

有限理性行动者的偏好变化与行为策略： 一个初步的理论模型

严 俊 李婷婷

内容提要：依托有限理性的理论思路与概念工具，本文挑战了传统经济行为分析中的偏好不变与效用最大化假定，构建了一组包含四种行动者类型的理论模型。在此基础上，本文进一步描述了连续行动过程中的偏好变化与策略选择，修正并丰富了以“显示性偏好”理论为代表的既有研究对偏好与行为之间复杂关系的理解。与行为经济学侧重短期情境性分析不同，本研究关注偏好与行为的演化（进行或退行）机制，以及在特定条件下行为显示或隐藏偏好的可能。这项工作不仅有助于重新审视关于偏好变化的既有结论，也能为新的行为实验提供设计思路。

关键词：有限理性；偏好变化；行为策略；理论模型；“显示性偏好”理论

基于对经济学的偏好不变与效用最大化假定的修正，本研究试图建立一个刻画有限理性行动者偏好改变与行为策略的理论模型，以便更好地解释复杂的真实行为过程。首先，让我们来构想一种常见的现象：某位看重职业能力提升的技术官员在相当长的时间内一直为官清廉，拒斥灰色收入。但在临近退休或面对前所未有的巨额诱惑时^①，却突然出现贪腐渎职行为。通常认为，这种看似匪夷所思的变化不难理解：官员对灰色收入的偏好一直存在，其行为的先后差别只是在收益预期、风险控制水平等外在约束条件变化后的正常反应。这里遗留下两个重要的疑问：第一，官员之前的清廉行为是否一定是“成本—收益”考虑下，隐藏贪腐偏好的结果？会不会存在偏好改变的可能？第二，无论清廉或贪腐，官员的行为是否一定是根据自身偏好精细计算后的最优选择？会不会存在因信息、判断力或诉求模糊性等造成的“次优决策”可能？针对更普遍的情境还可进一步发问：如果在一段时间内出现清廉或贪腐的行为反复，这是否意味着官员只是在具体情境下显示了稳定双重偏好（技能提升与灰色收入）的不同侧面，并且每次都做出了全面、“正确”的“效用最大化”选择？

作者简介：严俊，上海大学社会学系讲师，主要研究方向为经济社会学、组织社会学；李婷婷，上海大学社会学系硕士研究生，主要研究方向为经济社会学。

^① 通常我们将这类情况称为“59岁现象”或“糖衣炮弹”的影响。

本文认为,以上讨论不能在经典行为假定框架内得到满意的答案。事实上,效用最大化假定^①已经遭到了其他社会科学(尤其是社会学)研究者的大量批评(斯梅尔瑟、斯威德伯格,2014)。在经济学内部,赫伯特·西蒙的有限理性理论(bounded rationality)(Simon, 1955;西蒙,1989)更是直接而深刻地挑战了经典模型,提出分析真实决策过程的“满意法则”(satisficing)。相比之下,偏好不变假定虽然同样备受质疑,并在多学科的经验研究中屡遭“证伪”,但改变这一假定后的理论建模工作却相对滞后,我们将就此做出尝试:借用有限理性的基本概念和分析工具,建立一组包含历时性偏好改变与行为反复的理论模型,用以分析连续过程中偏好与行为策略之间的复杂关系。

本文内容沿如下脉络展开:首先,回顾既有研究对偏好不变假定的质疑;其次,按照“偏好—行动”的不同关系,建构四种行动者模型;再次,依托行动者模型,分析偏好产生和消失的连续过程,并与“显示性偏好”理论(Revealed Preference Theory)的既有解释展开对话;最后,指出进一步可能的研究方向。

一、文献回顾:对偏好不变假定的多学科质疑

传统经济学的偏好不变假定是指一个人的偏好是给定的,不因经济环境、生活环境以及收入增长等因素的变动而改变。按照贝克尔的定义,偏好不是对某一具体商品的诉求,而是在生物学基础上进化而来的实质性目标^②,如声望、健康等(贝克尔,1995)。

如果将偏好视为个体心智机构中的重要一环,偏好不变实际上假定了一类人格稳定的行动者。从这一思路考虑开篇提出的现象,似乎不难给出简洁的答案:官员始终持有对技能提升和灰色收入的双重偏好,并可通过抽象统一的收益值在二者间实现自由兑换。官员看似反复无常的行为无非是基于“成本—收益”情境的合理选择而已,不能被视为偏好改变的证据。不过,以上解释至少留下了一个疑问:如果一部分官员的贪腐偏好的确发生了变化,其行为能否在原有框架中得到甄别,而不与其他类型混同?

近年来,行为/实验、神经等新兴经济学分支和社会学、人类学等其他学科都已开始突破偏好不变假设。第一类研究主要关注偏好的历时性变化。例如,鲍尔斯(Bowles, 1998)认为经济结构和政策等因素会塑造行动者的内生性偏好,并以此来解释相应的行为。黄凯南(2013)从偏好与制度的交互关系入手,指出二者处于共同演化之中。伊祖玛等人(Izuma, et al., 2010)的研究则给出了偏好历时变化的微观证据:在严格受控的实验中,行动者的历史选择会明确改变随后的行为偏好(choice-induced preference change)。

相比之下,关注偏好情境性变化的第二类研究似乎更具颠覆性——即便是在一次决策内,行动者的偏好也未必稳定。诺万斯基等人(Novemsky, et al., 2007)揭示了给定(单次)选择中的流畅性(难易程度)

① 效用最大化的当代意涵是:在给定约束条件下,行动者会选择符合自身诉求(偏好)的、能带来最大化效用结果的策略。与以往研究者只关注经济收益不同,贝克尔拓展了效用函数的边界,在行为分析中纳入了大量非经济因素(贝克尔,1995,2013),从而成功将传统经济学分析框架应用于家庭、犯罪、歧视等非经济领域,被称为“经济学帝国主义”(斯威德伯格,2003)。虽然贝克尔拓展了偏好内容的多样性,但他并没有突破基本假设,而是将其运用扩大化,认为行动者所有其他类型的偏好都可以替换成经济偏好进行计算。

