

# 均衡宏观经济学方法论（上）

## 永久收入的消费理论

总需求

$$Z = C + I + G + NX \quad (1)$$

消费函数假定

$$C = c_0 + c_1 Y \quad (2)$$

产品市场出清

$$Z = Y \quad (3)$$

解得 IS 曲线

$$Y = \frac{1}{1 - c_1} (c_0 + I + G + NX) \quad (4)$$

**凯恩斯：有效需求不足，需求决定最终产出。**

**新古典：** $Y = AF(K, L)$

令人沮丧的是，消费函数难以估计。引入**弗里德曼的持久收入假说**permanent income hypothesis进行解释。

消费者关心两期的总效用，可以决定自己的消费占比。

$$\begin{aligned} \max_{c_1, c_2} & u(C_1) + u(C_2) \\ \text{s. t.} & C_1 + C_2 = Y_1 + Y_2 \end{aligned} \quad (5)$$

设立拉格朗日函数

$$\mathcal{L} = u(C_1) + u(C_2) + \lambda(Y_1 + Y_2 - C_1 - C_2) \quad (6)$$

一阶条件为

$$u'(C_1) = \lambda = u'(C_2) \Rightarrow C_1 = C_2 \quad (7)$$

有

$$C_1 = C_2 = \frac{Y_1 + Y_2}{2} = Y^p \quad (8)$$

**消费者的收入决定于自己未来的平均收入预期** $Y^p$

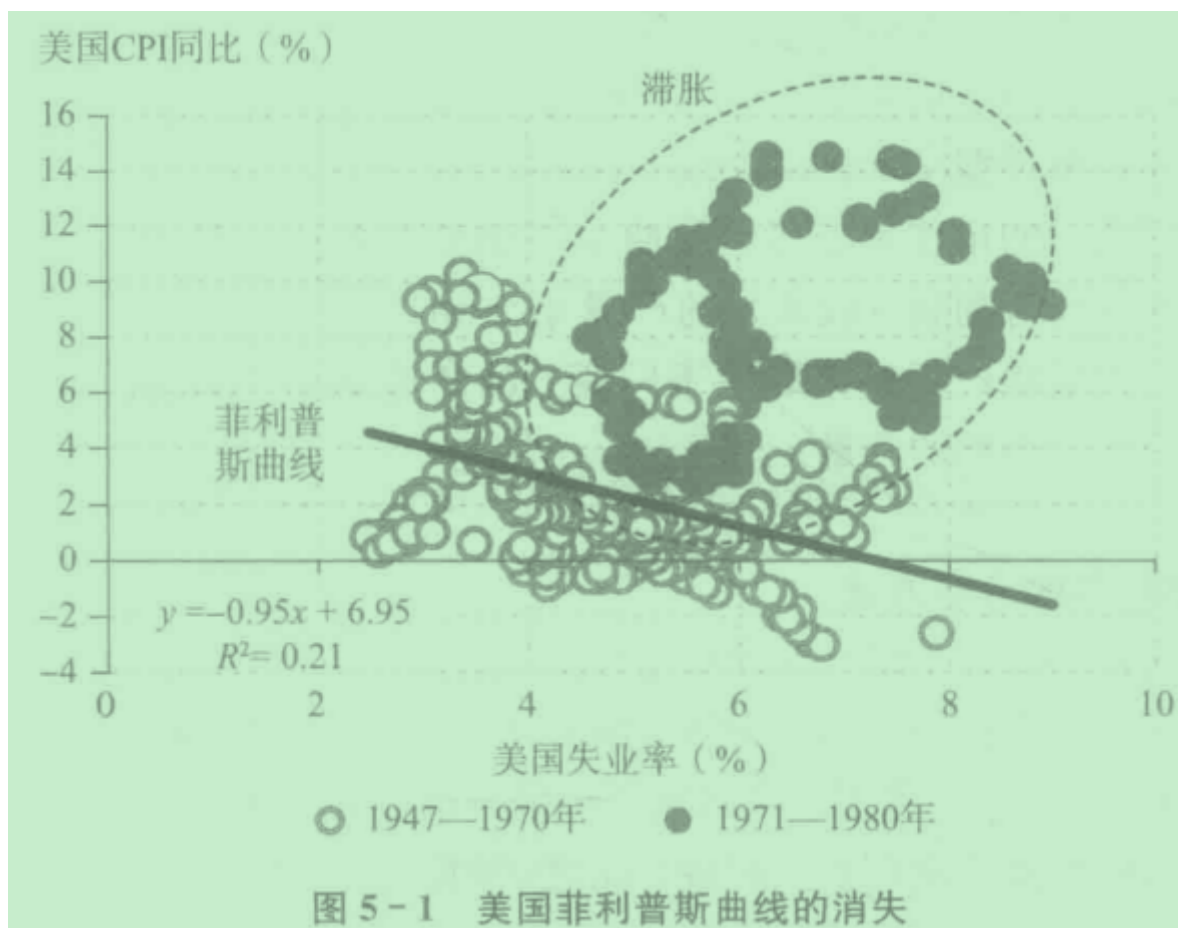
**并且消费者希望自己的消费是平稳的**

也就是说，消费并不是一个取决于当期收入的线性函数，凯恩斯所说的消费函数虽然听上去符合直觉，事实上并不存在。突然失去工作的消费者并不会大幅改变他自己的消费习惯。这也警示着我们，消费者的行为是非常复杂的，菲利普斯曲线的消失就说明了这一点。

