

宏观经济学微观基础问题的不同视角与本质*

汪浩瀚

(宁波大学 商学院, 浙江 宁波 315211)

摘要:自20世纪60年代以来,宏观经济学的各个分支学科都越来越重视寻找宏观经济理论的微观基础。主流经济学认为,宏观经济理论必须建立在与新古典模型的根本特征相一致的微观经济基础之上;非主流经济学对传统意义上宏观经济学的微观经济基础之争持有很大的怀疑;后凯恩斯主义者认为,真正需要的是宏观经济学的宏观经济基础;演化经济理论主张微观基础解释的是社会变迁。文章在对当今微观基础问题争论进行梳理的基础上对宏观经济学体系的内在形成机理和变化趋势进行了探索。

关键词:微观基础;新古典经济理论;个体主义;演化

中图分类号:F091 **文献标识码:**A **文章编号:**1001-9952(2005)10-0086-09

在过去的数十年里,宏观经济学作为一个独立的研究领域,所要研究的是产出、失业、通货膨胀等经济活动。宏观经济学力图解决的是:在一定的微观基础上,在不确定性状况下,通过对不完全市场进行一般均衡的动态研究,阐释和理解经济中产出、就业和价格的运动。主流经济学认为宏观经济理论必须建立在合理的微观基础上,对此一般的理解是宏观经济学是建立在新古典经济学的微观基础之上,宏观经济分析必须有与新古典经济理论模型相一致的根本特征。几乎所有当今主流宏观经济学的分支理论都坚信宏观经济理论必须基于适宜的微观基础之上,而且一般都是在新古典经济学分析范式中的微观基础含义下解释宏观行为特征。当代宏观经济分析力图将瓦尔拉斯均衡微观基础注入宏观经济学,并依据行为的最大化原理及经济的基本因素解释宏观变量。然而,越来越多的经济学家也意识到主流宏观经济学的瓦尔拉斯微观基础体系是不充分的,即便在一般均衡理论的分析框架内,微观基础^①也存在一些基本问题,并不是所有的个人或市场都能够被有效地、连贯地描述。

收稿日期:2005-06-28

基金项目:教育部人文社科项目(03J790023),浙江社会科学基金项目(NM03LJ6)

作者简介:汪浩瀚(1964—),男,安徽合肥人,宁波大学商学院教授。

一、微观基础与凯恩斯宏观经济理论

西方经济学的边际革命构筑了微观经济学的基础,而凯恩斯革命则奠定了宏观经济学的分析基础。然而,两者的发展却基本上是在各自的领域内较为独立地进行。传统的观点一般都认为,由于在凯恩斯经济学里,宏观行为或总量规律并不是由微观行为推演而来,而是依据价格刚性假设和三个基本心理规律来构筑的,因此,新古典微观分析难以成为其宏观分析的微观经济基础。然而,凯恩斯确实将它的宏观理论建立在微观经济基础之上,而这一微观基础并非是新古典的。正确理解凯恩斯宏观理论微观基础问题的困难和复杂性是关于其微观经济学的基本特征问题,尤其是与新古典宏观经济学的关系。凯恩斯对市场经济本质的独特视角使他注重对影响个体行为的社会条件的重要性分析。在这方面,凯恩斯所建立的不确定性基本概念和由此建立的不确定性经济分析框架起到了至关重要的作用。

凯恩斯在《通论》中将消费倾向、资本资产的预期收益和流动性偏好这三个基本的心理因素运用到解释收入与就业水平的变化中。正如凯恩斯所指出的,一个显而易见的事实是,我们对预期收入作出估计时所依赖的基本信息是极其不确定的。如果从心理角度理解对消费、货币及投资的总需求,显然凯恩斯的理论是建立在对个体行为分析的基础上的。在其他情况下,凯恩斯也明确地指出只有从个体行为分析着手,才可以很好地理解整体经济行为。他认为,经济学家与自然科学家的区别在于前者要涉及到动机、期望、心理不确定性。所以,一个好的经济学家必须依赖于内省,内省是对个人经验的沉思并通过类比将这种个人经验推论到一般层面上。凯恩斯对新古典经济学基于经济主体是完全理性和信息完全基础上的自由市场理论的逻辑提出了质疑,他把不确定性与信息完备性联系在一起,实际上奠定了现代不确定性理论的基础。对凯恩斯而言,个体应该把决策建立在有一定信念的事实上,经济行为主体对未来没有完全的认知,这是一个似乎被那些深信新古典传统的经济学家所忽略的事实。

