

名家学术讲演录

第一辑

田国强 主编

格兰杰
经济预测的展望

田国强
现代经济学的基本分析框架与研究方法

王—江
国家与经济

雷鼎鸣
现代经济学的方法

上海财经大学现代经济学前沿系列讲座

谭国富
产业组织理论的研究方法和一些新进展

经济曾长与文化



上海财经大学出版社

名家学术讲演录

第一辑

田国强 主编

格兰
经济预测的展望

田国
现代经济学的基本分析框架与研究方法

王
国家与经济

雷
现代经济学的方法

谭
产业组织理论的研究方法和一些新进展

图书在版编目(CIP)数据

名家学术讲演录. 第1辑:上海财经大学现代经济学前沿系列讲座/田国强主编. —上海:上海财经大学出版社, 2006. 5

ISBN 7-81098-632-5/F·582

I. 名… II. 田… III. 经济学-演讲-文集 IV. F0—53

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2006)第 030029 号

□责任编辑 金福林

□封面设计 钱宇辰

MINGJIA XUESHU JIANGYANLU 名家学术讲演录

第一辑

田国强 主编

上海财经大学出版社出版发行
(上海市武东路 321 号乙 邮编 200434)

网 址: <http://www.sufep.com>

电子邮箱: webmaster@sufep.com

全国新华书店经销

上海市印刷七厂印刷

上海远大印务发展有限公司装订

2006 年 5 月第 1 版 2006 年 5 月第 1 次印刷

787mm×1092mm 1/16 17.75 印张(插页:2) 247 千字

印数:0 001—5 000 定价:30.00 元

上海财经大学现代经济学前沿系列讲座

陈志武

金融技术

杨涛

经济增长的源泉

魏尚进

金融全球化

张欣

人民币均衡汇率计算与调整方案分析

文贯中

中国的疆域变化与走出农本社会的冲动

王一江

许成纲

钱颖一

魏尚进

李约瑟之谜的经济地理学解析

编委

(以姓氏笔画为序)

田国强

丁学良

田国强

陈志武

奚恺元

现代经济学的基本分析框架与研究方法

格

文贯中

艾春荣

邹恒甫

谭国富

经济预测的展望

王一江

国家与经济

雷鼎鸣

现代经济学的方法

谭国富

产业组织理论的研究方法和一些新进展

陈志武

金融技术、经济增长与文化

序

中国自 1978 年改革开放以来,作为社会科学显学的现代经济学发展迅速,并在中国的市场化改革和经济建设中发挥了重要作用。作为开放时代的产物之一,一大批学有所成的华人经济学家在国际经济学界崭露头角,他们同时也非常关注祖国的经济发展与改革,对中国的改革进行了许多有意义的理论性探讨并提出了诸多具有建设性的建议。中国的市场化改革,演进至今,面临着诸多敏感而艰危的“瓶颈”区域,在国家“十一五”发展规划制订之际,由国企改革的争论,而经济学教学和研究方向的论辩,及至新近学界和政界在反思改革的同时对改革的肯定,充分昭示了中国经济学本身所面临的改革或规范发展问题。

作为近二十年中国改革的滞后领域之一——教育,以高等教育为例,是近年媒体和学界讨论的焦点之一,由“大学有问题”,而知“大学的逻辑”,高教界终于分头做起实际的动作。大批海外华人学者的回归,即是大学近年来聚拢优等人才、提升办学层次、致力于研究型大学建设的重要举措之一。

