

当代经济统计学批判系列

经济测度逻辑挖掘： 困难与原则

邱 东◎著



科学出版社

当代经济统计学批判系列

经济测度逻辑挖掘：困难与原则

邱 东 著

科学出版社

北 京

内 容 简 介

作为当代经济统计学批判之一,本书主要针对以斯蒂格利茨为首的“经济表现和社会进步测度委员会”的经济测度报告提出质疑。该报告可分为三大部分:传统 GDP 统计、生活质量测度和可持续发展测度。本书分析了经济测度“系统性革命”的必要性,特别是其可行性,指出了测度问题与解决办法之间的逻辑断裂之处。这是人类当下共同面临的经济测度难题,所以不能在强调实证数量分析的同时极度轻视经济统计学基础,否则,再高深的模型得出的数据结果也会失去真正明确的经济意义,而这恰恰是当代经济学的一个通病,经济统计学还大有可为。

本书适于从事或有志于从事经济学实证分析的人士,经济学、管理学专业的研究生、本科生阅读,也可供从事经济学教学的教师参考。

图书在版编目(CIP)数据

经济测度逻辑挖掘:困难与原则/邱东著. —北京:科学出版社,2018.11

(当代经济统计学批判系列)

ISBN 978-7-03-058874-6

I. ①经… II. ①邱… III. ①经济统计学-文集 IV. ①F222-53

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2018)第 215657 号

责任编辑:陶璇/责任校对:杜子昂

责任印制:吴兆东/封面设计:润一文化

科学出版社出版

北京东黄城根北街 16 号

邮政编码:100717

<http://www.sciencecp.com>

北京虎彩文化传播有限公司印刷

科学出版社发行 各地新华书店经销

*

2018 年 11 月第 一 版 开本:720×1000 B5

2018 年 11 月第一次印刷 印张:10

字数:202 000

定价:82.00 元

(如有印装质量问题,我社负责调换)

序

本书的主要内容是质疑闻名全球的“斯蒂格利茨经济测度报告”，作为“当代经济统计学批判系列”的第一部。

对经济统计学有太多心里话要说，于是自己写了一篇长序，从 GDP (gross domestic product, 国内生产总值) 开始。

对 GDP，多数人是耳熟不能详，无论国内还是国外。

作为宏观经济核心指标，尽管几十年来对之的批判、敌视不绝于耳，决策者还是离不开 GDP。原来 GDP 主要用于政府管理，现代社会以来，企业和个人决策也需要宏观经济信息，相对而言 GDP 是最顺手的指标，就连媒体都持续炒作，是故人们耳熟。

耳熟未必能详。

因为日常生活中接触得太多了，久之产生错觉，以为熟悉便是能详，遇到 GDP 甚至不愿做多想，只是按照自己的感觉走，压根儿没有需要“能详”的意识。浅尝辄止，以至于社会上诸多经济数据用户看似洋洋洒洒，其实混杂了好多南郭先生——“蒙昧的数据解读者”(the uneducated interpretation of data)，剑桥大学教授沃德(M. Ward)在《量化世界》(*Quantifying the World—UN Ideas and Statistics*)中提及的一个说法。

因为指标计算看上去太简单了，就认定不值得详细探究。持此论者只知数理逻辑的坚硬之难，不知“事理”逻辑的深远之难。按照《GDP 感人简史》作者 D. 科伊尔教授的说法，理解 GDP 如同难度逐步升级的电脑游戏(a video game with increasing levels of difficulty)，到了一定程度就寸步难行。当前，经济测度纠结于 GDP 是否应该超越又如何超越之间，业内外对其必要性和可行性异见纷呈，莫衷一是，有能力把握此格局的学者，确能详者，十分难得。

因为指标口径尽是些“艰涩的概念”[现任经济合作与发展组织(Organization for Economic Co-operation and Development, OECD)统计局局长兼首席统计师玛蒂娜·杜朗语]，彼此关系错综复杂，梳理时还需要相当广的知识面，把研究精力放在 GDP 的基础构建上很不经济，“脑力劳动生产率”极低，故而不愿意去详。

一些讨巧的人更愿意把时间放在高深数理模型的应用上，至于模型的投入数据质量如何则往往不问究竟，或者干脆直接归罪于统计工作者，巧借脑力劳动分工之便，认为责任找不到我即可。然而，意识不到经济测度缺陷，只是专业素质问题；但明明知道缺陷的存在却刻意避开，就是职业操守问题。

几十年来，经济学界存在着一个深究起来非常奇葩的悖境：一方面是数理模型分析被重视到无以复加的程度；另一方面却是对作为必备基础的经济统计方法论轻蔑到无视其存在的地步。