此外,从凯恩斯对不确定条件下市场经济运行的分析来看,重要的决策单位是企业家而不是普通的个体。但是,凯恩斯强调微观经济分析的重要性并不被普遍接受。特别在《通论》中,凯恩斯的论述也许使人产生了他的微观经济学与新古典的微观经济学并没有多少不同这样一种观念,他只是批评了新古典经济学忽视了总体产量的需求理论,而并没有批评其不合理的个体行为理论。但是,有一个关键因素使凯恩斯的个体行为观点与新古典的个体行为观点根本不同。凯恩斯方法的特征是确信经济、社会及环境是由不确定性支配的,而这种不确定性不能被简化成风险,也不能用传统的概率论工具处理。所以,凯恩斯的不确定性概念与新古典经济中的个体行为分析是不一致的。

凯恩斯对个体行为的分析主要集中在个体的一个具体层面,这个层面的决策对经济的运行至关重要。凯恩斯通过将企业家的决策置于他分析的中心,使自己更接近于古典传统而不是接近于新古典经济的分析视野。

二、主流宏观经济学的发展与其微观基础的分析视角

凯恩斯创立宏观经济学之后,一些著名的经济学家把凯恩斯对宏观经济丰富多彩的描述还原成枯燥的经典力学体系,其中主要代表人物有希克斯、帕廷金和萨缪尔森等。以萨缪尔森为代表的新古典综合理论力图把凯恩斯经济学移植到传统的新古典经济学的理论基础上,并试图在均衡分析的模式里,将凯恩斯理论与以价格为中心的新古典微观理论加以协调综合,使价格分析成为投资、储蓄分析的微观基础。在此期间,主流宏观经济学的发展主要表现在:一是从经济总量关系入手,建立消费函数、投资函数、货币需求函数等来研究变量之间的相互作用,二是沿着瓦尔拉斯或非瓦尔拉斯方向构筑各自宏观理论的微观基础。

自 20 世纪 60 年代以来,西方经济学界各派对如何使微观经济和宏观经济相结合的机制问题一直争论不休,其中受到责难较多的是被认为缺乏微观经济理论基础的凯恩斯的宏观经济学。实际上,自从货币学派反凯恩斯革命开始,新古典综合派就因为没有使它的宏观经济分析与微观经济的新古典视野相一致而一直受到指责。

为弥补新古典综合派的不足,新古典宏观经济学把宏观预期引入微观经济选择理论的框架中,明确地把微观理论作为宏观分析的基础并将二者有机地加以结合。该理论主张所有宏观经济理论的建立必须基于个体最优化行为,经济行为人根据对宏观经济变动的预期来选择对应的最优行动,这种微观行为会引起宏观总量关系的相应变化,因此预期形成机制理论便在微观与宏观经济之间架起了一座桥梁。近些年来,异军突起的新凯恩斯经济学也试图克服新古典综合派对微观基础问题解释的不足而与严格的微观经济基础相一致。他们试图吸取新古典宏观经济学的理性预期假说,甚至承认自然失业率的存在来补充凯恩斯宏观经济学的微观经济基础。

与此同时,从 20 世纪 60 年代中期开始,几乎所有的西方经济学家均对货币理论缺乏微观基础表示不满,由此引发了对货币理论的进一步改进。一种发展方向是力图建立微观的现代货币理论,解释为什么货币会存在,为什么货币是重要的,并在此基础上维护已有的货币经济理论体系;另一个变动的方向则对传统货币理论的基本框架提出质疑,认为货币与非货币之间并无本质区别,货币经济学不能把基本框架建立在一个含糊不清的货币概念之上,试图取消货币在经济理论中的独特地位,以便从根本上解决现实经济中的货币波动与干扰。在货币经济和金融经济学的理论和实践中也呈现出微观化的倾向,

其微观化的核心动力就是处于现代经济体系中心的资本市场的不确定性。当在金融体系中资本市场成为核心部分的情况下,金融风险更多地来自于金融微观结构的设计和安排,来自于市场的不确定性或者与市场不确定性有关的各种风险,这是金融微观化的根本原因。

