Stiglitz: “社会主义向何处去” (“Whither Socialism?”,,MIT Press, 1994)

第四章

福利经济学第二定理批判

福利经济学第一定理的重要性在于，它阐释了通过运用市场，我们可以保证经济高效率地运行的观点。而对上述观点正确性的假设在格林沃德一斯蒂格利茨定建(以及其他前文所涉及的理论阐述)面前都失去了存在的基础。同样，福利经济学第二定理指出，每一种具有帕累托效率的资源配置都可以通过市场机制实现。人们所应做的一切只是使政府进行某些初始的总量再分配。

该定理被广泛解释为，人们可以使效率问题与分配问题相分离。有时收入分配的结果并不尽如人意，但这并不能否认市场的作用。如果社会不愿进行收入分配，那么政府分配部门 (马斯格瑞夫的术语)可以通过总量再分配来改变资源的初始禀赋。

新的新福利经济学：缺乏总额税的结果

由于某些原因，政府并没有进行总量再分配。他们不知如何以公平的方式征税。政府认为不同的个人应缴纳不同的税款。作为征税的基础．他们不可避免地依靠像收入和财富这样　明显的变量来制定规则，然而变量是可变的。因此税款并不一定反映实际情况。

一旦我们意识到再分配不可避免地有些不切合实际，也就会认识到资源配置的变化会对经济的整体效率产生影响。图 4．1 说明了这一点，它描述了只有两个个体的简单经济条件下的效用可能性曲线。在给定一方的效用水平后，该图给出了另一方可能达到的最大的效用水平。假定政府知道谁属于哪一组以便影响总额变动，那么图中实线给出的是效用的可能情况，虚线描述的是信息如何限制效用可能性曲线向内移动…。现在假设正如图所示的那样，我们可以通过社会的无差异曲线表达社会对公平的态度。我们可以通过给定的无差异曲线看到，征收偏离实际情况的税款是一项最优的选择。效率和公平是不能被分割考虑的。如果经济具有不同的初始禀赋，那么所需的再分配性征税的额度就应小一些，同时社会福利(双方)也会提高。

一般情况下，再分配性征税会在某种程度上脱离实际情况．这一事实就产生了“新的新福利经济学”[2]。“原来的新福利经济学”强调的是，人与人之间效用的比较是不可能的，经济学家所能做的只是去描述具有帕累托效率的资源配

置。但是“原来的新福利经济学”假定总额再分配是可能的。“新福利经济学”意识到了政府在信息方面的限制。因此它把注意力集中在“具有帕累托效率的征税”的概念上[3]——在给定一方效用水平和在给定政府进行再分配的信息限制时，上述概念可以使我们定义另一方所能达到的最大的效用水平。因此“新的新福利经济学”发现，政府所面临的机会不是图 4．1 中实线所描绘的，而是实线下面的虚线所描绘的情况；至于在特定位置上虚线比实线低多少，则取决于财富的初次分配。

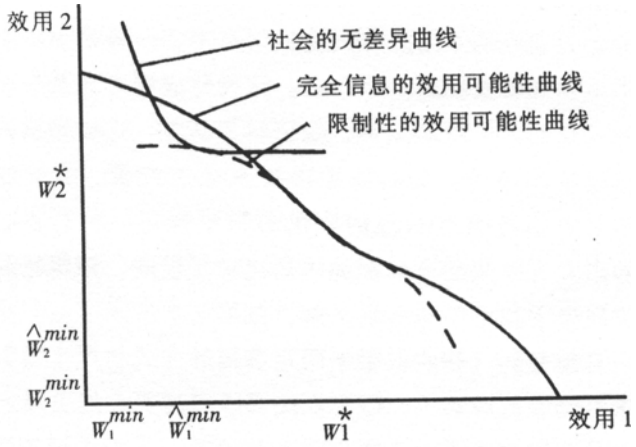

图 4.1

当存在信息限制时，效用可能性曲线位于存在总额征税的曲线内部。

经济效率与分配

前面解释了分配与效率问题不可分割的原因。初次分配中的不公平程度决定了政府依赖征税的程度，政府正是通过这种偏离实际情况的再分配性的征税以实现任意要求的最终的福利分配。但是，不公平程度以及信息问题的性质影响了不公平与经济效率之间的关系。在一些不公平程度很高的情况下，它降低了经济效率(读者可以从下面的讨论中清楚地看到这一问题)，然而在其他情况下，不公平却可以加强经济效率。现在让我们进一步研究效率与分配之间的关系。

激励问题

激励问题是经济学的核心问题：一些经济学家做了深入的研究，从而提出激励问题就是经济学问题。激励问题与分配问题是紧密相关的。分成制就是说明了这种关系的一个例证。在许多农业国家中，贫富不均的情况十分严重，这导致了土地所有者和劳动力之间的矛盾。在欠发达国家中，一种普遍的契约安排要求地主和佃农同时分享收益。这种分成制方式至少从马歇尔开始就受到了广泛的批

