

正确认识经济学理论对于社会经济实践的指导作用*

杨东升

(北京大学中国经济研究中心, 北京 100871)

中国社会科学院农村发展研究所, 北京 100732)

内容提要: 本文作者认为, 经济学理论与社会经济现实之间严格来讲是不一致的, 这种不一致性产生的可能途径有三个: (1)、理论模型的假设条件与社会经济现实的真实约束条件不一致; (2)、理论模型本身与由社会经济现实所决定的潜在的真实模型不一致; (3)、理论模型的内部逻辑不一致。作者进一步论证(2)是引起经济学理论与社会经济现实之间的脱节以及经济政策失灵的深层原因, 并且由于(2)难以从根本上克服, 因此在社会经济实践中对于经济学理论不应抱以迷信的态度。

关键词: 经济学理论 理论模型 稳健性

“我的主要结论是, 看起来同样合理的模型导出的结论却截然相反。”^{[1]85} 杰罗米·斯坦在 1970 年关于货币增长理论的综述的引言部分这样写道。二十年之后我们所得到的支持这一结论的更为充足的理由。”

上面这段话摘译自阿桑那休斯·奥凡尼德斯和罗伯特·索罗 1990 年的论文“货币、通货膨胀与经济增长”^{[2]224}, 其中第二作者为 1987 年诺贝尔经济学奖得主。本文可以看作是对这一结论的一种解释及引申。

引 言

二十世纪给人类留下了两大值得记取的教训: 一是教条照搬照抄“苏联范式”^[3]经济学教科书中的个别论断、个别结论, 把这些论断、结论当作终极真理, 最终导致了前苏联社会主义、共产主义运动的失败; 二是盲目迷信、完全照搬西方经济学家开出的“休克疗法”药方导致前苏联阵营内的大多数国家经济发展出现大规模倒退且长期停滞^{[4]2}。这两起事件虽然跨度超过半个世纪, 且依据的是两种立场、观点基本对立, 研究方法一古典、一现代的经济学理论, 但结果却是一样的: 历史并未按照经济学家事先设计的程序运行, 实践的发展与经济家的理论预期背道而驰。经济学家常说, 经济学不象物理学等自然科学那样, 可以在同等条件下重复实验。但是发生在二十世纪的这两起事件, 无疑是人类历史上两次超大规模的经济学实验^{[4]1}, 而且从某种意义上还可以看作是寻求下面问题的答案所做的重复实验: 即, 我们应该如何认识和对待经济学理论对于社会经济实践的指导作用? 我们首先看一看经济学界对于上述两起事件失败原因的解释。

一、经济学界的解释

关于前苏联模式中央计划经济体制下经济运行效率低下, 经济增长缓慢, 经济理论界给出了多种解释, 主要有:

1、预算软约束说

该观点由匈牙利经济学家科尔耐提出。科尔耐注意到, 在实行中央计划经济的国家, 当

* 本文发表于《经济学家》2006年第2期, 第17-25页。作者E-mail: ydsh301@yahoo.com.cn。

企业因各种原因面临破产时，政府往往会对企业进行扶持，帮助企业度过难关，不让企业破产。政府对企业进行扶持的方式，可以是补贴，也可以是对税收或其它应收款项的减免或推迟，还可以是给予企业不符合条件的贷款等。科尔耐认为，政府对企业的这种基于“父爱主义”的扶持，使企业面临的预算约束“软化”，企业缺乏改进生产效率的积极性，进而导致中央计划经济表现为一种短缺经济^{[5]1806}。科尔耐将中央计划经济中出现的许多问题都归咎于预算软约束。

2、信息非充分说

该观点由英国经济学家哈耶克提出。哈耶克认为，实行中央计划经济的国家的决策者们在进行资源配置等经济决策时，除了需要掌握与决策对象有关的科学理论外，还要掌握做出有效率的决策所需要了解的全部信息。而这些信息在社会成员中的分布是相当零散的，不可能被人数居于绝对少数的决策者全部掌握。哈耶克据此推断，实行中央计划经济的国家，其经济运行必定是低效率的。^{[6]521}

3、违背比较优势说

该观点由我国经济学家林毅夫、蔡昉、李周提出。林毅夫等认为，实行前苏联模式中央计划经济的国家，其政府为了推行“赶超战略”，需要优先发展重工业等资金密集型产业。而这些国家原本属于资金稀缺的落后的农业国，发展资金密集型产业不符合这些国家的比较优势。在自由竞争的市场经济条件下，这些缺乏比较优势的资金密集型产业根本发展不起来。于是政府便选择实行中央计划经济，通过扭曲利率、汇率、价格等手段人为扶持资金密集型产业的发展。由于要素投入价格和产品价格都是国家规定的，无法通过利润指标考核企业经理人员的业绩，同时为了防止经理人员滥用职权，政府便采取统购统销的办法，以产量指标代替利润指标考核企业生产任务的完成情况。因中央计划者无法克服信息不充分问题，在调拨原材料和下达生产任务等方面难免会出差错，企业即使由于自身的原因未完成生产任务，也会将其归咎于政府计划方面的失误；同时政府为了筹集向重工业倾斜所需要的资金而实行的低工资、高福利政策使企业背上了沉重的经济负担，“企业办社会”现象严重，政府难辞其咎，对企业的预算约束必然软化。该观点认为，前苏联模式中央计划经济之所以效率低下，在于其产业发展战略违背了由自身资源禀赋所内生决定的比较优势^{[7]18-54,106-10}。该观点还附带解释了为什么这些国家当初要选择实行中央计划经济，为什么在这些经济中预算软约束盛行，并指出预算软约束并非产生于科尔耐所说的政府对企业的所谓“父爱主义”，而是由于政府对企业的亏损负有难以推卸的责任。

