普遍意义的结论是：即使一个交易系统中没有明确使用价格，在关于家庭消费和企业生产的帕累托分配中也暗含着线性的“有效价格”。这一观点我们在前文还提到过一次：当一个经济体非常“庞大”且其参与者对彼此的活动非常了解，就有可能得到核心结果，那么这样的结果一定是帕累托有效的，也一定是瓦尔拉斯结果，而对于这一结果的实现我们并没有明确提到市场或价格的作用。总而言之，这一定理与福利经济学第一定理一道将瓦尔拉斯结果与效率紧密联系在一起。11

实际上，从分配公平的角度来看，只有瓦尔拉斯结果既是“无剩余”结果又有可能实现“公正”或“公平”。经济学家Hal Varian和WilliamThomson（见Thomson、Varian1985）提出了一套非常有趣的结果，这些结果作为瓦尔拉斯结果出现有一些神奇之处，它们是唯一的一种既能够实现“公正”或“公平”又能够满足不同迫切需求的结果，被称为收入公平的瓦尔拉斯均衡（缩写为IFWE）。因此，通过瓦尔拉斯结果实现分配目标看起来当然是有益的。如果我们将真实世界近似看作WCH，这使得我们再一次将注意力放在实现购买力再分配的有效方式上，而不是其他对信息要求更高的再分配方案上。

但是必须明确，这里还存在很多注意事项，关于这一点我们将在下文中看到。

3.2.1 福利经济学定理成为了中央计划的理论依据！

福利经济学第一定理仅仅指出一套完整的瓦尔拉斯价格集合和成本最小化的生产者行为就足够实现“效率”。福利经济学第二定理则认为价格（至少是“有效率的价格”）的作用其实有些虚张声势。这些想法能够帮助我们解释为什么市场社会主义者会对瓦尔拉斯理论做出那样的反应，关于这一点Barone（1908a）和Lange（1936）做出了开创性的贡献。这一运动的领袖们认为——恰恰是基于福利经济学定理背后的那些原因——出于效率的考虑，使消费者和生产者面对给定的但同时也是最优化的瓦尔拉斯价格确实是至关重要的，但是如果国家拥有企业的所有权并且人们有权利公平分享企业利润，那么购买力就可以实现公平分配。

特别地，市场社会主义者感到通过国有资本设备（也许还包括生产者）能比在私人资本市场上获得更好的结果，原因有三点。第一，也是最重要的一点，他们觉得可以获得既有效率又公平的结果。第二，他们觉得国有生产可以绕开垄断问题，避免在市场社会产生无效率的结果。第三，他们深深地担心投资陷入繁荣与萧条循环，因为他们认为这种循环像瘟疫一样笼罩着自由市场社会。他们认为国家更能够抵御投机狂热，这种狂热行为虽然一开始能够带来投资的迅速增长，但是马上投资就会下降，并对金融体系和实际生产造成不好的影响。因为我们都知道在房地产投资泡沫破裂以后产生了大萧条，所以最后这种说法听起来很熟悉。

然而，重要的是，市场社会主义者正确地看到了瓦尔拉斯经济学完全没有提到人们是怎么保证实现瓦尔拉斯价格的。市场社会主义者机械地构想出一种实际上与WCH类似的制度，在这种制度下经济会有规律地运转并为各种各样的商品和服务计算出其瓦尔拉斯价格。然后，在这些价格的基础上，这一机制会指导国有企业生产出能够实现利润最大化的产出水平。家庭会根据这些价格和自己的偏好提供劳动、获得收入，并且最终购买他们想要的商品或服务。只要价格计算正确，市场就能够出清。即便不是全部，大多数生产单位（企业）和有形资本（比如厂房和设备）都归集体所有，私人所有权以及基于私人所有权（股本）的交易都不复存在。政府会成为劳动力市场上唯一的（或主要的）雇主。所有利润所得都会被当做政府一般收入被再分配给大众或再投资到企业。产生的所有损失（比如没能将生产的产品销售出去）都通过降低工资或抬高价格的方式由消费者埋单。因此，市场社会主义者的提议完全否定了价格允许社会通过绝对分散经济获得有效率结果的作用。12

尽管如此，那些尝试过市场社会主义的国家（主要在东欧）并没有取得巨大成功。那么问题出在哪里呢？对于这一点，Joseph Stiglitz在《社会主义将去向何方？》一文中进行了推理。简单的说，Stiglitz的推理告诉我们：在以上的这些警告下，一个由国家经营的WCH无论在形成线性价格方面还是督促企业追求利润最大化方面都是徒劳无功的，与在实际的市场经济中相比，这个WCH要求价格承担了过多的角色，包括在私人拥有信息的情况下让价格提供足够的激励却又不承诺允许失败（就像现代市场经济中的那些大企业一样，国有企业也拥有自己的批拥护者）。与此相比，在实际市场经济中，有一部分这类问题通过团队生产（企业团体）得以解决，即使如果企业存在浪费就会损害股东的利益而且如果企业丧失偿还能力债权人就会强迫企业破产。确实，没有竞争的私人所有权（也就是“资本主义”）就相当于不允许存在失败的资本主义，这种资本主义已经丧失了瓦尔拉斯激励。到头来，这种资本主义注定会导致低效率，更糟糕的是它还是不公平的。

因此，想要让交易环境接近于ADM模型的前提假设，尤其是市场完全性和企业的利润最大化行为假设，界限清楚的产权以及“承认可能会失败的优秀的守旧的竞争方式”是极其必要的。

Stiglitz还提到，分散化的安排必须满足以下三点才能够成功：（1）有意义的竞争；（2）承诺允许存在失败（企业之间）；（3）针对激励问题或创新本身签订创新型合约。对于后者，诺贝尔经济学奖获得者Elinor Ostrom记录了一系列例子，在这些例子中即使不存在“平民”市场，也基本上不会产生失败的结果。

