

西方经济学经典选读

作 者：萨缪尔森、诺斯、弗里德曼等

编译者：王学武、左柏云、李 俊

李晓明、宁军明

海天出版社

图书在版编目(CIP)数据

西方经济学经典选读/萨缪尔森等著. - 深圳:海天出版社,2002.8

ISBN 7-80654-564-6

I.西... II.萨... III.现代资产阶级经济学-文集 IV.F091.3-53

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2001)第 063995 号

海天出版社出版发行

(深圳市彩田南路海天大厦 518026)

<http://www.htph.com>

责任编辑:来小乔 特约编辑:刘翠文

封面设计:李 萌 责任技编:陈 炯

深圳希望印务有限公司印刷 海天出版社经销

2002 年 8 月第 1 版 2002 年 8 月第 1 次印刷

开本:787mm×1092mm 1/16 印张:24

字数:630 千 印数:1-3000 册

定价:54.00 元

海天版图书版权所有,侵权必究

海天版图书凡有印装质量问题,请随时向承印厂调换

目 录

第十部分 经济政策问题

1. 经济学家与经济政策 米尔顿·弗里德曼 (3)
2. 微观经济理论的未来 伯兹·艾伦 (8)
3. 21 世纪的宏观经济学 罗伯特·卢卡斯 (13)
4. 凯恩斯主义与货币主义争论的外行指南 *P.D.* 麦克希兰德 (18)
5. 制度、交易成本与经济增长 道格拉斯·C. 诺斯 (23)
6. 为达到什么目的而竞争 本杰明·罗斯 (29)
7. 自由贸易过时了吗 保罗·克鲁格曼 (36)
8. 自由贸易之愚蠢 约翰·卡伯特森 (42)
9. 自由贸易为什么有效 托马斯·迪洛伦佐 (49)
10. 战略贸易是公平贸易吗 马雷·莱文森 (53)
11. 对于贸易与货币关系的重新思考 伊斯梅尔·豪森·乍德 (58)
12. 詹姆斯·布坎南与古典政治经济学的复活 *G.B.* 克里斯顿森 (61)
13. 美国新经济存在吗 凯文·斯特罗 (66)
14. 公司所有权与控制权分离了吗 *H.E.* 弗里克 (73)
15. 市场, 市场失灵与发展 约瑟夫·E. 斯蒂格利茨 (76)
16. 不对称市场的益处 蒂博尔·西陶夫斯基 (82)

第十一部分 宏观经济理论

17. 关于就业和产量的古典理论 埃弗里特·E. 哈根 (93)
18. 通论 阿尔文·H. 汉森 (101)
19. 收入决定的简单数学 保罗·A. 萨缪尔森 (106)
20. 完整的凯恩斯体系图解 沃伦·L. 史密斯 (115)

21. 收入和消费之间的关系及其推论 詹姆斯·S. 杜生贝里 (121)
22. 消费函数新理论 M.J. 法雷尔 (132)
23. 投资需求无利率弹性
——来自企业态度调查案例的再思考 威廉·H. 怀特 (143)
24. 凯恩斯先生和“古典”学派:一个值得推荐的解释 J.R. 希克斯 (153)
25. 货币数量论:再论 米尔顿·弗里德曼 (160)
26. 货币主义的客观评价 保罗·A. 萨缪尔森 (170)
27. 货币在凯恩斯理论中的作用 劳伦斯·S. 里特 (178)
28. 货币工资水平与就业 詹姆斯·托宾 (185)
29. 价格的伸缩性与充分就业 D. 帕廷金 (192)
30. 英国 1861~1957 年间失业与货币工资水平变化速度之间的关系
..... A.W. 菲利普斯 (203)
31. 乘数分析与加速原理之间的相互作用 保罗·A. 萨缪尔森 (211)
32. 经济进步与人口增长率的下降 阿尔文·H. 汉森 (215)
33. 扩张与就业 E.D. 多马 (223)
34. 一个新的经济增长模型 N. 卡尔多 J.A. 米尔利斯 (234)

第三部分 微观经济理论

35. 实证经济学方法 米尔顿·弗里德曼 (251)
36. 希克斯教授对需求理论的修正 弗雷兹·马克鲁普 (266)
37. 劳动分工受市场范围的限制 乔治·J. 斯蒂格勒 (276)
38. 成本与产量 阿门·阿尔奇安 (282)
39. 什么是完全竞争 琼·罗宾逊 (292)
40. 垄断概念与垄断权力的测量 阿巴·P. 勒纳 (299)
41. 过多的生产能力与垄断竞争 约翰·M. 卡塞尔斯 (310)
42. 两家垄断、寡头垄断和浮现出来的竞争 G. 华伦·纳特 (316)
43. 多工厂企业、卡特尔和不完全竞争 D. 巴廷金 (324)
44. 医药行业的价格歧视 利本·A. 凯赛尔 (339)
45. 资本与利息的几何学:一个建议的简化方案 唐纳德·J. 杜威 (353)
46. 工会对资源配置的影响 阿伯特·利斯 (356)
47. 多国籍企业管理:价格机制与等级制的作用 J.F. 赫拉特 (361)
48. 资源的有效配置 特加林·库普曼斯 (374)

第一部分

经济政策问题

1. 经济学家与经济政策^①

[美] 米尔顿·弗里德曼^②

按照我们今天的看法,经济学一般原理的奠基人是亚当·斯密。他的论著《国富论》出版于1776年,它既是经济学领域第一部科学论著,又是已出版的试图影响公共政策的、给人印象最深的著作之一。然而,花了整整70年的时间,《国富论》的学说才被英国所采用,斯密赞成自由贸易和反对重商主义政策的论点才被付诸实施。

从那时至今,经济学家们一直遵循同样的双重目标:加深我们对经济运行情况的了解和影响公共政策。在努力影响政策的过程中,经济学家们普遍采纳了政府公共利益的观点。在他们的著书立说之中,似乎政府官员(无论是通过选举还是任命的)都无私地献身于实现公共福利事业,似乎经济学家的作用只是研究如何去做——决定要做的正确事情是什么,并劝服人们献身于公共利益,而增进这种公共利益才是正确的事情。