20 世纪 50 年代开始，经济统计学发展曾有过“黄金 30 年”，R. 弗里希、S. 库兹涅茨、W. 里昂惕夫、R. 斯通等学者都曾因为经济统计研究的成果而获得经济学诺贝尔奖（但国内有的数理统计学者在介绍统计学与经济学诺贝尔奖的关系时，却全然忽视了他们）。尔后，经济测度与国民核算方法论研究相对停滞。在当时的历史条件下，能够做出经济测度创新的课题已大致完成，遗留下来的经济测度难题恐怕还需要相当的学术积淀。经济统计领域里似乎只能做一些零敲碎打的修补工作，学术机会稀缺，难以吸引经济学学术精英驻足。

SNA（system of national accounts，国民核算体系）是公共产品，其功能之一便是为计量经济分析奠定基础。有了 SNA，宏观经济数据库的开发和应用便一发而不可收拾。数量分析成为经济学主流，还引得不少数学学者转战于此，场面蔚为大观，期刊上的成果累累。

按道理，由于人的自反性（索罗斯特别强调的 reflexivity），经济学研究笃定比生物学研究困难。然而这些年来经济学赫赫然成为显学，其成果产出效率恐怕远高于生物学。究其原因，生物学实验受到两大限制：一是物理限制，生物作用结果需要在一定物理形态上体现出来；二是时间限制，生物学因素彼此作用需要一定的时长，实验过程没那么快。经济学没有这种障碍，计算机速度够用就行。而且，因为基础数据来源的多元化，模型的内在不一致也有了很现成的托辞。由于这些原因，经济实证分析结果很难证伪，究竟是实证还是“虚证”，难以辨明。而且，经济学帝国主义盛行，外延拓展有足够空间，内涵深入从饭碗角度看也就不那么要紧。也正是由于这些原因，即使无视测度方法论隐含乃至显在的逻辑漏洞，也可以像模像样地大搞经济数量分析，可见经济学家的专业自律颇成问题。

托互联网之福，好多人都看到过沙特迪拜七星级的摩天高楼，若是云雾缥缈，在楼顶宛如身处仙境。经济学就如同这样的一座大厦，人们进了此门便奋力攀登，意欲领略其上的无限风光。更为诱人的是，越是在产业链的高端，就越容易占据学术资源，得以形成个人职业发展的良性循环。殊不知，无论是高端风光体验，还是研究“专利”的获取，都内在需要有一个前提：大厦的基石牢固可依。如果确知大厦基石之下存在漏洞，或者有流沙层，我们还能气定神闲地在大厦里讨生活吗？我们还敢义无反顾地往楼顶攀登吗？

学术研究固然应该追逐前沿,然而好多学者的“前沿观”是二维的。经济学中“生产可能性集”图是在平面上表现的,“最大生产可能性边界”看上去是远离原点的凸性弧线。如果在三维乃至多维空间里思考,“生产可能性集”就相当复杂了,“最大生产可能性边界”也未必远离原点。由此,若要树立“多维前沿观”,就不能线性地看待研究课题,只知向前、向上未必科学。须知,所谓“360度视角”也只是一种平面思维,貌似全面,实为错觉。总之,研究回归本初(back to the original)确有必要,至少时有必要。

我心力不逮,于是困惑多多,读书时总想问为什么,聪明人很容易理解的内容,在我这儿往往过不去,而且生性执拗,基础性内容没搞透就憋在那儿,不愿意跨过去。久而久之,总是喜欢提问题,总是抱着批判的态度读书,总是很容易感觉到“事理之矛盾”,就如梁漱溟所说,成了个“问题中人”。虽意愿学习经典却不迷信专家,自认为师生在人格上平等,位置再高的学术权威也需要把道理说透,这才能让我心悦诚服。或者从根子上说,我是一个悲观主义者,遇到专业问题更喜欢质疑,尽管相关文本都成了国际标准,我的脑子还“停留”在必要性、可行性上面打转转。这一点往往令我自愧,远不如乐观主义的技术精英,任何问题都可以找到解决方法,仿佛十八般武艺在手,总是一副无往而不胜的架势。

算算自己入得经济学大厦已有四十年整(若从数学角度看则还没入),人家都在向上攀登,我却偏偏往冷宫里钻,盯着不受待见的经济统计学,居然有滋有味,至今无悔。早有朋友劝我科研转向,我的回答是,经济统计学真有不少需要深究的问题,这块骨头够我这辈子啃的了。而今人生已过六十,感恩苍天待我颇厚,思忖着一生只为一大事来,恐怕就是要我在经济统计学专业有所贡献吧?

