

从微观基础到宏观基础 看现代宏观经济理论的发展

汪浩瀚

摘要:对经济学基础的思考是经济学方法论的主要内容,而对微观与宏观经济基础的构建一直是现代经济学发展最为活跃的领域之一,也是各宏观分支理论争论的焦点。自凯恩斯革命后,由于宏观经济学缺乏相应的微观经济基础,导致自20世纪60年代开始引发了为宏观经济学寻找微观基础的潮流;近些年来,又出现了尝试为微观经济建立宏观基础的后瓦尔拉斯宏观经济理论,这种新的理论试图超越微观基础,从而揭示现代各宏观经济理论纷争的实质。

关键词:微观基础 方法论的个人主义 宏观基础

自斯密的“看不见的手”原理提出之后,经济学发展的历史主要是围绕着微观和宏观两大基础范式:资源配置范式和凯恩斯范式展开的,但在古典经济学体系里,整个经济理论没有微观和宏观之间的区分,也没能意识到从个体层面和总体层面观察经济,其结论会产生显著差异,更没有对微观与宏观之间的内在联系予以过多的关注。新古典经济学认为经济运行应是协调平稳的,只有实际产量能产生实际影响,经济自身能克服短期的失衡,恢复到均衡水平上来。凯恩斯革命后,凯恩斯的总量分析模式使宏观经济学与微观经济学产生了分立:在微观经济领域,瓦尔拉斯一般均衡理论居于统治地位;而在宏观经济领域,凯恩斯宏观失业非均衡理论占据主流位置。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,微观均衡分析难以成为宏观非均衡分析的微观经济基础,因此,古典主义宏观思想与凯恩斯主义宏观思想的激烈交锋在整个宏观经济的分支理论中表现得尤为淋漓尽致,凯恩斯宏观理论与一般均衡理论存在着明显的不相容性,也是新古典经济学存在的基本问题。

一、微观基础的基本含义与方法论问题

一般来说,由于微观层面上经济行为者之间具有分散性和非平稳性,人们总是试图理想化地在宏观现象与微观现象之间建构一个统一的或至少是相容的理论体系,近几十年来,经济理论力图发展一种精致复杂的分析结构来连接微观与宏观的脱节。主流宏观经济学微观基础是旨在通过对个体行为的分析来阐释宏观经济总量之间的关系,任何想把宏观经济分析置于坚实的微观基础立足点主要通过三个方面实现:行为主体决策的微观经济研究及主体间的相互作用;行为的加总,即研究微观行为的宏观经济含义以及来自宏观经济行为规则的微观选择的推演;经济理论和经验数据的比较。关于宏观经济学的微观基础问题涉及依据总量表示的理论与行为之间的关系,它包括行为的协调、决策者对自身行动不确定后果的反应及均衡的含义等。具体地说,微观基础主要表现在:宏观经济理论应拥有微观个体的行为基础、微观结构基础和微观个体行为之间的协同性。

凯恩斯创立宏观经济学之后,宏观经济学的发展主要表

现在:一是从经济总量关系入手,建立诸如消费函数、投资函数、货币需求函数等来研究它们之间的相互作用,最为成功代表的是希克斯构造的IS-LM模型,但并没有解决凯恩斯消费函数中收入既定与传统均衡分析收入可以内生决定的假定之间存在的矛盾;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,特别是近二三十年来,这一倾向更加凸显。

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,但“这样形成的凯恩斯主义宏观经济学与新古典微观经济学之间的融合就如油和水的融合一样”,只能是松散的搭配在一起。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。他们借鉴了斯拉法的价值理论,从而为其收入分配理论提供了一个价值理论的基础。此外,新剑桥学派还主张应从垄断竞争的市场结构角度来剖析滞胀等问题,用一般均衡分析作为凯恩斯宏观经济学的微观基础本质上抽掉了凯恩斯主义的精华,因此,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。

斯蒂格利茨认为,调和宏观与微观这两种理论的方式可以有两种:要么使宏观理论适应微观理论,即采用新古典方法;要么使微观理论适应宏观理论,即采用新凯恩斯主义方法。近二三十年中,这些调和的尝试与努力在主流宏观经济理论中一直占据着支配地位。

自凯恩斯主义问世以来,微观经济学的建立是以方法论的个体主义为核心,而宏观经济理论的发展则注重方法论的整体主义,关注的是整个经济的结构、表现和行为。两种方法论争论的焦点集中于是否存在不可还原为个体特性的经济规律这个问题上。主流宏观经济理论试图将经济看作一个内在相关的整体来分析,而不是关注于分离的经济主体

各种类型的活动,与微观经济学相比,像诸如总量消费函数、总量生产函数、总量投资函数、菲利普斯曲线、货币非中性理论及哈罗德—多马经济增长理论等总量关系均体现在众多宏观经济理论之中。这些关系中的每一种都可以用诸如国民生产总值、总的价格水平、总的货币供给等总量变量基于一个稳定的因果关系来体现,几乎与个体的最优化行为没有什么关联。由于这种以总量分析为核心的方法论思想缺乏相应的微观基础,所以方法论的个体主义思想在宏观经济分析中一直较为盛行,也是新古典微观经济学的思维范式在宏观经济里的延伸。