② 贝克尔在《人类行为的经济学分析》第一章中讲道:“稳定的偏好不是对市场中的橘子、汽车或医疗保健等具体产品或劳务的偏好,而是指选择的实质性目标。每一家庭可以使用市场产品与劳务,时间和其他投入要素实现这些目标。这种实质性偏好显示了生活的根本方面,诸如健康、声望、肉体快乐、慈善或妒忌,它们与市场中的某种具体商品或劳务并无确定的联系。偏好不变的假设为预见对各种变化的反应提供了坚实的基础,避免了研究人员以偏好的改变来解释事实与其预言的明显矛盾。”(贝克尔,1995)

会影响消费者的偏好。诺雷斯和西蒙森(Nowlis & Simonson, 1997)则发现,参照组与实验组消费者的偏好显著差异与(是否以及如何设置)比较品牌高度相关。海斯等人(Hsee, et al., 2006)将以上发现推向了一般化:在多项选择和单独选择两种不同的情境中,行动者会出现偏好逆转(preference reversal)的现象。

在这类研究中,尤其值得注意的是行为经济学的理论进展(凯莫勒等,2010)。通过系统分析有限理性行动者在决策过程中的偏好不一致情况(Kahneman & Tversky, 1979; Tversky & Kahneman, 1992),卡尼曼等人提出了著名的“前景理论”(Prospect Theory),为情境性条件下偏好改变及其引发的行为变化提供了基础模型。

多学科的研究新进展表明,偏好改变已经成为一个值得关注的重要问题。贝克尔本人也充分意识到了这一点。他在《口味的经济学分析》的中文版序言中指出,中国快速的经济社会发展提示“我们不仅有必要分析给定的偏好对价格以及所生产的商品的影响,而且有必要分析经济的飞速变化如何反过来影响偏好的形成”(贝克尔,2000)。应当指出的是,在实验或经验观察中证明偏好可变是不够的;情境性分析也不能很好地解释长时段内偏好与行为的连续变化,尚需建立描述历时演化过程的理论模型。我们将从划分代表不同“偏好—行动”关系的行动者类型来开始这项工作。

二、“偏好—行动”一致的简单行动者模型

下文分析建立在赫伯特·西蒙的有限理性模型基础之上(Simon, 1955; 西蒙, 1989)。考虑到行动者有限的信息获取和计算(认知)能力,西蒙认为他们在决策过程中并非追求效用最大化,而是遵循“满意法则”,即达到满意值^①即可。遵循这一基本思想,他首先提出简单收益模型,进而发展了局部有序收益模型^②。

借鉴西蒙的理论思路和分析工具,我们首先构建了两种“偏好—行动”一致的简单行动者模型:“稳定单偏好”^③模型(模型I)和“稳定双偏好”模型(模型II)。在这两种简单模型中,行动者明确意识到自身的单一或双重偏好,并持续表现出与偏好一致的行为选择。

(一)“稳定单偏好”模型(模型I)

西蒙认为,古典经济学的收益模型^④对于行动者“理性”的要求过于严格,即行动者有能力为每个可能的结果赋予明确的收益值或者概率,且收益有完全的优劣次序。但是,由于人类在选择时无法获取完全信息(有限信息),也不能进行精确计算(有限计算能力),行动者不会遵循效用最大化原则。

通过构建只包含单一偏好/效用来源的简单收益模型(见图1),西蒙指出复杂决策的基本规则是“满意法则”。在该模型中,收益之于行动者只有(0,1)取值[或(0,1,-1)的取值]:当产品附带的效用超过某一满意值时,收益为1,否则为0。具体而言,有限理性的行动者无法同时掌握所有选择的收益情况,只能根据可触及的选择是否达到满意值来做出(初次)判断。当选择高于满意水平时,行动即被触发(无须/无法考虑

① 这里所说的“满意值”及后文所讲的“欲望水平”“阈值”是同一意思。

② 为了保证收益模型中解(策略选择)的存在性,西蒙(1989)引入了欲望水平和备择行为集(指行动者认知范围内可以选择的行为的集合)变化;此外,他还引入顺序机制保证了解的唯一性。

③ 理论上讲,四种模型都应按照“偏好—行动”的具体对应方式来命名。出于简化考虑,本文采用了侧重偏好特征的命名方式。

④ 西蒙总结了三种“古典”理性模型中的收益模型,一是“极大极小法则”,即“采取使收益的最小值最大化的备择行为”;二是“概率法则”,即“选择最大化收益的期望的备择行为”;三是“确定性法则”,即“如果每一个选择都能得到确定的收益,那么采取使收益最大化的备择行为(最简单的消费者理论中的预算约束线与无差异曲线的切点的消费选择模型)”(Simon, 1955; 西蒙, 1989)。

潜在更优的选择),并以此持续优化;当低于满意水平时,选择间则无明显差异。

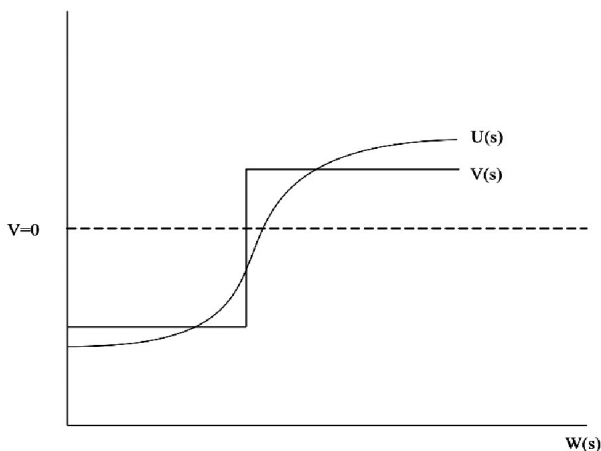


图1 简单收益模型

(来源:摘自Simon,1955)

根据简单收益模型,可以假设一种稳定的单偏好行动者模型。如图2所示, M 为行动者的客观选择集, M_0 为行动者的备择行为集^①。行动者只存在 y 物品所满足的 P_1 偏好,不存在 x 物品所满足的 P_2 偏好。对于 P_1 偏好,行动者的选择阈值为 y_0 。图2中 $y \geq y_0$ 的灰色区域代表行动者的满意域。由此可知, M_0 与满意域的交叉区域(即网格区域)为行动者会选择区域,即“策略解”所在的区域(后文简称“选择域”)。由于 M_0 和 y_0 ^②均可变动,所以一定会出现能够落在选择域内的备择行为,更复杂情况下的逻辑与之类似。

