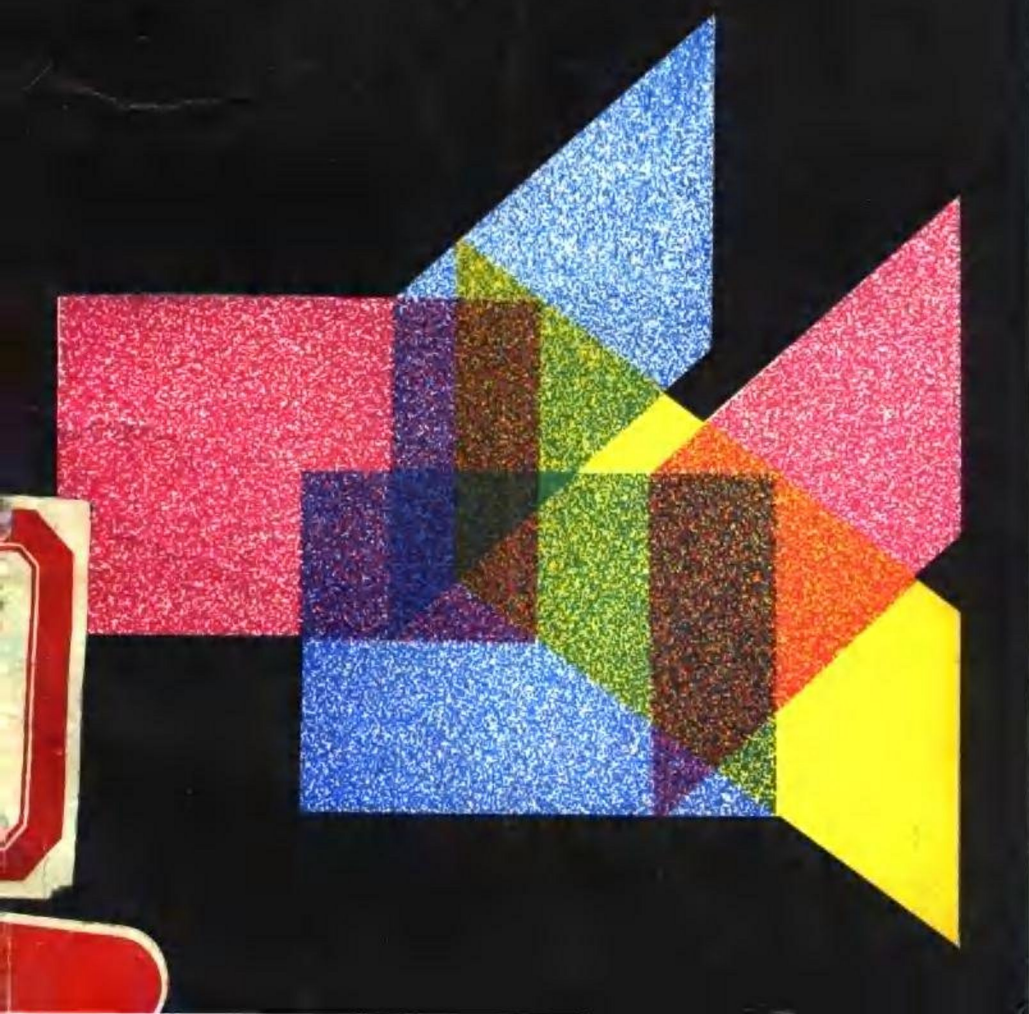


西方经济理论 与实证方法论

陈 璋 陈国栋 刘霞辉 著
北京大学出版社





中财 B0002342

西方经济理论与实证方法论

陈 璋 等著

604732

中央财经学院图书馆藏书章

总号 419958

书号

北京大学出版社

新登字（京）159号

书 名：西方经济理论与实证方法论
责 任 者：陈璋等著
标准书号：ISBN 7-301-01884-3/F·157
出 版 者：北京大学出版社
地 址：北京大学校内
邮政编码：100871
排 印 者：北京大学印刷厂
发 行 者：北京大学出版社
经 销 者：新华书店
版本记录：850×1168毫米 32开本 13.625印张 350千字
1993年10月第一版 1993年10月第一次印刷
印数：0001—2000册
定 价：11.00元

