

现代经济学研究方法的最新进展

Recent Advances of Research Method in Modern Economics

谭克虎

(北方交通大学经济管理学院, 博士生 北京 100044)

来评述现代经济学研究方法的最新进展。

一、引言

不同的读者(学者)对 / 现代经济学的最新发展⁰ 论题理解不同(偏重不一), 如中国社会科学院经济研究所研究员张曙光在 5 中国经济学: 19986 (1999 年由上海人民出版社出版) 一书前言的一部分题为 / 现代经济学的最新发展⁰ (刊登在 5 经济学动态⁶ 1999 年第 8 期) 中从博弈论、社会选择理论、机制设计理论和演化经济学 4 个方面进行了探讨。同年(1998 年 8 月 4 日) 美国前总统克林顿经济顾问委员会主席 Joseph Stiglitz 在中国人民大学作了题为 5 现代经济学的新发展⁶ 的演讲报告(该文由王健平整理, 刊登在 5 经济参考报⁶)。Stiglitz 从信息的不完全性和激励问题、金融问题、金融机构的失灵、政府的作用, 以及政府与市场是互补而不是替代的角度进行了阐述。他的主要目的是出于对宏观、微观日益分离的不满, 试图从信息不完全的角度去把宏观、微观统一起来, 并进一步推销他的畅销书 5 经济学⁶。

笔者认为, 要理解现代经济学的最新发展, 可以从两个方面(理论上, 方法上) 和两条思路(放松假设, 引进新的经济变量) 来解释、理解不断变化发展的世界经济问题。

从理论上讲, 现代经济学的发展可从宏观和微观去展开。宏观经济理论的发展包括全球经济一体化、金融市场的重要性、统一货币问题、经济政策协调, 以及开放经济条件下宏观经济政策的作用等(在这一方面, 以 1999 年诺贝尔经济学奖得主 Robert Mundell 的学术贡献为代表)。微观经济理论的发展包括社会选择理论(以诺贝尔经济学奖得主 K. Arrow, A. Sen 为代表), 产权经济理论(以 Ronald Coase, Douglass North 为代表), 以及人力资本理论等(以 T. W. Schultz, G. Becker 为代表)。

从研究方法上讲, 现代经济学的最新发展包括 4 个方面: 数学化, 数量化, 博弈论在经济学中的应用, 跨学科研究的趋势。本文试图从上述 4 个方面

二、经济学研究方法的最新进展

1. 数学化

自从诺贝尔经济学奖在 1968 年设立、1969 年第一次颁授以来, 到 2000 年已有 46 名经济学家获此殊荣。每年对诺贝尔经济学奖得主学术贡献的认可反映了经济思潮的变化, 揭示了现代主流经济学的变迁。这些经济学奖得主的所在国家的分布为: 美国 30 人、英国 5 人、挪威 3 人、加拿大 2 人、瑞典 2 人、俄罗斯 1 人、法国 1 人、德国 1 人、印度 1 人。这些经济学奖得主的年龄分布为: 51~ 60 岁之间有 9 人、61~ 70 岁之间有 24 人、71~ 80 岁之间有 11 人、80 岁以上有 2 人。获奖时年龄最小的经济学家是 K. Arrow(51 岁获奖, 1972 年), 获奖时年龄最大的经济学家是 William Vickery(82 岁获奖, 1996 年)。从美国情况来看, 获奖 1 人以上的大学有: 芝加哥大学 10 人、加州伯克利分校 3 人、哈佛大学 4 人、麻省理工学院 3 人、斯坦福大学 2 人、普林斯顿大学 2 人。这些经济学奖得主的学术贡献涉及经济学研究的各个领域: 宏观经济计量学、一般均衡理论、发展经济学、投入产出分析、宏观及制度经济学、规范的配置理论、宏观经济学、国际经济学、公共管理科学、产业经济学、国民核算理论、储蓄及金融市场理论、经济及公共决策理论、增长理论、市场均衡及效率理论、金融学、经济及法经济学、微观家庭经济学、经济计量史学、博弈论、信息经济学、福利经济学、微观计量经济学。除 1991 年诺奖得主 R. Coase 通过引入交易成本、产权等概念, 以两篇叙述性论文而获奖外, 其他诺奖得主都是数学高手, 有不少经济学家(如 Nash, Samuelson 等) 还获得了数学博士学位。他们以应用高等数学中的某个理论(领域) 建立某种数学模型而著名, 并且建立的数学模型有从宏观模型到微观计量的趋势, 这反映了人们开始从微观角度去思考宏观经济现象的产生、发展、变化, 同时也反映了经济学家试图弥补自 1936 年凯恩斯革

