

社会经济史研究系列

RESEARCH METHODS OF CLIOMETRICS

计量经济史 研究方法

刘 巍 / 著



社会科学文献出版社
SOCIAL SCIENCES ACADEMIC PRESS (CHINA)

社会经济史研究系列

计量经济史 研究方法

RESEARCH METHODS
OF CLIMETRICS

刘 巍 / 著



社会科学文献出版社
SOCIAL SCIENCES ACADEMIC PRESS (CHINA)

图书在版编目(CIP)数据

计量经济史研究方法 / 刘巍著. -- 北京: 社会科学文献出版社, 2016. 12

(社会经济史研究系列)

ISBN 978-7-5201-0078-6

I. ①计… II. ①刘… III. ①计量经济学-经济史-研究方法-世界 IV. ①F224.0-091

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2016)第 300537 号

· 社会经济史研究系列 · 计量经济史研究方法

著 者 / 刘 巍

出 版 人 / 谢寿光

项目统筹 / 陈凤玲

责任编辑 / 陈凤玲 吴春华

出 版 / 社会科学文献出版社·经济与管理出版分社 (010) 59367226

地址: 北京市北三环中路甲 29 号院华龙大厦 邮编: 100029

网址: www.ssap.com.cn

发 行 / 市场营销中心 (010) 59367081 59367018

印 装 / 北京季蜂印刷有限公司

规 格 / 开 本: 880mm × 1230mm 1/32

印 张: 13 字 数: 287 千字

版 次 / 2016 年 12 月第 1 版 2016 年 12 月第 1 次印刷

书 号 / ISBN 978-7-5201-0078-6

定 价 / 88.00 元

本书如有印装质量问题, 请与读者服务中心 (010-59367028) 联系

 版权所有 翻印必究

内容提要

本书系统地考察了计量经济史 (Cliometrics) 的研究方法, 并提供了作者近年来尝试研究的案例, 可供计量经济史爱好者、经济史研究者和理论经济学其他学科研究者参考。

本书正文共 9 章, 分为上下两编。上编讨论研究方法, 基本上遵从实证主义研究路线: 前提假设—逻辑推理—实证检验。本书将“前提假设”分为上位前提 (总供求态势)、下位前提 (制度安排、习俗和发展阶段特征等) 和技术性前提 (为分析方便而做的暂时假设), 并分别做了讨论。在“逻辑推理”部分, 本书简要考察了经济学逻辑和前提假设的关系, 总结了几种常用的逻辑推理工具。在“实证检验”部分, 本书总结了计量经济学应用的基本原则和需要注意的一些问题。最后, 本书讨论了计量经济史的“研究链”——经济史研究的相互连接的三个层次, 并对研究者的定位问题提出了建议。下编介绍了几个不同角度的研究案例, 诸如文献评介、学术商榷与应答、中外经济史专题研究和理论质疑与补充等。

自序：对“经济史应当成为经济学之源”理念的思考

已故著名经济史学家吴承明先生认为，“经济史应当成为经济学的源，而不是经济学的流”。^①多年来，这一理念始终为国内经济史学界众多学者所接受，在许多文献中都可以看到赞扬和诠释。但是，绝大多数文献都停留在呼吁和号召的层面上，而将这一理念付诸研究过程或提出具有可操作性的研究路径者却很少见到，国内学界长期以来的实际情况是“源”与“流”之间鲜有沟通管道，经济学和经济史两界学者自说自话，难以体现上下游之间的顺畅联系。以中国近代经济史为例，学界惯常的研究路径是，就时下经济中的某一热议问题，如房地产、“三农”、基础设施建设、股市等，做民国或晚清时期同一问题的论文，文中大都声称为当今提供借鉴。但是，由于作者对经济运行逻辑知之甚少，所以，论文描述的基本因果关系和所用数据的统计口径等规范性元素与经济学含义相去甚远，经济学界无法参考借鉴。于

