

计量经济学 ■■■■ ■■■■ 模型方法论

JILIANG JINGJIXUE MOXING FANGFALUN

► 李子奈 等 / 著



清华大学出版社

国家社会科学基金重点项目研究成果
“211”三期重点学科建设项目成果

计量经济学 模型方法论

► 李子奈 等 / 著

清华大学出版社
北 京

内 容 简 介

本书是关于计量经济学模型方法论的研究专著,从哲学、经济学、统计学和数学的基本原理出发,对计量经济学模型的经济学基础、模型设定理论与方法、模型对数据的依赖性、模型应用的功能与局限,以及计量经济学课程建设等重大问题进行了系统、深入的讨论。理论与实际相结合,特别是结合计量经济学模型应用中发生的问题和错误展开研究,采用通俗易懂的表达方式,是本书的一个特色。本书既适用于从事计量经济学理论与应用研究的读者,也可以作为计量经济学课程的教学参考书。

本书封面贴有清华大学出版社防伪标签,无标签者不得销售。

版权所有,侵权必究。侵权举报电话:010-62782989 13701121933

图书在版编目(CIP)数据

计量经济学模型方法论/李子奈等著. --北京:清华大学出版社,2011.6

ISBN 978-7-302-25575-8

I. ①计… II. ①李… III. ①计量经济学—方法 ②计量经济学—数学模型
IV. ①F224.0

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2011)第 095793 号

责任编辑:梁云慈

责任校对:王荣静

责任印制:李红英

出版发行:清华大学出版社

地 址:北京清华大学学研大厦 A 座

<http://www.tup.com.cn>

邮 编:100084

社 总 机:010-62770175

邮 购:010-62786544

投稿与读者服务:010-62776969, c-service@tup.tsinghua.edu.cn

质 量 反 馈:010-62772015, zhiliang@tup.tsinghua.edu.cn

印 刷 者:三河市君旺印装厂

装 订 者:三河市新茂装订有限公司

经 销:全国新华书店

开 本:170×240 印 张:18 插页:1 字 数:304 千字

版 次:2011年6月第1版 印 次:2011年6月第1次印刷

印 数:1~4000

定 价:38.00 元



(一)

本书作为国家社会科学基金重点项目“计量经济学模型方法论基础研究”(08AJY001)和“211工程”三期重点学科建设项目“数量经济学理论创新、模型系统研制与数据中心建设”的研究成果,由我近年来独立完成或者与合作者合作完成的20余篇研究论文结集而成,主要章节是在项目研究期间完成,其中大部分已经公开发表。凡是已经发表的,在题注中注明了首发刊物和时间;凡是与合作者合作撰写的,在题注中列出了作者姓名和排序。在此,对国家社会科学基金和“211工程”的资助表示最衷心的感谢!对首发项目阶段研究成果的《中国社会科学》、《经济研究》、《经济学动态》、《数量经济技术经济研究》、《统计研究》、《中国大学教学》、《清华大学学报》等刊物的支持表示最衷心的感谢!对潘文卿、齐良书、冯燮刚、刘亚清、周建、李鲲鹏、刘晓平、杜聪慧、康赞亮、方征、霍玲等项目组成员和合作研究者的贡献表示最衷心的感谢!还要特别感谢高等教育出版社,在他们出版的《计量经济学(第3版)》中吸纳了项目研究的部分成果,使之能够及时、广泛地应用于教学。

(二)

Econometrics是由挪威经济学家R. Frish于1926年提出的,标志着这个学科的诞生。20世纪70年代末传入我国时,很多人认为应该翻译为“经济计量学”,直到现在这一名称仍然会出现在课程表中 and 教科书的封面上。我们在最早开设该课程时没有拘泥于直译,而将它称为“计量经济学”。理由很简单,希望教师把它作为一门经济学课程去教,学生把它作为一门经济学课程来学。1998年7月,在教育部高等学校经济类学科专业教学指导委员会的第一次会议上,将该课程确定为高等学校经济学门类各专业的共同核心课程,在讨论它的中文名称时,当时的教指委主任吴树青教授征求我的意见,我主张称为“计量经济学”。之后,在正式的行文中,一般采用“计量经济学”。但是,直到现在,将计量经济学建设成