命以来把微观与宏观经济学截然分开的局面。

另外,从国内外著名经济学杂志来看,如美国经济评论(AER)、政治经济学杂志(JPE)、经济学期刊(QJE)等国际著名经济学杂志中的内容几乎充满数学模型、数学公式,使我国一些文科背景或者说数学知识较少的经济学者想看懂这些文章几乎是不可能的,更不用说要在这类杂志上发表论文了。

所幸,国内知名的国家一级经济学刊物《经济研究》⁶和《数量经济技术经济研究》⁶等已开始注重经济学论文中建立数学模型的要求(虽然其中有些数学模型质量较差),以便构建中国经济学,也便于中国学者与国外经济学家开展学术交流。当然,也由于上述原因,中国经济学者要想获得经济学诺贝尔奖还为期甚远。^[2]

对于经济学的数字化趋势,当前的经济学者基本有两种观点:一种是赞同,理由是数学模型精炼,能刻画经济现象,有助于人们对经济现象的预测;另一种以香港学者张五常为代表持强烈反对态度。张五常认为,经济学过于数字化,则表现为一种黑板经济学,没有生机,玩数字游戏,远离现实世界。他强调经济学思想,认为经济理论的目的在于能解释经济现象。他正着手写一本自认能与亚当·斯密比美的经济学原理)))《经济解释》⁶,几乎不用任何数学。

2. 数量化

数量化趋势可从计量经济学的诞生与发展得到很好的说明。R. Frisch等人于1930年发起并成立了计量经济学会,Joseph Schumpeter为首任会长。计量经济学革命的两大标志主要是美国考尔斯委员会完成的引入精确的概率论框架和建立联立方程组,以及1933年在美国出版《计量经济学杂志》⁶。Jan Tinbergen建立了第一个美国经济的宏观计量模型,其中包含48个方程,并且在很多方程中包括着滞后变量,因而该模型具有动态性质,旨在设法定量明确多个变量的相对重要性,以便检验当时各种商业周期性学说的解释价值。

Wassily Leontief于1931年开始编制美国经济(1919~1929)投入产出表,建立起投入产出分析理论。/二战后L·R·Klein与Godenbag共同构建的/克莱因)戈德伯格模型(1955年)在结构、规模和估算方法上都是现代宏观模型的典范,也是第一个正式用于预测波动的经济计量模型,之后成立了/沃顿经济计量预测模型研究中心⁰,这些模型用于短期预测获得成功。20世纪60年代成为计量经济模型的黄金时代。

进入70年代,经典的计量经济模型没有预测到70年代石油危机而引发的世界性经济衰退,而对于随后的/滞胀⁰也未能开出/药方⁰,导致对经典计量经济学的批判延续至今。经典计量经济模型的基本

缺陷有二:一是主要使用时间序列数据(数量的质量没有保证)或加总数据,缺乏坚实的微观基础,其应用范围相对较少;二是进入70年代以来,人类社会的经济行为与交易也悄然发生变化,如是否愿意工作、职业的选择、个人教育计划乃至移民、交通工具的选择等等。这些微观经济行为的变化导致了宏观经济的相应波动,如,个人交通工具的选择影响对能源的需求和相关产业的调整;个人是否愿意作为劳动力则影响总量劳动力的供给,等等。