序

为努力实施研究型大学的战略目标,上海财经大学率先聘请一些海外学有所成的学者担任院系行政职务,本人有幸被聘为上海财经大学经济学院院长。上海财经大学推出了“经济学创新平台”建设项目,以此为载体,全面推进上海财经大学经济学教学、科研的改革与创新,已经受到了国内外经济学界的广泛关注。目前正通过倾力引进海外优秀人才、全面的教学体制改革、高层次的对外合作、筹建高等研究院、建立现代经济学实验中心和文献信息中心等措施,最终将上海财经大学打造成为国内一流、国际知名的财经大学,使之成为能与国际接轨,具有国际对话实力的经济学教育基地和经济学理论、应用人才的培养基地。并希望通过改革,能够摸索出一套在体制内可实行的,真正具有推广价值的经济学教育改革实践方法,供其他大学的经济学教育改革参考,从而为中国社会主义市场经济建设培养出众多高质量的理论和应用型人才。

“经济学创新平台”的建设思路与前期工作得到中央部委的充分肯定和重视,得到了教育部和财政部专项资金的大力支持,成为教育部、财政部和国务院学位办联合立项的国家重点教育改革专门项目,是新中国社会

科学领域前所未有的单列建设项目,并在海内外产生了积极的影响和示范效应。

目前,“经济学创新平台”正以上海财经大学经济学院为主体,全面展开平台的建设。“经济学创新平台”建设的内容之一,乃是频繁邀请海外学有专攻的一流学者前来讲学交流和做学术报告。自2004年9月起,上海财经大学经济学院陆续邀请了钱颖一、陈志武、邹恒甫、王一江、谭国富、丁学良、张欣、杨涛、文贯中、魏尚进、雷鼎鸣、奚恺元等十多名著名海外华人经济学家、学者访问该院,并作专题学术报告。

本书便是上列诸位经济学名家、学者在上海财经大学所作学术报告精选辑录而成。诚望本书的出版,能让学界同行分享这些学术报告之精彩处,自然也供同行高人批评指正其不足、谬误处,以共推中国经济学教学和研究之进步。

需要说明的是,本书所辑录的学术演讲报告,有的经讲演者修改合乎学术论文写作规范,有的则未及校改仅以整理稿为基础实录了演讲时的原味。从内容看,主要涉及现代经济学研究的方法和分析框架、经济增长理论、金融理论、经济史及行为经济学诸学术领域。社会学家丁学良

教授的报告论及现代研究型大学的核心体制,颇具警醒意义,乃予辑入。

是为序。

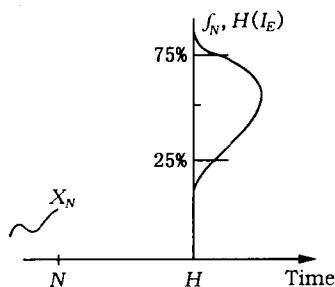
田国强
2006年3月20日

目 录

田国强	序 / 1
格兰杰	经济预测的展望 / 1
田国强	现代经济学的基本分析框架与研究方法 / 6
王一江	国家与经济 / 54
雷鼎鸣	现代经济学的方法 / 87
谭国富	产业组织理论的研究方法和一些新进展 / 104
陈志武	金融技术、经济增长与文化 / 140
杨 涛	经济增长的源泉 / 156
魏尚进	金融全球化 / 178
张 欣	人民币均衡汇率计算与调整方案分析 / 192
文贯中	中国的疆域变化与走出农本社会的冲动 ——李约瑟之谜的经济地理学解析 / 221
奚恺元	经济行为幸福分析 / 250
丁学良	研究型大学的核心体制 / 260

经济预测的展望

我首先感谢上海财大的邀请。我今天的题目是经济预测的展望。经济预测涉及到经济决策的问题,经济预测的影响都是在未来,我们也会谈到对经济理论的预测。首先介绍我们是如何进行经济预测的,我一会儿还要继续讲这个话题。下面先来看一下我身后的这张图表:这个横坐标代表时间, N 点是现在, N 点加上 H 点表示未来,中间是我们作为预测的区间。比如说要做经济预测,时间在这个点上,再比如说失业,在这里记做 X_N , X_N 的一个工资支付形式是 Z_N 。我们要预测将来失业,用到其他



(此图仅供参考)

