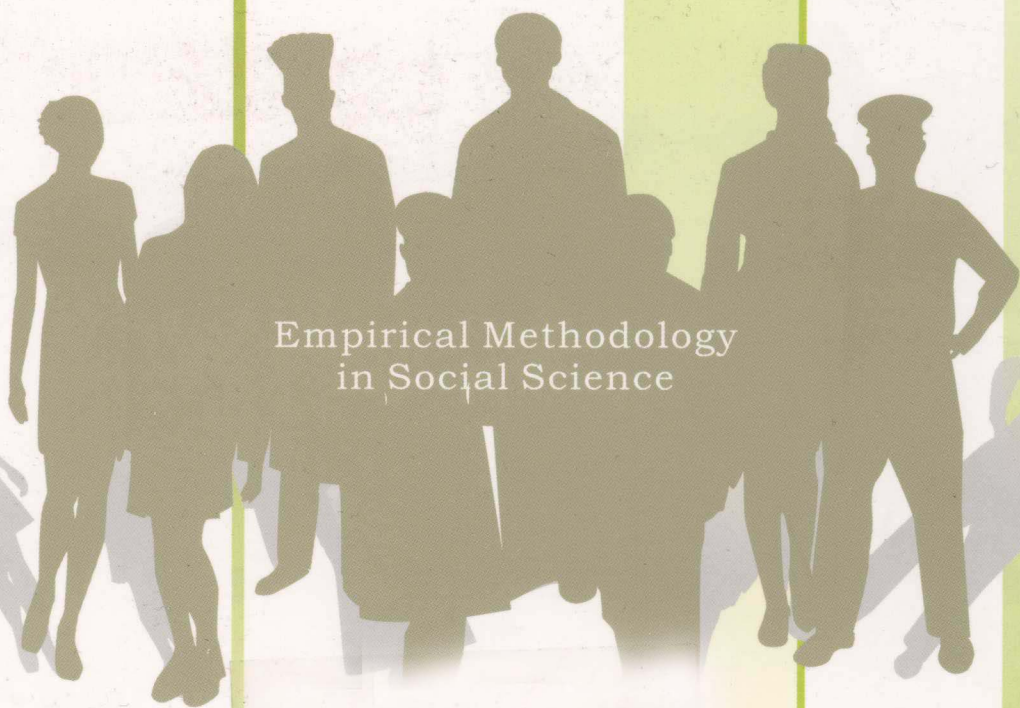


社會科學實證方法

-附經濟學說明實例

顏吉利 講座教授

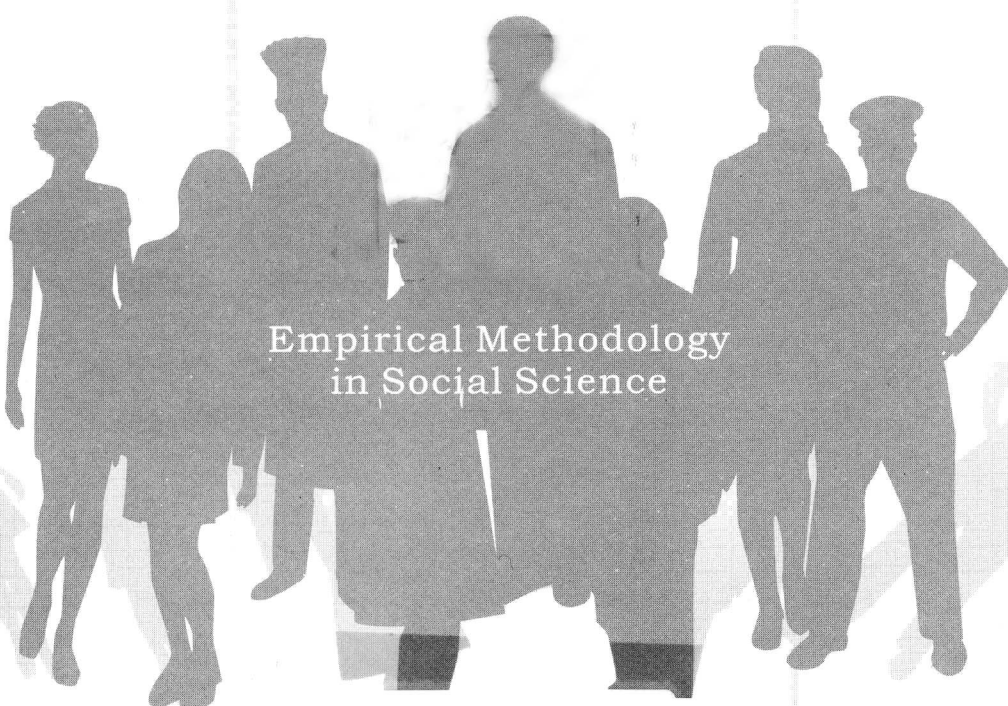


Empirical Methodology
in Social Science

社會科學實證方法

-附經濟學說明實例

顏吉利 講座教授 著

A group of approximately ten people of various ages and ethnicities are shown in silhouette, standing together. The text 'Empirical Methodology in Social Science' is overlaid on the group.

Empirical Methodology
in Social Science

國家圖書館出版品預行編目資料

社會科學實證方法—附經濟學說明實例／顏吉利著.

-- 初版. -- 臺北市，民 96

面； 公分

ISBN-13: 978-957-41-4460-0 (平裝)

社會科學實證方法—附經濟學說明實例

作 者／顏吉利

發 行 者／顏吉利

發 行 所／顏吉利

地 址／台中縣霧峰鄉吉峰東路 168 號

電 話／(04) 23390337

傳 真／(04) 23742331

E - Mail／gyen@cyut.edu.tw

總 經 銷／華泰文化事業股份有限公司

地 址／台北市 11494 內湖區新湖二路 201 號

電 話／(02)2162-1217

傳 真／(02)8791-0757

承 印 者／瑞明彩色印刷有限公司

電 話／(02)2991-7945

出 版／西元 2007 年 6 月 初版

I S B N／ISBN-13: 978-957-41-4460-0

定 價／180 元

