



· 学术史 ·

从历史主义到计量方法:美国经济史学的 形成与转变(1870—1960)

关永强

内容提要 美国经济史学自19世纪末产生之初起,就带有鲜明的历史主义色彩和对理论经济学的批判风格。然而,进入20世纪后,传统经济史在稳步发展的同时,也遭遇到来自计量经济学者的挑战。尤其是20世纪50年代以后,青年经济史学者普遍接受了计量方法,传统经济史学者则被边缘化。计量经济史研究逐渐成为美国经济史学的主流,但也因其抛弃历史主义传统而备受争议,其对历史的过度抽象和对新古典经济学的过分依赖都在一定程度上限制了经济史学的发展。

关键词 经济史 历史学派 制度学派 计量史学

20世纪50年代以来,计量方法在美国乃至世界经济史研究中占据着越来越重要的地位,但同时也遭到了很多激烈的批评。持反对意见的学者大都认为,计量方法的大量应用导致经济史学偏离了原本的历史主义传统,失去了对新古典经济学的批判意义,只是在“回敬给经济学家们同样的一碗粥”^①,成为了“经济学家的经济史”^②,因而建议历史学家们绝不要“去崇拜计量方法这个女财神的圣像”^③,而应该回归“优秀的老经济史学”^④。甚至连计量史学的早期代表人物诺斯也对此进行了反思,并指出大部分计量经济史研究只是把新古典经济学简单应用到历史研究中,“这种做法的

本文得到教育部人文社会科学研究基金项目(项目批准号:10YJC790067)和中国特色社会主义经济协同创新中心的支持,笔者感谢彭慕兰教授推荐的文献资料。

- ① 罗伯特·索洛:《经济史与经济学》(Robert M. Solow, “Economic History and Economics”),《美国经济评论》(*The American Economic Review*)1985年第2期,第328—331页。
- ② 陈振汉:《西方经济史学与中国经济史研究》,《中国经济史研究》1996年第1期。
- ③ 卡尔·布莱登鲍尔:《突变》(Carl Bridenbaugh, “The Great Mutation”),《美国历史评论》(*The American Historical Review*)1963年第2期,第326页。
- ④ 罗纳德·哈特维尔:《优秀的老经济史学》(R. M. Hartwell, “Good Old Economic History”),《经济史杂志》(*The Journal of Economic History*)1973年第1期,第28—40页。



收益很快就会出现递减”^①,因而需要重新运用传统的制度学派研究方法,开拓新制度经济史学的方向。^②

对这一时期的美国新经济史学,我国学界已经进行了广泛而深入的研究;^③但有关此前美国经济史学的早期发展情况及其历史主义传统,学者们则很少涉及。本文拟对 1870 年至 1960 年间美国经济史学的形成、发展和向计量史学转变的过程进行初步考察,并归纳其转变的原因,希望为我们理解经济史学的意义、方法和推动我国经济史学的发展提供一些参考和借鉴。

一、美国经济史学的形成与早期的历史主义风格

尽管 19 世纪前期美国就已经出现了一些金融史和商业史方面的论著,但这些大都是零散的个体研究,尚未形成专门的课程、讲席或专业的学术规范。^④直至 1878 年,亨利·亚当斯撰写关于 1789—1816 年美国税收史方面的论文,并凭此获得了约翰·霍普金斯大学的博士学位。此后,他留校任教并开设了最早的经济史课程。1881 年,理查德·埃利也来到约翰·霍普金斯大学,从事美国制度与经济史方面的研究,并设立了“商业发展的原理与历史”课程。与约翰·霍普金斯大学差不多同时的还有哈佛大学。1871 年,查尔斯·邓巴在哈佛大学获得了美国第一个政治经济学教授职称。1884 年,邓巴开设了“1763 年以来欧洲与美国经济史”课程。1886 年,哥伦比亚大学的埃德温·塞利格曼开始讲授美国金融与工业史和欧洲经济发展史,耶鲁大学的爱德华·伯恩和阿瑟·哈德利分别开设了中世纪以来欧洲贸易与工业史和美国金融与政治史课程。19 世纪 90 年代以后,美国主要的研究型大学基本都设置了经济史课程。截至 1910 年,在美国主要大学的经济学和商学总授课时间 113,000 课时中,专门的经济史课程已经占到了 8,000 课时。^⑤

美国早期经济史课程的一个特点是大都由政治经济学或经济学教师兼职讲授。亨利·亚当斯

① 道格拉斯·诺斯:《关于麦克洛斯基、科恩和福斯特论文的评论》(Douglass C. North, “Comment on McCloskey, Cohen, and Forster Papers”),《经济史杂志》1978 年第 1 期,第 78 页。

② 关于诺斯及此后新制度经济史学对历史主义传统的回归和继承,可以参见韩毅的《历史的制度分析:西方制度经济史学的新进展》,辽宁大学出版社 2002 年版,第 30—51 页;韩毅的《经验归纳方法、历史主义传统与制度经济史研究》,《中国经济史研究》2007 年第 2 期。