作 者 序 言

我们对有关西方经济学的方法论和研究方法的学习研究早在六年前就开始了。现在这种理论学术性较强的著作得以出版实属不易,我们首先感谢北京大学出版社的有关领导、编辑同志,特别是彭松建教授的关心和支持,否则这本书是难以顺利出版的。下面就写此书的目的和意义简要谈谈我们的初步认识,以帮助读者了解我们写作本书的中心思想和内容。

众所周知,我国改革开放以来,我们已深深感到了西方发达国家从社会经济的各个方面对我们的影响。就经济理论而言也是如此,应该承认,西方经济理论对我国经济理论界的冲击在一定程度上是客观的,难以避免的,也将是长期的。因而在这种冲击下,对于我们研究我国社会主义经济理论的各种问题所带来的种种影响在一定程度上也将是客观的、长期的。西方经济理论对我国理论界影响现实的客观性表明,片面采取绝对地否定、绝对地肯定的态度都是不正确的。因此,我们认为,如何按照一般理论研究的科学态度,去认识和借鉴西方经济理论、特别是其方法论和研究方法,将成为我国经济理论研究中首先要解决的主要基础问题。

应该说,如何正确地认识西方经济理论价值的问题是一个重大的现实与理论问题,同时又是一个研究难度十分大的学术问题,很难找出一般性的充分必要条件作为我们要达到的明确标准。根据我们的学习和认识,下列四个方面的必要条件也许是我们能够努力达到的主要概略性前提。

1. 较扎实地掌握马克思主义的基本原理及其经济理论思想;

2. 掌握有关西方经济学的学习和研究必备的基本素质知识(主要指有关数学知识和思想);

3. 了解有关西方经济学基本经济理论的逻辑及研究方法(主要指有关实证经济学部分和实证研究方法);

4. 了解有关作为西方经济理论研究逻辑和方法论基础的西方科学哲学理论(主要指波普的证伪主义和库恩的历史主义等学派的内容)。

以上似乎是我们较短时间内能够努力把握的较明确的必要条件。我们认为如果能基本上达到上述条件,也许就能较好地从总体和逻辑上把握西方经济学的全貌,从而初步形成对其认识和辨别的基础性条件(必要条件)。

我们认为波普的证伪主义思想是西方经济学实证方法论及实证研究方法的主要哲学基础,虽然近些年来,西方经济学界也开始热衷于讨论经济方法论问题,并期望进行方法论革命。本书的第一篇主要介绍了波普证伪主义的基本思想,以及对西方经济方法论的主要影响,特别是数学方法在经济学研究中广泛应用的基本思想根源。因此,要认识西方经济学实证研究方法的哲学依据和存在的主要问题,必须从科学哲学的高度去把握和认识它。实际上,波普的证伪主义思想对现代西方科学哲学的形成产生了重要影响,但其真正占学术统治地位的时间却很短,大约只是五十年代期间,而后又出现了许多其它重要学派。证伪主义思想对西方经济学方法论的影响一直延续到现在,这不能不说明西方经济学方法论本身的确存在较大局限性。由于本书的篇幅关系,对有关证伪主义的评价和对其它重要西方科学哲学流派的介绍很少。有兴趣的读者可以去阅读有关专门介绍西方科学哲学的书籍,国内已有不少这方面的编译著。在我们的学习和研究过程中,我们深深感到,在总体上如何认识西方经济学方法论及研究方法,非常有必要去进一步探讨其思想根源的西方科学哲学的有关内容;这也是我国理论

界目前讨论中较少涉及的一个重要方面。

第二篇主要是介绍性内容,在写作上我们主要是期望通过有关西方基本经济理论实证研究过程的描述,一方面使读者了解到实证研究方法的一般逻辑程序和具体的研究方法,对西方经济理论研究发展的具体过程和实证研究方法的关系有一个较为具体地了解;另一方面,使读者跟随其研究发展的逻辑主线,找到实证方法研究经济理论的长处和存在的主要问题。由此我们期望读者读完这一篇后能对实证研究方法有一个较为全面和科学的认识态度。