的一些已知的信息集,在做出预测之前,那些因素信息集我们用 I_E 表示。此外, X_N 表示失业有它自己的历史,还有其他一些变量,这些变量的因素限制了信息化,但它们不妨碍我们预测这个 S_N 在 $N+E$ 这一点的值,比如说我们可以预测生产就在这个信息集里面。预测未来就意味着在将来的这段时间内会有很多的随机事件发生,失业就是这段时间内的一个变量,就可以预测它的可信度,于是我们就用它的分布来描述。在很多经济预测中,实际上我们经常预测一个点,比如说 A 点,

在这个图中,我们用 A 加 H 来描述它的分布。如果我们要预测这个点的话,实际上就是它的均值。在这里,我们做的是点预测。但是,如果你意识到这是一个随机的变量,那么用一个点来预测肯定是不全面的,我们会用一个区间来表示,也就是均值加上或减去 ϵ 。经济预测的方法实际上就是如何用历史和它的信息集来预测 A 点的分布,我们有时会运用已有的信息集来预测未来,有些方法很简单,例如,我们会把一些统计的数据放进信息集里对未来进行预测。在现代,美国的一些新闻媒体也会经常提供对未来的预测,这些预测大多是对期望的一种描述。比如说一些技术性的公司在发布业绩报告的时候,经常说,某某公司的利润只有几百万,比预期的要少。这些预期都是由做预测的人来评估的,你就会明白预期值是对未来的一个预测,要知道这些预期值是怎么产生的,而且预测人员会采用各种方法对预测值进行评估。

经济预测还有很重要的一点是其中的数据,但现实情况是研究人员所采用的数据质量越来越差,在我们开始做研究的时候,也就是 20 世纪 70 年代的时候,人们会嘲笑做经济预测的经济学家,认为他们做的预测就像天气预报一样并不准确。但是他们现在不会去笑话那些做天气预报的人了,因为,现在的天气预报非常准确,这是由于有太空气象卫星为做天气预报的研究人员提供相当准确的数据资料。那么,对于我们这些经济学家来说,高度精确的数据资料在哪里呢?

我们下面举几个例子来说明一下。首先是信用卡公司的例子。尽管在中国,信用卡的使用还不是很普遍,但是,在美国,人们在付款的时候大多会使用信用卡,而很少会使用现金。在美国,信用卡对客户资料的记载是非常详细的,如果能得到信用卡公司提供的信息,我们进行处理后就能够得到消费者对消费的期望是多少。另外一个例子就是对电的需求。对电的需求是不可替代的,实际上,每户每月对电的需求都是已知的,随着时间的推移对它的需求是可以理想化的,这些理想是可以控制的。在美国,每个月都会公布房屋买卖的信息,它反映经济已经发生的事情,对有些经济变量的预测是很困难的,对有些变量的预测是短期的,比如说,对明天的电力需求的预测;对有些变量的预测是两三个