关于“休克疗法”的失败^①，经济学界也给出了许多解释。主要观点有：

1、斯蒂格利兹认为，“休克疗法”的失败不在于“疗法”没有被不折不扣地执行，而在于“疗法”本身的错误。“疗法”过分依赖经济学教科书中的模型。这些模型用于课堂教学很管用，可以使学生很快理解主要经济变量之间的逻辑关系，但不适合用来指导一个国家、一个政府建立市场经济。例如，新古典经济学中的阿罗—德布鲁一般均衡模型虽然表现出了价格在市场经济中的重要作用，但却忽视了信息等因素对于公司治理所起关键作用。设计“休克疗法”的经济学家忽视了信息经济学所揭示出来的一般均衡模型的严重局限性，对市场经济的基础和制度变革过程的理解都是错误的，同时也低估了制度和法律方面的基础结构对于有效率的市场经济所发挥的重要作用。^{[4]3}

2、林毅夫认为，实行前苏联模式中央计划经济的国家出于推行“赶超战略”的需要，优先发展不符合这些国家比较优势的重工业等资金密集型产业。由于所发展的产业缺乏比较优势，在一个开放的、竞争的市场中无法获得正常利润，因而不具备自生能力。而新古典经

^① 指政策处方的实际效果与理论预期之间的背离。

济学理论中有一个暗含的假设,即假设市场经济里的企业都是符合比较优势因而具有自生能力的,这与转型国家的企业不具备自生能力这一事实相矛盾^[8]。当转型国家的政府按照基于新古典经济学理论设计的“休克疗法”将计划经济迅速转为市场经济后,因大部分企业没有自生能力,整个国家经济必然下滑。

3、杨小凯认为,现代经济学的中心是价格制度和资源配置问题,而前苏联改革所涉及的是经济组织演进和体制演进问题,产权制度的变化是核心。用价格理论来回答产权制度问题,当然是牛头不对马嘴。^{[9]168, 169}

二、经济学仍是一门百家争鸣的社会科学

上一节中的观点,虽然从不同角度指出了上述两起事件失败的部分原因,但在笔者看来,所给的解释均有就事论事之嫌。笔者认为,经济学理论模型与真实世界之间难以避免的偏差,以及经济学家和政府决策层对于由这种偏差所导致的经济学理论模型的结论和真实经济运动规律之间的脱节认识不足,并进而导致的对于某些经济学理论甚至提出或解释这些理论的经济学家个人的盲目迷信,是导致上述两起事件失败以及其它政策处方失误的更为本质的原因。

先看“苏联范式”政治经济学。根据樊纲的研究,这套理论其实是上世纪50年代初在斯大林主持下写成的,未必与马克思、恩格斯等人当年构造的经典意义上的马克思主义经济学一致^{[3]71}。但就是这套理论,统治前苏联以及中国经济学界长达数十年之久。人们所做的所谓的经济研究工作,就是引经据典,从教科书中寻找只言片语来佐证自己的主张或驳斥他人的观点。人们对于这套理论的迷信简直达到了无以复加的程度,以至于拒绝吸收马克思之后100多年间世界范围内经济学理论研究的任何进展^{[3]77}。正是由于这种极端的迷信,使得人们不能正视社会主义经济中存在的问题,拒绝学习和借鉴其他经济制度中先进的管理模式和经验,最终导致了前苏联社会主义、共产主义运动的失败。

再看“休克疗法”。上世纪90年代初,前苏联政府邀请一些西方经济学家,请他们出主意、拿办法,把自己的国家由计划经济改为市场经济。这实际上相当于把自己国家的前途和命运交给外国经济学家,由他们把自己的国家改成他们想象中的样子。由此可以看出,前苏联政府对于这些西方经济学家以及他们的理论和政策处方是很迷信的。而这些经济学家对于新古典经济学理论也同样迷信,完全忽视了这些理论所要求的前提条件及理论本身的局限性。双重的迷信最终导致了前苏联改革的失败。

那么我们该如何看待经济学的理论研究成果对社会经济实践的指导作用呢?笔者认为,经济学理论与社会经济现实之间严格来讲是不一致的。这种不一致性产生的可能途径有三个:(1)、理论模型的假设条件与社会经济现实的真实约束条件不一致;(2)、理论模型本身(如模型中的目标函数、效用函数等除假设条件之外的模型的组成部分)与由社会经济现实所决定的潜在的真实模型不一致;(3)、理论模型的内部逻辑不一致(即模型中的逻辑推导有错误或疏漏)。其中(1)和(2),尤其是(2),是引起经济学理论与社会经济现实之间的脱节以及经济政策失灵的根本原因。