最后，Stiglitz还给出了另外一个有趣的推理：他认为，如果主要的分散性方法比其他的替代方案（如市场社会主义）更具有优越性——而实际上看起来也确实如此——ADM模型并不能告诉我们原因。特别地，他强调，在现实世界中，对于结果而言，价格（当然是指线性的瓦尔拉斯价格）并不具有中心意义，因为尤其是在企业内部看似实行市场经济的情况下常常都有中央计划的情况发生；但是，正如我所说过的，这些中央集权化的行为是在“理性”边界内发生的。

总之，不同国家从古至今的经验表明分散经济的优势无可匹敌并且在提供有意义的竞争方面具有非常独特的能力。分散经济是切实可行的，而且从横跨了整个20世纪的与中央集权经济的对比来看，我们可以肯定地说只有分散经济是可行的。分散经济最大的弱点存在于保险和信贷发放领域（包括长期“雇佣”关系的解除，关于这一点我以后还要反复强调），而且这些弱点非常严重。很不幸，要修正这些弱点是非常困难的，尤其是通过由中央支持的不对消费者负责的并且可以动用国库的大型机构来解决。结果，即使是在当前这种对于使用其他方法大规模替代“资本主义”的讨论不断发酵的情况下，没有任何一种方法有希望真的能替代“资本主义”，还不如对资本主义不时改进一下，或在表现非常糟糕的市场内进行一些小范围的替代，同时要配合使用一些措施以防止“亲商业”的政策阻碍“亲市场”目标的实现。有很多经济学家都认为最后这一点存在很大的风险，最近的讨论请见Zingales（2012）。

3.2.2 福利经济学第二定理的一个普遍教训：税收可能会带来伤害

福利经济学第二定理告诉我们“有效率的结果往往看上去都像是瓦尔拉斯结果”，所以这一定理也说明了非一次总付性税收为什么会产生一定的负担。我们早已经在上文中提到了税收会产生无谓损失。然而，这一结论有两点局限性。第一，如前所述，这一结论几乎总是在单一市场环境下得出的。第二，这一结论是基于对于家庭对价格变化反应的“顺畅程度”的强假设得出的，不管这些变化是由税收引起的还是由其他原因引起的。但是，如果我们不想制定这样的假设呢？如果我们只是像在福利经济学第一定理中那样假设家庭具有局部非饱和性将会怎样？非一次总付性税收是否还总是会导致效率损失？福利经济学第二定理告诉我们答案是肯定的。原因如下：福利经济学第二定理的逆反命题是：“看上去不是瓦尔拉斯结果的都是没有效率的。”但是这意味着，除非所有家庭和企业所选择的结果“就像是”在相同的瓦尔拉斯价格下得到的，否则我们所得到的结果一定不会是有效率的结果。而根据定义，一次总付税已经排除掉了所有人都面对相同价格的可能。

3.2.3 提示一：到底什么是“初始”禀赋？

在这一点上，福利经济学第二定理赞成通过经济学家们所称的“一次总付”的方式对家庭资产收税，并将这种方法作为最好的增收方式，您也许会为此感到吃惊。我们现在难道不应该让人们承担其自身行为无法改变的交税义务吗？事情并非如此。正如我们已经说过的，福利经济学第二定理设想在进行任何交易之前应该存在一次对于禀赋和购买力的重新洗牌，同样重要的，当福利的衡量方法忽略了“真正的”初始分配（指政策制定者重新安排禀赋和所有权之前的分配）的时候也应该这样做。这样去看的话，这里所说的内容就更加具有局限性了。换句话说，如果通过对初始禀赋重新洗牌之后能够消费的商品和服务来衡量生活水平并使用这种重新安排之后的衡量方式来定义帕累托效率，那么就能通过WCH实现任何帕累托有效结果。

因此，这一定理只是一次理论上的好奇；诚然，事已至此，而且“初始”禀赋（比如，人们拥有的房子、股票、债券、汽车等）对于人们的生活水平也非常重要：我们不能没心没肺地假装认为现在进行重新洗牌不会对任何人的情况造成不良影响！举例来说，如果我们预期目前的交易安排可以产生有效率的结果（比如，经济像一个运转良好的完全市场WCH），但是结果却不如某些人想要的那样公平，这时我们的的确确不能在不损害任何人利益的情况下重新安排禀赋和所有权。说了这么多，让我们继而回到由这一结果推导出的这样一个信息上来：福利经济学第二定理告诉我们帕累托有效结果与瓦尔拉斯价格存在一种根本性的联系，而且任何非瓦尔拉斯结果都是低效率的。

3.2.4 提示二：一次总付性再分配的局限性

将真实世界中的“初始”是由什么构成的这一问题放到一边，让我们把问题简化只关注一个全新的社会里最关键的几个因素，将这个社会看成是一个运转良好的WCH。你喜欢公平，但同时也想要得到有效率的结果。为此，你特意去跟隔壁的经济学家咨询，问她“我应该怎么办？”她为你讲述了福利经济学第二定理。“啊！”你说，“我只需要重新分配人们的初始禀赋就可以了。”在这一案例中，由于社会还没有开始运转（也就是说人们还没有拿到自己的初始禀赋和所有权束），你需要做的只是让人们以正确的禀赋开始，然后你就可以静观其变，一个能够达到你所要求的平等程度的有效率的结果就会展现在你的眼前。

