

在经济学与 哲学之间

汪丁丁 著



现代经济学学术丛书

440107

现代经济学学术丛书

在经济学与哲学之间

汪丁丁 著

人行研究生部藏书	
分类号	F0/248
总号	073159



073159

中国社会科学出版社

(京)新登字 030 号

图书在版编目 (CIP) 数据

在经济学与哲学之间 / 汪丁丁著. —北京: 中国社会科学出版社, 1996. 11

(现代经济学学术文库)

ISBN 7-5004-1933-3

I. 在… II. 汪… III. 经济学: 哲学-研究-文集 IV. F0

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (96) 第 13073 号

中国社会科学出版社出版发行

(北京鼓楼西大街甲 158 号)

北京兆成印刷厂印刷 新华书店经销

1996 年 11 月第 1 版 1996 年 11 月第 1 次印刷

开本: 850×1168 毫米 1/32 印张: 10 插页: 4

字数: 256 千字 印数: 1—8 000 册

定价: 14.50 元

出版说明

近些年来，随着国内外学术交流活动的日益频繁，在经济学界有一批中青年经济学者活跃在经济科学理论与实践的前沿，对中国经济改革进行了积极探索，提出了各种见解。这些见解，对深化我国经济体制改革，繁荣和发展经济理论研究具有借鉴和启迪作用。为了使广大读者了解他们的学术见解，我们特选择其中有代表性的作品加以出版，供研究参考。当然，其中有些观点不尽妥当，也并不代表出版者的观点，这是需要指出并申明的。

中国社会科学出版社
经济学编辑室

《现代经济学学术丛书》

编辑委员会

编 委 (以姓氏拼音为序)

崔之元 马长山 肖 耿 杨小凯
叶南奇 易宪容 俞 卫 张 红

策划人 易宪容



作者简历

汪丁丁，男，北京市人，1953年5月生于沈阳，祖籍：浙江淳安；1969年赴黑龙江生产建设兵团，曾做农活、机械修理、炼钢浇铸等工作；1974年调回北京某电子研究所做工人，其间曾发明“抗跳键积分电路”；1981年获首都师范大学（原北京师范学院）数学系理学学士学位；1984年获中国科学院系统科学研究所“数学与系统科学”理学硕士学位；1985年赴美国东西方文化研究中心访问研究，1986年转入夏威夷大学经济系博士班；1990年获美国夏威夷大学经济学博士学位，同年转任（1990—1993年度）美国东西方文化中心“东亚经济发展，文化与制度变迁”项目研究员；1991年任教于香港大学经济系；研究领域包括：制度经济学，博弈论基础，微观经济理论，资本理论，资源经济学，经济增长与发展理论，道德哲学和政治哲学；1996年赴德国杜伊斯堡Gerhard-Mercator大学任客座研究员。1997年3月再返回北京大学中国经济研究中心任教。

自序

同国内一些热心的朋友们的对话，得到他们的理解，这几乎已经成了我思考的不可缺少的条件。“文集”就是把这些对话，把这些似乎是炎夏乘凉的夜晚记录下来的“闲聊”，一股脑儿放在读者眼前。于是，我就陆陆续续出了三本这样的文集。现在，又是由于一位理解我的朋友和建议和督促，由于编辑张红女士的努力，第四本这样的文集又开始了它自己的生命。

那位朋友告诉我，这本文集是《现代经济学学术丛书》的一种。“现代”，什么是现代性？为什么叫做“现代经济学”？当我们说“现代经济学”的时候，什么是我们所要意味的？这些问题正是我近来对新制度经济学以及新古典经济学进行批判性整理时常常思考着的问题。我的这些思考和经过我整理的经济学，是我希望写出来并且正在写的第一本专著。眼下的这本文集所收录的论文，它们是我在经济学与哲学之间还没有超越经济学时的思考的记录。

现代性，它的第一个特征就是“反思”。所以哈贝马斯说康德是开启了“现代性”的第一人。当然，任何哲学都是反思，所以我们不妨说，苏格拉底的启蒙就是现代性的开端。反思的第一个结果是黑格尔和德克海姆首先发现的“现代性危机”：分工社会的发展和道德共识的瓦解，财富的增长和社会基础的崩溃。于是人类的反思首先就引发了经济学和道德哲学的思考。