学习过高等数学的人都知道,在常微分方程理论中,有相当一部分篇幅用于证明当常微分方程满足一定的条件(主要是李氏条件)时,其解(存在、唯一,且)对于方程中的参数和状态变量的初始值是连续依赖的。这一部分内容对于求解一个具体的常微分方程来说用处不大,但却是常微分方程的理论基础,是常微分方程理论及其算法在实践中能被广泛应用的理论依据。何以如此?原因很简单,因为误差是不可避免的,方程中的参数值和状态变量的初始值总是存在某种程度的测量误差。如果常微分方程的解对于方程中的参数和状态变量的初始值不是连续依赖的,而是有跳跃,方程中的参数或状态变量的初始值的微小误差将会导

致方程的解出现大的跳动，与真实参数和初始值情况下的解相差悬殊。这样，求出来的解由于误差太大而没有什么用处，从而整个常微分方程理论在实践中的可应用性就要大打折扣。因此，常微分方程的解对于方程中的参数和状态变量的初始值的误差所具有的稳健性，是常微分方程生命力的源泉。如果我们从这结论稳健性这一角度去考察经济学理论，就会发现，现代以模型演绎为基础的经济理论，其对于社会经济实践的指导意义，在很大程度上取决于模型的结论是否对于理论模型与社会经济现实之间的偏差具有一定程度的稳健性。

马克思将物质世界的运动形式由简单到复杂分为五类，即：机械运动、物理运动、化学运动、生命运动和社会运动。对于较简单的机械运动和物理运动，我们可以通过重复实验的方法，找出它们的精确的运动规律，再由微分方程的解对于参数和初始值的稳健性，来保证我们关于机械运动的理论和关于物理运动的理论对实践的正确指导作用。例如，人类能够发射宇宙飞船将宇航员送入太空，正是由于我们关于机械运动和物理运动的理论模型和真实的机械运动和物理运动之间是吻合的。在发射宇宙飞船的过程中必然会有参数和初始值之类的微小误差，但是模型的结论对于这类误差是稳健的，只要控制在一定限度内，就不会影响宇宙飞船的成功发射。经济学的研究对象是最为复杂的社会运动，偏偏又难以进行相同条件下的重复实验以找到经济运行的真实规律，因此经济学中的理论模型很难与真实的社会经济运动规律高度吻合，而只能是对经济现实的一种粗糙近似。哈耶克在其诺贝尔经济学奖获奖演说中，将经济学家开出的政策处方的失灵归咎于对物理学研究模式的滥用，即用少数几个变量刻画本质上复杂的（经济）结构(structures of essential complexity)^{[10]4}。科斯在其诺贝尔经济学奖获奖演说中指出，由于经济学研究的高度数学化，造成了在某些研究领域内，理论模型充斥但实证检验极少，“所研究的是经济学家头脑中想象的系统，而不是存在于现实世界中的系统，我将其称为‘黑板上的经济学’。”^{[11]714}由于经济学家的理论模型仅仅是对现实的某种程度的近似，在以近似模型来代替由社会经济运动所决定的真实模型时，模型的结论是否对于由这种近似所蕴涵的模型与模型之间的偏差（而非物理学模型中的参数误差）具有一定程度的稳健性，对于经济学理论对社会经济实践的指导作用至关重要。

遗憾的是，模型的结论对于模型本身的偏差和扰动往往不具有稳健性。例如万有引力模

型 $\mathbf{F}(t) = -G \frac{Mm}{|\mathbf{r}(t)|^3} \mathbf{r}(t)$ ，其中 G 为模型中的参数（万有引力常数）， M 为恒星的质量， m

为环绕该恒星运行的某一行星的质量， \mathbf{F} 为恒星作用在该行星上的引力， \mathbf{r} 为以恒星为起点

的行星的位置矢量。众所周知，由该引力模型结合牛顿第二运动定律 $\mathbf{F}(t) = m \frac{d^2 \mathbf{r}(t)}{dt^2}$ 推导

出的行星的运动轨道是圆锥曲线（椭圆、双曲线或抛物线）。再根据行星绕太阳周而复始地运行从而具有封闭轨道这一经验事实，可以推断出行星的运动轨道是椭圆。但是，模型本身的微小变动却会导致行星运行的理论轨道从定性方面发生根本改变。例如，若将万有引力的

理论模型改为 $\mathbf{F}(t) = -G \frac{Mm}{|\mathbf{r}(t)|^{3+\delta}} \mathbf{r}(t)$ ，其中 δ 为很小的正数。则由于引力变小，此时得