个体主义方法论思想源于早期具有科学方法论原理意义的原子论假说,它是支配经济学和其他社会科学唯一普遍的方法论原则,个体主义分析方法也是自斯密以来主流经济学家分析的出发点。个体主义方法论把个人看作是分析和规范化的基础,而社会则被视为一种个人追求其自身利益的总量效果,所有的社会现象和社会变化都只能通过对个人的行为、愿望及信仰的考察来解释,所以社会理论必须植根于个人态度和行为。这种方法要么倾向于将个人偏好视作理论体系之外的因素,要么把外部因素的影响看成极为有限,个人偏好的变动取决于预先设定的效用函数,个人遵循给定的模式对经济作出反应,一旦偏好确定,选择也相应被固定下来。方法论的个体主义的最低限度条件是,只有个人作出决策,其重点关注个人行为如何产生制度和制度变迁。

个体主义方法论的认识基础是,一切经济现象都可以视为在交换过程中利益冲突的无数个人愿望和追求的结果。于是从认识论中引申出来的方法论原则就是:从个人的经济行为出发来理解整体的市场行为。方法论的个体主义是微观经济学的方法论基础,也是理性选择理论的基本方法论。方法论个体主义的解释排除掉了所有不能简化为微观命题的全部宏观经济学命题,由于至今只有很少宏观经济学命题做了这种简化,所以依据个体主义方法论思想,几乎大部份宏观经济学内容都要被排除掉。

二、微观基础的构筑: 代表性主体范式与微观基础

由于凯恩斯宏观理论直接采用总量行为描述经济,没有涉及微观基础的构造问题,一般来说,宏观经济理论要么是在已有的微观理论中寻找相应的微观基础,要么重新构造适宜的微观基础。对微观基础的构造应满足以下几方面的要求:微观基础应该使宏观体现出微观的综合和加总,宏观总量行为应该具有个体行为的加总能力;微观基础应当建立在微观个体行为为理性和优化行为及信息结构之上,在处理微观优化问题时,可以采用宏观约束条件,也可以把微观约束条件结合到宏观目标函数中,同时宏观上的信息也应具有可加总性,从而保持微观和宏观在理性行为上的统一;在宏观总量模式中,总量行为方程应有较为明确的微观支撑,宏观层次的性质应该在微观层次有所对应,微观与宏观之间的传导机制,在宏观层次上清晰地加以显现;微观基础应当具有时间上的连续性和结构上的稳定性,如果微观行为方式或者结构发生变化,而宏观结构方程或结构参数不能及时地加以调整,就会出现宏微观结构之间的所谓“卢卡斯批判”。

主流宏观经济理论通行的两种作法是,要么采用典型个体代替群体,要么完全忽略微观个体的行为分析,无论采用哪种方法,都可能导致宏观经济分析和微观经济分析的相互

分离。这里现主要剖析现代宏观经济理论中频繁使用的用典型个体代替群体的模式——代表性主体范式。

(一) 代表性主体假设

代表性主体假设是基于对利己行为的基本性质特殊考虑的一种个体行为分离理论,被视为连接宏微观之间的桥梁。代表性主体概念源于马歇尔的《经济学原理》,其微观供给理论是以产业部门为范围,对企业的内部经济和外部经济进行研究,但由于各个企业的生产经营状况有很大差异,为此他提出了代表性企业概念,将其作为生产企业的代表。其定义是:“一个具有相当长久历史且相当成功,而又具有正常经营能力和能正常的获得其总生产量的外部及内部经济的企业。”马歇尔尝试运用这一概念来建立其微观经济分析的公理体系,通过设计代表性企业,他试图协调在使用局部均衡分析方法考察众多异质企业和报酬递增、报酬递减行业时所遇到的矛盾。马歇尔意识到一个商品的供给取决于生产这种商品的成本,但是在任何给定的产业中,由于大量不同规模企业的存在和企业内在的规模经济,这些不同规模的企业将会以不同的成本提供给市场同样的产品。为此,他设计这一概念是想避免假定所有企业以完全相同的方式从事生产的情况下,能够用一个单一的市场价格描述一个产业的均衡状态,并进一步说明一个由不同企业构成的产业如何能够生成单一的市场价格。代表性企业很类似于庇古构造的“均衡性企业”概念,也非常相像于在竞争性均衡条件下对企业的描述,它不是某种统计意义上的构造,也不能被看成是一个可以生产所有总量产出的巨大超级企业。代表性个体假设是马歇尔作为从多样化的现实和个体行为角度出发的—种简化手段,成为马歇尔进行产业分析的基本单位和研究商品供给的有力工具。