## 菲利普斯曲线的消失

Phillips curve 的消失 在1970s掀起了**理性预期革命**rational expectation revolution

也就是高失业低通胀，高通胀低失业的规律被70年代的滞胀stagflation（高通胀高失业）打爆了。



因为在五六十年代，政府没有人为地制造通货膨胀，所以规律才成为规律。通胀时，民众参与工作的热情很高，失业率会降下来。但是当政府有意识地用通胀这把剑的时候，民众开始察觉了，政府只是在印钞。**这是卢卡斯批判（Lucas critique）的内容。用观察到的历史数据之间的数量关系来评价经济政策调整的效果是无效的。如果历史数据用的是高度加总的宏观数据，更是如此。**

就是说，在理性预期革命之前，宏观经济学家对经济的认识是以一种机械的态度，他们认为，宏观决策者可以拿着一本名为“宏观经济操作手册”的小本本，这里捅咕一下，那边折腾折腾，可保机器无虞。

**宏观经济分析的结论不能构建在宏观变量间的数量关系上，因为这些关系都是偶然而易变的。**

于是，把宏观经济分析建立在微观representative agent 的行为上，而微观个体的理性，自利的一些特点是不变的。这就是宏观经济学的微观基础micro-foundation

此处略去双寡头竞争模型的微观分析。

其实理性、自利是一种博弈的筛选过程残留的结果。以下为拓展内容。

行为经济学与非理性

“非理性”并不是任意假设的。只有那些由大量心理学实验所证实的行为偏差才被用作行为经济学的分析起点。之所以要这样，也是因为行为经济学需要避免“非理性”的任意性，因而需要用心理学的研究成果来约束“非理性”的可能形式。事实上，正是因为心理学在近些年确认了一些普遍存在的非理性行为偏差，行为经济学才得以基于这些被确认的非理性行为偏差而发展起来。如果行为偏差是可以任意假设的，那么任何可能的经济现象都可以用某种行为偏差来解释。但这样一来，看似能解释一切的行为经济学其实什么也解释不了。所以，正是行为偏差假设的非任意性，才让行为经济学变得有意义。

更为重要地，行为经济学至今也无法取代构建在理性假设之上的均衡经济学分析。在未来，我也不相信行为经济学能替代后者。原因在于对理性的最优反应是理性，但对非理性的最优反应不是非理性。理性意味着人做到了最好，找到了最优的选择。当我知道我做到了最好时，我当然会继续力争做到最好。所以，当人知道自己是理性的，他会愿意继续理性下去。但是，如果我知道自己因为一些行为偏差而没有做到最好，那么我会怎么做？显然我会力争变得理性，从而做得更好。所以，当不理性的人知道他是不理性的时，他会想变得理性，消除非理性给自己带来的劣势。因此，当行为经济学用作假设的这些非理性行为偏差为人所熟知时，多半也就是这些行为偏差逐步消失的时候。所以，行为经济学的发展有自我打败的倾向。而这是构建在理性假设之上的均衡经济学不会碰到的问题。

## 理性假设的真理辩护

怎样看待构建在理性假设上的经济学？它能否带领我们走向真理，还是仅仅是从一个虚构假设推演出来的无意义的空中楼阁？要回答这个问题，我们需要求助于有关真理的哲学讨论。

判断一个陈述是否为真，我们可以借助三种有关真理的理论。（1）真理的符合论（correspondence theory of truth）：一条陈述为真当且仅当它与事实相符合时；（2）真理的融贯论（coherence theory of truth）：一条陈述为真，是因为它最能与我们的经验和信念构成的整体网络相一致；（3）真理的实用论（pragmatic theory of truth）：一条陈述为真，是因为它最“管用”，即它能让我们更好地行动。

因为怀疑论的发展，也因为德国伟大哲学家伊曼努尔·康德（Immanuel Kant, 1724—1804）所引发的哲学中的“哥白尼式革命”，真理的融贯论和实用论已经在真理判断方面成为更为接受的标准。从融贯论和实用论的角度来看，理性基础上的均衡经济学确实具有真理的成分。毕竟，经济理论与其他学科的研究成果之间具有很高的一致性，并被广泛应用于其他学科的研究。而经济学带给我们认识经济社会、改造经济社会的能力也是不容抹杀的。

在《实证经济学方法论》（1953）这篇著名的文章中，米尔顿·弗里德曼宣称，不能通过比较“假设”与“现实”来检验理论。弗里德曼说：“某一理论是否‘足够’真实这一问题，只有通过考察该理论所产生的预测，对于我们所要解决的问题来说，是不是足够令人满意的，或者是不是比来自其他假说的预测更令人满意来做出回答。”<sup>①</sup>显然，弗里德

## 推荐阅读

在经济学方法论方面，弗里德曼的《实证经济学方法论》是必读的文献（Friedman, 1953）。尽管这篇文章引发了有关假设是否符合现实的激烈讨论，但文章的主要思想还是为大多数经济学家所认可，并成为经济学为理性人假设辩护的重要论辩。对科学研究方法的讨论属于科学哲学的范畴。而谈到理性预期革命，卢卡斯的《经济计量政策评估：一项评论》是相当经典的文献（Lucas, 1975）。