到的行星的理论轨道将是某种形式逸出太阳系，而不再是周而复始的椭圆轨道。

这就是经济学等社会科学与物理学等自然科学的本质不同之处：物理学家可以找到物质运动规律的精确模型，而经济学家只好以近似模型来做替代研究。虽然当代经济学的研究中使用了大量的现代数学方法，甚至朝数学中的公理化方向努力，研究论文中充满了定义、命题、定理、推论，但对其研究结论，即使其假设条件与现实相当一致，因其模型与现实有偏差，而模型的结论对于这种偏差不一定具有稳健性，在用其结论指导社会经济实践时，仍只

能作程度不同的定性参考，而不能当作铁的真理盲目照搬。这一点是被许多数理经济学家所忽视了的，或者虽然知道却无力从根本上予以改变的；这一点也是经济学家不得不长期面对的一个基本事实，是经济学等社会科学与物理学等自然科学的一个基本不同之点。数学模型方法的应用并未从根本上改变经济学作为一门人文社会学科所具有的百家争鸣的基本特征^①。

三、对经济学理论和研究方法发展史的简要回顾

本节对经济学理论和研究方法作一个简要的历史回顾，以从中认识经济学理论和政策相对于复杂的社会经济运动所具有的历史局限性。

经济学，从1776年苏格兰思想家亚当·斯密发表著作《国富论》标志着其作为一门独立学科的诞生算起，到现在已经有两百多年了。在斯密之前，虽先后出现过重商主义、重农主义等经济学说，以及威廉·配第、弗朗斯瓦·魁奈等经济思想家，但限于当时的历史条件，这些经济学说以及这些思想家的经济思想，多局限于分析当时社会经济发展中所出现的具体问题，提出了经济学中的一些基本概念及对一些具体经济问题的粗浅认识。就像牛顿是现代物理学之父一样，斯密无疑是站在巨人的肩上，开创现代经济学科的第一人。在《国富论》中，斯密系统论述了生产和分配理论，并提出了著名的“看不见的手”的思想。这一思想也许是人类有史以来最天才的经济思想，其对于经济学发展的影响之深远，超过了任何其它的经济思想。事实上，迄今为止经济学的发展以及宏观经济学中不同学派之间的争鸣（包括宏观经济学的诞生本身），从某种意义上都可以看作是围绕着证实或质疑“看不见的手”而展开的。

斯密提出“看不见的手”的初衷是反对当时英国因受重商主义影响而盛行的贸易保护主义及其它维护特权阶层利益而损害广大公众利益的政府干预。斯密认为，在国际贸易中一味追求贵金属的贸易盈余损害国民利益，因为一国的国民财富是由该国的经济系统向其国民提供有用的商品和服务的能力来衡量的。

1874年，在瑞士洛桑大学任教的法国经济学家瓦尔拉斯发表论文《交换的数学理论原理》，首次为“看不见的手”构造数学模型——一般均衡模型，该模型后来成为新古典经济学的理论基础。然而，瓦尔拉斯关于一般均衡存在性的数学证明是有缺陷的。一般经济均衡存在性的严格证明于1954年由阿罗和德布鲁最终给出^[12]。一般经济均衡的存在性和福利经济学的两个基本定理给“看不见的手”提供了严格的数学支撑，而且表明斯密所说的由“看不见的手”引导实现的公共利益其实就是帕累托最优。

基于一般均衡理论和福利经济学基本定理的新古典经济学，其政策主张当然是减少政府干预、实行自由贸易、充分发挥市场和自由竞争对有效率的资源配置的作用。虽然新古典经济学理论也承认经济有时会偏离充分就业和对其它生产要素的充分利用，但却认为这种偏离仅仅是暂时的、摩擦性的，价格的自动调整会使经济迅速恢复对生产要素的充分利用，不会出现长时间的萧条和衰退。

然而，正如一般经济均衡存在性的证明有严格的前提条件（主要是凸偏好假设、完全竞争假设及没有外部效果假设）一样，新古典经济学理论也有自身的局限性。1929—1933年，资本主义世界爆发了严重且持久的经济危机，工人失业率长期高达25%以上，市场的自发调节迟迟不能使经济恢复充分就业。新古典主义理论暴露出了明显的缺陷，不仅无法解释长期存在的失业和萧条，而且对此束手无策。

^① 三个经济学家争论，往往会提出四个观点。数学模型方法的应用使经济学家之间的争论由单纯的观点分歧、看法不同向模型选择与设定方面的分歧转化。

现实的困境推动理论的创新。1936年，凯恩斯发表《就业、利息和货币通论》，质疑以“看不见的手”为基础的新古典经济学及其所主张的自由放任的经济政策（*Laissez faire*），学术界称之为“凯恩斯革命”。凯恩斯认为，有效需求的不足是引起经济萧条的根本原因，而且工资和价格水平并不象新古典经济学所认为的那样灵活，因此市场缺乏提高有效需求的自发调节机制，经济运行完全有可能长期保持在低于充分就业的水平上；另一方面，政府可以运用货币政策和财政政策对宏观经济进行调节，以提高总需求，降低失业率，加速经济的复苏。

“凯恩斯革命”使经济学从此分成了两个大的分支：微观经济学和宏观经济学。原来的新古典经济学被归入微观经济学的范畴，而凯恩斯所提出的对经济总量指标（如总产出、利率、失业率、通货膨胀率等）的分析则形成了一个新的经济学分支——宏观经济学。