③ 主要的研究成果:章铮:《美国经济史研究的新动向》,《史学理论研究》1992 年第 2 期;刘宏谊:《西方经济史学发展和美国新经济史学——从福格尔、诺思获诺贝尔经济学奖谈起》,《世界经济文汇》1994 年第 1 期;赵凌云:《探寻经济理论与经济史的结合——“新经济史革命”评析》,《东南学术》2001 年第 1 期;韩毅:《比较经济体制研究的新方法:历史的比较制度分析》,《经济社会体制比较》2002 年第 1 期;韩毅:《西方制度经济史学的历史演进:评价与思考》,《中国经济史研究》2002 年第 3 期;郑备军:《论新经济史革命的启示》,《浙江社会科学》2002 年第 4 期;赵冈:《经济学对历史研究的影响》,《社会科学战线》2003 年第 3 期;韩毅:《西方制度经济史学研究:理论方法与问题》,中国人民大学出版社 2007 年版;孙圣民:《历史计量学五十年——经济学和史学范式的冲突、融合与发展》,《中国社会科学》2009 年第 4 期;隋福民:《创新与融合:1957—2004 年美国新经济史革命及对中国的影 响》,天津古籍出版社 2009 年版;孙圣民、刘晓鸥:《历史计量学发展中面临的问题及对策》,《中南财经政法大学学报》2012 年第 5 期等。

④ 对 19 世纪 70 年代以前美国经济史著作的介绍,可以参见阿瑟·寇尔的《美国的经济史学:学科形成时期》(Arthur H. Cole, “Economic History in the United States: Formative Years of a Discipline”),《经济史杂志》1968 年第 4 期,第 556—589 页;N. S. B. 格拉斯的《美国的经济史学》(N. S. B. Gras, “Economic History in the United States”),埃德温·塞利格曼主编:《社会科学百科全书》(Edwin Seligman, ed., *Encyclopedia of the Social Sciences*)第 5 卷,麦克米兰公司 1937 年版,第 325—327 页。

⑤ J. de L. 曼主编:《大学中的经济史教学》(J. de L. Mann, ed., “The Teaching of Economic History in Universities”),《经济史评论》(*The Economic History Review*)1932 年第 3 期,第 332 页。

和查尔斯·邓巴等都是政治经济学或经济学教员。类似的还有:1872年耶鲁大学将弗朗西斯·沃尔克评为“政治经济学与历史教授”,1875年卡尔顿学院将J. B. 克拉克评为“经济学与历史”讲师等。直到1892年,威廉·阿什利在哈佛大学被评为美国第一个专门的经济史教授。

之所以如此,是因为美国早期的经济学者大多在德国留学,受德国历史学派的影响,把历史方法看作经济学研究的基本方法。^①德国历史学派学者代表人物罗雪尔、克尼斯和施穆勒与英国历史学派的克利夫·莱斯利、约翰·英格拉姆一起,^②反对英国经济学日益演绎化的倾向。他们坚持历史主义的指导思想,认为所有经济问题都应当被置于特定的历史阶段和具体的政治、社会和文化等制度背景中进行考察,而不应该像自然科学那样去追求超越国家和历史界限的普适性真理。这种历史主义的思想在美国第一代经济学者的身上都有所体现,尤其是理查德·埃利和威廉·阿什利,他们分别开创了美国的制度学派经济学和经济史学。

理查德·埃利师从德国历史学派的卡尔·克尼斯,获得海德堡大学博士学位。他曾任1900、1901年度美国经济学会会长,著有《近代法国和德国的社会主义》、《工业社会演进研究》、《美国工人运动》和《艰难的时代:问题与出路》等,对劳工问题有较深入的研究,尤为重视政府在经济中的作用。1892年,埃利在威斯康星大学创办了该校的经济、政治和历史学院,并长期担任院长,把历史主义的思想方法贯彻到教学当中,系统地开设了经济与社会史方面的课程,培养了以约翰·康芒斯为代表的一批制度经济学学者。理查德·埃利曾总结制度学派的核心思想方法,指出经济学只是社会科学的一部分,它不能与其他社会现象、社会关系和道德因素、价值判断相分离,经济学的研究也应当从社会事实出发,注重运用历史归纳的方法。^③因此,制度学派的成员虽然都是经济学者,但大多以历史主义为指导思想,把历史归纳法视作研究现实经济的基本方法。这方面的代表性著述为康芒斯主编的《美国工业社会史文献汇编》、《美国劳工史》和韦斯利·米切尔在经济周期方面的几部专著。在制度学派看来,要了解美国当代的劳工问题,必须从工业和劳工的发展历程入手;而要解决现实面临的经济波动问题,也必须先梳理经济周期发展史。

与制度学派学者相比,经济史学家威廉·阿什利的研究更偏重历史领域。他毕业于牛津大学,曾师从英国历史学派的经济学者阿诺德·汤因比,主要著作有《英国经济史及学说》、《黄金与物价》、《关税问题》和《英格兰经济组织简史》等。阿什利也很强调经济史研究的现实意义,主张投身社会改良,“在历史地考察社会进化方向之后,推动社会沿其自然轨道和方向发展”^④。阿什利在担