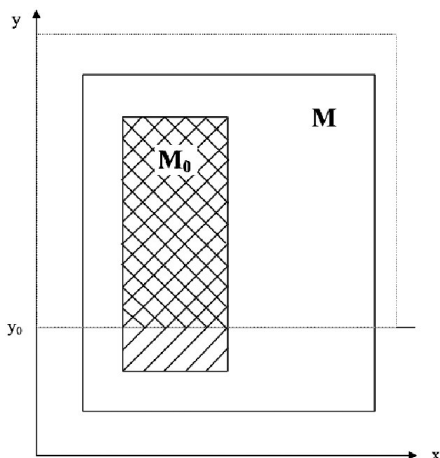


图2 “稳定单偏好”模型^③(模型I)

① 根据西蒙(1989)对有限理性行动者探索过程的分析, M 表示行动者面临的客观选择集合,它描述了外界环境约束下,与行动者诉求相关的所有可能策略; M_0 则表示行动者的备择行为集合,它描述了客观可能性中被行动者感知到或能够实施的部分,是 M 的真子集。当环境改善时, M 的范围会扩大;而 M_0 的范围则取决于行动者的能力与认知变化,在 M 内伸缩。

② 西蒙(1989)指出:“如果行动者在探索备择方案时容易发现满意方案,其欲望水平便提高;反之,其欲望水平就下降。”这种影响并不局限于单次选择中,而会以“系统的历史(从前的欲望水平和从前达到的欲望水平)”方式持续存在。

③ 需要指出,虽然这类行动者稳定持有单偏好,但并不代表其备择行为集(M_0)中的某个决策不具有 P_2 偏好(x)上的收益值,只是行动者对这类收益不敏感而已。

这种行动者持有明确的单偏好,表现出与之对应的单一行为且遵循“满意法则”。让我们用开篇提及的技术官员行为来简单说明^①:具有提升职业技能偏好的某位官员,对灰色收入不敏感。在对其长期(甚至一生)的观察中可发现,他从未有过故意的贪腐行为,但会保证每次决策高于一定^②的技能提升价值水平。

(二)“稳定双偏好”模型(模型Ⅱ)

与古典理论假设收益完全可比且有序不同,西蒙认为存在收益不完全可比的情况,并称之为“收益的局部有序”^③。为解决该问题,他依据“满意法则”提出局部有序收益模型。如图3所示:假设行动者拥有两个没有共同衡量尺度的偏好 v_1 和 v_2 ,二者无法彼此替代,则行动者在进行选择时需要同时满足 v_1 和 v_2 偏好各自的满意值(k_1 和 k_2),即仅有 $v_i \geq k_i$ (对一切 i 均成立) (V_i 为 i 的基数效用函数)时的收益被视为对行动者有效用价值的收益。在图3中, $(v_1 \geq k_1) \cap (v_2 \geq k_2)$ 构成了行动者的满意域(阴影部分)。与简单收益模型类似,行动者对满意域之外的选择不予考虑或比较;但会在情境条件优化后提高理性决策能力,并对原有满意值做出调整。

基于局部有序模型,可以构建一个稳定的双偏好行动者模型。如图4所示,行动者同时明确拥有 P_1 偏好(y) 和 P_2 偏好(x)。对于 P_1 偏好,行动者的满意阈值为 y_0 。 $y \geq y_0$ 的区域代表行动者在 P_1 偏好上的满意域;对于 P_2 偏好,行动者的满意阈值为 x_0 。 $x \geq x_0$ 的区域代表行动者在 P_2 偏好上的满意域。因此,该行动者的(总和)满意域为二者交集所在的灰色区域。备择行为集 M_0 与满意域的交集 β 区域(即网格区)就是行动者的选择域。

这一模型所描述的行动者持有稳定的双重偏好,并表现出与双偏好一致的行为结果,即这样一类技术官员:他们既希望提高技能水平,又想获得灰色收入。在对其长期(甚至一生)的观察中可发现,所有选择

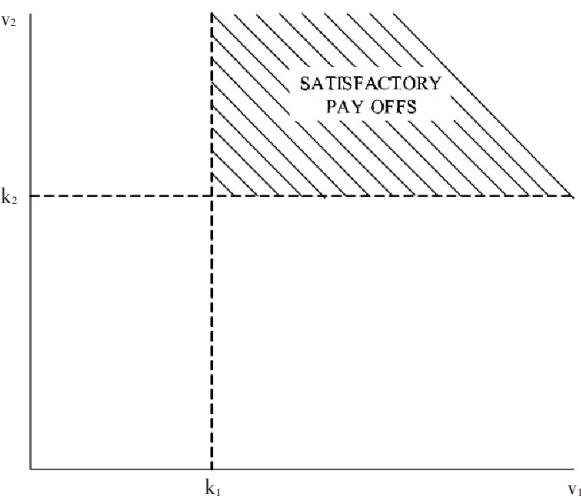


图3 局部有序收益模型

(来源:摘自 Simon,1955)

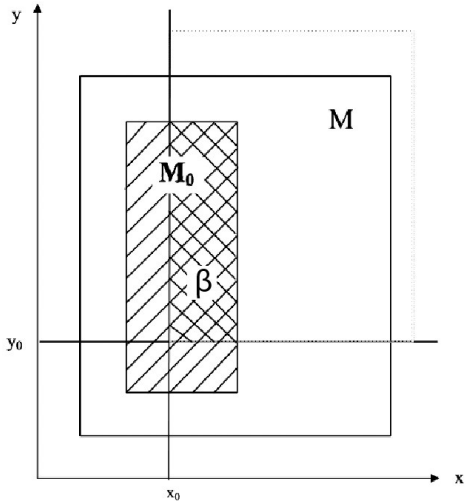


图4 “稳定双偏好”模型(模型Ⅱ)

① 在讲述其他行动者模型时,我们还将使用这个例子。
② 由于偏好满意的阈值可变,因此只能认为行动者在任一给定行动中持有确定的技能提升价值最低标准。类似的逻辑在后续行动者类型描述中同样存在。
③ 西蒙列举了三种“收益局部有序”的情况,其中第二种与本文讨论的议题高度相关,即“对一个人来说,他可能试图获得好几种价值,而这些价值彼此之间没有共同衡量的尺度”(西蒙,1989)。