为一门经济学的目标仍然没有实现。国内外的计量经济学教科书都是以模型估计和检验为核心内容；学生掌握了一大堆先进、复杂的模型理论方法，就是不知道如何建立一个正确的应用模型；计量经济学应用研究已经十分广泛，但是大量的问题和错误充斥其中。原因在哪里？对计量经济学模型方法论基础缺乏研究是其中之一。

我从1981年开始因参与当时的国家计委预测中心的工作而接触计量经济学，从1986年开始一直从事计量经济学的教学与研究，也出版了几本计量经济学中、高级教科书，发表了一些理论方法研究和应用研究的论文，但是从未敢称自己为“经济学家”。原因也很简单，因为多年来一直试图回答的两个问题仍然没有明确的答案。一是计量经济学是否是经济学，以及如何才能使之成为真正的经济学？二是计量经济学模型方法是否是科学，以及如何才能使之成为真正的科学？这也是我进行计量经济学方法论基础研究的目的所在，希望能够通过研究找到一些答案。

(三)

2008年寒假期间，为了准备当年春季学期《计量经济学》的第一堂课，我随手拿起一本刚收到的经济学刊物，在这期刊物中共刊载11篇论文，其中8篇是采用计量经济学模型方法的应用研究。这正是说明《计量经济学》课程重要性的很好的例证。但是，当我比较认真地读完这些论文，发现其中5篇在计量经济学模型设定和应用方面存在明显问题。我感到沉重和沮丧。经过一番思考，决定申请当年的国家社会科学基金重点项目，集中进行计量经济学模型方法论基础的研究。该申请虽然属于项目指南外的自选题目，但还是顺利得到批准，表明评审专家们对于问题的重要性具有清醒的认识，更加坚定了我的决心。当然关于这个问题的思考和研究早已开始，本书中关于计量经济学的经济学基础研究的2篇论文分别发表于2005年和2006年；而整个研究框架在2007年发表的“关于计量经济学模型方法论的若干问题”中就已经提出。但是，集中的研究工作仍然是在项目批准之后，既然立项了，就有了动力和压力。所以，将该书作为项目的研究成果，仍然是名副其实的。

同年夏天，我申请了“211工程”三期重点学科建设项目“数量经济学理论创新、模型系统研制与数据中心建设”，并获得批准。按照我国的学科分类，数量经济学包括计量经济学、数理经济学和数量经济学的其他分支，其中计量经济学是主要组成部分。既然计量经济学模型方法论基础研究成为数量经济学理论创新研究的主要内容，那么，本书也是该重点学科建设项目的一项研究成果。

(四)

本书共分七章。

第一章绪论包括2节。“我国计量经济学发展的三个阶段与现阶段的三项任务”是关于我国计量经济学教学、研究与应用的总论。“关于计量经济学模型方法论的若干问题”提出了计量经济学模型方法论基础研究的一个完整的研究框架。

第二章讨论计量经济学的经济学基础。正统经济学贫瘠的理论基础,直接导致计量经济学的方法论混乱——在先验理论导向和数据关系导向之间摇摆。经济学转向主体关系导向,严格遵循经验工具体系可测度的公度性原则,在理论分析上清除本质主义的误导,转向外在于主体的动力学关系分析,为功能强大的计量方法提供可靠的逻辑前提,可实现先验理论导向和数据关系导向的综合。由此,计量经济学将在理论、工具、数据的互动过程中,不断发展,不断融入现实世界,不断深入未知世界。正是基于这一认识,笔者将“正统经济学知识的性质与开放的经济学方法论”和“经济学的关系论转向”作为计量经济学的经济学基础研究成果。

第三章从科技哲学和计量经济学模型发展史两个角度解析计量经济学模型方法体系。“关于计量经济学模型方法的哲学思考”从功能上的检验与发现、认识论上的归纳与演绎、方法论上的证伪与证实,以及应用研究模型设定中的一般与特殊、相对与绝对出发,对体现于计量经济学模型中的哲学范畴进行了讨论,澄清了一些模糊认识。“现代计量经济学模型体系解析”分析了现代计量经济学的各个分支是如何以问题为导向,在经典计量经济学模型理论的基础上,发展成为各个相对独立的模型理论体系,在交叉与综合的方向上提出了现代计量经济学模型理论的研究前沿领域。