然而,我能贡献什么呢?伟大如 W. 丘吉尔到了“至暗时刻”,所能贡献的只是鲜血、辛劳、眼泪和汗水。我不过一介书生又能做些什么?只是诸多的疑问,只是一些或许会危及人家饭碗的异见,只是一份对年轻学子善意的专业提醒。

2010年,以斯蒂格里茨(J. E. Stiglitz)、森(A. Sen)、菲图西(J. P. Fitoussi)为首的“经济表现和社会进步测度委员会”发表报告《对我们生活的误测——为什么 GDP 增长不等于社会进步》(笔者简称之为 SSF 报告),对经济测度方法做了较为系统的评判,这是多年来少有的、对经济测度的集中研究。SSF 报告分为三大部分,分别侧重于传统 GDP 统计、生活质量(quality of life, QoL)测度和可持续发展测度。SSF 报告指出了各种经济测度方法存在的主要问题,也提出了系列的改进建议。从经济测度发展的格局看,报告认为应该将测度重心从经济生产转向社会福利,并认为超越 GDP(beyond GDP)的时机已经成熟。法国时任总统 N. 萨科齐是该项研究的发起人,他在报告序言中极力强调经济测度系统革命的必要性。

2012年在《宏观测度的边界悖律及其意义》一文中,笔者有这样一段评论:

“然而在 SSF 报告中，我们还读不到所希望读到的内容。我个人认为，SSF 报告存在以下不足：①过多讨论宏观测度应该做什么，较少讨论当今的测度能够做什么。②过多讨论宏观测度中存在的问题，较少给出切实可行的解决办法。③问题和建议之间还存在许多断裂，缺乏足够的逻辑支撑。④忽略了常规统计与专题调查的区别，没有对新建议测度项目的成本估计，实地操作的可行性研究不够。”（该文发表于《统计研究》2012 年第 8 期，也载于《经济统计学科论》，中国财政经济出版社 2013 年版，该文曾作为 2012 年日本经济统计学会第 56 届年会的大会特邀报告）

当时笔者交代过要专门撰文展开本人所提出的评价，出版这部文集就是要兑现六年前的承诺。其中 GDP 统计分为三篇，分别论述其指标功能、特殊测度困局和一般测度困难及其原则。生活质量测度和可持续发展测度各一篇，当今世界，福利测度和可持续发展测度都是实证分析的热点，本书仅就 SSF 报告涉及的方法论内容提出意见。本书还包括两篇论文：《全球核算体系 SNA 可持续发展面临的潜在挑战》和《经济统计学：从德国传统到当代困境》，可以看作讨论 SSF 报告的背景。另外，本书的附录纳入了两篇经济统计学的随笔，行文的笔调试着放轻松些，但专业思考是很严肃的。

时至今日，笔者对 SSF 报告的基本观点没变。这个报告应该是我们深入开展经济测度研究的起点，而绝非终点。而进一步研究的重心在于：各种测度改进的可行性如何？各种测度方法的逻辑节点是否切实链接？能否系统地比较不同测度主张以梳理其各自的长处、缺陷及使用场合？是否能总结出一系列测度原则用以指导经济统计实践？只有这些工作大致完成，才能得知 GDP 可否超越又如何超越，经济学大厦的测度基石才算比较牢固，基于其上的经济数量分析才真正具有实证的意义，而不是课堂作业或数字游戏。

几度认真读过 SSF 报告，笔者仍然坚持：人类共同面临着许多经济测度难题，往往处于难以抉择的悖境，笔者的批判系列之一便是经济测度悖律及其意义。因而需要警觉的是，经济数量分析的基础并不乐观，着实承载不起那么多高端的实证研究成果。从经济统计学的母学科——经济学看，存在着两个截然相悖的基本趋向，一是研究范围的无限拓展，二是要求研究结果的格外精确，从而造成了经济统计学如今的内在紧张格局。从根本上看，是这个社会对经济定量信息过分贪婪，硬要经济统计工作者去测度不可测度之事物或其成分，去核算缺乏平衡关系的经济变量，去比较不可比较之事物或其成分。测度、核算与比较是否切实可行本是定量分析成败之关键，却不入某些经济数量分析者的法眼，这一点远不如经济学初创时的老师——物理学，所以笔者断言：经济学并不是物理学的好学生。尽管这些年实验经济学盛行，形似容易，神似却难乎其难。以科学的方式出现，精神上却违背科学的原意，突出表现之一就是经济统计方法论缺乏敬畏之心。

