

确定性条件下的偏好表示和形成及其发展含义

王今朝

(武汉大学经济发展研究中心)

摘要：五种形式化的偏好定义表明，偏好概念应该有更一般的定义。外生的、静态的偏好对于当期经济发展，偏好的形成对未来的经济增长都能够产生重要影响，因此通过教育、完善选举制度和公务员的选择任用机制来改善个人偏好，是促进经济发展的重要政策。

关键词：偏好；内生；政策

中图分类号：F061.3 **文献标识码：**A

在可预见的将来，中国作为大的发展中国家，经济增长率保持在较高的水平似乎没有什么问题。然而，在宏观经济持续高速增长的同时，一些地区和一些人的经济地位甚至长期停留在原来的水平上。这要求发展经济学在继续进行宏观发展研究的同时，更多地关注经济发展的微观问题。本文将发展看成是经济主体（个人、企业、政府）选择变迁的过程，因而致力于理解它们的选择行为，这与发展理论的微观化趋势是一致的。

研究选择行为，无法绕开偏好这个概念。它最初的正式含义是指消费者对消费品组合的一种排序。消费者选择由偏好和商品价格决定。因而偏好不仅影响资源配置效率和生活福利，甚至也影响着经济波动。然而，偏好在经济学中应该具有更广泛的含义。众所周知，世界各国的政策往往是由少数人或某个人制定的，从而这些（个）人的偏好和价值观对于制度选择、制度变迁以及经济结构能够产生非常重要的影响。因此，对偏好的研究可说是发展经济学的—个基础。

偏好影响经济行为和经济绩效仅仅是问题的—个方面，经济行为和经济绩效反过来也会影响人们的偏好。偏好远不是新古典所暗含的具有统一的模式，而是受到制度的制约，因此应该在具体的历史过程中去分析。本文首先描述了偏好的各种表述，然后分析了偏好的形成，最后讨论了偏好和偏好形成理论的政策含义。

—、外生偏好的形式化定义

偏好作为经济学的概念，体现了马歇尔关于“经济学的理论必须用大家所明了的语言来表达”的主张¹。但是，在将日常生活中惯用的名词用于经济学时，我们必须遵循马歇尔的指导，确定它们的确切含义。

按照日常生活的用法，偏好不仅是口味，还包含价值观、强迫性、上瘾等方面，它可能来自先天禀赋，也可以后天形成，总之，它是行为的原因或者个人的特性，该特性决定了个人在—定环境下的行为。现代微观经济学的消费者行为理论将消费者的偏好描述成为消费品空间中的序关系。然而被 Lancaster（1966）誉为“具有伟大美感的玻璃柜里的珠宝”的经典消费者行为理论还要求消费者的偏好是理性的。所谓理性偏好，即序关系的完全性、传递性和自反性。完全性要求消费者对消费可行集合的任意两个消费组合都是可以比较的。传递性要求当涉及三个组合时，其相互关系不能与仅考虑其中两个组合时的相互关系相矛盾。自反性是仅涉及—个消费组合时的—个要求。不难看到，理性消费者的假设要求在一个抽象集合上存在—个全序关系。正如在自然数集合上不存在极大元—样，我们

无法肯定地在任意的抽象集合上根据全序关系得到一个极大或极小元。因此必须对集合的性质予以限制。最一般的限制可以见 zorn 原理²。在下面将提到的 Little (1977) 的文章中, 我们可以看到, 存在某种偏好概念, 可以不要求完全性和传递性。

现代的消费者行为理论可以抽象地建立在偏好理论的基础之上, 但是以函数形式表示偏好能够得到可计算的结果, 例如至关重要的需求函数和福利函数。这些函数表示还可以说明, 为了得到理性选择结果, 需要对消费可行集合以及序关系进行怎样的限制。下面人所熟知的定理 1 表明对理性偏好的要求是基本的, 而定理 2 将把我们引导到古典的效用函数理论。