判，经济学家认为，这种做法减弱了农民劳动的积极性。如果地主得到 50%的产量，那么这种方式同样对必须缴纳 50%税的农民的积极性是一种打击。然而近期的研究文献表明分成制契约是比较积极的，该契约反映了激励与风险承担之间的市场平衡，如图 4．2 所示[4]一个单纯的租金总额契约(佃农以缴纳固定费用的方式租用土地)可以更好地激励农民劳动[5]，因为农民可以通过更多的劳动获得更多的产品，同时农民也必须承担全部风险。一个单纯的工资契约会把风险转移给地主——例如，农民的收入与天气情况无关——一般情况下，地主可以更容易地承担风险(因为地主有更多的财富)，但是此时农民除非在直接的(有成本的)监督之下劳动，否则没有任何积极性。分成制契约提供了一个折衷方案。许多读者被我早先有关分成制经济的均衡观点所误导，(分成制经济是在给定佃农所期望的效用，以及给定信息限制的情况下解决地主福利最大化问题的方法。)他们认为这种经济情况是具备帕累托效率的，同时与马歇尔的观点相反，并未出现产量的减少。这是一种错误的解释。我只是认为该均衡是具有契约效率的，它只是一种限制性效率的形式。一般均衡效率问题需要从格林沃德一斯蒂格利茨定理中得到更多的，直接的解释，如前所述，存在多处优点的分成制经济一般情况下是不会限制帕累托效率的。但在此与我们研究目的更相关的是，尽管分成制契约限制帕累托效率，但产量比不存在分成制的情

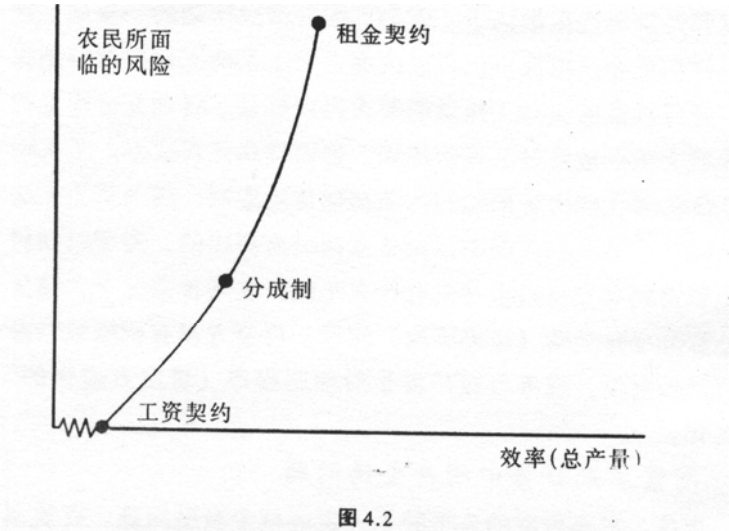

图 4.2

在风险和激励的平衡中，单纯的租金契约使农民更具积极性（因此产量就高），但是农民必须承担风险。单纯的工资契约减弱了农民的积极性，但是农民不承担风险。分成制契约提出了一个折衷方案。

况下要低很多，也就是说土地再分配对国民产值有重大影响。这种影响就像把工资税从 50%减到 0 一样：大多数观察者会说这种变化产生了巨大的影响。[6]

过度不公平引发的问题

为什么分配问题和效率问题不可分割呢?从直觉上回答这个问题是比较容易的。当存在有成本监督以及‘‘资本”和“劳动力”相分离的经济时，资本的所有者就必须激励工人工作。这种激励必然是不完全的，也必然是有成本支出的[7]。如果每个农民都拥有土地，每个工人都拥有资本品，那也就不存在激励问题。

在通常情况下，初始的财富分配对社会面临的激励问题的程度和性质会产生影响[8]。例如，改善激励问题的一条途径就是抵押保证金。担保不仅可以使雇主对工人的工作要求得到保证。还可以使雇主对工作量的要求得到保证。得到充分保证的雇主就会积极地对员工进行培训，进而提高经济效率。工人出色工作的潜在能力受到他们的最初财富的影响。借与贷是无法取代的。正如我们在前面讨论分成制时所提出的，借贷以预付租金和到期末支付租金并没有什么不同，在两种情况下，拖欠租金都会导致激励(道德风险)问题：借贷方没有积极性以避免破产的发生，或者当破产发生时使回报率(贷出方应得的)最大化。

财富不充分集中所产生的问题

当然，更高程度的公平并不一定能减少激励问题。有效率的生产需要规模大的企业，同时需要大量的资金。正如我在前文中提到并将在后面章节中继续讨论的情况一样，由于不存在不公平性，因此就产生了所有权和经营权分离的问题。有迹象表明，实际上所有权集中的企业(尽管大股东不直接管理企业)其经营行为是更加“理性化”的。在下面部分中，我将以接管和征税中的两个例子说明这一点。但是正如我将指出的那样. 东欧国家正在寻求的解决这些问题的方法并不需要增大不公平性和集中所有权，而是需要进一步发展可供选择的控制程序。