这听上去很好，是吧？当然。只是明显存在一个问题。既然不存在一个全知者，政府或其他再分配当局不能够直接知晓家庭的偏好和能力或者现存企业的技术能力。如果他们掌握这些信息，那么我们就不需要市场了。所以，任何想要使用这一定理的人都必须提供这一信息。然而，如果政策制定者不得不依赖被提问人所提供的信息的话，只要参与者发现伪造信息对他们有利他们就一定会给出错误信息。而且，在当代经济中，智力、人格特征等因素都起到了至关重要的作用，真正对这些“禀赋”进行再分配是根本不可能的。因此，唯有可行的再分配就是对个人的劳动所得和资本收入进行再分配。但是，一旦对于人们的行为收入征税，除非能够直接观察到“努力”和能力，这样做必然会改变对家庭的工作、消费和储蓄的激励。反过来，社会就不能使用“一次总付性”或“交易前”转移这类可以应用福利经济学第二定理的措施了。因此，除非整个社会都对未经干涉的分配结果感到满意，否则就存在问题。

事实上，纯粹自由放任市场结果才是通过竞争性市场系统可以获得的唯一一个完全高效率的结果。13而出于某些非常明显的原因，对于很多人来讲都不想看到这样的结果。一个后果是，在现实中，公平与效率之间必然存在权衡。

根据这一点，在不付出成本就不能够观测到家庭偏好和行为的情况下，对于那些必然与个人努力成果的再分配密切相关的权衡，经济学中的整个公共财政领域都在试图对其进行测量和了解。换言之，公共财政研究的是当人们没有福利经济学第二定理所要求的信息或能力的时候会发生什么。14也许，除了理解创新是怎么发生的之外，在经济学中就没有比公共财政更重要的领域了。

公共财政研究中运用了实施理论（见Jackson2001第7节，或Mas-Colell、Whinston、Green1995第23章）。简略地说，从现代观点看来，由于信息私有化常常会阻碍帕累托最优结果的产生（因为个人经常会以不利于社会却有利于自己的方式使用这些信息），一个社会在处理这类信息的时候特别强调要制定相应的规则来降低对人们影响效率行为的激励。关于这一点我们在下文中还要进行讨论，但是现在先让我们来看一下目前我们所看到的、正在应用的关于器官捐献/分配的不同拍卖方法或协议。所有这些机制都能够产生激励，而对于它们到底产生了什么激励的系统化的研究是目前极其活跃的一个研究领域。实际上，2011年的诺贝尔经济学奖就颁发给了两名从事这一领域研究的经济学家——Alvin Roth和LloydShapley。

3.2.5 提示三：一次总付性再分配的实施需要出奇制胜

我们日常生活中所看到的很多东西——尤其是耐用设备（汽车、工厂、公路，等等）——都是源于我们过去所做的决定。严格来讲，人们过去做的这些决策的基础是他们预计会在将来从这些事物中获得收益。这一估计包含了一个至关重要的问题——政策制定者在日后会如何处理这些收益。因此，唯一的一种在现存经济体中无论任何时候都不会改变决策的重新洗牌方式就是要出奇制胜，要让目前的家庭完全意想不到，而且这一招在任何给定的时间点上适用于经济中的耐用资产。

比如，如果政府为了“平整赛场”而突然宣布要对房屋、股票、债券和汽车的所有权进行重新分配而且在日后用永不再收税，结果会怎么样呢？一方面，这种做法看起来并没有对社会造成扭曲：房屋和汽车早已经就位，股票和债券也已经帮助那些生产出这些房屋和汽车的工厂进行了融资。而永不再收税的承诺（如果可信的话）从此以后再也不会改变任何人的决策。那么，是不是我们从今往后就能够获得相对公平的结果而又不用承担任何无谓损失了呢？

也许并非如此。想一想，要想实现这样的重新安排都需要达到那些条件？它要求我们赋予政策制定者突然没收所有人财产的权利，而且当政策制定者承诺再也不会这样做的时候人们要能够相信他们。

在当前的“真实世界”中，唯一与福利经济学第二定理所构想出来的重新洗牌相类似的方法（前提是我们同意不考虑那些在重新洗牌中遭受损失的人所处的困境）就是真正的突然袭击，也就是指那些没有任何人觉得有可能会发生的事情。应该承认，出现这类突然袭击的可能性微乎其微，而我们似乎也希望如此。此外，如果我们所在的经济体能够在任何“初始”所有权和禀赋的分配下实现有效率的结果进而符合福利经济学第二定理，那么即使存在这样的突然袭击，我们也不得不忽略被我们剥夺了资源的那些人们的幸福。

3.2.6 福利经济学第二定理并不要求比福利经济学第一定理更多的假设

下面让我们从技术层面来梳理一下对福利经济学定理的探讨。它在什么情况下成立？那些想要正式学习这本书中观点的读者会发现在对福利经济学第二定理的论证中（比如，Mas-Colell、Whinston、Green1995和Kreps1990），我们会假设企业的生产集合与家庭的偏好都具有凸性。这属于强假设，而且比证明福利经济学第一定理时所需要的单一条件——局部非饱和性要强得多。Maskin和Roberts（2008）给出了简短却清晰的证明，他们的研究表明如果在一个本身就是帕累托有效的初始禀赋安排下存在一个瓦尔拉斯均衡，那么该瓦尔拉斯均衡中的价格一定要能使初始禀赋本身就能够构成瓦尔拉斯配置。这一证明只要求具备局部非饱和性，这一点与福利经济学第一定理一样。15总结成一句话就是：如果我们真的需要“凸性”假设，我们也只是需要它来证明瓦尔拉斯均衡的存在，但是福利经济学第二定理并不需要直接给定一个瓦尔拉斯均衡。

这一技术秘诀具有重要的实质意义，原因如下：正如我在第二章中所提到的，大型经济体中完全市场瓦尔拉斯均衡的存在是一个非常强大的现象，主要由于经济体规模足够大的时候很容易存在凸性。因此，只要瓦尔拉斯模型具有相关性（指在陌生人之间进行激烈竞争的大型社会中）就能够保证瓦尔拉斯均衡的存在。

3.3 非一次总付税有什么好处？或者说，一次总付税有时不利于“保险”