定理 1: 一个偏好关系可以用一个效用函数来表示的必要条件是该偏好是理性偏好。

定理 2: 一个连续的、强单调的理性偏好可以用一个连续效用函数来表示。

因此, 当效用函数定义在一个紧的消费可行集合上时, 我们可以肯定地得到使效用达到最大的一个或几个甚至无限多个消费组合。更进一步, 对于凸效用函数, 我们可以得到古典的需求函数。

二、外生偏好概念的扩展及其形式化

最早对上述正式概念不满而进一步扩展它的经济学家是 Lancaster (1966)。他认为: 第一, 已有偏好理论建立在“商品就是合意的东西”(goods are goods) 的基础上, 把不同种类的商品看成是对消费者提供效用, 商品之间的差别仅仅是效用大小有所不同, 而把特定商品的内在性质, 例如使钻石区别于面包的那种性质, 完全抽象掉了。这样, 由上述偏好概念所引申出来的理论就是一种“从最少假设得出最少结果”的理论。第二, 已有偏好概念不能应用于一个快速发展的社会。随着经济的发展, 新产品不断出现。这意味着我们需要将消费可行集合的维数不断地扩大。然而, 一个张大的消费可行集合下的偏好与原有的偏好有什么关系呢? 这并不能够确定。从而已有的偏好概念很难用于描述经济发展对需求产生的影响。第三, 已有概念甚至不能用于处理消费者与商品之间存在的许多明显重要的互补、替代、独立以及中性关系。

Lancaster 对偏好概念进行扩展的方法把商品的性质而不是商品本身看做效用的来源。根据这种方法, 偏好的序关系是建立在对商品性质排序的基础上, 通过对商品性质排序间接地对商品组合排序, 而不是对商品组合直接排序。例如, 本身作为一种商品的一顿晚餐既具有营养价值, 也具有审美价值, 不同的晚餐可能具有不同的营养、审美特征组合。这样, 消费就不再是一种商品数量的减少, 而是对商品一个或几个特征的感受。商品不但可能具有多样化的特征, 而且当它与其他商品组合在一起时, 可能会具有新的特征。例如, 中国传统中医歌诀“十八反”中所论及的中药单独或与其它药物使用时, 具有很好的疗效, 但与药性相反的药物使用时, 便产生毒性。

Lancaster 对偏好概念的扩展看起来非常平凡, 但实际上并不是。虽然在分析中他假设人们对商品特征具有同一意见, 因而排除了不确定性的存在, 但这种扩展可以很自然地应用到处理不确定性条件下消费者偏好问题。实际上, 它已经成为现代微观经济学中一种非常典型的方法, 被用于讨论 Arrow-Debreu 均衡问题。

Lancaster 的方法暗含着这样的思想: 偏好可以定义在商品数量以外的其它对象上。正是基于这种思想, Pollak (1977) 建立了价格依赖的偏好理论。他认为, 由于商品的质量可以在一定程度上通过价格来反映, 所以价格可能影响偏好。但是, 他又认为, 影响偏好的价格——他称之为正常价格——可以和市场价格不同。一般而言, 正常价格取决于过去和当前的市场价格。当正常价格只取决于过去价格而与当前价格无关时, 市场需求函数将是短期需求函数。当然, 正常价格只能是一种相对价格而不是绝对价格, 否则将存在货币幻觉。最著名的经济增长文献, 包括 Harrod (1939), Domar (1946), Solow (1956),

Romer (1986), Lucas (1988), 都不容许价格对经济增长产生影响。但是, 许多发展中国家都曾经采用压低利率和汇率甚至农产品价格的办法来获得足够的国民储蓄, 从而提高国民收入的增长速度。因此, 这些理论并没有提供一种框架来讨论这些国家的经济发展经验。而如果将价格引入效用函数, 我们就可能利用无限期界的 Ramsey-Cass-Koopman 模型、Dimond 叠代模型等来研究这些价格安排以及价格变动对经济增长的影响。