因为近来东欧国家有关改革的讨论在强调效率问题时并没有充分地联系分配问题，所以在此我要强调效率问题和分配问题之间的联系。我将在后面指出，从现在开始，如果这些国家再不重视分配问题，那么这些问题不仅会以社会动荡的形式来困扰这些国家的经济，同时将影响到这些国家长期的经济效率。无论如何，至少我们没有发现割裂效率和分配问题的理论依据。

基本的非分权化定理

对于福利经济学第二定理的一种解释认为是该定理使分权化成为可能，即在极其有限的政府干预下，通过分权化的价格机制，任何具有帕累托效率的资源配置都是可以实现的。特别值得指出的是，政府并不一定要对资源配置的基本过程

进行干预。在讨论经济体制选择问题之前，必须提出分权问题，分权的概念有多种解释。在本书中，我对该术语的使用反映了目前经济学中对其用法的演变过程，同时也反映了不同用法所导致的含混意义。

实际上，几乎分权化的所有定义都涉及了经济中存在大量不同单位的决策问题。高层权威人士“干预”经济的大量的不同方式导致了如何定义分权的问题。我们可以通过考虑非线性征税的可能性来澄清对分权化概念的含混理解。非线性征税可能使得厂商和个人没有选择的余地，他们只能按中央计划制定者的要求来采取行动。从某种意义上讲，厂商和个人确实作了选择，但是政府通过对非政府期望的选择的充分限制使厂商和个人的选择余地缩小，以致于使他们失去了选择的余地。大多数干预在一定程度上限制了选择。但是人们并未发现可以通过留给不同单位的“真正”辨别能力的大小来“衡量”政府干预的简单方式。[9]

信息经济学近期的研究对分权化结论有效性问题提出怀疑。通过价格机制能在多大程度上使经济分权化在一定程度上受到强的约束?下面分五点讨论这一问题。

格林沃德一斯蒂格利茨定理与分权化

格林沃德一斯蒂格利茨定理指出，虽然政府干预有时仅限于征收一系列线性特许权税(对生产、购买，消费的单位商品征收相同税率的税制)，但是在缺乏一定形式的政府干预情况下，限制性的具有帕累托效率的资源配置是不可能实现的。因为在一般情况下，分权化并不是获得帕累托效率产量的有效途径。所以有时我把格林沃德一斯蒂格利茨定理称为“基本的非分权化定理”。

如果唯一可能的政府干预是线性征税，并且(或者)如果政府可以通过线性征税而实现限制性的具有帕累托效率的资源配置，那么原来分权化结论的“主旨”就可以得到满足了。尽管我在本章的第一部分曾经提出，再分配通常与实际情况有偏差，但是政府干预就是要对财富进行再分配。当然政府干预还有其他目的，但干预仍然是有限的。政府所应做的“只是”对不同的商品进行征税或补贴。　分权化具有帕累托效率的资源配置问题实际上比格林沃德一斯蒂格利茨定理所提出的要糟糕得多，这主要是由下面四个原因造成的，即交叉补贴，非凸性的普遍性，外部性以及非线性特征。

交叉补贴

阿罗一德布鲁模型的主要结论之一(虽然很少被加以评论)是说，帕累托效率可以通过该模型实现而不存在任何的交叉补贴的出现。用一种美国化的方式来表

达就是，每个厂商都可以自主自立。当存在不完全信息时，上述观点是错误的，甚至在明显缺乏回报率的增长时，它也是不成立的[10]。我和阿诺特在 1989 年详细分析了道德风险经济学所提出的问题，例如保险市场的存在影响了人们尽量避免偶然事故发生的积极性。我们指出保险公司独立承担所有风险时，竞争性均衡是不具备(限制性)帕累托效率的。如果把对某些行业(有可能是保险业)征税用来补贴(其他)保险业，那么社会福利将得到改善。(我们把不出现交叉补贴时该结论的无效性称之为交叉补贴市场失效。)该结论告诉我们对道德风险问题不严重的行业征少量税，其产生的效果也是次要的(额外净损失与税率的平方成正比)。另一方面，道德风险(激励问题)所产生的福利损失是主要的，也就是说重要的是通过补贴来补充努力成果，这将促使人们更努力地工作，这样做对福利的影响也是最主要的。

非凸性的普遍性

当经济中存在非凸性时则在分权化中产生另一个问题。我在前面讨论福利经济学第二定理时已经提出了这个问题，当时它被认为是在自然垄断经济中确实需要某种形式的政府干预。在此我不想阐述分权化问题，因为人们对它已经比较熟悉了，我只想讨论与不完全信息相关的非凸性的普遍性问题。

显然，与信息相关的非凸性的存在是一个明显的事实。信息可以被理解为一种固定成本(参见第二章)。无论对它做什么，该成本总会发生的，而且固定成本产生了非凸性。同样，如果一个厂商发明了一种制造工具，那么它所带来的价值取决于该工具的产量。从新产品的研制开发的支出上所得到的总收益和边际收益都会随着生产规模的扩大而提高。

