

# 实证主义经济学研究 的价值及其方法论局限

靳卫东\*

**摘要:** 伴随着经济学方法论的日趋多元化,现代经济学研究仍然是普遍采用了具有实证主义倾向的假设-演绎模式,同时强调逻辑演绎和计量检验的理论验证和理论发现功能。如果将这种研究模式所必须提出的经济假设划分为三类,那么可以更加清晰地认识其价值,但也更充分地显示出它的方法论局限。首先,通过逻辑演绎,逐步放宽限制性假设,虽然可以将理论假设还原为潜在经济现象,但众多的还原对象很难实现与客观事实的完全对接,所以逻辑演绎的理论验证功能很难完全实现。其次,逻辑演绎可以发现错误,但却不能发现真理,其理论发现功能也只能在有限的范围内成立。最后,在三类假设划分的框架下,将数据导向和理论导向的建模思想相结合,所构建的计量模型并不能实现对理论假设的完全证实或者证伪,计量检验的功能同样面临着多方面的挑战。

**关键词:** 实证主义 经济学研究 假设 方法论

## 一、引言

自改革开放以来,与国民经济的快速增长相比,我国的经济学研究一直发展较慢。这主要表现在,我国经济学研究的原创性不足,还不能将具体经济实践上升为一般理论,仍然停留在对西方主流经济学的吸收与利用。并且,由于缺少对方法论的深入思考<sup>①</sup>,盲目批判和错误使用西方经济理论的现象也十分普遍<sup>②</sup>。因此,开展科学哲学研究,系统讨论经济学的方法论问题,是促进我国经济理论健康发展的一个重要因素。

一百多年来,从逻辑实证主义到证伪主义、工具主义、逻辑经验主义、操作主义等等,经济学方法论日趋多元化,已经没有哪种科学哲学可以在经济学研究中居于绝对统治地位<sup>③</sup>。但是,经验主义仍然构成了大多数经济学家的认识论基础(汉兹,2009),现代经济学研究还是普遍存在着实证主义倾向。实证主义是近代

\* 靳卫东,山东财经大学经济学院,邮政编码:250014,电子信箱:jinweidong@sdufe.edu.cn。

本文得到国家社科基金“农村义务教育财政投入的总量、结构和效果评价研究”(项目编号:10CJY069)、山东省自然科学基金“山东省义务教育均衡发展的财政投入机制研究”(项目编号:ZR2011GL010)、山东省高校人文社科项目“山东省义务教育均衡发展的评价指标体系研究与开发”(项目编号:J10WF14)、教育部人文社科项目“二元经济结构下人口迁移对消费需求的影响探讨”(项目编号:11YJA790196)和“劳动力迁徙决策及流动研究:基于高等教育空间集聚的视角”(项目编号:11YJA840019)资助。感谢北京大学教育经济研究所丁小浩、蒋凯老师的讨论和修改意见,同时特别感谢匿名审稿人的建设性意见,但文责自负。

①虽然对方法论的思考不一定就可以直接带来经济理论创新,但是反思经济学必然要反思方法论。这种反思显然可以提高经济学研究的科学化水平,加深对现代经济理论的理解(Hausman,2001; Colander, Holt and Rosser,2007; Duppe,2011)。

②汪丁丁(2011)将精通西方经济理论而不能将其灵活应用于中国实践的现象称为“食洋不化”,并将盲目排斥西方经济学研究范式的现象称为“闭门造车”。

③20世纪90年代以来,经济学不断向其他学科渗透,同时也受到其他学科研究方法和范畴的影响。这种相互影响和渗透,使经济学研究的领域得以扩展,催生了一系列的交叉学科,如:法律经济学、经济社会学、新制度经济学、实验经济学、行为经济学、演化经济学、经济哲学、信息经济学等等(张东辉,2004)。这种融合在增强经济学解释力的同时,也促进了经济学研究方法的多元化。因此,为经济学研究提供一个简单而清晰的方法论原则,变得越来越不可能,现代经济学研究已经不可能再受到某一种科学哲学的绝对支配(Hausman,2001; Lewis,2003)。

哲学向现代哲学过渡的一种思潮,它承认理性的作用,同时又特别强调经验在科学研究中的核心地位。所以,实证主义经济学研究一方面主张对实践的客观归纳以及对理论的事实检验,另一方面又提倡发挥逻辑演绎的理论验证和理论发现功能。虽然这两个方面的内容都不能单独为经济学研究提供科学的康庄大道,但将两者结合在一起的假设-演绎模式却遵循了19世纪以来的穆勒传统<sup>①</sup>,得到了大多数经济学家的认同。这种研究模式逐渐将经济学研究塑造为一个提出假设、逻辑演绎和计量检验的程序化过程。其中,不同方法论的区别就越来越突出地表现在对经济假设的认识差异,以及由此所产生的对逻辑演绎和计量检验的功能定位和使用原则上,这最终决定了它们对实证主义经济学研究价值的不同理解。所以,本文研究的主要贡献是,综合多种方法论的差异化观点,将经济学研究假设划分为真实程度不同的三种类型,以此来认识实证主义经济学研究的价值及其局限,从而消除人们对主流经济学的盲目批判和过度信心(Frey, 2001),提高我国经济学研究的科学化水平。