社會科學實證方法

—附經濟學說明實例

顏吉利 講座教授著

謹將本書獻給長眠於
台北縣林口鎮公墓之雙親

作者簡歷

基本資料

姓 名：顏吉利

出生日期：1953 年 3 月 8 日

出生地點：台北萬華

求學經驗

小 學：台北縣牡丹國民小學／基隆市八堵國民小學

中 學：台灣省立基隆中學初中部；

台灣省立基隆中學高中部

大 學：國立台灣大學經濟系學士

研 究 所：國立台灣大學經濟學研究所碩士；

美國華盛頓大學經濟學研究所博士

主要經歷

先後任職於中華經濟研究院、國立中央大學、台灣經濟研究院、中華開發信託公司，現擔任朝陽科技大學企管系專任教授、南開技術學院財金系／企管系合聘講座教授（自朝陽科技大學借調）。曾先後擔任國立台灣大學、國立中興大學、輔仁大學、東吳大學、逢甲大學等校兼任副教授、教授，並曾擔任中國經濟學會（現更名為台灣經濟學會）理事、中國財務學會（現更名為台灣財務金融學會）創會秘書長、行政院經濟革新委員會產業組顧問、上市審議委員會委員、中國鋼鐵公司董事／監察人、中德電子材料公司董事、泛亞銀行常務董事、月眉公司董事、國立中央大學產業經濟研究所所長、國立中央大學財務管理研究所所長、台灣經濟研究院研二所所長、中華開發主任

秘書、朝陽科技大學管理學院院長、國內外學術刊物編輯、管理學域學術研討會論文集主編等職務。

專業成就

曾多次榮獲行政院國科會研究成果獎助、研究專案補助，計發表國際學術論文四十餘篇，加上前述擔任產、官、學界重要職務之資歷，先後獲收錄於 Who's Who in the World (Marquis; 1999 —)、Five Hundred Leaders of Influence (ABI; 1999)、The Asia 500 (Barons; 2000)、The Global 500 (Barons; 2001)、Lifetime of Achievement One Hundred (IBC; 2004)等世界名人錄。