均能保证高于一定的技能提升意义和灰色收入金额。

三、“偏好—行动”不一致的复杂行动者模型

在此基础上,我们将继续发展出两种“偏好—行动”不一致的复杂行动者模型:“可变单偏好”模型(模型Ⅲ)和“可变双偏好”模型(模型Ⅳ)。前者描述的行动者,虽然自认为只有单一偏好并展开行动,但另一潜藏的偏好可在一定条件下被激活^①,且相应的行为变化具有滞后性;后者描述的行动者具有意识明确的双重偏好(与模型Ⅱ类似),但其行为却时而出现反复,并不始终与偏好保持一致^②。

(一)“可变单偏好”模型(模型Ⅲ)

跨时偏好、实验和行为经济学研究已经探索了偏好的形成和消失,但刻画两种稳定人格类型的行动者模型Ⅰ和模型Ⅱ尚未涉及这一点。“可变单偏好”模型(模型Ⅲ)的意义在于描述从单偏好向双偏好变化的第一步。

通常情况下,这类行动者在主观认知上仅持有 P_1 单偏好(y),其行为也表现出一致性(即模型Ⅰ状态)。但在持续行动中,他们会因为外界刺激或个体经验积累而产生 P_2 偏好(x)。由于 P_2 偏好所要求的满意阈值在 x_0 ,行动者在 $x < x_0$ 时将不会显示^③出追逐 P_2 偏好的行为,即便此时他们已经形成了双重偏好。这类行动者具有偏好与行为分裂的特征:其行为的选择域依然为图5中的网格部分(同模型Ⅰ),但看似稳定的单偏好可以或已经提前发生变化^④。只有当备择行为集(M_0)包含有 x 收益高于 x_0 的策略时,行动者才会开始追求 P_2 偏好(x),重新实现偏好与行为的统一。一个可能的疑问是,行动者放弃追求 P_2 偏好(x)是否仅为“成本—收益”计算的结果,而仍与浮现的双重偏好一致?我们认为答案是否定的。按照有限理性的“满意法则”,行动者在比较附带 x 收益低于 x_0 的任意两种选择时,并未在 P_2 偏好(x)维度上进行计算。换言之,即便这种偏好存在,也已在行动中被简化忽略,故而可认为偏好与行动出现了分裂。

相对于“稳定单偏好”(模型Ⅰ)与(后文将介绍的)“可变双偏好”(模型Ⅳ)，“可变单偏好”(模型Ⅲ)行动者似乎难以在经验观察中确定^⑤,但却构成了偏好变化过程中重要的逻辑环节,即偏好的产生或消失往往提前发生,并不会瞬时体现在行动之中。仍以技术官员的例子加以说明:某位具有技能提升偏好的官员坚称,自己对贪腐收益毫无兴趣。但与(“稳定单偏好”模型所描述的)意志坚定的同事相比,他因自身经济压力或外界诱惑发生了动摇,逐步产生了对灰色收入的模糊诉求。不过,在其职权可触及的范围中尚未出现具有足够诱惑力的选择——他仍然是一个众人眼中清廉而上进的官员,事实也的确如此。

① 需要指出,潜在偏好被激活不同于已有偏好在“成本—收益”计算后的行动显现,而是新偏好的情境性产生过程。

② 同样的,后文将说明这种行动与偏好的不一致并非复杂计算后的结果,而是有限理性下的简化决策。

③ x_0 也可称为行动者 P_2 偏好的显示阈值。 P_2 偏好的显示阈值和满足阈值在概念上是两个值,但是假设行动者的满意域是 $x \geq x_0, y \geq y_0$,若行动者在 $x = x_0$ 会显现 P_2 偏好,且为显现 P_2 偏好的最小值,也即是 P_2 偏好的显示阈值。之后引入动态过程后的满意阈值变化,则需要另行讨论,但从模型简化的角度来讲,可以先将满意阈值与显示阈值均定义为 x_0 。

④ 行动早于偏好变化的例子属于偶然或非理性行为,本文不予讨论。

⑤ 虽然难以通过行为数据来测量,但这种类型可能比“稳定单偏好”模型(模型Ⅰ)代表的行动者更具普遍性:很难说一个从未有过追逐 x 效用的行动者就一定不具有潜在的 P_2 偏好。

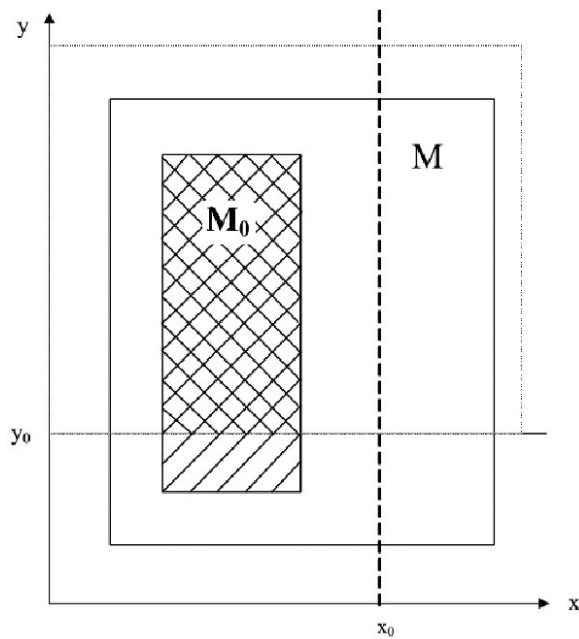


图5 “可变单偏好”模型(模型Ⅲ)

(二)“可变双偏好”模型(模型Ⅳ)

如前所述,“稳定双偏好”模型(模型Ⅱ)的一个隐含假定是行动完全显示偏好,具体含义可表达为:当 $x \leq x_0$ 或 $y \leq y_0$ 时, $U(x, y) \approx 0$,行动者将不会采纳该策略^①。与这类执着于双偏好的行动者不同,现实中常可观察到另一种更具“适应性”的情况:同一行动者的行为有时“表现”出单偏好,有时则“表现”出双偏好。与其说这种行为的不连贯或矛盾是源于偏好随时反复,倒不如说是行动者随机应变的结果。类似的,这里所称的“随机应变”并非基于“成本—收益”计算后对某种偏好的隐藏,而是在备择策略无法达到阈值时偏好简化的结果。“可变双偏好”模型(模型Ⅳ)旨在描述这类“偏好—行为”不一致的行动者。