在代表性主体假设基础上拓展而来的代表性主体模型力图进一步探讨个体行为是如何转换到总量水平,它假设总量经济活动类似于一个巨大的实体,采用的方法论思想是沿袭牛顿力学的分析范式。在牛顿分析模式里,对系统是通过辨识其零部件,再加上零部件的因果关系,并最终得到某种机械的组合来建立系统模型。代表性主体假设设定经济行为人的行动非常相像于构成总量的微观实体,在这类模型里,代表性主体的最优化问题已被明晰地解决。主流宏观经济理论在很大程度上是通过限制性的代表性主体假定来构造宏观经济均衡的微观基础,例如,货币学派、新古典宏观经济学和新凯恩斯经济学均采用了大量的代表性主体分析范式,将微观分析宏观化来建立各自宏观理论的微观基础。

然而代表性主体只能表示市场参与者总量水平意义上的一种简化的平均水平,在马歇尔的分析框架里,它与其他一些简化的假定没有什么不同,在对经济主体异质性的处理上它同样不具有什么独特的地方。显然,为避免异质主体的复杂性而采用代表性主体假设有助于分析过程的简化,但在一些诸如主体拥有非对称信息或战略反应、代理人合作或非合作博弈等问题的分析中,由于异质性假定至关重要,使用代表性主体则显得不合时宜了。正如杨格所指出的:“随着产业间劳动分工的扩大,代表性企业,正像它是其中部分的产业一样,丧失了同一性。”

(二) 主流宏观经济理论的微观基础

现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。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,十分注重其微观基础,并关注价格信号、预期及数量调整之间的微观和宏观经济的联系;格罗斯曼认为传统宏观经济分析的基础很薄弱,需要重新构造微观经济基础;新古典宏观经济学通过结合理性预期假设来使用代表性主体模型,并认为经济主体在宏观经济活动中有能力把握正确的宏观经济模型。该学派将宏观预期引入微观经济选择理论的框架中,认为经济行为人会利用一切机会实现自身利益最大化。其代表人物卢卡斯、萨金特和巴罗等认为,凯恩斯宏观经济学存在的致命缺陷之一是缺乏微观基础,因此宏观经济学的微观基础就是自由市场经济理论。其成功之处不仅仅在于提出了新的预期机制,而是它明确地把微观理论作为宏观分析的基础。卢卡斯借助于建立在一系列微观假设基础上的单个产品市场的供给函数,加总平均推导出总供给函数,这与马歇尔为代表的新古典学派和凯恩斯主义流行的总供给函数通过总量生产函数和劳动供求函数来建立总供给函数截然不同。新古典宏观理论认为:经济行为人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,经济行为人为人不同的预期形成机制会导致宏观经济总量间的不同规律,从而会产生不同的政策效果。在新古典宏观经济的视野里,凯恩斯革命切断了支撑自身宏观理论的一些重要表述与一般均衡理论的联接,特别是其与最大化微观假设的矛盾。

新凯恩斯经济学在吸收了新古典宏观经济学经济主体最大化和理性预期假设的基础上,沿袭了其所采用的代表性主体模型来考虑总量经济问题,并建立了一系列有微观基础的模型来解释宏观经济的总量变动。新凯恩斯主义通过引入名义粘性和实际粘性并解释这两种粘性产生的原因,试图弥补凯恩斯理论缺少价格和工资粘性的微观基础这一不足,进而为其宏观经济理论建立微观基础。

近些年来,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,这种状况在罗默和卢卡斯为代表的新增长模式中更为显著。它们将传统的总量增长模式改造成为一种近似于微观经济理论的增长模式,把从注重对一般技术进步和人力资本的研究转移到对某种特殊知识需要的专业化人力资本的分析,这使得新增长理论较少采用边际分析方法,转而更多地采用宏观问题微观化的方法。20世纪80年代以来兴起的演化经济学抛弃了新古典经济学的利润最大化等假定,充分考虑到了微观个体的差异性、技术创新的不确定性、多样性及路径依赖等特征,为分析微观层次的变动和宏观经济的联系提供了可能,从而给演化经济理论建立了清晰的微观基础。

宏观经济理论的微观基础在许多问题上,就是宏观理论的古典基础,任何一种宏观经济理论都要有其相应的微观基础,似乎已成为经济学家们达成一致的共识。

三、宏观基础的由来与含义

经济学家普遍认为,就宏观基础而言,市场经济的运行并不能自行恢复平衡,市场不会自动出清,而其原因也并不完全在于市场的不完全性。由于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,这种假设忽视了产生总量行为的个体差异和总量结构所拥有的有效信息,更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。新

古典宏观和新凯恩斯经济学所提供的微观基础到目前为止还不能令人满意,要实现微观与宏观真正意义上的综合,还应考察宏观层面的行为对微观经济活动的影响,即要考虑微观经济学的宏观基础。