第四章“计量经济学模型设定”是本书核心内容,因为计量经济学模型方法的哲学基础、经济学基础、统计学基础和数学基础集中体现于模型设定。在本章中,笔者通过对总体模型设定的研究目的导向、经济学理论导向、数据关系导向的分析评价,提出总体模型设定的唯一性、一般性、现实性、统计检验必要性和经济主体动力学关系导向原则;通过对计量经济学应用模型中的变量性质设定问题的讨论,指出了变量直接影响与间接影响的相对性、内生性和外生性的相对性,以及随机性和确定性的相对性;明确提出了计量经济学模型中源生的随机扰动项和衍生的随机误差项的概念和区别,证明了如果模型存在总体设定误差和变量观测误差,将导致随机误差项对古典假设的违背;阐述了正确设定模型函数关系的重要性,以生产函数模型的发展为例,说明经济行为分析和数据关系分析在模型函数关系设定过程中的作用。

第五章讨论计量经济学模型的数据基础问题,核心是“计量经济学模型对数据的依赖性”一节。该节全面论述了计量经济学模型与数据的关系,从计量经济学模型类型选择、总体回归模型设定、模型估计和模型应用等方面分析了数据的作用,强调了模型对数据的依赖性,指出了容易出现的错误和产生错误的原因。本章还专门对时间序列数据和截面数据的质量诊断理论方法进行了探讨。

第六章讨论计量经济学模型的应用问题。首先对计量经济学模型的功能和局限进行讨论,指出它的“工具性”本质。既然是工具,用得合适,它将发挥巨大的作用;相反,如果运用不当,也会产生欺骗性。从计量经济学模型方法论基础出发,结合模型应用实践,对模型在结构分析、经济预测、政策评价,以及检验与发展经济理论的应用中提出的一些问题和争论进行了理论和实际分析;借以澄清了计量经济学模型在这些应用领域的功能与局限;进而对正确认识和充分发挥计量经济学模型的应用功能提出了一些理论依据和实际建议。然后以假设检验的不对称性为例,说明正确运用计量经济学模型方法的重要性。接下来再以假设检验中的因果关系检验为例,说明计量经济学模型方法的运用是有条件的。

第七章在前面各章关于计量经济学方法论研究的基础上,讨论计量经济学课程建设问题。实际上,在高等教育出版社于2010年3月出版的《计量经济学(第3版)》中,已经融入了方法论基础研究的成果,特别是关于计量经济学模型设定的研究成果。本章收入的“关于计量经济学课程教学内容的创新与思考”和“《计量经济学(第3版)》序言”对此进行了详细的解读。作为本章的附录,介绍了笔者从事计量经济学课程建设与教学的一些体会和认识,藉以与从事计量经济学课程教学的老师们交流。作为最早获得批准的计量经济学国家级精品课程负责人,也有这个责任和义务。

(五)

作为项目研究成果,本书贡献了一些新知。正如全国哲学社会科学规划办公室在“成果验收情况报告”中所引用的鉴定专家的评价,本书“提出了完整的计量经济学模型方法论基础研究框架,是对该领域的奠基性研究”。但是,关于计量经济学模型方法论基础的研究,本书仅仅是开始,也肯定存在问题甚至谬误。欢迎读者通过各种方式提出批评。另外,对于收入本书的已经公开发表的文章,为了真实地体现认识发展过程,保持每节内容的相对完整性,以便于读者选读部分章节,没有进行修改,这也使得书中存在一些前后重复甚至不一致之处,特此说明。

李子奈

2011年1月于清华大学

第一章 绪论	1
第一节 我国计量经济学发展的三个阶段与现阶段的三项任务	1
一、引言	1
二、我国计量经济学迅速发展的原因分析	2
三、我国计量经济学教学与研究的三个阶段	5
四、我国计量经济学教学与研究现阶段的三大任务	7
第二节 计量经济学模型方法论的若干问题	11
一、引言	11
二、计量经济学模型方法的科学性	12
三、模型类型设定对数据的依赖性	14
四、经典模型总体设定的先验理论导向	15
五、时间序列分析模型的数据导向	17
六、模型总体设定的关系论导向	19
七、模型变量设定的相对性	21
八、模型随机扰动项的源生性	22
九、假设检验的不对称性	23
十、计量经济学模型应用的适用性和局限性	25
第二章 经济学的关系论转向——计量经济学的经济学基础	28
第一节 正统经济学知识的性质与开放的经济学方法论	28
一、引言	29
二、正统经济学范式	30
三、正统经济学知识的性质	32
四、经济学本质主义、唯理主义和经验主义的不可能	34