我发现，所谓的“现代经济学”，其实没有回答现代性危机引

发的问题。在当代经济学与当代哲学之间的，是一段沉默的距离。经济学家们，至少他们的大多数，埋头在日常经济问题中，正像海德格尔说的：必死的生命在烦忙中希望由“忙”而避免思考那“死”的必然性，避免那对于“死”的烦。中国改革，中国社会变迁，中国目前面临的问题，中国的基本困境，不可避免地就是人类一直以来面临着的基本困境，也就是由黑格尔提出的那个现代性危机。所以中国人在现代化过程中对现代性危机的回应也就是人类对现代性危机的再次回应。

收录在这里的第一篇论文就是我对经济学的批评，同时也阐明了我所理解的经济学的“现代性危机”。只有对经济学进行“反思”才可能使经济学进入“现代”。而我对经济学的反思，把我带回到了经济学的古典时期。回到“古典”，才可能进入“现代”。我的这个立场表现在我对市场经济的“道德基础”的理解中。我的道德哲学思考贯穿着收录在这里的几乎全部论文。

经济学家思考道德哲学问题的方式是在现实中思考。“在历史中阐释，在阐释中创新”。这不仅是这本文集最后两篇论文的主题，也是穿插在文集内那些讨论现实经济问题的文章的方法论基础。

最后，我想借这个“自序”写几句感谢我的父亲和母亲的话（我对其他人的感谢和赞美，都写在为其他文集作的“自序”里了）。在我人生旅途刚刚开始的那个阶段，我走过了几个十字路口。如果不是父亲的指点，我一定已经无可救药地迷失了。在我记忆所及的生命过程中，我几乎始终享受着提问、思考和说话的自由。我仔细地检索我的记忆，我看到我的母亲不断地，常常是毫无希望地追求她自己的梦。我觉得正是母亲的榜样让我理解了“自由”的真实涵义。我的父亲和母亲，他们是知识分子，同时他们是革命的一代。理想，只要是真的，就永远是感人的。父母的理想，在感人之外还带着亲切。读者一定能够从我的文章中看到我的父亲和母亲的影子。

“卢卡斯批判”以及批判的批判

罗伯特·E·卢卡斯及“理性预期”学派的工作，于1995年得到诺贝尔经济学奖委员会的承认。记得哈耶克在接受1974年诺贝尔奖时警告人们，任何知识都只是局部有效的，诺贝尔奖带来的危险是使社会盲目崇拜某一种局部有效的知识从而助长其滥用权利（感谢后现代主义批判家们，我们现在知道了知识就是权利，“话语”的权利）。我欣赏伍迪·艾伦从不参加评选奥斯卡金像奖的态度。不过，既然有了1995年的诺贝尔经济学奖，我也不妨借题发挥，借了介绍卢卡斯的工作之机，发挥一下我对经济学存在的基本问题的看法。

这篇文章分成三部分。第一部分综述卢卡斯本人的主要工作，这些工作又分做“早期”、“中期”和“后期”。因为从新闻中知道，诺贝尔委员会奖励的是他“发展和应用理性预期假设，由此改变了宏观经济分析和深化了我们对经济政策的了解”（《明报》1995年10月11日）。据我的理解，这是卢卡斯“中期”的工作，又被称为对凯恩斯主义的“卢卡斯批判”。第二部分评价卢卡斯及“理性预期”学派在整个经济学中的地位。第三部分讨论经济学存在着的基本问题以及为了解决这些问题，经济学未来的走向，这构成我所谓“批判的批判”。

一、对凯恩斯宏观经济分析的“卢卡斯批判”

卢卡斯，1937 年生于美国华盛顿州，1959 年于芝加哥大学得到历史学学士，1964 年仍于芝加哥大学得到经济学博士。1970 年他在卡内基—梅隆大学得到教授职位，1974 年加入芝加哥大学任教至今。

