

我国计量经济学发展的三个阶段与现阶段的三项任务

■ 李子奈

(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。

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—2006 年《经济研究》发表的 3100 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 为 56%,2006 年为 53%。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。其它经济类刊物,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它学科点,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的发展和占据如此重要的地位?主要有以下原因:

第一,计量经济学理论的科学性和计量经济模型在经济实证研究中不可或缺性。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的方法、预测的方法和回归的方法;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,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检验实证。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。对于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,认为她“是一种认识经济世界的方法”,“首先是一门实证科学”。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方法。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,都是一个“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须的知识基础,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,2003 年 5 月 15 日《光明日报》曾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。

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曾经提出,经济学有没有“世界先进水平”?有,又没有。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,就是实证研究的经验实证研究方法。(李子奈,1994)

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。”(《光明日报》2004 年 9 月 6 日文章“主流经济学须不断创新”)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”。(《人民日报》2004 年 11 月 25 日文章“中国经济学的发展方向”)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。我国近三十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 余人,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。根据不完全统计,高等学校财经类专业开设《计量经济学》课程的比例从 1980 年为 0%上

升到 1987 年为 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,发布经济形势分析年预测报告,出版《中国经济形势分析与预测》兰皮书,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。

1993 年 11 月党的十四届三中全会确立了我国经济体制改革的社会主义市场经济体制目标模式,以及全球化信息化潮流,对高校经济类专业的教学产生了很好的指导作用。1997 年 3 月进行的调查显示,在设置经济类专业的高校中,92%的学校开设了计量经济学课程,其中 88%为必修课程,平均学时为 54 学时。

原国家教委于 1996 年启动了“高等教育面向 21 世纪教学内容和课程体系改革计划”,在 1996 年 7 月确定的经济管理类 20 项重点研究项目中,包括“经济管理学专业数量分析系列课程设置和教学内容研究”。通过对现状的调查分析、对需求的调查分析,以及对发达国家经济类专业数量分析系列课程设置的调查分析,同时开展了大范围的讨论,于 1997 年 9 月提出了我国高校经济类专业数量分析系列课程设置建议。建议将经济学类本科生数量分析类课程分三个层次设置,即核心课程、必修课程和选修课程,《计量经济学》应该列入经济类专业核心课程。

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《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。这是我国经济学教学走向现代化和科学化的重要标志,对我国经济学人才培养质量产生了重要影响,也标志着计量经济学在我国得到推广普及。

第二阶段从 1998 年至本世纪前十年中期,为计量经济学教学的提高阶段和应用研究的推广阶段。其开始的标志是核心课程的确立,结束的标志是 2006 年 7 月,世界计量经济学会首次在中国大陆举办全球性国际学术会议。

本科生计量经济学课程的普及,为研究生计量经济学高级课程的开设创造了条件。20 世纪 90 年代后期,随着一些计量经济学高级课程教科书的引进,以及国内学者编写的高级计量经济学教科书的出版,真正意义的计量经济学高级课程在高校经济学科研究生中开始开设。2000 年和 2003 年诺贝尔经济学奖分别授予在微观计量经济学、现代宏观计量经济学和金融计量经济学领域做出突出贡献的计量经济学家,对我国计量经济学高级课程的教学无疑是巨大的推动力。据 2006 年 10 月召开的全国数量经济学专业博士生培养研讨会的交流,在博士研究生的课程表中,各个学校都将高级计量经济学放在突出的位置上,有的学校开设了多门,最多的开设了 6 门计量经济学高级课程。

研究生计量经济学高级课程的开设,也推动了本科生计量经济学课程内容的改善和教学水平的提高,特别是在基础和前沿的结合、理论与应用的结合方面取得了显著的进步,建设了若干门国家级和省级精品课程。2006 年的调查显示,98%的高校在经济类专业开设计量经济学课程,其中全部必修 69%、部分必修 36%、全部选修 3%,这个数据与 1997 年调查差别不大。但是,在课程内容方面有了显著的改善,100%的学校包括经典单方程线性模型,73%的学校包括经典联立方程模型,

40%的学校包括常用的应用模型,26%的学校包括时间序列分析模型,15%的学校包括微观计量经济学模型。

在这个期间,计量经济学模型在我国经济理论研究和经济问题分析中被迅速广泛采用。如前所述,在我国经济类学术刊物上,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,迅速提高,50%以上。这个比例已经达到美国同类刊物,例如《美国经济评论》(<American Economic Review>)同样的水平。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。计量经济学模型已经成为我国经济研究的一种主流的实证研究方法。更为重要的是,计量经济学模型成为综合经济管理部门和经济类研究机构分析经济形势、研究实际经济问题和制定经济政策的常用工具,提高了经济预测和决策的水平。