在我国,受西方主流经济学的普遍影响,经济学者之间并没有出现明显而系统的方法论差异。只是,一些人强调经济学研究的一般性,如田国强(2005);而另一些人则更加注重我国经济学研究的独立特征,如林毅夫(2001)、汪丁丁(2011)等。其实,从总体上看,科学哲学本身也在不断变化之中,经济学者并不必然需要具有某种特定的方法论原则(Duppe, 2011)。但是,针对实际经济学研究过程,对比分析不同方法论对具体问题的认识差异,有助于形成多个相对合理的单项认识,必然有利于提高经济学家的理论创新能力。

## 二、经济假设的提出

经济假设是对客观规律的猜测,是有待验证的理论。由于证实和证伪的不完全性,一切经济理论在某种程度上都是假设,所以提出相对合理的假设就成为经济学研究的核心内容。但是,对于怎样提出合理假设,不同方法论的认识并不统一。

### (一) 经济假设的来源

经验主义认为,经济学作为一门以事实、感觉和经验为依据的科学,其假设必须是来源于事实归纳<sup>②</sup>。只有经过长期而广泛的观察,才能发现经济现象之间的恒常关系,并提出真实的假设。这种假设可以是在概率意义上对恒常关系的猜测,能够避开“休谟问题”和不可知论的挑战<sup>③</sup>。

客观世界存在着必然规律,只是这种规律可能不为现代科学知识所完全描述。为了提高知识的真实性,经济假设理应借助于事实归纳。不过,任何归纳都是基于局部事实的主观归纳,并不能产生完全的真实。正因如此,以米塞斯为代表的奥地利学派提出,人类对自己的行为是自知的,以人的经济行为为研究对象的经济学,应该通过人类的自我考察和内省来提出先验为真的假设。米塞斯是典型的理性主义者,他认为,依靠这些先验为真的假设,通过正确的逻辑演绎,就可以得到综合为真的所有经济理论。这种观点显然与强调事实归纳的经验主义形成了一种紧张关系。

事实上,奥地利学派所提出的先验为真的假设也是来源于人类实践,是人类长期进行归纳和理论验证的结果,并没有太多新意。并且,这种过分强调理性的观点,有悖于经济学的经验主义传统,在现代经济学研究中也并不常见。大多数学者还是倾向于对各种哲学理念进行某种综合<sup>④</sup>。经验主义研究同样需要理性思考,

---

<sup>①</sup>19世纪中叶以来的穆勒传统认为,科学研究是从事实观察开始,通过归纳推理提出一般性假设,形成人们所称的理论,然后再把理论与事实进行比较,以验证其真实性。到20世纪初,奥地利学派和实用主义者改变了穆勒传统在经济学研究中的绝对统治地位,但其仍然不失为一种重要的经济学研究方式。其实,演绎法与归纳法可以也应该被统一起来,只是这种统一要随着经济学的发展进行适时调整,比如借鉴非主流经济学的研究方法,注意对社会结构进行整体分析等等(Lewis, 2003; 张建伟、胡乐明, 2005; Dow, 2008)。

<sup>②</sup>作为纯粹经验主义的代表,历史主义者就认为,基于归纳的对客观经济现象的科学陈述是知识的唯一来源。这种观点很容易使经济学研究陷入无休止的现象整理和数据收集。

<sup>③</sup>经济理论一定是来自于对客观实践的归纳,这是其成为规律的基础(Khan, 1993)。休谟是从经验主义怀疑论出发,对归纳方法提出了质疑。从本质上说,“休谟问题”是出现在一个相信确定性的时代,其错误就在于要求建立确定性的知识。如果放弃科学知识的无错论,认为基于事实归纳的经济理论也可以是不确定性的知识,这一问题就将不复存在。事实上,归纳方法对于人类来说具有实践的必然性,它可以使人类从经验的重复学习中建立起对世界的近似认知(张建伟、胡乐明, 2005),“休谟问题”只是体现了人类对这一方法的反思。

<sup>④</sup>除了米塞斯以外,奥地利学派的其他代表人物并没有严格坚持理性原则,而是不同程度地强调了对经验事实的归纳,如门格尔、哈耶克、梅耶等。同样,新历史主义的温和派,如斯穆勒,也特别强调了逻辑演绎的重要作用。

而理性主义研究也要植根于客观实践,经济假设的提出在两者之间并没有非此即彼的选择程序。

一些学者试图避开对经济假设来源的讨论,认为只要存在充分的批判,就能够获得真理性认识。在历史上,这种观点一直存在,从苏格拉底式的辩论到波普尔的证伪主义,都在强调批判对知识进步的作用<sup>①</sup>。但是,受到不充分决定性问题、数据的理论负荷以及计量技术发展等等的限制,充分的批判在现代经济学研究中是很难实现的。这种观点会导致大量经济假设的存在,各种相互矛盾的经济理论将充斥整个经济学。作为这种观点的现代变体,工具主义者完全抛弃了对经济假设来源的讨论。他们认为,经济理论的优劣是决定于其预测力,而与经济假设的来源无关,并且“越是真实的经济理论,其假设可能越不真实”<sup>②</sup>(博兰,2000)。

