

现代经济学的基本分析框架与研究方法^{*}

田国强

(上海财经大学经济学院 200433; 美国德克萨斯 A&M 大学)

内容提要: 本文讨论了现代经济学研究人类经济行为和经济现象所采用的基本分析框架和研究方法。一个规范经济理论的分析框架有五个基本组成部分: (1) 界定经济环境; (2) 设定行为假设; (3) 给出制度安排; (4) 选择均衡结果; (5) 进行评估比较。基本研究方法包括提供研究平台、建立参照系、给出度量标尺, 及提供分析工具。本文也讨论了区分充分条件与必要条件的重要性; 正确理解经济理论的作用, 一般性与相对性; 数学在经济学中的作用等。

关键词: 经济学分析框架 研究方法 参照系 分析工具

近些年来, 不时看到有人从研究方法到结论对现代经济学大肆进行批判, 否认现代经济学及其研究方法, 并宣称要创造出自己的经济学。但这些所谓的经济学往往只给出了观点, 既没有明确的前提假设条件和分析框架, 也没有逻辑推理和严格证明; 既拿不出周密可靠的数据做依据, 又不引用基本的经济理论, 随随便便就得出了自己的结论, 并将所谓“自己创新的观点”的作用无限放大。我们不时听到有人耸人听闻地宣称: 自己或某人的理论对现代经济学造成了冲击, 他们往往用中国问题的特殊性来否定现代经济学。

不少人还以为现代经济学的分析框架和研究方法只能用来研究规范市场制度安排下的经济问题, 从而对现代经济学以及它的分析框架和适应范围持怀疑、批判、甚至否定的态度, 认为不能用现代经济学来研究中国经济及其转型问题。这也许是为什么一直到现在“西方经济学”一直是“现代经济学”最流行的代名词。许多人直观地认为, 现代经济学的理论仅适用于“西方”社会。另外, 由于现代经济学存在着各式各样的理论, 许多理论似乎导致了截然不同的结论, 其中不少理论还用到了高深的数学, 这些让不少人感到现代经济学的基本分析框架和研究方法难以把握, 从而对现代经济学产生了误解或畏惧。

笔者以为, 这些观点和说法误导了不少人, 是对现代经济学最基本的分析框架和研究方法没有弄清楚, 不知道现代经济学的分析框架和研究方法具有非常的

普遍性、高度的规范性和逻辑的一致性。并且, 由于相对其他学科, 经济学与经济社会更休戚相关, 甚至会影响到经济政策的制定, 因而非常有必要正本清源, 讨论清楚。

本文结构如下: 第一节讨论掌握现代经济学基本分析框架和研究方法的重要性。第二节介绍现代经济学分析框架的基本组成部分。第三节讨论现代经济学的基本研究方法和所要注意的要点。第四节总结本文, 并给出结束语。

一、掌握现代经济学基本分析框架和研究方法的重要性

经济学是一门研究人类经济行为和经济现象及人们如何进行权衡取舍的学问。正是由于资源的稀缺性与人的欲望的无止境性这一对基本矛盾才产生了经济学, 逼迫人们作出权衡取舍的选择, 用有限的资源最大限度地满足人们的欲望。而现代经济学则按照科学的方法并运用分析工具——通过观察、理论和再观察——来系统地探索人类经济行为和社会经济现象, 从而它是一门科学, 代表了科学的分析框架和研究方法。这种系统探索, 既涉及到理论的形式, 也为经济数据的考察提供了分析工具。

了解并掌握现代经济学的基本分析框架和研究方法, 对正确理解和学好现代经济学以及对现代经济学的创新和应用都十分重要。它能帮助人们正确地运用

^{*} 限于篇幅, 本文在原稿基础上作出了较大的删改, 完全版本可在作者的网站见到。在此感谢(按拼音顺序排列) 艾春荣、白重恩、陈志武、费建平、甘犁、李利明、柳永明、茅于軾、钱颖一、谭国富、王一江、文贯中、周晓娟等人的宝贵批评意见和建议, 使得文章的内容和表达有了很大的改进。

经济学的基本原理和分析方法来研究不同经济环境、不同经济人行为及不同制度安排下的各类经济问题。现代经济学中的不同学派、不同理论本身就说明了现代经济学的分析框架和研究方法的普遍性和一般性。由于不同理论采用了不同的假设和不同的具体模型设定,它们可用来解释不同的经济现象,并能在接近理论假设的各类经济环境下,给出合乎逻辑的结论或进行科学的预测与推断。

经常听到有人批评现代经济学存在着太多不同的经济理论,觉得经济学流派观点各异,不知道孰对孰错,甚至有人借此讽刺经济学家,100个经济学家会有101个不同的观点和说法,从而否认现代经济学及其科学性。其实他们没有弄清楚,正是由于不同的经济、社会、政治环境,才需要发展出不同的经济理论模型和经济制度安排。经济学家之所以对于一个问题会有不同的观点,恰恰说明现代经济学的严谨和完善,因为前提变了,环境变了,结论自然就要相应改变,很少有放之四海而皆准的一般性的“好”结论,否则就不需要因时制宜,因地制宜,具体情况具体分析了。不同的经济、政治、社会环境可以发展出不同的经济理论或经济模型,但决不是不同的“经济学”。

现代经济学的基本分析框架和研究方法是无地域和国家界限的,并不存在独立于他国的经济分析框架和研究方法,现代经济学的某些基本原理、研究方法和分析框架可以用来研究任何经济环境和经济制度安排下的各种经济问题,研究特定地区在特定时间内的经济行为和现象。几乎所有的经济现象和问题都可以通过下面要介绍的基本分析框架和研究方法来进行研究和比较,从而中国实际经济环境下的各种经济问题也可通过现代经济学的分析框架来研究。事实上,这正是现代经济学分析框架的威力和魅力所在:它的精髓是要人们在做研究时必须考虑到,并界定清楚某时某地具体的经济、政治和社会环境条件。现代经济学不仅可以用来研究不同国家和地区、不同风俗和文化的人类行为(无论自私自利与否)下的经济问题和现象,它的基本分析框架和研究方法甚至也可用于研究其他社会现象和人类行为决策。事实证明:由于现代经济学分析框架和研究方法的一般性和规范性,在过去20年,现代经济学的许多分析方法和理论已被延伸到政治学、社会学、人文学科等学科。

二、现代经济学的基本分析框架

现代经济学所研究的问题和解决问题的方式类似于人们处理个人、家庭、经济、政治、社会各类事务时所采用的基本方式。大家知道,要做好一件事情,与人打

交道,首先要了解国情和民风,也就是要知道现实环境和所要打交道人的品行和性格;在此基础上,决定相应的待人处事规则,从而在权衡利弊后作出激励反应,争取达到尽可能最佳的结果;最后对所选择的结果及所采用的规则进行价值判断和评估比较。

现代经济学的基本分析框架和研究方法完全是按照这种方式来研究经济现象、人类行为,以及人们是如何作出权衡取舍选择的。这种分析框架具有高度的规范性和一致性。它首先给出想要研究的问题,或想要解释的某种经济现象,即经济学家首先需要确定研究目标,然后试图回答所要研究或所要解释的问题。比如,下列问题是现代经济学直到现在仍在试图研究或回答的一些问题:为什么会出现经济周期和经济衰退?面对经济周期和经济衰退,政府应采用什么样的宏观经济政策?为什么一些国家非常富裕,同时另外一些国家却非常贫穷,而不是整个世界同时富裕起来?人们生活在其中的市场制度安排是如何运作的,它有什么样的优越性?市场在什么时候会失灵,如何解决?如何解决经济外部性问题,是通过政府干预,通过明晰产权的办法来解决,还是通过其它办法来解决?如何在信息不对称的情况下解决经济人的激励问题?中国经济学家所面临的问题是,如何解决经济制度转型过程中所面临的各种问题,比如:如何改革金融体系和国有企业,如何解决经济效率与公平的两难,以及国有资产流失等问题。

