



English

下载中心

首页

网站地图

关于 IWEP

研究课题

研究人员

研究成果

数据库

出版物

媒体报道

研讨会/讲座

## 期刊文章选登

[HTTP://WWW.IWEP.ORG.CN](http://www.iwep.org.cn)

《世界经济》2007年第12期

[\[PDF全文下载\]](#)

弗里德曼的《实证经济学方法论》：缘起、内容及再解读

谢作诗 李平

[内容提要] 本文再解读《实证经济学方法论》，探讨和回答了如下问题：（1）理论的本质是什么？（2）理论的假设需要具有现实性吗？什么样的理论其假设需要具有现实性，什么样的理论其假设反而不能都具有现实性？（3）利润最大化假设真的不具有现实性吗？到底应该怎样来检验一个理论的假设的现实性？（4）理论可能被证实吗？可能被证伪吗？我们又该怎样对一种理论进行检验？

[关键词] 实证经济学 方法论 假设 现实性

[作者简介] 谢作诗：沈阳师范大学国际商学院 110034 电子信箱：[zuoshixie@hotmail.com](mailto:zuoshixie@hotmail.com)；李平：辽宁大学比较经济体制研究中心 110036 电子信箱：[lping0000@sina.com](mailto:lping0000@sina.com)。

弗里德曼在货币理论和消费函数方面的学术研究贡献成就了他于1976年荣获诺贝尔经济学奖。然而，若要全面评价其学术贡献，我们还必须补充他于1953年发表的《实证经济学方法论》（以下简称《实证》）一文。这篇现已成为经济学方法论经典的论文，自发表以来就饱受争议。当时，不少经济学界泰斗都曾直接撰文参与论战（Samuelson, 1963, 1964; Koopmans, 1956, 1979; Simon, 1963）。时至今日，有关这篇文章的各种争论、解读和再解读仍在继续。2003年，为纪念该文发表50周年，西方学者还特地举行了一场专场研讨会。

《实证》一文的确极富洞见，国内一些较为有名的方法论论文《理解现代经济学》（钱颖一，2002）、《经济学、经济学家与经济学教育》（许成钢，2002）中的许多重要观点都没有超越其见解。但是弗里德曼的论证多少有些晦涩和难以理解，主要是其把不同层次的问题放在了一起来加以说明。我们结合自己对于方法论问题的某些理解，用新的体系对《实证》的主要论点及其证明进行梳理，做一个再解读。

### 一、《实证》的缘起和写作目的

弄清《实证》一文的缘起和写作目的，对于理解该文不无裨益。《实证》一文的初稿，大概写成于1948年底，最初的目的是为了反对历史主义者对于边际分析方法的否定。众所周知，20世纪20年代之前，美国经济学界的主流是以凡勃伦（Veblen）和康芒斯（Commons）为代表的制度学派理论。随着价格理论在30年代的兴起，40年代不少研究者纷纷质疑边际分析方法。Lester（1946）通过问卷调查发现，企业普遍使用平均成本加成定价，而不是等边际原则定价，企业似乎并没有追求利润最大化。于是他主张放弃假设企业追求利润最大化的新古典厂商理论，取而代之以更现实的假设作为研究的起点。对此，Machlup（1946, 1947）以及Stigler（1947）从Lester的问卷调查方法存在问题入手做了回应。然而在弗里德曼看来，他们的回应和Lester的质疑都犯了同样的错误，即都试图用假设的现实性来检验理论本身是否正确。因此弗里德曼《实证》一文最初的主旨，在于论证不能用假设的现实性来衡量理论本身正确与否。

《实证》一文还源于弗里德曼1946年发表在《美国经济评论》上的评论文章《奥斯卡·兰格有关价格灵活性与就业的论述》。在这篇评论中，弗里德曼批评兰格（Lange）只关心经济模型之形式完美，忽视了应用经验数据检验这些模型，使经济学最终退化为数学的仆人。该文发表后不久，美国数学、统计学专家威尔逊（Wilson）给弗里德曼去了一封信，大概意思是反对其对兰格追求经济学科学化努力的“吹毛求疵”。他指出，形式化、科学化的经济学只是观察现实世界的有用窗口，不应强求经济理论的经验内涵。弗里德曼不同意威尔逊的看法，在随后的回信中他指出，作为社会科学的经济学和自然科学不同，它不仅需要形式化，同时还要有充分的经验证据，否则没有任何意义，并且列举米切尔（Mitchell）有关经济周期的研究做了进一步的说明。