由此可见,经验主义、奥地利学派和工具主义是基于不同的认识论,形成了三种对经济假设的不同理解。这是它们之间相互区别的重要内容,也是对现代经济学研究实践的真实反映。在实证主义经济学研究中,经济假设确实可以分为真实程度不同的三种类型,本文分别将它们称为公理性假设、理论假设和限制性假设<sup>③</sup>。这种划分方法将有利于更加清晰地认识实证主义经济学研究的价值及其方法论局限。

## (二) 经济假设的分类与功能差别

经济理论应该能够准确描述经济现象,完全脱离事实归纳的假设很难通过经验验证而上升为规律性认识。所以,虽然不能做到完全客观的事实归纳,但是经过仔细观察和统计分析,提出的关于少数变量因果律的经济假设应该更为真实,以此进行经济解释和预测的效果也会更好。这种坚持经验主义的假设,就是未经检验的经济理论,也是经济学研究的核心内容和价值体现,本文将它们称为理论假设,比如:各种经济增长理论、经济周期理论和通货膨胀理论等等。

在经济学研究中,要基于事实归纳提出关于少数变量因果律的理论假设,还需要对客观经济现象进行适度的简化和抽象(Hands,2001),这就要求引入另一类假设,即限制性假设,比如:完全信息、独立市场和产品无差异等假设。首先,经济学的一些概念并没有很强的演绎关系,要得到精确的结论,就必须加入大量的约束条件(汉兹,2009)。其次,经济理论只能分析在真实世界中起作用的少数重要因素,而其他因素必须被人为地隔离(Maki,2003)。限制性假设就是要实现这种隔离,构建起一个思想试验室,来单独考察少数重要因素之间的因果关系。当然,从操作主义的意义来说,这些限制性假设都是具体的、在经验上可以阐述的概念。因此,经济理论还可以通过取消限制性假设而还原为经济现象(于忠江、陆锦周、邱国锋,2007),从而建立起理论假设与客观事实之间的联系桥梁(Solow,1997)。为了实现对客观经济现象的简化和抽象,限制性假设通常表现为是对事实的背离。这种假设越多,越不真实,那么以此为基础所提出的理论假设就会越简洁和一般,从而以此进行经济预测所需要的初始条件也就越少。所以,按照工具主义的观点,“越是真实的经济理论,其假设就越不真实”,只是表述了在限制性假设条件下经济学研究所具有的一般特征<sup>④</sup>。

既然理论假设的提出需要以限制性假设为条件,而不同学者所设定的限制性假设必然有所不同,那么对于同一经济现象就可能存在多种理论假设。按照库恩、拉卡托斯以及劳丹的观点,要辨别这些理论假设的真实性或者优劣,只能依靠学术共同体的理解和认同。这是因为,经济学具有社会性,它必须根据自己的原则建立理论评判标准。这种评判标准不一定要得出绝对正确或错误的结论,但必须符合学术共同体的基本观点(Lewis,2003),即在一定历史条件下形成的一些形而上学的公共知识,例如:理性人假设、均衡理论以及边际报酬递减规律等等。这些公共知识构成了经济学者之间交流的理论平台,已经获得了学术共同体的认可,

<sup>①</sup>证伪主义者认为,可以通过证伪的假设就是真理,证伪的范围和次数决定了假设的真实程度。这种“试错法”对假设的来源和真实性并没有特殊要求。

<sup>②</sup>一些学者认为,作为工具主义的代表,弗里德曼的方法论是混乱的,前后充满了不一致。在这句话中,弗里德曼似乎是在强调,经济假设的不真实并不足以构成对理论的批判(Maki,2003)。

<sup>③</sup>当然,这种划分并不是绝对和固定不变的,在一定情况下各种假设也可以相互转化,例如:理论假设经过长期的事实实验证就会逐渐转变为公理性假设。

<sup>④</sup>不真实的假设可以剥离非研究因素。这种假设越多,越严格,剥离出的非研究因素也就越多,经济理论就会具有更强的一般性(Maki,2003)。谢作诗和李平(2007)使用了经济理论的不同类型来解释这种现象。他们认为,作为参照系的“基准”经济理论,例如:MM定理、科斯定理和阿罗-德布鲁体系等等,只是描述了现实世界的极限状态,并不要求前提假设与现实世界相符合。而且,前提假设越不真实,这种理论就越简洁,越有价值。当然,也有学者反对这种过于简化的“隔离”分析,认为它会使经济学丢失太多真实,不再具有解释客观经济现象的能力(马涛、王宏磊,2011)。

具有很大的稳定性<sup>①</sup>。实证主义经济学研究通常将它们作为不证自明的公理,理论假设一般不应与其相矛盾<sup>②</sup>,而这些公理所形成的假设就是公理性假设(谢作诗、李平,2007)。博兰(2000)据此把现代经济学看作是完全的“修辞学”,显然是否定了公共知识和公理性假设的存在,将理论假设的验证过程误认为是公理性假设的证明。这很容易将经济学研究重新推入纯粹经验主义的泥潭。