微观计量正是通过模型,揭示这些个体、家庭、单个企业的经济行为与交易,评价相关的政策或者实施某项社会保障计划的效果。鉴于此,2000年诺贝尔评奖委员会授予了James Heckman和D·L·McFadden,以表彰他们对微观计量经济学所做的杰出贡献。

总之,数量化趋势表现为计量经济模型由宏观模型计量向微观(数据)计量发展的趋势。

3. 博弈论在经济学中的应用

1994年诺贝尔经济学奖授给了3位博弈论专家纳什(Nash)、泽尔腾(Selten)和海萨尼(Harsanyi),确立了博弈论在主流经济学中的地位。对此,北京大学中国经济研究中心张维迎博士曾以《从1994年诺贝尔经济学奖看主流经济学的新发展》为题加以分析(在《经济科学》⁶1995年第8期连载)。在该文中,张维迎博士说明了授奖给这些人的3个主要原因。第一,博弈论在经济学中的应用最广泛、最成功;博弈论的许多成果也是借助于经济学的例子来发展的,特别是在应用领域。第二,经济学家对博弈论的贡献也越来越大,如克瑞普斯和威尔逊都是对此有突出贡献的经济学家。特别是在动态分析和不完全信息引入博弈论之后对经济学的影响更大。第三,最带根本性意义的原因是,经济学和博弈论的研究模式是一样的,这即是强调个人理性的,也就是在给定的约束条件下追求效用最大化的共性。

博弈论在经济学中的应用还可从国外流行的教科书中看出来,如:Hal Varian的《微观经济分析》⁶在1992年的第三版加上了/博弈论⁰一章,而且有关寡头竞争这一章也按博弈论的理论重写了。Kreps在1990年出版的《微观经济学教程》⁶是1991年最畅销的经济学教科书,被相当多的欧美名牌大学选为研究生课程的教材。其中的第三部分就是/非合作博弈论⁰,共219页,占全书正文的28%多,且书中的许多内容也涉及到博弈论。Jean Tirole在1988年出版了《产业组织理论》⁶一书,内容都是建立在非合作博弈论的基础之上,以至作者不得不在最后加上一章/非合作博弈论⁰。博弈论已经基本上成为产业组织理论中占主导地位的研究方法。

在中国,应用博弈论研究经济学问题最早的是1994年平新乔等在《经济研究》⁶上发表的一篇文章

5/ 三角债0 的博弈理论分析6。1994 年后, 介绍博弈论方面的文章逐渐增多。为扩大博弈论研究方法在中国的传播, 中国社科院 1996 年在杭州商学院举办了首届全国经济对策论的研讨会; 1997 年由中国社科院数量经济与技术经济研究所张守一研究员主持编写了我国第一部现代经济博弈论(对策论)教材, 并于 1998 年由高等教育出版社出版; 1998 年 7 月成立了全国经济对策研究会。之后, 研究会还召开多次研讨会, 大大地深化了人们对经济对策论(博弈论)的认识; 一些主要的经济学刊物如 5 经济研究6、5 数量经济技术经济研究6 也增加了用对策论研究方法研究经济现象的论文。国内还出版了张维迎博士的专著 5 博弈论与信息经济学6, 随后博弈论的专著和译著在中国相继问世, 很多大学还开设了经济博弈论的有关课程。

4. 跨学科的研究方法

新古典经济学在其诞生之日起就与物理学、生物学等自然科学结下了不解之缘, 经济学各学科中采用数理科学和生物学领域的模拟、模型和术语说明社会经济现象已具有悠久的历史。特别是, 经济学中应用物理学的情况更是源远流长, 古典经济学家亚当·斯密曾格外垂青于牛顿力学。著名经济学家 N·G·Roegen 在其代表作 5 熵定律与经济过程6 (1971 年) 对经济学过于力学化有所论述。P. Mirowski 在其代表作 5 热力与光: 作为社会物理学的经济学与作为自然经济学的物理学6 (1989 年) 中认为, 19 世纪 70 年代新古典经济学的起源是与 19 世纪物理学的发展紧密相连的, 两者的关系非常密切, 以至于瓦尔拉等先驱理论家都在该学科的模拟公式化中采用效用论数学。