持这种观点的最著名的代表人物无疑当推凯恩斯。他为评论《通向奴役之路》一书而给其作者哈耶克的一封信中非常明确地表明了他的观点。这封信中被频繁地引用的一段话是:“这是一本宏大的书。……在道德和哲学上我发现我实质上与其整体是一致的;而且不只是一致,还是受了深深感动的一致。”人们对凯恩斯给予该书这么一种不相称的评语感到吃惊。不过,当你读到这封信的其余部分时,你将不可避免地看到一个“但是”。凯恩斯的“但是”是:“我们需要的不是我们经济计划的改变……而甚至是……计划的扩大……我们需要的是正确的道德思想的恢复——恢复我们社会哲学的正统的道德价值观……在一个意识与感觉正常的团体里,危险的事能被安全地完成,如果危险的事由那些意识与感觉不正常的人来干,这个团体将走入地狱之路。”

对公共政策的这种态度是凯恩斯留给经济学家们的政治遗产。我倒是认为,与他经济学方面的遗产相比,这很可能是一项更重要也更危险的遗产。

我对经济学家们论述公共政策一般态度做上述归纳,我自己也并不例外。我自己论及公共政策的大部分著作也有同样的特点,似乎我在对那些无私地献身于公益事业的政府官员发表演讲。多年来,我一直研究和分析货币政策。基于此项工作,我试图劝说联邦储备系统,使其相信它正在干错事,它应当采取不同的政策。而这只是白费时间。联邦储备系统的所作所为没有什么值得评价的功绩,而且这种无功绩有充分的原因:因为政府的公共利益特征基本上是不存在的。这种看待政府的方式与我们看待商业的方式有很大差别。我们不认为一个商人可以无私地献身于公益事

① 原载[美]《经济影响》杂志1987年第1期。

② 米尔顿·弗里德曼(Milton Friedman, 1912—)为芝加哥大学教授,1976年度诺贝尔经济学奖获得者,货币主义学派的创始人。

业。我们认为商人是在商业经营中增进自己的福利,为其自身的利益服务。亚当·斯密告诫我们:“我们对餐桌上佳肴的期待并不是来自于屠夫、酿酒商和面包师的仁慈,而是来自他们对自身利益的关心。我们不求他们博爱,只希望他们自爱,因而,我们也决不告诉他们我们需要什么,而只说他们可获得哪些好处。”他的最著名的一段话是:“每个人只想追求自身的利益,但他受一只看不见的手引导,去尽力达到一个并非其本意要达到的目的。”

我们为什么要有差别地看待政府官员呢?他们也旨在追求自身的利益,在政府里如同在商界里一样。我们必须试图建立起一种制度,在此制度之下,那些追求自身利益的个体受一只看不见的手引导,而服务于公共利益。而不是像通常表现的那样,受一只“看不见的脚”引导,而服务于本非他们意愿的私利。我们对政府和商业的分析之间的不一致现象早就被人们认识到了,不过一般只是“避而不谈”。像安东尼·唐斯在《民主的经济理论》、詹姆斯·布坎南与戈登·塔洛克在《一致的计算》之中发展而来的,被认为是公共选择理论的伟大贡献的,就是使这种不一致得到了详尽的论述。并且迫使我们都认识到,我们应当以我们分析商人的方式来分析政府官员,即认为他们的所作所为也是为了增进他们自身的私利。

我可以举例说明这种看法改变的重要性,以此来表明使联邦储备系统皈依于我的观点的努力是徒劳的。假定10年或20年以前,联邦储备机构采用我和其他货币主义者建议的政策,假定它采取每年至少增加3%货币量的政策,除此之外什么也不用干——至少就总的货币政策而言,我相信,无论是一般经济学家还是货币金融专家都会同意这种看法,即这样的政策会避免70年代的通货膨胀和由此带来的金融体制的混乱。也会避免80年代初期利率和整个经济的波折起伏。美国 and 整个世界今天的经济状况将会大不一样,而且我相信还要好得多。

甚至我确实很不赞同的一个机构——国际货币基金组织——或许仍在服务于它的初始目标。1971年当《布雷顿森林协定》终止、实行浮动汇率制时,它原来的目标便不复存在了。从1971年起国际货币基金组织已成为一个寻找目标的机构,而不是一个有具体目标的机构。

然而,现在让我们来看,如果联邦储备组织采取一种年增长率3%的稳定的货币政策,将会产生怎样不同的一系列结果。根据这种假设,民意测验结果显示美国第二号要人还会是联邦储备委员会主席吗?如果联邦储备委员会采取了这项政策,公众之熟悉联邦储备委员会成员大名的程度,充其量也只与他们熟悉美国货币印刷厂官员大名差不多。联邦储备委员会将成为一个完成过于简单机械任务的官僚机构。它将完成一个有用的职能,像印刷厂那样。显然,采取假设的那种政策是不符合联邦储备集团的利益的。因此,试图说服他们那样做是徒劳的。

为了避免误解,我强调我并不是要批评在联邦储备体系中工作的人们,正如我说商人追求他们的私利并不是要批评他们一样。相反,如已强调过的,从亚当·斯密那儿,我和大多数经济学家都知道,如果存在一种制度,在此制度之下,受一只看不见的手的引导,追求自身私利的人们也会致力于公共利益,那么这个世界会最有效地运转。除了那些负责建立与此制度不同制度的人,我不想批评任何人。联邦储备系统把大量权力让少数人独揽,而且这种建制造成了他们根据自身的利益去追求某种政策,我相信这种政策对公众有害无益。同样请允许我声明,我不是在指责控制货币政策的人故意做出这种危害。相反,我毫不怀疑他们真诚地相信他们的所作所为是从公众利益出发的。而且,如果他们不按这种方式行事,经济状况会以一种更不受人欢迎的途径发展。我们每个人都清楚,符合彼此利益也就符合公众利益。