只是“指标解释”，这曾是国内某些人贬低经济统计学的一大恶名。其实，国外就有现成的反例可用来抗辩，诸位不假思索就接受了 SNA，那么去看一下 SNA 文本吧，那里通篇都是指标解释。难道可以存在没有多少数学公式的经济统计学？是的，SNA 就是这样的经济统计学。N. 格里高利·曼昆（N. Gregory Mankiw）教授在《经济学原理——宏观经济学分册》中也曾强调指标解释：“重要的是，要记住 GDP 包括了什么，而又遗漏了什么。”我想补充强调的是，理解 GDP 为什么包括（不包括）某些子项更为重要。从经济统计学的专业层次看，其实 SNA 手册对指标解释得还不够，方法论的内容还嫌少，倒是《理解国民账户》（*Understanding National Accounts*）稍好，对指标解释得更“在理”一些。问题在于：为什么 SNA 进行指标解释就可以被接受呢？只是因为其出身欧美？难道这是学术判别标准吗？

当然，这些年来经济学本身的唯数理倾向也十分严重，即便栖身于经济学科群中，经济统计学也只能是边缘化的存在。美国经济学大家罗伯特·卢卡斯认定，经济学就是数学，除此之外全是想象和漫谈，按照这个断言，经济学就是由想象和漫谈大师亚当·斯密（Adam Smith）创建的了。卢卡斯可以作为经济学“唯数理观”的典型代表，1995 年他因开创“理性预期”理论而获经济学诺贝尔奖，不过有一件小事也同时载入史册，让他名利双双有所损失。

1989 年卢卡斯妻子在协议离婚时提出，若他在 1995 年前获诺贝尔奖，她要分得一半奖金。无论是数学功底，还是经济学理论，显然她都比不上卢卡斯，但她的预期理性却超出了卢卡斯。仔细看看离婚协议关于诺贝尔奖的条款，在时间点选择上多么精准！倘若可以延迟，笔者宁愿相信，卢卡斯肯定会祈祷这个大奖晚来一年，这可是几十万美金的归属权啊。当年卢卡斯能同意前妻的这一条款，说明他对自己六年之内获得诺贝尔奖不抱希望，并没有理性预期。

理性预期首创者的理性不如他人，那么优秀的数学头脑在真金白银的大决策上失效，说明卢卡斯的学术主张存在漏洞，“想象和漫谈”却可能反超。如果数学即经济学，如果理性预期的确具有完备性，则卢卡斯不可能同意前妻附加的离婚条件，他那位相对外行的前妻就不可能分得诺贝尔奖奖金。卢卡斯的学术主张与其行为相悖，这恐怕可以概括为“卢卡斯诺贝尔奖悖论”。有此悖论为例证，我们需要数理，但不必唯数理。

科学需要追求精确，社会科学也是如此。然而，数学精确性并不是唯一的精确性，相对于形式精确性而言，内容精确性更为本质。试想，法律的精确性要求肯定比经济分析更为严格，如果只承认数学精确性，那么法律条文和契约都应该用数学公式来制定，语文阐述全都应该废止，“案例判据”压根儿就不能成立，遑论作为英美法系的支撑。比照法律而言，经济分析又怎么能唯数理？A. 迪顿教授指出：“在处理数据时，我们需要尽力弄清它们是怎么来的，它们所表达的意义何在，否则，我们就容易犯无中生有的错误，还可能遗漏一些紧急而明确的需求。”

(A. 迪顿《逃离不平等》引言, 中信出版社 2014 年中文版)

不唯数理还有时机 (timing) 上的考虑。一是现代中国年轻人是从高考隧道里钻出来的, 多数长于计算而短于思辨, 故而我们不应该误人子弟, 让其长板更长, 短板更短。再一是数理统计在经济中的应用已经有了长足的发展, 再多人凑热闹, 真正能做出的边际贡献恐怕并没有那么多。扪心自问, 累累计量实证分析成果, 创新的增加值究竟几何?

依笔者之见, 本学科的主要矛盾并不在于数学工具简单, 而在于经济测度逻辑的切实接续而非虚搭, 在于计算结果的社会经济含义的解读而非拷贝, 在于变量间相互影响关系的深入剖析, 乃至基础经济概念的再审视, 而不是停留在抽象的硬性的“清晰”上。

如果对“国之重器”确有专业担当, 学者的悲悯之心便会油然而生, 经济统计学现在在中国已经近乎“绝学”, 需要不合时宜的人秉烛, 需要不愿逐流的人坚守。毁掉一个学科容易, 而构建又何其难。2017 年是最新一轮国际比较项目 (international comparison program, ICP) 的基础数据基准年, 国际上对 ICP 向来争议颇多, 哪个学科能在此领域发出中国的声音? SNA 这些年来处于是否需要转型又彷徨于如何转型的关键时期, 哪个学科能提出切实可行的回应和独到见解? 斯蒂格里茨等主持的经济测度报告发表已经将近十年, 哪个学科能针对此报告提出批判意见和建设性发展思路?