综上所述,在实证主义经济学研究中,公理性假设是来源于学术共同体的形而上学的公共知识,它构成了经济学研究的理论硬核和范式基础;理论假设是基于公理性假设对客观事实做出的归纳,是对经济现象本质特征的大胆猜测;限制性假设是为了隔离非研究因素而对客观经济现象进行的适度简化和抽象。现代经济学者对这三类假设的灵活运用,体现了多元化的科学哲学思想,在同一领域得出了优劣各异的多种经济理论。

### 三、逻辑演绎的意义

长期以来,无论是将经济学看作归纳科学的经验主义者,还是将其看作演绎科学的理性主义者,都认为逻辑演绎不能产生任何在前提假设以外的真实(博兰,2000)。但是,大部分学者也承认,现实主义者所倡导的事实归纳和案例分析并不可靠,逻辑演绎绝对不是毫无意义的同意反复,而是认识经济规律的一条重要途径(曹均伟,2010)。逻辑演绎可以使经济理论更加符合一致性、逻辑自洽性、简洁性和有效性的科学原则,具有验证理论假设、发现潜在规律以及清晰解释经济现象的功能。只是,在三类假设划分的框架下,这些功能都具有明显的局限性。

#### (一) 验证理论假设

理论假设是对客观事实的一种抽象,是关于少数变量因果趋势律的大胆猜测。利用经济模型,逐步放宽限制性假设,去除所有的理想化陈述,理论假设可以还原为潜在的经济现象。因此,要验证一个理论假设,只需要观察由它还原的潜在经济现象是否与客观事实相符即可(于忠江、陆锦周、邱国锋,2007)。如果理论假设的还原对象符合客观事实,就说明它是真实的,或者至少可以说明它没有被证伪,能够被暂时接受<sup>③</sup>。所以,逻辑演绎具有重要的理论验证功能。

但是,在经济学研究实践中,由于缺少可控的实验条件,逻辑演绎的这种理论验证功能是很有限的。首先,通过逻辑演绎,理论假设是从理想化故事开始,逐步放宽限制性假设而实现与事实的对接。可是,每一个限制性假设的取消,理论假设都可以产生众多的相符事实。而且,越是接近于客观事实,理论假设的还原对象就越多。那么,当一个现象可以用一个内在逻辑一致的理论来解释时,它也可以通过改变要素组合而被其他很多内在逻辑严谨的理论所解释(林毅夫,2001)。这也就是说,同一理论假设可以演绎出众多经济现象,而相同经济现象也可以归纳出很多经济理论。所以,逻辑演绎至多只能是用来推断理论假设是否可能为真,或者说只是保证了其在形式上为真,但不能完全判断它的真实性。显然,限制性假设越多,越严格,逻辑演绎的理论验证功能也就会越弱。其次,在三类假设划分的框架下,逻辑演绎的理论验证功能存在着不充分决定性问题。在逻辑演绎中,三类假设是作为一个整体来实现与事实的对接,当还原对象与事实不符时,公理性

---

<sup>①</sup>当然,这种稳定性是相对的,公共知识会随着经济学的发展而不断调整。例如,理性人假设是来源于维克斯蒂的享乐主义思想,它通过罗宾斯,对经济学研究产生了重要影响(Drakopoulos,2011)。近年来,随着非主流经济学的发展,主流经济学正在通过放松一系列的严格假设,来把握更多现实经济的复杂性,逐步将有限理性、不确定性、不完全信息等引入理性人假设。不过,这种调整只是力图改变主流经济学研究与现实的脱离,是为了挑战数理形式主义方法论的过度自信,并没有产生方法论的巨大发展(张东辉,2004; Colander, Holt and Rosser, 2007; Dow, 2008)。

<sup>②</sup>一般认为,经济学研究的主要贡献是,基于公共知识,提出一个新颖的理论,来解释反常的客观现象。当然,在我国,基于事实归纳的理论假设可能并不完全符合西方经济学范式下的公共知识。这并不反常,反而应该成为我国经济学研究的主要创新方式。西方经济学的公共知识,是在西方稳定的社会经济环境中长期积累而形成的,完全承借这些知识来研究尚处于变革中的中国经济,显然会有很多缺陷。这也就是说,要想对我国社会经济有一些切实的创新性理解,就必须重新思考那些来自于西方的公理性假设(林毅夫,2001;汪丁丁,2011;韦森,2005)。这也进一步说明,公理性假设与理论假设的划分是相对的,而不是绝对不变的。

<sup>③</sup>一种观点认为,理论的本质是形式体系,无论其假设是否与事实相符,也不管其逻辑结论是否与经验相一致,只要这些假设满足独立性、相容性和完备性的特征,并且逻辑结论的推导是严谨可信的,那么人类在有限的实践中就不可能实现对这一理论的完全证伪(谢作诗、李平,2007)。所以,从理论上讲,如果逻辑演绎实现了理论假设与客观事实的相符,那么这只是对理论假设的一次不完全的证实,而如果不相符,也只能说明进行了一次不完全的证伪。