而这一微观化的势头同样体现在国际贸易领域。根据在完全竞争框架下的经典国际贸易理论,国际贸易更多地应该在劳动生产率、资源禀赋不同的国家间进行,作为国际贸易的结果,生产要素的价格会趋于均等,贸易国家双方都会获得利益。但是国际贸易的现实向人们揭示了大量的国际贸易是在人均国民收入、劳动生产率和资源禀赋相似的国家间进行的,即所谓的“产业内贸易”现象,并成为近些年来国际贸易理论的热门研究领域。为了解释这一新的国际贸易格局,人们开始重视规模经济、递增收益以及不完全竞争的市场结构在国际贸易理论中的作用,国际贸易理论开始吸收产业组织理论以及博弈论的分析方法和理论框架作为它的补充和扩展,这使得国际贸易理论朝着以不完全竞争的市场结构为基础的研究方向发展,重视以公司或产业的特点来解释国际贸易格局。

在宏观经济增长领域,现代增长理论的研究也越来越多地采用了新古典主义的微观分析方法,并在形式上日趋微观化,这种状况在以罗默和卢卡斯为代表的新的增长模式中更为显著。而早在 20 世纪 20 年代,拉姆齐模型^②就从宏观和微观相结合的角度来研究宏观经济增长问题,开创了在微观基础上分析宏观问题的较早先例,并对当今经济学研究产生了重要的影响。拉姆齐模型的构建是建立在具有一定假设条件的微观基础之上,从微观的角度出发,通过效用函数和生产函数的约束,在满足最优化的条件下,求解出宏观的最优消费和资本积累路径。所以该模型虽然是讨论宏观经济增长问题,但却放弃了宏观和微观相互脱离的状态,把宏观分析建立在有效的微观基础之上。

三、非主流宏观经济学关于微观基础的分析视角

由于现实经济活动中微观个体所存在的异质性和相互作用,到目前为止,主流经济学的微观基础问题一直没能得到很好的解决,对主流宏观经济的微观基础问题的质疑也相继出现。

(一)后凯恩斯主义的观点

非主流经济学家,特别是后凯恩斯主义者,对传统意义上宏观经济学的微观经济基础之争抱有很大的怀疑。他们认为,试图在新古典视野里解释宏观现象是对凯恩斯理论的背叛。以罗宾逊为代表的新剑桥学派强烈反对宏观与微观经济学之间的划分,他们认为,凯恩斯的宏观理论缺乏价值理论和市场结构理论等方面的微观分析,必须联系微观的商品决定来研究宏观的国民收入分配问题,价值本身应具有客观的物质基础。此外,新剑桥学派还主张在宏观

与微观分析方法的结合上,应当采取李嘉图的价值论和分配论,并用历史的概念替代均衡概念,以收入分配的结构分析作为凯恩斯宏观理论的微观基础。

许多后凯恩斯主义经济学家在谈到宏观经济学的微观经济基础这一话题时,往往倾向于强调真正需要的是微观经济学的宏观基础,而不是宏观经济学的微观基础。后凯恩斯主义者倾向于采纳一种双向式分析法,认为宏观经济学对微观经济学的影响与微观对宏观的影响同样显著,他们企图建立一个与现实紧密相关的稳定的微观基础,克洛尔和莱荣霍夫德在运用一般均衡分析重新评价凯恩斯理论时认为,从瓦尔拉斯世界转换到凯恩斯世界的一个关键是抛弃了瓦尔拉斯的“拍卖人”神话机制,该拍卖者被假定免费提供完美协调所有交易者当前和未来活动所需的全部信息。同时,克洛尔还严厉批评所有的主流宏观学派,认为他们没有严肃对待市场过程,市场和货币制度是由企业、个人和政府创造的,要真正理解市场过程,应当创造一种建立在马歇尔微观基础之上的,而不是在瓦尔拉斯微观基础之上的宏观经济学。