总体上来说，一次总付税在政治上是不可行的，而且历史上也没有实施过。16这应该会让那些给政策制定者出谋划策的宏观经济学家感到紧张。我们是否忽略了什么重要因素呢？通常反对一次总付税的原因主要在于这类税收的反对者认为这种税收方式“不公平”，因为在这一税收条件下穷人和富人需要支付同样的金额，而这对于很多人来说都是不正确的。有这样的想法也不无道理：我们中的很多人都认为某个人的经济状况的好坏只在特殊情况下才取决于其个人努力，而大多数时候则取决于一些完全随机的因素，也就是那些不承保风险。如果你认为不承保风险，或称为运气，对于某人在给定时间和地点所面临的状况非常重要的话，那么一次总付税就具有糟糕的“保险”性。换一种说法就是：如果你不知道自己最后是称为富人还是穷人，你愿意接受这样一个税收体系吗？在这一体系下不管你最终是富有还是贫穷都要缴纳同样的税收。如果不愿意接受，就说明你可能是一个风险厌恶者。而在现实生活中，我们至少都买过某些保险，风险资产的回报率通常也会更高一些（回想一下我们在第一章中所讨论过的Mehra、Prescott1985），我们也都购买过汽车气囊，尽管这些气囊也许我们从来都没有使用过，所有这些事实都证明像你这样的人还有很多。

还有一个更具有普遍性的例子，我们在刚开始工作的时候，都有机会购买一份综合保险合同。这份合同会在你遇到各种不幸（包括失业、离婚、生病，等等）的时候给你一定的经济补偿。但是，如果你没有能力购买不包含扣除条款（这一条款通常规定被保险人至少要对其所遭遇不幸承担一部分责任）的这类保险，那么你未来的境况就真的要仰赖运气了（或好或坏）。现在，想象一下你正身处我们所描述的这样一个社会，不但没有全额保险还要面对下面这个问题：你和所有其他公民都害怕外族入侵。所有人都认为你们的社会需要一个防御体系，而且你们要一起决定如何为这一体系筹款。

如果这个社会现在只面临两种选择：一次总付税，此时所有家庭都支付不变金额的税收；或这，让比较富裕的家庭承担高的税率，而对收入较低的家庭征收较少的税率。考虑到缺少对于他们所面临冲击的保险，公民在一种选择面前很可能会犹豫不决。而第二种选择也许是可行的：它不要求将资源从家庭转移到国家，即使当这些资源对于家庭来说是极其有价值的时候（也就是在遭遇不幸之后）。因此，从政体的角度来考虑，似乎所有选民都更倾向于累进税。如果你赞同累进税，这些听起来都还不错。但是，不健全的保险制度会全权授权给累进税制的支持者吗？不会。要想知道原因，让我们先来学习几个有用的术语。

3.3.1 “事前”和“事后”帕累托效率

当我们在选择中不得不面对不确定性的时候，就存在“之前”和“之后”的差别了，而这也是宏观经济学家（还有政策制定者）在任何情况下都要考虑的问题。前者指选择或政策实施之前，而后者是指在不确定性有了定论之后（或好或坏）。这两种情况在经济学中所对应的术语分别是“事前”（指事实成立之前）和“事后”（指事实成立之后）。

帕累托效率可以通过事前和事后来定义。事前帕累托有效结果是指那些在不确定性得以明确之前家庭所认为的帕累托有效率的结果。事后帕累托有效结果是指这一不确定性已经明确之后家庭所认为的帕累托有效率的结果。那么，下面就让我们回过头来看一下之前提出的一个观点：非一次总付税的问题在于这类税收会产生事后无效率。

这两种效率之间有什么关系呢？首先，事前有效率的结果一定是事后有效的。其次，反之不然：事后效率并不意味折事前效率。第三，事前有效率的结果有的时候也许可以通过一些政策加以改善，而在这些政策下我们所采取的行动一定会导致事后无效率。下面让我们一一对这几点进行检验。

首先：事前有效率的结果一定是事后有效的。为了说明这一点，我们来看这样一个例子。有两个农民，Athreya和Bewley，他们各自拥有一片土地，生产相同的作物，而且两个人都面临着作物减产的风险。但是，事情看上去也没有那么糟糕：他们两家距离很远，而且虽然存在作物减产的风险，可两个农户的总产量是一定的。也就是说，如果一个农户的年景不好，另外一个就会迎来丰收，保证了这两家的总收成一定会是100蒲式耳玉米。如果这两个农民都是风险厌恶的，我们可以想象他们一定会同意平均分配收成，因为这样能够保证他们每个人都获得平均收益，而平均收益是一个常数。

现在，每年收割之后，总有一个人要把多生产出来的玉米送到对方家里去。假设，这两个农民每人都有一台拖拉机，但是Athreya的拖拉机性能不稳定，通常运到半路就会有10蒲式耳的玉米腐烂掉。Bewley的拖拉机则是新的，开起来速度非常快，从来不会导致这样的损失，而且这还是一辆太阳能拖拉机。

事后有效率的结果就是每次需要运送玉米的时候都使用农民Bewley的拖拉机。也就是说，一旦知道了收成怎样，就应该把Bewley的拖拉机开到收成好的田地里，再把作物运送到另外一个人的家里。现在让我们来考虑下面这种安排：Athreya和Bewley有的时候会一起搬运。很显然，即使是在不确定的事情有了定论之前双方也都会认为这种安排应该加以改进。他们只需要约定再也不使用农民Athreya的拖拉机运输玉米就好了。这告诉我们，要求Athreya运送玉米的安排是事前无效率的。换句话说，我们已经表明“不是事后有效率的就肯定不是事前有效率的”，等同于在说“事前有效率的意味着一定是事后有效的” 。