① 在1870—1900年美国28所大学的76名经济学者中,有53人曾留学德国;在美国经济学会的前10任主席中,有8位都曾留学德国。参见约翰·帕里希的《经济学科的兴起》(John B. Parrish, “Rise of Economics as an Academic Discipline”),《南方经济杂志》(Southern Economic Journal)1967年第1期,第1—16页。

② 关于德国历史学派和英国历史学派较详细的介绍,可以参见盐谷佑一的《德国历史学派:经济研究的历史和伦理方法》(Yuichi Shionoya, *The German Historical School: The Historical and Ethical Approach to Economics*),罗德里奇出版社2001年版;《德国历史学派的灵魂:施穆勒、韦伯和熊彼特的方法论》(*The Soul of the German Historical School: Methodological Essays on Schmoller, Weber and Schumpeter*),施普林格出版社2005年版;杰弗里·霍奇逊著,高伟等译的《经济学是如何忘记历史的》,中国人民大学出版社2008年版;杰拉德·库特著,乔吉燕译的《1870—1926年英国历史经济学》,中国人民大学出版社2010年版。

③ 参见理查德·埃利为英格拉姆的专著《政治经济学史》(John Kells Ingram, *A History of Political Economy*, A. & C. 布莱克出版社1915年版)撰写的序言。

④ 阿什利还与德国历史学派有着密切的联系,并把他们的研究成果介绍到英国,他自认“从施穆勒著作中得到的激励和促进比任何其他人多”,参见杰拉德·库特的《英国历史经济学》,第117、120、123页。

任英国经济史学会第一任主席的就职演讲中,特别强调经济史学对经济学应有的批判精神和修正意义,批评“理论经济学家们认为,只要给我们一小块属于我们自己的田地,就可以让我们保持沉默了;而我们这些谦卑的历史学家们也应当为这一小块没有争议的领地而感激庆幸,以至于听任那些经济学家们自行其是”;但是,“如果我们彼此都能多了解一些对方田地里的作物和种植方式,我想,一定会对双方的成长都有好处的”。^①

在担任哈佛大学经济史教授期间,阿什利开设了很多课程,既包括经济学基础,也包括从庄园制到工厂制的发展史和从柏拉图到历史学派的经济思想史,还有经济调查方法、政治学理论等,^②成功地把历史主义的思想方法注入经济史课程体系当中。在此基础上,德国历史学派施穆勒的弟子埃德温·盖伊进一步推动哈佛大学经济史学的发展,不仅培养了诺曼·格拉斯、阿瑟·寇尔、阿伯特·厄什、切斯特·怀特、安妮·贝赞森、约翰·奈夫和伊尔·汉密尔顿等一批著名经济史学者,还开创了哈佛大学商学院和这里的企业史研究。^③1905年以后,哥伦比亚大学、耶鲁大学和明尼苏达大学等相继设立了经济史讲席。

到20世纪初,在制度学派经济学家和经济史学者的共同努力下,美国的经济史学作为一门学科已经基本成形,并建立了自己的历史主义风格,形成了与新古典经济学分庭抗礼的局面。^④

二、历史主义传统下美国经济史学的发展

20世纪上半期,这种历史主义导向的经济史学在美国取得了长足地发展。经济史教职、课程和论著都不断增加。1904—1928年在经济学博士生最多的10所大学里,经济史成为了最受欢迎的研究领域,经济学科培养的全体2,809名博士生中,有372名都选择了经济史专业。^⑤这一时期,经济史学发展最重要的事件当属1920年美国国民经济研究局的创办和1940年美国经济史协会的成立。

1920年,米切尔、康芒斯和埃德温·盖伊共同创建了美国国民经济研究局(NBER),并把历史主义的思想贯彻到了该机构的工作当中,推出了很多非常有影响力的研究成果,包括由米切尔及其弟子阿瑟·伯恩斯共同完成的一系列关于经济周期的研究、盖伊领导的世界各国物价史研究、米切尔和另一个弟子西蒙·库兹涅茨对国民收入波动和长期经济增长的研究,以及安娜·施瓦茨和米尔

① 威廉·阿什利:《经济史在大学研究中的位置》(William Ashley, "The Place of Economic History in University Studies"),《经济史评论》1927年第1期,第1—11页。

② J. de L. 曼编:《大学中的经济史教学》,第331页。

③ 关于埃德温·盖伊和哈佛大学企业史研究情况,可参见阿瑟·寇尔《美国的经济史学:学科形成时期》。

④ 在理查德·埃利以后,康芒斯、米切尔等十多位制度学派学者和埃德温·盖伊都担任过美国经济学会主席,并坚持历史和制度的研究方法,与新古典经济学派就经济学的性质、范围、自由市场政策、价值判断和制度因素的意义等问题展开了一系列的争论。参见尤维尔·约纳的《经济学的灵魂之争》(Yuval P. Yonay, *The Struggle over the Soul of Economics*),普林斯顿大学出版社1998年版。