另外，弗里德曼本人的工作经历和知识背景是《实证》一文的又一重要写作背景。他不仅具有极高的统计天赋，而且具有丰富的统计实践经验。从学校毕业后，弗里德曼在美国经济研究局、国家资源委员会、哥伦比亚大学统计小组以及威斯康星大学从事的工作，主要都集中在数理统计理论与实践领域。他曾担任库兹涅茨（Kuznets）的研究助手，战时和许多自然科学领域的科学家一道用统计方法预测飞机、炮弹等军用物质的用材，积累了丰富的统计工作经验。这些实际工作经历可能使他意识到，由于经验事实的无限性，理论将永远无法被证实，因此能否不被经验事实反驳，就成为评判理论是否“好用”，能否暂时被接受的合适标准。

值得一提的是，Hammond（1991）在《弗里德曼方法文章的背景》一文中，还考察了一个非常有价值的细节：弗里德曼的方法论文章从1948年的第一稿到1951年的第二稿之间有较大的补充，尤其是增加了有关假设在假说、理论中的作用的说明。通过查阅弗里德曼和Stigler有关这篇文章的通信，Hammond指出，弗里德曼从原本消极地看待假设的作用，到行文后半部分对假设的积极意义做了“画蛇添足”式的补充，很大程度上是受Stigler评论的影响。

在《实证》一文中，弗里德曼清楚地表达了他的写作目的：“论述在创立凯恩斯所倡导的‘性质截然不同的实证科学’时引起的一些方法问题，特别是探讨如何决定提出的假说或理论是否应当被暂时接受为是关于‘是什么’的系统知识这样的问题。”核心一点，《实证》一文是要证明不能根据假设的现实性来检验理论正确与否。

## 二、理论是什么

在弗里德曼看来，理论首先是一个形式体系。理论“是一种被设计用于促进系统和有组织的推理方法的语言”“就一种‘语言’来说，理论没有实质性内容，……形式逻辑准则可以说明特殊语言是完整的前后一致的语言。”

毫无疑问，人类认识自然和社会的一般规律是先有归纳，然后才有演绎。先观察到三片秋叶、三头黄牛、三颗星星、……这些有经验含义的事物，然后才抽象出数字“3”的概念。数字“3”就是一个形式化的东西，“ $2+3=5$ ”也是一个形式化的东西，全部数学就是一个形式体系。我们可以赋予它们经验含义，甚至之所以能够抽象出这样的形式化东西可能正是得益于经验上的观察和归纳，但是反过来，数字“3”却不是因为有经验含义而成为数字“3”，数学也不是因为有经验含义而成为数学。理论只要符合“内在一致性”即可，是不需要一定具有经验含义的。我们可以给形式化的理论体系赋予经验含义，但是它们不是因为有经验含义而成其为理论，而是因为它们本身是形式体系而成其为理论。

适者生存，不适者淘汰。无可否认，在对待理论的态度上，人类同样不得不表现出极大的功利性。在理论构建过程中，虽然不排除出于对纯形式美的追求和好奇心而展开研究（例如，数学中许多重大理论都是出于数学家们对于纯数学美的追求和好奇心而发展起来的），但是一般来说人们总是努力赋予它们经验含义。不过反过来，我们的确不应该以是否具有经验含义作为理论的评判标准，甚至都不能以是否具有经验含义作为是否是有用的理论的评判标准，因为我们根本就不知道那些没有经验含义的纯形式化的理论什么时候就会发挥出巨大用场，又会以怎样的方式发挥用场。

如果我们承认数学是具有最严密的演绎体系的理论的话，那么我们就必须接受理论不是因为有经验含义而成其为理论，而是因为它们本身是形式体系而成其为理论这样的判断。

不过，在弗里德曼看来，作为实证科学的经济学到底与一般性理论有所不同。实证科学是研究“是什么”的系统知

识，其终极目标是发展能够对观察到的现象提供有效的解释，并对尚未观察到的现象提供既有效又有意义的预测的理论。“这样的理论是两种要素的混合体：一方面，它是一种被设计用于促进系统的与有组织的推理方法的语言；另一方面，它是一个被设计用于抽象复杂现实本质特征的实质性假说体系。”在弗里德曼看来，作为一种实质性假说体系，理论又需要被检验，不仅要具有“内在一致性”，还要保持“外在一致性”。他在《奥斯卡·兰格有关价格灵活性与就业的论述》这篇评论中，就曾批评兰格只关心经济模型之形式完美，忽视了应用经验数据检验这些模型，使经济学最终退化为数学的仆人。面对威尔逊的形式化、科学化的经济学只是观察现实世界的有用窗口，不应强求经济理论的经验内涵的指责，他随后又进一步指出，作为社会科学的经济学和自然科学不同，它不仅需要形式化，同时还要有充分的经验证据，否则没有任何意义。