有人质问, 你们经济统计学除了 SNA 还有什么? 放下 SNA 自身的博大精深不说, 我的回答是, 经济统计学首先还是经济测度, SNA 只是其中可以形成核算平衡关系的主要内容, 无法纳入 SNA 的经济统计学内容还真不少。须知, 世界上最大的经济统计项目是国际经济比较项目, 而不是 SNA。更重要的是, 经济统计中需要研究的疑问太多太多。如果这样的问题都不成问题, 或者可以轻松地被其他学科解决, 当然可以把经济统计学丢进历史的垃圾堆。那么就请诸位大咖屈尊来解惑吧, 就从通常以为最简单的 GDP 开始, 不止耳熟, 但愿能详。

抵制“唯数理观”, 绝不是要关门搞经济统计学, 而恰恰是要打开学科交叉的大门, 发展丰富经济统计方法论。开门不是放弃经济统计学, 要开大门而不是开小门, 不能只对数理统计开门。经济统计学并不只是, 甚至不首先是, 数理统计方法的用武之地。经济统计学首先需要一般经济理论和各分支经济学的指导, 需要经济学方法论的指导, 需要行为经济学等最新成果的滋润; 其次, 作为一门社会科学, 还需要社会科学方法论的指导; 最后, 需要经济统计工作对方法论的追问, 需要社会认知等学科最新发展的支撑。

经济统计学当然需要使用数学工具, 但并不限于数理统计方法。除了随机不确定性现象, 经济现象还存在其他类型的不确定性。所以任何一门数学方法都不能搞垄断, 应该是现实经济问题需要或适用什么计量工具, 就采用什么计量工具。

经典数学方法不能废弃，此外也需要注重其他数学工具的应用开发，如对于边界模糊的经济测度问题，模糊学方法恐怕更为重要。有的人公然要学生只学数理统计，掌握了此种方法就无往而不胜，领域知识压根儿不在话下，应用非常简单。在堂堂著名高校论坛上闻得此言，心里不禁为一心向学的年轻学子担忧。随时准备提供一切问题的解决方法，这不是科学，而是科学主义的教条。

本人反对这种占领军意识，如果切实主张学科交叉，那么再重要的学科也不能取代经济统计学。特别是工具性学科，对“领域知识”的轻蔑其实是自设陷阱。各学科知识与经济统计学交叉，本意应该是帮助解决现实疑难问题，经济统计学的主旨还是经济测度、国民核算和国际比较。本书把我所意识到的经济测度问题罗列出来，正包含了开门求教的意思。

也可能有人不以为然，哪种方法会那么完美呢？存在问题很正常嘛！是的，任何方法都可能存在问题，关键在于：不应该大帽子底下开小差，一副若无其事的样子，假装问题不存在而我行我素。需要深究：这些问题对经济测度结果的影响究竟有多大？是不是到了似是而非的程度？是不是需要揭示问题以求弥补？一种方法的缺陷是否可以被其替代方法所解决？替代方法是否带来了新的问题？不同方法之间是否具备互补性，是否具备系统一致性，能够总体上完成经济测度逻辑的构建？

在我看来，这些基础性问题不做深入思考，这些缺陷不做弥补，所谓经济数量分析的学术价值和现实意义就大为消减。试想，如果到后厨推门瞥见食材被蟑螂爬过，或者发现加工过程中混入了杂物，再回餐桌还能照旧大快朵颐么？还好意思招呼同桌人“可劲儿吃”么？相对于“计量不较质”的蛮横处理，相对于巧妙“调适”模型炒作数据的学术欺诈，我这“倒胃口”的揶揄并不为过。梁漱溟先生说过，哲学的进步不存于正面，而在负面，即指示“此路不通”。我当然不敢说这种话，但总是想大声疾呼：不少指标和经济测度方法都隐藏着陷阱，不能因其盛行就盲目采用。

如果仔细阅读我的批判，就可以发现，我对经济测度挑战的分析是回溯性的，而不是展望性的。人们多喜欢随波逐流，我也知道新经济迅猛发展已经对经济测度产生巨大的冲击，这值得重视，但我的论文对此却着墨不多，因为在我看来，经济测度方法论研究欠下了太多的历史旧账，如今看似遇到的新挑战，其根源往往是当年隐含的测度悖境，如果不把这些旧账理清，所谓迎接新挑战就失去了坚实的基础，于是我每每把自己的思考重心放在基础性问题上，虽孤独，亦不悔。

笔者时时自警的是，种种疑惑和想法也许只是个人误解所致。然而对经济统计方法论不甚了了的恐怕并不只是我自己，我的祛昧之道就是要班门弄斧，不揣冒昧地把自己的看法坦白出来。期望至少能提请业内外专家放下身段，今后更清晰地阐述各种经济测度方法，注重经济测度逻辑的构建和解读，尽量减少没有理

