

## 经济学可以预测未来吗？

张若妍 1800013716 国家发展研究院

A: 正方

B: 反方

M: 主持人与协调者

M: “经济学可以预测未来吗？”——关于这个问题的争论可以追溯到 20 世纪中叶，弗里德曼在《实证经济学方法论》一文中提出检验经济学理论是否科学的唯一标志是将现实与其理论预测进行比较，而经济学能否成为实证科学的重要特征便在于其能否预测未来。随后，以弗里德曼和萨缪尔森为代表的两派经济学家关于经济学的科学特征是解释现实还是预测未来展开了深入的争论。那么在探讨这一问题前，我想先请二位带领我们对历史上的这一争论进行简要的回顾。

A: 正如主持人所讲，弗里德曼的观点与卡尔·波普尔相似，其思想深受科学哲学影响，有着证伪主义的印记——他强调经济学的科学特征在于预测经济现实的未来。而波普尔也指出，可以从逻辑上被反驳、证伪或推翻，而不仅仅是命题可以被证实，才是科学之所以是为科学的关键；即若存在一种可以建议并且为真的理论，那么它仅仅可以提供成功的预测。而由于理论的目标在于对未来进行准确预测，因此判断一个理论是否有效的标准则应当为其预测能力的好坏。

B: 以萨缪尔森为代表的众多经济学家对弗里德曼的观点进行了反对。萨缪尔森的观点是科学是在描述的基础上给出解释，即仅提供描述，而不能进行预测；而依据经济学理论进行逻辑推演得出的结论与现实相一致，该理论则不被证伪，反之则会被修正或摒弃。而英国经济学家罗宾斯也曾早于萨缪尔森发表过相似的观点，即强调必须依靠演绎推理来发掘经济学的基本规律，而经济学的主要功能是进行质的分析，而非预测，这是因为开放的经济系统存在着诸多不确定性。

M: 感谢二位。那么简单来讲，以弗里德曼和萨缪尔森为代表的两派经济学家产生了方法论上的分歧——前者受到实用主义哲学工具主义的影响，即在工具主义者眼中，理论最好应当作为一种工具，我们需要关注的仅仅是这个理论得到结论的有效性，即其预测能力；而后者则经历了操作主义到描述主义的转变，即从强调理论的可操作性，到强调理论对现实的描述和解释。

通过回顾，我们也发现了一些问题——弗里德曼所说的预测到底指什么？在平时谈及“预测”一词时，我们是否区分了预言与科学预测？在明确定义了科学预测（“若 A，则 B”）后，我们又如何确定在何种程度上理论产生准确的预测，

并且这个预测在未来也不会被打破？

在这里也希望二位以此为出发点，又不必局限于此，为我们畅谈想法。

A：首先，提到是否是“科学”，我们便自然地将经济学与最典型的科学——物理学相比较：现在的经济学在愈来愈多地使用数学符号和假设、重视实证、运用实验，这些都是与物理学高度相似的。

给定有如此多的相似之处，法国经济学家阿莱便认为经济现象中的规则性和物理学的规则性同样显然，而通过对现象进行分析，其规则性得以显现，因此经济学基于一种是和物理学同样的普遍原则和方法。

如果说阿莱的论断可能有些许直接或武断，布劳格则认为是现有的经济理论不够完善，导致了目前经济学的预测能力不够强，但我们在发展理论时应当强调对于这种预测能力的提高。

B：其实之前的讨论中我们已经阐述了很多历史上的观点碰撞，我想或许我们不再需要过多地简单罗列大师的观点了。相反，我认为您刚刚的论述距离“经济学能否预测未来”这个问题的关键还差一步：我认可您所讲的经济学与物理学存在诸多相似之处，但我们不可否认的是物理学可以在实验室中保证环境稳定，但经济学却不能避免外生冲击造成的约束变化——当“其他条件不变”这一前提失效时，预测便难免失败；并且经济学的理论与经济现实之间存在着难以避免的相互作用，而这一相互作用则会带来重要的变化。

我可以举几个简单的例子。比如说被预期到的货币冲击对真实经济不会产生影响；又比如行为金融学中发现的投资者的不理性被用于设置特殊的投资组合进行套利后，市场中的这种不理性逐渐消失。也就是说，我们提出一个经济理论，这个理论自身产生的力量通过某种互动，同时作用于系统自身，使得系统发生某种“自我调节或适应”，导致预期结果更可能或更不可能发生，即产生偏移。在这种意义上，预测“某国未来的通货膨胀率”与预期“地球会继续自西向东围绕太阳公转并同时自转”是截然不同的两件事。

以上只是一些经济理论与现实交互的例子，而换一个角度，如果社会历史的发展完全按照固有的逻辑向前发展，那么人在历史中的位置何在？人们应当如何体现自己的自由意志？现有的经济学理论可以很好地将我们对未来现实产生的影响纳入考虑呢？