第二点和第三点是相互关联的。这两点是说：对于事后有效的承诺可能会为事前有效带来一些问题，而且有时我们可以通过事后无效率的行动来增加事前福利。这些都是自然而然的想法。想象这样一个社会，人们完全不关心产权问题而且不对偷窃行为采取任何惩罚措施。在发生偷窃事件之后，由于不用把盗贼关押起来并供吃供住若干年，因此这个社会不会进一步浪费资源。这个例子听起来十分荒谬，它说明事后标准可能会包括一些看起来十分愚蠢的政策。到底哪里愚蠢呢？如果你认为这样的政策愚蠢，很可能是因为您是通过事前标准在看问题。从事前角度来看它是愚蠢的：在这个社会中，预期盗窃行为会发生的人们不会再努力工作，也不会再为了让后人变得富有而积累生产工具。也就是说：事后效率不意味着事前效率。

现在请构想一个社会，这个社会缺少一个完美的法律执行体系。由于不能够保证所有犯罪行为都被发现，有些人就抱着侥幸心理以身试法，因此就会产生犯罪。这个社会也许会选择这样一个系统，在该系统下被判有罪的人会受到惩罚，这种事后的惩罚会伤害到有关各方（比如，纳税人筹资建立监狱关押犯人，而这些犯人却不能带来任何收益）。这能是有效率的吗？如果我们使用事后标准的话，答案就是否定的。

但是，考虑事前效率我们应该如何处置罪犯呢？我们可以想象，如果一项政策对犯罪行为处以严厉惩罚，那么从事前角度来看这项政策能够保证得到好的结果。然而，从批判的角度来看，尽管事实如此，这样做之后这个社会也许要把大量的资源花费在监禁罪犯上（被称为事后“浪费”）。从事前观点来看，允许事后无效率结果的政策——或者，实际上是必然导致这样结果的政策——与那些保证事后效率的政策相比，可能会使结果对所有人都更有利。

既然我们已经了解了这些术语，我们现在就回到寻找对于符合事后效率标准的一次总付税的替代性政策的问题上来。这里，存在这样一个问题：基于市场的——或者说分散的——保险安排的不完全性为事后无效率（包括税收和转移计划）改进事前福利创造了多大机会。这一问题取决于您认为经济体中的参与者通过自身行为能够对结果造成多大影响。如果您认为他们的行为不能产生什么影响，很多保证事后有效率结果的政策确实也是能够产生事前效率的（想象在一个社会里，人们难以遏制一生只有一次的要打朋友一拳的冲动）。那么如果违法的人被抓，而经营监狱又十分昂贵，此时把他们送到监狱里就是不明智的选择。相反地，如果犯罪行为来自于所有公民每天都在考虑的冷酷的计算，很多事后有效率的结果在事前也许是非常糟糕的。在此处的例子中，为了免受伤害，我们不会轻易原谅罪犯。

然而，还有一个棘手问题。如果实施事后无效率惩罚能够改善事前福利，那么我们需要对这些行为进行恰当地计算。换句话说，这个问题是一个定量问题，要在各种相互存在竞争关系的的力量中进行取舍。这里没有我们能够依靠的“基本原则”。例如，从事前观点来看，我们必须对犯罪行为加以整治。但是，如果从关押犯人需要消耗社会资源的角度来看，我们就需要考虑要关押多少犯人、因为司法制度的不完善导致我们把无辜的人关押起来的概率是多大，等等。这往往是非常复杂的问题，但是也正是现代宏观经济学正在研究的课题，关于这一点您将在第五章和第六章中看到。17

3.3.2 回到一次总付税，这不利于保险

让我们回到之前的例子，家庭面临着可以在日后生活中得以解决的风险，他们没有为这些风险投保。一旦所有人的人生都被定格，那么我们中的一些会比较贫穷，另外一些人则比较富有。如果我们秉承事后效率的标准，那么我们当然不愿意实施非一次总付税而让我们自己沦为穷人。但是，按照事前效率的标准，情况又会怎样呢？在这个例子中，我认为在没有针对社会成员所面临风险的保险的情况下，所有人都会更倾向于非一次总付税，或者是通过缴纳累进税的方式为防御系统筹资。当所有人都更倾向于非一次总付税的时候，我们可以理智地说这种税收方式比一次总付税更符合帕累托最优标准。换句话说，追求事前效率，就会选择非一次总付税，而不会选择一次总付税。

事实是否真的如此？要是累进税打击人们工作的积极性而且使商品变得更加昂贵（比如，因为提高人们的小时工资，而使商品和服务变得更加昂贵）又会怎样呢？现在，即使是按照事前标准来看，事情也不再明朗了。我们应该怎样做呢？这个问题很难回答。首先，我们需要找到一种方法来衡量以下几个因素：家庭生活中广泛存在的不可保的风险、百姓的风险规避情况、面对税收的时候家庭对于努力工作的态度。当这些问题都解决了之后，接下来，我们必须在这些风险的影响与存在于任何非一次总付税中的无谓损失之间做出权衡。第五章将会向大家展现研究这些问题的工作者的一些发现。但是在这里我们只是知道问题比较复杂，这是个定量问题，尽管某些理论结果在一系列前提假设下可能是非常符合逻辑的，但是市场的本质可以把在使用这些理论结果时候的无心之失变成魑魅魍魉。

这样，对于宏观经济学家来说，好的公共政策分析需要尽可能地将最小化事后无效率的原则（比如对于税收和无谓损失的典型的公共财政观点）与那些在事前观点看来正好相反——尤其当市场不完全的时候（比如前文提到的缺少保险市场的情况）——的结论融合在一起。结果，每当宏观经济学家被问到某一政策有什么好处的时候，他们都必须仔细思考一番。特别地，他们尤其想要知道，当私人市场缺失的时候，这个政策能在多大程度上改善结果，而且他们还想知道存在争议的政策的实施会使——即使只是事前——经济总量缩减多少。当被问到这类问题的时候，一个宏观经济学家需要评估能够得出不同结果的那些前提假设的适用性，而且如果必要的话，他们还需要对其间所做出的权衡进行定量评估。