假设和限制性假设都可能存在问题,因此并不能据此就否定理论假设的真实性。最后,很多理论假设都是以方法论个人主义为基础的,而现实生活中并不存在抽象的个体,所以这些理论假设可能根本就演绎不出符合事实的经济现象,也就无法借助逻辑演绎得到验证。

## (二) 发现潜在规律

事实归纳是科学知识的重要来源,但是很多理论假设的内涵和外延,以及主要概念之间的相互作用机理,并不能依靠直接观察来认识,还需要逻辑演绎去逐步发现。奥地利学派甚至据此认为,通过对公理性假设的逻辑演绎就可以得到所有经济理论,这些理论是先验真实的综合,不需要任何事实验证。

经济学研究的目的,是揭示主要概念之间的因果趋势律,并尽可能详细地说明客观事实的产生根源。在这一过程中,逻辑演绎可以从已有的假设出发,查找现有概念中的矛盾,并总结出一些有用规律,具有重要的理论发现功能。不过,如前文所述,在三类假设划分的框架下,逻辑自洽并不能完全证明理论假设的真实性,逻辑演绎只能发现逻辑错误,但不能发现真理,其理论发现功能也只能在有限的范围内成立。

## (三) 解释经济现象

主流方法论认为,经济学具有社会性,在某种程度上是一种“修辞学”。所以,好的经济理论首先应该具有清晰、简洁的特征。如果经济理论与现实一样复杂而难以理解,其意义将不复存在<sup>①</sup>。

在实证主义经济学研究中,限制性假设可以隔离其他非研究因素,使理论假设成为描述少数变量关系的思想实验室。这个思想实验室一般是采用逻辑演绎的方法,通过描述一个理想化的事实,使理论假设更加符合思维经济原则。限制性假设越严格,思想实验室就越简单,理论假设也就越清晰和简洁。在这一过程中,数理模型借助于具有严密逻辑结构的数学推导,能够更加精确地刻画经济概念,从而可以更为方便地通过还原性分析来演绎说明客观事实。正是由于数理模型具有这种逻辑自洽性,可以与限制性假设所虚构的经济事实保持严格一致,并用简洁的语言让人们理解复杂的现象,所以它几乎已经成为实证主义经济学研究的标准化内容<sup>②</sup>。一些学者甚至由此逐渐产生了对形式化数学知识的过度依赖,并将数理知识的多少作为评判经济学研究价值的标准(Debreu,1991)。这导致很多经济学研究严重脱离客观事实,完全蜕变为一种虚构的数学游戏。其实,经济学与数学的关系并没有那么紧密(Hands,1984),理论假设的逻辑演绎并不必然要采用数理分析的方式,只有以解释经济现象为目标的简洁思想表达才有意义<sup>③</sup>。为了片面追求精确的数学推导和有限的实证意义,在很多因果关系不能量化时,仍然竭力用数学语言表达思想,强行将理论假设转换为函数表达形式,这只会进一步增加限制性假设,削弱逻辑演绎对客观事实的解释能力。

因此,为了有效发挥逻辑演绎的功能,如何妥善处理理论假设与限制性假设之间的矛盾,把限制性假设控制在合理范围之内,以同时提高经济理论的简洁性、可验证性和解释力,一直是实证主义经济学研究的重要课题。正是逻辑演绎所面临的这种困难,迫使经济学家不断努力寻找其他理论验证和理论发现方法,从而推动了计量检验的迅速发展。

## 四、计量检验的作用

实证主义认为,真实的理论假设必须能够还原为客观事实。逻辑演绎虽然不能完全验证理论假设的真实性,但却保证了其“内在一致性”,并且为理论假设与经验事实的进一步结合提供了可能。计量检验正是借助于经验数据和计量技术,对理论假设进行概率分析,从而在有限范围内发挥了理论验证和理论发现功

<sup>①</sup>在证伪主义的影响下,很多经济学家出现了行为分裂,其研究工作与方法论观点通常存在着很大差异(Lewis,2003)。事实上,经济学研究很少符合证伪主义的要求,而是接近于一个修辞工作,目的是为了得到学术共同体的认可和理解。由此,萨缪尔森提出了描述主义,认为经济理论就是出于方便或其他实用目的而对经验事实的重新描述(汉兹,2009)。

<sup>②</sup>经济学具有社会性,其表述可以采取多种方式。一些经济行为确实可以用数学知识来刻画,这可以使理论变得简洁和易懂。所以,数量经济学的发展曾经对经济学研究产生了广泛影响。但是,应该强调的是,用数学的形式化逻辑来表述经济原理,并不是唯一和必须的方式(Debreu,1991;Khan,1993)。数学只是经济学分析基础的一个部分,其他的经济学分析基础还有哲学、社会科学,甚至是艺术和文学。如果经济学只保持一种高级数学的形式,那么它将失去基本的人性和实践性,其真实性和解释力将会遭遇严重危机。

<sup>③</sup>在古典经济学中,对经济现象的描述通常是采用文字和图表的形式。这在讨论少数抽象概念的逻辑关系时具有很大优势,能够避免对概念的精确界定,从而可以直接得到推断性结论。相反,一些研究刻意使用数理分析方法,使同一问题演绎出了太多复杂模型,这并不比文字和图形表述更具说服力。