事实上,从凯恩斯开始已经重视微观经济的宏观基础问题,他在建立有效需求原理时的一个成功之处是将斯密式的“同情心”转换成经济形式。凯恩斯的一个重要贡献就是把这个哲学意义上的话题引入经济分析中,他主张经济主体需要遵循常规惯例,从而把协调方面的分析引入其经济理论中,惯例在凯恩斯理论体系中被看作是实现个体理性目标的手段。他认为预期直接表现为总量心理数据的形式,且在某种意义上预期是客观的,其所强调的总量心理数据准则对个体预期的形成意味着对传统微观经济理论的一种重要评价,即认为它缺乏必要的宏观基础。凯恩斯的主要看法是,这些短期的宏观变量即使在新古典微观模型中也很有必要给予足够的解释,特别地诸如国民生产总值(GNP)、一般价格水平和预期这些总体并不依赖于任何特定个体的心理状态,而是依赖于所有其他个体的行为和预期。由于存在一些总量心理数据的客观经济因素不能被还原为一种个体决策的总和,所以,单个个体到总量的转换并不能够轻易地实现。

西蒙关于有限理性和满意行为思想的研究,开辟了现代宏观基础研究具有里程碑意义的分析基础。他认为,对各种可能选择的全部范围作出决策,超出了经济决策制定单位的处理能力,因而决策制定过程意味着仅能在一个宏观环境背景中实现。人们所实现的理性都是局部的,一般不可能知道所有的完备方案,在局部既定的约束下,求目标函数的最大化就是理性行为。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,由于认知的限制,理性是有限的,人们没有能力用最优的方式解决复杂问题,而所做的是建立易于遵循并发挥一定作用的决策规则。大多数后凯恩斯主义赞同西蒙的观点,采用了一种制度方法来寻求并确定一个适宜的宏观基础。该学派认为,在开始讨论市场各部分如何运转时,需要一套有关市场的理论,并应说明为什么要建立市场及市场的作用。在宏观总量世界里,个体决策的制定是依据现已存在的制度结构作出,经验观察是确定一个合理的宏观限制性选择的唯一途径,这种宏观环境能使个体在多重均衡中作出选择,并能够和具有环境背景的选择性基础相互关联。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也认为,在瓦尔拉斯一般均衡理论中,协调问题是通过虚构的瓦尔拉斯拍卖人神话机制来实现的,并使经济体系调整到最优均衡状态。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:“凯恩斯从古典学派理论基础上去除的唯一东西,就是那个解围之神——即那个拍卖者,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。

由于主流经济学比较习惯于用还原论方法把复杂的经济系统简约化为简单的模型,进而叠加得到整个系统的性质。为了更好地研究微观与宏观之间的关系,系统科学的复杂适应系统理论提供了较好的分析框架,这种理论的基本思

想是:组成系统的子系统是具有自身目标和行为规则的个体,这些个体具有学习和适应能力,能够通过与环境及其他个体的相互作用改变自身的结构和行为。赋予个体一定的激励就定义了子系统之间及子系统与环境之间的相互作用机制,研究在给定机制下个体相互作用所表现出来的宏观性质,也即只要能够恰当地描述个体之间的相互作用机制,就可分析系统整体的演化行为。

四、宏观基础与后瓦尔拉斯宏观经济理论

以科兰德为代表的后瓦尔拉斯宏观经济理论,依据有限理性概念建立微观的宏观基础,其宏观基础意味着在进行有意义的微观分析之前,必须首先确定微观决策制定的宏观环境背景。由于真实经济行为拥有多种可选择的均衡路径,只有把宏观制度约束结合到代表性主体行为中才能决定均衡的结果并增加经济体系的稳定性,协调失灵和制度变化的政策成为该理论建立微观经济学的宏观基础。

后瓦尔拉斯宏观经济理论具有的显著特征是:多重均衡和复杂性、有限理性、制度和非价格协调机制及具有新的内涵的代表性主体假定。

1. 多重均衡与复杂性

后瓦尔拉斯宏观理论假设描述经济的方程系统的解具有多重均衡和复杂性,这意味着总体经济不可能采用瓦尔拉斯的比较静态均衡模型来分析。在瓦尔拉斯的框架里,假设存在不受动态调整过程影响的单一总体均衡,而后瓦尔拉斯宏观理论放弃了瓦尔拉斯单一均衡的竞争性框架,提出了与博弈论有相同特征的多重均衡概念来反对主流经济学的单一均衡假设,个体将不得不采取某些方式来应对和处理多重均衡的存在,要同时解决每个具体状态的复杂性将超出个体的计算能力。

2. 有限理性

在瓦尔拉斯模式里,个体能够理性地应对经济系统的复杂性,而且有能力充分迅速地获取信息。后瓦尔拉斯宏观理论认为宏观经济是如此复杂以至于在瓦尔拉斯一般均衡系统的环境背景中理性决策的制定是不可能的,该理论并没有放弃理性假定,只是抛弃了超越个人实际分析能力的完全理性,是有限理性而非完全理性,其所坚持的理性具有更多的局部特征。