我们如何看待西方经济学,如何认识和正确借鉴经济研究的实证方法,自然应是第三篇所要讨论的主要内容,也是在讨论建立具有中国特色的经济学首先要遇到和认识的基本方法论问题。由于此问题本身的难度和我们的水平所限,只能尽我们目前所能达到的认识程度上来提出自己的看法,与此同时,我们也感到书中的某些看法仍存在一定的混乱之迹,还不可能完全形成十分鲜明的观点。我们的一个基本认识是,要建立具有中国特色的经济学,理论上就必须在经济学方法论方面有所突破,这一方面要学习和借鉴西方经济学研究方法的科学成份,另一方面更要注意发展中国家和我国经济的基本特征对经济学方法论的要求。

在本书构思、写作的过程中,曾得到中国人民大学高鸿照教授的指导和支持;在本书初稿完成后又得到北京大学彭松建教授的热情关心和推荐,特别是他对本书的结构安排和书名的最终确定提出了重要的意见,并亲自担任了本书的编审工作。在此表达我们十分真诚的谢意。此外,我爱人张绮在她八小时工作之外帮助我整理和抄写了大部分手稿。

本书各章具体执笔情况如下:陈璋:第一篇的第一章、第二章;第二篇的第四章、第五章;第三篇的第八章、第九章;陈国栋:第二篇的第三章、第七章;刘霞辉:第二篇的第六章。

我们衷心希望有关专家、学者及读者对本书的有关内容、观点提出指正意见,我们将十分乐意作出答复。

陈 璋 一九九一年五月于北京

作者简介:陈璋,男,一九五七年八月生,湖南湘潭人,现为中国人民大学国民经济管理系副教授。主要著作有:《中国工农业经济预警》(两人合著),《企业股份制操作全书》(主编),《现代公司运作全书》(副主编),《新国民经济核算全书》(副主编),《股票、债券全书》(副主编),《经济学方法通览》(副主编),《企业股份制会计实务全书》(主编)等。另参加十余部教材等的编写,并在《经济研究》等杂志上发表学术论文十余篇。

目 录

作者序言	(1)
第一篇 实证方法论概述及其评介	(1)
第一章 实证方法论概述	(3)
§ 1.1 实证方法论的基础	(4)
实证方法论的哲学基础 实证方法论的数学基础	
实证方法论的一般原理	
§ 1.2 经济理论实证研究中的假设条件	(18)
理论研究的科学性与假设条件 实证研究方法与	
假设条件 经济理论研究中假设条件的分类	
§ 1.3 实证研究过程概论	(30)
实证研究的一般过程 实证研究过程中存在的	
主要问题 实证研究发展的一般趋势	
§ 1.4 从方法论角度评介西方经济理论	(39)
西方经济理论分析方法结构的演变 西方经济理论	
应用的主要限制	
第二章 实证研究方法的一般论述	(50)
§ 2.1 西方经济学与数学	(50)
经济学中的数学性 经济学中的数学轨迹	
经济学中的数学迷宫	
§ 2.2 实证研究过程的一般介绍	(61)
理论实证过程 经验实证过程	
§ 2.3 经济计量学的方法论、基本假设及其最新发展	(75)
经济计量学的基本方法论问题 经济计量学方法的	
基本假设体系 经济计量学的最新发展	
第二篇 西方经济基本理论实证过程的演示	(95)

