

关于经济学方法论的探讨
——对六组“二律背反”命题的解答
2020/12/27

“二律背反”是十八世纪德国哲学家康德提出来的一个基本哲学概念。它指“双方各自依据普遍承认的原则建立起来的、公认的两个命题之间的矛盾冲突”。在针对经济学方法论的讨论中，这类矛盾似乎特别多。不管是经济学的初学者、资深学者或实践者，都会时不时陷入这样的困惑与争议之中。

今年以来，我陆陆续续在知乎想法发布了一系列我关于经济学方法论的思考，获得了一些反响。我认为，如果对于这些根本性的问题不能有清晰的认识，学习者就容易在间断式的狂热笃信与悲观嫉俗中反复横跳，甚至产生严重的自我怀疑（包括本人曾经在内）。本文选取了经济学领域内六个最具代表性和争议性的“二律背反”命题进行辨析，综合各方的观点，希望能为有类似疑惑的人提供一些有益的视角。当然，本文仅代表个人观点，欢迎大家的理性讨论。

正如康德看来，二律背反产生的根本原因在于人类试图突破超越自己的经验界限去认识物自体本身，我将指出，对于经济学方法论的很多批判根源自人类认知的局限性，并不在于经济学方法论本身。

1.人是理性的，还是非理性的？

经济学中最基本的、受人误解最深的假设就是**理性人假设 (rational agent)**。人是理性的吗？近年来兴起的**行为经济学**用大量的实验证据给出了否定的回答^{[1][2]}，但似乎这并未对主流经济学沿用理性人框架形成任何实质性挑战。为什么会这样？

首先，正如林毅夫[3]所指出的，理性人的框架足够灵活，可以容纳所有的非理性现象。例如，在模型设定中将非理性因素“理性化”。还有很多的非理性行为可以看作是决策主体不可观测的约束条件的动态变化（你视我为非理性，我基于当时当地的条件并不自认非理性）。

从更深的哲学层面来看，理性只是“理念”，是“基准”，而非“知识”。事实上，无论是坚持人是理性还是非理性的群体，都没有足够证据去说服对方自己是百分百正确的。类比于人是否具有自由意志的辩论。我此时此刻从椅子上站起来，你可以用种种自然规律来解释这个行动，如肌肉的紧张度、骨骼的变形等，但不可能否认这个行动是由我的自由意志所决定的。作为科学家，要尽量把所有人的行为都归结为因果必然性，这是科学家的责任所在。但是不是这就能够解释一切了呢？科学家显然不能够解释一切，例如自由意志与因果性的关系，这是在他们视线之外的。自由意志是一种理念，没办法证实，也没办法否定。虽然它在知识的范围内是没用的，但是它在实践的范围内是有用的。

类似地，坚守理性人假设，并不代表所有经济学家认为这是一个真理，而是因为理性为变幻无常的人类行为提供了一个有用的标杆。理性是唯一的，而非理性则有无穷的可能[4]。对经济现象的分析故而可以被简化为对相对于理性基准的偏离的探究[5]，这显然有益于经济学知识的迭代与推进（直至下一次的范式革命[6]）。

2. 经济学的理论假设需要和现实相符，还是不需要？

这又是一个经恒持久的辩题。论点的双方都有地位极高的大咖站台。从正方来看，有科斯[7]、周其仁[8]。从反方来看，有弗里德曼[9]、索洛[10]、鲁宾斯坦[11]。但如果我们对第一个辩题有了答案，那么其实第二个辩题也就自然有了答案。我们还能够发现，两派观点从根本上并不存在矛盾。

首先，假设 (assumption)，根据定义，本身就是不真实的。所以问“一个假设是否真实”就等同于问“一个不真实的东西是否是真实的？”在语义上就不值一驳。

何谓“现实”？“现实”是一个极难把握的概念，它包含有无穷无尽的维度和外延，它是人类知识的极限。在现实生活和研究中，我们只能从理念上对现实这一整体有一个模糊的把握。但是理念既然脱离经验证据，它是不能被看作一种知识的，那么又何来保证自己的假设与现实相符呢？更进一步来说，如果我们做出 100% 符合现实世界的假设，那不也就等同于我们可以 100%完美模拟现实世界的运行，那么理论/模型作为一种对于现实世界复杂性无可奈何的妥协和简化还有存在的意义吗？

其实如果仔细研读过两派的原著，你会发现他们从理念上说没有本质的区别。科斯在其著作中并不反对假设的“易于处理” (manageable)。他反对的只是把“易于处理”作为选择前提性假设的唯一条件，特别是反对为了“易于在经济学上处理”而不惜牺牲前提的真实性。这与索洛所说的敏感性假设 (crucial assumption) ——如果理论结果完全受一条敏感假设所主导，那么只要这个假设可疑，理论就是可疑的——简直是异曲同工。