⑤ 位居第二的专业,也是由制度学派学者领导的劳工问题研究(357名),这10所大学依次是哥伦比亚、芝加哥、威斯康星、哈佛、宾夕法尼亚、明尼苏达、康奈尔、耶鲁、约翰·霍普金斯和伊利诺伊,合计约占全美国经济学博士生总人数的75%。参见刘易斯·弗洛曼的《1904至1940年经济学科的研究》(Lewis A. Froman, "Graduate Students in Economics, 1904-1940"),《美国经济评论》1942年第4期,第820—821页。

顿·弗里德曼共同完成的美国货币史研究等。^①

米切尔或美国国民经济研究局研究的特点是大量使用历史数据进行统计分析,但同时拒绝使用新古典经济学制定研究框架或进行理论解释。研究者们总是从历史和现实资料而不是已有的理论模型出发选取研究对象和构建统计指标,进而通过对经验事实的归纳得出结论。他们都坚持把统计数据放在具体的历史背景下阐释,而不进行纯数据之间的相关性分析。

对制度学派的这种研究方法,米切尔曾进行过系统的阐释。他认为,经济学理论固然有着重要的价值,但单纯依靠逻辑推理得出的经济学概念和理论往往容易脱离现实,因此学者必须立足于历史统计的方法,以现实调查所得的资料作为研究的基础;学者可以根据研究对象和任务的变化不断调整和修正研究视角和方法,但关键是要从对历史资料的归纳中推导出结论,而不是把已有经济理论的含义赋予到统计数据中去。^②

在此期间,以埃德温·盖伊为中心的美国经济史学者们也取得了丰硕成果。除了在主要研究型大学中不断拓展经济史课程外,他们还撰写了大量优秀的经济史著作,主要包括:埃德温·盖伊的《英国圈地运动》,诺曼·格拉斯的《经济史导论》、《12—18世纪英国谷物市场的演变》、《美国企业史案例集》,阿瑟·寇尔的《美国毛纺织业》、《美国地毯业的历史与分析》,梅尔文·柯普兰的《美国棉纺织业》,凯瑟琳·科曼的《美国工业史》、《远西部的经济起源》,阿伯特·厄什的《法国粮食贸易史:1400—1710》、《英国工业史导论》、《1750年以来的欧洲经济史》、《地中海欧洲储蓄银行早期史》,切斯特·怀特的《1890年以来的羊毛业与关税:美国经济史的一项研究》,约翰·奈夫的《英国煤矿业的兴起》、《美国与文明》,以及伊尔·汉密尔顿的《美洲财富与西班牙的价格革命》、《瓦伦西亚的货币、价格与工资》、《西班牙的战争与物价:1651—1800》等。

值得一提的是,1929年盖伊主持的物价史研究获得了洛克菲勒基金会的大力资助,研究团队扩大到包括英国、法国、德国、奥地利、荷兰和美国在内的多国学者,并在此后陆续出版了一系列著作。在物价史合作研究的基础上,1940年美国经济史学者们组建了经济史研究委员会和美国经济史协会,次年又创办了期刊《经济史杂志》。和当年的阿什利一样,1941年埃德温·盖伊在担任经济史协会首任主席的演讲中,再次强调了经济史学的历史主义传统,并提出经济史研究应当被置于一个宽

① 美国国民经济研究局学者这一时期在经济史方面的主要论著包括:韦斯利·米切尔:《经济周期:问题与研究框架》(Wesley C. Mitchell, *Business Cycles: the Problem and Its Setting*),国民经济研究局1927年版;阿瑟·伯恩斯:《1870年以来美国的生产趋势》(Arthur F. Burns, *Production Trends in the United States since 1870*),国民经济研究局1934年版;米切尔与伯恩斯:《美国经济周期中的生产》(Mitchell and Burns, *Production during the American Business Cycle*),国民经济研究局1936年版;米切尔:《经济周期及其原因》(Mitchell, *Business Cycles and Their Causes*),加州大学出版社1941年版;伯恩斯与米切尔:《测量经济周期》(Burns and Mitchell, *Measuring Business Cycles*),国民经济研究局1946年版;米切尔:《经济周期中发生些什么:一份进展报告》(Mitchell, *What Happens during Business Cycles, a Progress Report*),国民经济研究局1951年版;米切尔主编:《1909—1919年美国的收入总量与分配》(Mitchell, ed., *Income in the United States, Its Amount and Distribution, 1909—1919*),国民经济研究局1921、1922年版;西蒙·库兹涅茨:《1929—1932年的国民收入》(Simon Kuznets, *National Income, 1929—1932*),国民经济研究局1934年版;库兹涅茨:《1919—1935年的国民收入与资本形成》(Kuznets, *National Income and Capital Formation, 1919—1935*),国民经济研究局1937年版;库兹涅茨:《1919—1938年的国民收入及其构成》(Kuznets, *National Income and its Composition, 1919—1938*),国民经济研究局1941年版;米尔顿·弗里德曼与安娜·施瓦茨:《1867—1960年美国货币史》(Milton Friedman and Anna Jacobson Schwartz, *A Monetary History of the United States, 1867—1960*),普林斯顿大学出版社1963年版等。