月之内的,比如对三个月以后的预测;还有是针对一年以后的预测,随着对数据收集质量的提高,相信肯定会有新的计量经济的方法会提出来得到改进,并利用定期的信息。他不可以预测这些新的方法将是什么,不过他们会自己提出新的方法。用这些预测方法会预测到未来多久呢?做长期的预测似乎是不可能的。但只要你去做,那么,长期预测并不是不可以做,而只是一项很困难的事情。针对这样的情况,只要你去做,就会发现它的问题所在。在1967年的时候,我写了一本本科生的教材,其中我做了一个简单的人均实际消费的预测,就是用时点变量来预测,从现在的数据看来,我的预测是非常正确的。在那本书里,我是在1967年预测2000年的事,将近有33年的跨度,我用了许多变量,包括人口等经济指标,也包括了科技的进步。你自己也可以想想,十年已经是很长的时间了,那么,三十年后,会怎么样呢?一般来说,你会说你不知道会是怎么一个样子,这种长期的预测是非常困难的。但由于现在已经过了2000年了,如果我们再去翻那本书的话,你会发现书中的预测是非常准确的。我们对33年后的消费预测是高于实际的消费,而并不是预测的结果差,实际上,其他的一些预测变量有些好有些差。这些年来,有了一些重大的科学发现,比如说,计算机的发现,当时在60年代的时候,只有IBM的笨重的计算机,那个时候预测,到了2000年的时候,每个家庭都有一台计算机,并且都能在网络上联络,我那个时候已经预测了计算机的网络性,还预测到了移动电话的普及。大家当时都没有预测到的就是移民的问题,他们迁移到富裕的地区工作的这个趋势。20世纪60年代大部分美国的妇女都呆在家里,我在这本书里就预测了以后的妇女会有很多人走出家门参加工作,实际上现在的美国妇女参加工作而彻底地改变了美国的劳动力市场。我在这本书里表示,独身主义会解体。世界变化得非常之快,我们那时候预测的很多事情,到现在并没有发生。我们现在预测的时候还有一个问题就是,经济系统的跳跃问题,我们很难预测经济系统的跳跃,但并不是说它们是不可预期的,只是说预测它们是不容易的,但我们仍然应该虚心地去想办法来预测经济系统这个不可控制的跳跃。我们预测以后看看

结果如何,然后再去评估。比方说火山爆发,火山爆发在过去也是经济系统中不可预期的,但是现在我们可以对它进行很多的处理。Prispon 也在做这方面的研究,也就是重新预测金融危机,预测金融危机并不是说,经济危机在什么时候就会爆发,而是在预测一个概念。金融危机的爆发是一个诚信问题,现在的一些宏观指标的变量可以告诉你现在爆发宏观经济危机的可能性是在增加还是在减少。每月的宏观指标以及一些其他的指标,你把这些指标结合在一起,就能够预测发生经济危机的可能性是否在增加。如果可能性在增加,就应该采取一些措施来避免这些危机的发生。如果预测的方法得以改进的话,那么预测的准确性就能相应地提高。我们上面看到的图就是 2000 年美国国会预算赤字和盈余的预测(图略)。在这里,我们把它分成两块,宽的一块是对美国财政状况分布的预测,预测的时间越晚,它的不确定程度就越高,从图中表现来看就是越来越宽。下面的框架是引用英国的财政状况,这些预测当时在媒体上是有很大大争论的,这个预测分两部分来做:一部分是我们可以用经济现象来判断,实际上我们可以用统计的办法来评估,在经济预测里面有许多问题是没有答案的。另外一个经济预测是关于经济政策的预测,在某些经济现象还没有发生之前,我们就采取一些政策,等到那些预测到的经济现象发生的时候,我们的政策正好可以发生它的效果,这样的话,它就给预测带来了一定的困难。在经济预测中,由于预测中的事情还没有发生,现实中的情况难免会受到经济预测的影响,因此很难评估不同预测的效果如何。比如说,我们预测股票的价格会上升,那么大家就会更多地购买股票以求获利,这样的话就很难判断这种预测的效果到底如何,因为它影响了现实中的客观经济,这就给我们的评估工作带来了很大的困难。在全球化之前,我们可以单独对一个国家进行预测,但是现在全球化的到来使我们不得不以全球化的视角来对待每一个单一国家的经济预测。因此,我们需要建立一种全球的模型,这个模型把各个国家的经济连接起来,也有一些比较简单的模型,但是很具体,把各种潜在的因素都挖掘出来。现在的很多模型都是相当复杂的,因此想要用一个模型来包括所有的经济变量来进行预

测是不太现实的。你在用这种全球化的模型来评价一个国家的政策对全球的影响的时候,会发现不知道用哪一个模型更合适,这在我们经济学里是关于如何去发现或构造一个更合适的模型来预测我们需要研究的经济体的问题。在我刚刚接触这个演讲的时候,我的同事说经济预测是一个非常激动人心且很有趣的研究领域,他建议我们以后做非常非常长期的经济预测,因为这种预测只有经过很长的时间才能检验它到底是对还是错。

