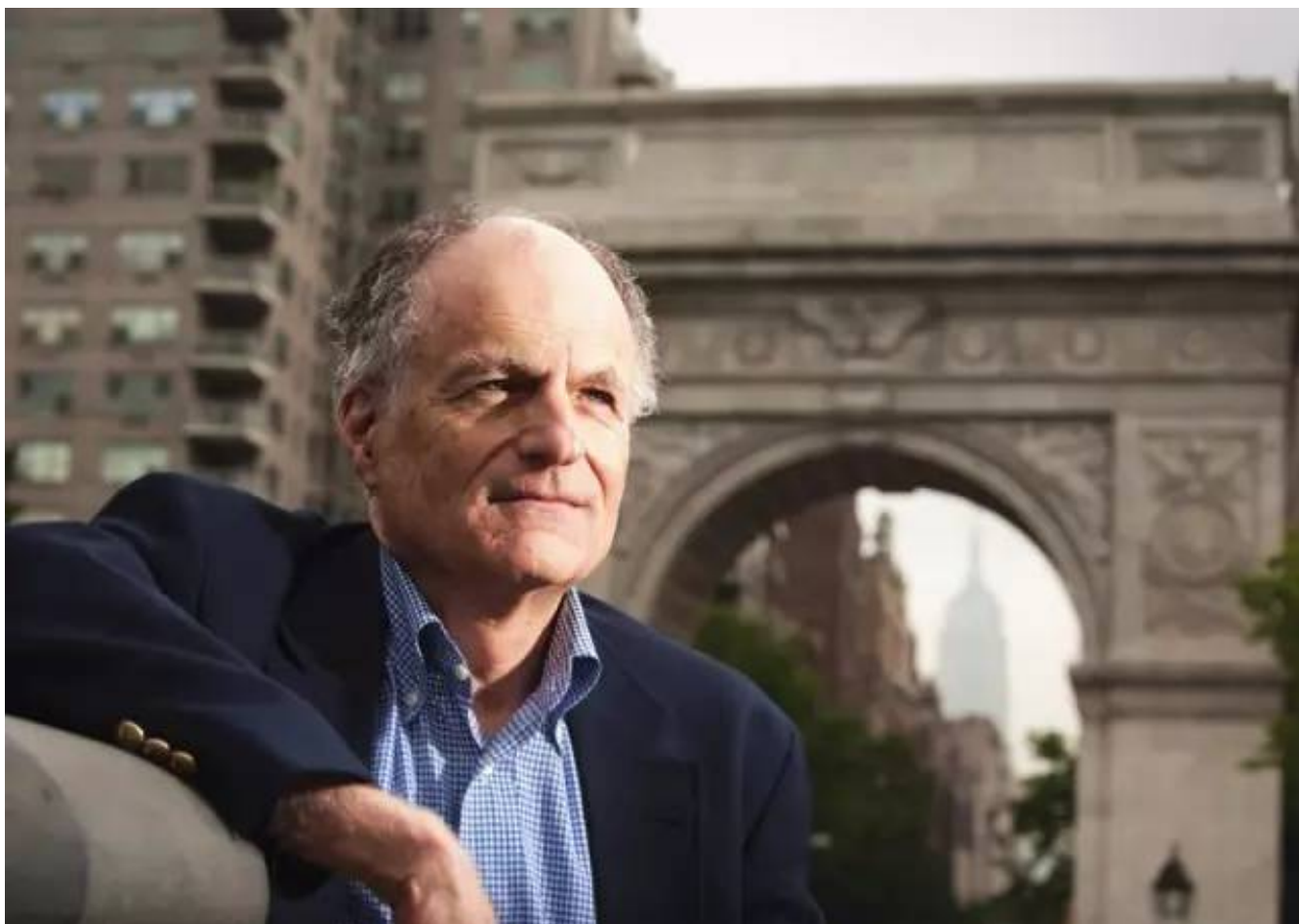


萨金特最新演讲：经济学家在做什么，他们如何学习？

原创 2017-06-12 萨金特 中国经济学教育科研网



“

上世纪70年代以来，萨金特教授一直是理性预期学派的领袖人物，在宏观经济模型中预期的作用、动态经济理论与时间序列分析等方面做了开创性的工作，并与西姆斯共同获得2011年诺贝尔经济学奖。

“物理学和经济学有同样的数学语言。我对此感兴趣的原因是语言、理论和数据之间有很亲密的关系，”萨金特上周在以其命名的研究所成立仪式上说道。他希望经济学像物理学和化学那样更注重量化，通过运用大数据和数量方法进行实证研究。今日，我们推送萨金特教授当日英文演讲的翻译稿件，他的演讲简洁却深