价格依赖的偏好是介于直接偏好概念与间接偏好概念之间的一类。一般认为, 只有实际商品才能产生效用, 收入和价格只是名义变量, 并不能为消费者直接带来效用, 所以定义在商品空间上的偏好称为直接偏好, 而定义在价格和收入空间上的偏好称为间接偏好。直接效用函数表示直接偏好, 而间接效用函数表示“间接偏好”, 直接效用函数与间接效用函数是对偶关系³。下面我们讨论引致间接偏好。

一种引致间接偏好的概念是 Little (1979) 提出的。其结构如下:

假设在商品空间 X 上存在严格直接偏好关系 P 。记 X 的幂集为 2^X , 集合族 $B \subseteq 2^X$ 。又记 $p(x) = \{x' \in X | x'Px\}$ 。 $\forall b \in B$, 定义 $m(b) = \{x \in b | p(x) \cap b = \phi\}$ 和 $\pi(b) = \bigcup_{x \in m(b)} p(x)$ 。于是, B 上引致间接偏好 (D) 可以如下方式如下定义:

$$bDb' \Leftrightarrow \pi(b) \cap b' = \phi, \text{ 其中 } b \text{ 和 } b' \text{ 是 } B \text{ 中元素。}$$

也就是说, 对于商品空间的任意子集 b 和 b' , 如果后者没有包含直接偏好于前者元素的元素, 则前者引致间接偏好于后者。这样定义的引致间接偏好不要求直接偏好具有完全性和传递性, 因此它是一种非常重要的扩展。

另外一种引致偏好概念是 Rader (1978) 提出, Milne (1981) 予以进一步扩展的。这是一种更一般的概念, 它将把我们前面讨论的 Lancaster (1966) 作为它的特殊情形。其结构如下:

假设一个消费可行集合 X 属于某个拓扑空间, 一个可交易生产要素集合 Z 属于 n 维空间, 以及一个表示生产技术的上半连续集值映射 $H: Z \mapsto X, \forall z \in Z, H(z) \neq \phi$ 。消费者对于消费可行集合中的消费组合具有经典的偏好和效用函数表示。于是, Z 上引致偏好可以如下方式定义:

$$u^*(z) \equiv \max\{u(x) | x \in H(z)\}$$

不难看出, 这里引致偏好是定义在生产要素集合上, 而消费者均衡问题是求解如下问题:

$$\begin{aligned} & \max u^*(z) \\ & \text{s.t. } pz \leq w \end{aligned}$$

综合以上讨论的五种偏好形式, 偏好就是定义在商品空间、性质空间、商品数量和价格空间、要素空间上的序关系。我们把这些定义理解为形式上的定义, 对这些定义的讨论说明我们可以比较任意地定义偏好, 不排除根据对问题讨论的需要定义其它类型偏好的可能性。例如定义对财富的偏好, 对政策的偏好。下面我们研究市场经济条件下偏好的形成问题, 其中所考虑的偏好是定义在任意有意义的抽象空间上。

三、偏好的内生性: 形成、改变和一般化

无论上述诸位作者做了怎样的扩展, 他们都假设消费者偏好是外生的、不变的。Milton Friedman 把外生、不变的消费者偏好看作是经济学区别于心理学和道德学的基本特征, 他认为, 心理学研究偏好的形成, 道德学研究对偏好的评价, 而经济学研究不变偏好下的消费者行为⁴。据此观点, 经济学对偏好的研究将仅限于对静态偏好的形式化表述, 而且世界各国人民无论地区、气候、历史、文化如何存在差异, 上述五种模型都可以用来描述他们的偏好。