(讲演时间:2005年6月6日)

【讲演者简介】

格兰杰,1934年出生于英国威尔士的斯旺西,现为英国公民。他于1955年获英国诺丁汉大学颁发的首批经济学与数学联合学位,1959年在该校获博士学位。1974年移居美国,现为美国圣迭戈加利福尼亚大学经济学院荣誉经济学教授。据瑞典皇家科学院介绍,格兰杰对经济学研究的一大杰出贡献是,发现非平稳时间序列的特别组合可以呈现出平稳性,从而可以得出正确的统计结果。格兰杰的发现对研究“财富与消费、汇率与物价水平,以及短期利率与长期利率之间的关系”都具有非常重要的意义。

2003年诺贝尔经济学奖获得者。

田国强

现代经济学的基本分析框架与研究方法^①

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。另外,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。这些在很大程度上误导了大众以及学生。

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。这也就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

① 本文为上海财经大学作讲座的报告稿。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。

经济学的理论仅适用于“西方”社会,中国的经济学家应该研究适用于发展中国家的“东方”经济学,甚至“中国特色”的经济学。持有这些观点和说法的学者中还有一些著名的“海龟”经济学家,由于他们的海外留学背景,使得他们的观点更具有误导性。笔者认为,其实是这些人对现代经济学最基本的分析框架和研究方法还没有弄清楚,不知道现代经济学的分析框架和研究方法具有非常大的普遍性、高度的规范性和逻辑的一致性。这些观点和说法误导了不少人,特别是对现代经济学还不太了解的人。并且,由于相对于其他学科,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。

当然,产生这些现象的原因,可能是由于现代经济学主要研究现代市场制度,而大多外文教科书的作者和读者对象都生活在市场经济制度相对完善的发达国家中,这些教科书一般也不讨论现代经济学的分析框架和研究方法。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,这些问题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。在他们看来,现代经济学似乎高深莫测,难以理解其中许多似乎不一致的理论结论。

笔者作为 20 多年来一直学习、讲授以及研究现代经济学的一名学者,经历了对现代经济学从无知到有所悟的过程。写作本文的动机就是为了澄清对现代经济学及其研究方法的一些误解,帮助读者理解现代经济学最基本的分析框架和研究方法,并讨论它们在学习、研究、乃至日常工作中所起的现实作用。它们看似简单,但人们对现代经济学的误解,往往正是没有弄清楚这些最基本的分析框架和研究方法。需要指出的是,近年来已有一些学者,包括钱颖一、林毅夫及笔者本人,对经济学的研究方法作过一些讨论。但谈及分析框架的,笔者只见到钱颖一教授的《理解现代经济学》一文,这是一篇非常值得一读的文章。尽管本文所讨论的问题与钱文所讨论的问题基本相同,但侧重点不太一样,分析框架的划分也不太一样。本文特别对现代经济学中每一个

理论基本上所共有的分析框架作了较详细介绍,并且讨论了其基本分析框架和研究方法的现实作用。钱颖一教授和笔者的两篇文章具有一定的互补性,可结合起来看。另外,文中有些内容在笔者的讲义、书和一些文章中也零散地讨论过,见田国强、张帆(1993),田国强(1996)及Tian(2004)。

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。第四节讨论现代经济学基本研究方法和分析框架的具体现实作用。第五节总结本文,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冲突才产生了经济学,逼迫人们作出权衡取舍的选择,尽可能有效地利用资源,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,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。现代经济学主要是在第二次世界大战以后发展起来的,通过六十年的蓬勃发展,现已成为一门规模庞大、分支众多、体系严谨、模型化的社会科学领域,在社会科学中占有重要地位。

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。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