凯恩斯的理论和政策主张，在第二次世界大战以后被西方的主要资本主义国家广泛采用。上世纪六十年代，资本主义世界几乎所有的宏观经济政策都是基于凯恩斯的理论。在凯恩斯理论和政策的鼎盛时期，经济学界和决策层乃至公众舆论都认为政府的宏观经济政策可以对经济进行很好的调节（fine tune），甚至可以驯服经济的周期性波动。

上世纪七十年代，受石油输出国组织两次大幅度抬高石油和能源价格的影响，资本主义经济出现了由供给冲击引发的两位数的通货膨胀。中央银行依据凯恩斯的理论试图控制通货膨胀的努力又引起了严重的衰退。资本主义经济中出现了一种新型的通货膨胀——“滞胀”——高失业率与高通货膨胀率同时存在。一般情况下，通货膨胀率与失业率之间存在一种此消彼涨的转换关系（trade-off）。经济萧条时期，失业率上升，但通货膨胀率下降甚至出现通货紧缩；反之，在经济快速增长时期，失业率下降但往往伴随着通货膨胀。这种统计上的规律性被总结为菲利普斯曲线。“滞胀”不仅以前没有出现过，而且也超出了凯恩斯主义者的想象。按照凯恩斯的理论，若想抑制通货膨胀，应采用紧缩性的货币政策和财政政策，但这会加剧已经存在的停滞；反之，若想摆脱经济停滞而采用扩张性的货币和财政政策，又会加剧已经严重的通货膨胀。凯恩斯主义理论的这种两难困境招来了对于“凯恩斯革命”的反革命，宏观经济学中又出现了货币主义学派、新古典宏观经济学派和供给学派。

宏观经济学从诞生到现在已经有六十多年了，但对于如何实现经济增长、物价稳定和充分就业，宏观经济学家们的意见还远未一致。宏观经济学中还存在不同的学派，且同一学派内部在不同问题上的观点也不完全一致。对于这种局面，托宾认为，当问题牵扯到政策、政治和意识形态，而且又不能进行可控制条件下的重复实验时，争论是在所难免的。^[13]

由上述对于经济学说史的简要回顾可以看出，(1)、经济学理论都有自身的历史局限性；(2)、经济学中的重大理论突破往往滞后于社会经济实践。常常是一个大的经济事件，引发了其后的理论突破，或可称为“诱致型理论变迁”。这两点其实在很大程度上都是由经济学的研究方法内生决定的。

经济学的研究方法，从形式上看，大致以第二次世界大战为分水岭，分为两个阶段。第一个阶段，即第二次世界大战以前，经济学研究主要以逻辑判断和文字描述为主。在这一阶段，经济学家对数学以及数学模型的态度基本上是怀疑和排斥。第二次世界大战以后，以萨缪尔森等人为代表的一批经济学家大力倡导数学方法在经济学研究的应用。萨缪尔森认为，以冗长的文字描述简单的数学原理，不利于经济学科的进一步发展，并将其形容为“一种被奇特地劣化了的思维体操”^[14]。第二次世界大战临近结束时，经济学理论研究进入了一个高度数学化的时代。据德布鲁的统计，从1969年到1990年的30位诺贝尔经济学奖得主中，有25位是计量经济学会的成员，占83%。^[15]

从实质上看，经济学研究所遵循的是模型内部逻辑一致前提下的逻辑推导，再辅以计量经济学的实证检验。经济学研究之所以采用这样一套模式，是由于经济学不象物理学等自然科学那样可以在相同的条件下做重复实验从而直接找到物质运动所遵循的真实规律或模型，

而只能是先构建理论模型,再由模型内部的逻辑演绎结论是否与经验事实一致来判断理论模型本身是否不被证伪。正是由于经济学理论需要得到经验事实的支持,才导致经济学中的大的理论进展常常滞后于社会经济实践。

数学方法的应用最大限度地保证了模型内部逻辑演绎的一致性。在使用数学模型的情况下,只要有关的数学推导是正确的,模型内部的逻辑就是一致的。若内部逻辑演绎不一致,则任何荒谬的结论都有可能得到。据德布鲁的研究,上世纪三十年代后期发表在《计量经济学杂志》(Econometrica)和《经济研究评论》(Review of Economic Studies)上的论文,若不看其经济解释,单就其中隐含的数学关系而言,很少有经得起严格推敲的^{[15]3}。因此,从保证模型内部逻辑一致性这一角度来看,数学推导相对于纯文字描述的逻辑判断无疑具有优越性。

然而,数学方法的应用也仅仅是保证了模型内部逻辑的一致性。引起经济学理论与社会经济现实之间脱节的另两个重要渠道:模型的假设条件与现实之间的不一致及理论模型本身与现实之间的不一致,并未从根本上得到解决。