如图6所示,假定行动者同时拥有偏好 P_1 和 P_2 ,其满意阈值分别为 x_0 、 y_0 。备择行为集 M_0 与满意域($x \geq x_0, y \geq y_0$)的交集 β 区域构成行动者策略的最优解集; M_0 与部分满意域^②($x \leq x_0, y \geq y_0$)的交集 α 区域构成行动者策略的次优解集;该行动者的整体选择域为 $\alpha + \beta$,且 β 区域内的解始终优于 α 区域的解。具体而言,当存在 β 区域内的策略时,行动者会对其优先选择,真实体现出双偏好(同模型Ⅱ);如果通过降低 x_0 (扩大 β 区域)依然无法获得最优策略解,行动者将不再考虑备择策略的 x 效用差异(即放弃 P_2 偏好),转而选择 α 区域的次优方案,表现出“偏好—行为”的不一致。

① 行动者为了获得解会改变其阈值 x_0 或 y_0 以扩大 β 区域,但其行动永远表现出双偏好,即根据两个偏好的效用进行选择,如当 $U(y)$ 相等时,行动者会选择 $U(x)$ 较大的方案。

② $y \leq y_0$ 时的情况与 $x \leq x_0$ 时一致。

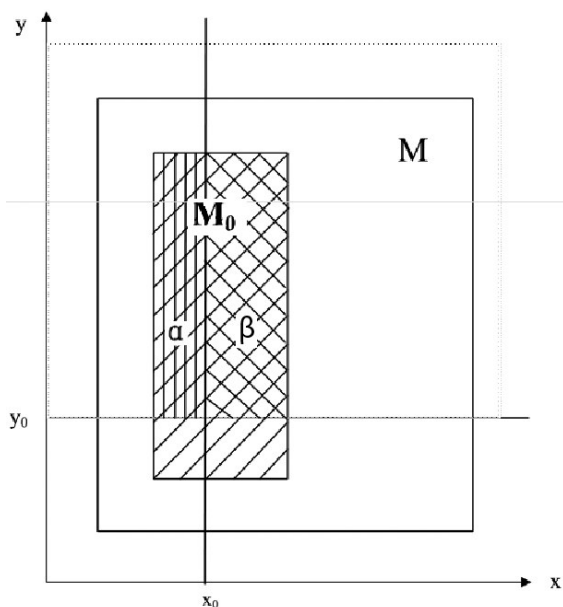


图6 “可变双偏好”模型(模型Ⅳ)

与“可变单偏好”模型(模型Ⅲ)类似,“可变双偏好”行动者同样代表了偏好连续变化过程中的重要一环:偏好的固化或消失并非一蹴而就,行动者能根据现实条件在相当长时间内保持权变。事实上,多数希望同时提高职业技能与获取贪腐收益的官员正属于这类行动者:当出现能够带来可观灰色收入且有利于能力提升的选择时,他们会表现出符合真实偏好的行为;当灰色收入过低,他们仍会是清廉而上进的代表。如果仅从贪腐收益的角度来看^①,其金额长期稳定处于变化中的满意阈值之上或之下,决定了官员偏好与行为变化的方向。

四、偏好与行为的动态变化:偏好产生的连续行动模型

基于以上四种行动者模型,本节将首先分析第一类动态变化:偏好形成过程中伴随的行动趋势。为简化表述,我们将用模型Ⅰ、Ⅱ、Ⅲ、Ⅳ来指代不同“偏好—行为”状态。后续讨论主要涉及模型Ⅱ、模型Ⅲ和模型Ⅳ。不讨论模型Ⅰ所代表的“稳定单偏好”的原因在于,其定义规定了偏好和行动的不可变性。所有可能产生后续动态变化的单偏好状态都是指潜在的“可变单偏好”,即模型Ⅲ。

如图7所示,对于原本只拥有 P_1 偏好(y)的行动者而言, P_2 偏好(x)产生并演化的完整过程起始于模型Ⅲ的单偏好可变环节,并逐步转变为模型Ⅳ,最终定型于模型Ⅱ。如果条件发生变化,也可能出现停滞(长期处于模型Ⅲ或模型Ⅳ)或跨越(从模型Ⅲ直接到达模型Ⅱ)^②。除了模型Ⅲ行动者拥有“可能产生新偏好”的内在心理结构,推动偏好产生与行为变化的动力主要来自偏好涉及的阈值变化与备择策略的收益属性之间的关系。为方便集中讨论 P_2 偏好(x),后文将控制 P_1 偏好(y)的阈值 y_0 和备择策略在 y 上的收益值变化。

① 同样的,也可从技能提升价值(即工作/决策的挑战性)的角度来展开讨论。实际上,行动者同时受到二者变化的影响。

② 逻辑上也存在倒退的可能,我们将在偏好消失机制部分介绍。

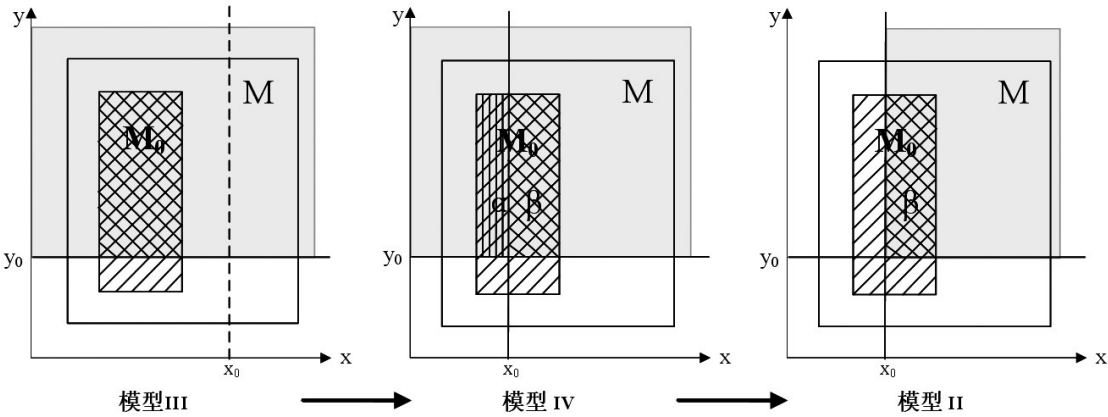


图7 偏好产生的连续行动模型

如前所述,模型Ⅲ行动者的单偏好 P_1 与行为看似一致,但却存在产生新偏好 P_2 的可能性。当选择域(阴影内网格区)在 x 轴上不断扩大, P_2 偏好将被激活,形成相应的满意阈值 x_0 。如果随后选择域退回并长期处于 x_0 水平以下,行动者将停滞于模型Ⅲ,但此时的单向诉求(y 收益)行为已与双偏好不一致;如果选择域在 x 收益上持续优化且快于 x_0 的变大速度,那么行动者将进入模型Ⅳ——虽然具有双偏好,但会根据备择策略的 x 收益值出现在 α 和 β 区域间的行为反复。