然而，市场经济制度不仅仅配置商品和服务；也会影响价值观、口味和性格。考察一个成年以后的效用函数还有待于形成的孩子，就不难看出，在任何一个非老龄化的社会，至少约 1/6 的社会成员的偏好约在 10 年的时间中内生性地生成。因此，社会可以而且确实在就这些效用函数作出决策，个人偏好会随着经济发展而出现内生性的变化。

一些内生性偏好是文化特征 (Bowles, 1998)，对经济学研究有意义的“偏好的内生性”指偏好至少部分地后天形成或改变。这主要有以下四种途径：

第一，现实经济、政治或社会活动中所产生的信息对于确定偏好所定义于其上的选择空间和选择可行空间是必不可少的。例如，市场经济中所生产出来的产品集合构成了消费者的选择空间，而在其中所产生的收入和价格确定了消费者的选择可行集合。政治或社会活动中的选择空间的确定同样离不开这些活动本身。

第二，现实活动的外在激励效应能够强化或弱化已有的偏好。经济、政治和社会活动提供了个人判断是否满足的简单标准。如果一个人在现实活动中获得满足，她就可以不关心别人如何看她，而继续我行我素，反之则有可能改变自己的行为。因此，现实活动通过影响外在和内在满足的程度来改变偏好。例如，外在激励效应可能降低对同情、父爱、兄爱和团结的需要，因而社会可能出现诸如利他主义缺乏等偏好特征。在传统上被认为是好的个人品质只有在如下一些情况下会发生和加强：交易重复发生；建立一个好名声是占优策略；人群分割；受到强迫。但现实生活中许多交易并不会反复发生，因此机会主义行为屡见不鲜。社会越人口众多，流动性越大，建立好名声的收益就越小，极端利己的机会主义行为的可能性就越大。

第三，市场活动的结果，例如是否就业、是否在工作中得到升迁，可能引起新的偏好。斯密认为，如果人的一生都在从事一些简单操作，那么他永远没有机会运用自身的理解能力去分析问题。他自然会丧失运用理解能力的习惯，这使得他不仅不能够品位或了解任何理性的对话，而且他也不能体会慷慨、高尚或脆弱这类情感。反过来，如果一个人从事高级工作一定有助于增进他的情感。

第四，通过教育塑造偏好。一般认为，现代教育制度的目的在于，通过要求从儿童期就开始接受系统的训练，为其将来能够进行持续不断和明确的信息和知识交流做准备。然而，现代教育更重要的目的应该是塑造偏好。在受教育的过程中，人的认知能力得到提高，偏好形成也同时发生。例如，受教育的人可能形成较低的劳动负效用和较低的时间偏好率，这会影响他们的劳动供给和储蓄倾向。

这些因从事某一项活动而有意或无意学习所形成的偏好将会影响这个人在所有场合的行为，例如，一个人在学校里诚实，在工作以后也会比较诚实，因此，一种习惯性行为可能影响许多其它行为，这就是偏好的一般化。如果我们遵循个人理性这个假设，那么偏好的一般化有三种途径：第一，经济制度导致个人经常面临类似的或重复性的环境，结果产生了“移情”。第二，干中学会导致个人迅速地利用或修正个人的偏好以适应新的情况。第三，人是一种逻辑动物，因此具有减少在经常性行为中，以及新旧行为中不一致的动机，以避免多重人格的出现。这三个途径的产生，可能是两个方面的考虑的结果：第一，对于每一种特征，都会对应于某个支付函数，当个人获得某种偏好特征后，就会根据该支付函数获得一定的收益，因而个人可以根据不同特征所对应收益的不同而选择不同的特征。这种考虑是演化博弈论的方法。第二，如果获得某种特征所得的收益并不明显或不重要，那么这时人们可以考虑不同人之间的相对收益。如果相对收益相差无几，就可能会产生理性从众心理。