从公共选择的观点看,有趣的是经济学家怎样影响公共政策,又如何简单地描述它。简单地描述并非是不重要的任务。确实,学者们的主要职责是理解社会生活的运行方式,而不是去影响它。然而,就我们不仅要理解社会运行方式而且还要影响它而言,在认识到正在同追求自身私利的人们

打交道时,经济学家如何实施这种影响呢?这些人或是政治家,其私利使得官僚主义更加膨胀和更有权力;或者是理想主义者,其私利将促进一种特殊形式的公共利益。正如经济学家很早以前知道的那样,私利的概念毕竟不仅限于狭隘的物质利益,它包含许多非物质的动机,这个世界的圣徒追求自己的私利并不亚于魔鬼。

就我看来,经济学家依然以三种方式对公共政策产生影响。最老的,也是我们实施最多的方式,是简单地告诉公众,使他们对自身的利益有一个正确的理解。最明显的范例,是在经济学家之间对自由贸易优势看法的基本一致。我们不主张设置关税,因为它们充其量也不过是为了公众私利罢了。我们依然设置关税,是因为大多数公众成员不了解关税对他们的影响。某项特别关税,往往由某个小的联合组织(某项产品的生产者)发起,这种联合组织既包括雇主又包括雇员。为了设置某项关税或其他壁垒来抵制国外的竞争,他们不惜花费大量精力和钱财。

例如,我们来看一下美国蜂蜜生产者。我们之中很少有人(如果有的话)知道生产者的名字,而这些生产者却相互认识,并且彼此保持着联系。他们为限制蜂蜜进口而进行游说是值得的。这种限制的成本则由我们这些消费者分担了。每年它会使我们多花去几美分或几美元。甚至对我们来讲,花这些工夫去了解蜂蜜对我们造成了多少危害都是不合算的。结果,立法者作了逐项考虑后,能够明确他们赞成此项限制所得的支持票数,但他们不清楚因此会减少多少支持者;因此,他们趋向于投赞成票。

考虑到公共选择学派的洞察力,对经济学家来讲,要想使公众相信他们的利益受到某种关税的损害,这是没有希望的。对于有关蜂蜜问题,我们不可能希望去详尽地教导公众,以使得政治家在政治上有利可图而投票反对蜂蜜进口,更不用说使经济学家有利可图以做这种尝试。我们甚至不能(或没有充足的激发力)对从日本进口汽车实行限额,即使外贸限制可能比其他单项贸易摩擦花费公众更多的钱财。食糖进口限额就是一个惊人的例子,由于实行限额,我们用的食糖每磅价格是世界平均价格的5倍。

为了成功地促进自由贸易,我们必须使公众了解关税的一般知识,了解作为一般政策的自由贸易之优点,不要把我们的精力浪费在对每种关税的抨击上。这些个别关税只可作讲解的例子,仅此而已。显然,这不是件容易的事。我们做了两个世纪的努力却并无引人注目的成就,非常清楚,我们没有按照正确的方式行事。

这使我想到了第二种方式,在此方式中经济学家们可以期望影响公共政策。这种方式就是分析那些将导致满意结果的体制改革,并努力说服公众使他们接受这些体制改革,而不是直接影响政策制定人。例如,就关税而言,我认为,在不抨击国会提议的每一单项限制时,如果我们提出一项法律修正案,主张“国会将不制定法定关税或不实行贸易限制”,或者提出一种甚至更宽容的法律修正案,主张“国会将不在法律上禁止两个相互自愿的成人之间的自愿订约”,我们或许会有很大的成功机会。这样一项修正案将废除关税以及对国内贸易的许多限制,因为此处的“相互自愿的成人”是由一个国外卖者与一个国内买者组成。

我这里的意思并不是讲修正案的精确措词,我强调的只是陈述这样的原则,即要想有效地促进自由贸易,我们需要把精力放在利用法律条款或其他途径来改革体制上。这样一种程序有两个优点:第一,国外限制的整体成本对个体消费者来说是很大的,大到足够值得他们花费精力去了解这些限制——假定有使这些信息发生效用的机会。第二,只实行一项持续的“改革运动”,颁布一项法律修正案,一旦通过修正案,它就会长期生效。反之,要否决一项一项的关税议案则需要一系列的运动。

公共选择观点有时建议从多方面着手,而这些方面看起来在经济上不合适。让我们拿现行的

国会预算案来作例子。人们广泛赞同联邦政府预算应被削减。预算该如何削减呢?简单的经济论证认为应在边际上开刀,也就是这里砍一点,那里删一点,其他地方又削一块。经济学家们都知道边际成本等于边际收入的含义。当消费者研究人员问人们,如果他们有200元的外快要花,他们会干什么?报告里讲,人们回答是他们将把这些钱花在某种单个大项目上——一台电冰箱或一台计算机等等。这倒把我们都逗乐了。我们都知道消费者实际会做什么:他们会花5分钱买牙膏、3分钱买其他东西等等。

边际的原则同样意味着,削减政府预算的最优方法是均等地削减各种项目费用。然而,就政治效果来看,这恰恰是一种错误的方法。正确的方法应是精简机构和功能。为什么?如果国家铁路客运公司的预算(美国政府补贴旅客铁路费)被削减15%,下一年该公司官僚们会为更高的预算辩护。如果你取消这个公司,就不会存在为它游说的官僚。精简机构,收益才会是永久的;实行边际削减,则收益注定只是暂时的。

对总统来讲,他想要削减支出,国会里的一些反对者却显然不想削减支出,但是他们都知道以上的原则。总统在他提交给国会的预算里,提议中止十多项政府项目。国会参议院一方主张只削减5~6项;众议院一方则主张只削减2项,并进一步建议完全不削减。最终双方通过的决议案几乎没有中止主要的项目。结果,为更大拨款进行的官僚游说依然如故。这个例子很好地说明了如何进行政治的经济分析,当把经济原则运用到政治问题上时,对其进行修正是必要的。