② 韦斯利·米切尔:《理论经济学的定量分析》(Wesley C. Mitchell, "Quantitative Analysis in Economic Theory"),《美国经济评论》1925年第1期,第1—12页。

广的背景下,与其他各种社会科学尤其是经济学合作,以历史方法为基础,推进实证研究在整个社会科学中的发展。^①

在洛克菲勒基金会社会科学部主任约瑟夫·威利茨的大力支持下,1940年经济史研究委员会又获得了总计30万美元的持续资助,开展对美国发展及其经验的大规模实证研究。主要包括四个领域:产业与企业案例研究、经济年鉴的编纂、地区经济史研究和美国经济生活中的政府。1948年,阿瑟·寇尔和安妮·贝赞森在哈佛大学创办了企业家史研究中心。

然而,这种发展局面并没有持续多久。20世纪40年代末,美国制度学派和经济史学的历史主义研究传统遭遇了来自计量经济学者的挑战。

三、历史主义与计量方法的论争

1947年,来自考尔斯委员会^②的计量经济学家佳林·库普曼斯对米切尔和美国国民经济研究局的研究方法提出了激烈批评。他把科学研究进程分为开普勒式的实证阶段和牛顿式的理论阶段,认为经济研究应当把这两个阶段结合起来,以新古典经济理论为基础,通过计量回归的方法,形成一条更为快捷的研究道路。他批评米切尔的研究只是一种开普勒式的“没有理论的度量”,缺乏经济学理论的指导,严重限制了实证研究及其对经济学的价值。^③

然而事实上,米切尔的研究并不缺乏理论基础,只不过他没有采用新古典经济学的理论,而是通过历史叙述或统计数据的编排来阐释他自己的理论。^④他认为,新古典经济学宣称的普适性理论并不符合事实,他要研究的经济问题都是在特定历史条件下形成的,把这些经济问题放进新的统计数据 and 具体历史背景中进行考察,不仅可能带来经济学理论形式的改变,甚至连理论的构成要件都会发生变化;但学者如果只是按照既有的经济理论来设定统计指标,再据此进行计量研究,往往只会循着已有的逻辑去给这些指标和概念赋值,而无法发现那些被既有理论遗漏而在现实中可能很重要的关联。^⑤米切尔还指出计量方法存在的很多问题:首先,计量回归存在不确定的概率误差,不同的抽样会产生不同的回归结果;其次,回归只能得到单一的相关系数,因而会抹杀统计量在长期趋势中的不规则波动,无法反映出趋势和波动中蕴含的重要信息;最后,在变量可能存在的周期性时滞问题上,回归和相关性研究也缺乏有效的解决办法。^⑥

1948年,米切尔逝世。1949年,国民经济研究局的学者拉特里奇·韦宁对库普曼斯的批评

① 埃德温·盖伊:《经济史学的任务》(Edwin Gay, "The Tasks of Economic History"),《经济史杂志》1941年第1卷,第9—16页。

② 考尔斯委员会(Cowles Commission)1932年由美国商人阿尔弗莱德·考尔斯创办,1955年更名为考尔斯基金会(Cowles Foundation)。其最初的目的是推进数学方法对市场波动问题的研究,成立后不久,考尔斯委员会就向美国计量经济学会和《计量经济学》(*Econometrica*)期刊提供了重要的资助,并与拉格纳·弗里希和欧文·费雪等计量经济学家建立了良好的合作关系;二战期间,考尔斯委员会成为了美国计量和数理经济学研究的基地和最主要的赞助机构,包括库普曼斯在内的很多成员在此后都曾获得诺贝尔经济学奖。

③ 佳林·库普曼斯:《没有理论的度量》(Tjalling C. Koopmans, "Measurement Without Theory"),《经济与统计评论》(*The Review of Economics and Statistics*)1947年第3期,第161—172页。

④ 米尔顿·弗里德曼:《作为理论经济学家的韦斯利·米切尔》(Milton Friedman, "Wesley C. Mitchell as an Economic Theorist"),《政治经济学杂志》(*Journal of Political Economy*)1950年第6期,第465—493页。

⑤ 韦斯利·米切尔:《理论经济学的定量分析》,第4页。

⑥ 韦斯利·米切尔:《经济周期:问题与研究框架》,第262—264页。

再次进行了系统性的回应,并由此形成了所谓“美国国民经济研究局方法”和“考尔斯方法”之争。^①

在这场论争中,库普曼斯认为,个体主义框架为新古典经济学提供了普适性的、稳定的分析基础,以新古典理论作为研究的出发点,有助于系统性地选择统计变量、推导经济政策和全面理解统计指标的含义;而通过回归和联立方程组等计量方法,可以更加有效地解释和解决经济周期等宏观经济问题。韦宁则主张,抽象个体在现实中并不存在,所有个体都受总体和制度的影响,而宏观总量指标的运行特征也无法简单地从个体中推导出来,以个体主义和效用论为基础的新古典经济理论并不适用于研究宏观经济问题。韦宁重申了米切尔的观点,认为以现有经济学理论为基础的计量推导,总是把我们的研究限制在那些已经被理论设定好的待解释变量当中,而对我们发现和拓展新的理论假设几乎没有什么帮助。他还进一步指出,计量回归的方法并不能揭示出宏观经济体的结构及其运行方式,它实际上是一种建立在抽样基础上的有偏估计,它所计算出的置信区间只是由样本统计量所构造的总体参数的估计范围,并不是我们基于回归模型预测未来的可信取值范围,也不是我们从计量模型出发制定经济政策所能达到效果的可能区间。