论的测度（measurement without theory），让走心的用户对 GDP（或者新的核心指标）既耳熟，又可详。倘若得此之万一，也算对经济统计学专业的一桩功德。

北京师范大学国民核算研究院

邱 东

2018 年 2 月 9 日于读壁斋

目 录

世纪发明 GDP 的功能之辩	1
剖析 GDP 统计隐含的几个测度困局	19
GDP 的测度逻辑挖掘：困难与原则	38
探索福利测度的可行性和必要性	55
可持续发展测度的可持续性	77
全球核算体系 SNA 可持续发展面临的潜在挑战	100
经济统计学：从德国传统到当代困境	114
附录一 从“买一送一”说起——透视社会经济计量中的“可加性”	129
附录二 从 GDP 被误解看经济统计意识的必要性	138
后记	147

世纪发明 GDP 的功能之辩

2010 年，以斯蒂格里茨（J. E. Stiglitz）、森（A. Sen）和菲图西（J. P. Fitoussi）为首的“经济表现和社会进步测度委员会”发表报告《对我们生活的误测——为什么 GDP 增长不等于社会进步》^①，较为系统地梳理和总结了经济测度方法，GDP 统计、福利测度和可持续发展测度成为其三大内容。

本文论述与 GDP 功能相关的种种思辨，作为探讨 GDP 测度难题和应对原则的基础。从对 GDP 的两种极端评价开始，第一部分说明为什么一个价值指标（monetary aggregate）会成为一种“世纪发明”。第二部分点评美国参议员罗伯特·肯尼迪（R. Kennedy）对国民生产总值（gross national product, GNP）的非专业看法。第三部分说明宏观经济核心指标的历史性转变，即由国民收入（national income, NI）改为 GNP 的内在原因。第四部分探讨 GDP 作为宏观经济核心指标是否具有普适性。第五部分从几个事例看 GDP 作为经济发展判据可靠性究竟如何。第六部分讨论 GDP 作为宏观经济核心指标是否具有永续性。第七部分概括分析 GDP 的基本功能之辩，究竟是反映经济事实，还是服务于决策（政策）需求。

1 为什么 GDP 可以成为 20 世纪最伟大的发明之一

世纪之交，美国一批经济界知名人士，包括诺贝尔经济学奖获得者，回顾 GDP 统计的历史作用，结论是：GDP 是 20 世纪最伟大的发明之一^②。一个宏观经济核心指标怎么会成为 20 世纪人类最伟大的一项发明？笔者认为，GDP 的伟大，并不在于经济指标所隐含的学理，而在于其作为宏观经济管理工具发挥了独特的功

① 英文原文为 *Mismeasuring Our Lives: Why GDP Doesn't Add Up*，以下简称 SSF 报告，国外有的文献称之为“斯蒂格里茨报告”，名称缺乏特异性，故改称之。

② 英文原文是 *One of the Great Inventions of the 20th Century*。参见 Coyle D. *GDP: A Brief but Affectionate History*. Princeton: Princeton University Press, 2014. 浙江人民出版社 2017 年中译本的名称为《极简 GDP 史》，可能是为了与东方出版社 2016 年另一本《GDP 简史》相区别，但笔者认为应该称之为《GDP 感人简史》。

能，主要体现在战时与平时两方面。

1.1 GDP 是战争产物

美国著名经济学家、经济学诺贝尔奖得主约翰·肯尼思·加尔布雷思（John Kenneth Galbraith）在第二次世界大战后参与接收德国的工作，他总结得出一个结论：国民账户重要性不亚于密码和曼哈顿计划，是把希特勒锯倒的大锯中的关键零件之一。密码帮助英国保卫伦敦，免于首都被轰炸毁坏；曼哈顿计划造原子弹，迫使日本投降，美军死伤大大减少。国民账户为什么可以与之媲美？

战争需要耗费巨资，宏观账户可以让最高决策者知道还有多少钱可供支配。事物发展规则如此，有多大本钱开多大买卖。希特勒对交战双方的经济状况了解得不太充分，因而造成一些重大决策失误。英国战时开始搞国民账户，国家正处于“至暗时刻”，为什么要搞经济核算的创新？就是为了服务于凯恩斯等所关心的核心问题，看看英国财力能否支撑战争。也正是在第二次世界大战的紧要关头，美国经济统计学者竟然与相关政府官员展开了核心指标之争：到底采用国民收入，还是 GNP？可见其确定对战时宏观经济管理的至关重要。

