

经济分析方法史

在 AI 时代发展经济学元能力 (Meta-skill)

赵博

南开大学金融学院

2026 年 3 月 2 日

一些值得思考的现象：

- **门槛与工具的脱节**：进入经济、金融行业通常需要研究生学位及长期实习。但业界的经济分析（尤其是宏观）极少使用学界的高深数学，两者常是不同的体系（例如 Ray Dalio 的《原则》）。
- **论文的同质化**：当今绝大部分本、硕、博毕业论文皆为回归分析（因果框架），极少见系统运用微观、宏观理论的文献。
- 但学生们花了大量时间学习微观、宏观，计量经济学也包含大量非因果关系的内容

学界内部的争议

- 最近的例子 Paul Romer: “Mathiness in the Theory of Economic Growth”, “The Trouble with Macroeconomics”
- 核心观点:
 - 真数学 (Math) 的作用: 真正的数学应该用于澄清概念、收紧逻辑链条, 让理论更容易被检验和反驳。
 - “数学作秀”(Mathiness) 的作用: 使用复杂的数学公式作为学术伪装, 其真实目的是掩盖意识形态偏见、隐藏脆弱的前提假设, 并逃避经验数据的检验。
 - 引入“燃素”(Phlogiston): 当代理论家为了让模型与数据强行拟合, 在模型中塞入了大量根本无法观测的“虚构冲击”(如偏好冲击、技术冲击), 这就像中世纪炼金术士解释燃烧现象时发明的“燃素”一样, 毫无科学意义。
 - 学界的“集体无意识”: 他批评学术权威们形成了一个封闭的圈子, 大家心照不宣地维护着这套数学上极其复杂、但对现实毫无解释力的“智力游戏”(Intellectual game)。这导致整个宏观经济学在过去三十年里不仅没有进步, 反而倒退了。

“形式正确、实质空洞”“来制星星的你”

经常能看到随便找变量回归、或者对明显成立的因果关系进行检验的现象。

- 不是没办法，是没出息！陆铭痛批经济学界的集体无意识
- 但我认为：这是经济学近百年发展路径的必然，多多少少是“没办法”。
- 但在这个大背景下，学者仍有选择的自由，做出有意义的研究。
- 这种现象导致了相当一部分人重理轻文，轻视社会科学。

上述现象引申出几个核心问题：

1. 为什么费力学会的数理模型，在实际工作中往往用不上？
2. 对同一个问题，各个流派的观点常有很大不同，但诺奖可以同时颁给观点严重相左的流派，为什么？
3. 为什么毕业论文几乎全是回归分析？学微观、宏观经济学究竟有什么用？
4. 怎样做出有质量的研究？
5. 怎样理解经济学中的不同建模套路，以及新技术在其中的位置？

这些困惑在 AI 时代被进一步放大。传统上被视为“护城河”的技术能力正在经历前所未有的冲击：

- 回归模型可以自动生成
- 代码可以自动完成
- 文献综述可以自动整理

如果工具本身不再稀缺，那么真正稀缺的是什么？

核心目标：发展元能力 (Meta-skill)

判断力与审美能力

过去，这种能力往往是高层统帅的专属——他们无需死磕技术细节，只需做关乎全局的“方向”抉择。今天，当 AI 成为全能的“超级执行者”时，这种能跳出细节泥潭、俯瞰全局的“元能力”就成了每个普通人的刚需。

这门课的核心目的，正是发展这种元能力。
我的办法：把各种方法的套路都研究一下

为什么要从“方法”谈起？

这很笨。在自然科学领域这完全不需要：

- 物理学模型正确与否的标准极其单一：实验数据是否吻合预测。
- 业界工程师与学术圈使用的是同一套体系。修桥的工程师没有自己独立的“修桥物理学”。

经济学的鸿沟：学界和业界存在很大差异。如果学术理论的解释和预测远胜于业界，这种差距不可能长期存在（有效市场假说）。反之亦然。

前置拷问：认识论 (Epistemology)

这种现象说明，在全面评估经济分析方法前，必须先回答一个更根本的问题：

我们怎样知道经济学的理论对还是不对？

- 是预测准就行，还是逻辑自洽就行？
- 还是既要准又要逻辑自洽？
- 统计显著性够了吗？
- 所谓“明显成立”的因果关系，究竟有什么判断标准？

这涉及到认识论、方法论的问题 (Meta-methodology)，是本课程的前置内容。

按照经济分析方法本身发展的历史脉络，及经济问题方法论本身的差异划分：

0. **认识论**：怎样知道经济学的理论对还是不对？
1. **不用数学**的经济分析方法
2. **利用数学**的经济分析方法
3. **实证**的经济分析方法
4. **业界**的经济分析方法

在 AI 时代，工具会越来越强大。但工具无法替代坐标系。

与“经济思想史”的区别

本课程具有显著区别，非思想史的简单罗列：

- **提炼内核**：强调经济思想的分析方法，而非某时代大牛的特定看法。
- **重组脉络**：不按历史顺序划分，而按**方法差异**划分。
- **现实导向**：划分不是出于对思想史的好奇，而是为解决现实经济分析问题提供方法论选择。

在 AI 时代，浏览式了解“谁说了什么”并不困难——我们希望更进一步。

- **探索性**：以“方法演化”为主轴，系统比较学术与业界的课程不多见。
- **争议性**：有方法划分，就意味着指出某些方法的局限——这可能会引起争议。
- **开放性**：课程旨在提出问题，引发思考。由于课程性质，我们会有广泛的辩论，但不一定能获得满意的答案。

无需特殊知识储备，但微、宏观，计量，统计与逻辑学知识会有帮助。基础思想史

参考：

- Landreth and Colander (2001), *History of Economic Thought*.
- Robbins (2000), *A History of Economic Thought: The LSE Lectures*.
- 汪丁丁 (2015), 《经济学思想史进阶讲义》.
- Schumpeter (1996), *History of Economic Analysis*.

其他重要读物:

- Kennedy (2008), *A Guide to Econometrics*.
- 张五常 (2015), 《经济解释》.
- Alchian and Allen (2018), *Universal Economics*.
- Horwitz (2020), *Austrian Economics: An Introduction*.

大部分参考文献会随着课程的进行逐步展开。

- **平时成绩 (70%)**: 课堂讨论与小测验。
 - **注**: 请确认愿意在课堂发言后再选课。
- **期末考试 (30%, 闭卷)**
 - **目的**: 确保这些思维工具真正属于你, 而非你的 AI。
 - **形式**: 客观题 (30%-40%) + 主观题 (60%-70%)。
 - **要求**: 主观题会提供具体的场景问题描述, 只需选择你认为最有力、最适用的工具进行剖析。