为了能对个体行为作出合理的解释,我们必须考虑市场经济内在特征的限制。西蒙认为对各种可能选择的全部范围作出决策,超出了经济决策单位的处理能力,因而决策制定过程仅能在一个宏观环境背景中实现。他用习惯、决策规则等取代最大化计算概念和最优概念,又保留了部分理性概念。大多数后凯恩斯主义均赞同西蒙的观点,并采用了一种制度方法来寻求并确定一个适宜的宏观基础。由于现实中的制度变迁并不是在单个人而是在单个人组成的利益集团的相互冲突和合作中进行的,那么,单个人的行为又是如何形成集体行为?要解释这一问题制度变迁理论还是需要其微观基础的。在这个问题上,奥尔森的集体行动的逻辑、公共选择理论和博弈论等都提供了很好的分析思路。

(二)基于演化理论的微观基础

演化是发生在经济的水平组织结构中的一种确实存在的现象,包括科学、技术、商业、市场、法律体制、消费偏好及广义的制度与文化等。演化思想的萌芽很早就已存在于经济理论中,斯密早在《国富论》中就已经给我们提供了经济均衡和演化两种理论,但当边际主义开始致力于经济分析的形式化时,其演化思想便无法纳入新古典的最大化分析框架中而被人们逐渐“遗忘”了。马歇尔在其《经济学原理》中也指出,经济学的目标应当在于经济生物学而不是经济力学,但生物学概念更复杂,一百多年来,演化理论一直既是生物学也是经济学的核心。但是,大多数情况下,经济学对演化理论的应用一直局限于对达尔文“自然选择”的应用。

进入20世纪80年代后,演化思想又促使人们在主流经济体系之外发展了经济演化理论。1982年尼尔森和温特的《经济变迁的演进理论》一书的出版,是演化经济学的一个突破。演化生物学中诸如路径依赖、适应性、自组织、

共同进化等概念正开始影响经济思维。但是,即使在非主流经济学家中仍流行这样的观点,即方法论个体主义是经济问题比较偏好的方法,经济变迁是渐进式的、并由具有边际意义上的效率改进所推动。在演化微观经济学方面,罗斯比认为,在解释企业及相关宏观经济演化过程时,内部选择过程起着重要作用;戴伊也强调,在适应、学习和经济化的概念和理论形成阶段,通过引进“中观层次”,人们可以以一种相当不同的方式考察经济学的微观和宏观领域。微观个体和宏观个体群,再加之异质性和多样化,构成了一种演化的结构和过程解释的核心。当今演化经济学的各种流派虽然基本观点有所分歧,但都对新古典经济学的正统理念提出了挑战,并试图运用现代动态的分析方法,来揭示经济发展的过程及制度变迁,以此重构经济学的分析范式。

事实上,经济系统和生物系统一样,演化主要是两种机制推动的:一个是创新机制,通过系统的创新产生多样化;一个是选择机制^③。生物学中宏微观之争所讨论的问题要比经济学中类似的争论广泛得多,这也就是我们之所以要考虑生物学中宏微观之争的原因。演化生物学理论包括达尔文微观层面的自然选择理论及宏观层面的排序理论^④,而集体选择又是演化生物学中一个被热烈讨论的问题,它不是将宏观现象仅仅看作是个体不协调行动的总和。与生物学中一样,合作与竞争也在经济演化中同样起到根本性的作用。人类社会中集体选择的存在同样也对以个体效用理论为基础的基本行为假设中的一些观点提出了挑战,人类社会认知的存在表明在人类群体中是有集体选择的,因为文化规范会导致或抑制可能的个体行为,所有的这些都与微观基础之争有直接关联。

四、争论与评价

在分散化的经济中,我们所观察到的宏观现象是个体决策和行动的结果,因此要合理分析宏观经济运行就必须分析个体行为。格林沃德和斯蒂格利茨认为,只有当主流微观经济分析令人满意时,才有可能辨别不同的宏观经济理论。宏观现象的统计分析并不足以使经济学家能够在各种理论中作出选择,从而在某种程度上解释了微观经济基础的必要性。

传统宏观经济学把个体决策集合成各种聚合体,如投资、消费和储蓄,并就其行为和关系提出了各种命题。主流经济理论构筑微观基础有两种常用的方法:一是对微观层面的函数设置约束,这样就宏观层面的结果而言,微观层面的分配对其不会有影响,而且信息在集中加总中也不会丢失;二是基于理性行为所激发的边际规则,对微观层面的变量值实行限制。不管采用何种方法,总是假定总变量等于微观层面变量之和,即宏观关系式类似于微观关系式。但是这两种情况往往不能同时并存表明,为微观与宏观经济关系寻找一个明确独特的微观基础是徒劳的,微观经济理论及模型与宏观经济理论及模型应