我赞成主流的观点：我们应该使用事前标准。我是一个“使用在二和四之间CRRA参数并试图牢记帕累托效率的罗尔斯分配主义者”。（这些术语会随着我们的学习变得越来越明确。现在，您只需要知道我们是在使用风险厌恶——但不是太厌恶——的效用函数来评估不确定的结果。）这与其他“主义者”的观点不同，完全是一个后果主义者的立场。它认为某些形式的政府干预是有价值的，尤其是那些保证竞争的普遍性、保护经济体中的新加入者免受童年贫困环境困扰、在私人保险市场不完全的情况下为不幸的人提供保险以及提供纯粹公共品（比如国防与全球气候）的政策。它担心某些干预、规定和再分配过于笨拙、过于扭曲；怀疑在竞争环境下是否根本不需要任何规定；而且对政府是否有能力在不引致浪费和腐败的情况下做出规定持悲观态度。

这样的标准从来不会为了回避利弊权衡而成为不容侵犯的“原则”或“诫命”。因此，它会经常发生妥协。我猜测，这一标准使我的观点与“沉默的大多数”保持一致，我们并不认为这个社会是非黑即白的，也不以摩尼教的观点看待世界。支持这一观点的人不会用过于紧张的——或者往往是阴谋论的——视角来看待大型企业或新兴力量。相反，这一观点的支持者们往往同时持有左派和右派的观点，而且还经常因为通过政治程序做出的选择而苦恼。

3.3.3 我们为什么不应该用事前效率换取公平？

我在上文中曾经说过，因为有的时候不公平可能会被看作是事前无效率，对于公平的追求就与效率目标变得完全一致了。这样的一个观点让再分配看起来让人们更加容易接受，并且让我们相信公平与事前效率之间并不存在一个明显的权衡关系。

但是，如果存在一个明显的权衡关系又会怎样呢？放弃事前效率获取公平真的不好吗？换句话说，关于帕累托最优结果的吸引力的第一个问题也许是：我们为什么要关心帕累托最优问题？毕竟，我们也曾经提到过，甚至有很多看起来极其不公平的结果也可能是帕累托最优的。

（注：158页最后一段，少内容，应该是少抓了一页）

结果是，尽管经济学家们都喜欢说一切都在于创新（而且接下来我也将在本书中说到这一点），认识到这一观点的适用范围是非常必要的。很简单地，我们不能够认为造成目前我们所看到的贫富差距的关键就在于缺乏创新。实际上，持有这样观点的人是缺乏整体视角的。在长期，创新对于整个物种来说当然是最重要的。但是，根据我们所学的知识，我们当今世界所见痛苦的根源不在于缺乏创新，而在于缺少对于目前可用技术的应用，也就是缺少对于帕累托效率的关注。

3.4 思考有关配置和交易制度的一般方法：机制设计

本书的这一部分主要关注效率与公平之间权衡的理论根源，我们说这一权衡是由于缺少信息而产生的。让我们回想一下福利经济学第二定理：它之所以缺乏实际应用性正是因为它不能够对“正确的人”征收“正确数量”的一次总付税。我们不知道个人的能力与偏好，也不知道企业的生产集合，因此便不能用正确的方法征收一次总付税。相反地，一个社会（也许是有意识地）所选择的税收体系往往要求所有家庭都按照其禀赋价值和这些禀赋的出售程度（尤其是劳动时间）缴税。但是，面对这些税务的实体当然可以通过某种手段免税：比如，在征收劳动收入税的情况下，人们可以通过减少工作量实现免税。更糟糕的是，由于征收劳动收入税，而使得劳动所得降低，很多人干脆放弃学习技能。鉴于一般技能具有“公共品”的性质，在其他一切都相等的情况下，对于这些技能的削减会产生巨大的社会成本。一般来说，非一次总付税体制下所产生的行为变化不会引导投入与产出朝着帕累托最优结果的方向流动。那么，我们应该做些什么呢？

自从Hurwicz（1972）开了先河之后，经济学家，尤其是现代宏观经济学家，对这样一种观点变得非常敏感，他们认为在追求效率结果的过程中与信息和承诺相关的限制所起到的阻碍作用与物质资源局限的作用基本相同。基于这一观点，产生了一个全新的经济学分支，被称为机制设计（简写为MD）。这一分支试图精确给出由信息产生的限制，这里的信息指那些私人持有的、涉及到一个社会实现效率配置的能力的信息。我们在第二章中，为了证明市场力量的重要性（通过Myerson-Satterthwaite定理），已经接触了这方面的知识。

MD方法的开山鼻祖是LeonidHurwicz。他与很多其他经济学家一道——其中最著名的包括Stanley Reiter，Mark Satterthwaite，DavidSchmeidler，Hugo Sonnenschein，Roger Myerson和EricMaskin——做了大量工作，深化了经济学家对于信息问题所产生的限制的本质的认识。

正如其名，机制设计是一个试图理解信息与交易规则对于结果的作用的经济学分支。MD方法的一个特点就是它并不是乌托邦式的：它总是试图尊重那些对于善意的政策制定者所占有信息的限制以及对于“机制”中自利的参与者的信息优势的限制。

MD方法将传统上宏观经济学的关注点转移到了问题的起始点。至少有一代微观经济学家问过——而宏观经济学家仍然这样问——以下这一问题：当参与者确实面对/或者不面对一套他们认为无法改变的针对他们感兴趣的所有商品和服务的瓦尔拉斯价格集合的时候，我们又能对所产生的结果说些什么呢？但是，MD方法会问：人们怎样才可以设计一套最合适的“游戏规则”，让潜在的交易伙伴可以在这套规则下进行互动？请注意，当我们这样说的时候，传统方法的局限性就跃然眼前了。MD反映出科学经济学的致力于系统地检验资源配置方案的性质而不是对它们进行预先判断。按照这样的观点，市场——不管其价格是不是瓦尔拉斯价格——只是对商品和服务进行配置的众多方式中的一种。