3. 经济是可以预测的，还是不可预测的？

撒切尔夫人在位期间尖锐地批评经济学家的失职，称其“无法预测经济危机”。时至今日，这样对于经济学家的批评还是可以随处可见。

然而，仔细推敲，“经济”是一个可以准确定义的概念吗？它是 GDP 吗？它是财政收入吗？它是人均收入吗？当我们在说**经济好坏**的时候，是在讨论政府机构收集的**统计数字**，还是在这个世界上**实际产生的经济活动**？然而后者真的是可以用数字**测量并加总**的吗？我相信任何人都很难给出一个确定的回答。所以当我们在说“经济是（不）可以预测”的时候，“经济”作为主语只是一个模糊、不可准确定义的概念，是我们对现实的一个理念，一个模糊的把握。在康德看来，知识只存在于经验世界。对于不可知的对象，我们只能具有“理念”，而“理念”，就类似于“信仰”，是一个理性的“幻觉”。**我们真正能做的只是在具有清晰限定域内的、可测量的经验世界里做出预测——只有这样，判断“经济”是否可预测才是有意义的。**

很多人试图以可预测性强来论证自然科学对于社会科学的优越性。然而确有此事乎？让我们来仔细看一看当我们在评判两者的“可预测性”强弱时，大家容易忽视的、自然科学和社会科学命题中所使用的主语性质的隐晦的变化。当我们谈论自然科学的可预测性时，我们会想到牛顿、爱因斯坦的理论，以及他们提出的清晰直白可供检验的猜想——海王星的存在，光线的偏折等；但当我们谈论社会科学的可预测性时，怎么评判对象突然就忽然变成了模糊的概念——经济周期、与经济危机？

当你认为经济学无法预测出经济危机反映经济学方法论的失败时，我可以把同样的难题抛给自然科学——既然自然科学可以预测原子与分子的运动形式，那么为何不能经由预测原子与分子的运动推演出现实世界的运行，从而预测到经济危机？

其实要害还是在于一个命题是否具有**清晰的限定域**。正如物理学家、化学家可以预测有限范围内原子和分子的变化和反应一样，劳动经济学家可以预测人们的消费对于减税的反应，贸易经济学可以预测进出口对于关税减免的反应，金融经济学家可以预测房价冲击对于 MBS 违约率的影响。**在他们专业所从事的限定领域内，经济学家可以做出很专业、很准确的预测和建议**。就预测经济危机来说，也不乏有很多经济学家终身投入其中，例如，美国金融危机时期的美联储主席伯南克。经济学对于经济危机的预警本身作为信息也进入了宏观经济的运行，而经济系统中的 agent 会对信息做出反映，所有被预警和针对性应对的危机也就不会发生了。宏观里有一个典型事实就是 1980 年代以后现代宏观经济学逐渐建立成熟之后，世界经济的波动性减弱了很多，被称为“the Great Moderation”。这恰恰体现了经济学家的专业性。

在物理学领域，有一个很有名的量子多态理论：More is different[12]。复杂性涌现于简单的规则，即所谓“将万物还原为简单基本定律的能力，并不蕴含从这些定律出发重建整个宇宙的能力”。不同层级的事物之间会产生难以估计的性质的非线性迁跃。“经济”作为一个模糊边界的整体概念，显然属于复杂系统的范畴。复杂系统的预测和建模不论对于各个科学领域都是前沿的、具有挑战性的课题，而并不仅限于经济学领域。经济学目前做不到的，自然科学目前也做不到。

有趣的是，最经常批判经济学家没用的撒切尔夫人和我国的马某人，后来转头都咨询与雇佣了很多的经济学家。时至今日，主流经济学方法论虽然受到全方面的批评却依然屹立不倒，主要在于批评者并未能提供足够有效的替代框架。批评总是简单的，而建设是比较难的。

4. 经济学家“懂”经济，还是“不懂”经济？

社会上充斥着对于经济学家“砖家”的评价。这一方面是由于自诩为“经济学家”这件事情门槛极低，导致整个行业鱼龙混杂，水平参差不齐；另一方面这个行业里的人热衷于跨界发表评论，外行愣充内行。但最重要的原因还在于公众在讨论经济学家的“懂”与“不懂”时对于“懂”的定义常常在不经意间发生了变化。

最常见的嘲讽就是“经济学家啥都懂，就是管不好企业”、“任何一个小学毕业的企业主都比经济学家理解市场”。然而这其实混淆了研究者的知识（declarative knowledge）与行为者的知识（imperative knowledge），等同于说“鸟儿不懂流体力学，但也飞的很好”[13]。人类虽然能理解鸟儿飞行的原理，但自身缺乏能够飞起来的生理条件。经济学家能够理解产业经济的运行规律，但恰恰缺少企业家所需的冒险精神、直觉、领导能力（不然经济学家自己都去创业了，不是吗？）。