兰德尔和斯蒂格利茨在 1984 年指出，在统计决策理论中，信息的价值是不会产生球面凹陷的(如图 4.3)。对极少量信的回报往往等于零，如果信息成本是正值，那么净收益则是负值。“如果不忽略这一点。那么至少这是一种限制性的最优选择。[11]

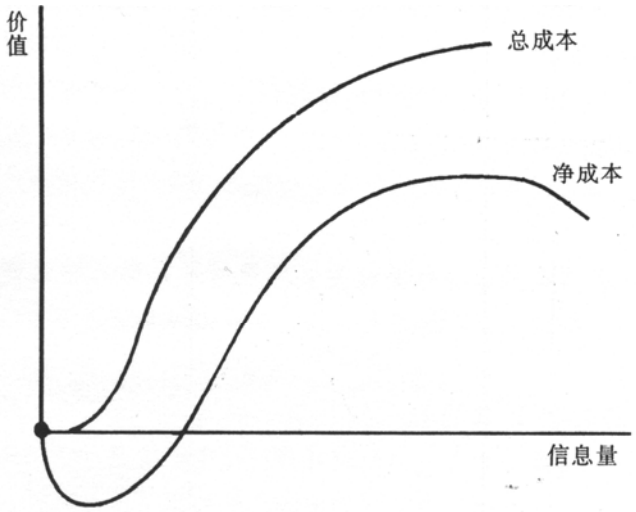

图 4.3
非凹性是信息价值的一个特征。“如果不忽略这一点，那么至少这是一种限制性的最优选择。”

但是非凸性甚至比讨论的结果更具普遍性，这一点说明：当存在道德风险、激励或者选择问题时(涉及激励适应性限制或者自我选择限制)，在适当空间里会出现非凸性，并且不论问题多明显，都会出现非凸性[12]引。(对这种现象的一种简明扼要的解释就是激励限制可以被看作涉及私人或厂商最大化问题的初级条件。因此全部最大限度的凹性，包括内部激励限制，都涉及到了第三个衍生物：效用或利润功能，对于这些衍生物来说，不存在自然的经济限制。)阿诺特和斯蒂格利茨指出,在最简单的道德风险模型中，收益与成本之间的无差异曲线在本质上是从来不会出现准凹性的，同时被收益和酬劳所限制的

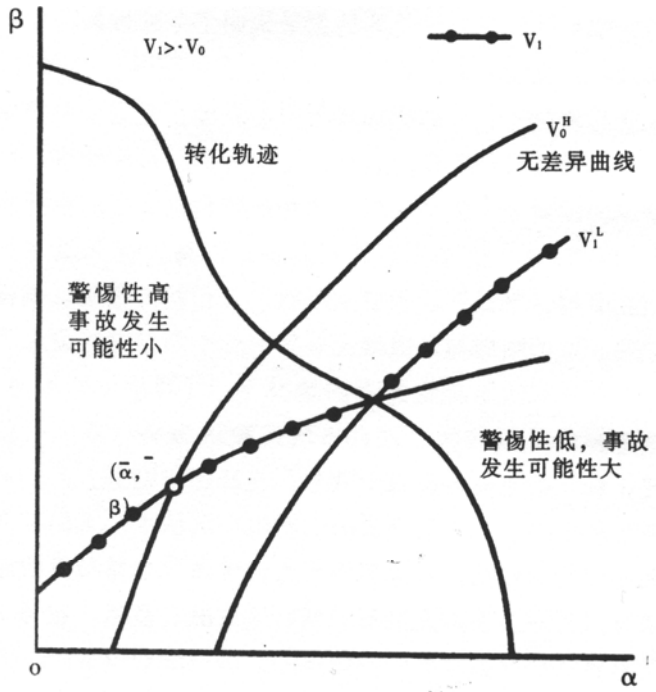

图 4.4

当存在道德风险时，即使最简单的模型也会产生非凸性的无差异曲线。在此人们有两种行为选择：吸烟与不吸烟。转化轨迹就是(利益，保险金)的组合，该组合使人们在两种行为选择上是无差异的。无差异曲线(利益，保险金)的形状是如图描绘的扇性。α轴表示利益，β轴表示保险金(只是指在没有事故发生的情况下缴纳的保险金)。上标 L 表示“警惕性低，事故发生可能性大的行为”，H 表示“警惕性高，事故发生可能性小的行为”，因此 V^L 表示低警惕性行为个人的无差异曲线。通过图中任意一点都有两条无差异曲线，一条表示事故发生可能性低的行为，另一条表示事故发生可能性高的行为。既然在转化轨迹上两种行为选择对人们来说是无差异的，那么很显然在点$(\hat{\alpha}、\hat{\beta})$上，人们宁愿选择警惕性高，事故发生可能性小的行为。(随着保险金的减少和利益的增加，效用会增加。)