五、开放的经济学方法论与开放的经济学知识体系	36
第二节 经济学的关系论转向	39
一、正统经济学选择理论解构	40
二、行为经济学的描述性选择理论框架	47
三、经济学的关系论转向	51
四、结语	60
第三章 计量经济学模型方法体系解析	61
第一节 关于计量经济学模型方法的哲学思考	61
一、引言	62
二、检验与发现	63
三、归纳与演绎	66
四、证伪与证实	70
五、一般与特殊	74
六、相对与绝对	78
七、结论	81
第二节 现代计量经济学模型体系解析	82
一、引言	82
二、经典计量经济学模型的基础地位	83
三、现代时间序列计量经济学的进步与问题	88
四、基于研究对象和数据特征而发展的微观计量经济学	92
五、关于非参数计量经济学的简要讨论	95
六、基于充分利用数据信息而发展的面板数据计量经济学	96
七、现代计量经济学模型体系的分解与综合	99
第四章 计量经济学模型设定	101
第一节 计量经济学应用研究的总体回归模型设定	101
一、问题的提出及其重要性	102
二、计量经济学模型的总体设定	102
三、计量经济学模型总体设定的“唯一性”和“一般性”原则	104
四、计量经济学模型总体设定的“现实性”原则	106
五、计量经济学模型总体设定的“统计检验必要性”原则	109

六、计量经济学模型总体设定的“经济主体动力 学关系导向”原则	111
七、结论与启示	113
第二节 计量经济学模型变量设定的相对性	113
一、问题的提出	114
二、变量之间的直接影响与间接影响	115
三、变量的内生性与外生性	117
四、变量的随机性和确定性	121
五、结论与启示	123
第三节 计量经济学模型随机扰动项的源生性	124
一、随机扰动项的源生性	125
二、随机误差项的衍生性	126
三、包含模型设定误差的随机误差项	127
四、包含观测误差的随机误差项	129
五、结论与启示	133
第四节 计量经济学应用模型函数关系设定	
——以生产函数模型为例	134
一、模型的关系类型	134
二、模型关系误设的后果	135
三、模型关系设定的指导原则	137
四、模型关系设定检验	137
五、从生产函数模型的发展看计量经济学应用模型函数关系设定 ——以要素替代性质描述为线索的生产函数模型的发展	137
第五章 计量经济学模型与数据	147
第一节 计量经济学模型对数据的依赖性	147
一、引言	147
二、模型类型设定对数据的依赖性	150
三、总体回归模型设定对数据关系的依赖性	152
四、模型估计对数据质量的依赖性	154
五、模型应用对外生想定数据的依赖性	156
六、结论与启示	157

第二节	宏观经济统计数据结构变化分析及其对中国的实证	158
一、	引言	158
二、	宏观经济序列中“异常点”的分类和诊断方法	160
三、	国外的相关研究及其结论	163
四、	中国宏观经济时间序列异常点联合估计诊断及结果分析	164
五、	结论与启示	168
第三节	微观数据质量诊断理论方法综述	176
一、	引言	176
二、	微观截面数据质量的内涵	177
三、	微观截面样本获取的随机性检验	179
四、	异常数据的数据统计诊断	180
五、	异常数据的模型统计诊断	185
第六章	计量经济学模型的应用	192
第一节	计量经济学模型的功能与局限	192
一、	计量经济学模型在结构分析中的功能与局限	193
二、	计量经济学模型在经济预测中的功能与局限	198
三、	计量经济学模型在政策评价中的功能与局限	201
四、	计量经济学模型在理论检验中的功能与局限	206
五、	结论	208
第二节	计量经济学模型假设检验的不对称性	210
一、	引言	210
二、	统计意义和经济意义的不对称性	211
三、	证伪和证实的不对称性	215
四、	犯第一类错误和犯第二类错误的不对称性	216
五、	结论与启示	217
第三节	Granger 因果关系检验的适用性研究	218
一、	问题的提出	219
二、	小样本 Granger 因果检验方法统计量的 分布特征及其性质	220
三、	实例分析	222
四、	结论	223
附录：	从《经济研究》与 AER 发文比较看计量经济学应用	225