综合以上，市场经济条件下的偏好形成过程首先是一种经验，然后将经验一般化的过程。因此，塑造偏好是政策不过是确立影响经验的政策。

四、把塑造偏好作为一项经济发展政策

发展经济学的一般目的就是寻求促进经济发展的一般政策。现代社会分为两个部门：私人部门和公共部门。按照经济活动的性质，私人部门分为消费者和生产者。按照职权划分，公共部门分为决策者和公务员。根据以上分析，应当把塑造私人部门和公共部门的偏好作为一项经济发展政策⁵。

第一，要塑造消费者的偏好。一方面，税收、政府购买、社会保障、公共选择都会影响消费者的偏好，因此在制度相关政策时，必须注意政策对消费者偏好所产生的影响，另一方面，可以通过其它方式影响偏好，以促使公共政策的有效实施。例如，随着社会进步，社会进程越来越依赖公共选择。而公共选择依赖个人偏好的显示与加总。通过塑造消费者偏好，选民的偏好显示问题就会大大简化。就私人消费者而言，其偏好塑造，包括其对民主、自由和公平的态度，主要应该由市场和正规的学校教育自由地完成，同时兼顾公共政策对个人偏好的影响。

第二，塑造生产者的偏好。微观经济学中一般假设生产者是利润最大化或股票市值最大化的。然而，实际中的企业经理可能是以销售收入最大化，或市场份额最大化为目标，甚至以产量最大化或寻租数量最大为目标。经济学原理已经说明，利润最大化或股票市值最大化是企业唯一正确的目标。现代的企业即使在短期内可以考虑偏好其它目标，最终也应该回到正确的目标上去。企业对正确目标的长期偏离会产生巨大的效率损失。因此，应当采取措施塑造生产者的偏好。

第三，应该塑造领导者的偏好。传统的发展经济学把促进储蓄、促进人力资本形成和转移、促进技术进步、加速工业化、财政政策、货币政策、贸易政策、吸引外资甚至计划化等政策作为经济发展的基本政策。然而发展中国家经济发展的历史留下了种种的遗憾：当执行促进储蓄的政策时，消费者的利益被忽视了；当执行促进人口流动的政策时，城市失业的后果被忽视了；当执行促进技术进步的政策时，技术进步对劳动力的挤出被忽视了；加速工业化的政策忽视了农业；积极的财政政策和计划化忽视了市场的作用；扩展的货币政策忽视了通货膨胀的危险；进口替代政策忽视了贸易的利益，而出口导向的政策忽视了外来冲击；吸引外资的政策忽视了发生金融危机的可能性。

这些失误的共同特点是政策出现了过度的偏向，结果出现了所谓资本原教旨主义等问题。出现这些失误的原因在于经济学家对于自己历史使命的过度自负和政策制定者对他们的过度信任。根据马歇尔的观点，经济学家的任务应该是帮助民生，而不是经世济民，那么他们的目的可以通过论文写作来达到。通过不同作者的一系列论文向政策决策者描述出政策的可行集合，决策者根据自己的偏好在该集合中选择适当的政策组合。因此，为了宏观经济决策的正确，应当首先塑造最高政策决策者的偏好。

世袭封建帝王偏好的塑造机制非常简单。他们或者在干中学，或者依靠正规的教育。由帝王子女数量所限制的偏好种类决定了封建社会的制度选择必然比较地单一，因而社会也不易稳定。在现代社会，由于民主化的发展，选举成为领导偏好塑造的替代机制。具有得到广泛认可偏好的人当选这一选举规则支持了现代社会的繁荣。因此，通过建立更好的选举制度和监督机制可以塑造更好的领导者偏好。

最后，应当塑造公务员队伍的集体偏好。社会经济的管理在很大程度上依赖于公务员的偏好。一个公务员不仅是上级公务员的代理人而且是下级公务员的委托人，它不仅具有直接选择的权力，而且拥有影响上级公务员选择可行集合的能力。同级行政级别下一些人的偏好同样能够影响其他人的行为选择可行集合。因此，通过建立更好的选拔任用机制可以更好地塑造公务员队伍的偏好。

参考文献

- [1] 胡长松. 实变函数[M]. 科学出版社. 2002.