3. 制度与非价格协调机制

后瓦尔拉斯宏观经济学认为,由于现有的微观理论基础并没有一个有关个人如何选择和构建市场的模型,如何在理论上将市场结构融入模型是宏观经济学的中心问题,协调问题和提供协调的制度成为经济分析的一个核心内容,这是后瓦尔拉斯宏观经济学的本质。一旦我们拥有了宏观基础,就可以建立宏观经济学的微观基础。

4. 赋予新的涵义的代表性主体假定

主流经济学个体选择理论的总量结果是依据缺乏环境背景的代表性主体决策而产生的,为此后瓦尔拉斯学派反对标准的总体宏观经济学和代表性主体设计,主张将宏观制度约束结合到代表性主体行为中。在后瓦尔拉斯宏观理论的分析框架里,存在许多相互作用的代表性主体,人们可根据布坎南的制宪方法来分析经济制度的理性选择,这些由演绎推演出的制度便成为微观经济理论的宏观基础。

科兰德拓展了新古典意义上的总量生产函数,提出了马歇尔式的总量生产函数,其形式为: $Y = F(L, K, C)$,其中L和

K分别代表劳动和资本要素的投入,C则是一个反映经济系统协调程度的新增变量。后瓦尔拉斯宏观理论致力于对协调变量C的分析,协调具有普遍的一般化形式,如果采用后瓦尔拉斯的生产函数,一种总量产出的下降会有很多与实际工资水平没有任何关系的解释。而瓦尔拉斯一般均衡分析没有能力考察个体行为的差异性、垄断行为、信息不完备、价格和工资粘性、预期的不确定性、时间的不可逆等经济行为,甚至不考虑新的偏好的产生、人口和厂商数目变动、新产品的出现等因素。后瓦尔拉斯宏观理论采用了比瓦尔拉斯分析方法更为复杂的数学工具,如混沌理论和非线性动态理论等,强调和有限理性一致的经济主体的适应性行为。它把瓦尔拉斯单一均衡模型看成是更一般的后瓦尔拉斯多重均衡模型的一个特例,在一个后瓦尔拉斯框架中,不再假设某些抽象化的市场会导致一个理想化的结果,市场本身是内生的,非均衡调整路径能够影响均衡结果,在个体决策和均衡结果之间不存在唯一的联系形式,所有决策被认为是与其他决策完全内在相关的。由于真实经济行为拥有多种可选择的均衡路径,只有把宏观制度约束结合到代表性主体行为中才能决定均衡的结果并增加经济体系的稳定性,也只有这样才能够把宏观环境背景置于个体决策的制定者之中,并且在引导微观经济基础到宏观时,这些制度约束得以真正被考虑。因此在试图建立任何宏观经济的微观基础之前,逻辑上必须先建立适宜的微观经济的宏观基础,独立于宏观基础的任何微观分析只能是不相关的一些博弈行为。

后瓦尔拉斯宏观理论认为宏观经济是如此复杂,以至于在瓦尔拉斯一般均衡系统的环境背景中理性决策的制定是不可能的,该理论并没有放弃理性假定,只是抛弃了超越个人实际分析能力的完全理性,是有限理性而非完全理性,其所坚持的理性具有更多的局部特征。后瓦尔拉斯宏观理论坚持发展一种能够说明经济萧条和充分就业状况、强调主体间的内在相关性及微观和宏观方法统一的系统理论,并主张寻找一个拥有在最低水平且具有一个唯一总量均衡序贯解方程的分层系统,其唯一性不是系统内在固有的,而是与制度相关并由制度来决定的。总体经济之所以能够相对稳定,是因为存在多层次的制度,这些制度规则限制着个体行为。后瓦尔拉斯宏观理论在很大程度上与后凯恩斯主义类似,认为马歇尔是宏观经济学更为合适的参照点,凯恩斯的《通论》是正确的,古典理论学只是其一种特殊情况。一个后瓦尔拉斯模式遵循一种自下而上的方法,个体的相互作用会引起个体决策单位拥有完全预测的能力,其政策设计始于这样的基本观点,即个体在制定决策时不可能把握整个经济所必要的信息,不可能完全了解经济的运行。施加于个体的制度约束能够对个体行为的变动建立充分稳定的环境,如果个体是完全理性的,则经济将是不稳定的。后瓦尔拉斯宏观经济理论主张微观和宏观问题必须同时解决,人们不可能假设存在独立于个体激励之外的竞争性市场,而是需要一种制度性理论,即在分析市场的作用之前,确定市场本身的形态。当无法知道市场本身究竟是什么之前,要来断定市场到底能解决什么问题是无意义的。

后瓦尔拉斯宏观经济学在涉及宏观基础、代表性主体范式和经济政策等方面与主流宏观理论存在着较大的分歧,它不赞成由标准凯恩斯总量模型所建立的宏观基础,这种宏观基础所体现的具有力学特征的乘数概念和IS-LM模型否认了制度结构的存在,犯了和不少理论在建立微观基础时同样