刻，从物理学角度切入，论述了经济学家的使命与学习方式。

演讲实录

● 经济学家在做什么？ ●

经济学是一种工具，用于发现数据中的各种现象，然后加以解读从而将相关关系与因果联系区分开来。

要解释物理研究的话，理查德·费曼曾用到一个国际象棋的隐喻。假如有一位天体物理学家完全不知道什么是国际象棋，只是观测那些恰好在下棋的人。通过对下棋者行为的不完全观测，这位天体物理学家的任务是揭示下棋者的意图及国际象棋的规则。对费曼而言，“国际象棋的游戏规则影射了物理规律。

费曼的比喻正是对经济学家工作的表述。正如天体物理学家，我们获取某些经济过程所产生的非实验数据，并且想要理解这些经济过程。约翰·冯·诺伊曼将博弈定义为：（1）一系列参与者，（2）每位参与者可以采取的一系列的行动，（3）每位参与者基于所有参与者行动所获得的累计收益，（4）时间协议：即谁在何时做出何种选择。一个策略即一个规则，规定你在可能遇到的不同情况下做些什么。约翰·纳什给出过一个强有力的定义：一个博弈的均衡就是所有参与者策略形成的集合，其中没有参与者想要改变他的策略。

像费曼比喻的物理学家一样，我们作为经济学家的任务是通过观察数据推测一项博弈。但我们还想做些物理学家不做的事情：去考虑不同博弈如何产生改进的结果。

在物理学中，根据拉普拉斯所言，过去造就未来。

我们可以将宇宙的现状视为宇宙过去的影响，也是宇宙未来的起因。

在经济学中则不同。

我们对他人行为的预期决定了我们现在的行动。

我们每个人都有一套理论预测他人想要什么，并用此来预测他们的行为。

假如我们有可靠的“他人行为预测模型”的话，那么他人实际可能采取的行动将决定我们对他们的预期。这样的推理方式产生了一种感觉：在经济学体系中“未来决定现在”。

时间的箭头在经济学中是倒的。



这里有些例子：

- 银行挤兑：如果我预期其他人要去银行挤兑，我会跟风，反之亦然。如果没有存款保险，存款人有动机避免银行这种易遭受挤兑的风险。有存款保险，存款人则不再关心挤兑风险，也不会去挤兑。
- 存款保险：如果政府确保银行存款安全，银行的所有者就希望银行能够尽可能扩张，风险尽可能高，而存款人则不会关心这样的风险。
- 失业和残疾保险：这里涉及一些取舍关系：一方面这些制度要为遭到不幸的人们提供保险，另一方面这样的救助会为人们带来负面的激励。
- 中央政府为下级政府机构提供救助。保险VS逆向激励。
- 公共和私有部门的声誉。别人期望我做什么就是我的声誉。就他们的预期，我面临让他们满意或失望的选择。这些选择会伴有后果。珍妮特·耶伦等中央银行家对此有多番考虑。

● 我们如何学习？

像物理学家一样，我们使用模型和数据来学习。当我们发现旧模型有缺陷时，我们开始学习新的事物。

我们受到旧模型如何失效的启发来建立新模型。这就解释了我们何以从过去的经济萧条、金融危机中学到如此多的东西，并从现在这些危机中学到了更多。

最后，我想与诸位分享下几句关于科学的名言：

“我希望，当我说我们不接受他们的观测结果，除非这些观测已经经受了理论的验证时，不会令实验物理学家过于震惊。”—亚瑟·埃德，1933年9月。

“科学学科的进程由不同的方式塑造，这取决于是理论引领数据或数据引导理论。一个理论告诉我们要寻找什么，你要么找到它，要么没有。如果你找到了，你将继续去寻求下一个开放问题的答案。如果你没有理论，你将开始收集尽可能多的数据并希望数据中出现相关模式。但直到你完成概述，你几乎一直在黑暗中摸索。”—奈斯·格拉斯泰森，《黑洞之死》

“当你所知晓的一切几乎都错了时，你便活在最好的时代。”汤姆·斯托帕德，《美国》，第一幕场景4

“悖论产生进步。”—约翰·惠勒

“宇宙无法被解读，直到我们学会了宇宙的语言，熟悉了书写宇宙的文字。说到底，就是一种数学语言。”

“没有这些，人只是在黑暗的迷宫里徘徊。”—伽利略，转引自爱丽丝·霍夫曼的《对立婚姻》，P112。

2017年6月8日，萨金特在北大汇丰商学院举行的萨金特数量经济与金融研究所成立仪式上，发表了这篇演讲。编译：金颖琦 经新加坡国立大学副教授朱胜豪审定发布；[点击阅读原文](#)，查看萨金特教授的英文演讲原稿。

[阅读原文](#)