以上这些问题看起来非常不一样,但研究这些问题的基本分析框架却可以是一样的。一个规范经济理论的分析框架基本上由以下五个部分或步骤组成:(1) 界定经济环境;(2) 设定行为假设;(3) 给出制度安排;(4) 选择均衡结果;及(5) 进行评估比较。可以这样认为,任何一篇逻辑清楚、层次分明、论证合理的经济学论文,无论结论如何或是否作者意识到,都基本上由这五部分组成,特别是前四部份。可以说,写经济学方面的论文,就是对这些部分进行具有内在逻辑结构的填空式写作。掌握了这些组成部分,就掌握了现代经济学论文的基本写作方式,更容易学习和研究现代经济学。

1. 界定经济环境

现代经济学分析框架中的首要组成部分,就是对所要研究的问题或对象所处的经济环境(economic environment)作出界定。如前所述,要做好任何一件事,首先要了解国情、所处的周围环境或现实背景。现代经济学在研究问题时也完全如此。在作经济问题研究时要从实际出发,对经济环境进行界定。经济环境通常由经济人、经济人的特征、经济社会制度环境以及信

息结构等组成。对经济环境的界定可分为两个层次：(1) 客观描述经济环境和(2) 精炼刻画经济环境特征。要做好这两点，前者是科学，后者是艺术。对经济环境描述得越清楚、准确，理论结论就会越正确；对经济环境刻画得越精炼和深刻，论证起来就越简单，理论结论也越能让人理解和接受。界定好一个经济环境，就是要将这两个层次有机地结合起来。在现代经济学大多数问题的研究中，经济环境都假定为外生给定的，而不是由理论模型延伸出来的，否则就无法讨论问题，因为总需要将一些经济因素或变量当作参数给定。

描述经济环境：现代经济学中任何一个经济理论，首先需要做的就是，对所研究的对象或问题所处的经济环境作近似地描述。一个合理、有用的经济理论应正确、恰当地描述其研究对象所处的具体经济环境。不同国家和不同地区的经济环境往往存在着差异，从而所得到的理论结论多半会不同。经济问题研究的一个基本共同点就是要对经济环境进行描述。对经济环境描述得越清楚、准确，理论结论就会越正确。

刻画经济环境：在描述经济环境时，一个同等重要的问题是如何做到既清楚、准确地描述了经济环境，又精炼、深刻地刻画了经济环境的特征，使之能抓住所要研究问题的本质。一个现实经济环境包括众多方面，非常复杂。如果把所有情况都统统描述出来，当然可以说是非常准确而真实地描述了现状或经济环境；但是如果只是将环境的所有要素简单罗列，就抓不住重点，或者说，不知道哪些方面对所研究的问题最重要，就会无法看清问题的本质，而让大量繁杂的事实弄晕了头脑。

因此，为了避开细枝末节，把注意力引向最关键、核心的问题，我们需要根据所考虑的问题，对经济环境进行特征化的刻画。例如，在现代微观经济理论中，为了研究经济人的选择问题，一个消费者的经济特征(characteristic)就简单地假定由经济人的消费集、偏好关系(或效用函数)、初始禀赋和信息结构(如考虑不确定性)来描述；一个厂商的经济特征则由它的生产可能性集合或生产函数来表示；所有经济人的经济特征便组成了经济环境。同样，在研究转型国家，如中国经济转型问题时，人们也需要刻画不规范经济制度环境下的经济环境特征。这样，对经济制度环境不规范的转型国家，我们就不能简单地照搬在规范经济环境下所得出的理论结果，而是需要刻画出转型经济的具体特征，并且仍然是采用现代经济学的基本分析框架和研究方法来研究转型经济问题。

人们也许比较容易理解，不同的经济环境可能导致不同的经济理论。但不少人难以理解的是，为什么

即使现实经济环境相同，所要研究的问题相同，还会得出不同的经济理论呢？有些人因此导致了对现代经济学及其研究方法持怀疑，甚至否定的态度。其实，许多经济理论间的结论差异往往是经济学家对经济环境界定的差异所造成的。这种差异不仅可能是客观经济环境上的差异所造成的，而且还可能是由经济学家如何对经济环境进行界定所造成的。如上所述，由于经济环境十分复杂，在许多情况下，经济学不能像自然科学那样只进行描述性分析，还需要对经济环境行为方式进行抽象式的精炼，找出最主要的特征，这往往会让经济学家带有一定程度上的主观判断。不同的主观判断，就会导致对经济环境的不同界定，从而导致了不同的经济理论、经济学派或理论结果。现举两个例子来加以说明。

第一个例子是关于宏观经济学的。宏观经济学中有众多的学派：凯恩斯学派、后凯恩斯学派、理性预期学派(或称为新古典主义学派)、货币主义学派、供给学派和新制度学派等。其实，这些学派之间的对立并不像非经济学家或媒体所渲染的那么大，它们有许多共同之处：基本分析框架相同、研究方法相同(采用经济模型和市场均衡来分析市场)、及对象相同(在市场制度安排下研究宏观经济变量的相互作用关系和变化规律)。它们都相信市场制度，相信从经济运作的长期或总的趋势来说，都会趋向最优的市场均衡，这些理论之间的差异，主要是刻画经济环境时的差异所造成的，特别是对经济系统的冲击或干扰是来自需求方面还是供给方面、关于经济波动的信息是充分的还是不充分的，以及对干扰的时间效应是滞后还是瞬间的等诸多假设之间的差异所造成的。

比如，在回答为什么会经济周期和经济衰退及应制定什么样的宏观经济政策问题时，凯恩斯学派认为关于经济或非经济因素波动的信息是完全的，这种波动主要是来自于需求方面，并且价格在短期内变化极慢，以致这种波动会破坏“最优”市场均衡。为了避免经济周期给整个社会带来的损失，政府应对经济施行干预，使用经济政策，特别是财政政策，对社会总需求进行刺激或控制，从而抵消各种干扰的影响。

而1976年诺贝尔经济学奖得主弗里德曼(Friedman)认为，现实经济中对波动存在“信息不充分”及“时间滞后”效应，使得自身趋于稳定的经济在经过政策调节之后，反而变得更加振荡了，因而政府应对经济尽量减少施行干预，只对货币实行控制，保持不变的货币增长率。而以卢卡斯(R. Lucas)和萨金特(T. Sargent)为代表新古典宏观经济学派在定义经济环境时却假定：波动的“时间滞后”效应只是瞬时现象；并在经

济环境中添加了具有代表性的基本经济单位(厂商和家庭),从而使得整个理论建立在坚实的微观经济理论基础之上;经济活动中基本经济单位所需要的经济信息是不充分的。基于对经济环境的这种界定,并在理性假设下,理性预期学派于是认为,凯恩斯理论没有把公众对政府政策以及其它经济信息的反应考虑进去,人们往往会通过“理性预期”的行为方式,使得政府的经济政策的效果往往事倍功半。因而,政府应该尽量不干预经济,即使在不得不使用政策去干预经济活动时,要注意政策的信誉,即政策的连贯性。卢卡斯于1995年获得诺贝尔经济学奖,新古典现已成为当今宏观经济学的主流。

而刚刚获得2004年诺贝尔经济学奖的基德兰德(F. E. Kydland)和普雷斯科特(E. C. Prescott),也是属于新古典宏观经济学派中的重要人物。他们在1980年代初期提出了真实经济周期理论,他们对经济环境的界定又有些不同。他们假定:宏观经济的波动主要是供给方面引起的;价格和工资在短期也是瞬间发生变化。他们进而认为,经济周期或经济波动是经济对生产技术及生产率变动的自然且有效的反应,技术冲击引起劳动生产率提高,就业、投资和产出也随之提高,总供给曲线上移,经济上涨,反之亦然。他们由此认为,经济周期不是对市场均衡的偏离,而是市场均衡本身暂时的波动,既然是市场均衡,便具有帕累托效率,所以不存在市场失灵,因而政府没有干预经济的必要,货币政策与财政政策尤其是赤字政策一样无效。