模型Ⅳ能否维持的关键,取决于后续备择策略出现在 α 或 β 区域的概率差异。假如选择更多地出现在 α 区域,行动者将保持权变行为;但如果始终有大量备择策略出现于 β 区域,那么行动者将进一步演化,进入模型Ⅱ,即放弃 α 区域的次优选择,稳定地追求能使双偏好同时得到满足的结果——偏好与行为达成一致。

图7所示的完整过程在理论上也有跨越发展的可能。当处于模型Ⅲ的行动者产生新偏好 P_2 偏好(x)后,如果选择域(阴影内网格区)在 x 轴上快速上升并保持稳定,那么行动者将越过 α 区域代表的次优选择,直接进入模型Ⅱ。与“模型Ⅲ→模型Ⅳ→模型Ⅱ”过程的循序渐进相比,这种变化发生需要更强烈的刺激条件。

上述逻辑可以用一个简化^②的“糖衣炮弹”故事来大致说明:对于长期接受正统教育、准则内化的技术干部而言,提高职业技能是他在工作中的单偏好,灰色收入并不在其考虑范围之内,这时他表现出与实质单偏好一致的行为。但是,随着外界诱惑反复出现并不断增强(即所谓的“糖衣炮弹”),加之其他因素的共同影响^③,他可能逐步形成对于灰色收入的欲望。但由于此时其职权范围内的潜在受贿金额尚未达到令其满意的水平,他的行为仍然表现出某种“清廉”。如果促使金钱欲望产生的因素持续存在(甚至加强)且权力随年资或业绩上升不断扩大,他将出现选择性的贪腐行为,即灰色收入可观且有一定技能提升意义的选择。当行贿者络绎不绝出现,快速膨胀的“胃口”始终能够得到更高水平的满足,该官员的贪腐行为将“常态固化”。通常来看,从清廉到贪腐的变化具有累积性特征。阻断这一过程的方法并不止于提高违规成本,更不应寄希望于思想教育杜绝灰色收入的念头萌芽,而是控制职权行使中的寻租空间。

① 需要注意的是,行动者 P_2 偏好产生的阈值可能小于观察到的行为显示阈值 x_0 。假设可以得到连续数据,且行动者备择行为的扩大是一个逐渐的过程,则偏好出现的阈值就近似等于行为显现偏好的阈值。但一经产生,它对后续行为的影响则是确定的。

② 以下分析并未考虑工作挑战性对官员的影响(即 y_0 变化),也忽略了大量的现实因素,但并不妨碍基本逻辑成立。

③ 例如在个人生活的其他方面,金钱的重要性不断上升(其他选择的影响),或经济诱惑的数量持续超过个人生活的物质水平(参照群体的影响)等。

五、偏好与行为的动态变化:偏好消失的连续行动模型

将上述机制逆转,将得到关于偏好消失的连续过程解释。如图8所示,对于同时持有两种偏好的行动者而言, P_2 偏好(x)弱化直至消失的完整过程起始于模型Ⅱ,并逐步转变为模型Ⅳ,最终定型于模型Ⅲ——极端情况下甚至会达到模型Ⅰ。以下讨论依然仅从 P_2 偏好(x)的阈值 x_0 和备择策略在x上的收益值变化方面展开。

如前所述,行动者维持模型Ⅱ状态的基础是始终存在 β 区域内的备择策略。当备择策略的x收益下降,行动者可以先通过调低满意阈值 x_0 来维持与双偏好一致的行为;但如果环境持续劣化,备择策略的x收益的下降速度超过行动者对 x_0 的调整速度,行动者将弱化 P_2 偏好(x),转变为模型Ⅳ状态。

假定此时(无论如何调低 x_0 水平)备择策略的变化趋势仍是更大概率出现在 α 区域,那么 P_2 偏好(x)将进一步衰退,行动者将到达模型Ⅲ状态, P_2 偏好(x)几近消失。极端情况下后续演化或将继续:不管是“ x_0 下降停止于某个位置,模型Ⅲ所示的选择域(网格区)仍低于 x_0 ”,抑或是“行动者将 x_0 持续调低至接近原点”,都代表着行动者将最终到达模型Ⅰ,即 P_2 偏好彻底消失,无法重新产生。

那么,偏好消失的过程是否与其产生一样,也存在因条件变化而遭遇停滞、跨越或逆转的情况?我们认为,逆转和停滞的可能是显而易见的,但跨越的可能性微乎其微。和强大刺激造成偏好的情境性生成不同,作为心智结构要件的既有偏好可以在行为中消失,但不可能被从认知中迅速抹去。因此,模型Ⅳ是行动者无法越过的阶段。