第三章 需求分析的实证研究	(97)
§ 3.1 消费者最大效用假说与需求函数一般	(97)
效用函数和预算约束 最大效用假说和需求函数的一般形式 需求弹性 零阶齐次性 需求函数的经验形式	
§ 3.2 数据资料和总量问题	(103)
时间序列资料和横截面资料 总量问题	
§ 3.3 具体需求函数的经验实证研究	(106)
用时间序列资料求解 恩格尔曲线的估计 耐用 品需求分析 需求方程系的完全估计 需求分析 的最新发展及初步结论	
第四章 消费函数理论的实证研究	(138)
§ 4.1 从绝对收入假说到库兹涅茨反论	(138)
绝对收入假说的提出 假说的经验实证结果 库兹涅茨反论	
§ 4.2 相对收入假说	(145)
相对收入假说的要点 假说的实证推理过程 假说的经验验证	
§ 4.3 生命周期假说	(151)
假说的基本要点 假说的实证推理过程	
§ 4.4 持久收入假说	(157)
持久收入假说的要点 假说实证研究的基本构思 假说的经验实证过程 假说的进一步实证研究	(169)
§ 4.5 有关消费函数中财产变量作用的实证分析	
财产假设的经验实证	
§ 4.6 有关消费函数进一步的实证研究及一般总结	(174)
有关消费函数进一步的实证研究 有关消费函数 理论的一般性总结	
第五章 生产函数理论的实证研究	(179)
§ 5.1 新古典生产函数的基本理论实证内容	(179)

一般新古典生产函数的理论实证	柯布—道格拉斯生产函数	
固定替代弹性的生产函数(CES 生产函数)		
§ 5.2	生产函数经验实证中的两个基本问题	(192)
	统计资料的搜集和处理	生产函数的识别问题
§ 5.3	微观生产函数的经验实证	(198)
	截面数据的研究	时间序列数据的研究
§ 5.4	总量生产函数的经验实证	(208)
	总量生产函数估计的基本问题	截面数据的总量生产函数
	时间序列数据的总量生产函数	
	索洛有关技术进步的经验实证	
§ 5.5	CES 生产函数的经验实证	(216)
	SMAC 的经验实证	其它经验实证研究
	有关生产函数理论的进一步发展	
第六章	西方投资理论的实证研究	(228)
§ 6.1	投资行为的理论实证	(229)
	加速器理论	乔根森新古典理论
§ 6.2	投资行为的经验实证研究	(238)
	加速器理论的经验实证	乔根森的经验实证研究
	对乔根森经验实证的补充和发展	经验实证中的偏倚问题
§ 6.3	经验实证研究的一个实例	(261)
§ 6.4	投资函数的统计资料和估计问题	(268)
第七章	货币理论及其实证研究	(273)
§ 7.1	西方货币学说的理论实证过程	(274)
	传统的货币数量学说	数量方程的建立
§ 7.2	凯恩斯主义的货币学说	(278)
	对传统货币数量说的批判	凯恩斯的货币利息理论
§ 7.3	现代货币理论	(286)
	弗里德曼的货币理论——现代货币数量说	后凯恩斯主义

的货币理论	
§ 7.4 货币需求经验实证中的估计问题	(299)
数据和变量的定义 期望余额与实际余额	
真实余额与名义余额 联立性问题	
§ 7.5 货币需求的经验实证分析	(307)
货币需求函数的不同形式 货币需求的经验实证过程	
货币需求的利率弹性 货币需求函数的稳定性	
问题和展望	
第三篇 中国经济理论实证研究的思考与探索	(329)
第八章 对中国经济理论实证研究的思考	(332)
§ 8.1 用实证思想看中国的经济理论研究	(333)
经济学的研究对象 经济学研究的方法	
中国经济理论与西方经济理论的异同	
§ 8.2 对中国经济理论研究初始假设条件的认识	(344)
稀缺公理 “经济人”假设	
§ 8.3 中国经济理论研究的基本假设条件初探	(355)
概念的提出及一般描述 生产力非平衡结构的一般	
描述 平衡结构与非平衡结构演变数量描述生产	
力平衡结构演变过程 生产力非平衡结构演变过程	
第九章 一个例子——中国工业经济波动实证分析	
初探	(366)
§ 9.1 中国生产力及其工业生产力演变的基本特征	(367)
生产力非平衡结构形成的客观基础 生产力平衡结构与	
非平衡结构演变概述 生产力非平衡结构演变的客观性	
与稳定性 生产力非平衡结构演变与经济波动 中国	
工业生产力的基本状态及演变形式 关于我们实证研究	
方法的一个重要说明	
§ 9.2 我国工农业比例关系与工业经济波动的实证分析	(385)
理论实证分析 经验实证分析	
§ 9.3 我国工业内部比例关系与工业经济波动的实证分析	(398)