的错误。瓦尔拉斯学派在经济建模时,总是假定市场是存在的,且运行机制良好,然后就以此为基础建立模型,但对应的市场概念并没有坚实的基础。从后瓦尔拉斯宏观经济理论的观点来看,不是凯恩斯经济学而是古典经济学在一种单一均衡的假定下犯了“微调”的错误,在任何复杂的经济体系里,因果关系不仅仅是单向的,即使微观经济主体活动的某种结合能够生成宏观经济现象,但这些宏观经济现象反过来又会影响到微观经济主体,一个好的经济理论体系应当能够将宏观到微观和微观到宏观这两方面都进行正确的转换。

此外,后瓦尔拉斯宏观经济理论还反对主流宏观经济学中频繁使用的代表性主体假设,它认为,现实经济活动中的异质性主体与代表性主体假设是根本不相容的,如果所有主体都是相同的,我们就不需要代表性主体模型,对一个经济系统而言,若要正常运转,必须正视制度意义上的协调问题,如果不理解关于个体决策制定的协调机制,宏观经济学是无法被真正理解的。与代表性主体模型相关联的效用最大化问题并不是生成总量结果的充分条件,对传导机制不闻不问,仅仅在宏观经济变量间设定一种具体关系的作法是无视所要解释的宏观经济现象的复杂性。

团队协调的后瓦尔拉斯方法进一步强调了宏观经济环境和制度对经济行为的潜在重要性,它试图引导出一种制度理论,从而能够决定某种均衡形式的制度安排。它注重对内生不确定性的分析,这种内生不确定性在博弈论中被称为策略不确定性,如果它能发挥作用,将会消除由内生不确定性生成的不确定因素。已有实验和证据表明:在系统性的协调博弈中,众多个体行为的表现是不同的,他们没有相同的预期,也没有希望相互之间能够形成一个共同的预期。凯恩斯是最早对概率理论的哲学基础真正提出质疑的人,而团队协调理论恰恰捕捉到了凯恩斯的“动物精神”,并识别到奈特式不确定性的一个重要来源。由于新古典宏观的实际经济周期理论所识别的是,对经济系统产生随机冲击的外部因素,这种“动物精神”即内生不确定性与实际经济周期理论形成了一个鲜明的对比。协调或许是一种关于制度的重要函数,而在新古典经济学中,制度本质上是不起作用而且是无法解释的。自20世纪30年代以来,宏观经济学已经历了一个较长的发展时期,但却有意或无意地排除掉了经济中重要的分析因素,而团队协调理论却捕捉到许多被剔除掉的因素,为后瓦尔拉斯宏观理论的微观基础提供了一个重要的砖块。因此,我们不难看到,后瓦尔拉斯的团队协调分析方法与新古典经济学有着本质的不同,它所强调的内生不确定性能够在经济模型中留下具有实质意义的不确定性含义。

由于后瓦尔拉斯宏观理论的一个独到见解是总体经济是如此复杂,其理论含义只是提出广泛的政策规则,而不是确定机械的政策规则。该理论认为,应充分考虑到个体不可能完全掌握经济运行所必要的信息,如果经济的复杂结构已被相对稳定和有序地观察到,则其有序的状态来源于两种机制:系统的市场和非市场协调机制。瓦尔拉斯方法通过市场价格探寻经济的特殊协调机制,这种调节机制需要个体预期、决策和行为的完全协调,市场仅仅是一种相关的制度规则。后瓦尔拉斯理论则认为^①,现代经济决不可能仅通过价格机制这样理想化的协调方式来运行,而应对具体政策问题的运用在市场和非市场协调机制之间寻找一种平衡。在后瓦尔拉斯宏观理论的视野里,正是规则制度创造了系统的稳定性。

近些年来,新奥地利学派的重新崛起,旨在为经济学提供一个彻底的主观主义基础,其中经济现象是通过个别代表性经济主体的主观阐释的参照物进行解释,而这些代表性主体也受到特别的制度性的约束,这与后瓦尔拉斯建立宏观基础所基于的代表性主体模式具有相似的特点。

五、若干质疑与评价

对凯恩斯宏观理论微观基础的特别关注,一直是经济学的热门话题,这已是不争的事实。由于当今发展势头强劲的宏观经济理论都主张建立严格的微观基础,一个没有微观基础的宏观经济学无法让人理解,似乎也成为一个不容置疑的命题。然而,现有各种理论对为什么需要构筑微观基础的解释并不很有说服力。20世纪30年代,弗里希和丁伯根创立了经济计量学,为宏观经济理论的发展提供了重要的经验分析工具。但由于其宏观经济模型是通过经济历史数据的计量分析引出分析结果,所依据的凯恩斯理论本身缺少微观基础,并没有预先为经济计量模型提供一个合适的微观基础,更没有考虑如何使微观行为能够被加总到宏观。到目前为止,微观基础问题和加总问题一直没能得到很好解决,不是因为这些问题不重要或不令人感兴趣,而是它们无法轻易地被容纳进最优化的框架中,特别是最优化方法尤其难以处理信息的混杂性。卢卡斯和萨金特认为,他们所坚持的微观基础与他们之前的凯恩斯主义没有什么不同,新古典宏观经济学仅仅是比前者采用了更好的方式建构微观基础,却没能就宏观分析为什么必须建立在个体水平上给出有说服力的理由,即使从个体最优化原理出发解释总量波动是可能的,也无法证明建立微观基础是必要的。