掀起一项运动,去争取通过一种平衡预算、限定支出的修正法案,则是另一个为影响政策而通过体制改革,使立法者既能按公众利益行事,也能符合其私利的例子。一般来讲,如果某个游说者要求某位立法者投票赞成做某事,立法者会对游说者说,“我不能这样做,因为这意味着高税收。”而游说者会说,“你说什么,你这样做不是要穷人的命吗?”立法者找不到有力的措词来回答游说者。不只是立法者,连游说者也很清楚,为某个专项筹资的税额的任何增长都是很小的,而且很分散,因而不那么显眼。而某个专项支出案一旦被人们注意,就十分惹眼。这就是为什么逐项考虑每个支出议案的程序会产生超过公众预期总预算的缘故。我们传统体制上的这种缺陷,正可以解释这种自相矛盾的现象。这种现象是,每次民意调查都表明,大多数人赞成小额预算而反对税收,同时,国会一致投票同意扩大支出、实行高税收而反对开支限制。

如果某项修正法案要求限制总开支,立法者的私利将会变化。他现在会对游说者讲,“你是对的,你建议的项目很好。不过,法律限制了我们的支出总额。如果我投票的话,当然我只赞成你的提案,而不赞成别的提案。可是我不赞成别的什么提案呢?”这会使一种利益与另一种利益相抗衡,并以一种方式改变游戏规则,即立法者发现按公众利益行事与其私利是相符的。同样的考虑取决于我们促进通过某项金融条例修正法案的努力。

经济学家们影响公共政策的第三种方式,或许是最有效的方式,是维护危机时期公开地自由选择的权利。发生在非危机时期的主要体制改革,即使有也是很少的。我们现在有机会通过要求平衡预算和限制支出的修正法案,这其中的唯一理由是预算危机的存在。大多数舆论都为庞大的赤字预算感到遗憾。我很欣赏,赤字是迫使我们认真思考如何控制联邦支出的唯一的東西。赤字的经济影响无疑是糟糕的,不过,赤字的政治影响却是好的。

第三种影响的新近最好例子是浮动汇率的采用。从二次大战到1971年,布雷顿森林固定汇率一直在生效。一些像我和哈伯勒等这样的经济学家,几十年一直在写文章和发表讲话,论述浮动汇率相对于固定管理汇率的优势。政策制定者的反应是,总把我们看作是不现实的、简直不了解“现实”世界如何运行的理论家。我记得在一次出席哥本哈根的有声誉的国际银行家聚会上,我同当时的国际货币基金组织的首脑分在一个讲台上,他立即反驳了我对浮动汇率的支持,称之是完全难以

实行的和不现实的。他声称,固定汇率是唯一可行的体系。在两年以后,《布雷顿森林协定》被废弃,同样的组织相聚于蒙特利尔,我再次同国际货币基金组织一位新的首脑分在一个讲台上,这时他的发言却是:“当然浮动汇率是当今世界上唯一能行得通的。”

正如这个例子所表明的,我们去劝服所有的人来相信浮动汇率是正确的政策,而浮动汇率总是没被采用。浮动汇率被采用是因为出现了一种危机(美国黄金的外流)而要求采取严厉的行动。这种选择是开放性的,这是由于经济学家们一直在著述和谈论浮动汇率。如果这种选择不是开放性的,如果没有大量学术背景的周密考虑的方案(确实有众多的金融及国际贸易方面的经济学家做后盾),一些事情还得继续下去。可以断定,可能还是浮动汇率之外的事情。

关于经济学家的论述,我感到自相矛盾。我们也在追求自身的利益。我们不能问心无愧地认为自己与我们所分析的人不同。我们不能把自己作为例外。那么,问题便出现了:以我们所阐述的途径来促进公共政策符合我们的私利吗?这是无法弄清楚的。30年代的“新政”对于当时的经济学家毕竟是最大的就业计划。我会怀有情感地谈论它;正是因此我获得了我的第一份工作。大多数人由于年轻而不记得“新政”对于为经济学家打开就业之门的重要性。更一般地讲,政府是经济学家就业的渠道,经济学家们直接地、或者通过政府的干预来对私人企业施加影响。比如,反垄断,一种最古老的政府干预方式,它为经济学家创造了大量有利的需求,这些经济学家则是许多反托拉斯事件双方的专门见证人。同样,其他政府的干预创造了我们在私人企业就业的机会,这使人们认识到干预的效果,也为普通的企业向特殊的企业变化提供依据。它们也为我们在政府中分析干预的效果创造了工作机会,并且也为这些干预的保留与改进提供了依据。我时常感到困惑,当我附和一般赞成自由市场观点的经济学家而进行阐释时,我是否玩世不恭。但同时,错误地领会被表面现象、不完全市场、零碎的结果等印证的相反结论,也是极端幼稚的。

举另外一个例子,对凯恩斯《通论》的大量陈述能接受的一个原因,是它对于就业以及对经济学家的影响展示了极好的机会。毕竟,如果不能通过税收和开支的变化来控制一种经济,那么,谁还去变化税收和开支?谁还愿意去占据这些权力地位;我相信,之所以在许多时候,对于我们的货币主义制度有大量不热心的接受,这是由于适宜于经济学家的工作猛烈减少。所以我不相信我们这些经济学家有任何例外。

让我再来重复一下我前面所讲的关于商人和政府官员的话。我并不是说,那些居于他人之外的经济学家,故意地公开地把自身利益置于公众利益之上。我们都知道于己有利也会于国有利,反之亦然。每一位联邦储备委员会的成员都知道,他是一位重要人物并居于重要地位。让他相信其行动的危害性这在其心理上是难以接受的。同样,在经济的每一个角落发现外界影响的经济学家,都是居于同样的位置。所以,我不是说任何人都在公开地利用其位置做有危害的事情。我说的完全是另外一码事。我是说,作为分析家,我们应当承认,我们是那种了解自身利益胜过了解一切,并追求自身利益的人类。让我们再次强调,自身利益并非限于狭义的物质利益,它包括服务于公众利益、帮助他人的愿望。