新古典经济学家试图把经济学建立成类似于物理学、数学一样精密的科学。在此分析框架内, 经济系统被描述成线性的、静态的、确定的、简单的和可逆的。只要具备社会市场经济的几个基本要素, 一个经济系统不论其过去的制度、文化和历史状况如何, 都会迅速地趋向均衡。在经济人假设的条件下, 完全理性、且能获得完全信息的人们能够最大限度地追求自身的利益最大化, 均衡唯一且最优。在这样一副图景下, 市场达到完美均衡, 不会发生意外事件, 且市场上的微小波动即使出现也会迅速消失, 股票市场也会非常稳定。然而这种建立在边际报酬递减假设基础上的新古典理论无法解释 1987 年“黑色星期一”和 1997 年东南亚金融风暴的奇异性; 也无法解释当今世界的贫富差别及贫困的原因; 也无法解释技术的产生、发展、演化及其对经济发展变化的影响。

这种“完美均衡论”受到一些经济学家的责难, 特别是受到了来自分子生物学、脑科学、物理学等领域自然科学家的不断挑战, 因为现实世界是一个

非线性的世界, 经济系统是一个复杂的适应性系统 (complex adaptive system, 简称 CAS)。

20 世纪 80 年代中期, 国际科学界兴起了对复杂性的研究, 一个突出的标志是 1984 年在美国新墨西哥成立了以经济学为切入点以研究复杂性为宗旨的桑塔费研究所 (Santa Fe Institute, 简称 SFI), 这是由诺贝尔物理学奖获得者 M. Gell-mann, P. W. Anderson 和诺贝尔奖经济学奖获得者 K. J. Arrow 为主的一批不同学科领域的著名科学家组织和建立的。旨在开展跨学科、跨领域的研究, 他们称之为“复杂性研究”。他们把经济、生态、免疫系统、胚胎、神经系统以及计算机网络等通称为复杂的适应系统。认为存在某些一般性的规律控制着这些复杂适应性系统的行为。特别是, 在桑塔费研究所最引人注目的成就是以美国斯坦福大学经济学家、SFI 的专职研究员 W. B. Arthur 为项目负责人的经济学项目的研究成果。Arthur 充分吸收了分子生物学领域、脑科学领域、物理学领域(如混沌理论的研究、Lorenz 蝴蝶效应等)的思想及最新成果, 特别是吸收了普利高津的非平衡系统热力学和耗散结构理论, 摒弃了牛顿力学的思维方式, 使经济学研究重新建立在新的哲学和自然科学基础上。他认为, 经济系统是一种非线性、正反馈、路径依赖、具有报酬递增的适应性系统, 不必孤立地去研究每一个报酬递增问题, 因为它们都适合于一般的非线性 Polya 随机过程; 正反馈导致多个可能的均衡点, 而且不能保证从多个可能的均衡中选择出的某一个一定是最优的; 相反, 一旦某个随机偶然的经济事件导致经济过程走上了某一特定路径, 这种选择可能被锁定(lock-in)而放弃另一种更优的选择。

总之, 报酬递增系统的特征是: (1) 多重均衡, (2) 可能存在某种无效率, (3) 锁定, (4) 路径依赖。

目前, 我国国内正兴起复杂性科学的研究热潮。而且, 许多高等院校、科研院所、不同背景的学者都从不同的角度去研究经济学, 取得了许多好的成果。自 1999 年以来, 国家自然科学基金委员会还拨专款资助复杂性科学的研究, 鼓励的研究领域主要包括: 复杂系统的演化、突现、自组织、自适应、自相似的机理研究; 金融避险与经济动力学。中国人民大学还专门成立了经济科学实验室, 旨在借助于计算机科学、信息科学并利用 SWARMO 平台去解释、模拟经济现象, 已取得许多阶段性成果。

总之, 现实经济世界在不断发展变化, 要求经济理论也不断适应这种发展。单一知识背景的理论工作者很难适应这种变化, 必须要求不同学术背景的学者从不同角度参与研究、切实把握经济系统的变化规律。现代的经济学研究方法逐步数学化、数量化, 并引入博弈论, 形成了跨学科综合研究的新