在我看来，卡内基—梅隆学派的赫伯特·西蒙 (Herbert Simon, 1978 年获得诺贝尔经济学奖)，以其非正统的分析方法至少影响了曾经在他身边工作或学习过的两位目前著名的经济学家——卢卡斯和奥利弗·威廉森 (Oliver Williamson, 新制度经济学主要人物)。卡内基—梅隆的风格是“管理学院”的风格，一切理论都应当切合经济、社会和人类心理的现实，因此卡内基—梅隆学派注重行为学和组织理论的研究。西蒙最早把“有限理性”假设引入经济学，同时觉得有必要深究“不确定性”给经济分析带来的变化。西蒙的两篇论文对卢卡斯早期的研究有很大影响，一篇讨论不确定性情况下动态规划，另一篇综述经济学中的决策理论 (参见 Herbert Simon, ‘the dynamic programming under uncertainty with a quadratic criterion function, *Econometrica* 24(1956): pp. 74—81; 及 ‘theories of decision-making in economics.’ *American Economic Review* 49 (June 1959): pp. 253—283)。

卢卡斯早期的研究 (60 年代中到 70 年代初) 集中于单个企业和单个工业的最优投资问题 (参见卢卡斯, 1965, ‘distributed lags and optimal investment policy’; 1966, ‘optimal investment with rational expectations’, in Lucas and Sargent, eds. *Rational Expectations and Economic Practice* London : George Allen &

Unwin, 1981), 这在当时 (60年代) 的经济学系和管理学院是一个重要的研究方向, 受到大经济学家诸如西蒙, 肯尼思·阿罗 (Kennith Arrow, 以其一般均衡理论与希克斯一起获1972年诺贝尔经济学奖), 乔金森 (Dale Jorgenson, 哈佛教授), 佛朗哥·莫迪利亚尼 (Franco Modigliani, 1985年获得诺贝尔奖, 60年代初在卡内基—梅隆任教, 后终身任职于 MIT), 尤金·法玛 (Eugene Fama), 兹维·格里利希 (Zvi Griliches, 哈佛教授, 60年代中期任教于芝加哥大学) 等人工作的推动。那个领域是应用最优控制理论的活跃场所 (以阿罗的研究为先导)。我相信卢卡斯当时所用的那种动态规划分析方法始终伴随着他的理论表述, 以致“理性预期”学派及其“新宏观经济学”必须在80年代末推出一本专门讲授动态经济学“递推方法”的大部头著作, 以消除那些在萨缪尔森经济分析传统下长大的经济学家的陌生感 (参见 Nancy Stokly and Robert Lucas: Recursive Methods in Economic Dynamics, 哈佛大学出版社1989年)。而我本人 (以中国科学院数学硕士, 最优控制理论专业的资格), 至今仍不认为那是表述动态经济学思想的必要方式。

单个企业的最优投资问题成为当时宏观经济学研究的热点, 因为: (1) 凯恩斯的宏观经济理论认为, 30年代经济危机产生于“有效需求”不足, 而投资正是需求方面最重要最主动的因素 (凯恩斯《通论》的基本假设之一是“消费惯性”假设, 也就是说在总收入中用于消费的部分由于习惯而变动缓慢, 对比之下, 资本投资的变动不居成了经济波动的主因)。但是凯恩斯并没有深究投资者的动机, 他凭着直觉把投资动机分成两部分。首先是“自发性投资”, 受到资本家的“野兽冲动” (animal spirit) 的驱使。其次是投资者基于对市场信号 (例如利率变化, 价格变化, 总产值的增长等等) 的观察作出的理性投资决策, 我们不妨称之为“理性投资”。随着凯恩斯主义在战后的成功, 对投资动机做深入研究,