最后,经济学家们在过去是如何影响公共政策、将来又怎样能够影响公共政策,这些是科学研究的一项重要课题。公共选择学派已对这项课题做出了重要贡献,其他的经济学同行们(货币及价格理论家以及同类的应用经济学家)也同样做出了卓越的贡献。尽管我的观点有限定和保留,但我自身的利益使我相信,全面地看,经济学家已实施了一种好的影响。或许关税比以前低10%,这是由于我们长期以来对自由贸易倡导的结果;如果是这样的话,那么这种少付的10%的关税,就应作为长期鼓吹自由贸易的那些经济学家的报酬。

2. 微观经济理论的未来^①

伯兹·艾伦^②

我不打算去给经济理论下定义,但是为了开始我们的讨论,考虑一下什么样的理论才算好的理论可能是合适的。在此之后,我会对微观经济理论一些研究领域的未来发展做出一些比较保守些的预测,当然也会给出一个较为大胆些的预测。

好的理论从好的问题开始,它不会就为着得到某种答案而添加足够的条件来骗人。即使在高深的理论中,一些重要的研究问题总是能够用语言向那些受过很好训练但不是理论家的经济学家们解释清楚,通常它也应该能够向该专业的大学生解释清楚,向来自不同领域的学者专家解释清楚,向商人、律师或受过教育的社会公众解释清楚。一个好的问题应该能够很快给人以这样的印象,即它是重要的或是吸引人的,它也应该具有极大的可能性促使人们寻找到新的重大发现。对此或许好的检验就是是否一个人凭直觉就会叫出来:“为什么我没有想到呢?”从这种意义上来讲,理论不同于经济学的其他领域。好的理论是在拥有切合实际的长期研究目标并努力朝向该目标前进时取得一定成绩的结果。它是创新的结果,即便新思想新方法初期会带来一些不安,但得出的令人吃惊的结论可能很奇妙。最后,成功的理论可能产生一些解释,回忆起来它们至少能够说明人们的一些常识。有时,会发展出一些漂亮优雅模型出来;当出现这种情况时,研究就是真的很令人满意的了。

而且,风险和潜在收益都很高的研究项目对于经济理论(或说任何科学领域)发展的贡献往往最大。这倒不是要贬低大量平淡研究的价值,特别是当这些研究是小心完成的而且是有益的时,但是我还是认为,重要的激动人心的进展往往还是与高风险的研究相关联。资助机构应该更多地意识到高风险项目能够产生较多的社会收益,虽然这类项目不容易找到足够的私人资助,但是这类项目却更可能提供真正的公共产品。

在方法论领域,我不打算重述有关经济学的可检验性方面实证与规范讨论的分歧。在我看来,在经济学课堂上这些问题讨论得太多了,在经济学发展的这个阶段不值得为此花费那么多的精力,尽管数十年前人们就强调这一点——这还是我做学生之前。通常一长串文章或者一项研究项目往往将实证研究和规范研究结合起来;在能够提出改进的建议之前,人们首先应该了解事物的运行机理。而且,我认为先做预测再做实证的老方法和标准作为一种科学标准其价值被高估了。在经济学领域,这其实并不要紧,因为人们并不能建立合适的受到控制的实验或者能够获得必要的资料。就算这些障碍能够被克服,经济学的实证研究也很少能够清楚地验证某个具体的假设,反倒是将研

① 原载《Journal of Economic Perspectives》,2000年冬季号。

② 伯兹·艾伦(Beth Allen)为明尼苏达大学卡尔森(Carlson)经济学讲座教授。

究者感兴趣的现象与理论的细节及其假设前提混淆在一起。很杰出的理论往往本质上就是不可验证的,但是正如下面所讨论的那样,往往用数学的方法能够证明其有效性。

基于同样的理由,我很高兴地看到,有关数学在经济学研究中的作用的似乎无休无止的争论基本上停止了。也许我接触的圈子很窄,不过我的印象是,在经济学界基本上取得了这样一种共识,即:使用无论什么数学方法的正当理由必须是,这种方法是为了模型化某个有价值的理论问题并有助于有效解决它。必要的技术方法不能被批评为“滥用”,当然使用不必要的很少为人采用的复杂的方法,主要为了卖弄技巧而不是为了增进对原原本本的经济问题的理解,这种对技术方法的使用应该受到我们学界行规的继续抑制。

尽管人们对于经济学研究中运用数学的讨论好不容易平息下来,我还是担心现在许多理论家在研究中不讲逻辑的严密性。这种情况通常出现在我们这个行业的年轻人身上。或许这种令人警惕的趋势的出现与最近十年年轻人要进入学界圈子所遇到的提高了的出版著作要求或淘汰压力有关,但是实事求是地说,草率和马虎这一战略不会取得扎实的科学成就。(我怀疑是否有这样的天才,他们属于例外的情况,因为大多数人觉得他们比普通人优秀,而经济学家——或推而广之的研究者们,可能比大多数普通人更傲慢。)在微观经济领域之外的经济学领域,我发现追求严密逻辑和认为严密逻辑不值得花时间去追求的两部分人之间关系紧张。显然,我同情前者,因为我认为“应用”这个词并不包含着任何非科学的含义,何况(简单重复一个老的正统说法)数学使人在分析中不会犯显而易见的微妙的错误,这些错误不可能被人们的直觉所发现,但会造成进一步的不完善的研究。没有严格的逻辑性和精确性,作者和读者就没有办法评价某一结论是正确还是错误。