视为是互补的。由于经济资源的变化是由一种资源或几种资源数量的外生变化引起的,现代微观和宏观经济学仅关注和研究资源运动的表层水平,忽略了结构、过程及深层结构的复杂性,尤其是制度和技术的复杂性。从这个意义上讲,主流宏观经济理论使用的代表性主体概念、同质线性生产函数和非结构性总量不能作为分析资源总量的出发点。

当今主流宏观经济理论事先假设知道经济主体对未来预期的形成过程,没有考虑协调失灵等重要问题。因此,其所构筑的微观基础本质上还不能为宏观分析找到一个严格的微观基础。尽管主流经济学家从市场经济的本质中推导出方法论的个体主义,但这并不意味着新古典方法是惟一可能的理论路径。新古典的经济人假设处于方法论个体主义的核心,能够在独立和隔绝的情况下作出无条件的决策,但是这种隔绝的独立体往往并不存在,个体是社会实体,所以他们的决策和行为必定受到历史与社会条件的限制。在自由竞争的社会里,对个体行为作出严格的解释是必须的,但这并不意味着要将个体的概念还原到经济人这一新古典概念。而且,强调个体行为分析的必要性也不意味着总变量一定是个体变量的简单加总,整体不是部分的简单加总。

凯恩斯的确在个体行为分析的基础上分析了总体现象,但他并不认为个体作出的决策是受社会条件限制的,也没有指出“合成谬误”。凯恩斯宏观经济理论之所以被指责缺乏微观经济基础,原因在于其理论被误认为与20世纪50年代和60年代的新古典综合派的宏观经济学相同。如果新古典综合派是凯恩斯《通论》的直接衍生物的话,那对凯恩斯的批评是正确的。但是,正如后凯恩斯主义者强烈指出的,凯恩斯理论并不能被还原成新古典综合派。事实上,凯恩斯是将他的宏观经济理论建立在微观经济分析之上,而这种微观经济分析与个体行为的新古典分析具有本质的不同。凯恩斯方法的基本特点是他强调不确定性及在经济中企业家而非普通的个体是重要的决策主体这一事实。对后凯恩斯主义者而言,凯恩斯的理论代表了同正统经济学的分道扬镳。凯恩斯试图用一种新的理论框架来解释我们生活的这个世界,而后凯恩斯主义者努力进一步发展这一理论。

演化经济理论认为,微观经济分析应该采用离散的形式来描述和分析经济体制与经济变迁,经济变迁就是从关联的宏观及微观动力学方面考虑经济制度的变化,社会制度是通过集体行为及个体选择与集体选择,从复杂动态的个体互动中演变而来。而传统的均衡理论假定现实的连续性,允许应用诸如微积分这样的技术以及均衡、代表性经济主体、生产及效用函数这样的概念来阐释经济活动。在演化经济学看来,微观基础争论的焦点是如何解释变迁,对于两个时点间的经济实体的结构为什么会不同,新古典经济学的答案是效率,若以经济利润衡量,那些合适的公司或技术就生存下来;反之,那些不合适的公司或技术就消亡。演化视角的层级解释则提供了一个更为一般的框架,因

为它认可了微观层面效率的重要性,同时也承认其他因素对各种层面的经济变迁起着推动作用。

后凯恩斯经济学和演化经济学的研究方法不同于新古典经济理论的,他们都对以一般均衡理论为基础的新古典消费者行为与企业行为的微观层面模型提出了批评,替代的方法是从行为研究、博弈论及社会科学与自然科学的其他领域寻找分析的工具。有证据表明,绝大多数个人在行为上不会遵从静态意义上的理性或是理性预期所假设的严格理性。一个显而易见的事实是:决策成本是明确的,而关于经济结构的知识是不完全的,建立在严格理性行为微观基础之上的宏观经济变迁理论也已经受到经济心理学和行为经济学理论的挑战。演化经济学具有比最优和均衡更多的内容,演化经济模型显然与新古典经济学集中于优化计算、个体间均衡的一致性的建模方法不相容。