能。目前,数据资料的日益丰富以及计量技术的迅速发展,也为这种科学研究方法提供了广阔的发展空间。

一般认为,标准的计量检验应该包括三部分内容:首先,根据理论分析结果和数据样本特征构建计量模型,实现理论验证和理论发现功能的初步融合;其次,在计量技术的能力范围内正确解读检验结果,对理论假设进行证实或者证伪;最后,对检验结果进行回溯推理,以发挥计量检验的理论发现功能。

### (一) 计量模型的构建

构建合理的计量模型决定了理论验证和理论发现功能的发挥,是计量检验最为重要的环节(李子奈、齐良书,2010),它涉及样本数据的分析、计量技术的使用、理论假设的函数表示以及由限制性假设转换而来的控制变量的选择等等。首先,对理论假设的数理分析可以延伸出计量模型的结构和内容,使其成为理论假设的一种函数表达形式。这要求,计量模型所涉及的变量在理论假设中都有明确界定,变量之间的结构关系符合理论要求,主要变量的系数大小以及符号也有相应的理论预期。其次,样本数据的统计学特征也可以为计量模型的构建提供有用信息,从而使模型构建类似于一种前期事实归纳,以发挥计量检验的理论发现功能。这是因为,限制性假设的多样性以及经济现象的复杂性,使同一理论假设可以演绎出众多关于事实的陈述,仅仅以理论为导向构建计量模型,可能很难找到相符的事实。相反,以部分样本数据为依据,实施类似于事前归纳的数据导向型建模,却可以提高计量检验验证理论假设的效率。

20世纪70年代以来,卢卡斯对传统数理模型的批判<sup>①</sup>,促进了数据导向型建模技术的发展,例如:因子分析、结构方程、分位数回归、向量自回归、非参数回归分析等等。甚至有人提出,计量模型的构建,不是理论经济学的任务,而是计量经济学的责任。这种观点极力推崇计量检验的理论发现功能,直接将计量检验变成了证伪主义的“试错法”。近年来,数据资料的积累,以及计量技术的发展,更是促进了这种研究方式的推广(Reeder,2003)。它产生了一种不良风气,使计量模型可以脱离经济理论和常识,而唯一地追求关键变量的统计显著性。其实,基于存在理论负荷的局部样本数据来构建计量模型,同样面临着时变性的考验,其预测能力可能更不可靠。计量检验的目的不是为了确定毫无经济意义的变量关系,脱离了经济理论分析而过度强调计量检验的理论发现功能,只不过是一种纯粹的数字游戏。

因此,一种更为合理的做法是,首先,通过逻辑演绎,逐步放宽限制性假设,将理论假设还原为接近事实的陈述,以提供计量模型的构建基础。然后,结合数据样本特征,设置计量模型的内容与结构,建立计量检验的直接对象。这样,将数据导向和理论导向的建模思想结合在一起,同时发挥计量检验的理论验证和理论发现功能,可以使计量模型尽可能地模拟现实经济世界的数据生成过程,提高理论假设对接客观事实的概率。

### (二) 检验结果的解读

计量检验是在概率意义上确定计量模型参数是否与理论分析有所不同,以及计量模型的结构和内容是否解释了理论假设所描述的因果趋势律。计量检验结果并不能完全证实理论假设的真实性,更不能作为肯定或否定理论假设的最终依据。首先,即使解决了不充分决定性和理论负荷问题,基于局部样本数据的单称命题也不能实现对理论假设这种全称命题的验证。其次,理论假设是对复杂经济现象的抽象,只能反映少数变量的因果趋势律,很多未知或不可观测的其他因素并没有被纳入到计量模型之中,那么检验结果也就不能完全隔离它们的影响。最后,怎样将复杂的原始数据转变为“平稳”和“同质”数据,并消除经济关系的时变性,也是计量经济学尚未解决的难题。因此,在现有的技术条件下,经济学还不能依靠计量检验的理论验证功能而达到“科学”要求的程度(洪永森,2007)。

证伪主义认为,任何理论都是或然性的,只要可以被证伪,就应该纳入科学知识的范围,并且可证伪性越强,其科学价值就越高。但是,如前文所述,在复杂的经济学研究实践中,虽然可以采用近似证伪的形式,每次计量检验在整体上却只是论证了理论假设在一定条件下的“可验证性”,其全部意义仅仅是表明理论假设的局部为真,并不能实现真正的证伪。

因此,计量检验既不是完全意义的证实,也不是真正的证伪,而是基于现有计量技术在概率意义上对理论假设的实证主义意义做出的不完全评判。所有计量检验结果都不是变量关系的精确表达,而只是一种模

<sup>①</sup>“卢卡斯批判”是反对主流经济学借助于数理模型的逻辑演绎将经济现象描述为一个机械过程。他认为,这种理论经不起经济时变性的考验,预测能力极低(Lucas,1976)。“卢卡斯批判”推动了实用主义的发展,经济学者开始逐渐脱离了对于逻辑演绎方法的依赖,转而重视数据资料的收集和分析。其实,利用经济理论的预测能力,来评判经济学的科学意义,也是错误的,是缺乏客观依据的(Hands,1984)。