美国主持经济研究局的韦斯利·米切尔（Wesley Mitchell）指出：“只有那些亲身参与过为战争所进行的经济动员的人才认识到，对 20 年间的国民收入进行评估并用多种方法进行分类，在各方面都极大地帮助了我们在第二次世界大战中取得胜利。”^①

再回顾 350 多年前，威廉·配第出版《政治算术》并不是一个单纯的学术行为，配第当时并不想开创一个学科，他的主要目的是向国王证明，英国具备足够的经济实力，可以支撑与荷兰、法国的战争。

战争作为发明之母，不仅体现在物质技术上，也体现在管理工具上。配第对国力的数量分析还只是一个指标系列，后来的经济统计才逐步发展出国民收入作为核心指标。从国民收入到 GNP，既体现了经济统计的历史传承，也反映出核心指标的重大创新。

不过，并不是所有战争都会导致核心经济指标的发展，笔者认为，只有当交战方的经济实力大致相当、不存在压倒性差异，战争处于胶着状态时，经济测度的独特重要性才会突显。

^① 科伊尔 D. 极简 GDP 史. 邵信芳译. 杭州：浙江人民出版社，2017：17.

1.2 GDP 的平时作用

在平时,政府往往需要按照经济波动趋势,使用财政政策和货币政策等进行逆周期调节。GDP 统计的作用,就是为这种政策调节提供宏观信息支撑。萨缪尔森(P. A. Samuelson)教授认为:“GDP 能够给你一幅经济运行状态的整体图画。”^①

“如果没有诸如 GDP 这些核算经济总量的指标,政策制定者只能在杂乱无序的数据海洋中漂泊。GDP 及其相关数据就像灯塔一样帮助政策制定者们把经济驶向关键的目标”^②。

笔者认为,减少经济波动幅度带来的效益,这应该是政府这个经济主体最大的产出。因为政府具有超经济的权力,其政策服务会产生很大的乘数效应。“政府政策服务产出”,远不是其要素成本或采购支出可以计量的。一个突出的例证,是美国战前和战后经济波动的变化。确立“国民收入和生产账户”(national income and product accounts, NIPAs)^③之后,美国经济的波动平稳多了,表现为衰退时间减少、出现的间隔时间延长、经济下降幅度大大降低^④。美国商务部前部长威廉·戴利(W. M. Daley)曾说过:“GDP 核算体系并非是美国经济步入稳定轨道的唯一原因——虽然我特别想这么说。不过,毫无疑问的是,该核算体系对美国的经济福祉产生了非常积极的影响。”^⑤

在欧美国家,即便 GDP 出现最小幅度的下跌,也会被政治对手当作经济决策无能的证据。2012 年第二季度英国 GDP 下降了 0.7%,是 2009 年来最大的季度跌幅,因此全国都陷入一片恐慌,很多人要求财长引咎辞职。而布朗首相曾担任财政大臣长达十年,他的一个习惯就是重申他所在内阁的业绩:让英国经济持续了有史以来最长时间的 GDP 增长。这个例子告诉我们,欧美政府也存在一定程度的唯 GDP 倾向,这个数字只能上升,不能下降,保证这一条竟然成了政府各种政策的出发点。

有人坚持说西方国家政府不干预经济,这与大量的历史事实不符。1985 年“广场协议”首次承认可以通过调节汇率来纠正国际贸易不平衡,就是一个典型反例。为了应对 2008 年的经济危机,美国国会批准了高达 7 000 亿美元的“凯恩斯主义”政府支出,被称为“问题资产救助计划”(Troubled Asset Relief Program, TARP),乔治·沃克·布什总统当年 10 月 3 日签署使其成为法律^⑥。试想,近年来西方国家的元首到中国访问,哪一次不是带着庞大的企业家队伍随行?哪一次不是签下

① 赵彦云,伍业峰. GDP——20 世纪最伟大的发明之一. 统计研究, 2001, (7): 54.

② 美国的国民收入和生产账户与 SNA 在核算原则上基本一致。

③ 赵彦云,伍业峰. GDP——20 世纪最伟大的发明之一. 统计研究, 2001, (7): 55.

④ 马苏德 E. GDP 简史: 从国家奖牌到众矢之的. 钱峰译. 北京: 东方出版社, 2016: 12.

⑤ 马苏德 E. GDP 简史: 从国家奖牌到众矢之的. 钱峰译. 北京: 东方出版社, 2016: 30.