和产小非负利润的政策也从来不会是凸性的。图 4．4 用个人在吸烟与不吸烟两种行为前作选择的例子说明了上述性质。如果人们吸烟时间的比例上升，那么火灾发生的可能性也会增加。在没有保险的情况下，人们会选择不吸烟；当存在完全免费保险时，人们不承担任何吸烟的后果，因此他们会选择吸烟。对于任意给定的保险金，就会出现一个特殊的利益水平。在此水平上，人们吸烟与不吸烟是相同的利益。当高于此利益水平时，人们就吸烟，当低于此利益水平时，人们就不吸烟。当保险金增加时。人们吸烟与不吸烟无差异的这个利益水平就会下降。在吸烟与不吸烟不存在差异的情况下，(利益，保险金)组合的轨迹是向下倾斜的，并且该轨迹被认为是一条“转化线”。“转化线”把空间分成两个部分，在转化线以下，人们不吸烟，在转化线以上，人们则吸烟。在每个区域中，人们都有两条不同的无差异曲线，一条表示当人们吸烟时利益与保险金的变化情况，另一条表

示人们不吸烟时的情况。显然，在每个区域中无差异曲线都必定是向上倾斜的，即当利益增加时，人们愿意支付的保险金也会增加。随着利益的增加，无差异曲线会变得平坦，这是因为对于给定的利益增加值，人们愿意支付的额外的保险金数额会减少。然而在转化线上，无差异曲线会突然变得陡峭，如图示，在人们选择吸烟的区域(转化线以上)中，由于火灾发生的可能性比较大，因此利益增加的数值会很大。因此，当利益增加时，表示行为变化及边际价值的一条真正的无差异曲线是扇形的，如图示，这是因为在无差异曲线中存在着非凸性。

在可能的组合中存在着相应的基本非凸性，(利益，保险金)组合策略至少可以被平均分开。在转化轨迹以下，即人们不吸烟的时候，火灾的可能性较小。为了刚好与利益相匹配,保险金必须随利益线性增长，如图 4．5 所示。同样，如果人们选择吸烟，保险金也必须随利益的增加而增长，但是基本的必需保险金一定要非常高以致于可以用来补偿火灾发生可能性高所带来的损失。可能的组合必须考虑到在转化线之下人们选择不吸烟，而在转化线之上人们选择吸烟，如图 4．5 所示的阴影部分。很明显，它是非凸性的。这个例子解释了当存在道德风险和激励问题时，利用最简单的假设条件以及明显发挥作用的效用功能，非凸性是如何自然产生的。在更现实的组合中，人们有更大的行为选择空间，可能的组合以及无差异曲线都会显得更不规则。

人们很早就认识到了非凸性的某些可能的结果(例如，随机策略的可能性需要)[31]。出于我们的研究目的，重要的是具有限制性帕累托效率的资源配置的非分权性。不仅政府干预是有必要的，而且“性线”干预是不能满足需要的[14]。图 4．6 使大家从直觉上理解为什么非凸性会产生这些问题，在图中我们给非凸性的生产可能情况画了一个草图；最优配置是图中的 E 点，它是“典型个人的”无差异曲线与生产可能性曲线的切点。如果厂商追求利润最大化，在给定 E 的相对价格(边际替代率)的情况下，厂商将选择如 A 点的角点。同理，当存在道德风险以及非凸性无差异曲线时，在我们的保险模型中，最优选择应是图 4．7 中的 E 点。当固定相对价格以后，人们会选择戈比买 E 点更多的保险(即到达了 E’点)。然而当厂商这样做的时候，人们的警惕程度就会降低，同时造成 E 点不能存在。

我强调上述结论是出于几个原因。经济学基本的数学结构萨缪尔森的《经济分析基础》发展到德布鲁的《价值理论》，都强调了凸性对基本存在结论、竞争市场的福利结果 (特别是福利经济学第二定理)，以及比较静态的缘由的重要