这个例子说明了,在一个领域中,即使研究的问题基本相同,但对经济环境的界定不同,也会产生不同的经济理论和经济学派。像自然科学对自然不断地加深认识一样,经济理论的发展在许多时候也是如此,并基于人们对经济环境的不断地认识和重新刻画而不断改进,在前人工作的基础上不断地改进原有理论或提出新的理论。

第二个例子是当今流行的委托代理理论、最优合同理论、拍卖理论及信息经济学。这些理论都认为,在信息不对称的情况下,市场一般会失灵,因而需要设计某种激励机制诱导经济人显示真实信息,从而达到次优结果(the second best)。这些理论中关于经济人的行为假设相同(收益最大化),所研究的问题相同(信息不对称情况下的激励机制设计问题),分析框架基本相同,研究方法相同[提供研究平台,建立参照系;给出完全信息情况下所得到的最佳结果(the first best)]。但由于对经济环境中参与者的经济特征及信息结构界定的不同,导致了不同的理论结果。这些理论中的各种不同结果主要是对经济环境刻画的差异所造成的,特别

是关于经济人的特征及信息结构界定的差异所造成。比如,关于经济人的行动是信息不对称[称之为隐蔽的行动(hidden action)],还是关于经济人的特征是信息不对称[称之为隐蔽的信息(hidden information)];经济人是风险中性,还是风险厌恶;契约或机制是在经济人了解信息之前制定(ex ante),之间制定(interim),还是之后制定(ex post);允许共谋还是不允许共谋(collusion);允许重新谈判还是不允许重新谈判(renegotiation);从经济活动中所得结果的价值是私人价值,共同价值,还是关联价值等方面的差异。

这种研究的好处是,针对经济环境各种特征的刻画,给出不同的最优合同,或激励机制等制度安排。这样,根据现实选择恰当的激励机制。在许多情况下,如何界定和刻画一个经济环境,都是给出一个经济理论或决定经济制度安排最重要的一个步骤和环节。由于米尔利斯(J. Mirrlees)、维克瑞(W. Vickrey)、阿克洛夫(G. Akerlof)、斯宾赛(M. Spence)以及斯蒂格利茨(J. Stiglitz)、在这些领域中作出了开创性的工作,他们分别在1996年和2001年获得了诺贝尔经济学奖。

2. 设定行为假设

现代经济学分析框架中的第二个基本组成部分是对经济人的行为方式做出假设。这个假设至关重要,是经济学的根基。一个经济理论有没有说服力和实用价值,一个经济制度安排或经济政策能不能让经济持续快速地发展,关键看所假定的个人行为是不是真实地反映了大多数人的行为方式。

一般来说,在给定现实环境和游戏规则下,人们将会根据自己的行为方式作出权衡取舍的选择。这样,在决定游戏规则、政策、规章或制度安排时,要考虑到参与者的行为方式并给出正确的判断,看他们是自私自利还是无私利他,是忠厚老实还是老奸巨猾,是讲究诚信还是谎话连篇。面对不同行为方式的参与者,所采用的游戏规则往往不同。如果你所面对的人是一个老实,做事讲诚信的人,你和他处事的方式或者说你针对他的游戏规则将多半会相对简单,不需费什么精力(设计游戏规则)和他处事,游戏规则也许显得不是那么重要。但如果要打交道的人是一个难缠、狡猾、无诚信可言的人,你和他打交道的方式可能会非常的不同,与他相处的游戏规则可能会复杂得多,需要小心对付,并需要花费很大的精力。这样,为了研究人们是如何作出激励反应和权衡取舍的选择,对所涉及人的行为作出正确判断和界定是非常重要的。在研究经济问题时,如研究经济选择,经济变量间的相互作用和它们的变化规律时,确定经济人的行为方式也非常重要。

一个比较合理和现实而又通常被经济学家所采用

的人类行为假设是,人是自利的,即人主要追求自己的利益。“人是自利的”这一人类行为假设是现代经济学中的一个基本假设。利己性假设即使对一个国家、一个民族、一个集体、一个家庭或者一个政治家也是适应的。人们通常所说的,国家有国家的利益,民族有民族的利益,集体有集体的利益,家庭有家庭的利益,讲得就是这个道理。

对人类的利己行为假设不仅必要,符合基本现实,并且更重要的是:即使这一自利行为假设有误,也不会造成严重后果;而相反,如果采用利他性假设,一旦假设有误,所造成的后果要比前者大得多,甚至可能是灾难性的。例如,改革开放前所采用的计划经济体制,强调“一大二公”,否认个人利益,在文革期间甚至宣称要跑步进入共产主义。到文革结束时,中国经济几乎处在崩溃的边缘。之所以出现这种结果,是因为当时的制度安排基于人是利他无私的假设之上的。为什么大多数的国营企业效益低下,就是由于大多数厂长、经理和他们的上级并不是“雷锋式”的人物,他们有着自己的个人利益,即使能找到对付他们的激励或监督机制,其运作机制的交易成本也太大。

其实,对人的行为作出正确判断在日常生活中也是非常重要的,俗话说,“明枪易躲,暗箭难防”,伤害你最深的人往往是欺骗性最强的人——你相信他,他却欺骗你的人,你认为他老实,他其实非常狡猾。只要想一想在现实中将一个行事自私、狡猾的人看作是一个行事简单、一心为公的“老实人”来和他行事处世,将会对你造成的什么样的后果就会明白这种假设错误的严重性。这就是为什么人们往往说,把丑话说在前面,先制定好游戏规则,为什么在现实中我们需要“党纪”、“国法”,需要各种法律和规章制度,比如严格的财务制度,实质上是为了预防个人私欲膨胀!由于不知道什么样的人有私欲,没有严格的财务制度,这些人就会任意拿走公家的财产。

在经济学中,比利己更强的行为假设是人的理性假设,也就是最优化假设:每个人、每个企业都会在给定的约束条件下争取自身的最大利益。尽管理性假设不完全真实,但与现实基本接近,至少从长远来看是如此。比如,作为一个竞争性企业,如果总是不追求利润最大化,终究它就会被淘汰。需要指出的是,由1980年诺贝尔经济学奖获得者西蒙(Herbert Simon)所提出的有限理性假设并不是对理性假设作完全否定,而只是

说明人们有时是健忘的、冲动的、混乱的、有感情的和目光短浅的,不能真正地总是追求其最优目标。尽管如此,有限理性假设仍然是指人的行为接近理性,是较弱的一种利己性假设,在面对这样的主观局限性约束时,人们仍然是权衡取舍,选择尽可能好的结果。

当然,由于有限理性假设与理性假设的差异,经济学家会得出一些不同的理论结果。以前看到国内一些学者,用有限理性这个假设来否定现代经济学,将有限理性假设与理性假设对立起来,认为有限理性假设对现代经济学造成了冲击。其实这是误解。科学总是不断地进步和发展,和理性行为假设一样,有限理性假设也是自利行为假设的一种,只是后者是前者的推广和延拓,后者比前者更一般化。它包括了前者作为一个特殊情况,根本谈不上有限理性否定或者推翻了现代经济学。这就如同爱因斯坦的相对论是牛顿力学的推广和延拓一样,前者比后者更一般化,但不能说爱因斯坦的相对论否定或推翻了牛顿力学。

3. 给出制度安排

现代经济学分析框架中的第三个基本组成部分是给出制度安排,也即游戏规则。对不同的情况,不同的环境,面对不同行为方式的人们,往往需要采取不同的因应对策或游戏规则。当情况及环境发生变化时,所采用的对策或游戏规则多半也会相应地发生变化。游戏规则的决定对做任何事情都非常的重要。不同的游戏规则将导致人们不同的激励反应,不同的权衡取舍结果,从而可能导致非常不同的结果。这对经济学的研究也同样成立,当经济环境确定后,人们需要决定经济上的游戏规则,在经济学中称之为经济制度安排。现代经济学的任何一个理论都要涉及到经济制度安排。现代经济学,特别是最近30年来发展起来的经济机制设计理论、信息经济学、最优合同理论和拍卖理论等,根据不同的经济环境和行为假设,研究并给出大到整个国家、小到二人经济世界的各式各样的经济制度安排,也即经济机制。^①依赖于所讨论的问题,一个经济的制度安排可以是外生给定,也可以是内生决定的。^②