4 经济测度逻辑挖掘：困难与原则

巨额订单？还有，特朗普总统强调美国实业企业回美国本土办厂，正是在实施某种产业政策调节。经济学家马里亚纳·马祖卡托认为：“创造就业机会离不开政府的帮扶，……互联网是由美国政府资助的科学家发明的，万维网也基本上完全是由欧洲各国政府通过日内瓦的欧洲核子研究中心资助完成的。”^①

随便比较经济波动幅度大小不同的两个数列，就可知道“大起大落”与“平稳增长”两种发展模式的巨大差别。

时间序号	A ($\uparrow 40\%$, $\downarrow 20\%$)	B $\uparrow 10\%$	$C (=B-A)$
0	1 000	1 000	0
1	1 400	1 100	-300
2	1 120	1 210	90
3	1 568	1 331	-237
4	1 254.4	1 464.1	209.7
5	1 756.2	1 610.5	-145.7
6	1 405.0	1 771.6	366.6
7	1 967.0	1 948.8	-18.2
8	1 573.6	2 143.6	570
合计			-700.9 1 236.3

假设 A 数列先增 40%，然后下降 20%， B 数列只是每年增长 10%， C 是两个数列之间的比较。 A 数列大幅上升，但其后速率下降一半， B 数列则平稳上升。不用太长时间， B 数列就反超了。当然也可以假设其他数字变化模式，赶超期和幅度会有变化，但同样可以说明，“过山车式”发展大大劣于平稳增长。

2 R. 肯尼迪对 GNP 的非专业看法及其批判

与“世纪发明说”截然相反的是对 GDP 的种种轻视乃至抨击。笔者要强调的是，GDP 当然不是万能的，但是没有 GDP 是万万不能的，GDP 所代表的恰恰是经济福利提升的物质经济基础。而且，也正是因为有了一定数量的 GDP，才有了不以 GDP 为中心的本钱。富足之后 GDP 的边际效用的确会降低，但忘乎所以转而痛骂 GDP，充分体现了人类的机会主义劣根性。

^① 马苏德 E. GDP 简史：从国家奖牌到众矢之的。钱峰译。北京：东方出版社，2016：32。

2.1 R. 肯尼迪对 GNP 的非专业看法

最典型的反 GNP 代表恐怕是美国参议员罗伯特·肯尼迪，他是约翰·肯尼迪（J. Kennedy）总统的弟弟，1968 年竞选美国总统，在堪萨斯大学讲演时集中讲到了 GNP。竞选总统为什么要大讲经济统计核心指标呢？当时美国经济已经发展到一定水平，社会问题引起了更多的关注，其历史背景是经济社会发展的重心需要转移，从而凸显了 GNP 指标隐含的不足^①。

肯尼迪参议员对 GNP 的指标功能不以为然，因为他认为 GNP 测度了不少坏东西，讲演中他慷慨激昂地列举了十多项：“它包括了我们在门上的特种锁和关撬锁的人的监狱，包括了我们对于红木森林的破坏和因城市无序蔓延而消失的自然奇观。它包括了凝固汽油弹，包括了核弹头，包括了警察用来应付城市骚乱的装甲车，包括了惠特曼步枪和斯佩克刀，包括了为了向孩子推销玩具而美化暴力的电视节目。”^②一句话，好多不应该包括的项目，都纳入了 GNP。然而，GNP 漏算了许多好东西：“这个国民生产总值不包括我们孩子的健康，他们教育的质量和游戏的快乐。它不包括我们诗歌的美丽，我们婚姻的坚强，我们公众辩论中的智慧，和我们官员的正直。它不包括我们的机智和勇气，不包括我们的智慧和学问，不包括我们的同情心，不包括我们对国家的热爱。简言之，国民生产总值衡量一切，却把那些令人生有价值的东西排除在外。它告诉我们美国的方方面面，却不能告诉我们为什么为美国而自豪。”^③

2.2 笔者对肯尼迪“国民生产总值观”的评论

笔者对肯尼迪参议员对 GNP 非专业观点做五点评论。

第一，肯尼迪参议员指责 GNP 包含了空气污染和环境退化，这不确切。GNP 包括了可能导致环境退化的产品产值，但并没有包括环境退化本身。另外，他以“特种锁”为例批判 GNP，可见当时美国治安也不太好，经济上去了，社会矛盾调和得不够。

防盗窗和特种锁，都属于“遗憾性产品”（the regret product），是不得不生产和使用的产品。然而，它们都是国民核算中正常的经济产品，究竟要不要包括在 GNP 中？业内有过激烈辩论，最后的专业结论没变，还是得包括在 GNP 内。

① 当时核心指标是 GNP，还没改成 GDP。不过二者是“交叉指标”，构成项目有其共，有其异。尽管后来 SNA 强调 GNP 应该是国民总收入（gross national income, GNI），更是一个收入指标，但基于三方等价原则，二者作为宏观经济总量指标仍是共性居多，从功能上看在许多场合可以做同义词使用。

② 这段讲演在中国也非常有名，中文版、英文版在网上都能找到，人们至今还以它为依据来攻击 GDP。