糊的概率推断。如果有人将计量检验结果的概率意义解读为“科学”意义,并将其作为真理应用于实践,那显然是对现代计量技术的重大误解。

### (三) 回溯推理的使用

近年来,“卢卡斯批判”以及工具主义和实用主义的流行,使很多学者逐渐放弃了对理论假设的逻辑演绎,而极力推崇计量检验的理论发现功能。李子奈和齐良书(2010)就认为,对计量检验结果进行回溯推理,并以此为依据来修改计量模型,能够有效发挥计量检验的理论发现功能,从而可以推动经济理论的发展。

回溯推理是从客观事实反向追溯理论假设的过程,可以发掘不能直接观察的机制,代表了解释性灵感和创造性洞见,是重要的科学研究方法。但是,在计量检验中,如果回溯推理和理论验证使用了相同的样本数据,那么理论验证过程就变成了一种单纯的事实相符性努力,不再具有任何证实或者证伪效果。所以,为了同时发挥计量检验的两项功能,首先要求将两个过程放在不同的样本空间中,使回溯推理变成理论验证过程的事前归纳<sup>①</sup>。

另外,与理论验证功能一样,计量检验的理论发现功能也面临着不完全决定性问题。在三类假设划分的框架下,以计量检验结果为依据,回溯推理首先应该调整的是限制性假设,然后才能考虑修改理论假设。并且,这种调整和修改不能单纯为了提高计量模型的显著水平,而仍然要以公理性假设为前提,以解释经济现象为目标,符合一致性、逻辑自洽性、简洁性和有效性的科学原则。

## 五、研究结论

经济学和科学哲学的发展使经济学方法论日趋多元化。但是,在经济学研究实践中,大多数学者还是普遍采用了具有实证主义倾向的逻辑-演绎模式。这种模式使经济学研究逐渐蜕变为标准的程序化过程。在三类假设划分的框架下,分析这种研究模式的价值及其方法论局限,对于我国经济理论发展将具有重要的意义。

第一,经济理论在一定程度上都是无法得到完全证实或者证伪的假设。那么,怎样提出合理假设就成为经济学研究的核心任务,也是不同方法论之间相互区别的重要内容。经验主义、奥地利学派和工具主义在不同认识论基础上对经济假设的差异化理解,是对实证主义经济学研究实践中三类不同假设的真实反映。灵活运用这些假设,体现了不同学者的哲学思想,在同一领域可以得到优劣各异的多种理论。

第二,逻辑演绎不是毫无意义的同义反复,而是一种重要的科学研究方法,具有验证理论假设、发现潜在规律以及解释经济现象的功能。但是,通过放宽限制性假设,理论假设可以还原为众多潜在经济现象,所以逻辑演绎的理论验证功能是有限的。并且,在三类假设划分的框架下,逻辑演绎可以发现逻辑错误,但却不能发现真理,其理论发现功能只能在有限范围内成立。另外,为了追求经济理论的清晰、简洁和逻辑自洽性,对形式化数学知识的过度依赖,也容易削弱逻辑演绎对客观经济现象的解释能力。

第三,逻辑演绎面临的困难促进了计量检验的迅速发展,但是计量检验的理论验证和理论发现功能同样具有很大的局限性。首先,理论导向和数据导向建模思想的结合,有利于同时发挥计量检验的两项功能,促进理论假设与客观事实的对接。不过,即使解决了数据的理论负荷和时变性问题,现有的计量技术也不能完全刻画经济系统的运行,这种分析仍然不能为理论假设的真实性提供任何确凿的证据。另外,虽然对计量检验结果的回溯推理,能够依靠调整样本空间而转变为理论验证过程的事前归纳,但三类假设划分所显示出的不充分决定性问题,同样可以阻碍其理论发现功能的发挥。

总之,随着经济学方法论的日趋多元化,为了充分发挥实证主义经济学研究的有效作用,在肯定其价值的同时,更应该清楚地认识它的方法论局限。这一方面可以促使经济学者更加关注方法论问题,提高实际经济学研究过程的科学化水平,另一方面也可以为经济理论发展提供必要的科学哲学基础。

### 参考文献:

1. 曹均伟 2010 《论经济学方法论的哲学基础》,《上海财经大学学报》第6期。

<sup>①</sup>在非主流经济学中,回溯推理的使用在很大程度上是为了打破主流经济学的逻辑演绎分析方式,以强调经济理论必须符合经济活动的事实(马国旺,2011)。可是,与逻辑演绎分析一样,回溯推理也只能发现错误,而不能发现真理。所以,计量检验的理论发现功能还是要以理论导向型建模思想为基础。