李 序

憶及 1987 年本人返台為國立台灣大學及國立政治大學合開國際財務管理課程講學期間，經由時任國立台灣大學經濟系林大侯主任之引見，本書作者顏吉利教授與本人有緣結識；當時顏教授也參與該課程之研討。

顏君於 1983 年自美國華盛頓大學取得經濟學博士學位後，即陸續有學術論著問世。就本人了解，截至目前為止，顏博士已有四十餘篇論文於國際學術刊物發表。以其在學術專業上之傑出表現，獲收錄於多本世界名人錄，獲本人邀請擔任本人主編學術刊物之編輯委員，並於 2007 年 2 月自朝陽科技大學借調至南開技術學院擔任講座教授。誠可謂「一步一腳印」，正是國內從事學術研究者之最佳典範。欣聞顏博士，趁教授年度休假之便，將多年鑽研研究方法論之心得撰成專書，期能提供國內博碩班同學、學術界新血一窺學術堂奧之途徑，本人極樂意為本書寫序。

綜觀全書，舉凡研究態度之養成、研究流程之掌握、研究主題之擇定、研究題綱之撰提、研究論文之撰寫，顏講座教授均提有獨到精闢之見解，這可說是國內外研究方法論書籍難得一見的重大貢獻。誠如作者所言，讀者諸君如能熟讀本書並身體力行，將能成為深具品味的學術鑑賞者，進而成為功力日進的學術研究者，終而成為卓然有成的學術貢獻者。對於顏講座教授不遺餘力完成此一發人深省之作品，本人身為顏講座教授國立台灣大學經濟系之學長，給予高度之肯定，謹此鄭重強力推薦。

Rutgers 大學財務講座教授
數量財務與會計評論主編
亞太金融市場與政策評論主編

李正福 謹識 2007 年 1 月

自序

自 1983 年學成返台，指導學生人數逐年增加、學術論著亦陸續發表，對研究方法重要性之體認日深，而時思將個人鑽研研究方法之心得，與攻讀學位之博、碩班莘莘學子、初踏入學術研究行列之學術界新血分享，亦可收與學術同儕相互切磋之功效。加以，坊間有關研究方法論之書籍，或著眼論文體例之介紹、或注重相關數量方法之說明、或側重論文撰述技巧之討論、或強調論文發表程序之解說，與我心目中理想研究方法論書籍應涵蓋之題材有相當之差距，依個人淺見，這是國內亟待填補之學術缺口，而這也是撰寫本書之另一動力。

回顧 1975 年到 1978 年就讀國立台灣大學經濟研究所碩士班期間，在恩師林大侯教授悉心指導下完成乙篇水準出眾的碩士論文，於 1988 年經改寫後，收錄於薛琦教授主編產業經濟學讀本之第七章；在 1978 年至 1983 年就讀華盛頓大學經濟學博士班期間，有幸擔任 Lee K. Benham 教授之研究助理，得有與他合撰學術論文之機會（於 1986 年刊登於 Journal of Health Economics），並在他的悉心指導下完成博士論文，日後經改寫後發表於國際學術期刊，並獲收錄於劍橋大學學術論文集。今日略有小成，實得力於兩位恩師所給予之嚴謹學術訓練，尤其是研究方法方面之訓練。同時，在 Benham 教授的鼓勵下，從進入博士班以迄於今，不斷思索與研究方法攸關之問題，其間尤獲益於 Simon 教授於 1969 年所著 Basic Research Methods in Social Science: The Art of Empirical Investigation，Blaug 教授於 1980 年所著 The Methodology of Economics，以及 McCloskey 教授於 1987 年所著 The Writing of Economics 等三本力作。另外值得一提地是，筆者一再研讀 Sir Arthur Conan Doyle 所撰四篇中篇，五十六篇有關 Sherlock

Holmes 探案之作品，除提供筆者無盡之閱讀情趣外，有三項與研究方法有關之驚喜：一、提供筆者若干上課之題材；二、精進筆者推理能力之途徑；三、成為筆者英文寫作之標竿。書末所附本書作者著作目錄，可為明證。