关于一般性理论与实证科学理论的这种区分，弗里德曼在《实证》一文中并没有明确地表达出来，但究其精神，这种区分却是清晰可见的。这种区分正是我们理解弗里德曼“从原本消极地看待假设的作用，到行文后半部分对假设的积极意义做了‘画蛇添足’式的补充”这种“矛盾”现象的关键所在：仅仅就作为形式体系的理论本身而言，假设的确不重要，但是就具有解释和预测能力的实证科学理论而言，假设就是重要的了。当弗里德曼讲假设不重要的时候，他强调的是作为形式体系的理论本身；当他讲假设重要的时候，他强调的是理论的实证特性、理论的解释和预测能力。

在我们看来，作为理论的形式体系还必然表现为公理体系。

由于“归纳问题”不可克服，因此任何科学的理论体系必然是逻辑演绎体系。但哪里才是逻辑演绎恰当的起点呢？答案是：理论构建的逻辑起点只能是不定义概念和公理假设。一切科学的理论，归根结底都是由不定义概念和公理假设（广义地统称为公理假设）、逻辑推导、逻辑结论三个部分有机构成的公理体系。牛顿的物理学是公理体系，爱因斯坦的相对论是公理体系，经济学的阿罗-德布鲁体系是公理体系，……。事实上，我们是找不到不是公理体系的科学理论的。

在科学理论与非科学理论的分界问题上，我们是不折不扣的理性主义者，强调理论的本质是形式体系，而且这种形式体系还必然地表现为公理体系。历史地看，经验归纳在演绎体系的形成过程中的确起了重要作用，而形式逻辑的规定为什么是这样的而不是那样的，同样与经验归纳不无关系。不过一旦形式化的抽象形成了，反过来其存在就不需要依赖于经验含义了。在我们看来，公理体系的要义不仅仅是对待前提假设的态度，同样包括对待逻辑推导，也就是形式逻辑本身的态度。当然，我们承认并不是任何理论都可以容易地形式化。要知道，欧几里得几何经历了2200年才被最终构建成完备的公理体系。也不是说还没有被最终构建成完备的公理体系的理论就没有科学的成分。理论总是要逐步地被完善，最终成为科学的理论。我们要表达的意思是，一个理论，只有最终被构建成完备的公理体系才能真正算做科学的理论。

三、何谓理论之“对”与“错”，经验事实是否可以验证理论

.....

四、实证科学理论是否一定要求假设具有现实性

.....

五、怎样验证假设的现实性

.....

六、结束语

以下观点，有的是弗里德曼《实证》一文的直接观点，更多的则是我们在《实证》一文的基础上延伸而推导得到的。

第一，理论的本质是形式体系，并且是由公理假设、逻辑推导、逻辑结论三位一体有机构成的形式体系。理论只要符合“内在一致性”即可，是不需要一定具有经验含义的。我们可以给形式化的理论体系赋予经验含义，但是它们不是因为

有经验含义而成其为理论，而是因为它们本身是形式体系而成其为理论。

第二，仅仅就作为形式体系的一般性理论而言，假设的确不重要，只要满足独立性、相容性和完备性即可。但是，要使理论具有解释和预测能力，假设就是重要的了。对实证科学来说，理论的假设是不可以“任意”做出的。

第三，实证科学不可以“任意”做假设，并不意味着其假设就一定要具有现实性。对于作为“参照系”和理论“基准”的经济学模型来说，其假设可以与现实不相符，也一定与现实不相符，至少不会都与现实相符合，我们不应该要求其理论假设具有现实性。对于直接解释、预测经济现象和行为的经济模型来说，应要求理论的前提假设与现实世界相符合，尽管不可能完全符合，需要做到的是理论假设不能过于偏离现实。但是何为不过于偏离现实，要依据问题的性质而定，并没有简单的规则可以遵循。