第七章 建设中国的计量经济学课程	241
第一节 关于计量经济学课程教学的实践和思考	241
一、关于本科生计量经济学课程的内容体系设计	242
二、关于本科生计量经济学教材建设	245
三、关于本科生计量经济学教学研究	246
四、关于本科生计量经济学教师的知识结构	247
五、关于本科生计量经济学课程的中国化	248
第二节 关于计量经济学课程教学内容的创新与思考	250
一、问题的提出	250
二、计量经济学课程教学内容创新的方向	252
三、计量经济学课程教学内容创新的实质性一步	255
四、结论	258
附录 1:《计量经济学》(第 3 版)序言	258
附录 2:《计量经济学》(第 2 版)序言	263
附录 3:如何才能讲好《计量经济学》课程	269

绪 论

第一节 我国计量经济学
发展的三个阶段与现阶段的三项任务^①

【内容提要】

本节指出计量经济学的迅速发展是 30 年来我国经济学发展的显著标志之一,从六个方面分析了原因。将我国计量经济学教学与研究的发展历程划分为三个阶段,即推广普及阶段、教学的提高与应用研究的推广阶段,以及目前的发展与创新阶段。提出了目前阶段的三个任务,即加强理论研究,提高应用研究的水平和发展中国的计量经济学课程。因此,本节既是关于我国计量经济学教学、研究与应用总论,也是关于计量经济学模型方法论研究的基础、条件和重要性的总论。

一、引言

改革开放 30 年来,我国的经济学发生了深刻的变化,其中计量经济学的发展是一个显著的标志。可以用以下几组数据加以佐证。

^① 本节基本内容发表于《经济学动态》2008 年第 11 期,《新华文摘》2009 年第 2 期转载,并收入《中国数量经济学 30 年》一书,系笔者为 2008 年 9 月召开的“中国经济学教育第三届年会”准备的论文,该年年会的主题为“中国模式与中国经济学发展——改革开放 30 周年回顾与展望”。

根据我们的历次调查,高等学校财经类(1992年以后的经济类)专业开设《计量经济学》课程的比例:1980年为0%,1987年为18%,1993年为51%,1997年为92%,2006年为98%。尽管由于调查的范围和抽样方法不同,会有一些偏差,但大体上反映了各个时期计量经济学课程在高校的普及程度。计量经济学已经成为我国高校经济类各专业学生的一门核心课程。

根据我们对1984—2007年《经济研究》发表的3300余篇论文进行的统计分析,以计量经济学模型方法作为主要分析方法的论文占全部论文的比例,1984年为0%,1992年为5%,1998年为11%,然后迅速提高,2004年为40%,2005年为56%,2006年、2007年均均为53%。^①而且研究对象遍及经济的各个领域,所应用的模型方法遍及计量经济学的各个分支。其他经济类刊物,例如《金融研究》、《世界经济》等,无不如此。毫无疑问,在我国,计量经济学模型已经成为经济理论研究和实际经济分析的一种主流的实证研究方法。

根据我们所了解,我国数量经济学(它的核心部分是计量经济学)博士学位学科点的数量,从1984年的1个、1993年的2个、1998年的7个,发展到2004年的18个和2006年的25个(与金融学博士学位学科点的数量相同,在经济学门类中处于前列)。如果加上设置计量经济学研究方向的其他学科点,例如管理科学与工程和应用经济学的其他二级学科,数量将成倍增加。可见,计量经济学是30年来我国经济学科中发展最为迅速的一个新生长点。

二、我国计量经济学迅速发展的原因分析

为什么计量经济学在我国经济学科中得到如此迅速的发展和占据如此重要的地位?主要有以下几个原因:

第一,计量经济学理论的科学性和计量经济学模型在经济实证研究中的不可或缺性。任何科学研究,不管是自然科学还是社会科学,甚至人文科学,都遵循以下过程:首先是观察,关于偶然的、个别的、特殊的现象的观察;其次是提出假说,从偶然的、个别的、特殊的现象的观察中,提出假说,或者是理论,或者是模型,这些假说是关于必然、一般、普遍现象而言的;然后需要对假说进行检验,检验方法一般包括实验方法、预测方法和回归方法;最后是发现,关于必然、一般、普遍的规律的发现。在经济研究中,如果假说(理论或者模型)完全依赖于观察而提出,