现有宏观经济理论的发展主要是依靠代表性经济主体行为的微观经济分析所得的结果直接转换到宏观经济层次,微观水平的相互作用是以非常特殊的方式完成的,这种方法意味着假定经验宏观数据的观测与微观行为的相容,从经济计量学观点来看,即宏观参数只不过是微观参数在更大尺度上的复制,它不是去阐释个人行为与总量结果之间转换的复杂性,而是用微观基础方法创造了所谓宏观模型作为一般均衡系统的超常简化。在相当长的时间里,宏观经济学很大程度上是依靠经济行为人同质假定来建立相应的宏观理论,沟通从微观经济到宏观经济的方法是简单地设定系统总是处于均衡状态中。人们虽然对瓦尔拉斯无所不能的“拍卖人”假设进行了批评,但却忽视了主流宏观经济学中频繁使用的代表性主体假设的缺陷。托宾认为,建立牢固的微观基础是一种方法论上的错误,由于假定存在代表性主体,他们的最优化行为能产生宏观经济的行为方程,这在很大程度上牺牲了宏观经济行为特征的本质。假定有许多不同类型的行为者,他们都追求最大化,那么宏观模型所需的便是把他们归并进一个行为方程,但这种总和未必是单个行为主体的解。

当今主流宏观经济理论为了能够使用代表性主体模型,事先假设知道经济主体关于未来预期的形成过程,这种假设隐密地消除了宏观经济中的一个重要问题,即各经济主体间的总量问题。新凯恩斯主义者由于运用的是代表性个体假设,采用局部均衡分析来研究宏观的总体经济,这种代表性个体方法隐含接受了单一的总量均衡假定,同时没有明确考虑局部均衡分析的总量延伸问题。此外,使用代表性主体模型还会产生合成谬误问题:例如,卡普林在经验验证微观水平上具有价格粘性的个体企业延伸到总量水平后是否仍具

有价格粘性时发现,如果众多的企业从不同的真实价格出发,则尽管每个个体企业具有粘性价格,但总量价格却不具有粘性。如果使用一个代表性主体模型来检验价格粘性的总量效果,我们会发现菜单成本能够引起总量价格同样具有粘性且使货币产生实际效应,这便产生了合成谬误问题。由于从微观水平到宏观水平会涉及对微观经济主体相互间的作用如何理解,因此探求关于总量行为的微观意义的解释是一件非常复杂的事情。现实经济活动中的异质性主体在当代宏观经济学中已经扮演着十分重要的角色,它与代表性主体范式是根本不相容的,代表性主体假设仅仅是为了经济行为分析上的方便,很难真正为宏观经济分析提供严格的微观基础。

主流经济学的个体主义方法论采用的是从现实要素入手来构造理论体系,社会结构及演化的关键是金字塔式的推力作用,其中每个因素都依赖于下面因素所产生的动力。当整个结构要素都建立在组合的基础上时,经济分析便只能限定在某一个方向上进行,即用微观来解释宏观,用部分来解释整体,其根本缺陷在于忽略了对个人偏好或目的形成的制度力量。所以制度经济主张建立一种既包含个人能动作用又包括社会结构要素的整体性解释方法,强调个人部分地被其所处的群体所包围和引导,并受其所处的社会和环境及制度变动的影响,这意味着若不考虑由个体构成的整体,则个体现象也不可能得到说明。新制度经济学认为,个体主义的方法在分析市场秩序中单个主体的行为方式方面可能是一个有效工具,但却无法解释整体性的社会变迁,从这方面看,后瓦尔拉斯宏观理论更好地体现了整体主义方法论的思想。是坚持微观基础还是倡导宏观基础,从某种程度上看也反映了方法论的个体主义与整体主义之间的长期争论。

后瓦尔拉斯宏观理论倡导建立“微观的宏观基础”致力于建立一种更兼容的理论体系,为一种具有非自我调节的宏观经济理论的复兴提供了一个理论基础,目的在于实现微观与宏观的融合。但是从其他凯恩斯主义的微观基础理论来说,后瓦尔拉斯的观点并不十分新颖;同时,后瓦尔拉斯理论只注重协调问题,没有进一步考虑激励问题,而“如何设计制度给经济主体提供正当的激励已成为当代经济学的核心问题”^⑩,但后瓦尔拉斯宏观理论虽注重制度的协调问题,却没能涉及激励问题。此外,以瓦尔拉斯和后瓦尔拉斯取代古典主义和凯恩斯主义作为划定经济学的界限,也还存在着不同的看法,尚难达成广泛的共识。由此可见,关于微观基础或宏观基础的争论与构筑,仍将持续下去,如何实现宏微观体系真正意义上的融合,要么是在现有宏观与微观基础的整合上实现突破,要么是跳出现行的分析视角与框架,重新建立一套崭新的体系。无论选择哪种方式,都会有漫长而艰难的路要走,这也是当代整个经济学体系面临的挑战。