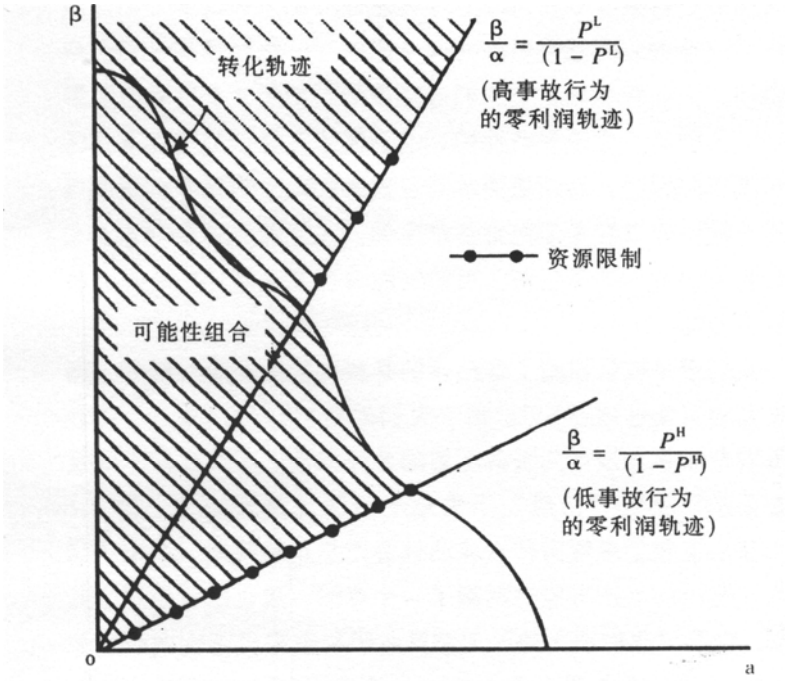

图 4.5

至少平均分开的策略仍然是非凸性的。P^L 表示人们放松警惕时事故发生的可能性。因此在这种情况下利润为零，同时 $\alpha P^L = \beta (1 - P^L)$；人们提高警惕时的情况与此相似。在人们提高警惕的区域内，利润对于零利润轨迹来说是正值，$\alpha P^H = \beta (1 - P^H)$；同样，在人们放松警惕的区域内，利润高于零利润轨迹而为正值，$\alpha P^L = \beta (1 - P^L)$。因此所有的可能性组合就是图中描绘的阴影部分。

性。除此之外，充分的非凸性市场不具备竞争性这一观点也被深刻地理解了。经济学家合理地提出，在“正常情况下”，消费者和生产者可以满足这些凸性的假设条件，同时限制了例外情况的发生，并指出政府干预是必要的。正常情况下，我们希望减少回报和缩小边限替代率的定律是具有说服力的。

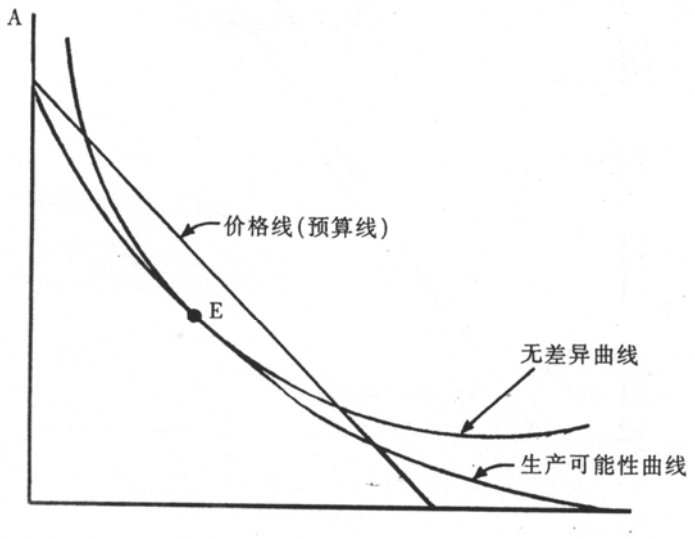

图 4.6

当存在非凸性生产组合时，具有帕累托效率的均衡是不能通过价格体系来维持的。

当考虑到信息的不完全性及其成本时，凸性的假设就不再合理了，非凸性情况则具有了普遍性。当存在普遍的非凸性的情况时，实现帕累托效率的资源配置的政府干预不像福利经济学第二定理提出的那样受到限制。由于干预不够，不仅总量干预无法实现，甚至连线性干预也无法满足。

外部性

恪林沃德一斯蒂格利茨的分析推论在于它向我们展示了当市场不完备，信息不完全的时候，个人或厂商所采取的行动具有“外部性”效果。非生产性工人如果要超时工作，那么这将

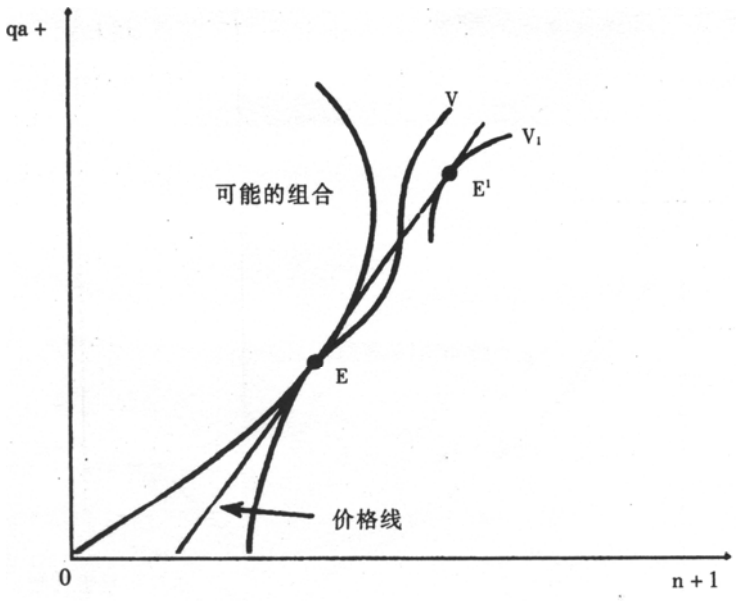

图 4.7

当存在道德风险时，假定由此产生无差异曲线的非凸性，那么有效的均衡就无法通过价格体系得到维持。

使在劳动力市场提供劳动的工人的平均素质下降，因此这些非生产性工人就对其他人产生了负的外部性。如果吸烟者决定多吸烟，则提高了火灾发生的平均可能性，保险金中必要的补偿部分也提高了，因此这种行为对所有买火灾保险的人都产生了负的外部效应。在特定情况下，这些外部性可以通过适当的征税得到抵销，从而保证分权化的“主旨”。