农户专业化: 农业产业化过程中的首要问题

Farmer Specialization Is the Most Important Problem to Be Solved

罗 丹

(中国农业大学经济管理学院 北京 100094)

陈 洁

(中国人民大学农经系 北京 100872)

一、农业产业化是农户专业化分工深化的必然产物, 实质是传统农业变为现代产业的过程

在国外, 并没有“农业产业化”之说; 而国内自“农业产业化”一词提出以来, 引起了许多争论。现在看来, 我国学者绝大多数已经认同了这一提法, 但对农业产业化内涵的界定则存在不同的观点。

从我们收集到的文献资料来看, 对“农业产业化”概念和内涵进行探讨的文章有 20 余篇。其中较有代表性的观点有以下几种: (1) 农业产业化是农业产业链条化、系列化论;^[1] (2) 农业产业化就是农业产业一体化;^[2] (3) 农业产业化是建立一个新型的农业组织方式;^[3] (4) 农业产业化是农业由不是一个典型的现代产业转化为现代产业的过程;^[4] (5) 农业产业化的真正内涵在于, 它是一种能够给有关利益主体带来制度净收益的新型交易方式或非市场制度创新;^[5] (6) 农业产业化是指以某种或某几种产品的生产为龙头, 将产供销不同阶段的服务企业以合同或协议的形式联接起来, 组成一个统一经营的综合体。当前, 对“农业产业化”一词的界定不仅出现在学术性文章中, 官方文件中也对其进行界定。十五届三中全会《决定》中的提法是“农村出现的产业化经营, 不受部门、地区和所有制的限制, 把农产品的生产、加工、销售等环节连成一体, 形成有机结合、相互促进的组织形式和经营机制。”^① 总体来说, 不论上述各种观点存在何种差异, 但都将农业与非农产业的整合作为农业产业化的最基本的内容。以上各种观点其实都是农业与非农产业的一体化的

思想的变形。

但实际上, 农业产业化和农业产业一体化并不是一回事。产业是近代、现代的概念, 是商品经济、市场经济发展的产物。当农民从一个自给性生产者转变为一个商品生产者时, 农业生产向产业转变。传统农业只是一个生产部门, 而不是产业。农业产业化的根本目的不外乎实现农业的现代化与提高农业的效益。而农业产业的一体化经营则是达到这一目的的一种手段。而且, 这种手段并不是随时随地可以有武之地的。发达国家之所以实行农业产业一体化经营, 是因为其具有发达的工业化水平, 具有发达的商品经济和市场条件, 具有现代化农业, 具有完善的各种社会化服务体系,^[6] 但我国还没有这样的基础和条件。当然, 实现农业的一体化经营, 是提高农业效益的有效手段, 也是我国农业的发展方向。

就内涵而言, 农业产业一体化指的是产业系列化, 实际上就是将农工商“捆绑”在一起; 而农业产业化的含义是非常广泛的。除了包含农业产业一体化经营的含义外, 还包括农业经营体制的创新、生产方式的变更等内容, 即是指不仅仅是指农业经营组织的创新, 更多的是农业经营制度的变迁。

农业产业化的过程大致是: 农业生产力水平的提高促进了社会分工的深化, 而社会分工的深化一方面促进了生产的发展, 另一方面当农民进入市场后, 市场法则会引导其转向农业专业化。社会分工越发达, 社会协作也必然越发达。这样, 原有的协作关系或制度安排的协调功能就会弱化或失灵, 并产生了对新的分工协作关系或制度安排的社会需求, 提出了加强农业与其关联产业之间联系与协作或

趋势。

参 考 文 献

[1] 张维迎. 博弈论与信息经济学. 上海人民出版社, 1996

[2] 林毅夫. 经济学研究方法与中国经济学学科发展. 经济研究, 2001(4)

[3] 张曙光. 中国经济学: 1998. 上海人民出版社, 1999 (责任编辑 蔡德诚)