另外，刚刚您提到了物理学，我想说明的一点是物理学的微观领域也存在着类似的交互作用：即量子领域如果通过物理方式进行测量则会出现“波函数坍缩”。而物理学家波尔在陈述量子力学中的测不准关系时也使用了“在生活的舞台上，我们既是演员又是观众”这一巧妙的比喻来描述观测与实在、学者的行为与现实发展。

A: 其实弗里德曼也承认社会科学不可能进行如自然科学的精准实验,但他认为这是社会科学的特色,并且即使自然科学中也存在无法进行受控实验的分支(如天体物理),因此,他认为实验是否精准受控只是程度上的差别,不能进行受控实验并非以预测作为检验经济学理论的标准阻碍。

此外,我理解您所说的经济理论可能与现实的交互作用,但是不可否认的是,在现实中的确有很多经济学家做出了准确的预测,如邹至庄先生预测中国 1985 年通货膨胀率不超过 9%,又如林毅夫老师对中国经济增长的奇迹进行预测等等。请问这些要如何解释呢?

在我看来,当然不是所有的经济事件都可以被预测,这些经济事件必须要满足一定的条件——一类是遵循基本经济规律的事件;另一类则是可以分析影响因素的作用机制的事件,尽管这些历史事件可能很难被重复。

而进行预测也有以下几种方法。

一是进行规范的定量分析,即经济学家需要选择重要的变量进行参数估计,来衡量其对我们想要观察的因变量的影响。在这里需要假设经济学家选用了准确的数据和合适的模型或计量方法来估计参数,并且在必要时还需要综合考虑来自多个模型的不同预测结果,甚至依据自身的“功力”对预测结果进行一定的调整。二是不规范定性分析法。针对于一些如经济改革的历史上首次出现且难以重复的事件,便很难依赖统计数据与计量模型了。这便需要经济学家利用相似的分析框架,选择正确的变量和机制进行分析。

当然,上述描述或许过于抽象。那么从另一个角度讲,经济预测还可分为基于结构模型的预测和基于统计学方法的预测。前者基于结构模型的预测则可以解决在经济政策发生变动等突发事件下,未来的经济走势会如何,即经济学家会通过结构模型估计一些不会随政策变动的基本参数,通过这些参数来预测新的结果。而后者有如 ARMA、VAR 等时间序列模型,或机器学习中的 LASSO 等,这些方法具有良好的内部有效性,即关于因果效应的统计推断对于所研究的总体来说是有效的。

B: 那我想给出几点回应。

首先,关于您刚刚提到的基于统计学方法的预测具有良好的内部有效性,但我们不应该忽略这些方法的外部有效性可能并不好——统计推断可能很难由所研究的总体与设定推广到其他的总体与设定,包括不同地区的政策、法律甚至物理环境都会产生影响。

其次,您所说的存在着很多预测成功的案例,这其中有着很强的选择偏误问题,即预测正确的情况会更有可能出现在大众视野中,甚至被历史铭记;而一些不正确的或碰运气的预测自然会被淡忘。因此我认为这不能构成“经济学可以预

测未来”的良好证据。

而更严重的是，如果我们只把目标集中于预测的成功之上，那么我们就无法把一些相关而不是具有因果性的解释和成功的预测中的真实性区分开来，这也是对弗里德曼观点的一点批评。比如说在夏天，冰淇淋的销量与溺水人数有着正相关的关系，这是由于气温高导致的，而非二者之间存在因果关系。

A：我明白了，我曾设想的是，无论是通过因果逻辑进行推断，或是仅仅通过大数据发现相关性，进行成功的预测即可。不过我们不能否认大数据预测运用了来源丰富的“全数据”，并且可以进行“现时预测”，具有一定程度上的优势。

而您的意思则是要保证区分开因果的真实预测和其他，区分开真实的预测和“误打误撞”，这样才能保证经济学的健康发展，在未来使用经济学理论来指导实践时才能更为可靠。

B：没错。而您说的仅仅通过大数据发现相关性这是否应当是经济学家的职责我不敢苟同，或许未来的发展方向更应该是使得大数据方法和技术促进经济学的发展；并且大数据的优势是否可以转换为更好的预测力也是一个目前来看颇为模糊的问题，因为大数据预测的思路是归纳法，并不关注因果逻辑，更容易受到“黑天鹅”事件的影响。

不过我想回到“科学”这一讨论之上。经济学目前是实证主义方法论，具有可证伪性，并且应用了理性人范式——但在库恩的意义上，经济学不是完美的科学，因为经济学共同体的内部分歧很大，理性人范式的具体运用分歧也很大。

经济学当然不是自然科学意义上的科学。如姚洋老师所言，好的经济学家不会像标准的教科书上一样从理性假设出发推演构造出一套有关经济运行的理论，而他们是先有了一个好的故事，再试图用严谨的数学语言去描述、证明它。经济学模型和数学理论还是存在着本质区别的——数学是使用了远比经济学复杂的工具，去研究机械性的规律；而经济学需要去面对的则是充满主观能动性的人类。但而今越来越多的经济学家试图用经济逻辑代替摄入的社会、历史或政治分析；或是认为经济理论可以指导实践，并产生实际效果。