但是有许多外部性是无法轻易抵销的。在佃农一地主关系中，激励问题和风险承担问题导致了最优的分成制契约的产生。因此佃农所采取的任何影响产量的行为都会对地主产生外部性影响。如果农民使用化肥，那么地主不仅可以通过产量的增加而直接受益，而且化肥的使用增加了佃农的边际产品，佃农更努力地劳动，这也使地主间接受益。因此地主愿意资助农民使用化肥。从而要素市场(化肥)、土地市场、以及劳动力市场就会在内部产生联系。政府干预(例如，资助化肥的生产和使用)是无法满足要求的，这是因为供给反应(例如，农民对增加使用化肥的反应，反过来要取决于化肥供给的增加所导致的劳动者边际生产率提高的程度)的程度对于不同的农场来说是不一致的。因此地主就处于较优越的位置上(因为他们掌握有关土地和佃农的详细信息)，他们可以提供“适当”水平的资助，而这种水平对于不同的农场来说是相差甚远的。赞成分权的人们提出，相关信息只对一地有效，这一观点有助于解释为什么完全的分权化(土地、劳动力以

及化肥市场可以自由运作，巾央政府的干预极其有限)是行不通的。同时，存在内部相关市场的局部分权化也不能充分地保证在没有政府干预的情况下实现经济效率，特别是在二级市场无法避免的情况下，例如化肥市场。

上面的例子说明，在当事人之间的关系很复杂的情况下，内部相关市场具有明显的优越性，这一点适用于更普遍的情况。产品市场的参与者(如生产者和商品销售者)会发现这种关系网在其他例子中也是随处可见的，在信贷市场中(厂商经常给供给者和消费者提供信贷)也是如此。

非线性支付计划

市场社会主义所面对的最简单的分权化的问题是与非线性特征相关的，这在标准竞争性模型中也得到了证实。如前所述，格林沃德一斯蒂格利茨定理指出，在一般情况下，分权化的市场经济不能产生限制性的具有帕累托效率的结果。它还指出，简单的征税和补贴可以使每个人的情况更好，但是这只是简单的干预。如果政府只通过这种简单的方式干预，那么正如我所强调的那样，分权化的意图得到了维护。市场社会主义经济正如兰格和勒纳预期的那样自我运行，然而主要的区别在于 “计划制定者”必须给生产者和消费者提出不同的价格。(这就是斯蒂格利茨和达斯古塔所预期的框架。) 但是最近有关最佳激励机制和最佳税收政策的研究成果表明，只有在严格的数学条件下，如此简单的干预方能满足经济重现帕累托效率的要求。例如，有关具有帕累托效率的税收体制的文献指出，在一般情况下，政府征税要取决于每种商品的消费水平，这种依赖方式是非常复杂的，例如对消费商品 A 所征收的税款总额取决于商品 B 的消费水平。

在市场上，厂商，工人以及贷方之间会产生非常精密的平行联系。大学允许其教职员工到外面担任顾问，例如每周一天。这可以被看做是一种简单的非线性征税体制(支付计划)。前 8 个小时不征税，8 小时以外的部分征收高额调节税。一个啤酒公司对其零售商说，它可以出售其他公司的啤酒，但如果零售商真的这样做了，那它将失去特惠政策。

因此政府在市场中的最佳干预方式以及市场中最佳的契约安排往往是极其复杂的，它反应了导致信息的外部性、非线性特征和数量限制，并使用了交叉市场限制和信息。这些结论对于经济理论和标准新古典(阿罗一德布鲁)模型的现实性具有深远的意义。

效率所要求的不是新古典模型提出的完全分权化，而是部分分权化。正如我们所见所闻的那样，在我们的经济中有许多大公司，它们只是有限地分权。信息

诱导的商业关系(或集聚)和相互关系会影响竞争的有效性，至少标准模型所预期的过于简单的竞争形式是这样。在其他情况下，所有受影响的只是发生竞争的“单位”；例如，如果向土地施肥，那么相关的竞争单位就是地主连同化肥的售卖者。在某些情况下，相互关联(外部性)的网络是极其复杂的，以致于通过这样的方式不能有效地提出外部性问题。同样，在其他情况下，即存在重要的跨时期的内部关联以及事前竞争(个人或厂商签定合同时的竞争)的情况下，一旦签定了合同，那么竞争就非常有限了。当存在不完全预期和不完备保险市场时，事前竞争远远无法取代事后竞争[15]。同时在其他一些境况中，许多厂商和个人被进行中的关系联在一起，这个事实使竞争的实施以及市场的完全竞争性遇到了严重的阻碍。[16]