经济理论研究中还有另一个干扰性的趋势,那就是许多研究者不是从事真正的理论研究,而是做一些无意义的事情。当他们有了一个好主意或是一个说明某种新现象的有趣的例子,他们不是究根问底地去追寻它的逻辑结论。最终的结果是发表这样一篇漂亮的文章,它包含着某些好的思想,这些思想指出了某些潜在的令人激动的重要的事情,但是读者找不到归纳这种分析的线索,因为所呈现给读者的只是一个有着非常具体的参数的事例。这个问题不同于我前面对于缺少严格逻辑性和精确性的抱怨;对于一个小例子可以通过非常细致的分析保证对于它的所有分析和结论都是正确的,但是当分析不能够一般化不能够推广时,这种个案的分析就算正确,价值也不大。我以前的同事大卫·卡斯(Dave Cass)就喜欢说例子与模型或定理之间没有明显的差别,因为后者往往也依赖一些假设,包括像一定条件约束下的最优化这样的维持性假设。尽管这一点已经广为人们接受,在此我还是想说,如果理论家有意识地多注重抽象和归纳,这也是理论最能有效地贡献经济科学的地方,经济科学将会得到更快的发展。

不考虑跨学科的研究工作来讨论经济学的研究趋势是很难的。不过,我承认直到最近,我也没有发现与大多数其他社会科学家的交流对我是特别有益的,当然那些已经在从事跨学科(例如在政治科学、法学或会计学领域)的理论研究工作的人是例外。然而,随着某些跨学科联系的发展,我的观点改变了。“新”政治经济学呈现为一个很有希望的领域。在经济理论研究中,金融学也有很大的影响,它激发出考虑不确定性和不对称信息的许多经济学文献,包括合理预期和契约理论的部分内容。一个更新的研究趋势是作业研究和计算机科学的成果对于经济理论主题的影响,如复杂性、平行信息处理、随机与确定性系统以及计算技术这些词也进入到经济学的研究中。

我估计生物学和工程学在未来也会产生跨学科的影响。就生物学来说——或者更加准确点说,就可认知的神经系统科学来说——可能的联系在于行为的生物基础和理性选择之间。本文后面会详细讨论到的工程学与经济学的潜在联系是通过技术的重要性起作用的。最后如果不考虑实验经济学(它以统计学和其他实验科学为基础)和来自数学和统计学的最基础工具(包括概率论、随

机过程和统计决策理论)的重要性,所列的学科间相互影响的单子就是不完整的。

经济学中一个跨学科研究的比较局部地看问题的方法正在出现:微观经济学和宏观经济学之间传统的区分正在消失。人们认为宏观经济学应该建立在微观经济学和一般均衡理论的基础上,因此二者的界限模糊了。我期望这一积极的趋势将进一步加速。动态经济理论思维将微观经济学和宏观经济学融合,它为未来研究提供了一个有趣的重要的研究领域。

若干可以预测的发展方向

在此,我不打算提供一份未来若干年需要研究的主题清单,也不想穷举还可有重要发展的现行研究领域,本节主要关注两个主题:博弈论和信息学,这里排列顺序与重要性无关。

把博弈论引入经济学的研究,源于19世纪的卡洛特(*Cournot*, 1838)。20世纪60年代和70年代涌现出许多这方面的技术文献,主要集中在寻找一般竞争均衡的策略基础上。这些研究建立在合作对策基础上,在这些对策中,一群游戏者能够互相沟通,并形成彼此约束的协议。这与非合作对策形成明显的对照,在后一类对策中,单个游戏者要做的唯一事情就是根据对方对游戏了解的情况确定一种策略。(沟通可能是战略的部分内容,但是如果游戏者决定背叛,协议不具有强制性,除非建立了某种有惩罚措施的战略。注意在某些非合作对策中合作可能产生于均衡之中。)

到20世纪80年代,人们关注的焦点已经转向战略行为的非合作对策理论,这一理论被称为可能是对策理论在经济学中最有应用价值的内容。这一判断是基于这样的说法(最近表明是错误的),即只有非合作对策才可能以非对称信息为特征,人们观察到的是合作对策并不能够像理论上所说的各种联合情况下可能取得怎样的收益那样很好地变成实际战略,事实是非合作对策似乎以纳什均衡作为唯一的解,而合作对策理论有着众多的日益增长的解。非合作对策理论的第三个所谓优势被消除了,因为人们认识到他们可能遇到过多的有着各种各样性质特点的纳什均衡(如有效率和无效率的均衡、单纯战略和混合战略均衡、游戏者无所作为的少见均衡),这些特点导致人们发表数以百计的改进纳什均衡的文章。本研究产生的一个结论就是,非合作对策不仅显示出会产生太多的解决方案这样类似的问题,而且还产生更多的问题,即:非合作对策均衡很脆弱,他们对于假设的轻微变动都很敏感。我认为 *Kohlberg* 和 *Mertens* (1986)对战略稳定性的开创性研究表明,对于某个具体的经济问题来说,令人满意的精心安排不可能意味着说明详细的安排,即便界定得明确,也无非开出一长列例子,没有办法从这些例子中得到一些系统抽象的概括性的结论。

尽管近来从计算和实验角度研究纳什均衡的一些成果是有趣的,但是我的印象是力图证明纳什均衡有效的尝试都失败了,原因是上面提到的鲁棒性问题。这就告诉我们,非合作对策理论对于未来研究的启示意义非常有限,就算这样的策略思考对于我们从事经济理论研究、对于经济学家们的思考方式有着积极的、根本的、广泛的影响。请注意,对策论不仅进了经济专业也进了非经济专业的课程表。

在对策论中,我个人感兴趣的研究领域是网络对策和那些既是合作对策又是非合作对策的对策,它们对于未来的经济理论发展可能是很重要的。网络对策或基于图表的对策提供了现场互动对策模型。这样的对策显示出的战略行为可能性和均衡会不同于没有网络特点的对策。确实,在合作对策理论中,参与网络游戏的游戏者可以与联网的游戏者沟通,根据图表可以从属于某个联盟(因此签定有约束力的契约)。对于非合作型的网络游戏来说,关键思想是一个游戏者的报酬只依赖于临近游戏者的行动。这些网络能够反映社会关系、地点、通信模式等等。一个已经开始显示出重要性的例子涉及互联网,随着电子邮件、网上商业、网上商务和全球企业的扩展,互联网正在迅速

