

经济与经济分析的 逻辑

著

刘晓峰

在本书中，作者建立一个新的分析框架，为宏观经济分析提供新的、更合理的微观基础。该框架将完全解决由代表人分析和总量生产函数假设所导致的缺陷和问题。因此，本书的框架实际上提供了剑桥资本争论的一个解。作者的新框架所开辟的新的研究思路，能够为解决经济学领域的诸多令人不满意的问题提供可能的帮助。该书具有重大的理论创新意义，对剑桥资本争论、总量生产函数、代表性个体等西方经济学中一直存在争议的问题给出了解决方案。



图书在版编目(CIP)数据

经济与经济分析的逻辑/刘晓峰著. —厦门:厦门大学出版社, 2011. 10
(青年经济学者文库)

ISBN 978-7-5615-3957-6

I. ①经… II. ①刘… III. ①西方经济学-理论研究 IV. ①F091.3

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2011)第 109105 号

厦门大学出版社出版发行

(地址:厦门市软件园二期望海路 39 号 邮编:361008)

<http://www.xmupress.com>

xmup@public.xm.fj.cn

厦门市明亮彩印有限公司印刷

2011 年 10 月第 1 版 2011 年 10 月第 1 次印刷

开本:787×960 1/16 印张:20.25 插页:1

字数:400 千字 印数:1~3 000 册

定价:45.00 元

本书如有印装质量问题请直接寄承印厂调换

前 言

令人不满意的经济学

本书是笔者从 2004 年离开证券公司回到母校南开大学后,经过了七年艰苦思考后的总结。记得凯恩斯(J. M. Keynes)在《通论》中曾经写道,他的写作是一个“逃避惯性思维和习惯表达”的过程。在某种意义上,本书也有这样的特点。七年的思考,起点是为了解决笔者在博士班课堂上学习高级宏观经济学中经典的拉姆齐(Ramsey)模型时对代表人假设产生的疑问。七年来,随着思考的深入,我逐渐发现了一系列纠缠在一起、必须一体化整体解决的问题。这一系列问题的怀疑、思索和解决,即构成了本书的主体框架。为使读者有一个总体的观念,笔者在此先从总体架构方面对现有的经济学体系作一鸟瞰式的简单评析。

经济学理论大厦分为宏观经济学和微观经济学两大部分。几乎任何一个学习过经济学课程的人都会发现宏观经济学与微观经济学的差异。这种差异不仅仅是内容上的,而且是风格上的。我们首先谈宏观经济学。至少我所接触过的许多学生以至学者,大家都有一个共同的感觉:经典的宏观经济学教科书看起来好像是各个学派不同学说的拼盘,内容庞杂,但是一旦涉及具体问题的分析,则很少能给出一致的答案。当然,出现这种结果的原因也许是经济系统本身的复杂性,但是这种局面其实也揭示了在宏观经济分析理论层面所存

在的广泛分歧。换言之，在笔者看来，宏观经济学领域存在的困境不在于对问题和现象缺乏解释，而是对几乎每个问题和现象都有着不止一种解释。多种解释使得人们无所适从，也使得很多争论往往变成公众意见或者政治家意见的“选美”，并受到他们的影响，而不是出于证据和分析。

让我们再回到微观经济学。一般学习过微观经济学的人都会欣赏并喜爱其体系的严谨——至少表面上不像宏观经济学那样对同一问题有多种说法。然而，如果说宏观经济学的问题是对于同一观测事实拥有不同乃至相互对立解释的话，那么微观经济学的问题在笔者看来则是远离了观测事实。一般微观经济学的分析过程是：首先列举一些从直观上很容易被人承认和接受的公理性假设（比如有关偏好的几个公理），然后在此基础上展开演绎推理以获得推论。一般在此过程需要借助数学作为分析工具。由于你一开始已经承认了那些公理性假设的“正确性”，同时对于利用严谨数学工具的推理过程你也无法提出挑战 and 质疑，因此你会没有丝毫怀疑地接受整个理论体系的推论。然而，这个过程其实很可能与真实无关。即推理获得的结论未必能代表真实经济、真实世界中的行为。这方面绝佳的例子就是作为微观经济学具体应用的、存在于金融学领域的许多定价公式。这些复杂的定价公式在数学推理的意义上毫无问题，然而利用它来指导真实市场中的投资往往导致失败的命运，甚至有人将金融风暴的成因归咎于它。导致这种情况出现的原因可能有很多，从人的有限理性到对“理性”本身的不同理解，从信念的不一致到信息分布的不均匀等不一而足。但是所有这些解释的共同之处都是理论和现实的偏离。