从而理解经济持续增长的原因,是战后经济学顺乎自然的选择。但是,当经济学家们深入研究投资与增长的各种因素时,在英国和美国的学术思想传统之间发生了严重分歧,史称“两个剑桥”之争(一个是英国剑桥大学,凯恩斯主义大本营,认为市场体制有严重缺陷并且与收入分配不平等相关联;一个是美国剑桥,麻省理工学院和哈佛大学所在地,新古典经济学大本营)。争论的焦点是资本理论,但由于资本理论的深刻性,争论几乎涉及了社会 and 经济学全部领域,从50年代延续到60年代。读者可以参考弗兰克·哈恩(Frank Hahn,剑桥经济教授)与马修斯的综述文章“经济增长理论”(‘the theory of economic growth: a survey’. Economic Journal December 1964)。以上的讨论构成了卢卡斯所受教育的第一个大背景。(2)投资与市场信号的关系,尤其是从古典经济学承传下来的所谓“加速度原理”(即认为投资总额正比例依赖于总收入的增长额),在战前的经济研究中已经传统地被认为是造成“生产能力过剩”型经济周期的主因。道理很简单:当总收入增长时,不论是价格信号、边际利润、利率信号(有争论),还是按照收入减去习惯消费所剩余的可供投资的基金,都相应增长,于是投资者为追求利润而增加投资。但是增加了的投资,按照凯恩斯的解释,进入总需求,产生了“乘数效应”(即初始的需求诱致初始的供给,但是供给同时产生了对投入品的需求,这第二层需求又诱致第二层供给,如此无限推引,如果所有这些需求加在一起是收敛的,那么就存在一个大于1的实数,它是每一单位增加的需求在这个无限过程中所创造出来的新的收入),也就是进一步增加了总收入。这个加速的运动一直进行,直到整个经济膨胀遇到某种资源(或者货币供给)限制为止。一旦扩张停止,利润率下降,投资就会缩减,并且形成反向的加速运动,一直到整个经济下降被某种“底线”阻挡住(例如资本品自然消耗殆尽,又例如出现了新的市场和外来的需求增长),然后开始新的

循环。在这个传统观念的主导下，投资问题就成了经济波动研究的核心问题；另一方面，波动与经济信号的不确定性给投资理论提出了新的问题。事实上，以罗伯特·艾斯纳为首的企业投资与推广了的加速度原理研究给了卢卡斯早期研究很大的影响。(3) 投资问题的时间特征要求使用远比由萨缪尔森在40年代后期完善了阿尔弗雷德·马歇尔的静态分析方法复杂的动态方法。试想一个简单的故事：你用第一个月节约下来的午餐钱在第一个月的第一天买了将在下个月到期的银行存款证 (bank CD)。你的最优决策应当是比较以下两件事：首先，你放弃了一些午餐，也就是一些“幸福”，这叫做“成本”。如果你不投资，你原本可以享受那些幸福的。其次，你所放弃的午餐幸福，在第二个月给你带来了一定的利息收入，也就是增加了你将来可以享受的幸福，这叫做“收益”。你的决策是使收益减去成本在某种投资策略下达到最大值，你的任务是找到那种最优的投资策略。在静态分析中，这个最优策略是保证你从未来利息所得到的“边际效用”等于你所放弃的午餐所带走的“边际效用”的那个策略。实践起来，你可以先通过你自己的价值判断实验地画出一组“无差异曲线”(问你自己当你正在享受某一定量的现在幸福和未来幸福时，你打算放弃多少眼下的幸福来换取一个单位未来的幸福，这就是你正在享受的幸福所对应的那个无差异曲线在对应于现在幸福与未来幸福量处的斜率，你将能够在现在幸福和未来幸福的平面直角坐标系中画出一组曲线在每一个点处的斜率)，然后在你目前正享有的现在与未来幸福的那一点上，问你自己，为了换取利息带来的一个单位幸福，你愿意放弃多少单位的现在幸福？把这个答案与和它相等的那个无差异曲线的斜率重合起来，你就找到了一个静态最优策略。现在，我们把这个故事稍微变化一下：假设你每一天存入银行的午餐费都按照复利计算到下个月换取利息。现在你的问题复杂得多，因为较早存入银行的午餐费产生较多的利息；另一方面，较早存