标准的现代经济学主要是研究市场制度安排的。研究在市场制度下人们的权衡取舍选择问题(如消费者理论、厂商理论及一般均衡理论)以及研究在什么样的经济环境下市场均衡存在,并对各种市场结构下

① 经济机制、经济制度安排、经济制度、经济体系这些术语在文献中经常互用。不过,经济体系可能包括面更广,经济制度其次,经济机制包括面最小。赫维兹将经济制度定义为经济机制的集会。在本文中,经济机制等同于经济制度安排。

② 当经济制度安排作为外生给定时,它也看成是经济环境的一部分;当它是内生决定时,它就是典型的制度安排,而不是经济环境的一部分。

的配置结果作出价值判断(判断的标准基于资源配置是否最优、公平等等)。在这些研究中,市场制度安排通常假定是外生给定的。将制度安排作为外生给定的好处是将问题单一化,以便将注意力集中于研究人们的经济行为及人们是如何作出权衡取舍选择的。

当然,对制度安排的外生性假设在许多情况下不尽合理。如前所述,经济制度安排应依赖于经济环境和人的行为方式,不同的经济环境和不同的行为方式应给出不同的制度安排。例如,市场制度在许多情况下会失灵(即不能导致资源的有效配置和市场均衡不存在),这样人们想寻找替代机制,或其它更佳的经济机制,从而我们需要将制度安排看作为内生变量,是由经济环境和人的行为方式决定的。这样,经济学家需要给出各种可供选择的经济制度安排。

当研究一个具体经济组织或单位的经济行为和选择问题时,经济制度安排更应是内生决定的。新制度经济学、经济机制设计理论、转轨经济学、最优合同理论、信息经济学、现代企业理论、委托代理理论等就是研究经济组织及经济制度的设计问题。将经济制度安排作为未定,研究在给定的经济环境下的经济制度安排的最优选择。将经济机制看作内生的好处是,由于经济环境往往在一定时间内是给定的,人们需要给出相应的经济机制,也即制定出相应的游戏规则。那么,在给定经济环境下,人们应该选择什么样的经济机制使之达到所想要达到的目标呢?这正是经济机制设计理论及其分支——最优合同理论和委托代理理论等所想要解决的问题。

4. 选择均衡结果

现代经济学分析框架中的第四个基本组成部分是作出权衡取舍的选择,找出尽可能佳结果。由于做任何一件事往往存在着多种可行方案,这样人们需要作出选择。那么人们是如何作出选择,特别是经济上的选择呢?一旦给定经济环境和经济制度安排(游戏规则)及其它必须遵守的约束条件之后,人们将会根据自己的行为方式作出激励反应,在众多的可行结果中通过权衡取舍来选定结果,称之为均衡结果。有人认为经济学中均衡的概念不好理解,甚至反对采用均衡的概念。其实均衡概念不难理解,它表示在有多种可供选择的情况下,人们需要选定一个结果,这个最终选定的结果就是均衡结果。对利己的人来说,他将选择一个自认为是最有利的结果;对利他的人来说,他可能选定一个有利于他人的结果。

以上所定义的均衡应是经济学中最一般化的均衡定义。它包括了教科书中在自利动机的驱动以及各种技术或预算约束条件下所达到的最优消费、最大利润

生产计划,或最小成本结果均衡,它也包括了从总供给等于总需求条件下所导出市场竞争均衡。它还包括了人们在给定的市场机制下互相作用(如不完全竞争和寡头竞争市场结构下),达到某种均衡状态。以上所给出均衡概念也包括了在有限理性假设下所导出的均衡以及任何给定行为(无论是自利与否)假设条件下所导致的均衡。这样,根据以上对均衡概念的理解,可知有限理性假设根本没有冲击或推翻现代经济学的分析框架和研究方法。

5. 进行评估比较

现代经济学分析框架中的第五个基本组成部分,是对经济制度安排和权衡取舍后所导致的均衡结果进行价值判断和作出评估比较。这有点象在中国,一个人从学校到单位,经常需要对过去一段时间的学习或工作作出总结,与过去进行比较。当经济人作出选择后,人们希望对所导致的均衡结果进行评价,与某种给定的标准(如资源有效配置、资源平等配置、激励相容、信息有效等)进行比较,从而进一步对经济制度安排给出评价和作出优劣的价值判断——判断所采用的经济制度安排是否导致了某些“最优”结果;还要检验理论结果是否与经验现实一致,能否给出正确预测,或具有现实指导意义;最后,对所采用的经济制度和规则作出优劣的结论,从而判断是否能给出改进办法。

在评估一个经济机制或制度安排时,现代经济学通常所采用的一个最重要的评估标志是看这个制度安排是否导致了效率。所谓“效率”,就是用最少的成本,达到最佳效果。

帕累托最优这个概念对任何经济制度都是适用的。尽管帕累托最优标准没有考虑到社会公平问题,但它却从社会效益的角度对一个经济制度给出了资源是否被浪费的一个基本判断标准,从可行性的角度评价了社会经济效果。它意味着如果一个社会资源配置不是有效的,则存在着改进效益的余地。帕累托最优给出了一种判断标准。只要想提高经济效率,人们就应不断地追求,尽量地接近这一目标。因而它是一把标尺。用这个标尺,人们可以比较、衡量和评价现实世界中各式各样经济制度安排的好坏,看它们离这一标准还差多远,从而得知改进经济效益的余地,使资源的配置尽可能接近帕累托最优标准。

当然,帕累托有效是一种理想境界,对一个低效率的经济制度安排,如转型经济过程中的各种临时制度安排,帕累托有效也许是一个太高的标准。于是,退而求其次,在讨论制度的演进时,经济学家往往用帕累托改进这一标准来衡量制度转型的好坏。所谓帕累托改进意味着经济社会中所有人的福利或多或少有所改进。

帕累托改进较弱的要求是社会整体福利得到改进。

尽管现代经济学对平等结果注意较少,但并不意味着现代经济学的基本分析框架不能用来研究如何导致资源平等配置。资源的有效配置与平等配置是两个非常不同的概念,它们代表了不同的价值取向。一般来说,资源的有效配置和平等配置呈现权衡取舍的反向关系。人们通常所指的平等配置是一种绝对平均的概念,没有考虑到个人偏好。由于各人的偏好不一样,把所有的商品平等地分给每一个人虽然看起来公平,但不见得大家都满意。在经济问题的讨论中,人们还用到其他意义下的结果平等概念。例如,每个人都满意自己所得的一份,即不认为别人的比自己的好。以上平等配置的概念也许更合理,因为它们考虑到了个人偏好:人们愿意得到他喜爱的商品组合,而不愿意平等地得到他不喜欢的商品组合。并且,现代微观经济理论(参见笔者的微观经济理论讲义第九章)告诉我们,只要每人的初始禀赋的价值相同,在通常市场均衡存在假设条件下,市场竞争机制将可同时导致帕累托有效和以上所定义的平等配置。这就是说,在理论上,只要有一个公平的竞争起点(政府可以通过税收和给每个国民同等基础教育达到这种起点平等),然后通过市场运作就可以达到既有效率而又公平的的社会结果。笔者认为,这个结果对解决当今社会的越来越大的贫富差别和社会不公,也许有一点现实指导意义。

评估一个经济制度安排好坏的另外一个重要标准就是看它是否激励相容(*incentive compatibility*)。所谓激励相容就是将自利的个人利益和他人的利益统一起来,使得每人在追求其个人利益时,同时也达到了其制度安排设计者所想要达到的目标。由于每个人从所要做的事中获得利益与付出代价,通过对利益和代价的比较,将会对游戏规则作出合理的激励反应。一个好的经济制度安排就是要看它是否给主观为自己的个人以激励,使他们客观为社会而工作。激励相容是一个非常重要的经济概念,在最近30年已成为现代经济学中一个核心概念,是任何经济体制都需要具有的性质。除激励相容之外,还要看运行经济机制的代价,看信息是否有效,有没有较小的制度成本和经济交易成本等。