关于我们实证方法应用的一个说明	农轻工业和农业	
比例关系与工业经济波动关系的实证分析	原材料工业	
与采掘工业比例关系、重加工业和工轻工业与原材料工业		
比例关系同工业经济波动的联系		
§ 9.4 积累消费比例与工业经济波动关系的实证分析		(409)
理论实证分析	经验实证分析	
参考书目		(421)

第一篇 实证方法论概述及其评介

长期以来,实证方法论(又称逻辑实证方法论)作为西方经济学研究中方法论的核心或主流派是没有什么争议的。实证方法论所能覆盖的经济理论内容——实证经济学因而也就自然成为西方经济学主流学派关心的主要研究对象及其整个西方经济学的理论基础。本篇的主要内容包括对实证方法论思想的一般介绍;实证研究方法的一般过程及其每一阶段主要内容的评介;对西方经济理论实证研究中存在的主要问题及发展趋势的一般评介;对西方经济学中数学应用的基础,演变及问题的评介;对实证方法在经济研究具体应用中的过程及其存在的主要问题的介绍和分析。

本篇对有关实证方法论的评介,主要是从两个层次上展开的。首先,我们是从学习和了解的层次上来介绍和分析实证方法论主要思想和逻辑结构的。其目的是为一般读者描述实证方法论的哲学基础、数学基础及其有关的基本问题;这其中我们针对我国传统经济研究方法存在主要问题,突出地对实证方法中理论假说及假设条件有关问题进行较深入地讨论。其次,在前一层次的基础上,我们针对实证方法论与西方经济理论演变的关系,西方实证方法论的基本特征,以及实证方法论在西方经济理论研究中存在的主要问题展开了较深入的分析 and 评介。在这一层次上,既有对一般实证方法论存在的主要问题的分析和评介,也有对实证研究中具体方法应用存在的问题的分析和评介,从而使读者对实证方法论有

一个全面,深入的认识和评介。当然,由于经济学方法论问题本身的复杂性及其我们对此认识的肤浅性,仍深感本篇内容在有关资料的收集方面,在对西方经济学方法论最新发展的了解和认识方面存在不同程度的欠缺。如果本篇的内容能使读者感觉到对西方经济理论方法论认识必要性及其有关研究兴趣,能够初步认识到西方经济理论的方法论也存在其深刻的局限性。这就达到了本篇写作的基本目的。

第一章 实证方法论概述

现代西方经济理论认为经济学主要应是一门实证社会科学。作为实证社会科学的经济学,其一般方法论同自然科学方法论有相同之处,也有不同之处。相同之处是二者都属于实证科学,它们诉诸客观事实,其理论的科学性依靠事实来检验;这一点正是实证方法论的核心,是任何实证方法论的共同基础。其不同之处在于作为社会科学的经济学的研究的是社会现象,是具有意识和理智的人们的经济行为,而社会经济现象的规律性主要表现在千百万人的活动之中,而不是表现在个别人的行动中;因此,作为社会科学的经济学的实证研究方法与物理学、化学等自然科学不同,它不能完全依靠在实验室里做实验来构造、检验理论,而只能运用理论的抽象,也可以说经济学中的实证研究方法很难达到自然科学那种程度。我们认为社会经济现象的客观复杂性和经济学实证方法论的不彻底性是密切相关的,认识这一点是了解和借鉴西方经济理论实证方法论的关键所在。

我们不打算全面讨论有关西方经济理论方法论的演变历史和其各个侧面的问题,而是主要从二十世纪以来,特别是自从西方科学哲学中的波普主义(或称“证伪主义”)的理论产生以来,贯串于西方经济理论中的实证方法论的基本思想、内容及主要环节作一初步的介绍和评介。