^① 这个比例已经超过美国同类刊物《美国经济评论》(*American Economic Review*, AER)同期的水平。AER每年所发表的计量经济学理论与应用研究论文占全部论文的比例,从1984年的23.5%,到2004年的40.4%,然后基本维持这个比例。

不附加任何价值判断,然后对理论或者模型进行检验,这一研究过程被称为实证研究。实证研究包括理论实证和经验实证。在经济研究的检验阶段,经验实证分析是科学和便捷的。经济问题无法进行实验,人们不可能构建一个与偶然的、个别的、特殊的现象发生时完全相同的实验平台,进行重复的实验,以检验现象发生的必然和普遍性。根据假说对未来进行预测,然后与真实的“未来”进行比较,以检验假说的正确性,当然是可行的,但并不便捷。对已经发生的经济活动进行“回归分析”,发现其中的规律,并用以检验假说,是最可行的方法。所以说,回归分析在经济研究中是不可缺少的。而计量经济学,说到底就是回归分析。

第二,对经济学本质认识的转变巩固了计量经济学的地位。经济学是什么?马克思主义经济学和西方经济学的经典著作和教科书中都有各自的定义。但是,从20世纪中期开始,人们将经济学的本质的认识扩展了。经济学是一种思考社会问题的方法,是一套用以观察无限丰富和多变的世界的工具,经济学的主要贡献是它的分析框架,在现代西方经济学的教科书中已经形成一种普遍的认识。同样,不少学者也从方法论的角度定义马克思主义经济学,认为它“是一种认识经济世界的方法”,“首先是一门实证科学”。^①当然,西方现代经济学的“分析框架”和马克思主义经济学的“认识方法”在理论层面上是有本质区别的,但是在方法层面上存在共通之处。在这种认识指导下,经济学方法论的科学性受到前所未有的重视,实证经济学得到前所未有的发展,计量经济学更加巩固了它在经济学中的地位。

第三,适应社会需要。我国的经济体制改革和经济发展面临许多重大的经济理论问题和政策选择问题。如何才能减少理论错误和政策失误?一切经过试验,这是我们一直采用的行之有效的办法。但是,许多经济理论和经济政策是无法通过实践试验的,这是人们共知的一个常识。诸如,人民币汇率的调整会对国内的通货膨胀产生多大的影响?法定准备金率的变化会引起货币供给量多大的变化?某项“救市”政策措施的出台能否起到救市的效果?这些都无法进行试验,都是“一锤子买卖”,失误当然在所难免。一个已经被证明是成功的办法,是采用计量经济学模型,建立用于进行理论与政策试验的实验室。实践中不可试验的,可以在模型中方便地进行。

第四,培养创新型经济学人才的要求加强了计量经济学在经济学课程体系中的地位。为了培养创新型经济学人才,我们应该教给学生什么?是已经产生的知识,还是产生知识和发展知识的方法论?知识,有些已经过时,有些即将过时;而

^① 张宇、孟捷、卢荻主编.高级政治经济学(第二版)[M].北京:中国人民大学出版社,2006:24.

产生知识和发展知识的方法论,则是永存的。于是,计量经济学成为培养经济学人才所必需的知识基础、方法论基础和能力基础的最重要的课程。同时,掌握了计量经济学模型方法的人才也受到社会的普遍欢迎。例如,曾经有一篇关于某财经类大学研究生就业统计的报道,该校3年平均毕业生供需比排列于第一位的专业是数量经济学,硕士生为1:29,博士生为1:9,均列所有专业之首。在国家综合经济管理部门、金融机构的招聘中,越来越多的单位明确提出需要计量经济学专业人才。^①

第五,适应提高我国经济学学科水平的需要。笔者曾在较早的一篇论文中提出,经济学有没有“世界先进水平”?没有,又有。讲没有,主要指经济学理论与政策。各国国情不同,能够正确指导本国经济发展的理论就是先进的理论,能够正确调控各个时期经济协调发展的政策就是先进的政策。不存在也不应该存在所谓具有“世界先进水平”的经济学理论与政策。讲有,是指经济学研究方法、经济分析方法和经济决策方法。而在这个方面,我们落后了,而且落后了许多。其中最重要的,就是实证研究方法,而计量经济学模型方法就是最主要的经验实证研究方法。^②

