

第一章

导 论

第一节 经济学实证方法的研究背景

经济学作为一门研究资源配置、生产、交换、分配和消费等经济活动的社会科学,长期以来在理论推导和学术探讨中占据了重要地位。传统的经济学研究方法主要依赖于理论模型的构建和演绎推理,以揭示经济现象的内在规律。然而,随着社会经济环境的不断变化,单纯的理论推导已经无法完全满足现实问题的需求。尤其在 globalization、信息化、技术进步等背景下,经济学的研究开始面临更为复杂且多样化的现实问题,亟须通过实证研究来验证理论假设、解释实际现象、解决实际问题。实证研究方法在经济学中的应用,成为近年来学术界广泛关注的焦点。通过实证数据的收集与分析,经济学家可以检验理论假设的有效性,识别经济现象背后的因果关系,并为政策制定和实践提供科学依据。因此,实证研究方法在经济学中的意义和必要性愈加突出。

经济学实证研究方法是指通过收集、分析和解读实际经济数据,来验证、检验或推翻经济学理论假设的一种研究方法。与基于逻辑推演和数学模型的理论研究不同,实证研究依赖于观察现实经济现象,并通过数据分析来揭示因果关系、评估政策效果、推断行为模式等。它不仅可以帮助经济学家检验现有理论,还可以为政策制定和商业决策提供科学依据。实证研究通常采用以下几种方法。

统计分析:利用统计工具和方法分析大量经济数据,揭示变量之间的关系。

实验研究:通过设计实验和设置对照组来控制外部因素,模拟经济现象的真实环境,验证假设。

计量经济学模型:通过构建数学模型来量化经济关系,使用回归分析等方法来推断变量之间的因果关系。

第二节 经济学实证方法的研究意义

在经济学研究中,实证方法不仅是理论检验的重要工具,更是连接现实经济问题与政策建议的关键桥梁。随着数据可得性提升与计量技术不断发展,实证方法的科学性、规范性与创新性在推动经济学知识积累和实践中发挥着日益重要的作用。因此,深入探讨

经济学实证方法的理论基础与应用价值,具有重要的学术意义和现实启示。

第一,理论验证与修正。经济学理论的发展离不开实证研究的支持。通过收集和分析经济数据,研究人员可以检验已有经济理论是否在现实中成立,是否能够预测实际经济现象。这种验证过程不仅能够帮助我们确认哪些理论假设是有效的,还能揭示哪些理论需要修正或完善。例如,传统的供求关系理论可能未必适用于所有市场情境,通过实证研究,学者可以识别出不同市场结构下供求关系的差异,从而推动理论的发展和修正。

第二,现实问题的解决。经济学实证研究不仅限于理论推导,它还为解决现实经济问题提供了强有力的工具。在实际政策制定过程中,政府和企业常常需要依赖实证数据来决策。例如,如何通过税收政策促进绿色创新,如何调整货币政策以刺激经济增长等问题,都需要基于实证研究来进行深入分析和预测。通过科学的实证研究,可以有效地规避政策决策中的偏误,提高政策的精准性与有效性。

第三,提升学术研究的可靠性与严谨性。实证研究方法使得经济学研究能够从抽象的理论推导转向更具客观性和实用性的研究方向。通过规范化的数据收集与分析过程,实证研究能够消除理论研究中的假设偏差,确保研究结论的科学性和可靠性。同时,实证研究有助于推动经济学的研究方法从定性分析向定量分析转变,为学术界带来了更加严谨的研究标准。

第四,促进跨学科与国际合作。经济学实证研究往往依赖于大量的跨学科知识,如统计学、计量经济学、计算机科学等。此外,随着全球化的发展,许多经济问题具有国际性和跨国性。因此,实证研究也推动了不同学科和不同国家之间的合作。例如,全球气候变化、国际贸易等问题,都需要各国学者通过跨国数据的比较与实证分析,寻找解决方案。

第三节 经济学实证方法的应用案例

经济学实证方法的应用广泛且多样,不仅可以帮助学者验证理论,也能够为政策制定者提供科学依据。以下按照不同的经济学大类,结合中国的实际情况,介绍一些典型的实证研究案例,帮助读者理解这些方法如何在中国的经济环境中得以应用。

一、劳动经济学：最低工资与就业的关系

中国自 20 世纪 90 年代起逐步实施最低工资制度,尤其是在沿海地区和大中型城市。最低工资政策的目的是保障低收入群体的基本生活水平,但其对就业和企业用工的影响成为学者研究的热点。最低工资政策的核心目的是提高低收入群体的收入水平,减少贫富差距。然而,最低工资政策是否真的能够提高低收入群体的生活水平,是否会对就业、企业经营及整体经济产生预期之外的负面影响(如就业减少、劳动力成本提高等),需要通过实证研究进行检验。