MD还强调，实际上存在两种“政策”。关于这一点，我不能比Kenneth Mount和StanleyReiter（1974）说的更好，所以在这里便直接引用了他们的话：

经济政策的问题大概可以分为两类：一类是在某一给定经济制度体系下“参数”值的选择问题；一类是制度中的选择问题（斜体后加）。

前者的一个例子是针对饭店实施的单一税率制，它关心的是这种税制的变化会使饭店的收费发生什么变化并对饭店的数量造成什么影响。相比之下，一个从事MD研究的经济学家也许会问：如果想要征收某一给定数额的税，尤其在我并不清楚那个即将成为餐馆老板的人的技术水平和能力的时候，在所有可能的方法中，最好的方法是什么？

对于现代经济学家来说，目前所做的大量工作都是为了理解在私人持有信息和自利策略行为同时存在的情况下我们可以如何有效地促进交易。在这一领域中，经济学家对更好的市场“设计”做出了真正的贡献。从对用于信息传输的联邦拥有的频谱使用权的拍卖，到电力市场，甚至再到肾脏交换，在各种各样不同的领域中，经济学家在改进实际市场表现方面贡献了力量。19

现在，有的人可能会问：我想要表达的对分散交易的热情都哪去了？我们为什么要假定经济学家（或任何其他人）可以对市场功能进行有意义的改进？对于这一问题我会这样回答：我主要是对于分散经济产生瓦尔拉斯价格的能力抱有热情，这些价格被视为给定，当对于“瓦尔拉斯均衡的基础”的研究告诉我们会产生瓦尔拉斯价格的时候我们就会对其产生期待。然而，在很多情况下，我们不应该期待那些在参与交易的人们或企业之间非常流行的前提条件会产生这样的结果。正如在对于Myerson-Satterthwaite定理的讨论中所见到的，在很多实际情况中参与者的总数是非常小的：例如，当某一事物（比如频谱空间）只对于那些已经拥有了某项特殊技能或基础设施的企业有价值的时候，当一方不能承诺在将来按照某一特定方式行动的时候，或者当交易中的一方掌握了一些可以改变对方支付意愿的信息的时候。如果我们认为我们不能够通过改变规则获得更好的结果，或者交易各方自己不能够想出用什么办法可以获得有效率的结果，那么我们就有理由依赖于自由交易了。当然，在Myerson-Satterthwaite定理的前提下，我们知道没有任何一种机制可以让我们摆脱这一问题。

3.4.1 对于机制的限制

 实际上我们已经讨论过了设立一场博弈的话题，给予人们和他们所经营的企业以激励，通过相互博弈产生有效率的结果：这就是我们经常会提到的WCH。通过给定的瓦尔拉斯价格进行有效率的配置已经成为了我们的显性机制。然而，我之前有点投机取巧：我已经重复说过很多遍了，我在一开始就假设所有参与者都是价格接受者，这样做的结果就是让我们忽略了所有与激励相关的问题。特别地，我曾经在第一章和第二章剪短地提到过，如果WCH根据家庭的报告制定价格，那么除非参与者知道他们对WCH制定的价格完全没有影响力，否则他们就会为了操控价格的形成而谎报其需求（作为消费者）或生产能力（作为企业）。按照MD行话，我们会说“直接向家庭和企业索取其偏好和技术的有关信息的机制一般来讲不是‘激励相容的’”。也就是说，如果知道他们的报告将如何转化成社会结果（在这里指所有人都必须接受的瓦尔拉斯价格），参与者也许就不会针对他们所被问及的事情提供真实信息。我们可以重新回想一下上文中提到的公共品（国防）的例子。

前面的这个问题非常普通：关于MD的文献中的一个中心发现就是，对于信息的限制也对通过设立“博弈规则”而产生的效果构成了限制。然而，从更积极的角度来看，一般情况下，如果家庭数量足够多，那么将会使某一给定机制陷入瘫痪的激励问题就会得到改善。用术语来表达就是，“稠密”市场往往不可避免地都是竞争性的。这当然只是重复了我们已经在第二章中学过了的Aumann的等效性原理（尽管在当时的情境下，行为人并不可以操控资源配置机制）。

3.4.1.1 实现社会成果：Gibbard-Satterthwaite以及解概念的重要性

在MD方法中，构建了一场博弈，要求所有参与者都参与其中（如果不能强制参与，就给予他们这样去做的潜在激励），然后再按照所有参与者的行动集合安排一种配置。我们希望MD能够在缺乏关于家庭偏好和企业技术的信息的情况下通过提供恰当的激励——包括通过将个人所得与整体行为联系在一起而激发个体参与者之间的相互竞争——帮助政策制定者获得有效率的结果。

具体地，请考虑这样一个机制，其目的是为一个国家提供一支规模符合效率要求的军队，那么此时军队扩大规模所带来的集体利益刚好被其产生的额外成本所抵消。一种机制可以是询问每一名公民他们如何评价某一给定规模的军队，并要求他们为其评定结果赋值。但是，这种方法根本行不通，因为在任何一场博弈中，每一个参与者都会根据其他人的行为来选择自己的行为。这种互相依赖破坏了效率。直觉告诉我们：如果我认为这个社会上有人会为建立军队埋单，那么我就会不愿意这样去做。另一方面，假设一个社会非常大，以致于个体贡献对于整个社会来讲根本微不足道，那么如果我认为不会有人付钱，我就没有理由要自掏腰包，因为我的贡献根本就不值一提。