第四，“外在一致性”概念必须是在把理论作为公理假设、逻辑推导、逻辑结论的有机整体来对待的框架下才是有意义的，而不能简单地指理论的逻辑结论与经验事实相一致。如果理论的公理假设与局限条件相符合，理论的逻辑结论又与经验事实相一致，那么该理论就具有“外在一致性”。在这样的概念框架下，“外在一致性”概念并不能够多告诉我们什么，不过是说理论的公理假设与现实的约束条件相一致，而理论同时具备“内在一致性”罢了。

第五，理论评价的恰当标准只能是“内在一致性”，而不是“外在一致性”，理论正确与否的含义必须回到“内在一致性”标准上来。在某种意义上，我们的确可以通过“外在一致性”来检验理论，但是这种检验是通过“外在一致性”间接地验证理论的“内在一致性”，进而验证理论本身。一般来说，在可控实验的情况下这种间接检验才是可能的，在不可控实验的情况下这种间接检验就困难得多。

第六，理论可以被证实，或者被证伪。证实决不仅仅是理论的逻辑结论与经验事实相一致，证伪也不仅仅是理论的逻辑结论与经验事实不一致。我们必须把理论看成是由公理假设、逻辑推导和逻辑结论三个部分构成的有机整体，必须要在概念框架下谈论理论之检验问题。如果局限条件与公理假设相符合，经验事实又与理论的逻辑结论相一致，那么经验事实就证实了理论。如果局限条件与公理假设相符合，但是经验事实却与理论的逻辑结论不一致，那么经验事实就证伪了理论。一旦理论被证实，就不存在被证伪的可能；一旦理论被证伪，就不存在被证实的可能。不可以说理论既存在被证实的可能性，又存在被证伪的可能性。更为一般的情况是，经验事实与理论的逻辑结论不一致，但这是由于局限条件与理论的公理假设不相符合的缘故，并不表明经验事实就证伪了理论，只能说理论不适用于这个（类）现象罢了。也有可能经验事实与理论的逻辑结论相一致，但是局限条件却与理论的公理假设不相符合，这种情况不过是巧合罢了，是不能真正证实理论的。

第七，通常意义上的理论检验，因为只是简单地以理论的逻辑结论与经验事实是否相一致作评价标准，所以是不能对理论提供真正检验的，只能从否定的角度表明特定的理论是不是适合于解释、预测特定的现象和行为。这种“检验”只是、也只能是起到对理论进行区分和筛选的作用——从众多理论中区分和选择出实用的、能够有效解释观察到的现象和有效预测未观察到的现象的理论，分离出那些不实用的、不能够有效解释观察到的现象和有效预测未观察到的现象的理论。这是理论选择问题，不是理论评估问题。我们可以利用“外在一致性”来进行理论检验，但这在一般情况下难以做到。不过理论本身不一定需要通过经验来证明其正确性，理论正确与否完全由“内在一致性”来确定，形式逻辑可以对此给出说明。在经验上，我们真正需要解决的不是理论评估问题，而是理论选择问题。通常意义上的理论检验虽然不能对理论提供真正的检验，但却可以有效解决理论选择问题。

第八，厂商是否追求利润最大化与厂商以怎样的方式实现其最大化的利润不是一回事。前者是对行为主体行为动机的刻画，后者是对行为主体实现其行为动机的方式的刻画。如果我们用正确的方法对利润最大化假设进行检验的话，我们就会发现厂商的确在坚持利润最大化，利润最大化假设的确具有现实性。如果我们正确地看待模型的划分和作用的话，我们就能够正确地认识一个不具有现实性的利润最大化模型的应有功能和作用了。

推荐好友

相关文章

■ 李滨 科学方法论在国际关系研究中的局限性及其背后的意识形态 《世界经济与政治》2004 (2007-1-3)

本站的署名文章均属作者本人的观点。希望转载时，请事先与我们联系。

院首页

网站声明

会员登录

联系我们

下载中心

院图书馆

中国社会科学院世界经济与政治研究所 Copyright (C) 2002-2008 中企动力提供技术支持 请使用 1024\*768分辨率

地址:北京建国门内大街5号 邮编:100732 电话:010-85196063 传真:010-65126180 联系本站

《中华人民共和国电信与信息服务业务经营许可证》编号:京ICP备06059776号