^① 吴承明：《经济史：历史观与方法论》，上海财经大学出版社，2006，第219页。

是，当“源”不能为“流”提供“达标水”时，经济学界一旦需要借鉴历史经验，大都是自己动手。例如，经济学家陈志武近年来正率团队研究整理中国 1700 年以来的时间序列利率数据，其原因自不待言——中国近代经济史文献无法提供这类数据。又如，新中国成立以来中国近代金融史研究开展了几十年，但尚无国内学者估算货币供应量时间序列数据，目前学界使用的近代中国 24 年的货币供给量是美国经济学家罗斯基估算的，^① 虽有一定瑕疵，但终强于无据可循。众所周知，离开货币量数据，绝大多数经济问题是讲不清楚的。不可否认，也有经济学界学者轻率地使用经不起推敲的历史数据，进而得出令人遗憾的结论之案例。如财新网报道，香港大学许成钢教授 2011 年 7 月 5 日在北京出席 IEA 第 16 届全球大会时谈到了中国经济总量在世界上的地位问题：“从最近的 30 年或者 50 年来看非常了不起，但把历史拉开来看，只是相当于中等程度的恢复。1913 年美国 GDP 世界第一，中国第二，只看这个指标，中国终于回到了 1913 年时在国际上的地位。但从绝对数量上看，2010 年中国 GDP 约为美国的五分之一，还不如 1913 年。按照比较乐观的估计，2025 年中国 GDP 会成为世界第一，即便如此，中国也只是达到了 1880 年的状态，当时中国已经是世界最大的经济体。”^② 许成钢先生的数据不知出自何处，令人惊讶。在前辈学者研究成果的基础上，我们对 1887 ~

① Thomas G. Rawski, *Economic Growth in Prewar China*, University of California Press, 1989.

② 详见 <http://overseas.caing.com/2011-07-05/100276240.html>，且国内各大网站相关栏目多有转载，影响较大。

1936年缺失的40个数据做了初步的估算，^①形成了一个50年时间序列数据。笔者所做的比较研究结论是，1913年中国不是第二，1880年也不可能是第一。^②

凡此种种，不一而足，可见，在国内学界，有效沟通“源”与“流”，且保证“源”之水能为“流”所用，是当务之急。既然学界同仁对吴承明先生提出的理念从无异议，于是，呼吁号召就嫌多余了。笔者借自序之便，拟就有效沟通源流的思路抒发一孔之见，借以纪念学界泰斗吴承明先生。

一 经济史研究范式思考：“史无定法”大义浅读

从国内学界源与流不能有效沟通的现状来看，笔者认为，经济史学界与经济学界研究范式的巨大差异是源与流尴尬局面的症结所在，同时，问题在于经济史学界。经济史学界一些学者片面地解读吴承明先生提倡的“史无定法”理念，常对此说望文生义，进而作为事实上不懂经济研究方法和分析工具的搪塞，通常凭聪明和灵感对经济史做出朴素的或想当然的解释，研究结论常常令经济学界茫然不解。这犹如不大懂化学的人按自己的观察写出的化学实验报告和实验结果分析，化学家对这份文件是不会感兴趣的。

我们知道，经济史研究过程不是信马由缰的，研究者事先必

① 刘巍、陈昭：《近代中国50年GDP估算与经济增长研究（1887～1936）》，经济科学出版社，2012，第107～108页。

② 刘巍：《1887～1936年中国总产出的国际地位研究——与美英日三国的比较分析》，《广东外语外贸大学学报》2013年第2期。

有某种思路。于是，经济史文献中使用的历史资料必然是研究者精心选择的，基本适合研究者的研究思路。但是，如果研究者对经济运行逻辑关系知之甚少或浑然不知，那么，所选资料用处不大就是大概率事件了。

从研究范式差异这一起点开始，经济史学和经济学两界学者必然渐行渐远。那么，吴承明先生提倡的“史无定法”究竟含义如何呢？笔者虽与吴老相识，也曾多次得到吴老的指点，且吴老是笔者博士学位论文答辩委员会主席，但是，笔者毕竟没有就“史无定法”的含义一题向吴老做过专门请教。于是，以下对吴老主张的“史无定法”理念的理解纯属笔者演绎，荒谬之处在所难免。