2. 洪永淼 2007 《计量经济学的地位、作用和局限》，《经济研究》第 5 期。
3. 劳伦斯·A·博兰 2000 《批判的经济学方法论》，中译本 经济科学出版社。
4. 李子奈、齐良书 2010 《关于计量经济学模型方法的哲学思考》，《中国社会科学》第 2 期。
5. 林毅夫 2001 《经济学研究方法与中国经济学发展》，《经济研究》第 4 期。
6. 马国旺 2011 《马克思经济学方法论创新探析——批判实在论视域中的异端经济学启示》，《经济学家》第 4 期。
7. 马涛、王宏磊 2011 《历史学派与奥地利学派经济学方法论的“范式”之争》，《财经研究》第 7 期。
8. 田国强 2005 《现代经济学的基本分析框架与研究方法》，《经济研究》第 2 期。
9. 汪丁丁 2011 《转型期中国社会的社会科学研究框架》，《财经问题研究》第 7 期。
10. 韦德·汉兹 2009 《开放的经济方法论》，中译本 武汉大学出版社。
11. 韦森 2005 《奥地利学派的方法论及其在当代经济科学中的意义及问题》，《学术月刊》第 4 期。
12. 谢作诗、李平 2007 《弗里德曼的〈实证经济学方法论〉：缘起、内容及再解读》，《世界经济》第 12 期。
13. 于志江、陆锦周、邱国锋 2007 《现代经济研究的实践方法论》，《上海经济研究》第 3 期。
14. 张东辉 2004 《经济学研究方法的变革与现代经济学发展》，《东岳论丛》第 1 期。
15. 张建伟、胡乐明 2005 《经济学的“证实”理性主义传统》，《社会科学》第 9 期。
16. Colander ,David Richard P. F. Holt ,and J. Barkley Jr. Rosser. 2007. “Live and Dead Issues in the Methodology of Economics.” *Journal of Post Keynesian Economics* 30( 2) : 303 – 312.
17. Debreu ,Gerard. 1991. “The Mathematization of Economic Theory.” *The American Economic Review* 81( 1) : 1 – 7.
18. Dow ,Sheila C. 2008. “Plurality in Orthodox and Heterodox Economics.” *The Journal of Philosophical Economics* 1( 2) : 73 – 96.
19. Drakopoulos ,S. A. 2011. “Wicksteed ,Robbins and the Emergence of Mainstream Economic Methodology.” *Review of Political Economy* 23( 3) : 461 – 470.
20. Duppe ,Till. 2011. “How Economic Methodology Became a Separate Science?” *Journal of Economic Methodology* 18( 2) : 163 – 176.
21. Frey ,Bruno S. 2001. “Why Economists Disregard Economic Methodology?” *Journal of Economic Methodology* 8( 1) : 41 – 47.
22. Hands ,D. Wade. 2001. “Economic Methodology is Dead – long Live Economic Methodology: Thirteen Theses on the New Economic Methodology.” *Journal of Economic Methodology* 8( 1) : 49 – 63.
23. Hands ,Douglas W. 1984. “What Economics is Not: An Economist’s Response to Rosenberg.” *Philosophy of Science* 51( 3) : 495 – 503.
24. Hausman ,Daniel M. 2001. “A New Era for Economic Methodology.” *Journal of Economic Methodology* 8( 1) : 65 – 68.
25. Khan ,M. Ali. 1993. “The Irony in/of Economic Theory.” *MLN* 108( 4) : 759 – 803.
26. Lewis ,P. A. 2003. “Recent Developments in Economic Methodology: The Rhetorical and Ontological Turns.” *Foundations of Science* 8( 1) : 51 – 68.
27. Lucas ,R. 1976. “Econometric Policy Evaluation: A Critique.” *Carnegie – Rochester Conference Series on Public Policy* 1( 1) : 19 – 46.
28. Mäki ,Uskali. 2003. “‘The Methodology of Positive Economics’ ( 1953) Does not Give Us the Methodology of Positive Economics.” *Journal of Economic Methodology* 10( 4) : 495 – 505.
29. Reder ,Melvin W. 2003. “Remarks on ‘The Methodology of Positive Economics’ .” *Journal of Economic Methodology* 10( 4) : 527 – 530.
30. Solow ,Robert M. 1997. “Is There a Core of Usable Macroeconomics We Should All Believe in?” *The American Economic Review* , 87( 2) : 230 – 232.

## The Value of Positivism in Economics Research and Its Methodological Limit

Jin Weidong

( School of Economics ,Shandong University of Finance and Economics)

**Abstract:** With diversified methodology developing ,modern economics research generally makes use of hypothesis – deduction model that has obviously positivism inclination. The model employs logical deduction and meteorology inspection to validate and discover theory. Nevertheless there are three types hypothesis in economics research that have different functions ,they also make it clear that positivism research has methodology limitation. Firstly ,through logic deduction ,restrictive – hypothesis can be relaxed step by step and theoretical – hypothesis can be restored back to so many potential economic phenomena that it hardly conforms to any fact finally. Secondly ,it can find error and not truth by logic deduction ,and so it has little theory – discover function. Thirdly ,empirical test isn’t completely verification or falsification ,and its theory – discover function can also be reduced by the hypothesis.

**Key Words:** Positivism; Economics Research; Assumption; Methodology

**JEL Classification:** B41 ,C10

( 责任编辑: 彭爽)