§ 1.1 实证方法论的基础

实证方法论的哲学基础

经济理论的方法论主要是指对论证经济学的概念、理论和基本原理的研究,更一般意义上也可理解为经济学中所运用的科学哲学。故对如何确定经济理论研究的方法论,首先涉及到如何认识理论的科学性问题,亦即哲学意义上的科学观。我们认为二十世纪以来,特别是四十年代以来,西方经济学方法论的哲学基础主要来自于西方科学哲学中的“证伪主义”(或称波普主义)的科学观,因此,要了解现代西方经济学实证方法论的基本思想,必须首先了解“证伪主义”的基本思想和内容。

证伪主义的基本思想是由波普(Karl. R. Popper,有人也译为波普尔)在本世纪三十年代首先在其《研究的逻辑》(后来的英译本改名《科学发现的逻辑》)一书中提出来的。他认为任何一种科学理论都不过是某种猜想或假说,其中必然潜藏着错误,即使它能够暂时逃避实践的检验,但终有一天会暴露出来的,从而遭到实践的反驳或“证伪”。科学理论正是这样一个不断地提出猜想、发现错误而遭到否定,再提出新的猜想的循环往复的过程中向前发展的。科学也包含错误,要经受经验的检验,这不是科学的缺点,而恰恰是它的优点,它的力量所在,恰恰是科学之所以成为科学的本质特征。宗教教义自认为没有错误,玄学思辨也自认为没有错误,它们都把自己装扮成“永恒真理”,都不必经受经验的检验。但也正因如此,它们没有生命力,不可能再发展了,它们不是科学,而是反科学。这就是“证伪主义”科学观的基本思想。

应该指出的是,波普的这种科学观,并不都是新的创造。许多研究者找出它的某些根源;例如十九世纪最早一批科学哲学家约翰·赫歇尔、威廉·惠威尔等人,都已经有过一些类似的看法,

稍晚的实用主义者特别是查尔斯·皮尔斯也曾经沿着一个基本相同的方向有所贡献。马克思主义创始人还从辩证法的高度上说明了否定在认识过程中的作用。尽管如此，仍然不能抹煞波普的独创，他不仅把所有反归纳主义和反教条主义的积极因素都集中起来，而且以他所特有的锐利风格和极化形式建构了一个“证伪主义”哲学体系，因而赋予了这种科学观以极大的鲜明性和尖锐性，给整个西方科学界一股震撼的力量。为了进一步了解“证伪主义”的科学观，我们再简单介绍与波普科学哲学思想形成有关的两个主要问题，这就是波普科学哲学中著名的“分界问题”和“归纳问题”。

“分界问题”是波普学术生涯的第一个研究成果，也是他的全部科学哲学的基石。一九一九年广义相对论“推翻”（在“扬弃”意义上，不是全盘否定）牛顿引力论的科学事件给予他理智以极大的震动。如果象经典力学这样的经受了长达二百余年的亿万次检验的理论尚且有错误，如果象相对论这样优美严密的理论尚且属于它的创始人所一再声称的“短命的过渡理论”，那么，还有什么科学理论能够永远正确，万古不变呢？由此他认为，科学之为科学，不是因为它可以找到支持自己的例证。宗教、玄学、占星术都可以找到这种成功的例证。科学并不在于它的可证实性。或者说，科学之为科学，是因为它与一切非科学不同，要接受经验的检验，要在经验事实的发展中不断发现自己的错误，否定或伪证自己，以便过渡到更新的理论。就是说，科学恰恰在于它的可证伪性。可证伪性和不可证伪性，这就是一切科学与非科学的根本界限！如果连科学这种人类迄今为止最可靠的认识形式都是一些暂时的猜想或假说，都有错误，都可以而且必将被否定，那还有什么思想观念有权充当绝对权威或者永恒真理呢？如果有什么可以免于经验裁决的永远正确的东西，要么是数学和逻辑这样的先于经验的规则，它是正确的，但也是空洞的，不能作出任何经验判断来，因而不是经验科学；要