经济学不同学派之间以及同一学派内部的理论纷争,往往源于对模型的不同设定。同样的模型,经过数学推导,可以导出同样的结论;模型本身(而不是模型中的参数值)若稍加变动,导出的结论可能就大相径庭。例如,从一般均衡模型出发可以推导出福利经济学第一基本定理,该定理为“看不见的手”的数学版本。该定理断言,在没有外部经济效果的情况下,完全竞争市场的资源配置一定是帕累托最优的。然而,从萨缪尔森's 的交叠世代模型出发,却可以推导出,即使在外部经济效果等扭曲因素的前提下,若没有政府的适当干预,完全竞争均衡时的资源配置也未必是帕累托最优的。^[16]

1987年诺贝尔经济学奖得主罗伯特·索洛认为,试图将经济学构建为一门公理化基础上的硬科学的努力注定是要失败的。因为社会经济是一个非常复杂的系统,而我们又不能针对其特定的组成部分做受控制条件下的实验,甚至不能对这些组成部分做单独的观测,因此我们无法象研究硬科学那样通过实验的方式对相互竞争的经济学假说及模型进行检验,而只能通过对历史统计数据的时间序列做统计分析或计量分析。但这样又会出现一个新的问题:相互竞争的经济学假说之间的差别往往很细微,只有足够长的时间序列才可能将它们区分开来,而且这样的时间序列还应该是在其他条件(基本)不变(*ceteris paribus*)的条件下得到的。然而我们所处的社会经济系统总是处于不停的变化中,制度的、技术的、理念的、风俗的因素一直在变化,有些因素变得快,有些因素变得慢,有些因素变化大,有些因素变化小。因此足够长的时间序列很难满足*ceteris paribus*假设,用统计及计量分析的方法检验相互竞争的经济学假说及模型并非总能行得通^{[17]328}。从而数学及计量分析等方法的应用也难以从根本上解决理论模型与社会经济现实之间的不一致性问题。

除了没有解决理论模型本身与社会经济现实之间的不一致性问题之外,数学方法也没有解决理论模型的假设条件与社会经济现实所受到的真实约束之间的不一致性问题。关于后一种不一致性是否重要,经济学家之间还存在不同的看法。科斯认为,经济学理论的假设条件应当是真实的和易于处理的^{[18]386};而弗里德曼则认为,理论模型的假设条件是否真实无关紧要,竞争性的经济学理论及模型的优劣,应当用理论模型的推论(预言)是否与社会经济现实一致来判断^[19]。笔者认为,对于一个真实的——与物质运动规律吻合的模型(如物理学模型)而言,假设条件直接定义了理论模型的应用前提。违反理论模型的假设条件,仍形式地套用模型的结论,就有可能得到错误的结果。反之,当理论模型(如经济学模型)本身即不真实时,假设条件是否还真实就变得不那么重要了。在《实证经济学方法论》一文中,为了论证理论模型的优劣应当用由它们产生的预言的准确性来衡量,弗里德曼使用了反证法——通过论证理论模型的优劣不能用假设条件的准确性来衡量,来说明理论模型的优劣只能用由它们产生的预言的准确性来衡量。姑且不说这样一种反证法是否妥当,单就弗里德曼对

其所举例子的解释来看就有问题。弗里德曼举了几个例子，其中一个例子是自由落体的运动，另一个例子是树木的生长。在第一个例子中，初始速度为零的自由落体在时间 t 内下落的距离为 $s = \frac{1}{2}gt^2$ ，其中 g 为重力加速度。弗里德曼在这个例子中的理论模型可以表述为：“若（初始速度为零的）自由落体所受到的空气阻力为零（比如在真空管中的自由落体），则其在时间 t 内下落的距离为 $s = \frac{1}{2}gt^2$ 。”该模型的假设条件为“空气阻力为零”，模型本身为“ $s = \frac{1}{2}gt^2$ ”。弗里德曼反问：“每平方英寸 15 磅的气压（海平面附近的气压）所产生的空气阻力，算不算对于假设条件‘空气阻力为零’的显著偏离？”弗里德曼考察从楼顶落下的铅球和羽毛的运动。铅球的运动规律基本符合理论模型的预言“ $t = \sqrt{\frac{2s}{g}}$ ”，其中 t 为铅球落地所用的时间， s 为楼的高度；然而羽毛的运动与模型的预言相差很大。再考察铅球从高度为三万英尺自由下落至两万英尺高度的运动，虽然此时的空气阻力远小于海平面附近的空气阻力，但铅球的运动则与理论模型的预言相差甚远。弗里德曼据此推论：问题“每平方英寸 15 磅的气压所产生的空气阻力，算不算对于假设条件‘空气阻力为零’的显著偏离？”本身就是没有意义的，并进一步推论，理论模型的预言是否准确不能由模型的假设条件是否真实来衡量，理论模型的优劣也不能由假设条件是否更接近于真实情况来衡量。笔者不同意弗里德曼的观点。笔者认为，弗里德曼在此犯了偷换概念的错误。原模型的假设条件是“空气阻力为零”，而不是“空气阻力接近于零”。由于该物理学模型本身是真实的，因此对于假设条件“空气阻力为零”的任何偏离都有可能使模型得出错误的预言。至于“每平方英寸 15 磅的气压所产生的空气阻力，算不算对于假设条件‘空气阻力为零’的显著偏离？”，则完全属于另外一个问题了（事实上，弗里德曼所论证的是：理论模型预言的准确程度与假设条件被偏离的程度之间不存在简单的线性关系或比例关系）。弗里德曼所举的另一个例子是树木的生长。由于植物的生长需要光照，因此树木光照充足的一侧要比背光的一侧更加枝繁叶茂。弗里德曼针对这一现象所提出的理论模型可以表述为：“树木的每一片叶子（好像）都会计算在给定其它叶子的位置的情况下，朝何处生长可以获得更充足的光照，并且根据计算结果朝光照最充足的地方生长。”该理论模型的假设条件为“树木的每一片叶子都会做数学题”，模型本身为“树木的每一片叶子都（根据数学计算的结果）尽力朝光照更充足的地方生长”。弗里德曼认为，尽管该理论模型的假设条件不真实，但并不影响该模型做出正确的预言，并据此论证理论模型的假设条件是否真实无关紧要。笔者认为，该理论模型的假设条件之所以可以不真实而不影响模型的解释能力，是由于模型本身即不真实。事实上，由于植物的生长需要光照（从而光照是树木生产叶子所需要的一种要素投入），因此在其它条件相同的情况下，光照更充足的一侧，树木可以生产出更多的叶子，每一片叶子也可以长得更大，（或许）由此造成了树木光照充足的一侧更加枝繁叶茂，而不是树木的每一片叶子都根据约束优化问题求解的结果尽力朝光照更充足的地方生长。弗里德曼对其观点的论证之所以有缺陷，是由于他忽视了区分模型本身是否真实这一关键问题。