以上所讨论的五个组成部分可以说基本上是所有规范经济理论一致使用的分析框架,无论其中使用多少数学,无论制度安排是外生给定的还是内生决定的。现举四个例子。

第一个例子是科斯(R·Coase)1960年的著名论文《社会成本问题》(*The Problem of Social Cost*),它几乎没有用到任何数学,完全用文字论述。这篇文章主要研究如何解决经济外部性问题,以此论证产权的界定和

产权的安排在经济交易中的重要性。

为了论证他的论断,他所界定经济环境是一个非常简单的经济环境:只有两个经济人且具有外部效用性。所设定的经济人行为假设为:两个经济人都是自利的,追求个人最大收益。给出的制度安排为:产权明确界定,给任何一方都行,并且双方可以通过自愿谈判来决定合约。于是,科斯通过例子和逻辑分析论证:每个人所选定的结果会使自己的利益最大(选定均衡结果),从而使得外部效应的水平与产权的划分是无关,并且在自愿交易与自愿谈判的情况下,将导致资源的有效配置(作出评估比较)。这样,尽管科斯论文没有用到数学模型,他的分析框架仍然是按照以上五个组成部分进行的。科斯首先讨论了产权制度安排作为外生给定的相对简单情况,然后讨论了产权制度是内生决定的情况。在科斯中性定理中,其结论是外部效应的水平与产权的划分无关,因而制度安排——产权明确界定——在这个命题中是外生给定的。但在科斯有效性定理中,它说的是通过自愿交易与自愿谈判,可找寻到使得所有人利益之和最大的契约(制度)安排,因而制度安排是内生决定的。

由于科斯假设了一个非常简单的经济环境,且只用文字语言讨论问题,没有像用数学模型进行讨论那样清晰,因而一些术语和逻辑分析方面有许多含混不清的地方,使得科斯定理的成立与否存在着很大的讨论空间和许多争议的地方。在许多情况下,科斯定理成立与否依赖于经济环境的界定。例如,除非消费者的效用函数是准线性(*quasi-linear*),科斯中性定理不会成立。要知道准线性效应函数对消费者来说,是施加了一个很强的假设:对具有外部性商品的收入效益为零。不知道这个条件就可能误用这个定理。事实上,赫维兹(Hurwicz,1995)给出了科斯中性定理结论成立的充分必要条件:当交易成本为零及产权明晰界定时,导致有效配置的充分必要条件是效用函数为准线性函数,即具有外部性商品的收入效应一定要为零。

科斯有效性定理的问题更大。如阿罗(Arrow,1979)指出的那样,由于科斯的自愿谈判假设可以被模型为合作型博弈,这要求假定关于经济环境的信息是完全的。当信息不完全或不对称时,一般不能导致资源的有效配置。即使信息是完全的,Aivazian和Callen(1981)证明了,合作博弈的经济核(*economic core*)也许是空集,从而不能导致资源的有效配置。另外,Starrett(1972)论证了,对具有生产的外部性,它本质上可作为生产集的非凸性,一旦如此,有效配置也许不能通过市场机制来达到,理论上可以证明,也许不存在均衡价格来支撑有效配置(即,第二福利经济学定理不成立)。

还有,当经济环境中不只是两人时,如何解决群体行动中固有的搭便车问题。在这种情况下,市场机制可能会失灵,需要设计出某种激励机制,搭便车问题至今仍然是一个没有完全解决的问题。另外,科斯定理还有一些其他的问题,奇普曼(John S. Chipman, 1998)对文献中关于科斯定理的讨论作了一个很好的综述,有兴趣的读者不妨找来看看。总之,关于科斯定理的讨论和争论仍然还在继续中,这种争论和讨论带动了产权理论及组织理论的大大发展。科斯定理意义深远,使得科斯获得1991年度诺贝尔经济学奖。

第二个例子是纳什(Nash)的博弈均衡存在性定理。纳什是一个纯数学家,他在1951年给出了纳什博弈均衡的定义,并给出了纳什均衡存在性的证明。纳什均衡存在性是非合作博弈论的基础。^①从数学原创性及证明的难度来看,这个定理不是太难,只是数学中的不动点定理的应用,但它们成为博弈论的最根本的基础,使得博弈论成为经济学中最重要的分析工具之一,在经济学中有着广泛的应用,它可以用来研究经济人之间相互影响的策略选择问题。由于这些原因,纳什凭这篇论文和1950年关于纳什谈判解的论文获得1994年诺贝尔经济学奖。我们现在来说明,尽管纳什均衡存在性定理是一个纯数学定理,当它赋予经济涵义后,它的分析框架也包含这五个组成部份。经济环境:由所有游戏参与者及其经济特征所组成,这里每个游戏者的行动集、信息结构、收益函数等构成了他的经济特征。行为假设:每个游戏参与者知道其他人的经济特征,并将其他人的策略设为给定,决定自己的策略使之最大化自己的收益。游戏规则:由支付函数或支付矩阵决定,游戏的顺序是同时行动,这里游戏规则是外生给定的。均衡结果:所有游戏参与者的最佳策略组成了均衡策略。评估比较:对纳什均衡解进行评价,看是否达到某种社会最优或按某种标准剔除多余的纳什均衡。纳什的论文在非常一般化的条件下,证明了纳什均衡的存在。由于纳什的均衡存在定理是用数学模型表达的,没有不清楚的地方,不像科斯定理,没有什么争议,为研究经济人的决策互动及其选择建立了一个很好的研究平台。

第三个例子是阿罗-德布鲁(Arrow-Debreu)一般均衡理论,它主要是为了研究竞争的市场均衡。它的一个主要假设,也是新古典经济学的的一个基本假设,将市场制度安排作为外生给定。它的分析框架由这五个部份所组成。经济环境:由消费者和生产者及他们的经济特征和信息结构(如考虑不确定性)所组成,这里消

费者的经济特征定义为消费空间、偏好关系、初始禀赋,生产者的经济特征为生产集。制度安排:私有制下的市场机制,或称为价格机制。行为假设:每个消费者追求效用最大化;每个生产者追求利润最大化;每个人将价格作为给定。均衡结果:消费者在自己预算约束集中,决定偏好最大化的消费组合;生产者在自己的生产可能集中,决定利润最大化的生产计划;市场自我调节决定出所以商品的市场清均衡价格,即对所有的商品,总需求不超过总供给。评估比较:对一般均衡解进行评价和比较。在一般的条件下证明了:每个竞争市场均衡解导致了帕累托最优资源配置(第一福利经济学定理);每个帕累托最优配置结果都可以对初始禀赋的实行再分配,通过市场均衡来达到(第二福利经济学定理)。

第四个例子是赫维兹(Leo Hurwicz)所开创的经济机制设计理论。经济机制设计理论框架是最一般的理论分析框架,可非常清楚看出它的分析框架典型地是由这五个部份所组成。它提供了研究如何从各种经济制度或规则做出选择的一个非常一般化的理论模型和很好的研究平台,几乎所有的经济制度都可以用这个理论框架来描述、研究、评估比较以及进行价值判断。现今具有广泛应用的许多重要理论和分析工具,如委托代理理论和拍卖理论都是经济机制设计理论的子领域。

机制设计者的目标是要设计某种制度安排使之达到某个既定的目标,因而在机制设计理论与一般均衡理论的最大差别之一,是将制度安排作为内生决定的。为此,定义经济环境:由所有参与者及参与者的经济特征所组成,这里每个参与者的配置结果空间、偏好关系、初始禀赋、生产集、信息结构(如考虑不确定性)等构成了参与者的经济特征。行为假设:每个参与者根据自己的行为对机制以及其他人的选择作出激励反应,以此决定自己的策略,使自己的收益最大化。经济机制:由信息空间,决定信息如何交流的反应函数以及如何决定配置结果的函数所组成。均衡结果:所有参与者的最佳策略组成了均衡策略。评估比较:对均衡解进行评价和比较,看是否达到既定的目标,如是否激励相容,是否导致了帕累托最优结果,是否具有最小的机制运行成本等。