目前,实验经济学的迅速发展已经使得许多理论家致力于建立简单、具体和可进行检验的理论研究,而不是构建复杂、抽象和具有普适性的理论。新古典经济学和演化生物学之间究竟是像水与火一样的关系,还是存在互补并有可能进行杂交和综合?我们认为,通过超越方法论的个体主义,演化生物学的框架可以丰富传统的经济分析。最优是合理行为的极端特例,均衡不是被限定在某种状态中,现实经济也并不总是处在所定义的均衡中。宏观经济学应该吸收演化生物学的发展以建立一个更为一般的理论以解释现实经济的变迁,并最终能提供一个结构完善的理论以替代新古典经济理论。如果生物演化范式能够成功地把当前的新古典经济范式纳入进来,并尽可能不损害已有的知识体系,那么经济学将会在现实现象的分析上取得更大的进步。

* 本研究为汪浩瀚主持的教育部人文社科项目“宏观经济分析的方法论研究”和浙江省社会科学基金项目“不确定性经济学研究”的阶段成果。

注释:

- ①探寻经济体系中微观家庭和厂商的行为与宏观总量行为之间的内在关系,并通过对个体行为的分析来阐释宏观经济总量之间的关系,即是主流宏观经济学所致力于构筑的微观基础。
- ②参见汤为本:《论拉姆齐模型与现代宏观经济学的发展》,《中南财经政法大学学报》2004年第6期,第27页。
- ③选择机制是指经济系统的制度背景会有利于某些惯例,而不利于另一些惯例。选择将改变习惯及其个人和组织的行为方式,所以社会经济演化可看作是对多种制度进行选择的过程。
- ④为了说明宏观演化与微观演化的区别,有必要对“排序”与“选择”进行区分。排序是一个广义的术语,仅仅意味着不同的生存等级;选择是指由于竞争压力的达尔文选择,它是一种原因,而排序是一个更为广义的术语,仅仅说明一种结果。排序不仅仅是发生在生物学中个体层次和经济学中公司或技术层次,而是可以发生在所有层次。

参考文献:

- [1] E Roy Weintraub. Uncertainty and the Keynesian revolution[J]. *History of Political Economy*, 1975, 2: 17~26.
- [2] D Colander. *Beyond micorfoundations: Post Walrasian macroeconomics*[M]. Cambridge: Cambridge University Press, 1996.
- [3] G C Harcourt. *The microeconomic foundations of Macroeconomics*[M]. Boulder, Colorado: Westview Press, 1977.
- [4] Jeroen C J M. van den Bergh, John M. Gowdy. The microfoundations of macroeconomics: an evolutionary perspective[J]. *Cambridge Journal of Economics*, 2003, (27): 65~84.
- [5] 哈奇森. 经济学的革命与发展[M]. 北京: 北京大学出版社, 1992.
- [6] 纳尔逊, 温特. 经济变迁的演化理论[M]. 北京: 商务印书馆, 1997.
- [7] 杨瑞龙. 宏观非均衡的微观基础[M]. 北京: 经济科学出版社, 1994.
- [8] 刘金全, 张屹山. 宏观经济分析的微观基础[J]. *吉林大学社会科学学报*, 2001, (2): 62~63.
- [9] 汤为本. 论拉姆齐模型与现代宏观经济学的发展[J]. *中南财经政法大学学报*, 2004, (6): 27.
- [10] 汪浩瀚. 后瓦尔拉斯宏观经济理论评析[J]. *经济学动态*, 2003, (4): 75.

On Different Perspective and Nature of the Microfoundations in Macroeconomics

WANG Hao-han

(School of Business, Ningbo University, Ningbo 315211, China)

Abstract: Since the 1960s, various branches of macroeconomics have placed increasing emphasis on seeking the microfoundations for macroeconomic theory. Mainstream economists believe that macroeconomic theory should be based on the microfoundation which consists with the basic feature of New Classic model; Non-Mainstream economists adopt a highly skeptical attitude toward the traditional arguments about the microfoundations for macroeconomics; Post Keynesist maintain that we should devote time and energies to macrofoundations for microeconomics; Evolutionary economic theory argue that how to explain the social changes is really the key point. By combing and commenting on the substance of the microfoundation argument, this paper explores the inherent mechanism of formation as well as the change trend for the macroeconomics system.

Key words: micorfoundations; New Classic economic theory; individualism; evolution

(责任编辑 金 澜)