由上面对于经济学理论和研究方法发展史的简要回顾可以看出，不论是经济学理论，还是其研究方法，都有待进一步的完善。因此，在社会经济实践中，对于经济学理论，我们不应抱以迷信的态度。

四、结论：正确认识和对待经济学理论对于社会经济实践的指导作用

由以上的分析可知，在当前和今后相当长的一段时期内，经济学理论和经济学家都不能

胜任为大规模的、疾风暴雨式的、不可逆的经济和社会转型制定稳妥的、切实可行的日程表的任务。在这方面，也许中国经济体制改革的做法最为明智：先做初步的、局部的试验，成功了，再逐步向全局推广；失败了，再另寻他途——小平同志将其形象地比喻为：“摸着石头过河”。中国的渐进式改革道路，犹如医学上某一种疗法推广之前先进行了临床试验，既充分发挥了经济学理论对实践的指导作用，又考虑到了中国的国情，从而避免了南橘北枳之类的不利结果。这样的审慎态度，也许正是我们对待经济学理论和其它社会科学理论所应该持有的科学态度。

经济学是一门致用之学，经济学研究的目的，是找出社会经济发展过程中的一些带有规律性的东西，指导人类的社会经济实践。经济学家都乐于看到自己的研究成果被政府采纳，成为政府制定经济政策时的理论依据；经济学家也乐于充当政府和企业的智囊，为政府和企业制定经济政策和市场发展策略出谋划策。这也是为什么当初前苏联政府邀请一帮西方经济学家为其制定改革方略时，这些经济学家欣然领命，乐于效劳的原因所在。然而，迄今为止关于经济学的研究，都局限于一些具体的理论问题或对理论的实证检验，虽然其中也穿插有一些关于经济学研究方法方面的争论和对某一类研究范式的倡导或批判，但在如何正确认识和对待经济学理论对实践的指导作用这一关键问题上，研究却显得异常薄弱，认识也非常模糊。经济学理论界和政府决策层对这一重要问题的长期忽视，和经济政策的失灵也不无关系。

从历史的角度来看，在人类历史发展的早期，生存条件相对恶劣，人类的生存斗争主要表现为人和自然界之间的斗争。相应地，人类为了改善生存条件、提高生活质量而进行的科学研究活动也主要集中在对自然科学的研究上。随着社会的发展和科学技术的进步，人与自然界之间的矛盾退居于相对次要的地位，而且自然科学研究经费投入的边际收益也开始递减。与此同时，人类社会本身作为一个复杂的矛盾统一体，其自身的社会经济运动对人类福祉的影响越来越大。相应地，社会科学的研究也变得日益重要。可以预计，社会科学研究的经费投入在整个科学研究经费中的比重将会进一步上升，社会科学方面的研究成果也将会被更多地应用于指导人类的社会及经济实践。在此背景下，正确认识和对待经济学理论和其它社会科学理论对人类社会经济实践的指导作用，意义更为重大。