然而实际上，经济学在某种意义上更像是解释和复原短期内发生的历史，经济学家使用“科学”的方法论对于已经发生的经济事件进行个人的诠释，努力解释其中的因果关系，最后的结果是经济学理论更多的是片面而深刻，而非全面而流于肤浅。

A：我想我有一点被您说服了。弗里德曼在强调经济学的预测功能时也明确提出了经济学的预测是一个动态过程，它伴随着系统知识的不断发展完善。因为历史上经济的发展是动态的，用动态的经济发展去检验静态理论的预测结果也因此具有很高的不确定性。那是否可以得出结论，由于今天的人们不能预知自己未来能

掌握什么知识，所以只要承认人类的发展受到知识边界不断拓展的影响，那么预测也是不可能的。

B: 的确。并且经济学预测是否“准确”这一概念，与我们选用的评估标准有着直接的关系。弗里德曼所说的预测的范围实际包括尚未发生的现象、已经发生却尚未进行观察的现象，以及已经发生和被观察到但尚未被用来预测的现象——这一定义不仅与萨缪尔森的“解释”有某种程度上的重合，还没有对“预测”的时间维度进行规范。

就像进行天气预测一样，时间愈长、范围愈广，影响因素便愈多；在足够复杂、充满了不确定性的现实世界中，微小如蝴蝶扇动翅膀的扰动也将引起意料之外的结果。而这些人为不可控的情形，往往又被人们归为“偶然”。

而就算我们将“预测”所限定的时间缩短，那么“预测准确”的标准又如何呢？如果预测某个经济体一段时间的经济增长率为 4%，而实际数值为 6%，那这样是否算是预测成功了呢？我想这个问题上可能还没有一个明确的答案。

A: 是的，您刚刚说到的是世界的外在不确定性，而经济活动内部也存在着很强的不确定性——经济活动有趋势性变化和周期性变化，数个不同的周期变化与趋势项叠加在一起。囿于现有的经济知识，我们可能无法准确识别出每个波动，而波峰波谷的叠加又有可能掩盖了经济中发生的故事，使其更难以被识别。

最后，在谈及“预测”一词时，我们如何区分预言与科学预测？二者在定义上很容易被区分（前者包含更多非理性范畴的事情），但是我们在现实中有时又会混淆。

结合您之前的观点，我想经济学所谓的“预测”至少应该发生在可以度量而具有清晰定义的世界中，这个预测的时间范围不能很长，并且需要对预测的对象进行明确的规范。

然而回到我们讨论一开始的问题，即明确定义了科学预测（“若 A，则 B”）后，我们又如何确定在何种程度上理论产生准确的预测，并且这个预测在未来也不会被打破？我在这个问题上感到了一丝悲观。我们现在又应该做些什么呢？是否应当如姚洋老师所建议的，认同经济学与历史研究相似，经济学家也以产生思想为满足，追求写出“美”的文章呢？

B: 于我而言，现有的经济学已经建立起了一套较为完善的认识和分析问题的基本理论框架，即使这一框架或许不能很好地进行经济预测，但它无疑为后人提供了一个良好的判断和发展立场。而我认为，以史为鉴，并且吸收借鉴跨学科的经验也颇为重要，在“经济学帝国主义”之外，来自历史学、社会学、政治学、心理学等的思想，以及来自数学、数据科学的方法，想必也会对经济学的发展大有裨益。

此外,由于我们之前讨论的经济学科的特性,目前在很多问题上尚不存在“当前经济学理解”,或是基于同一问题有着大量观点的交锋;而“解谜”工作在经济学中的意义不如其在自然科学中的,这就意味着我们需要走到实地去,关心真实世界的经济学。从亲自发现问题,到找寻数据、构建理论支撑,哪怕最后发现“知道自己不知道”或“知道自己可能对某些问题(如预测)真的无能为力”也不算徒劳无用。并且在这个过程中,作为思想工作者的我们,用自己的声音努力把国家引向正确的方向,我想不论预测与否,也都有其意义。

毕竟无论如何,经济学所提供的那种系统的、实事求是的思维框架,使得经济学仍然有其用处。

A: 好罢,谢谢与您的交流,您的许多观点确确实实为我打开了新的视角,在某种程度上说服了我。

### 参考文献

- [1] 汪毅霖. 大数据预测与大数据时代的经济学预测〔\*〕[J]. 学术界, 2016, 000(011):77-90.
- [2] 汤吉军. 为什么过去统计数据无法预测未来——兼论经济计量学的局限性[J]. 经济学家, 2016, 5(5):29-36.
- [3] 马涛, 张洋, MA, 等. 经济学的科学特征是预测还是解释——弗里德曼与萨缪尔森相关论争的评析[J]. 上海财经大学学报, 2009.
- [4] 夏春. 经济学家如何进行经济预测? [J]. 中国证券期货, 2016(9):60-63.
- [5] 杜宁华, Du, Ninghua. 经济学实验的内部有效性和外部有效性——与朱富强先生商榷[J]. 学术月刊, 2017, 08(v. 49;No. 579):82-89.