

瑞典皇家科学院将 2010 年诺贝尔经济学奖授予了彼得·戴蒙德、戴尔·莫滕森和克里斯托弗·皮萨里德斯三位经济学家，以表彰其在分析“市场摩擦”方面所作出的杰出贡献。

搜寻理论起源于信息经济学革命

经济学对市场摩擦的分析起源于 20 世纪 60 年代信息经济学革命，其主要开创者与贡献者为 1982 年诺贝尔经济学奖得主乔治·斯蒂格勒（George J. Stigler）教授。在 19 世纪至 20 世纪上半叶，经济学家将自己所研究的市场称为“瓦尔拉斯”市场（取名于 19 世纪洛桑学派与一般均衡理论的创始人瓦尔拉斯），即信息完备的完全竞争市场。在一个完备的瓦尔拉斯市场中，市场所有的供需信息都将反映在价格上，价格机制会自动实现资源的最佳配置。

然而，理想中的瓦尔拉斯市场与社会经济现实相距甚远。在现实中，市场的买卖双方均存在信息不完全的可能。而搜寻理论，正是针对市场信息不完全的情况，在一定的行为假定条件之下，描述个人如何采用一套理性的决策法则，进而推演出合乎理性逻辑的最优选择的一种分析框架。因此，搜寻理论更加接近于社会经济现实，从而为经济理论与社会经济现实构建了一座桥梁。

搜寻理论为新古典就业理论提供了新分析框架

搜寻理论发轫于 20 世纪 70 年代初，经过整整一代经济学家们的努力，取得了长足发展，并且开始应用于经济学各分支与其他社会科学。从 20 世纪 90 年代开始，搜寻理论进入经济学的经典教科书。2010 年诺贝尔经济学奖的三位得主，就是在搜寻理论发展过程中作出杰出贡献的代表。瑞典皇家科学院将奖项授予戴蒙德教授以表彰其对搜寻理论基础框架的奠基性工作，授予莫滕森教授和皮萨里德斯教授以表彰其发展了搜寻理论的基础框架并将之应用于劳动经济学领域。其实，此三位诺奖得主的贡献远远不止诺贝尔颁奖委员会所提到的这些。

20 世纪 70 年代早期，搜寻理论研究主要集中于两个市场：商品市场与劳动力市场。分别需要回答的问题是：为什么同一种商品在市场上存在不同的价格；为什么劳动力市场上同时存在工厂找不到工人和工人找不到工作的情况。在古典的经济学理论中，这两个问题都得不到回答。

针对商品市场的搜寻问题，戴蒙德教授提出商品市场存在信息不完全。在存在异质性市场购买者的情况下，市场信息的不完全性与信息搜寻的成本将导致市场上同一种商品出现不同的价格或者出现一个价格的分布。戴蒙德教授还在信息不完全市场的其他方面作出了许多重大贡献。比如，从信息不完全性、经济行为者主体的有限理性与市场的不确定性角度来分析各种社会现象，包括投资、税收、转移支付、公共财政、社会保障政策等。

针对劳动力市场的搜寻问题,莫滕森和皮萨里德斯两位教授在序贯决策理论和动态控制理论的基础上,提出了一系列非常强大的分析框架和理论术语。劳动力市场搜寻理论最开始是分析初次进入劳动力市场者对工作职位的搜寻。然后,搜寻理论集中于在职搜寻行为。在此期间,莫滕森教授的代表性研究成果是在1970年用工作搜寻与失业的持续时间开始构建菲利普斯曲线的微观基础。皮萨里德斯教授的代表性研究成果是其1974年发表的研究论文,在考虑市场风险和工作搜寻情况下分析收入不平等问题。

20世纪70年代之后,戴蒙德教授在搜寻理论方面的代表性研究成果是其1982年发表的研究论文。该论文在搜寻的一般均衡情况下讨论了劳动力市场工资的决定机制及劳动力市场的效率问题。莫滕森和皮萨里德斯教授则在马尔可夫决策理论的基础之上,运用一种随机动态模型对不同时点上劳动者不同的工作状态与劳动力市场效率之间的关系进行一般均衡分析,并进一步将劳动力市场的搜寻行为与宏观经济结构变化和经济增长联系起来。此两位教授1994年合作发表的研究论文可以视为其代表性研究成果。该论文中所建立的莫滕森—皮萨里德斯模型被视为搜寻理论发展过程中的一个里程碑,在现代宏观经济学中具有广泛和深远的影响。