- [2] 加里·贝克尔. 口味的经济学分析[C], 首都经济贸易大学出版社. 2002.
- [3] 马歇尔. 经济学原理[M]. 商务印书馆. 1994.
- [4] 谭崇台. 发展经济学[M]. 山西经济出版社. 2000.
- [5] Burton A. Weisbrod. Comparing Utility Functions in Efficiency Terms, or, What Kind of Utility functions do We Want?[J] American Economic Review. December 1977. pp991-995.
- [6] Evsey Domar. Capital Expansion, Rate of Growth, and Employment[J]. Econometrica. April 1946, pp137-147.
- [7] Frank Milne. Induced Preferences and the Theory of the Consumer[J]. Journal of Economic Theory. 24, 1981. pp205-217.
- [8] Hal R. Varian. Microeconomic Analysis[M]. Norton, w. w. & company Inc.. 1991.
- [9] Harrod, R, F., An Essay in Dynamic Theory[J]. Economic Journal. March, 1939.
- [10] James T. Little. Indirect Preference[J]. Journal of Economic Theory, 20, 1979. pp182-193.
- [11] Joao Rodrigues. Endogenous Preference and Embeddedness: A Reappraisal of Karl Polanyi[J]. Journal of Economic Issues. March 2004. pp189-200.
- [12] Kelvin J. Lancaster. A New Approach to Consumer Theory[J]. Journal of Political Economy. April 1966. pp132-158.
- [13] Milton Friedman. Price Theory [M], Chicago: Aldine. 1976.
- [14] Paul M. Romer. Increasing Returns and Long Run Growth. Journal of Political Economy[J]. October, 1986. pp1002-1037.
- [15] Rader, T. Induced Preferences on Trades When Preferences may be Intransitive and Incomplete[J]. Econometrica. January, 1978.
- [16] Robert A. Polak. Price Dependent Preference[J]. American Economic Review. March 1977. pp64-76.
- [17] Robert E. Lucas, Jr.. On the Mechanisms of Economic Development[J]. Journal of Monetary Economics. July 1988. pp 3-42.
- [18] Robert R. Keller, John R. Mckean and Rodney D. Peterson. Preference and Value Formation: A Convergence of Enlightened Orthodox and Institutional Analysis? [J]. Journal of Economic Issues. No.4, December 1982. pp941-953.
- [19] Samuel Bowles. Endogenous Preferences: The Cultural Consequences of Markets and other Economic Institutions[J]. Journal of Economic Literature. March 1998. pp75-111.
- [20] Robert M. Solow. A Contribution to the Theory of economic Growth[J]. Quarterly Journal of Economics. February, 1956. pp 65-94.

The Indicating and Forming of Preference under Certain Situation and their Development Implications

Wang Jin-chao

(Center for Economic Development Research, Wuhan University, Wuhan 430072, China)

Abstract: Five formalized definitions of preference show that a general definition should be given. Owing to the importance of exogenous static preference for the current economic development, and of

the formation of preference for the future economic growth, it is an important development policy to improve individual's preference by education, by consummating election institution and mechanism of choosing civil servants.

Key Words: preference; endogenous; policy

收稿日期：2004 - 11 - 20

¹ 马歇尔,《经济学原理》,商务印书馆,1994,第71页。

² 参见胡长松:《实变函数》,科学出版社,2002,第25页。

³ 见 Hal R. Varian, microeconomic analysis, Norton, w. w. & company Inc., 1991.

⁴ Milton Friedman, price theory, Chicago: Aldine, 1976, p.13.

⁵ 许多经济学家建议把塑造偏好作为一项帕累托福利政策,与税收、补贴和管制并列,见 Robert R. Keller 等 (1982)。利用资源塑造偏好可能是一种帕累托有效的,见 Burton Weisbrod (1977)。