三、现代经济学的基本研究方法和注意要点

任何一个经济理论基本上都是由上节五个基本部

^① Nash在1950年的另外一篇论文给出了纳什谈判解的定义,它是合作博弈论的基础。

分组成的。对这五个部分的讨论自然会引申到如何按科学的研究方法将它们有机地结合起来,并且可以逐步深入地研究各种经济现象,发展出新的经济理论。这就是本节要讨论的现代经济学中通常所采用的一些基本研究方法和注意要点。它包括提供研究平台,建立参照系,给出度量标尺,提供分析工具,注意经济理论的适应范围,区分充分条件和必要条件的重要性,以及弄清数学与现代经济学的关系等。

1. 研究平台、参照系和度量标尺

现代经济学的研究方法是,首先提供各种层次和方面的基本研究平台、建立“参照系”,从而给出度量均衡结果和决定制度安排优劣的度量标尺。提供研究平台和建立参照系对任何学科的建立和发展都极为重要,经济学也不例外。提供研究平台和建立参照系有利于:(1) 简化问题,抓住问题特征;(2) 建立评估理论模型和理解现实的标尺,以及(3) 理论创新。

研究平台:现代经济学中的研究平台是由一些基本的经济理论或原理组成,它们为更深入的分析打下了基础。现代经济学的研究方法类似于物理学的方法,即先将问题简化,抓住问题的核心部分。当有众多因素形成某种经济现象时,我们需要弄清每个因素的影响程度。这可以通过假定其它因素不变,研究其中某个因素对经济现象的影响来做到。现代经济学的理论基础是现代微观经济学,而微观经济学中最基础的理论是个人选择理论——消费者理论和厂商理论。它们是现代经济学中最基本的研究平台或奠基石。这就是为什么所有的现代经济学教科书基本上都是从讨论消费者理论和厂商理论着手的。它们为个人作为消费者和厂商如何作出选择给出了基本的理论,并且为更深入地研究个人选择问题提供了最基本的研究平台。

一般来说,个人的均衡选择不仅依赖于自己的选择,而且也依赖于其他人的选择。为了研究个人的选择问题,首先要弄清楚个人选择在不受他人影响时是如何作出决策的。现代微观经济学中标准的消费者理论与厂商理论就是按照这样的研究方法得到的。在这些理论模型中,经济人被假定处于完全竞争的市场制度安排中。这样,每人都把价格作为参数给定,个人选择不受他人选择影响,并且每个人的效用或收益只依赖于自己的选择,而不依赖于他人的选择。

刚开始学现代经济学的人往往会对这种研究方法感到不解,认为这种简单情况离现实太远,理论中的假设和现实太不相吻合,从而认为现代经济学理论没有什么用。其实,这样的批评表明这些人对科学的研究方法还没有什么理解。这种将问题简化或理想化的研

究方法为更深入的研究建立了一个最基本的研究平台。这就像物理学科一样,为了研究一个问题,先抓住最本质的东西,从最简单的情况研究着手,然后再逐步深入,考虑更一般和更复杂的情况。微观经济学中关于垄断、寡头、垄断竞争等市场结构的理论就是在更一般情况下——厂商间相互影响下——所给出的理论。为了研究经济人相互影响决策这更一般情况下的选择问题,经济学家同时也发展出博弈论这一有力的分析工具。

一般均衡理论是基于消费者理论和厂商理论之上,属于更高层次的研究平台。消费者理论和厂商理论为研究在各种情况下的个人选择问题提供了基本的研究平台,一般均衡理论则为研究在各种情况下所有商品的市场互动,如何达到市场均衡提供了一个基本的研究平台。而最近30年发展起来的机制设计理论又是更高层次的研究平台,它为研究、设计和比较各种经济制度安排或经济机制(无论是公有制,私有制,还是混合所有制)提供了一个研究平台,它可以用来研究和证明完全竞争市场机制在配置资源和利用信息方面的最优性及唯一性。

参照系或基准点:参照系或基准点指的是理想状态下的标准经济学模型,它导致了理想的结果,如资源有效配置等。参照系是一面镜子,让你看到各种理论模型或现实经济制度与理想状态之间的距离。一般均衡理论就提供了这样一种参照系。将完全竞争市场作为参照系,人们可以研究一般均衡理论中假设不成立(信息不完全,不完全竞争,具有外部性,非凸的生产集、不规范经济环境等),但也许更合乎实际的经济制度安排(比如具有垄断性质或转型过程中的经济制度安排),然后将所得的结果与导致了资源有效配置的竞争市场均衡进行比较。

通过与完全竞争市场这一参照系相比较,人们就可以知道一个(无论是理论或现实采用的)经济制度安排在资源配置和信息利用的效率方面的好坏,以及现实当中所采用的经济制度安排与理想的竞争市场机制相差多远,并且提供相应的经济政策。例如,宏观经济学中的凯恩斯学派、后凯恩斯学派、新古典主义学派、货币主义学派等都是以一一般均衡理论作为参照系,来研究宏观经济变量的相互作用关系和变化规律,讨论和辩论这些宏观经济理论和学派的优劣,评价所给出的经济政策的有效性,从而改进这些理论,给出更有效的经济政策建议,甚至发展出新的理论学派。这样,一般均衡理论也为衡量现实中所采用的制度安排和给出的经济政策的好坏建立了一个标尺。如钱颖一教授所指出的那样,除了一般均衡理论,产权理论中无交易成

本和无收入效应的科斯定理,以及公司财务理论中的莫迪利安尼-米勒定理等也都被经济学家用作他们分析的基准点或参照系。

度量标尺:尽管作为参照系的经济理论可能有许多假定与现实不符,但是它们却非常有用,是用来作进一步分析的参照系。建立经济学中的参照系就像生活中树立榜样一样的重要,它们是建立评估理论模型和理解现实的标尺。这些参照系本身的重要性并不在于它们是否准确无误地描述了现实,而在于建立了一些让人们更好地理解现实的标尺,为进一步为解释现实的理论提供基准点或参照系。

2. 分析工具

对经济现象和经济行为的研究,光有分析框架、研究平台、参照系和度量标尺还不够,还需要有分析工具。现代经济学不仅需要定性分析,也需要定量分析,需要界定每个理论成立的边界条件,使得理论不会被滥用。这样,需要提供一系列强有力的“分析工具”,它们多是数学模型,但也有的是由图解给出。这种工具的力量在于用较为简明的图象和数学结构帮助我们深入分析纷繁错综的经济行为和现象。比如,需求供给图像模型,博弈论,研究信息不对称的委托-代理理论,动态最优理论等。钱颖一教授还指出了另外一些具有分析工具的经济模型。由于钱颖一对这些分析工具的作用作了较具体的介绍,笔者在这里就不多讨论了。当然,也有不用“分析工具”的,如科斯定理,只用语言和基本逻辑推理来建立和论证所给出的经济理论。

3. 经济理论的作用、一般性与相对性

经济理论的作用:经济理论至少有三个作用。第一个作用是,它能够用来解释现实中的经济现象和经济行为,这是现代经济学主要讨论的内容。第二个作用是,它能够对给定的现实经济环境、经济人行为方式及经济制度安排下所可能导致的结果作出科学的预测和推断,并指导解决现实经济问题,这个作用也许更重要。只要理论模型中的前提假设条件大致满足,它就能得出科学的逻辑结论并据此作出科学、正确的预测和推断,而不一定需要实验就能知道最终结果。例如,哈耶克关于计划经济不可行的理论就有这样的洞察力。

一个好的理论不用实验也能推断出最终结果。这在很大的程度上解决了经济学不能拿社会作实验的问题。人们需要做的只是检验经济环境和行为方式等方面的假设是否合理(近些年来非常热门的实验经济学主要就是从事检验经济人的行为方式假设等理论基础性方面的研究)。例如,社会不允许为了研究通货膨胀

和失业率的关系,而乱发货币。像天文学家和进化论生物学家一样,经济学家大多时候只能利用世界碰巧向他们提供的数据来发展理论和检验理论。第三个作用是,许多理论上的不可能性结果可以用来避免实施许多现实中不可行的目标和项目。这是因为如果一个结论在理论上不能成立,只要理论的前提假设条件符合现实,这个结果在现实中也一定不可能成立。