与这场学术争论非常相似并在思想方法上紧密相关的,还有此前英国经济学家凯恩斯对库普曼斯的老师——计量经济学家丁伯根的批评。

在对丁伯根著作的评论中,凯恩斯指出,经济理论本身不是普适性的真理,而是人们思考和研究经济问题的工具,如果把经济理论变成像自然科学一样的定量化方程,“那就等于是毁了它作为思想工具的价值”。^②他认为,多元回归分析所需要满足的前提条件至少应该包括:所有影响因素都被全部纳入计量模型、所有考察变量都可以定量化、各变量间彼此不相关、能解决时滞问题等,而这些条件在现实中全都不具备。最为重要的是,在进行历史计量研究时,我们必须保证同一变量的经济含义在整个历史进程中始终一致,这就要求变量所处的制度环境能够一直保持不变。然而,这在经济史研究中根本无法得到满足,^③而且“即或我们发现过去的情况的确如此,也不能确知未来一定还会这样继续下去”,因此在凯恩斯看来,丁伯根所从事计量研究的实际上只是一种“炼金术”。^④

20世纪四五十年代,被凯恩斯贬为“炼金术”的计量经济学却在美国得到了蓬勃发展。在“美国国民经济研究局方法”和“考尔斯方法”之争后的短短几年里,库普曼斯所倡导的“考尔斯方法”就成为美国经济学界的惟一研究方法,美国经济史学也随之发生了计量史学革命。

四、美国经济史学向计量经济史学的转变

二战期间,考尔斯委员会得到了来自芝加哥大学、洛克菲勒基金和古根汉姆基金等的大量资助,

① 拉特里奇·韦宁:《论库普曼斯关于变量选择和度量方法的观点》(Rutledge Vining, "Koopmans on the Choice of Variables to be Studied and the Methods of Measurement"),佳林·C. 库普曼斯:《回复》(Tjalling C. Koopmans, "A Reply"),拉特里奇·韦宁:《再反驳》(Rutledge Vining, "A rejoinder"),分别载《经济与统计评论》1949年第2期,第77—86、86—91、91—94页。

② 约翰·梅纳德·凯恩斯:《约翰·梅纳德·凯恩斯文集》(John Maynard Keynes, *The Collected Writings of John Maynard Keynes*)第14卷,麦克米兰出版社1973年版,第296、299—300页。

③ 换言之,即使我们可以用现在的统计方法核算出一千年前中国某个朝代的国内生产总值,但它所蕴含的市场化水平、产业结构、商品种类、技术水平和社会制度都与今天迥异,两者之间也就失去了比较的意义。

④ 凯恩斯:《丁伯根教授的方法》(Keynes, "Professor Tinbergen's Method"),《经济学杂志》(*The Economic Journal*)第195期1939年,第558—568页;凯恩斯:《再评论》(Keynes, "Comment"),《经济学杂志》第197期,1940年,第154—156页。

同时吸收了一大批因二战逃离欧洲的计量和数理经济学家,由此成为计量和数理经济学的世界中心。更为重要的是,考尔斯委员会还积极与美国政府和军方合作,把计量回归、线性规划和博弈论等数学方法大量应用到财政预算、战时资源配置、经济预测、物资运输、军事部署和战争规划等领域,^①使得这些研究方法迅速得以推广,进而产生了巨大的示范效应,吸引了一大批美国青年经济学者投身到经济学的数学化研究当中。^②

1954年,考尔斯委员会的学者肯尼斯·阿罗和杰拉德·德布鲁以不提供具体实例的非构造性证明的方式,给出了一般均衡存在性的严格数学证明,进一步为新古典经济学体系的数学化奠定了基础。20世纪50年代,数学化的浪潮席卷了整个美国经济学界,形成了所谓的经济学“形式主义革命”^③,对研究形式的追求压到了思想方法上的争论。^④新古典经济学迅速成为美国经济学的绝对主流,而制度学派和传统经济史学则遭遇了边缘化。

20世纪50年代末期,“尽管的确还有一些人自称为制度经济学者,但他们基本都是被边缘化的个人而已;在今天的经济学界,所谓制度主义运动或者制度学派已经不复存在了”^⑤。一些青年制度学者逐渐转入社会学领域,留在经济学界的制度学派学者则因受到新古典经济学的排斥而另外组建演化经济协会,成为被边缘化的非主流经济学派。主流经济学家们的批评导致了洛克菲勒基金会部分人士的不满,1950年经济史研究委员会的进一步研究计划被基金会否决,埃德温·盖伊等经济史学家们也逐渐失去了基金会的支持,只有阿瑟·寇尔主持的哈佛大学企业家史研究中心继续得到新的五年资助,“原本前景美好的美国经济史研究结果只剩下了哈佛大学的企业史”^⑥。1956年,连对哈佛大学企业家史研究中心的资助也终止了。