如果说宏观经济学与微观经济学各有自己的优势和缺陷的话，则另一个在笔者看来非常严重的问题是，今天的宏观经济学构建其“微观基础”的方法是错误的或者至少是误导性的。今天的宏观经济分析以及其他应用经济学分析所广泛依赖的建立“微观基础”的两大分析工具是：

(*) 代表人假设及基于代表人的分析

(*) 总量生产函数假设及基于总量生产函数的分析

遗憾的是，经济学理论界对于以上两个在理论经济学和应用经济学中均起到基础性作用的假设和分析工具长久以来一直存在着质疑。事实上，对于总量生产函数的挑战和质疑在 20 世纪 50—70 年代在理论经济学领域引起了一场巨大的争论：即所谓“剑桥资本争论”或者叫“两个剑桥的争论”。争论产生的结果是：争论双方都承认总量生产函数本身存在着难以解决和避免的逻

辑悖论,但是双方都认为自己获得了争论的胜利。之所以如此,是因为在新古典学派的学者看来,尽管总量生产函数作为分析工具存在缺陷,但是如果更好的新工具替代它,则放弃它是不明智的。而剑桥学派的学者则认为,通过批判揭示新古典总量生产函数的内在缺陷即意味着论争的胜利。

在本书中,笔者将建立一个新的分析框架,为宏观经济分析提供新的、更合理的微观基础。我们的框架将完全解决由代表人分析和总量生产函数假设所导致的缺陷和问题。因此,作为我们工作的一部分,本书的框架实际上提供了“剑桥资本争论”的一个解。笔者希望通过我们的新框架所开辟的新的研究思路,能够为解决经济学领域的诸多令人不满意的问题提供可能的帮助。

笔者的关键想法

笔者思考的起点是对于代表人假设的质疑。随着思考的深入,笔者意识到总量生产函数假设所导致的问题在本质上与代表人假设是类似的。如果说代表人假设相当于假设参与经济的所有个体完全相同的话,则在本质上,总量生产函数假设相当于假设参与经济的所有厂商完全相同。最初,笔者并无一体化解决代表人假设问题和总量生产函数问题的想法。毕竟,后者所导致的“剑桥资本争论”是公认的理论经济学难题。然而,笔者最终意识到两个问题的同质性后,决心攻克这个难关。

不涉及思考的逻辑过程,仅从笔者的结果看,解决代表人假设和总量生产函数问题的关键是:(1)将个体决策的过程融入社会关系的考虑,(2)将企业的生产过程加入时间。

对于第(1)点,在传统经济学分析中,个体效用函数以至其决策过程仅仅受到其接受的物质意义上的产品和服务的影响。换言之,其决策本身只涉及“人”与“物”之间的关系。但是本质上,这种处理方法只能适用于只有一个个体存在的“鲁滨逊”世界。或者说在一个每个个体都完全相同从而不存在任何交易行为的世界中,这种考虑是成立的。然而,在真实的世界中,由于个体之间的差异,由于不确定性的存在,个体的决策行为将不仅仅受到物质意义上的产品和服务的影响,也将受到各种社会关系的影响。例如,保持一个“体面”的生活到底需要多少产品和服务,实际不仅仅受到产品、服务数量和种类本身的影响,也与社会环境、社会关系相关。一旦我们放弃代表人分析,在异质个体

的世界中，个体的决策如果不考虑这种变化将产生具有误导性的结果。

对于第(2)点，传统的新古典分析对于企业直接使用一个生产函数来代表。这样导致的一个问题是：完全忽略了企业生产本身所需要花费的时间。在理论经济学领域，尽管针对新古典体系中的生产函数有着各种批评，但是至少笔者还没有见到从企业生产需要花费时间的角度展开的批判。根据本书分析的结果，将企业的分析加入时间因素，即考虑企业的生产经营活动所需要花费的时间，而不是像传统的生产函数那样，将各种生产要素放在一起立即获得产出的做法，是解决包括资本加总、帕西内蒂悖论等“剑桥资本争论”所涉及难题的关键所在之一。