每个社会参与者寓于他个人精力和经验，对于社会的理解基本只是树叶、树枝、树木，而不一定见森林。虽然他在长久的实践中进化出了给定环境下的最优决策能力，体现出了一种“智能”（注意非智慧），但不一定能看清整个系统的变动、环境的成因、以及自己在系统中扮演的角色——这种从树叶（细节/碎片/观察）到森林（整体/理论）的过程，就是社科研究者在工作价值所在。

5.经济是过度数学化，还是数学化不足？

首先什么是数学？康德认为，数学是涉及时间、空间的，涉及感性直观的先天形式[14]。数学对于人的认知来说是先验的，但相对地，自然语言却不是。关于经济学家为何诉诸数学语言，克鲁格曼[15]有过非常精彩的论述。早期的发展经济学理论，即被克鲁格曼称之为 High Development Theory，倾向于诉诸于宏大叙事，彼此之间都希望用自然语言下发明新词汇来确立自己思想的原创性，结果确是常常陷入鸡同鸭讲的尴尬境地。因为自然语言的模糊性，很难界定出思想的哪部分源于与已有理论的重叠，哪部分是真正的创新。相反，因为数学是内置于人类认知的先验形式，可以克服这一弊端。

克鲁格曼举例说，经济学家使用的数学模型特别像是地图。地图也做简化，譬如交通图会忽略地面的建筑、地铁路线图会把弯道拉直；地图也做抽象化的处理，有宽度的街道变成了一条细线、奇形怪状的城市变成了一个圆点等等。地图不真实，但是我们都知它有用。有意思的是，正是地图的不真实，让它变得更有用：想找行车路线的人，会上网查谷歌地图，很少有人去查更真实的谷歌卫星照片。经济学家用的模型也是一样的，不求真实、只为有用。

6.经济学理论是一般的，还是特殊的？

这又是一个无解的二律背反的问题。但至少从实践的需要来看，我们应该倾向于理论是一般的。仔细体会下面这句话的内涵：**理论太多了就没有理论了**[16]。这背后的哲学理念是“奥卡姆剃刀”——“如无必要，勿增实体”。用数学的语言来解释，引入过多的“分段函数”是昂贵而无用的，只是权宜之计——它创造了过多的黑箱，带来了过拟合的风险。举一个最极端的例子，假设我有一组同时观测到的个体具有的变量 x_i, y_i ，我想要预测 y_i ，我给每一个个体 i 赋予一个二值变量，那么这会立即将我的预测精度提高到 100%。但这并没有任何的意义，因为一旦我加入一个全新的个体，这个预测系统将彻底无能为力。

为何只有在这个问题上自然科学没有类似的分歧？在我看来，根本原因是自然科学不涉及价值判断，不被立场裹挟——但在社会科学中，这是不可避免的。

致谢

本文的撰写得益于北京大学 2020 年秋季学期徐高博士开设的《中国经济专题》与《中国经济专题讨论课》，以及选课同学启发性、思辨性的讨论。在次特表感谢。

参考

- [1] Daniel Kahneman, 《快思慢想》(Thinking, Fast and Slow), 2012
- [2] Richard H. Thaler, 《赢者的诅咒》(The Winner's Curse : Paradoxes and Anomalies of Economic Life), 2007
- [3] 林毅夫, 《论经济学方法》, 2005
- [4] 徐高, 《宏观经济学二十五讲：中国视角》, 2019
- [5] 许成钢, 《经济学、经济学家与经济学教育》, 2018
- [6] Thomas S. Kuhn, The Structure of Scientific Revolution. 1996
- [7] Ronald Coase, 《企业的性质》(Nature of the Firm), 1937
- [8] 周其仁, 《产权与制度变迁：中国改革的经验研究》, 2004

- [9] Milton Friedman, 《实证经济学方法论》(The Methodology of Positive Economics), 1953
- [10] Robert Solow, A Contribution to the Theory of Economic Growth, Quarterly Journal of Economics,. 1956
- [11] Ariel Rubinstein, Economic Fables, 2012
- [12] Philip W. Anderson, More is Different: Broken Symmetry and the Nature of the Hierarchical Structure of Science, Science, 1972
- [13] 柯荣住, 《经济学与世俗智慧》, 2013
- [14] 邓晓芒, 《康德哲学讲演录》, 2006
- [15] Paul Krugman, The Fall and Rise of Development Economics, 1994
- [16] 张五常, 《思考的方法》, 2014