对经济史学更为直接的冲击,发生在1957年美国经济史协会关于收入与财富的研讨会上。约翰·迈耶和阿尔弗莱德·康拉德在大会提交的两篇论文指出,通过定量研究,可以用新古典经济学理论对历史上的因果关系进行科学的阐释,并以奴隶制问题为例提出了与传统观点不同的看法。^⑦一些学者

① 克劳福德·古德温:《转变时期经济学的资助者》(Craufurd Goodwin, “The Patrons of Economics in a Time of Transformation”),《政治经济学史》(*History of Political Economy*)第30卷,1998年,第53—81页;迈克尔·伯恩斯坦:《危险的进步:20世纪美国的经济学家与公共目标》(Michael A. Bernstein, *A Perilous Progress: Economists and Public Purpose in Twentieth-Century America*),普林斯顿大学出版社2004年版。

② 罗伯特·索洛:《考尔斯委员会五十周年纪念文集》,考尔斯基金会1991年版,第81—108页。

③ 马克·布劳革:《1950年代的形式主义革命》(Mark Blaug, “The Formalist Revolution of the 1950s”),《经济思想史杂志》(*Journal of the History of Economic Thought*)2003年第2期,第145—156页。

④ 以《美国经济评论》、《政治经济学杂志》和《经济季刊》这三大经济学期刊为例,从1920年到1960年,使用数学方法的论文比例从0(纯文字)上升到了近50%;而在经济理论方面的论文中,则更是从0迅速上升到了近90%。参见罗杰·E. 柏克豪斯的《1920至1960年美国经济学的转变》(Roger E. Backhouse, “The Transformation of U. S. Economics, 1920—1960”),《政治经济学史》第30卷,1998年第85—107页。

⑤ 肯尼斯·博尔丁:《重观制度学派》(Kenneth E. Boulding, “A New Look at Institutionalism”),《美国经济评论》1957年第2期,第1—12页。关于美国制度学派的衰落,还可参见张林、徐颖莉的《美国本土经济学的多元时代及其终结》,《经济学动态》2010年第12期。

⑥ 克里斯泰尔·德·鲁夫瑞:《1939至1954年美国的传统经济史学》(Cristel de Rouvray, “Old Economic History in the United States: 1939—1954”),《经济思想史杂志》2004年第2期,第236页。

⑦ 约翰·迈耶、阿尔弗莱德·康拉德:《经济理论、统计推导与经济史》(John Meyer and Alfred Conrad, “Economic Theory, Statistical Inference and Economic History”),《经济史杂志》1957年第4期,第524—544页;阿尔弗莱德·康拉德、约翰·迈耶:《南北战争之前南方的奴隶制经济》(Alfred Conrad, John Meyer, “The Economics of Slavery in the Ante Bellum South”),《政治经济学杂志》1958年第2期,第95—130页。

对此提出质疑,认为新古典经济学的理论并不适用于历史研究;但青年经济史学者对此表示赞同。^①此后,包括罗伯特·福格尔、道格拉斯·诺斯、兰斯·戴维斯、乔纳森·休斯、阿尔伯特·费希洛和威廉·帕克等青年经济史学者,开始就计量方法在经济史中的应用展开经常性的讨论与合作。

1960年,这些青年计量经济史学者与传统经济史学者发生了一场冲突。兰斯·戴维斯一篇关于新英格兰地区纺织厂与资本市场的计量研究论文被《经济史杂志》退稿。这些青年学者们立即群起请愿。由于该文拥有经济学科数学化所带来的强有力背书,因而最终成功发表。这件事情还迫使《经济史杂志》调整了编委会,诺斯和帕克成为了新任编辑。同年,他们还在普渡大学组织了“经济史中的数量方法”讨论会,并将其发展成为年度性会议。

计量方法由此占领了美国经济史学的阵地,并迅速发展起来。^②随着世界各国计量经济史学会的成立、各种计量史学刊物的发行以及一些大规模数据库的出现,计量史学者的队伍不断壮大,并日益成为了世界经济史学的主流。到20世纪末,《经济史杂志》、《经济史评论》等国际主要经济史期刊已经很少刊登非计量经济史的文章了。

对经济史学的这次重要转变,福格尔认为计量经济史学成功地实现了经济史学和经济学的再度整合与统一。^③但在持传统观点的学者看来,这实际上只是把经济史学变成了新古典经济学的附庸和试验场,计量经济史学“虽然也搜集了不少原始历史资料,但是完全按照经济学理论的要求,把它们割裂开来加工处理之后再行利用”,因而“不能是研究历史的方法”,而只是在“用经济学来注释历史”;^④计量化导致经济史学“和那些经济学研究同样地使用积分、同样地回归、同样地用T统计量来代替思考……这种经济史学远不是提供给经济理论家们一个更广阔的视野,而只是在回敬给经济学家们同样的一碗粥”^⑤;一些学者甚至提出,“优秀的历史学家绝不会屈从于那些去人格化的社会科学方法……它所研究的是那些‘反复无常、腥臊恶臭的群众’,而不是被抽象了的个体”^⑥。