明确了以上两点，剩下的问题是如何建立一个合理的数学架构展开对于异质个体构成的经济以及异质个体之间相互作用的社会关系的分析。对此，笔者的处理方法是：将构成经济的各个异质个体不再看作一个个体构成的集合，而是看作一个由许多相互关联的个体构成的社会网络。使用合理的数学架构对该社会网络展开分析，包括在网络环境下个体决策的分析，即可建立我们的模型。

本书所建立的模型，第一个最明显的优点是，完全不需要借助任何辅助性的或者说前提假设，模型在不存在“刀锋”条件的前提下，可以同时与多个观测事实相符合。更重要的是，迄今为止还没有文献能够同时与这几个观测事实相符合。在这个意义上，我们的模型是一个较之新古典体系更好的分析工具。我们模型的第二个优点是，可以完全不需要借助代表人、总量生产函数等分析工具，从而不存在借助这两种分析工具所导致的逻辑悖论。

20世纪70年代以后“剑桥资本争论”逐渐淡出了学术领域，新一代的学者逐渐不再提及甚至不再知道这个重要的理论问题。其中的关键原因是：尽管争论双方都承认新剑桥学派的批评是有道理的，或者说新古典的整个分析框架在基础上存在致命的逻辑缺陷，甚至可能动摇整个框架的稳定性，但是新古典框架的辩护者和坚持者却认为：新古典框架本身在实证的意义做得还不错，这样在更好的新工具出现之前，放弃旧工具是不明智的。而我们的工作，在实证的意义，或者说在解释观测事实的意义，较之已有模型能够做得更好，同时又可以避免新剑桥学派所批评的那些问题，因此可以认为我们的框架构成了“剑桥资本争论”的解。更有趣的是，我们的框架甚至可以解释为什么新古典框架在存在逻辑悖论的情况下还能够“打中”观测。

全书主要内容

本书分为三个大的部分,分别是观点篇、分析篇和结语篇。观点篇包括了第一章和第二章,主要介绍全书的主要观点、建模过程的主要细节以及主要的结论。第一章从总体上介绍全书的研究出发点和论述的逻辑过程。特别是从方法论的视角,介绍了本书作为判断依据的模型好坏的标准。第二章首先介绍本书建立模型希望同时解释的几个观测事实,然后详细介绍了本书模型的建模细节。

本书第二部分是分析篇。这部分包括了第三、四、五、六、七各章。这部分内容是使用本书对经济分析领域的具体问题进行分析,特别是使用我们的分析框架解决在理论经济学研究历史上长时间悬而未决的几个难题:代表人假设问题、总量资本函数难题、“剑桥资本争论”相关问题等。具体来说,第三章介绍代表人假设背后的理论缺陷和逻辑问题,以及基于本书模型的解决思路和解决方法。第四章介绍总量生产函数假设背后的逻辑问题和其所导致的理论悖论,然后介绍基于本书模型的解决思路、方法以及相关结论。

在第五章,我们介绍了传统的一般均衡分析的一些缺点及我们的解决方法。第六章介绍本书模型与基于演化观点的经济学派之间的关系,以及本书模型在此领域的主要贡献。在本书第七章,我们给出了基于本书模型对于“剑桥资本争论”问题的解。

本书的第三部分是结语篇。这部分是全书的总结。在第八章,我们在总结全书的基础上介绍了全书主要观点和思想在直觉上的起源以及各个关键性假设与主要经济学流派——新古典学派、凯恩斯学派、马克思主义经济学派之间的关系。同时,还基于本书框架介绍了笔者正在进行的下一步研究工作。

阅读建议

从读者的受众群体上看,笔者并不希望本书仅仅局限在少数专业读者的范围。因此,对于不同类型的读者,笔者给出不同的阅读建议。如果你是一名对于理论经济学相关基本问题,比如代表人分析、总量生产函数、“剑桥资本争论”和一般均衡分析比较熟悉的读者,建议的阅读次序是本书的正常章节编排