首先，“史无定法”是大视野的理念。历史是对既往人类活动场景的记述，绚烂多彩，人们从各个角度研究，产生了诸如外交史、战争史、农业史、音乐史、哲学史等“泛历史”分支。如今早已不是司马迁写《史记》的时代了，科学发展突飞猛进，理应有各个角度的方法，不可能也不应该一致。各个研究角度既然有客观的运行规律，就必有反映和继续探索这些规律的逻辑框架及研究范式。于是，研究各种专门史的方法应该有特定的一种或数种，即在某一专门史领域中，方法应该是长期积累形成的特定范式。比如，研究音乐史不可能用外交史的研究方法，研究农业史不可能用哲学史的方法。因此，笔者认为，大视野的“史无定法”理念中蕴含着特定领域的“史有定法”。

其次，经济史研究与经济学研究是不能割裂的。经济学产生至今已有 300 年左右的历史了，当年威廉·配第、“经济学之父”

亚当·斯密、大卫·李嘉图、边际革命三杰等著名学者研究的经济学，就是我们今天视野中的经济史（也包括经济学说史）。不仅如此，就连“现代经济学之父”凯恩斯的重要研究对象——大萧条，也成了今天经济史学家不倦探索的领地。这些前辈经济学大师的研究方法体现在他们的宏论之中，是传世经典。吾等后辈学人今天在研究他们那个时代的历史经济运行，若连他们的研究方法和分析工具都不掌握（虽有些分析工具，但今天已显落后），甚至看不懂他们的文献，岂不汗颜。学术发展是需要传承的，若某一代人不能从前辈学者那里继承、发扬和创新充满智慧的技法，学术研究水准必将倒退。试想，假如一个人立志研究数学，但对笛卡儿的解析几何、牛顿的微积分既一无所知又不屑一顾，自己另起炉灶，即使此君终日悬梁刺股，又能有多大成就呢？

吴承明先生认为，“经济史研究历史上各时期的经济是怎样运行的，以及它运行的机制和绩效。依此定义，我们研究的视野就不能限于经济本身，因为自然环境、国家、社会和文化都制约着经济的运行，而经济运行的绩效也在自然环境、国家、社会和文化上表现出来”。^①从吴老的定义和释义中可以读出，经济史研究和以往各个时代经济学界对他们的“当今”经济运行研究极为相似。笔者对吴老所言之放开“研究视野”的感受是，任何一个历史阶段的经济运行必然受制于或受益于自然环境、国家、社会和文化等因素，即在不同的自然环境、国家、社会和文化背景之下，各个不同历史时期的经济运行方式不同，经济机制的传导路

① 吴承明：《经济史：历史观与方法论》，上海财经大学出版社，2006，第179页。

径不同，经济绩效的高低不同。而宏观经济绩效的累积效应必然促使自然环境、国家、社会和文化等因素发生变迁，进而对下一阶段的宏观经济运行提供大背景。总之，既然经济史的研究内容是历史上的经济运行，无论从何种角度展开研究，必然逼近和最终深入经济运行逻辑之中。因此，经济学的方法应该是经济史研究的核心方法。在《经济史：历史观与方法论》一书的第六章到第九章中，吴老将经济史研究的方法总结为经济学方法、社会学方法、计量分析方法和区域比较方法四种，除去社会学方法之外，其余三种都是大经济学研究方法的子类。同时，应用社会学方法研究经济史也不能独立于经济学逻辑之外，因为研究对象毕竟是历史经济运行，对经济运行逻辑的拒绝无疑会阻碍研究者得出正确结论。

最后，经济史的研究方法与经济史的分析工具是不同层次的概念。从科学研究方法论角度观察，方法应该是上位层次概念，属于梯次展开研究过程的理念或范式；而分析工具则应该是在某种研究理念或范式之下，研究者选择的架构完整的分析手段，如新古典的或现代经济学理论框架，数量分析工具或博弈论分析工具，等等。在一定的方法（理念或范式）之下，可选择的工具很多，但工具本身不是方法，虽然在口语中常常将二者混淆。譬如，在实证主义理念下，经济分析遵循“前提假设—逻辑推理—实证检验”这一范式进行，这是目前主流经济学的研究方法。在这一范式的“逻辑推理”环节上，研究者根据不同的前提假设选择不同的理论框架作为分析工具，推出最终结论。接下来，在“实证检验”环节上，根据资料情况，研究者可以选择数量分析

