

财经评论 14024：2014 年 11 月 2 日

张斌

zbiwep@126.com

宏观经济学的前世今生

——浦山世界经济学优秀论文奖（2014）获奖感言

王洛林老师是我非常尊敬的一位长者，他来给我颁这个奖，这个奖的分量就更重了。刚才听了王老师对浦山奖设立的背景介绍，很让我感动。感谢我的老师，两位都在座。一位是余永定老师，一位是杨先明老师。如果不是这两位老师，我可能不会坚持做学术方面的研究。感谢世经政所的同事，在世经政所工作了十多年，这里一直都是一个愉快的工作环境。都说文人相轻，但在世经政所同事之间，更多的是相互欣赏和称赞，很难得，感谢我的同事。还要感谢在座的世经研究的同行，没有在座各位的鼓励和支持，我也拿不到这个奖。邵老师要我用十分钟说一下获奖感受。我想利用这个机会和大家分享一下这篇文章背后的一些想法，宏观经济学的前世今生。

大家公认，现代宏观经济学之父是凯恩斯先生。父亲的身份确定了，母亲呢？宏观经济学之母的身份没有权威认定。从现代宏观经济学的接生婆和宏观经济学的长相来看，母亲的身份也能确定个八九不离十。我猜是瓦尔拉斯。

宏观经济学的接生婆是希克斯。我想这一点大家不会有太大异议，现代宏观经济学最基础的 IS-LM 模型大部分出自这位老人家之手，后来的很多修补也遵循了 IS-LM 的建模理念。据这位接生婆讲，他受到的最大启发源自瓦尔拉斯，而不是他伟大的同事马歇尔。

为什么是瓦尔拉斯呢？微观经济学和宏观经济学的区别，不仅在于前者研究对象是微观个体而后者研究对象是宏观变量，还在于前者主要是静态问题而后者

生来就是动态问题。瓦尔拉斯用不太复杂的数学回答了一个伟大的问题：静态地看，很多商品价格是被如何同时决定的。希克斯，还有其他一些经济学家，正是受到了这样的启发，用非常巧妙的方式把静态问题转化为动态问题，把静态的商品选择转化为跨时期的商品选择，其中还包含了货币在跨期选择中的关键作用。这是 IS-LM 模型的雏形。经过后人的进一步发展，储蓄投资平衡、货币市场平衡被简明地画在同一张图上，回答了短期内总需求被如何决定。这就是伟大的 IS-LM 模型。

尽管 IS-LM 表面上看起来和瓦尔拉斯讲的不是一回事，但是从背后的建模理念上，IS-LM 与瓦尔拉斯一脉相承。一般均衡理论家对 IS-LM 模型的精巧构思赞不绝口。所以，我猜宏观经济学之母是瓦尔拉斯。我对现代宏观经济学之父是凯恩斯先生的说法有些怀疑，凯恩斯如果在世，他对现代宏观经济学的样子也许不满意。凯恩斯在通论中提出的问题更深刻。凯恩斯关心的是为什么会发生非常严重的经济危机，现代宏观经济学至今还没有很好地完成这个使命。

确定了父母的身份，再说宏观经济学过去和现在的样子。宏观经济学自打出生那天起，就很孤独。社会上无时无刻不在讨论宏观经济问题。经济增长、物价、资产价格从来都是热点问题，出租车司机、政府总理和经济学家都能对宏观经济问题长篇大论。讨论虽然热闹，但是按照宏观经济学范式思考和研究宏观经济问题的人很少。宏观经济问题讨论和宏观经济学研究相隔很远，远到很多情景下二者几乎没什么关系。打个比方，宏观经济学研究的是空气动力学如何让飞机飞起来，而宏观经济问题讨论的内容经常是飞鸟羽毛的长短和颜色。

为什么会出现宏观经济学和宏观经济问题讨论的巨大隔阂？第一，宏观经济学是一门很抽象的科学，有普遍性的宏观经济学研究范式，但没有普遍性的宏观经济模型。对待任何一个国家的宏观经济问题研究，既要遵循研究范式，又要根据特定的经济环境把问题恰当地抽象出来，并且能够用数学方法求解，形成特定环境、特定需求的定制宏观经济模型，这是个很困难的过程。第二，沟通上的难题。即便你做出了恰当的模型，而且能够求解，你怎么对人把变量之间的关系说清楚呢？用纯粹的文字语言，把最简单的二元一次方程说清楚都很困难，更不用说像微分方程组这样复杂的关系式了。宏观经济学研究只能容纳很少的听众，而

想听的人太多，都在房子外面窃窃私语。

宏观经济学长大以后，就更孤独了。现在的宏观经济学，主流模型是带有价格粘性的动态随机一般均衡模型。这个名字听起来就费劲。现在的主流宏观经济模型的逻辑完整和一致性有了很大的进步，抽象程度上比早先的 IS-LM 模型大大下降，但是从形式上更复杂了，用到的数学知识也更复杂了。现在的宏观经济主流模型对于包括经济系学生在内的大多数人来说，都是天书。把这套模型活学活用不同情景下的宏观经济分析，门槛太高。

用科学的态度研究宏观经济问题，最终还要回到宏观经济学。泛泛而谈的宏观经济问题多数是走向邪路，和算命占卜差不多。宏观经济研究现在面临的挑战，一是太孤独，脱离群众；二是有很多根本性的问题还没法很好地回答。后面这个挑战现在还看不到太大曙光，也许要等到其他学科有突飞猛进的发展，再加上一个天才横空出世来改写整个宏观经济学。对于绝大多数的宏观经济学者来说，重要的是解决前面的挑战。

对于宏观经济学的研究，有三个建议。第一，遵循范式，但不生搬硬套，需求定制。第二，能简则简，不能简，才由简入繁。宏观经济学是一门工具，好用才是关键，简单模型和复杂模型各有自身的优点和缺陷，不能以好坏区分。第三，对于宏观经济学研究范式需要严肃的批评，但是不要泛泛而谈地反对。泛泛而谈地反对一个范式而没有切实的批评和建设性意见，其实是反科学的研究态度。

声明：本报告非成熟稿件，仅供内部讨论。报告版权为中国社会科学院世界经济与政治研究所世界经济预测与政策模拟实验室所有，未经许可，不得以任何形式翻版、复制、上网和刊登。