五、后记

在本文即将完成的时候，作者看到了《经济研究》上早已发表的田国强的文章：“现代经济学的基本分析框架与研究方法”^[20]（以下简称“田文”）。“田文”严厉斥责了“批判”以及“否认现代经济学及其研究方法”的行为。笔者认为，笔者的这篇文章并没有“批判”和“否认现代经济学及其研究方法”，而是从一个客观的视角，指出了现代经济学及其研究方法所面临的困境及潜在的缺陷。事实上，“田文”属于方法论方面的介绍，本文则属于认识论方面的探讨，因此本文与“田文”并无矛盾，反倒可以作为“田文”的补充或续篇。与“田文”观点相同，作者个人也认为，现代经济学的研究方法是目前人类能够有效利用的最接近科学、最严谨的研究方法。指出某种研究方法存在的问题与否认该种研究方法及其理论体系是两码事，为了维护某种正统的学术研究范式而无视或否认其潜在的缺陷也不是一种科学的态度。本文中提到的几位诺贝尔经济学奖得主对待经济学以及从事经济学研究过程中所表现出的客观的态度和严谨的学术研究风范是值得学习的。

参考文献：

- [1]Stein, Jerome L. Monetary Growth Theory in Perspective[J]. **American Economic Review** (S0002-8282), 1970, 60 (1): 85-106.
- [2]Athanasios Orphanides, Robert M Solow. Money, Inflation and Growth[C]//Handbook of Monetary Economics. Amsterdam; New York: Distributors for the United States and Canada Elsevier Science Pub. Co., 1990: 223-61.
- [3]樊纲. “苏联范式” 批判[J]. 经济研究, 1995, (10): 70-80.
- [4]Stiglitz, Joseph E. Whither Reform?: Ten Years of the Transition[EB/OL]. New York: World Bank, (1999-04-30)[2006-02-21]. <http://www.comrad.cz/item99a.htm>.
- [5]Kornai, J. Resource-Constrained versus Demand-Constrained Systems[J]. **Econometrica** (S0012-9682), 1979, 47 (4): 801-20.
- [6]Hayek, F A. The Use of Knowledge in Society[J]. **American Economic Review** (S0002-8282), 1945, 35 (4): 519-30.
- [7]林毅夫, 蔡昉, 李周. 中国的奇迹: 发展战略与经济改革[M]. 上海: 上海人民出版社, 1994.
- [8]林毅夫. 自生能力、经济转型与新古典经济学的反思[EB/OL]. 北京: 北京大学中国经济研究中心, (2002-08-15)[2006-02-21]. <http://www.cenet.org.cn/download/7514-1.doc>.
- [9]杨小凯. 中国经济改革的前景[C]//当代经济学与中国经济. 北京: 中国社会科学出版社, 1997: 168-72.
- [10]Hayek, F A. The Pretence of Knowledge[J]. **American Economic Review** (S0002-8282), 1989, 79 (6): 3-7.
- [11]Coase, R H. The Institutional Structure of Production[J]. **American Economic Review** (S0002-8282), 1992, 82 (4): 713-19.
- [12]史树中. 从数理经济学到数理金融学的百年回顾[J]. 科学, 2000, (6): 31-42.
- [13]Tobin, James. An Old Keynesian Counterattacks[C]//Full Employment and Growth. UK: Edward Elgar Publishing Limited, 1996: 17-32.
- [14]Samuelson, Paul A. Foundations of Economic Analysis[M]. Cambridge: Harvard University Press, 1947.
- [15]Debreu, Gerard. The Mathematization of Economic Theory[J]. **American Economic Review** (S0002-8282), 1991, 81 (1): 1-7.
- [16]Samuelson, Paul A. An Exact Consumption-Loan Model of Interest with or without the Social Contrivance of Money[J]. **Journal of Political Economy** (S0022-3808), 1958, 66 (6): 467-82.
- [17]Solow, Robert M. Economic History and Economics[J]. **American Economic Review Papers and Proceedings** (S0002-8282), 1985, 75 (2): 328-31.
- [18]Coase, R H. The Nature of the Firm[J]. **Economica** (S0013-0427), 1937, 4 (16): 386-405.
- [19]Friedman, Milton. The Methodology of Positive Economics[C]//Essays in Positive Economics. Chicago: University of Chicago Press, 1953:1-43.
- [20]田国强. 现代经济学的基本分析框架与研究方法[J]. 经济研究, 2005, (2): 113-25.
- [21]Tobin, James. Current Controversy in Macroeconomics: the Four Schools[C]//Full Employment and Growth. UK: Edward Elgar Publishing Limited, 1996: 33-42.

Correctly Understand the Guidance Role of Economic Theory in Social Economic Practice

Yang Dongsheng

(CCER, Peking University, Beijing 100871;

RDI, Chinese Academy of Social Sciences, Beijing 100732)

Abstract: The author holds that, strictly speaking, economic theories are inconsistent with the social economic practice. The inconsistency may only be resulted from the following three

channels: (1), the inconsistency of the assumptions of the theoretical model with the true constraints of social economic reality; (2), the inconsistency of the theoretical model itself with the underlying true model determined by social economic reality; (3), the inconsistencies that are possibly contained in the logical reasoning process within the theoretical model. The author further argues that (2) is a fundamental source of the inconsistency between economic theory and social economic practice and the failure of economic policies. Since it is hard to overcome (2) completely in economic research activities, so we should not have blind confidence in economic theory in our social economic practice.

Key Terms: Economic Theory; Theoretical Model; Robustness