注释:

经济体系中微观家庭和厂商的行为与宏观总量行为之间存在着相互联系,探寻微观层面上个体行为与宏观层面上经济行为间的内在关系,即一般人们称之为的寻找宏观经济学的微观基础。

布赖恩·斯诺登:《现代宏观经济学指南》,中文版,23、135页,北京,商务印书馆,1998。

斯拉法在《用商品生产商品》一书中,对李嘉图和马克思的价值理论作了重大发展。他建立了一种标准合成商品生产体系,把标准商品作为一种不变的价值尺度,解决了确定利润率的难题。

所谓方法论的个体主义,是指最恰当或最有效的社会科学认

识来自对个体现象或过程的研究,个人总是努力获取昂贵但有用的信息并从事有目的的行动。个体主义的方法论原则是:一切经济现象都可以从个人的经济行为出发来理解整体的市场行为,经济学的解释规律研究的是个体的特征。

方法论的整体主义认为,社会整体大于其部分之和,整体显著地影响和制约部分的行为,个人行为应当从作为整体的宏观系统及个人在整体中的作用演绎而来。

参见刘金全、张屹山:《宏观经济分析的微观基础》,载《吉林大学社会科学学报》,2001(2)。

关于微观与宏观层次的转换问题,有一些不同的观点:科尔曼主张用微观层面的信息去研究宏观层面,强调从微观到宏观的转变及宏观到微观的转变;科林斯则认为,微观与宏观的划分是一个连续系统,而不是两分法,微观事件在时间、空间和数量上的延长、扩大及重复而形成宏观过程。他强调宏观过程的微观机制和基础,并用微观过程来解释宏观过程,但拉赫曼则反对对微观和宏观进行的划分,他认为这样做没有考虑到层次间的相互依赖,而应采用更强有力的概念化理论体系取而代之。

马歇尔:《经济学原理》,中文版,上卷,327页,北京,商务印书馆,1981。

A. Young, 1928. Increasing Returns and Economic Progress. *Economic Journal*, V11XXX, pp. 538.

⑩D. Colander, 1996. Beyond Microfoundations: Post Walrasian Macroeconomics. Cambridge: Cambridge University Press, pp. 207 ~ 208.

⑪让-雅克·拉丰:《激励理论》,中文版,第1卷,导言部分,北京,中国人民大学出版社,2002。

参考文献:

1. J. Agassi, 1960. Methodological Individualism, *British Journal of Sociology* 11.
2. K. Arrow, 1994. Methodological Individualism and Social knowledge, *American Economic Review*, Proceedings 84.
3. R. J. Caballero, 1992. A Fallacy of Composition, *American Economic Review*, vol. 82, 1992(12), No. 5.
4. E. R. Weintraub, 1979. *Microfoundations: The Compatibility of Microeconomics and Macroeconomics*, Cambridge: Cambridge University Press.
5. D. Colander, 1993. The Microfoundations of Micro, *Eastern Economic Journal*, Vol. 19.
6. D. Colander, 1996. *Beyond Microfoundations: Post Walrasian Macroeconomics*, Cambridge: Cambridge University Press.
7. M. Friedman, 1953. *The Methodology of Positive Economics in Milton Friedman Essays in Positive Economics*, Chicago: University of Chicago Press.
8. G. C. Harcourt, 1977. *The Microeconomic Foundations of Macroeconomics*, Boulder, Colorado: Westview Press.
9. A. P. Kirman, 1992. Whom or What Does the Representative Individual Represent? *Journal of Economic Perspectives*, Vol. 6, No. 2: pp. 117 ~ 36.
10. 马克·布劳格:《经济学方法论》,中文版,北京,北京大学出版社,1990。
11. L. A. Boland:《批判的经济学方法论》,中文版,北京,经济科学出版社,2000。
12. 刘金全:《宏观经济分析的微观基础》,载《吉林大学社会科学学报》,2001(2)。
13. 杨瑞龙:《宏观非均衡的微观基础》,北京,经济科学出版社,1994。
14. 汪浩瀚:《宏观经济分析的方法论基础》,北京,工商出版社,2002。
15. 汪浩瀚:《试析主流宏观经济理论中的总量问题》,载《数量经济技术经济研究》,2002(8)。
16. 汪浩瀚:《经济学方法论的个人主义与整体主义之争》,载《经济科学》,2002(2)。
17. 汪浩瀚:《探究宏观经济理论微观基础的新视角》,载《福建论坛》(经济社会版),2002(2)。

(作者单位:宁波大学商学院 宁波 315211)
(责任编辑: S)