工具做实证，也可以选择案例分析做实证；如果实在缺乏条件，也可以暂时不做实证，将逻辑推理的结论暂且作为“假说”，待有条件时再做实证。但是，无论怎么变换分析工具，实证主义的研究方法并未发生改变，若研究者不走实证主义路线，那才是研究方法发生了变化。纵观近年来经济史学界对于研究方法的诸多讨论，笔者认为，许多文献的“方法”内涵差异很大，且有大材小用之嫌。

二 经济史与经济学：研究范式对接与研究领地拓展

和大约 30 年前的索洛教授一样，笔者不揣冒昧，也来谈谈经济史与经济学的研究内容。索洛撰文批评过美国计量经济史学派，^① 吴老在《经济史：历史观与方法论》一书中谈及方法论时，对索洛的论文做了客观的介绍。索洛认为，美国新经济史受到了经济学的损害，虽然也从经济学中得到了营养。索洛的批评主要是针对新经济史学家也和经济学界一样研究整合、使用回归分析工具和“用时间变量代替思考”，他认为，经济史学家应该从社会制度、文化习俗和心态层面给经济学提供广阔的视野。他虽然赞成经济史学家利用经济学家提供的分析工具，但认为不应还给经济学家“同样一碗粥”，即经济史学家应该用经济学的烹饪技艺做出几道新的大菜，从而令经济学家惊奇，而不是重复着经济学的菜单。

^① Robert M. Solow, “Economic History and Economics”, *Economic History*, Vol. 75, No. 2, May 1985.

虽然吴老在书中对其他学者的观点也有详尽的介绍，但是，中国经济史学界却经常引用索洛的宏论而非其他著名学者的，其意无疑在于否定用经济学工具研究经济史的“新潮”。然而，用某甲的言论否定或肯定某乙的工作是最不科学的，除非某甲是万能的上帝。尤其不可取的是，用某甲若干年前的宏论作为考量某乙若干年后研究工作的尺度。作为 1987 年诺贝尔奖得主，索洛 1985 年的观点无疑有较强的公信力，而且可能反映了当时的实际情况。但是，值得注意的是，1985 年美国新经济史的年龄不过二十几岁，阅历尚浅，“从社会制度、文化习俗和心态层面给经济学提供广阔的视野”这一重任对于新经济史学派并非力所能及。从新经济史学派的学术发展路径观察，正是由于新经济史学派执着地使用经济学界提供的研究范式和分析工具，潜心做了历史宏观经济运行之类的基础性研究，包括索洛所批评的“研究整合、使用回归分析工具和用时间变量代替思考”，然后才有了对历史上“社会制度、文化习俗和心态”的深入研究。20 世纪 80~90 年代新经济史学派的领军人物、1993 年诺贝尔奖得主 D. 诺斯对产权理论、国家理论和意识形态理论做出了巨大贡献，他的研究起点正是美国的航海运输史等经济史领域，若不采用经济学家提供的范式和工具，诺斯对新制度经济学的贡献将难以想象。诺斯的贡献被当今经济学界广泛应用，这一贡献显然不是经济学家们早餐中常见的“一碗粥”，而是做出了在经济学菜单上被忽视的大菜。假如索洛的论文在十年之后——1995 年发表，大概就是另外一种宏论了。