2006 年 7 月,世界计量经济学会首次在中国大陆举办全球性国际学术会议,来自 37 个国家和地区的近 500 位学者参加了会议,其中近 50 名中国大陆学者的论文通过统一标准的评审入选。在东京和其它几位学者曾于 1987 年参加了由日本举行的世界计量经济学会国际学术会议,被当时的世界计量经济学会会长称为来自中国大陆的学者第一次参加计量经济学会的国际学术会议。事隔近 20 年,在中国大陆举办如此高水平的全球性国际学术会议,表明了我国计量经济学教学水平提高和应用研究的广泛开展。

从近两广开始,可以认为我国的计量经济学教学与研究进入了第三阶段,不妨称为发展与创新阶段。这一阶段的主要任务是,加强理论研究,提高应用研究的水平,发展中国的计量经济学课程。

(四)我国计量经济学教学与研究现阶段的三大任务

1、加强计量经济学理论方法的研究与创新

计量经济学理论方法的发展,从经典到现代,已经形成了广泛的内容体系。在我国计量经济学发展的前 20 年中,我国的学者一直处于学习和跟踪的地位,而且人数极少。即使是该专业的博士研究生,选择模型理论方法作为论文选题的也不到 10%。在这个方面,我们与国际前沿水平差距甚远。近些年来,随着一些在理论计量经济学领域有成就的海外学者和一批在海外受到良好训练的年青学者回国,以及国际学术交流的广泛开展,情况正在改变。计量经济学理论的研究,既是学科发展的基础,又是学科水平的体现,只有加强理论研究,产生一批原创性成果,我们才可能融入世界计量经济学主流。这应该成为本阶段的任务之一。

问题在于从何处着手?翻开国际上“权威”的计量经济学学术刊物,在产生一种畏俱感的同时,我们不仅要问:什么是计量经济学理论方法的创新性研究?我国计量经济学理论方法研究与创新的方向是什么?综观计量经济学理论发展的历史,不难发现它是以问题为导向的,新的问题出现了,研究这些问题的理论方法就随之发展了。现代计量经济学理论的重大发展尤其是这样。赫克曼因为发现了样本大数的选择性及其对经典计量经济学模型的影响,发展了选择性样本模型的理论方法;麦克拉登研究选择结果与影响因素之间的关系,发展了离散选择模型的理论方法;格兰杰发现非平稳时间序列之间容易产生伪回归,进而发展了如何检验时间序列的平稳性以及如何在非平稳时间序列之间建立结构模型的理论方法。这些获得诺贝尔经济学奖的重大创新性成果,无一不是以问题为导向而产生的。中国经济的持续稳定发展,已经使关于中国经济的研究逐渐成为国际主流经济学中的一部分。中国经济发展的特殊性和数据的特殊性,也为计量经济学理论方法的创新提出了许多新的问题。例如,经济发现在时间序列上的结构变化特征,个体行为在同一时间截面上的极大的差异性,选择行为的非理性,等等。抓住这些问题,在解决问题的过程中发展理论方法,应该成为我国计量经济学理论研究的主要方向。

2、提高计量经济学应用研究的水平

在计量经济学应用研究已经广泛开展的今天,提高应用研究的水平已经刻不容缓。目前,错用和高用计量经济学模型的现象不断发生,甚至较为普遍。错用的结果是“自欺欺人”。滥用的结果是“自娱自乐”。如何提高计量经济学应用研究的水平?这个问题已经严肃地提出。否则,有可能影响人们对计量经济学的热情和信心,甚至葬送计量经济学发展的大好局面。

究其原因有许多,其中重要一条是对计量经济学模型的方法论基础缺乏深入研究和正确理解。包括计量经济学模型的哲学基础、经济学基础、数学基础和统计学基础。具体问题包括计量经济学模型方法的科学性,模型类型对数据的依赖性,模型总体设定的经济关系导向,模型变量设定的相对性,模型随机扰动项的源性生性,假设检验的不对称性,以及模型应用的局限性等问题。(李子奈,2007;洪永淼,

2007)所以,开展关于计量经济学模型方法论基础的研究,对于提高应用研究的水平,是十分重要和急迫的。而其中最重要的,是正确设定总体模型。(李子奈,2008)