成为美国经济生活的重要内容。融合合作和非合作对策理论有助于服务于合作对策理论的非合作对策基础,包括以非合作方式实施各种合作解决。正如 Zhao (1992)所介绍的,混合游戏是既包含合作又包含非合作对策阶段的游戏;它们可以用于这样的模型,如模拟企业内的合作和企业间的竞争或者更一般化地模拟宏观经济学里的“孤岛经济”。最后,我将联盟的形成环境作为继续研究的一个重要领域。时至今日,一般情况下,对策理论在开始玩游戏时都不能够预测哪种联盟会出现。这种令人吃惊的差距需要缩短,因为联盟的概念提供了一个模型化企业、国家、城市、关税同盟等各种经济机构的一般方法。

我的第二个可预测的发展方向涉及信息经济学。就个人行为 and 不对称信息下的均衡来说,还有许多问题没有解决。这些问题中有些把焦点放在激励上,但是我不打算把信息经济学和不确定性归结为研究激励相容约束问题。这个领域我最喜爱的一个未解决的问题是解释市场为什么是不完全的,这导致要求对市场结构做出内生的解释。一个更大的问题是把信息完全内生地纳入微观经济理论和对策论。尽管在过去 40 年里,我们取得了一些进展,但是仍然很遗憾,我们距离建立一个令人满意的一般模型还很远。

不太有把握的预测

我认为在将来经济理论研究会而且应该更多地关注技术问题。关注这一领域背后的动因源于技术在解释经济增长方面越来越重要。第二个原因是因为自从人们研究满意的方法和企业行为理论以来,经济理论研究的这个领域一直没有得到重视。知识产权领域是个例外,在这个领域研究的热情直追早期的专利竞赛和研究合资活动。

把研究企业的经济理论划分为 6 个相关的主题是有益的:①对企业和技术本身的定义;②产品及工艺创新与研究开发政策;③作为经济组织的单个企业的演进(如, Holmes 和 Schmitz, 1995; Lucas, 1978);④单个企业行为和资产市场均衡的财务方面研究;⑤管理控制、契约和激励;⑥策略行为。像企业形成、网络、产品组合这样一些研究主题值得受过好的经济理论训练的研究人员的更多注意。还可进一步研究研究开发在不同项目间的分布, Allen (1991)在这个方向做过努力的尝试。

然而,差距最大的是经济学对技术本身的研究,过去半个多世纪这方面没有多大的进展。最基本的研究还是遵循 Debreu (1959)当初提出的指导思想,根据这一指导思想,企业的技术可能性由一组生产函数所确定。如果不考虑范围经济、可竞争性和持续增长,经济学家们在研究什么假设适合生产函数方面没有取得什么进展。例如微观经济理论甚至在不理会亨利·福特组装线,超越规模经济和规模不经济理论情况下得出成本函数的合适形式。而现代经济的制造部门变化很快。工商传媒使大家了解到大规模定制、知识工人、工厂的计算机化和网络化、零库存控制、产品寿命周期、保护环境的废物利用与再生产等概念的重要性。新材料和新工艺不断涌现,连续生产得到发展。计算机辅助设计和生产在发达国家的大多数行业得到普遍采用。或许,我们的技术概念需要重新定义以超越标准的生产函数,或许需要更强的假设。除此之外,我们的经济理论必须反映真实世界的发展变化。

说到这一话题,我发现经济学家有很多需要向工程技术人员学习的地方。在校园外,许多工程技术人员正在以统一的方式研究产品选择和技术选择,称之为建立在“为生产而设计”基础之上的“产品开发”。遗憾的是,在我们的大学里,无论在哪个方向上都很少发生“技术转让”。

广而言之,管理技术项目的人越来越多,他们教育别人怎么去管理高技术企业,这提供了学科交叉联系的活生生的例子。这些项目管理教育往往导致在大学设立理学硕士或工商管理硕士级的

证书班,主要学习案例研究,或者给有企业管理、工程、计算机科学或物理学背景,同时对这些学科有兴趣的人士单纯提供这方面的学习课程。就我所知,麻省理工、康奈尔、明尼苏达、伯克莱和斯坦福这些学校都提供这样的研究项目,而且,我敢肯定还有其他学校提供这样的项目。基于经济学家和经济学研究在金融学等传统管理科学领域具有重要影响,我预计经济学在这一增长领域会发挥更大的作用。这就提供了未来几十年里教学和研究之间相互促进的激动人心的机会。

3. 21 世纪的宏观经济学

[美]罗伯特·卢卡斯^①

20 世纪下半叶的经济增长不同于 20 世纪 50 年代受教育的人们所知的历史上任何时期,这导致人们对于世界经济得出新的看法,办法就是看看事情究竟是怎样发展演变的。

在 1960~1990 年 30 年的时间里,整个世界的产量——包括社会主义国家、前殖民地及所有其他人——以每年 4% 的速度增长,而世界人口每年增长 2%。人均实际收入自二战和欧洲殖民时代结束以来翻了一番还多。

人均所得的这种显著的增长分布并不均衡:平均数字是把停留在工业化以前收入水平的国家的成绩与 20 世纪 50 年代同样贫穷但此后以前所未有的速度实现工业化的国家和地区的成绩合在一起得出来的。理解决定一个国家走上哪一条增长道路背后的力量是很关键的,这些利害关系的探索近些年来产生了许多富有吸引力的研究成果。理论家们提出了各种各样的模型来解释正在进行的工业革命是如何扩散的,试图了解我们会走向何处。