第六,具有良好的发展环境。伴随我国改革开放的30年,关于什么是我国主流经济学的争论从来没有停止,而计量经济学虽然作为西方现代经济学体系中的重要组成部分,却是可以置身于争论之外。因为计量经济学模型是经验的,而不是先验的。作为一门经济学的分支学科,计量经济学也具有社会属性,但它的社会属性来自于实践,而不是来自于价值判断。例如,研究同样的经济问题,在我们的模型中就可能包含显著的反映制度因素的变量,但是,它的显著性是经验检验的结果。正因为此,在经济学界关于中国主流经济学的讨论中,比较一致的意见是,“传统社会主义经济学在数学方面用得不够,只注重定性分析而缺少对现实问题的定量分析,这是需要加强的。”^③甚至在“坚决反对把西方经济学作为中国经济学的主流”的同时,也提倡“应积极借鉴西方经济学的一些科学方法”。^④ 这些就为计量经济学的发展创造了良好的环境。

由于上述原因,计量经济学自20世纪70年代末80年代初进入我国之后,迅速为我国经济学界广泛接受,使得我国的经济学教学与研究发生了深刻的变化。

① 《光明日报》2003年5月15日。

② 李子奈.我国经济学研究如何达到世界先进水平[J].数量经济技术经济研究,1994(1).

③ 《光明日报》2004年9月6日文章:主流经济学须不断创新。

④ 《人民日报》2004年11月25日文章:中国经济学的发展方向。

我国近 30 年来计量经济学的教学与研究大体经历了以下三个阶段,现在已经进入第三个阶段。

三、我国计量经济学教学与研究的三个阶段

第一阶段从 20 世纪 80 年代初至 90 年代中后期,为推广普及阶段。其开始的标志是 1979 年 3 月中国数量经济学会的成立和 1980 年夏由中国社会科学院邀请克莱因教授等世界著名计量经济学家在北京举办的计量经济学讲习班;其结束的标志是 1998 年 7 月教育部高等学校经济类学科专业教学指导委员会将《计量经济学》确定为高等学校经济学门类各专业的共同核心课程。

世界计量经济学会于 1930 年成立,被认为是计量经济学作为一个学科正式诞生的重要标志之一。同样,中国数量经济学会的成立,也是中国数量经济学科诞生的一个标志。一批在计量经济学领域有相当造诣,且具有远见卓识的经济学家,虽然人数不多,但以中国数量经济学会为平台,成为我国计量经济学发展的开拓者和奠基人。

克莱因教授等 7 位世界著名计量经济学家 1980 年夏在北京举办计量经济学讲习班,长达 40 余天,参加者达 100 余人,应该是我 国计量经济学教学与研究发展历史上的一个重要事件。1980 年以前,虽然我国已经有多位经济学家在推动计量经济学教学与研究方面做了大量工作,但是,计量经济学仍然是经济学中一个鲜为人知的分支。计量经济学讲习班的举办,是计量经济学理论在我国的第一次全面的介绍和推广。参加讲习班的中国学者,大多数都成为我国计量经济学发展的骨干。当年 10 月,克莱因教授获得了诺贝尔经济学奖,在他接受奖项时,专门提到“将现代计量经济学引入中华人民共和国”。这更使得讲习班成为一个引人注目的事件,扩大了它的影响。

20 世纪 80 年代初期到中期,少数高等院校经济类专业开设了比较完整的计量经济学课程,国内学者开始编写计量经济学教科书。根据不完全调查,高等学校财经类专业开设《计量经济学》课程的比例从 1980 年的 0% 上升到 1987 年的 18%,到 90 年代初期达到 50% 左右。

20 世纪 80 年代初期,以研究和编制 2000 年发展规划为契机,一部分研究机构和综合经济管理部门开始应用计量经济学模型方法。80 年代中后期,研制国家和地区的宏观经济模型,曾经形成热潮。特别是从 1990 年开始,中国社会科学院召开每年的经济形势分析预测会,发布经济形势分析预测报告,出版“中国经济形势分析与预测”蓝皮书,极大地推动了计量经济学应用模型研究的开展,在国内外产生了重大的影响。