次序,即从第一章开始,依次阅读,直到最后一章。

如果你是对于以上相关基本理论问题稍显陌生的读者,建议阅读次序是:首先阅读本书第一章,然后阅读本书第二部分相关章节。最后再返回阅读第二章和第八章。即对于此类读者的建议阅读次序是按照第一、三、四、五、六、七、二、八章的次序展开阅读。

最后,笔者希望使用王阳明的两句诗作为笔者写作全书过程感受的一个总结:

须从根本求生死

莫向支流辩浊清

在笔者看来,当一个体系根本性的问题没有解决的时候,理论研究者需要有直面并解决基本问题的智慧和勇气。这也正是激励笔者坚持下去的理由之一。

刘晓峰

2011年4月

目 录

第一部分 观点篇

第一章 总论	(3)
第一节 为什么要写作此书	(3)
第二节 科学的研究、分析方法与“好理论”	(5)
1.2.1 可证伪性标准	(5)
1.2.2 是否提出新观测预言	(8)
1.2.3 对于模型参数要求是否具一般性	(9)
1.2.4 模型是否包含不可测度参数	(9)
1.2.5 模型要求的自由参数个数多少	(10)
1.2.6 模型解释观测事实的个数	(11)
1.2.7 模型的简洁、优雅——奥卡姆剃刀原则	(11)
第三节 现有经济学理论简评	(13)
1.3.1 从微观到宏观的逻辑	(13)
1.3.2 解释观测事实方面的缺陷	(16)
1.3.3 代表人假设导致理论缺陷	(19)
1.3.4 总量生产函数方面的问题	(20)
1.3.5 一般均衡分析中的长期与短期	(23)
第四节 本书的基本观点及论述的逻辑过程	(24)

1.4.1	分析的起点	(24)
1.4.2	关键性假设	(25)
1.4.3	分析原则与思路	(27)
1.4.4	主要结论与主要观点	(27)
第五节	全书结构	(29)
1.5.1	全书内容与结构介绍	(29)
1.5.2	阅读建议	(31)
第二章	观测事实与模型分析	(32)
第一节	主要观测事实	(33)
2.1.1	观测事实一:卡尔多(Kaldor)事实	(33)
2.1.2	观测事实二:结构变化事实	(35)
2.1.3	观测事实三:新产品进入与旧产品退出	(37)
2.1.4	观测事实四:长期货币中性	(37)
第二节	现有理论模型之缺点	(38)
2.2.1	统一理论的缺乏	(38)
2.2.2	“刀锋”条件	(38)
2.2.3	被忽略的观测事实三	(42)
2.2.4	回到观测事实一:增长理论	(44)
第三节	我们的模型一:外生货币	(50)
2.3.1	模型一:经济的总体描述	(50)
2.3.2	模型一:货币	(52)
2.3.3	模型一:家户	(52)
2.3.4	模型一:厂商	(60)
2.3.5	模型一:经济指标	(65)
2.3.6	模型一:经济的长期动态	(67)
第四节	模型一:讨论	(69)
2.4.1	生产周期的差异	(69)
2.4.2	物质资本累积与金融资本累积	(69)
2.4.3	主观折现因子	(70)
第五节	模型一的预言与观测事实	(71)
2.5.1	简单的参数校验	(71)
2.5.2	平稳增长	(71)
2.5.3	观测事实四:讨论	(72)