为评估最低工资政策的效果,研究人员通常会收集实施最低工资前后各地劳动市场的数据,并使用回归分析等计量经济学方法控制其他可能影响劳动市场变化的因素。例如,研究人员可能会分析最低工资调整对不同地区(如东部沿海地区与中西部地区)就业率、收入

水平、企业用工成本等的影响,尤其是对低收入群体的收入增长效果与就业稳定性的影响。

这一实证研究帮助政策制定者更好地理解最低工资政策对劳动力市场的多维度影响,为制定更为精细化的政策提供有力的数据支持。

二、环境经济学：环境政策与企业绩效

随着中国环保政策的日益严格,企业在面临环境规制时的表现和经济后果成为重要的研究领域。如何评估环保政策对企业经营效益和社会福利的影响,是环境经济学中的一个核心问题。

以“双碳”政策对中国制造业企业的影响为例,中国提出的“双碳”目标意味着到2030年中国的碳排放将达到峰值,并力争在2060年实现碳中和。这一政策目标对所有行业均产生了深远的影响,特别是对制造业的冲击最为显著。制造业作为中国经济的重要支柱,是碳排放的主要来源之一,因此必须采取有效的减排措施以达到政府的环保要求。在此背景下,实证研究通过分析“双碳”政策的实施对制造业企业的影响,帮助学者、政策制定者和企业管理者了解这一政策对经济绩效、企业创新、投资决策等方面的实际影响。

这一实证研究为政府进一步完善环保政策提供了重要参考,表明在推动绿色发展的过程中,需要平衡环境保护与企业竞争力之间的关系。

三、金融经济学：金融发展对经济增长的作用

中国的金融市场经历了快速发展,从银行体系的改革到资本市场的开放,金融对经济增长的影响成为学者关注的焦点。如何通过实证研究分析金融发展是否促进了经济增长,是金融经济学的一个重要问题。

以金融改革与中国经济增长的关系为例,中国的金融改革自改革开放以来经历了多个阶段,从初步的金融体制改革到近年来的全面金融市场化改革,每一步都深刻影响着中国经济的增长和结构调整。金融体系的完善与创新不仅有助于提高资本配置效率,还能有效引导资金流向关键领域和行业,从而推动经济增长和产业升级。实证研究通过量化分析金融改革对中国经济增长的具体影响,帮助学者和政策制定者深入理解这一关系。实证研究通常会利用面板数据回归分析等方法,通过对不同时间段和不同地区金融改革进程的比较,分析金融市场的发展如何促进或制约经济增长。例如,考察金融市场开放程度、银行信贷政策、股市发展等因素如何影响企业的融资能力、投资决策及生产效率。

这一实证研究揭示了金融市场在经济发展中的关键作用,也为进一步深化金融体制改革、完善资本市场功能提供了实证依据。

四、国际贸易学：贸易自由化与经济增长

中国的对外开放政策,尤其是加入世界贸易组织(WTO)后的贸易自由化进程,极大地促进了中国经济的快速增长。这一历史性的举措不仅推动了中国与全球经济的深度融合,也对中国制造业的出口产生了深远的影响。加入WTO后,中国的贸易壁垒逐步降低,关税

大幅减少,且市场准入条件放宽,这为中国制造业打开了广阔的国际市场。随着外部市场的开放,中国制造业迎来了出口的快速增长,而实证研究通过分析这一时期的相关数据,揭示了中国加入 WTO 对制造业出口的具体影响。如何评估贸易自由化对中国经济的影响,成为国际贸易领域的重要实证研究课题。

以中国加入 WTO 对制造业出口的影响为例,通常采用双重差分法,通过对比加入 WTO 前后中国制造业出口的变化,识别政策实施前后的经济效应。还可采用行业面板数据,通过分析不同产业、地区及企业的出口表现,探讨国际市场开放对出口能力的影响。

这一实证研究为理解全球化背景下的国际贸易政策对国内产业的影响提供了实证支持,揭示了中国如何通过开放市场,提升国际竞争力。

五、公共政策：社会保障与收入分配

随着中国经济的快速发展,城乡收入差距问题成为社会关注的重点。为了缓解这一问题,政府逐步加强了社会保障制度的建设,特别是农村地区的社会保障体系。社会保障制度通过提供医疗保险、养老保险、失业保险等保障,旨在提高低收入群体的生活水平,减少社会不平等。实证研究通过分析社会保障政策对城乡收入差距的影响,揭示社会保障在缩小贫富差距、促进社会公平方面的作用。