众所周知，诺斯的贡献是里程碑式的，诺斯一生恐难再有这

样的贡献，就像索洛也难有超越“索洛模型”的贡献一样。不可能每一个经济史学家都会有诺斯那样的贡献，就像不可能每一个经济学家都会有索洛的贡献一样。绝大多数新经济史学者在绝大多数时间里做的研究还都是基础性的工作，科学研究不可能一蹴而就，要给新经济史以时日，要允许新经济史修补往日研究的不足，相信新经济史日后会不断丰富经济学家的菜单。新经济史在美国出现至今，尚不足 60 年；传到中国并被少数学者接受，还不到 20 年。笔者相信，随着时间的推移和新生代学者的成长，中国计量经济史也能对中国经济学提供新的营养餐。从笔者近年来的体会来看，国内学界许多激烈批评计量经济史的学者其实还未搞懂计量经济史的研究范式以及所用的分析工具。计量经济史研究的标准范式是“前提假设—逻辑推理—实证检验”，前两个环节要求研究者具备历史学和理论经济学的功底，后一环节要求研究者具备统计学和计量经济学的良好修养。可见，研究计量经济史不仅是会不会“做模型”的问题，而且是要迈过由理论经济学、历史学和计量经济学这几门功课共同设置的“门槛”。

三 经济史研究的最高境界：修正、补充或构建经济学理论

无论从吴承明先生的“经济学之源”角度讨论，还是从前引索洛的宏论分析，经济史研究的最高境界是修正、补充或构建经济学理论。著名经济史学家刘佛丁教授一贯倡导，经济史研究绝不应该是仅仅讲述经济史故事，而应该致力于补充、修正和发现经济学理论的前提假设，即研究经济学理论框架的适用条件，为

当今经济当局实施宏观经济调控政策提供理论依据和剔除前提假设与当前宏观经济运行环境不一致的经济学教条。这一理念和吴老的“源流”之说不谋而合。但是，由于受到诸多条件限制，这一研究导向的身体力行者不多见。

近年来，笔者及所在的团队——广东外语外贸大学中国计量经济史研究中心虽远未到构建理论的境界，但遵循刘佛丁先生的遗训对一些经济学理论发出了质疑和尝试做了粗浅的讨论，成文的浅见主要集中在以下方面（详见油印学术通讯《中国计量经济史研究动态》各期）。

第一，经济史进程中的阶段性特征研究。任何一个经济学理论均产生于特定的历史阶段，而产生于特定历史时期的经济学理论的前提假设（明确的或暗含的）与后来的宏观经济运行环境未必一致或贴近，因此，从先前形成的经济学理论中衍生的经济政策未必都能奏效。我们将近代至今的世界经济史分成三个阶段。

（1）供给约束型经济。这一阶段的特点是“短缺经济”，总供给的物质构成完全与总需求吻合。虽然总需求并不旺盛，但由于供给不足，销售没有任何问题，总需求总是被迫适应总供给。简单地说就是，低下的总产出不能满足消费者低水平的购买。政府若干预经济，一般是压制本来就水平很低的消费，鼓励投资或引进外资。

（2）需求约束型经济。这一阶段潜在总供给能力强大，且总供给的物质构成完全与总需求吻合，只要有订单，厂商就能供给产品，销售成了企业最大的问题。简言之，总供给总是被迫适应总需求。相对来说，只有消费者买不起的问题，而生产一端没有

太大问题。政府管理经济的手段一般是扩大外需和内需，经济政策往往比较奏效，至少在短期内效果显著。

(3) “新供给”约束型经济。这一阶段总供给能力虽强大，但其物质形态与总需求增长不吻合。国内需求只是在旧有的规模上循环，总供给的物质形态不能适应国内需求的增长。国内富裕的消费者不是买不起产品，而是没有什么新产品可以引诱消费者多买。处于这一阶段的国家经济增长只能依赖出口，一旦出口受阻，则 GDP 口径的总产出便陷入低迷状态，一切需求管理的政府经济政策均无显著的正面效果。通过对日本经济泡沫和“失去的二十年”的研究，从主流经济学的政策主张回推，得出了“凯恩斯的有效需求不足实际上是指有效内需不足”的结论。在政策意义上说，就是宽松的财政政策和货币政策不能治理外需不足导致的经济低迷。

我们的研究结论进一步指出，英国在维多利亚时代中期就从供给约束型经济过渡到了需求约束型经济；美国从 1919 年开始，完成了这一过渡；中国自近代至新中国改革开放前期，一直处于供给约束型经济态势下，直至 1995 ~ 1996 年才完成了向需求约束型经济的过渡；日本在 1950 年之后从供给约束型经济过渡到了需求约束型经济，20 世纪 80 年代中期则进入了“新供给”约束型经济。