研究重要问题,采用正确的模型方法,争取有所发现,应该成为计量经济学应用研究的指导原则。研究重要问题,是不言而喻的问题。在于,什么是重要问题?西方主流经济学刊物所偏好的问题,我们需要关注,也需要研究。但是,我们应该将更多的注意力放在我国改革和发展所面临的重要现实问题上来。采用正确的模型方法,就需要我们根据研究的问题和数据特征,在参考国外已经发展的模型方法的基础上有所发展和创新。争取有所发现,就是要通过计量经济学模型方法发现人们通过一般观察和定性分析难以发现的规律。如果建立了计量经济学模型,经过复杂的估计和检验过程,最终发现了或者验证了人们所熟知的结论,那么研究的价值就大打折扣了。

微观经济社会领域应该是需要着重拓展的计量经济学应用研究领域。从经济类学术刊物论文的统计分析中,我们发现,已有的计量经济学应用研究,我们集中于宏观经济和金融市场领域,各占 30%以上。原因有二:一是宏观经济和金融市场确实是我国经济发展中最受人们关注的领域,应该研究;二是关于宏观经济和金融市场的数据比较容易获得,方便研究。党的十七大提出了以科学发展观为指导,构建和谐社会的目标任务,而抓住民生问题,也就是抓住了构建和谐社会的根本和切入口。所以,以民生问题为研究主题,健康问题、教育问题、安全问题,甚至包括家庭问题、婚姻问题等,都会逐渐成为解决了温饱的人们所关注的热点问题,都应该成为计量经济学应用研究的重要课题。困难在于微观数据的缺乏。所以,微观经济社会数据的采集和数据质量的诊断,以及数据资源的共享,成为当前我国计量经济学应用研究的关键之一,需要我们共同努力。

3、发展中国的计量经济学课程

计量经济学作为一门与现代西方主流经济学课程体系最为接轨的课程,是否需要“中国化”?对于这个问题的回答,必须追溯到计量经济学的课程性质,即它是经济学课程还是应用数理统计学课程?无论从计量经济学的定义和研究对象,还是它在经济学科中的地位,都表明它是经济学科的一个分支,是一门经济学课程,更具体一点说,是一门经济学方法论课程。既然是经济学课程,就具有它的社会属性,就存在需要中国化和可以中国化的问题。将计量经济学看成为一门“纯方法”课程,是一种误解。“方法论”不同于“方法”,经济学方法论,显然是建立在经济学理论基础上的。例如,回归分析是一种“方法”或者“技术”,但是以回归分析作为分析技术的经典计量经济学模型,则属于方法论范畴。发生在 20 世纪 70 年代的对经典计量经济学模型的“卢卡斯批判”,并不是对回归分析的批判,实质上是对模型总体设定先验理论导向的批判,是对 30 年代至 60 年代占主流地位的凯恩斯宏观经济理论的批判。

第一,将计量经济学模型的总体设定由先验理论导向和数据导向转向主体关系导向(或关系论导向)。计量经济学应该把经济系统的主体动力学关系分析作为自己的任务,在此基础上进行计量经济学模型的总体设定。这样的模型才可能是建立在中国的计量理论和经济现实基础之上的模型,而不是“借人家的坛子装我们的酒”。那么,计量经济学课程就不能只讲模型的估计和检验,应该讲授如何在经济理论的指导下分析经济关系,如何利用经验数据检验经济关系,进而进行模型总体设定。

第二,将数据的分析和诊断引入计量经济学教学内容体系。在中国,数据资源的质量和数量都制约着计量经济学模型的发展与应用,计量经济学不能等着别人提供符合要求的数据,应该将数据的收集、分析与诊断作为自己的任务。什么类型的模型才能适合特定类型的数据?数据是否具备模型所要求的完整性、准确性、可比性和一致性?如何诊断时间序列数据中的结构变化和截面数据中的奇异点?等等。计量经济学课程应该将这部分作为它的教学内容。

第三,模型的应用和应用模型的教学应用应该有所侧重。计量经济学模型作为一类经济数学模型,是从用于经济预测发展起来的。但是从计量经济学模型的方法论基础可以看到,经济预测很难成为为计量经济学模型的主要应用领域,因为“成功的预测所依赖的必须是‘覆盖性的法则’”,而“计量经济学并不企图发现覆盖性的法则,只是试图寻找不明显的规律”。(K.D.Hoover,1997)相对于具有“绝对性”要求的经济预测,计量经济学模型对于具有“相对性”或者称为政策实验,包括宏观和微观,应该成为计量经济学模型的主要应用领域。在中国尤其是这样,因为我们的政策是有效的和变化的。计量经济学课程的内容应该据此做出相应的调整。

关于计量经济学课程的中国化,或者说发展中国的计量经济学,是一个很大的课题,这里只是提出一点初步认识,以期引起关注和讨论。