总而言之,搜寻理论在劳动经济学中的应用与发展为新古典就业理论提供了新的分析框架,使我们对劳动力市场微观运行机制有了更加深入的了解。但是,搜寻理论并不仅限于劳动力市场,而是被广泛地应用于货币理论、公共经济学、金融经济学、区域经济学、家庭与婚姻经济学等诸多领域。

货币搜寻理论发源于20世纪70年代,并且在过去30年内得到了蓬勃的发展。戴蒙德教授在20世纪八九十年代对货币搜寻理论的发展同样作出了杰出贡献。此次诺贝尔经济学奖授予了劳动力市场搜寻理论而未给货币搜寻理论,其原因可能有三:第一,搜寻理论的起源最早是受到劳动力市场信息不确定性的启发;第二,搜寻理论的发展在很大程度上受到就业问题的推动,劳动力市场的就业和工资问题也随之成为了搜寻理论的主要分析对象;第三,最重要的是,劳动力市场搜寻理论存在着非常明晰的政策含义,并且该理论在美国就业政策的制定过程中得到了广泛的应用。相对而言,货币搜寻理论目前并未广泛地被美国货币政策制定者采用。

诺奖第四次授予信息经济学相关领域

从搜寻理论发展的渊源而言,此次乃是诺贝尔经济学奖第四次授予与信息经济学相关的领域。前三次分别为:1982年授予了信息经济学的开创者乔治·斯蒂格勒教授;1996年授予了詹姆斯·莫里斯(James Mirrlees)与威廉·维克里(William Vickrey)两位教授,以表彰其在“非对称信息市场中激励理论”方面的贡献;2001年授予了乔治·阿克洛夫(George A. Akerlof)、迈克尔·斯宾塞(Michael Spence)与约瑟夫·斯蒂格利茨(Joseph E. Stiglitz)三位教授,以表彰其在“非对称信息市场”方面的贡献。



此次获奖的搜寻理论与前三次获奖的研究既一脉相承，又各具特色。其一脉相承的方面表现在研究对象都是不完全信息条件下的个人与市场行为。其各具特色主要表现在以下三个方面。第一，分析框架和分析工具不同。搜寻理论主要借助于（随机）动态控制理论的发展来分析信息不完全情况下市场行为者在搜寻过程中的市场动态一般均衡。而信息经济学的发展则主要借助于博弈论的蓬勃发展研究信息不对称条件下市场行为者之间的互动。第二，搜寻理论的分析框架与政策含义更具古典经济学的色彩。搜寻理论除了引入信息的不完全性及其搜寻成本之外，仍然保留了古典经济学的其他基本假设。因此，搜寻理论将现实中的各种偏离瓦尔拉斯市场的现象视为自由市场中的固有特征。比如说搜寻理论的主要贡献之一即为“自然失业率”提供微观基础。从“自然”这一术语，我们即可看出其所带有的古典经济学色彩。而信息经济学则放松了古典经济学更多的基本假设，强调市场行为者的策略互动。第三，搜寻理论搭建了从微观经济基础到宏观经济政策的桥梁。在基本的行为假设下，搜寻理论推导出个体的基本行为准则，最后再推导出市场的一般均衡条件，并引申出宏观经济政策含义。比如说，搜寻理论在劳动力市场中的应用和发展几乎重建了在凯恩斯基础之上的就业理论，是就业理论在 20 世纪 40 年代之后的第二次革命。

搜寻理论的分析框架与信息经济学中广泛引用的博弈分析框架，可以看做是经济学在引进市场信息不完全性之后并列发展的两套分析框架。但是，两者之间的关系并不是二分的。两套分析框架相互补充，互动发展，从而加深了我们对现实经济运行的理解。

搜寻理论在劳动力市场的应用与发展以及 2010 年三位诺贝尔经济学奖得主的研究成果有着重大而深远的政策含义，目前在美国制定劳动力市场政策过程中得到广泛应用。劳动力市场搜寻理论有助于我们理解失业现象、企业的空岗现象、工资结构如何受到经济政策与社会制度的影响，以及失业、空岗、工资结构与经济政策之间的互动。这些理论直接关系到劳动力市场的各种制度，如失业保险、失业救济、最低工资水平、企业聘任与解聘制度的规制以及劳动者的福利保障等。目前，在美国次贷危机之后，西方发达国家一直深陷高失业率的困境。最近一年内，美国的失业率一直在接近两位数的水平徘徊。因此，此次诺贝尔经济学奖授予劳动力搜寻理论可能别具用心。通过颁奖给劳动力搜寻理论，诺贝尔奖委员会可能想借此鼓励经济学界对劳动力市场就业理论的研究，从而对现实经济困境提出更多更有效的解决方案。

（作者单位：浙江大学公共管理学院；香港中文大学经济系）