二十餘個年頭過去了，上述國內研究方法論書籍之缺失依然沒有顯著的改善，也因而藉助專書發舒本人從事社會科學實證研究二十餘載之心得，開闢一讀者可窺研究方法堂奧之想法，可說是與日俱增。延續 1992 年編著產業經濟研究手冊之寫作經驗，趁 2006 年 2 月獲教授年度休假之便，方將蘊釀多年之構想撰成本書，衷心企盼可為激發國內社會科學實證研究，起一定程度之作用。撰寫本書期間，衷心感謝任教於國立中央大學之內人林純瓊博士同意提供其博士論文題綱作為本書第四章之部分素材，刻正在美國麻省理工學院攻讀電機博士之小兒顏志勳不遺餘力之精神支持，以及歷屆修習本書作者講授研究方法論碩士班同學之堂上討論。在 70 餘種知名國際財務期刊發表論文總篇數排名世界第一之李正福講座教授惠允寫序，為本書增色不少。筆者多年好友，中國大陸中央財經大學王廣謙校長，代為安排在中國大陸出書相關事宜，盛情可感。曾任朝陽科技大學設計學院代院長之黃台生博士，親自出馬指導高足設計研究所吳佩琦同學為本書設計封面，謹此申謝。

本書論述之重點，係針對有心修習研究方法之博、碩士生，以及積極尋求研究成果與學術同儕分享之年輕學者，就幾個在研究征途中經常遭遇之主要挑戰，諸如研究主題之擇定、研究流程之掌握、待驗證臆說之提出、研究專題之規劃、以及論文撰述技巧之淬鍊，嘗試提出解答。本書所欲成就之目標，簡而言之，期待讀者在熟諳本文內容後身體力行，先成為獨具慧眼的學術研究鑑賞者，進而成為卓然有成的學術研究貢獻者。本書之寫作，歷經多年之醞釀、不斷之琢磨、精心之擘畫、審慎之下筆、反覆之修訂，方成稿付梓，雖已竭盡棉薄之力，惟疏漏謬誤之處在所難免，希望海內外賢達、採用本書各大專校

院教師、以及本書讀者諸君不吝賜教，以作為本書修訂時之重要參考。

顏吉利 謹識
時 2006 年歲末

目 錄

李 序	i
自 序	iii
第一章 學術真理何處尋	1
第二章 實證流程縱橫談	5
第三章 實證主題之選擇	11
第四章 研究題綱之撰擬	21
第五章 撰述技巧之討論	39
第六章 暮然回首來時路	45
參考書目	47
附 錄：本書作者著作目錄	51

第一章 學術真理何處尋

“Come, Watson, come!” he (*Holmes*, italics added) cried. “The game is afoot. Not a word ! Into your clothes and come!” Arthur Conan Doyle (1881), “The Adventure of the Abbey Grange,” reprinted in The Complete Sherlock Holmes, P. 636.

謁語：呼喚讀者，共踏學術征途。

自 1983 年學成返回台灣服務以迄於今，先後指導碩士論文數十篇，發表國際學術期刊論文亦達四十餘篇。於講授研究方法論題材時，最常被學生問到的問題就是，「從事社會科學實證研究有訣竅嗎？」歷經二十餘年之嘗試與摸索，略有體會，樂於將個人心得與莘莘學子、學術新血分享，爰有此書之撰述。

經濟學是一門社會科學，經濟學者試著剖析經濟行為主體，諸如生產者、消費者、生產因素擁有者、政府從業人員、貿易商、財務投資者之決策與互動行為，進而對經濟現象提出解釋或作成預測。經濟學者藉由文字思考、圖型分析或數學模式之推導，針對所關心的經濟變數建立其間理論關係，再借助實證資料之蒐集與分析，來研判前述理論關係是否能夠成立—或曰是否得到實證資料的支持。經濟學在社會科學當中，素以嚴謹著稱，這點不難從經濟學是唯一設有諾貝爾獎之社會科學學門看出。除此而外，經濟學的研究方法已被廣泛地應用於其它社會科學各研究領域。因而，本書雖舉經濟學實證研究作為說明性之實例，然有關實證方法論之討論，很大一部分同時適用於其它社會科學。