2.5.4	模型一中的黄金律	(73)
2.5.5	库兹涅茨(Kurznets)事实(观测事实二)	(74)
2.5.6	数字例子一	(75)
2.5.7	数字例子二	(77)
2.5.8	数字例子三	(77)
2.5.9	产品篮子变动	(78)
第六节	模型二:内生货币	(79)
2.6.1	模型一的弱点	(79)
2.6.2	模型一的拓展:货币内生之加入中央银行	(80)
2.6.3	传统框架:没有商业银行的货币理论	(81)
2.6.4	内生货币的模型二:经济的总体描述与货币引入	(82)
2.6.5	商业银行的决策	(84)
2.6.6	模型二:家户	(87)
2.6.7	模型二:厂商	(89)
2.6.8	模型二:经济指标	(89)
2.6.9	模型二:经济的长期动态	(91)
2.6.10	模型二:相关讨论与观测事实	(92)
第七节	总结与评论	(93)
2.7.1	模型一与模型二的总结	(93)
2.7.2	评论之一:总量生产函数	(94)
2.7.3	评论之二:代表性个体	(94)
2.7.4	评论之三:“看不见的手”与竞争的本质	(95)
2.7.5	评论之四:市场结构与经济均衡	(96)
2.7.6	评论之五:短期均衡与长期均衡	(96)
2.7.7	评论之六:演化观点与经济运行	(97)
2.7.8	评论之七:利率、资本边际产品及剑桥资本争论	(97)
附录 A		(98)
附录 B		(100)

第二部分 分析篇

第三章	代表人——一个“本轮”	(105)
-----	-------------	-------

第一节	介绍	(106)
第二节	代表人分析框架的缺陷	(108)
3.2.1	代表人假设意味着“无交易”经济	(108)
3.2.2	代表人框架与收入分配、要素份额	(110)
3.2.3	代表人假设:过于严苛的加总条件	(113)
3.2.4	市场总需求线的性质与 SMD 定理	(116)
3.2.5	SMD 定理的基于直觉的解释	(118)
3.2.6	代表人框架与经济政策分析	(121)
3.2.7	代表人假设与时间偏好率	(124)
3.2.8	代表人假设与实证证据	(126)
3.2.9	总结与评价	(127)
第三节	基本思路与基本观点	(128)
3.3.1	分析的起点	(128)
3.3.2	选择的过程与作者的直觉	(130)
3.3.3	笔者基本观点的总结	(138)
第四节	模型构建的几个关键点	(139)
3.4.1	如何定义社会网络	(139)
3.4.2	社会网络中个体的偏好表示	(140)
3.4.3	收入分配与相对价格	(142)
3.4.4	厂商决策与社会关系	(143)
3.4.5	时间偏好率	(144)
第五节	基于模拟计算的说明	(145)
3.5.1	模拟程序中社会网络的确定	(145)
3.5.2	参数设定与模拟结果	(146)
第六节	讨论与总结	(148)
第四章	总量生产函数——另一个“本轮”	(150)
第一节	介绍	(151)
第二节	有关生产函数的加总条件	(152)
4.2.1	总量生产函数的发展历史	(152)
4.2.2	什么是关于生产函数的可加性	(153)
4.2.3	加总条件	(154)
4.2.4	费舍尔(Fisher)的模拟分析	(157)
4.2.5	对于加总条件的总结	(159)

第三节	总量生产函数与国民经济统计账户的“同一性”	(161)
4.3.1	什么是“同一性”	(161)
4.3.2	横截面数据中的同一性与柯布一道格拉斯生产函数	(162)
4.3.3	时间序列数据中的同一性与柯布一道格拉斯生产函数	(163)
4.3.4	新古典学者的回应及笔者的评价	(167)
第四节	基本观点与解决思路	(168)
4.4.1	对总量生产函数批评的补充	(168)
4.4.2	我们的解决思路	(170)
4.4.3	要素收入份额保持稳定的直观解释	(172)
第五节	总量生产函数的规模报酬	(173)
4.5.1	对规模报酬不变假设的质疑	(173)
4.5.2	规模报酬不变假设与“刀锋”条件	(174)
4.5.3	我们的观点	(177)
4.5.4	基于模拟计算的说明	(178)
第六节	讨论与总结	(182)
第五章	一般均衡相关问题之讨论	(184)
第一节	一般均衡理论简介	(185)
第二节	一般均衡分析存在的问题	(187)
5.2.1	一般均衡分析中没有真正的时间	(187)
5.2.2	均衡的稳定性和唯一性	(191)
5.2.3	一般均衡分析中的时间与不确定性	(192)
5.2.4	微观个体计算能力限制导致的问题	(193)
5.2.5	产品集合、偏好、技术的变化导致的问题	(194)
第三节	我们的观点和解决方法	(194)
5.3.1	我们的解决思想	(194)
5.3.2	“短期”与“长期”下经济的运行	(195)
5.3.3	向均衡回复速度问题的解决	(197)
5.3.4	均衡的稳定性和唯一性的解决	(200)
5.3.5	时间问题与不确定性的处理	(201)
5.3.6	个体计算能力和信息处理能力问题的解决	(201)
5.3.7	产品集合、偏好、技术的变化导致的问题	(202)
第四节	关于“看不见的手”的思考	(203)
5.4.1	“看不见的手”的另一解释	(203)