以社会保障对城乡收入差距的影响为例,研究社会保障对城乡收入差距的影响,通常采用面板数据回归分析、双重差分等实证方法,比较不同地区在实施社会保障政策前后的收入变化。

这一实证研究帮助政策制定者评估社会保障政策的成效,并为进一步完善社会保障制度,减少收入不平等提供了重要的参考数据。

经济学实证研究方法广泛应用于各个领域,为理解复杂的经济现象、制定有效的政策提供了宝贵的经验与数据支持。通过分析中国的具体案例,能够看出,实证研究不仅帮助验证经济学理论的适用性,也为政策调整和优化提供了强有力的科学依据。

第四节 经济学实证方法的研究流程

经济学的实证研究方法并非一蹴而就,而是遵循一定的研究逻辑和流程。以下是实证研究的基本步骤:

第一,明确研究问题。选择一个具体的经济学问题或现象,明确研究的目的和假设。例如,研究某一经济政策的效果,或者某一经济行为的规律。

第二,收集与整理数据。通过实验、调查、统计数据等方式,收集相关的经济数据。这一过程可能涉及大量的前期工作,如确定数据来源、清洗数据、确保数据的可靠性和有效性。

第三,模型构建与分析。根据研究问题,选择合适的理论模型或计量模型,并对数据进行统计分析。常用的方法包括回归分析、双重差分方法、面板数据分析等。

第四,结果的解释与政策建议。通过实证分析得出的结果,提供对经济现象的解释,并根据分析结果提出相应的政策建议或理论启示。

第五,验证与修正。实证研究的结论通常需要通过不同的模型、不同的数据集或不同

的研究方法进行验证和修正,以确保结论的可靠性。

第五节 经济学实证方法的主要内容

本书旨在介绍经济学实证研究的核心方法与技术,力求为学术研究人员、政策制定者及有志于从事经济学研究的学生提供系统的指导。本书按照由简至繁的逻辑结构,系统地介绍了几种常用的计量经济学模型,第一章为导论,其余内容共五篇,包括十二章内容。首先,我们从基本多元线性回归分析入手,它是实证研究中基础且常用的工具之一;接着,我们介绍非线性回归模型,这类模型用来处理那些不能通过简单线性关系来描述的经济现象;然后,深入探讨面板数据回归模型,为分析动态变化和个体间差异提供有力支持;随后,书中将介绍因果推断模型,这种模型尤其适用于希望推断因果关系的实证研究;最后,本书还将介绍空间计量回归模型,能够处理地理位置或区域之间的依赖性问题。五篇内容的具体安排如下。

第一篇为线性回归模型,包括第二章多元线性回归模型和第三章经典线性模型诊断。本篇从经典假设出发,系统梳理模型设定、估计与检验的全流程,帮助读者建立规范的建模思维。同时,通过诊断与修正方法的学习,培养对模型局限性的敏感性,为后续非线性、面板数据等扩展模型的学习奠定基础。

第二篇为非线性回归模型,包括第四章受限被解释变量模型和第五章分位数回归与门限回归模型。现实经济问题往往表现出非线性特征,本篇针对受限数据、分布异质性等经典非线性场景,介绍相应的建模思路。这些方法突破了线性框架的局限,能够更灵活地捕捉复杂经济关系,为实证研究提供更贴近现实的分析工具。

第三篇为面板数据回归模型,包括第六章静态面板数据模型、第七章动态面板数据模型和第八章变系数模型。面板数据兼具时间与截面维度,能够更好地控制不可观测异质性并捕捉动态效应。本篇由浅入深,从静态模型到动态设定,再到变系数扩展,完整呈现面板数据的分析逻辑,尤其适用于政策评估、企业行为等具有多维结构的研究问题。

第四篇为因果推断方法,包括第九章倾向得分匹配、第十章双重差分模型及第十一章其他因果推断模型。因果识别是实证研究的核心挑战。本篇围绕反事实框架,系统介绍主流的因果推断方法,从匹配策略到自然实验设计,帮助读者理解不同方法的适用边界,避免误用相关性推断因果关系的常见错误,提升研究的科学性与严谨性。

第五篇为空间计量模型,包括第十二章空间计量基础知识和第十三章空间计量模型的分类与选择。经济活动的空间交互效应日益受到关注。本篇从空间依赖性与异质性入手,建立空间分析的基本范式,为区域经济、城市发展等研究提供方法论支持,弥补传统计量模型忽视空间维度的缺陷。

即 测 即 练