第二，对某些国际贸易理论的修正。首先，贸易条件学说只适合于供给约束型经济，而在需求约束型经济态势下，已不适合作为考量国际贸易得失的尺度。对于绝大多数处于需求约束型经济态势下的国家（地区）来说，本币贬值虽恶化了贸易条件，却

能改善贸易收支，减少失业和促进投资增长；本币升值虽改善了贸易条件，却恶化了贸易收支，造成国内失业增加和投资下降。最能说明问题的是，在需求约束型经济态势下倾销与反倾销在国际贸易中司空见惯。倾销无疑是倾销国主动恶化贸易条件，但由于在产能巨大的条件下仍可薄利多销，所以很多国家乐此不疲；被倾销国虽贸易条件得到改善，但由于本国产品市场被挤占，则坚决动用关税武器反击。

第三，在需求约束型经济态势下，比较优势理论“ 2×2 模型”无效，自由贸易理论的基石发生松动。在“ 2×2 模型”中，两国都生产自己有比较优势的产品，互相贸易，结果都比没有贸易时的收益大，其中暗含的假设是产品销售没有问题，李嘉图时代的销售也确实问题不大。在当今需求约束型的世界经济中，产品销售是大问题，“ 2×2 模型”必然崩溃。同时，在国家之间时常产生利益冲突、战争不断的前提下，“ 2×2 模型”更难顺畅运行。

第四，对某些货币理论的修正。首先，主流货币理论将货币政策喻为一根绳子，认为“可以用绳子拉车但不可以用绳子推车”，即在萧条时货币政策难以启动经济，必须依靠财政政策。广东外语外贸大学中国计量经济史研究中心的研究结论认为，上述理论源自 1929 ~ 1933 年美国大萧条的特例，不具有一般性。由于胡佛总统固守金本位制，美国的基础货币根本没有供给弹性；由于美国商业银行大量倒闭，“硬件”系统无法使货币乘数运行。因此，问题不在于货币政策的软件本身，而是保证其运行的硬件系统出了问题。大萧条时期，同是需求约束型经济的英国于 1931

年实施了放弃金本位制的货币政策，经济便走出了低谷；处于供给约束型经济态势中的中国于 1933 ~ 1934 年发生了萧条，1935 年放弃了银本位制，经济增长重新开始。英中两国的共同特点是，货币供给有了充分的弹性，且商业银行体系均未遭受美国那样的重创。历史经验表明，货币政策也是可以引导萧条经济走出低谷的，用主流经济学家的话说就是“绳子未必不能推车”。其次，凯恩斯经济学在论述货币政策无效时论证了一个极端的假说——“流动性陷阱”：当市场利率（有价证券收益率）低到不可再低的水平时，公众将不再购买证券，当局无论投放多少货币，均会被货币需求吸收。于是，投资无法增长，经济不会走出低迷。通过逻辑讨论和对美国大萧条案例的分析，广东外语外贸大学中国计量经济史研究中心的研究结论认为，在金本位时期，经济中不存在凯恩斯“流动性陷阱”暗含的两个重要前提假设：其一，货币当局不具有持续增加货币供给量的能力；其二，有价证券市场上也没有一个“至低”的、公众一致不再购买证券的收益率。从逻辑层面分析，若第一个前提假设不存在，使“流动性陷阱”出现的可能性消失了——既然当局不能无限供给货币，那么，“货币需求可以吞噬任何数量的货币供给”就成了纯粹的想象或虚张声势。即使存在第一个假设——当局有无限供给货币的能力，但如果第二个前提假设不存在，“流动性陷阱”也不会出现，最多是有价证券交易量下降，而不会出现无人购买的惨状，宏观角度的短期收入摆布结构依然是货币和证券。从实证角度讨论，大萧条时期的美国货币当局不具有无限供给货币的能力，同时，1932 年国库券到期收益率在 10 ~ 11 月低到了 0.01% 时（股