经济理论的一般性:从以上对现代经济学的基本框架的讨论可以看出,经济学中每一个理论或一个模型都是由一组关于经济环境、行为方式,制度安排的前提假设以及由此得出的结论所组成的。一个理论的前提假设条件越一般化,理论的作用和指导意义就会越大。如果一个理论的前提假设条件太强,它就没有一般性,这样的理论也就没有什么用处。这样,成为一个好的理论的必要条件就是它要有一般性,越具有一般性,解释能力就会越强,就越有用。一般均衡理论就具有这样的特点,它在非常一般的偏好关系及生产技术条件下,证明了竞争均衡存在并且导致了资源的最优配置。

经济理论的相对性:在希望一个理论具有更大一般性的同时,也必须要注意到它的适应范围、边界以及局限性。这样在应用一个经济理论时便可避免犯两种错误。第一种错误是高估理论的作用。经济学中的所有假设与结论基本上都不是绝对的,而是相对的。无论一个理论多么一般化,它只是相对正确,并且有它一定的局限性和适应的范围。在讨论问题和运用某些经济学原理时,要注意这些原理后面的前提假设条件和它的适应范围,不能泛用,否则就会得出错误的结论。记住了定理的边界条件,你就不会轻易地下结论,否则就会误用某个定理,像误用科斯定理,弄不好会带来重大政策失误,如俄罗斯激进的私有化产权改革。

许多人,包括许多经济学家忘掉了这一点,他们往往把自己的结果或某个原理的作用无限扩大,结果使本来是有新意或正确的东西成为错误结论或误用。张五常教授经常将现代经济学的一两个经济学原理的作用绝对化,将其无限扩大,而不太考虑理论后面的基本假设;不了解现代经济学的发展就随意否定一门学科(如博弈论)的作用;更误导学生的是,他最得意的地方是向学生宣称自己30年不读书,还要学生少读书,所有的学生都能像他那样是天才吗?又有几个人能像科斯那样,不用数学模型就能发展出那么深刻的经济理论?即便如此,科斯的原定理还有那么多含糊和争议的地方。一个人不妨先踏踏实实地学点现代经济学,然后再去给出一些让人信服的批评。在海外学习,从事研究与教学二十多年,给我印象最深的一点

是,许多大师级的学者们在论述他们的学术观点时(即使是口头发言),往往会非常注重于强调结论成立的前提假设及具体约束条件。这样,在讨论经济问题和给出经济结论时,非常重要的是注意理论的边界、局限性,及这个理论的应用范围。

另外一个错误是低估理论的作用。不少人经常以现代经济学中某些假设或原理不太适合中国国情为理由而否定现代经济学。事实上,世界上没有一门学科的所有假设或原理完全地合乎现实(如没有空气阻力的自由落体等物理概念)。我们不应根据这一点来否定一门学科的有用性。对现代经济学也是如此。我们学习现代经济学,不仅仅是了解它的基本原理、它的有用性,更重要的是学习它思考问题、提出问题和解决问题的方法。有些经济理论本身的价值并非直接解释现实,而是为解释现实发展更新的理论提供研究平台和参照系。借鉴这些方法,人们可以对如何解决现实中的问题得到启发。此外,如上节所述,由于环境的不同,一个理论对一个国家或地区适合,不见得对另外一个国家或地区适合,不能机械地生搬硬套,而需要修改或创新原有理论,根据当地的经济环境和人们的行为方式发展新的理论。

4. 区分充分条件与必要条件的重要性

在经济问题的讨论中,区分充分条件与必要条件也是非常重要的,它能帮助人们很清楚地思考问题和避免不必要的争论。必要条件是一个命题成立所必不可缺少的条件,充分条件是能保证命题一定成立的条件。例如,经常听到有人,用印度的例子来否认市场经济,认为印度采用的是市场经济,但还是很贫穷,所以中国不应该走市场经济之路。说这些话的人,就是没有区分出必要条件和充分条件的差别。市场经济是导致一个国家富强的必要条件而不是充分条件。这就是说,要想国家富强,一定要走市场经济的道路。这是由于在世界上找不到任何富裕,但不是市场经济的国家。但走市场经济之路,只是必要条件,不是充分条件,我们也必须承认市场机制不一定导致繁荣昌盛。其原因是,尽管(根据目前观察到的事实)市场机制是使一个国家繁荣昌盛必不可少的,但还有许多因素也能影响一个国家的繁荣富强,比如,政府干预经济的程度、政治制度、宗教、文化、社会结构等,使得有好的市场机制和坏的市场机制之分。

5. 数学在现代经济学中的作用

数学现在已经成为现代经济学研究中最重要工具。由于提供研究平台,建立参照系和给出分析工具都需要数学,这就不难理解为什么数理分析的方法在现代经济学中成为主要的研究方法。如果经济学没有

采用数学,经济学就不可能成为现代经济学。可以说,学好数学几乎是学好现代经济学的必要条件。数学在现代经济学的作用是:(1)使得所用语言更加准确和精炼,假设前提条件的陈述更加清楚,这样可以减少许多由于定义不清所造成的争议。(2)分析的逻辑更加严谨,并且清楚地阐明了一个经济结论成立的边界和适应范围,给出了一个理论结论成立的确切条件。否则的话,往往导致一个理论的滥用。例如,在谈到产权问题时,许多人都喜欢引用科斯定理,认为只要交易费用为零,就可导致资源的有效配置。直到现在,仍有许多人不知道(包括科斯本人在给出他的论断时也不知道),这个结论一般不成立。如上所述,还要加上效用(支付)函数是准线性(quasi-linear)这一条件。(3)利用数学便于得到难以直观得到的结果。比如,从直观上来看,根据供给和需求法则,只要供给和需求不相等,竞争的市场就会由看不见的手,通过市场价格的调整,达到市场均衡。但这个结论并不总是成立。Scaff(1960)给出了具体的反例,证明这个结果在某些情况下并不成立。(4)它可改进或推广已有的经济理论。这方面的例子在经济理论的研究中太多了。比如,经济机制设计理论是一般均衡理论的改进和推广。

然而,光懂数学还不能成为一个很好的经济学家,还要深刻理解现代经济学的分析框架和研究方法,对现实经济环境、经济问题有很好的直觉和洞察力,学经济学时不仅要数学(包括几何)的角度去了解一些术语、概念和结果,更重要的是,即使它们是用数学的语言或几何的图型给出的,也要尽可能弄清它们的经济学含义。因而在学习经济学时不要被文中的数学公式、数学符号等迷惑住。

实证经济学家主要用的是数理统计和计量经济学。我们不是为学经济学而学经济学,而是对所观测到的经济现象和统计资料进行分析、描述和制定政策,并对经济理论进行检验。对经济问题,不仅要作定性的理论分析,还需要有经验性的定量分析。经济统计和计量经济学在这些方面发挥着重要作用。经济统计侧重于数据的收集、描述、整理及给出统计的方法,而计量经济学则侧重于经济理论的检验、经济政策的评价、基于经济理论和经验数据进行经济预测,及检验各个经济变量之间的因果关系。为了更好地估计经济模型和作出更精确的预测,理论计量经济学家不断地研究出更为有力的计量工具。

6. 经济学语言和数学语言的相互间转换

经济学研究的产品是经济论断和结论。一篇规范的经济学论文的写作一般由下面三个部份组成:(1)提出问题,给出重要性,确定研究目标;(2)建立经济模

型,严格表达并验证论断;(3)通俗表达论断并给出政策含义。这就是说,一个经济结论的产生一般需要经过三个阶段:非数学语言阶段——数学语言阶段——非数学语言阶段。^①第一阶段提出经济观念、想法或猜想,这些观念、想法或猜想可能由经济直觉产生或根据历史经验或外在经验而来。由于还没有经过理论论证,人们可将它们类比为一般生产中的初等品。这一阶段是非常重要的,它是理论研究和创新的来源。