政府干预实际所需要的信息比它们只进行线性征税或补贴的情况要多得多，因此兰格和勒纳以及其他市场社会主义者所期望的分权化的模式实际上是行不通的。他们把简单的(线性)价格体系作为其理论的基础，而以信息为基础的现代理论对此提出了质疑。

但是我们的观察似乎是自相矛盾的：当这些现代理论对市场社会主义的可行性提出疑问时，它们同时又削弱了我们对竞争性经济以及我们用来描述它所构建的模型的信心。(至少从我们过于简单的观点看，情况是这样的)。一方面，这些理论正确描述了我们所发现的经济关系中许多复杂的形式。另一方面. 这些理论又建议我们要更重视观察复杂的关系。例如，只有在非常严格的条件下，计件工资契约或分成制契约才是线性的。这种实际中的契约安排的简单形式和大多数信息理论模型所预期的情况是不同的，除非假定这些形式在其他条件下不能成立。[17]

当我们阐述“简单”(从理论的角度看)契约具有普遍性这一现象时，大家会觉得这很容易理解。雇工认为雇主不会去 “算计”他们，即雇主不会通过使用他们非常了解而雇工不了解的契约来坑害雇工 m’——然而标准模型没有解释经济关系的重要方面，这一事实仍然存在。同时它对模型一般情况下的可行性及其主要结论也提出了疑问，而且通过价格体制的分权化作用也是存在的。由此看来，无论是市场经济还是市场社会主义它们所模仿的不是市场经济而是市场经济的模型，即使用价格体制交流全部相关信息的分权化模型，这种观点至少是值得怀疑的。

小结

本章和上一章回顾了福利经济学新近的发展。上一章主要介绍了认为竞争性市场经济具有效率的福利经济学第一定理。近期的研究成果削弱了我们对市场效率推论的信心同时，研究进展还强化了政府干预的潜在作用，从而间接地支持了有关市场社会主义的论据。

本章主要介绍了福利经济学第二定理，并给出了三种解释。然而每种解释都陷入了困境之中。第一种解释强调了政府的有限作用：为实现具有帕累托效率的资源配置，政府应做的只是对总量进行再分配，其他工作是由市场完成的。与此相反。我提出当信息不完全时，传统模型所预期的总量分配是行不通的。同时政府为纠正财富市场分配的不充分性进行干预，其成本比传统理论所预期的要大。福利经济学第二定理提示我们，经济效率问题和分配问题是可以被明确分开的。这种分离对于研究“经济效率”概念的经济学家来说非常有帮助，他们可以暂不考虑分配问题。然而我在本章指出，如果信息不完全，效率问题和分配问题不能被如此轻易地分开。例如，不论经济是否具有帕累托效率，经济本身就取决于收入分配。

最后，福利经济学第二定理经常被认为是证实了经济的可分权性。通过比较，我提出了信息经济学的五点基本结论，这些结论告诉我们经济通过价格机制分权化的程度是受严格限制的：

1．格林沃德一斯蒂格利茨定理被认为是证实了经济的非分权性，因为它指出当市场不完备，信息不完全时，市场从来不会自己达到限制性的帕累托最优。

2．在市场不完备，信息不完全的经济中，会产生外部效应，并且具有普遍性。

3．阿诺特一斯蒂格利茨定理表明，通常所讲的交叉补贴是值得的(尽管缺乏直接的外部效应)。

4．利用价格体系进行分散化要求不存在非凸性，然而非凸性是普遍的。

5．当信息不完全时，最佳的激励几乎总是要求非线性的支付计划。

我曾指出以福利经济学第一定理为基础的分权化是有缺陷的。但这并不味着我反对经济能够也应该按一种分权化形式运行这一结论，在第九章，我将从其他角度讨论分权化问题。

市场社会主义非常“含蓄地”把福利经济学第二定理作为其经济的组织基础。由中央计划制定者获得社会主义所需的信息是一项非常沉重的负担，它可能使人们对社会主义存在的可能性产生怀疑，然而这种“含蓄的”做法使它避免了

这种批判。市场社会主义认为市场经济使用的信息的分权化，对于社会手义来说同样可以利用；在市场经济条件下价格可以有效地传递信息，在社会主义条件下同样可以，例如技术信息仍然可以继续在私人企业中存在。

我所提出的观点表明了福利经济学第二定理的限制性，同时也指出其缺陷。然而一个试图有效运作的分权化经济所需的全部信息并不仅仅由价格来传递。正如我将在后面的篇章中提出的，经济所面临的信息问题比市场经济模型和市场社会主义模型所预期的问题要复杂得多。如果市场经济不能完善地解决这些问题，那么在市场社会主义条件下甚至都不会提出这些问题。

市场和市场社会主义之间的根本区别在于资本的所有权和资本的配置格局。为保证资金可以有效地在市场经济中得到配置，所需的政府干预的范围比传统理论所预期的要大得多。社会所能接受的(或期望的)财富分配几乎不可避免地要求所有权和经营权的分离，这就给市场经济提出了与非市场经济相同的激励问题。我们将在后边的章节中详细讨论这些问题。