入银行也较早地放弃了享受午餐的幸福。所以为了比较,你应当把所有距离今天不同时间的幸福按照某种折现率贴现到今天,然后寻找投资策略使总的现值计算的收益减去成本达到最大值。从原理上说,上面讲的静态方法仍然可以用于这种情况,但非常麻烦。所以我们通常使用动态方法,它只需要用一个贴现值计算公式,把每一项成本和收益结合进去,形成一个所谓“净现金流”(net cash flow)。投资决策就是最大化这个现金流的现值。这是香港人(凡做过投资的)都非常熟悉的方法了。这种方法的时间特征与资本理论使用的最优控制理论是一回事。这就是卢卡斯早期工作的第三个大背景。

为了说明卢卡斯及理性预期分析的方法,我们不得不先说明一下最优控制理论要解决的基本问题。就像上面的故事所显示的那样,所谓决策,就是在每一个时刻,决策人必须采取一个“行动”,当时间从所考虑的时期的开始时刻流向终点时刻,就要求决策人一连串的行动。我们称这一连串的行动为一个“方案”或一个“策略”。决策人通常在每个时刻可以有許多选择,于是从这许多个时刻上的选择可以组合成许多方案(假如你在两个时刻各有两个选择,那么你可以组成4个不同策略;假如你在三个时刻各有三个选择,那么你可以组成27个不同的策略。通常,策略的数量比可供选择的行动多得多)。最优控制理论就是研究如何在如此众多的可能方案中找到最优的那些方案(“最优”可以是净现值最大,可以是总效用最高,可以是任何对计划者有意义的“目标”)。读者可能会不以为然:现代计算机的能力足够从任何数目的方案中一个一个地试算出那些最优的来,其实不然。在中国政府第八个“五年计划”中有一个重点研究项目是以中国科学院和清华大学为首的几十所“重点院校”合作开发一个“系统设计软件包”,其中数学家们努力的目标之一就是寻找优化算法。当中国国家计划生育委员会在80年代试图计算未来50年最优的人口生育

率时，他们发现最先进的计算机仍远远不够用来计算以“年”为时刻点的按年龄分布的人口控制过程产生出来的如天文数字之多的可能方案。这个事实非常重要，因为早期的哈耶克反对计划经济的理由之一，就是这种社会计划的“空想性”。我们在第三部分还要看到，理性主义运动始终要与之对抗的困难之一就是如西蒙（“有限理性”假设）早就说过的，没有人能够完成如此复杂的理性计算。

现在可以介绍著名的“卢卡斯批判”了，这是他“中期”的工作（从70年代初到80年代初）。这个名字来自卢卡斯自己的文章，“计量经济政策评价：一种批判”（‘*econometric policy evaluation: a critique*,’ in *The Phillips Curve and Labor Markets*, Carnegie-Rochester Conference Series on Public Policy. North-Holland, 1976）。在这篇论文中，他批判了凯恩斯主义企图把市场经济当做一架机器来调节的宏观经济政策。从现代博弈论角度看，卢卡斯的观点以及他在其他文章里的思想（参见 Lucas, 1972, ‘*expectations and the neutrality of money*’, *Journal of Economic Theory* 4: pp. 103—124; 1975, ‘*an equilibrium model of the business cycle*’, *Journal of Political Economy* 83: pp. 1113—1144），可以分做两个部分来解释。首先，任何政策都是政府与私人部门之间的博弈。双方力图猜中对方的最优策略。因此，如果政府把私人部门当成被动的“机器”来控制，其政策的基本假设已经错误了。当把政策制定过程视为政府与私人部门之间的博弈时，政府的每一个策略（例如货币政策的改变、利率调整、实行最低工资率、增加社会福利开支等等），如果已经被私人部门准确地预见到，则政策的“货币效应”将消失，顶多，政策所包含的实质性变化，即“物质性”的行动，将会产生如同一个私人部门的“物质性”行动一样的经济效应。因此，政府的货币政策将是“中性”的，不会产生任何物质力量。而政府的财政开