第二阶段需要验证所提出来的经济想法或论断是否成立。这种验证需要经济学家通过经济模型和分析工具给出严格的证明,只要可能,还需要得到实际经验数据的检验。所得出的结论和论断往往都是由数学语言或专业术语来表达的,非专业的人士不见得能理解,从而不能为社会大众,政府官员、政策制定者所采用。所以将这些由技术性较强的语言所表达的结论和论断类比为一般生产中的中间产品。

学经济学是要为社会服务的,所以第三阶段就是将由技术语言所表达的结论和论断用通俗的语言来表达,使得一般的人也能够理解,用通俗语言的形式给出这些结论的政策含义,深远意义及具有洞察力的论断,这些才是经济学的最终产品。注意第一和第三阶段都是用通俗、非技术、非数学的语言来给出经济想法和结论,但第三阶段是第一阶段的一种飞跃、升华。这种三阶段式,由通俗语言阶段到技术语言阶段,然后再回到一通俗语言阶段其实也是大多数学科所采用的研究方式。

四、结束语

总之,要理解和正确应用现代经济学,就需要了解现代经济学基本分析框架和研究方法。本文讨论了一个规范经济理论的分析框架的五个基本组成部分:(1)界定经济环境;(2)设定行为假设;(3)给出制度安排;(4)选择均衡结果;及(5)进行评估比较。基本研究方法包括提供研究平台、建立参照系、给出度量标尺,及提供分析工具。这种规范性的分析框架和研究方法使得现代经济学在过去六十年来发展迅速,应用广泛,影响巨大,已成为一门规模庞大、分支众多、体系严谨的社会科学领域。即使专门研究经济学的学者,也只能了解为数有限的分支中的很少一部份内容。不花一番工夫,是很难真正地理解其中一些经济理论的精髓。

在经济问题的讨论中,要区分充分条件与必要条件的差别,理解经济理论的作用,一般性与相对性,数学在经济学中的作用。学习经济学,不仅仅是了解它的基本原理,更重要的是学习它提出问题、思考问题和

解决问题的方法。掌握了现代经济学的基本方法和分析框架,有利于从事经济学的学习与研究,甚至帮助人们更好地处理日常事务。现代经济学基本分析框架其实也就是人们处理日常事务所用的基本方法。从这个意义上来说,现代经济学是“庸俗”的、“下里巴人”式的经济学。

参考文献

- 郎咸平:“中国需要立刻停止国企产权改革”,凤凰卫视 8 月 27 日。<http://www.phoenixtv.com/home/finance/fortune/200408/27/318836.html>.
- 钱颖一,“理解现代经济学”,《经济社会体制比较》,2002 年第 2 期。
- 田国强,《现代经济学的基本分析框架和研究方法》(完整版),2004。
<http://econweb.tamu.edu/tian/mcy96.htm>.
- Aivazian, V. A. and J. L. Callen, “The Coase Theorem and the Empty Core,” *Journal of Law and Economics*, 24 (1981), 175—181.
- Arrow, K. J., “The Organization of Economic Activity: Issues Pertinent to the Choice of Market versus Nonmarket Allocation,” in: *The Analysis and Evaluation of public Expenditures; The PPB System*, 1969.
- Arrow, K. J., “The Property Rights Doctrine and Demand Revelation under Incomplete Information,” in Michael J. Boskin (ed.), *Economics and Human Welfare; Essays in Honor Tibor Scitovsky*, New York: Academic Press, 23—39.
- Arrow, K and G. Debreu, “Existence of Equilibrium for a Competitive Economy,” *Econometrica*, 1954, 22.
- Chipman, J. S., “A Close Look to the Coase Theorem,” in *The Economists' Vision; Essays in Modern Economic Perspectives*, eds. by James and Buchanan and Bettina Monissen, Frankfurt/Mmain: Campus Verlag, 1998, 131—162.
- Coase, R., “The Problem of Social Cost,” *Journal of Law and Economics*, 3 (1960), 1—44.
- Debreu, G. (1959), *Theory of Value*, (Wiley, New York).
- Hurwicz, L., “On Informational Decentralized Systems,” *Decision and Organization*, Radner, R. and C. B. McGuire, eds., in Honor of J. Marschak, (North-Holland), 297—336, 1972.
- Hurwicz, L., “What is the Coase Theorem” *Japan and the World Economy*, 7 (1995), 49—74.
- Nash, J. (1951), “Non-cooperative games,” *Annals of Mathematics*, 54, 286—295.
- Sarf, H., “Some Examples of Global Instability of the Competitive Equilibrium,” *International Economic Review*, 1 (1960), 157—172.
- Samuelson, P., “Some Uneasiness with Coase Theorem,” *Japan and the World Economy* 7 (1995), 1—7.

^① 注意,笔者这里讲建立经济模型一般采用数学模型,但也有例外,如前面讨论的科斯定理。

Starrett, D. A., "Fundamental Nonconvexities in the Theory of Externalities." *Journal of Economic Theory*, 4 (1972), 180-199.

Tian, G. *Lecture Notes on Microeconomic Theory*, Texas A&M University, 2004. <http://econweb.tamu.edu/tian/class.htm>.

The Basic Analytical Framework and Methodologies in Modern Economics

Tian Guoqiang

(Shanghai University of Finance and Economics & Texas A&M University)

Abstract: The paper discusses the basic analytical framework that is typically used to study particular economic issues and questions that economists are interested in. The analytical framework usually consists of five steps: (1) characterizing economic environments, (2) specifying behavior assumptions, (3) providing an institution arrangement, (4) choosing an equilibrium, and (5) making evaluations. The paper also discusses the basic analytical methods widely adopted in modern economics, such as providing various analytical platforms, establishing reference systems, giving measuring criteria, developing analytical tools, noticing the boundary and arrange of an theory, etc. Understanding the general analytical framework and methodologies can help to classify some misunderstandings about modern economics, and can also help to use the basic economics principle or develop new economic theories to solve economic problems under various economic environments, different human behavior and institution arrangements.

Key Words: Analytical Framework; Research Method; Reference System; Analytical Tool

JEL Classification: B40, B41.

(责任编辑: 晓 峰)(校对: 林)

欢迎订阅 2005 年《经济研究》

《经济研究》是 1955 年创办的全国性综合经济理论刊物,由中国社会科学院经济研究所主办。1998 年被国家新闻出版署评定为“全国百种重点社科期刊”,2000 年获第二届“全国百种重点社科期刊奖”和首届“国家期刊奖”两项大奖,2002 年又获第二届“国家期刊奖”,是唯一入选的经济理论刊物。在近年公布的由南京大学和香港科技大学合作研制的《中文社会科学引文索引》(CSSCI)统计结果中,影响因子、被引总次数和被引指数在经济学和社科期刊中连续名列第一。

《经济研究》为适应跨世纪新形势的要求,在 2000 年和 2001 年先后进行了改版和扩版,即改原 16 开为大 16 开,从原 80 页扩大为 96 页,并提高了封面和内页用纸的档次。改、扩版后刊物的容量有了一定的增加,为广大读者刊发了更多的高质量的文章。2004 年又再一次进行了扩版,即从 96 页扩大为 128 页,由此使一些重点文章的篇幅可以适当加大。

《经济研究》改、扩版后将继续忠实地为经济理论研究人员、各级经济决策者、实际工作部门、政策研究部门和理论宣传部门的广大干部、各高等院校和财经类中专学校师生、各类企业的负责人和一切有志于研讨经济理论的各级人士以及关注我国改革开放事业的各界朋友服务。

《经济研究》2005 年不涨价,每期定价仍为 10.50 元,全年 126 元。全国各地邮局均可订阅,邮发代号 2-251。凡在当地邮局订阅不到者,可直接向经济研究杂志社订阅。银行汇款:北京工商银行阜外大街分理处,开户名称:经济研究杂志社,帐号:0200049209024900744。邮局汇款:北京阜外月坛北小街 2 号《经济研究》编辑部傅维平收,邮编:100836。

联系电话:(010)68034153;传真:(010)68032260。

网址:www.erj.cn;电子邮件:erj@cass.org.cn