回到先前提到的問題，「從事社會科學實證研究有訣竅嗎？」在此，試就此一問題，提出解答。首先，研究者須具備學術之基本訓

練。以經濟學實證研究為例，研究者須熟諳各種經濟理論，方能擁有觀察經濟現象、剖析經濟行為之堅實基礎。進一步言，經濟現象或經濟行為，無法脫離典章制度、文化特質或法規環境而獨立存在，故研究者應有這方面的認知與素養。原則上，我們常講，學術研究之驅力(drive)，係來自知性好奇心(intellectual curiosity)。就這方面言，敏銳之觀察力、出眾之洞察力、過人之分析力，其重要性不言可喻。具體而言，這就非要對現有文獻—即發表於國際學術期刊論文之總稱—有深入認識不可。惟有透過對文獻之有效掌握，方能充分理解過往學術研究之源頭、當前學術研究之重心、以及未來學術研究之趨向。也唯有如此，方能找出將西方學者提出理論觀點套用到學術新興國時（如：台灣），是否可完全適用、經修正後可適用、甚或完全不適用；而作成研判之前，勢須仰賴實證研究不可。經由上述的說明，不難發現從事高品質實證研究的重要前提，就是要能針對懸而未決的問題提出重要的研究主題(a research topic)。無怪乎，Einstein 強調：「一般而言，重要研究主題的提出，遠比一般研究主題的解答來得重要。」【註一】在擇定研究主題後，對於從事實證工作的學者而言，研究方法論方面的訓練就扮演舉足輕重的角色。實證研究既以實證資料為研究素材，自須先行界定實證研究對象，其理甚明。界定實證研究對象後，實證研究者緊接著即應思考如何蒐集具代表性之實證資料，如何選用合適之實證方法進行資料之分析，而後根據資料分析之結果，進行推論，並提出結論。如以研究方法論的術語來說，其間涉及待驗

【註一】原文為“The formulation of a problem is far more often essential than its solution, which may be merely a matter of mathematical or experimental skill. To raise new questions, new possibilities, to regard old problem from a new angle requires creative imagination and marks real advance in science.”轉引自 Cooper & Schindler (2003)，第 64 頁。

證臆說之提出，實證模型之設定，實證模型之估計，以及實證結果之呈現、討論與詮釋。而其中有關資料分析之部分，實即數量方法或統計學所涵蓋之主要內容，國內外已有大量這方面之論著，故本書僅從研究方法論之觀點略作論述。

本書為求與統計書籍發揮互補性，論述重點截然不同。除說明撰述動機之本章外，其它各章之主要內容概如下述：第二章說明實證研究之流程，以助讀者了解實證研究之程序(procedure)及其間包括之主要研究步驟(major steps)，俾作為往後各章研習之基礎。第三章敘明擇定研究主題之技巧，本章的內容，除說明實證研究之分類方式外，另一論述重點是擇定之研究主題宜具有趣味性(of interest)、重要性(of importance)與可行性(manageability)。第四章探究研究題綱(a research proposal)之撰擬。研究題綱，一如旅人手中握有之地圖，從研究構想萌芽之起點，以迄於研究論著完成之終點，在這兩點之間，發揮關鍵性之引領功用。第五章討論研究論文之撰寫。論文寫作可說是研究心路歷程之體現，惟有經由用心之經營，方能打動讀者之心靈。第六章，即本書最後一章，提出全書結論。

在踏上社會科學研究方法論學習旅程之前，謹就本書之撰述目標說明如次：就消極目的而言，熟知研究方法論，有助於讀者成為學術研究的鑑賞者(critical evaluators)，可使讀者居於有利地位評估學術研究之品質與貢獻，並作為深入研讀相關文獻之依據。就積極目的而言，熟知研究方法論，有助於讀者成為功力日進的研究者(better researchers)，並經由持續不斷的努力，終而成為學術研究的貢獻者(substantial contributors)。