支将以其物质力量与私人部门竞争资源，产生所谓“挤出效应”（crowding out effect），即每一元政府开支从市场里挤出去一元钱的私人开支。结果，政府开支仅仅是替私人花钱而已。纳税人知道，让别人替自己花自己的钱，不如自己花自己的钱来的节约。所以政府的任何政策，不论是货币的还是实物的，都不会产生有益于社会的效果。这个论证，如果被经验数据证实，当然是对凯恩斯经济学的重大打击，所以称为“卢卡斯批判”。其次，理论必须解释为什么在战后确实出现了持续繁荣，是否与凯恩斯政策有关系；如果有关系，理论上如何解释？于是卢卡斯批判需要引进很强的“不确定性”，以便产生所谓政府政策的“惊讶”效应。不必使用什么随机过程分析，我只需要读者想象一个接电话的故事（我认为这是卢卡斯的“岛屿模型”的生活版）：假如你在美国通过越洋电话用英语指示你在香港的股票经纪人买卖股票，并且你知道你的电话听不大清楚。假设你打算买卖两种股票，它们在股票市场上的计算机号码分别是15（跌的时候买进）和50（跌的时候卖出）。这时候你听到经纪人说，代号15的股票突然跌了，你会做如下两种设想：第一，实际上经纪人说的是代号50的股票跌了；第二，他说的确实是15号跌了。你应当做的计算是，首先，估计一下到底你听错的可能性是多大。其次，如果错的可能性不大，你计算买进15号股票的数量，尽量使可能赚到的钱超过可能因为听错而亏损的钱。最后，如果你认为这电话听错的可能性相当大（接近50%），你可以选择“不行动”，等候你的经纪人第二次来电话。经过多次通话，你总可以认定正确信息。卢卡斯觉得，凯恩斯政策如果短期内有效，那就是因为市场中存在大量“接电话”的噪音使私人听不清信号。当大多数私人因为听不清信号而放弃行动时，政府相当于在与一个完全被动的机器博弈，所以很容易实行“最优控制”以达到预期效果。但是当人们反复听取信号，终于搞清楚了政府意图时，博弈就又回到主动的理性人之间的博弈了，也就是上述第一

部分解释的情况。战后繁荣的代价就是，政府为了不断造成“惊讶”效应，必须不断使自己的政策强度升级。于是，我们观察到各国财政赤字以加速度上升，终于难以为继。这是凯恩斯式经济政策的代价。

卢卡斯的这些工作使他成为“理性预期”学派的主要人物。但是使这个学派的工作能够融入主流经济学的则是经济学大师米尔顿·弗里德曼（Milton Friedman，获得1976年诺贝尔奖），虽然“理性预期”派的学者总是声称计量经济学家约翰·穆特（John Muth，‘rational expectations and the theory of price movements’，*Econometrica* 29 (6), 1961）是他们的先驱。弗里德曼在1968年的文章“货币政策的作用”（‘the role of monetary policy’，*American Economic Review* LVIII (1), 1968）中已经说明了为什么凯恩斯主义的货币政策只可以产生“惊讶”效应。“理性预期”在弗里德曼文章里被叫做欧文·费雪效应。费雪是投资理论的美国祖师，他的预期学说又是承袭了北欧学派本世纪初的大家，克努特·威克塞尔的利息理论。后者提出的所谓“实质利率”就是名义利率减去预期的通胀率（在类似一般均衡状态下）所得。在对凯恩斯革命反击的运动中，只有弗里德曼的思想、分析方法及语言才显出对正宗经济学传统的继承。

卢卡斯在发表“理性预期”派的文章同时，几乎马上就开始了他“后期”（80年代）的工作。这是因为，其间理论上的密切联系。如上述，投资问题直接就是经济增长与波动的研究领域中的主要课题。于是卢卡斯在反击凯恩斯货币政策的同时，就在经济增长与波动理论方面展开了他“理性预期”的思想。随后，他的动态理论中又融入了加里·贝克尔关于人力资本在经济增长中的重大作用的思想。这就是他著名的文章，“经济发展的机制”（‘mechanics of economic development’）。这些工作使卢卡斯成为新经济发展理论的重要人物。我个人以为，他后期的工作是最精彩的。这些工