这样，如果纯粹从策略角度考虑，让人们汇报自己对于有效率的军队规模的评价的纳什均衡结果就是，不管其他人怎么样，每个人都会汇报说根本不需要军队。用术语来说就是，这种情况下的每个参与者都有一个占优策略，在这一策略下不管其他人怎么做，这个参与者都可以拿到最高回报。实际上，这看上去就好像是在这场博弈之中根本不存在其他人一样，因为他们的选择对于这个参与者的回报没有任何影响。在这种情况下，每个参与者需要考虑的事情都是非常少的。在我们所举的例子中，我们应该设置某种机制，能够让每个人都有说实话的动机，而不管他们认为其他人将如何汇报自己对于军队有效规模的看法。

现在让我们回到MD方法，我们会构建这样一场博弈，让参与者认为说实话是占优策略。这是有实际动机的：通常来讲，在现实世界中，相互依赖关系越复杂，家庭和企业按照博弈论所讲的方式进行理性决策的可能性就越小。在均衡或者“解”概念的万神殿中，如果我们能够找到实现偏好情况下的集体选择的占优策略均衡，那么我们就拿到了圣杯。

让人沮丧的是，这是不可能实现的，至少是不存在这样的占优策略均衡的。这就是Gibbard-Satterthwaite（GS）定理向我们传递的信息。在定义这一定理之前让我们先学习三个术语。第一个，社会选择函数（首字母缩写为SCF）：这一概念是指一种方法，通过这种方法社会成员同意将所有成员的特性（比如他们的偏好和禀赋）转化成某种结果（比如瓦尔拉斯配置）。先不管这是否可信，让我们来看这样一个例子。在不采取任何干预措施的情况下，如果一个经济体像WCH一样运转，那么选择了“自由市场”的社会的SCF就是：根据家庭所汇报的特性得出需求和供给行为，再根据这些行为计算出瓦尔拉斯价格，然后让所有人在这些价格下进行交易。第二个，帕累托的：对于任何家庭类型的集合（即家庭不同的偏好），SCF都会选出一个帕累托有效的结果。最后一个，如果一个SCF满足以下条件，那么它就是非独裁性的：没有任何参与者总是能够根据个人偏好独自决定结果而不管其他参与者的特性如何。

GS定理告诉我们，根本不可能设计出这样一种集体决策规则，使得在这样的规则下人们可以执行占优策略，实现对于机制中主体的所有可能偏好。因此GS定理捣碎了人们认为只要合理控制回报一个社会——不管参与者相对较少，还是像在公共品供给的经典事例中一样参与者较多——就能够完全克服信息问题的观点。

然而，我们还是能够得到三条不太消极的信息。首先，对于私人商品（指那些可以被一个以上个体消费的商品）来说，参与者人数越多这个问题就越不明显。结果，在私人商品和服务的“稠密”（指人口密度大的）市场中，对于好的机制设计的需求并没有那么急迫，因为市场本身就完成了这项工作。第二，GS定理只适用于占优策略。很多其他均衡概念——比如最常见的有纳什均衡——的可以通过精心构建博弈规则而得以实施的结果范围是被大幅扩大了的。20世纪80年代末、90年代初经济学家对这一课题进行了大量研究。关于这一经济学理论分支（也就是我们所说的实施理论）的综述，请见Repullo、Moore（1988）。第三，正如前文中所提到的，实验经济学指出真正的结果看起来往往比理论所预期的更加接近或偏离瓦尔拉斯结果，这就让我们相信即使当严谨的经济理论显示参与者也许会说太多的谎话的时候也有可能会实施有效率的结果。

3.4.1.2 宏观经济学家为什么会关注机制设计？政策制定者为什么也应该关注机制设计？

前面的一节讲解了一些“最纯粹的”经济理论。它只描述了经济学中考察由信息限制产生的理论局限性的那部分。但是，只要稍加想象，我们就能够明白为什么这样的理论对于宏观经济政策制定者来说是占据中心位置的。我们所能够想象得到的为了提供公共品（比如国防或者国家公园的股票）、应对生而贫穷的保险（比如针对孕妇的福利转移）、对于银行的规定、更加普遍的收入再分配（比如财政政策）等等所制定的任何计划都可以通过MD进行了解。在每一种情况中，政策制定者都必须认清参与者对于消费和生产各种商品和服务的评价和能力，这样才能够决定出最优的生产水平。同时，政策制定者还必须面对自己对于获取信息的局限性并想尽办法获得更多的信息。按照GS定理，想要让那些持有私人信息的人主动披露信息，我们往往必须做出妥协。但是这必然意味着获取信息是要付出代价的，而且这一代价既不在于提供公共品也不在于再分配。因此，是MD理论帮助宏观经济学家既能够更好地理解任何再分配都要涉及到的公平与效率的权衡的本质又能够找到最有效率的方法来代理那些在别的方法下会缺失的市场（包括一些保险市场，尤其是公共品市场）。MD还复活了福利定理。不出所料地，正如第二章已经说过的，作为宏观经济学的一个分支，整个新动态公共财政领域都在试图寻找实现面对信息限制仍然有效率的社会保险（失业、残疾等）和公共品水平的方法。20

如果没有这一理论，宏观经济学家和政策制定者就没有任何以效率为基础的正当理由来决定是干预还是不干预分散化的结果。目前为止，我们只需要记住GS定理与那些关于实施理论的文献一道表明政策制定者在帮助社会获得既有效率又公平的结果方面能力是非常有限的。这个结论本身对于解释或理解以下这点非常重要：为什么即使当结果看上去“很糟糕”的时候，对于一个政策制定者来说，其理智的选择仍然是不对这一结果进行干预。MD告诉我们“不带来伤害”并不容易。

3.5 结论

    在这一章中，我们所探讨的问题涉及到经济学家如何看待不公平现象、市场在创建之初的作用以及如何对其进行有效处理。真正用于分析公平-效率权衡问题的模型是我们第五章中将要学习的主题。为了描述这些模型的结构，我们首先应该弄清楚另外一组涉及到宏观经济模型建模的权衡的本质——这就是我们第四章中要讨论的话题。