美国之所以在20世纪40—50年代发生计量经济史革命乃至经济学形式主义革命,除了前述考尔斯委员会的积极推动和美国政府与军方的支持这些直接原因以外,还与自然科学的示范效应和逻辑实证主义哲学的影响等因素有关。^⑦近代以来,自然科学所取得的巨大成就,使得经济学界一直存在向自然科学特别是物理学借鉴思想方法的趋向,这集中体现在一般均衡思想和数学方法这两个方面。前者把经济描述成具有一般性的静态均衡或向静态均衡收敛的状态,从而排斥了历史和制度的

① 克里斯·弗里曼、弗朗西斯科·卢桑著,沈宏亮主译:《光阴似箭》,中国人民大学出版社2007年版,第9—43页。

② 关于计量经济史学在20世纪60年代以后的发展,以往学界已经进行了深入全面地介绍,读者可参见前文引言部分注释,这里不再赘述。

③ 罗伯特·W. 福格尔:《经济史学与经济理论的再整合》(Robert W. Fogel, “The Reunification of Economic History with Economic Theory”),《美国经济评论》1965年第1—2期,第92—98页。

④ 陈振汉:《西方经济史学与中国经济史研究》。

⑤ 罗伯特·索洛:《经济史与经济学》。

⑥ 卡尔·布莱登鲍尔:《突变》,第327页。

⑦ 此外,二战后美国经济地位和政策的调整,很可能对美国经济史学和经济学的转变也产生了一些重要的影响。正如德国垄断资本的登场和对世界霸权的追逐导致德国历史学派失去了社会基础一样(朱绍文:《经典经济学与现代经济学》,北京大学出版社2000年版,第148—153页),美国制度学派和传统经济史学的很多主张,也不如新古典经济学能适应二战以后美国经济霸主地位和冷战时期意识形态斗争的需要(类似的观点可参见琼·罗宾逊著,安佳译的《经济哲学》,商务印书馆2011年版;张夏准著,肖炼、倪延硕等译的《富国陷阱:发达国家为何踢开梯子》,社会科学文献出版社2009年版等)。只是由于资料所限,这一问题还要留待将来文献条件成熟之后再进行深入地探讨。



因素;后者则在二战后形成了布尔巴基主义思想,认为数学是一门抽象的独立科学,其真理性无须经验事实的验证,而经济学既然不能像物理学那样通过构造实验环境来进行经验性检验,那么就只能借助于数学的公理化来进行形式化的检验。^① 20 世纪 30—50 年代兴起的逻辑实证主义哲学则认为,整个科学是一个意义关联的命题集和逻辑严密自洽的公理体系,这就引导着经济学越来越致力于把自己建设成一套完全由基本概念和严密地演绎推理所组成的公理化系统,而这个系统的经验性检验则有赖于运用计量方法和历史统计数据,对既有的理论前提和推论结果进行相关性回归分析,继而推进了计量经济史学的发展。

回顾美国经济史学形成、发展和转变的历程,我们发现,对计量方法本身的意见差异只是传统经济史学与计量经济史学分歧的表面。二者更为核心的分歧在于:前者坚持历史主义的指导思想,强调在特定历史和制度条件的约束下进行研究,反对“离事而言理”;而后者则服从于新古典经济学的理论体系,把历史抽象成数据并纳入到新古典经济学的既有框架中进行研究。虽然传统经济史学者批评相关性和回归等计量方法所存在的不足,但他们并不排斥统计和定量研究。如前所述,制度学派和经济史前辈学者都进行了大量的历史统计研究,他们所反对的是对历史的过度抽象和对新古典理论体系的过分依赖。因为过度抽象历史会导致遗漏统计数据所赖以产生的各种特定历史和制度条件,而过度依赖新古典经济理论则会忽视通过历史归纳和制度视角探索新理论的机会,把理论的产生完全交给了逻辑演绎和数学推导来完成。

计量经济史虽然在定量研究与经济学理论相结合等方面取得了一些进展,但也的确产生了一些问题,如忽视对历史数据的考释与解读,往往把很多无法量化的制度因素排斥在研究框架之外,用数学关系来取代真实世界的历史因果关系,甚至出现了一些操纵数据、用历史数据来迎合新古典经济学理论的情况,这些都在一定程度上限制了经济史学的发展。

[本文作者关永强,南开大学经济研究所讲师。天津 300071]

(责任编辑:杜 娟)

^① E. 罗伊·温特劳布:《经济学是怎样变成一门数学科学的》(E. Roy Weintraub, *How Economics Became a Mathematical Science*), 杜克大学出版社 2002 年版,第 101—154 页;赵华、李建珊:《经济学方法论的科学哲学化》,《科学技术与辩证法》2008 年第 5 期;贾根良、徐尚:《经济学数学形式主义的哲学基础及其缺陷》,《教学与研究》2008 年第 12 期。