5.4.2 市场结构与经济均衡	(204)
第五节 讨论与总结	(205)
第六章 基于演化视角的模型评述	(206)
第一节 演化经济学简评	(206)
6.1.1 演化经济学的基本思想	(206)
6.1.2 演化经济学的优点与不足	(207)
6.1.3 演化经济学与新古典框架的简单比较	(208)
第二节 本书模型与演化经济学的比较	(210)
6.2.1 如何看待经济变迁与创新	(210)
6.2.2 在分析方法上的差异	(210)
6.2.3 对待时间和不确定性问题的处理	(211)
6.2.4 数学架构的建立	(211)
6.2.5 基于复杂性理论的纯粹模拟分析简评与比较	(212)
第三节 模型相关细节和模拟分析	(213)
6.3.1 遗传算法角度看待我们的模型	(213)
6.3.2 基于演化观点的模拟算例	(215)
第四节 讨论与总结	(218)
第七章 剑桥资本争论——基于我们模型的解	(220)
第一节 资本的加总：问题与解决	(221)
7.1.1 罗宾逊夫人的抱怨	(221)
7.1.2 基于我们模型的总量生产函数问题的解决	(223)
第二节 技术再转折与资本倒转：问题与解决	(224)
7.2.1 利率与资本要素的稀缺性	(224)
7.2.2 一个一般模型：单一产品	(225)
7.2.3 一个一般模型：多产品	(226)
7.2.4 萨缪尔森模型	(227)
7.2.5 技术再转折的例子	(229)
7.2.6 笔者的评论	(231)
7.2.7 我们的解决原则	(232)
7.2.8 对技术再转折等异象问题的解决	(233)
7.2.9 模拟算例：不同稳定状态的比较	(236)
第三节 斯拉法的批判与我们的解决	(238)
7.3.1 斯拉法的批判：模型一	(238)

7.3.2	斯拉法的批判:模型二	(240)
7.3.3	斯拉法的其它批判	(241)
7.3.4	笔者的评价	(242)
7.3.5	对斯拉法批判的解决	(244)
第四节	帕西内蒂悖论及其解决	(246)
7.4.1	帕西内蒂悖论简介	(246)
7.4.2	卡尔多的收入分配模型	(247)
7.4.3	帕西内蒂的收入分配模型	(249)
7.4.4	新古典学者的回应	(250)
7.4.5	帕西内蒂的反驳	(251)
7.4.6	最新的发展——帕西内蒂定理的跨期动态版本	(252)
7.4.7	笔者对于帕西内蒂悖论之解决	(257)
第五节	结论与总结	(262)

第三部分 结语篇

第八章	总结与展望	(267)
第一节	全书总结	(267)
第二节	本书模型架构与新古典分析框架的比较	(268)
8.2.1	新古典分析框架的本质特点	(268)
8.2.2	本书模型与偏好稳定性原则	(269)
8.2.3	均衡分析原则与本书模型的关系	(272)
8.2.4	信息处理原则与本书模型	(273)
8.2.5	对 GDP 概念的不同理解	(274)
8.2.6	分析的时间尺度与均衡观念的变化	(274)
第三节	本书模型的非新古典思想来源	(275)
8.3.1	源自凯恩斯的主要假设	(275)
8.3.2	源自马克思主义经济学的主要假设	(275)
第四节	未来展望	(276)
8.4.1	本书框架的应用	(276)
8.4.2	经济波动分析	(276)
8.4.3	贸易模型的改进	(277)

参考文献	(278)
英文参考文献.....	(278)
中文参考文献.....	(301)
图索引	(303)
表索引	(305)
后记	(306)

第一部分

观点篇

須从根本求生死
莫向支流辨浊清

明·王阳明