在本文中,我会在数字上模拟一个这样的模型,这是 Tamura (1996)建立在技术扩散基础之上的世界收入动态模型的简单化版本。该模型预测的世界平均收入增长趋势与观察到的很吻合。它所预测的相对收入分布的演变也与 Pritchett (1997)著作中记录的历史情况相吻合。我将用该模型对 1960~1990 年期间经济增长情况做出解释,它们是很多计量经济研究的课题,可参见 Summers 与 Heston (1991)的研究。我也将用该模型来预测 21 世纪世界收入增长路线和收入不平等情况。

一个增长模型

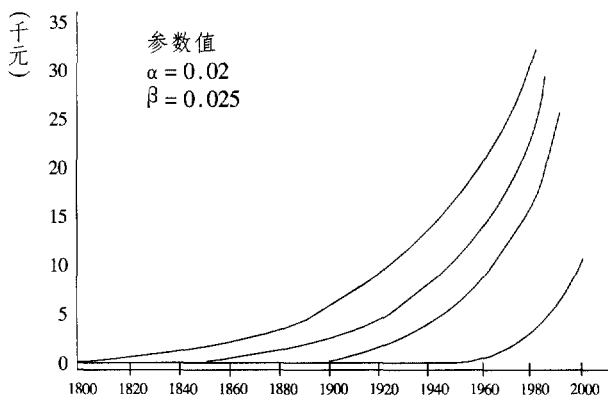
我们考虑一个有着许多国家经过了很长时间的这样一个世界里的实际人均产量。为了建立模型简便,假定这些国家的人口相等。想象这些国家在全面工业革命之前某个时刻作为增长的起点。具体说来,我把这个时点定为 1800 年。我假定在此时间之前,没有哪个国家出现人均收入(生活水平)的增长,大家的生活水平都相同。我取这个工业革命前时刻的收入水平为 600 美元(按 1985 年美元价值计算),这大约是今天世界上穷国的收入水平,与我们所知的工业革命前后世界生活水平相当。然后我们开始想象 1800 年的世界经济是这样的一种情景,它由许多贫穷、增长停滞、人口数量和收入水平相同的国家组成。

现在想象所有这些国家排成一行,都站在跑道上的起跑线处。在跑向我将要描述的工业化过程中,尽管门不是同时打开的,但是,他们都跑上了跑道。而且,在任一时间 t ,还没有打开的门中,

^① 罗伯特·卢卡斯(Robert Lucas, 1937—),芝加哥大学教授,新古典宏观经济学的代表人物,1995 年度诺贝尔经济学奖获得者。

用某种工具随机地选择几扇。当起跑的铃响起时,被选择的这些门被打开来,有些停滞的经济开始摆脱束缚,出现增长。其余门后的经济必须等待下一个($t+1$ 时)的机会。这样,在1800年以后的任何时候,世界经济就由还没有开始增长,收入水平停滞在人均600美元的经济和在过去某个时候已经开始增长并保持增长的经济组成。

图3.1说明这些国家经济收入增长的4条路径。这个图形的精确构思建立在两个假设之上。



注:美元价值以1985年美元价值计算。

图3.1 若干经济体收入增长路径

第一个假设是,从1800年开始第一个国家经济开始工业化——想象最早开始工业化的英国,其年增长率保持为 α 。我选择 $\alpha = 0.02$,如图中最上面那根曲线所示,这意味着到2000年时英国的人均收入达到33000美元(按1985年美元价值计算)。我同意该模型中没有多少深奥的经济学道理,但是,我们由此可以回顾和追溯到索洛(Solow, 1956)以及后来者对于理解什么条件下一国人均收入将按不变的比率增长为增长理论所做的贡献。不管怎么说,在经验上它是对于实际所发生的事情的最好的描述。

对于领先经济,我们就说这么多了。构成图3.1基础的第二个假设是,在1800年以后任一时间开始增长的某一国经济,其增长速度等于领先国增长速度 α 加上一个与收入落后差距成比率的参数。一国开始增长的时间越晚,初始的收入差距就越大,这就意味着后进者要有更快的初始增长速度。但是一国增长快于领先国会缩短收入差距,根据我的假设,这又会使它的增长速度趋向于领先国的增长速度,即2%。因此,后工业化的国家终究会有与先进国家大致相同的收入水平,但是不会超过领先国的收入水平。从图3.1的其他3条曲线可以看出这种追赶行为,它们分别对应于1850年、1900年和1950年开始增长的经济。

要量化这种追赶的速度,我们需要给不变速度 β 定值,它取决于两国的收入差距和它们相对的增长速度。例如,考虑那个于1850年开始增长的国家。在1850年,这个国家收入仍处于工业化以前的600美元水平,而领先国已经从这个基础上以年2%的速度增长了50年。因此,1850年领先国的收入是 $e^{(0.02)50} = e$,即是工业化以前收入水平的 e 倍。百分比缺口是该乘数取自然对数 $\ln e$,等于1。我确定参数 β 等于0.025,这样1850年开始增长的国家的初始增长速度 $\alpha + \beta = 0.02 + 0.025 = 0.045$ 。每50年,后进者的增长速度增加0.025,这样到1900年开始,后进者的增长速度将是 $\alpha + 2\beta = 0.07$,1950年开始后进者的增长速度将是 $\alpha + 3\beta = 0.095$,如此等等。这些都构成图3.1的假设:它们抓住了最为人熟知的事实,那就是后进者往往有着比先进者更高的初期增长速度,不过不会超过先进国的收入水平。

1800年以后的任何年份,产生图3.1的模型所描述的世界由1801年、1802年直至未来各年开始增长的国家组成——因为目前世界上还有一些尚未工业化的经济。世界经济总体水平是图3.1所示的各国经济水平的加权平均数。要预测世界经济的增长路线,我们需要知道这些权重,需要知道每一收入类别有多少个国家。

起初,我尝试给开始增长年份确定一个不变的概率。意即我假定如果一个国家到日期 t 还没有开始发展,那么它在那个日期开始增长的概率——“它的可能性”——是数值 λ ,它独立于 t 。这个模型不符合事实,因为起初工业革命扩展得很慢,19世纪的 λ 值很小,二战后扩展得很快,20世