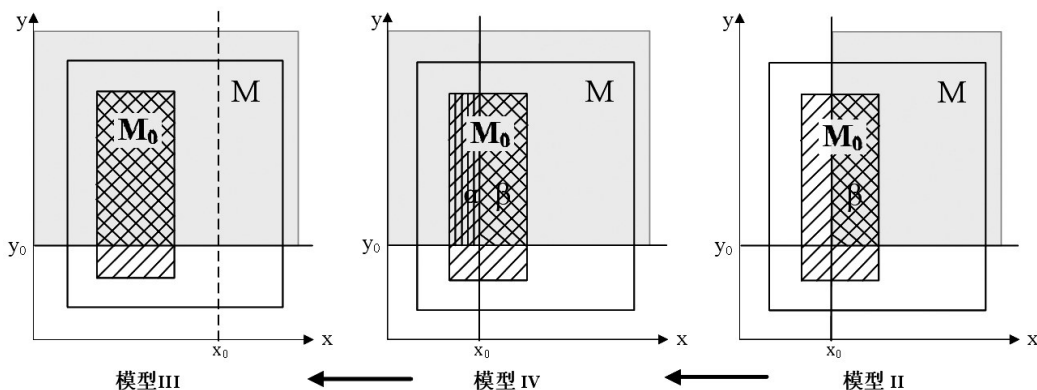


图8 偏好消失的连续行动模型

在“糖衣炮弹”故事的最后,我们提出压缩寻租空间(即降低备择选择的x收益值)对于杜绝贪腐偏好与行为扩大化的意义。下文将用一个简化^①的“廉政建设”过程说明偏好消失的连续过程,同时体现控制寻租和“高薪养廉”的意义:对于一个贪腐已经“常态固化”的技术官员而言,提升职业技能和灰色收入构成了他在工作中的双偏好。随着“廉政建设”推进,他的职权范围受到严格约束,获得大额灰色收入的概率迅速下降;同时,“高薪养廉”又在一定程度上提高了他对包括灰色收入在内的经济激励的“胃口”,该官员将收敛以往的无差别贪腐行为,表现出“老练”的情境选择特征。如果上述政策安排持续深入,同时满足技能提升

① 类似的,以下分析也不考虑工作挑战性对官员的影响(即 y_0 变化)。

与可观灰色收入的选择将进一步减少,“伪装的清廉者”也有可能向“真实的清廉者”转变。虽然在这一个体的职业历程中难以根除贪腐偏好,但当制度塑造出廉政文化,真正约束行为的将不再只是法律。这个故事并非只是天真的理论构想,已有学者发现北欧国家廉政建设的秘密:全面约束权力的制度与适度高薪养廉,而非单纯依赖重典(倪星、程宇,2008)。

六、偏好变化与“显示性偏好”的解释困境

如果行动者的偏好与行为变化确实存在,上述讨论将与“显示性偏好”理论发生冲突。通过介绍该理论的基本思路,我们将指出其存在的解释困境,进一步突出本文模型的分析意义。

由于消费者(行动者)内在偏好或效用结果不可测量,基于偏好的行为预测难以实现。为了解决该问题,美国经济学家保罗·萨缪尔森提出了“显示性偏好”理论(Samuelson, 1938),基本思路为:消费者在一定价格条件下的购买选择暴露了他的内在偏好,因此可以根据购买行为来推测消费者的偏好。具体可作如下表达:假定消费者在价格为 (p_1, p_2) 时可以购买商品组合 (x_1, x_2) 或商品组合 (y_1, y_2) 。如果存在 $p_1x_1 + p_2x_2 \geq p_1y_1 + p_2y_2$,则消费者一定会更偏好 (x_1, x_2) 组合。以上比较依次传递,就能得到行动者偏好的大致面貌。概而言之,虽然与传统思路的逻辑相反,“显示性偏好”理论目的和功能仍然指向解释和预测行为:通过观察行动积累偏好信息,进而完善效用函数。

不过,该理论在面对跨期偏好变化时将遭遇困境。假定行动者经历了“模型Ⅲ→模型Ⅳ→模型Ⅱ”偏好产生过程,并在模型Ⅲ和模型Ⅱ阶段分别观察到两个选择 (x_{III}, y_{III}) 、 (x_{II}, y_{II}) ,且 $p_1x_{II} + p_2y_{II} \geq p_1x_{III} + p_2y_{III}$,能否说明行动者对后一种策略更加偏好?如果假定个体偏好不变,仅比较其(在不同时期)两个选择的收益差异,答案或许是肯定的。但更准确的描述应该是偏好改变导致“显示性偏好”理论出现了跨期解释的错误。简而言之,不能在偏好改变前后的两个行动者类型之间做简单收益比较,即便它们归属于同一行动者个体。事实上,这种比较可能在经验观察中难以实施:在模型Ⅲ的选择域和模型Ⅱ的选择域中,可以找到两两收益比较的各类结果(大于、小于或等于),但却与偏好变化后的行动者稳定在 β 区域内选择的观察不符。

即便不考虑偏好变化,“显示性偏好”解释在处理模型Ⅳ代表的复杂行动类型时 also 存在问题。如前所述,此时行动者的选择域特征为: β 恒定优于 α 。但这并不意味着 β 区域任一选择在 x 与 y 上的收益和一定大于 α 区域的任一选择。更进一步的,在 α 区域中的任意两个选择间固然存在 x 与 y 上的收益和差异,但却不是对行动者决策的真实刻画——由于 α 区域整体处于 x_0 以下,行动者此时仅会比较 y 的收益差别而已。

综上所述,“显示性偏好”理论在处理偏好连续变化的行动者时存在明显的缺陷。这一方面源于该理论对行动者跨期变化的忽视,另一方面则源于其内生的强理性假定。如果真实的行动者是偏好可变且有限理性的,其行为表象与内在偏好的关系将更加复杂且具有情境性——这正是本研究试图说明的问题。

七、结论与讨论

依托有限理性的理论思路与概念工具,本文挑战了传统经济行为分析中的偏好不变与效用最大化假定,构建了一组包含四种行动者类型的理论模型。以此为基础,我们进一步描述了连续行动过程中的偏好变化与策略选择,修正并丰富了以“显示性偏好”理论为代表的既有研究对偏好与行为之间复杂关系的理

解。如前所述,行为经济学的前景理论已经对偏好改变、决策与偏好不一致的情况做出了富有洞察力的解释(Kahneman & Tversky, 1979; Tversky & Kahneman, 1992),并在近年来的深入研究中得到快速发展(Schmidt, et al., 2008; Werner & Zank, 2018)。与该范式侧重将情境性的认知偏差等心理因素纳入短期行为分析不同(边慎、蔡志杰,2005;张应语,2017),本研究更关注长期连续过程中偏好与行为的演化(进行或退行)机制,以及在特定条件下行为显示或隐藏偏好的可能。这项工作不仅有助于重新审视关于偏好变化的既有结论,也能为新的行为实验提供设计思路。

出于完成初步模型化的考虑,本文在偏好结构、偏好可替代性以及偏好与行动关系的具体情形等方面未能展开深入讨论。虽然针对这些问题已有不少文献(主要来自行为与实验经济学领域)做了大量探索(Grether & Plott, 1979; Safra, et al., 1990; Carson & Groves, 2007; Dellavigna, 2009; 李建标、付晓改、任广乾、李朝阳,2018),但还存在诸多争议:

(一)偏好的结构

为了避免在偏好定义上出现争议,本文没有探讨偏好结构。在新近文献中,这已经成为一个重要议题。针对传统定义的笼统性,研究者提出了显性偏好和隐形偏好、内层偏好和外层偏好等更符合实证需要的分类形式,试图为讨论偏好与行为的关系夯实理论基础。不过,如何确定这类探索的分析效力,尚需依赖实验设计与心理测量工具的发展。

(二)偏好的可替代性

基于西蒙的思路,本文假定行动者的多重偏好间存在不可替代性,这可能并不符合实际决策的全貌。关注这一问题的原因在于,偏好间能否替代会直接影响解释或预测行为的方法:如果选择域内的两类偏好可互相替代,则可以用一组凸向满意值交点(区域原点)的“无差异曲线”来描述行动者的收益结果,进而确定不同预算条件下的均衡位置;如果替代性不存在,则需找到比顺序机制更准确的分析工具。

(三)偏好和行动之间的关系

虽然我们在动态变化中讨论了偏好与行动不一致的诸多表现,并批评了显示偏好理论解释的潜在风险,但也未能给出更具系统性的理论描述。随着技术工具的发展,心理活动与实际行为的观测大数据将迅速累积,并涌现出海量的经验性规律。整合这些碎片化发现的关键仍然在于建构更精细的理论模型。

参考文献:

- 边慎、蔡志杰,2005,《期望效用理论与前景理论的一致性》,《经济学》(季刊)第5期。
- 赫伯特·西蒙,1989,《现代决策理论的基石》,杨砾、徐立译,北京:北京经济学院出版社。
- 黄凯南,2013,《偏好与制度的内生互动:基于共同演化的分析视角》,《江海学刊》第2期。
- 加里·贝克尔,1995,《人类行为的经济分析》,王业宇、陈琪译,上海:上海人民出版社。
- ,2000,《口味的经济学分析》,李杰译,北京:首都经济贸易大学出版社。
- ,2013,《歧视经济学》,于占杰译,北京:商务印书馆。
- 科林·凯莫勒、乔治·罗文斯坦、马修·拉宾,2010,《行为经济学新进展》,贺京同译,北京:中国人民大学出版社。
- 李建标、付晓改、任广乾、李朝阳,2018,《偏好结构、过度自信与代理人可变薪酬契约选择行为:基于真实任务的实验研究》,《预测》第1期。
- 倪星、程宇,2008,《北欧国家的廉政建设及其对中国的启示》,《广州大学学报》(社会科学版)第4期。
- 瑞查德·斯威德伯格,2003,《经济学与社会学》,安佳译,北京:商务印书馆。
- 斯梅尔瑟·尼尔、斯威德伯格·瑞查德,2014,《经济社会学手册》,罗教讲、张永宏译,北京:华夏出版社。
- 张应语,2017,《偏好的演化与经济学的发展》,《经济与管理评论》第1期。
- Bowles, S. 1998. "Endogenous Preferences: The Cultural Consequences of Markets and Other Economic Institutions." *Journal of*

Economic Literature 36(1): 75–111.

Carson, R. T. & Groves, T. 2007. “Incentive and Informational Properties of Preference Questions.” *Environmental & Resource Economics* 37(1): 181–210.

Dellavigna, S. 2009. “Psychology and Economics: Evidence from the Field.” *Journal of Economic Literature* 4(2): 315–372(58).

Grether, D. M. & Plott, C. R. 1979. “Economic Theory of Choice and the Preference Reversal Phenomenon.” *American Economic Review* 69(4): 623–638.

Hsee, C. K., Loewenstein, G. F., Blount, S., & Bazerman, M. H. 2006. “Preference Reversals between Joint and Separate Evaluations of Options: A Review and Theoretical Analysis.” *Psychological Bulletin* 125(5): 576–590.

Izuma, K., Matsumoto, M., Kou, M., Samejima, K., Sadato, N. & Matsumoto, K. 2010. “Neural Correlates of Cognitive Dissonance and Choice-induced Preference Change.” *Proceedings of the National Academy of Sciences of the United States of America* 107(51): 22014.

Kahneman, D. & Tversky, A. 1979. “Prospect Theory: An Analysis of Decision under Risk.” *Econometrica* 47(2): 263–291.

Novemsky, N. & Simonson, I. 2007. “Preference Fluency in Choice.” *Journal of Marketing Research* 44(3): 347–356.

Nowlis, S. M. & Simonson, I. 1997. “Attribute–task Compatibility as a Determinant of Consumer Preference Reversals.” *Journal of Marketing Research* 34(2): 205–218.

Safra Z., Segal, U. & Spivak, A. 1990. “Preference Reversal and Unexpected Utility Behavior.” *American Economic Review* 80(80): 923–930.

Samuelson, P. A. 1938. “A Note on the Pure Theory of Consumer’s Behavior.” *Economica* 5(17): 61–71.

Schmidt, U., Starmer, C. & Sugden, R. 2008. “Third-generation Prospect Theory.” *Journal of Risk & Uncertainty* 36(3): 203.

Simon, H. A. 1955. “A Behavioral Model of Rational Choice.” *Quarterly Journal of Economics* 69(1): 99–118.

Tversky, A. & Kahneman, D. 1992. “Advances in Prospect Theory: Cumulative Representation of Uncertainty.” *Journal of Risk & Uncertainty* 5(4): 297–323.

Werner, K. M. & Zank, H. 2018. “A Revealed Reference Point for Prospect Theory.” *Economic Theory* 1–43.

Preference Changing and Behavioral Strategy of Actors with Bounded Rationality: A Preliminary Theoretical Model

YAN Jun LI Ting-ting

Abstract: Based on the theoretical approach and concept tools of bounded rationality, through the hypothesis of stable preference and utility maximization, a theoretical model including a group of four categories of actors has been proposed in this study. On this basis, preference changing and strategy selection in the process of sequential action have been further described to revise and enrich the understanding on the complicated relationship between preference and behaviors in current studies, as represented by the Revealed Preference Theory. Different from behavioral economics which puts particular emphasis on short-term situational analysis, this study shows more concern about the evolution (progressive or regressive) mechanism, and the possibility of revealing or hiding preference in behaviors under specific conditions. This study may help reexamine existing conclusions on preference changing, but also provide design ideas for new behavior tests.

Key Words: Bounded Rationality; Preference Changing; Behavioral Strategy; Theoretical Model; Revealed Preference Theory

(责任编辑:王水雄)