
主要英文经济学期刊论文计量方法分析

肖金川 任 飞 刘 郁*

内容提要 本文基于2001~2012年五大英文顶级经济学期刊计量方法的统计分析表明,经验研究论文占刊登论文总数的比例在这12年中有所提高,2012年经验研究论文占比要明显高于2001年,而理论论文的占比有所下降。经验研究论文中缩减形式(reduced-form)占绝对主导地位。普通最小二乘方法在这12年中占刊登论文总数的比例较高,是缩减形式中占比最高的方法。此外,我们也发现经验研究论文中使用结构模型论文的相对数量有所上升。这些发现说明,相当数量的经验研究论文并未采用在技术上更为复杂的识别方法,采用哪种计量方法在很大程度上依赖于要解决什么样的问题。

关键词 经验研究 经济学期刊 经济学研究方法

一 引言

伴随中国经济的持续发展,经济学研究也在不断进步。十多年前,林毅夫讲“……国内经济学者一般善于写文章,阐述观点,而不乐意做经验实证的工作,有的人还误以为经验实证是数量经济学的事,将理论与实证检验不适当地割裂开来……”(林毅夫,2001)。随着时间推移,我们确实看到越来越多的经济学论文开始使用经验研究的方法来进行研究,这些论文使用的数据结构越来越丰富,采用的估计手

* 肖金川、任飞、刘郁:复旦大学经济学院 上海 200433 电子信箱:jcxiao2006@gmail.com(肖金川); Alex.renfei@gmail.com(任飞); liuyu0922@126.com(刘郁)。

本文曾在复旦大学经济学院“当代中国经济与社会工作室”报告过,作者感谢与会者的讨论和建议。作者感谢高琳帮助我们完成数据整理工作。同时感谢两位匿名审稿人富有建设性的修改建议。当然文责自负。

段和技术越来越复杂(成九雁和秦建华,2005)。的确,在中国当前的经济背景下,需要大量经验研究工作来不断检验经济学理论在中国的适用性,并通过检验结果来解释中国经济发展中存在的各种问题,从而能够进一步发展或创造更接近现实的理论框架来预测经济走势。

但是,经验研究工作能否真正推动经济学进步的一个最重要前提就是所做的经验研究是否合乎规范。而要评价一篇经验研究论文是否规范,根本在于其是否“把经验分析建立在理论上,并从系统的数据中定量地检验理论假说和估计参数的数值”(钱颖一,2002),在这个基础上,有时候学者们为了“更好地估计经济模型和做出更精确的预测”(田国强,2005),才会考虑使用比较复杂的计量方法和工具。但是,任何复杂的经验研究方法要比简单方法得出更精确的估计都是有假定条件的。如果不明白这一点,只是简单使用最前沿的计量方法而忽视了所研究问题的性质和需要,这样的经验研究就不具有很大的价值。从这个意义上来说,经验分析方法要服务于论文所研究的问题。

本文不打算探讨规范经验研究的范式,去分析规范的经验研究“应该”怎么做,而是希望通过分析国际公认的五大顶级英文经济学期刊所刊载论文在2001~2012年间的变化特征,客观呈现规范的经验研究是如何发展的。^①已有一些文献对国内期刊刊登论文的情况进行统计分析(夏业良和王欣,2000;林良夫和陶小荣,2000;刘俊婉等,2004;孟大虎,2008),但多数是分析作者情况、研究范式等,也有少量文献关注期刊论文采用的计量方法(成九雁和秦建华,2005),但其分类相对简略。与之前的国内文献不同,本文关注《美国经济评论》(*American Economic Review*),《经济学季刊》(*Quarterly Journal of Economics*),《政治经济学杂志》(*Journal of Political Economy*),《计量经济学杂志》(*Econometrica*)和《经济研究评论》(*Review of Economic Studies*)五大英文期刊的计量方法,^②并对五大期刊的论文根据计量方法进行细致分类。本文之所以关注五大顶级英文期刊,是因为改革开放以来国内经济学转型受西方国家影响很大,顶级期刊的论文自然也成为很多国内学者学习参考的对象。而西方国家的经济学界在计量方法的研究和使用方面,无疑是领先于国内的。因此,统计分析五大顶级英文期刊论文采用的计量方法,有助于我们认清经验研究乃至经济学研究的国际潮流,借鉴国际顶级英文期刊论文的相关经验,以提升自身的研究水平。

① 前提是需要假设这些顶级英文经济学期刊所载的论文是规范的。

② 在下文,为方便标记,我们将 *American Economic Review* 简称为 AER, *Quarterly Journal of Economics* 简称为 QJE, *Journal of Political Economy* 简称为 JPE, *Review of Economic Studies* 简称为 RES。

下文的安排是:第二部分分析 2001 ~ 2012 年五大英文经济学期刊所刊载的理论研究和经验研究论文的数量特征;第三部分按照经验研究论文采用的模型结构将其区分为结构模型、缩减形式和时间序列三个类别,并描述五大期刊刊载这三类经验论文的数量特征;第四部分将缩减形式分为十个类别,来分析每个类别在缩减形式中所占比重的变化趋势;第五部分总结全文。

二 2001 ~ 2012 年顶级经济学期刊刊载论文分析

随着计量经济学的不断发展,经验研究在经济学研究中的地位越来越重要。为了分析比较其变化趋势,本文首先参考 Persky (2000) 和 Hamermesh (2013) 的做法,将所有论文分为“理论”、“理论+经验”和“经验”三大类,具体的定义如表 1 所示,其中,在“理论+经验”这一类中,包括了部分以经验研究为主要贡献,而理论仅是说明性的研究。

表 1 论文分类

类别	描述
理论	只包含数理模型推导
理论+经验	同时包含数理模型推导,实际数据和大样本估计方法
经验	不包含数理模型推导,只有实际数据和大样本统计推断和估计

说明:“理论”类也包括涉及计量方法论的文献和使用模拟数据验证模型结论的论文。

图 1 给出了前述有代表性的五大顶级经济学研究期刊在 2001 ~ 2012 年合计的三类论文的数量统计,^①从总量上来看,2001 ~ 2012 年 12 年间,五大期刊上发表的论文总数相对稳定,大多数年份为 260 篇到 280 篇,最低的年份为 2008 年共计 254 篇,最高的年份为 2012 年共计 321 篇。其中“理论+经验”类论文和“经验”类论文在这 12 年中总体处于上升趋势,2012 年发表篇数较 2001 年均有所增加,分别上升 55.8% 和 42.1%。相较之下,纯“理论”类论文篇数却总体处于下降区间。^② 这初步反映了经验研究的重要性正逐渐得到重视,运用经验研究的方法进行经济学研究开始变得更流

① 参照 Card 和 DellaVigna (2013),我们统计的 AER 论文中包含了短论 (short papers),但不包括会议增刊、演讲稿、就职演说、评论及回复和勘误;统计的 Econometrica 论文中包含短论和评论 (notes and comments) 中的短论,但不包括评论。

② 2012 年“理论”类论文篇数有所反弹,一是因为五大期刊发文总数有所上升,二是“理论”论文占论文总数的比重相对 2011 年也略有上升。

行,并且越来越受到主流经济学期刊的欢迎。

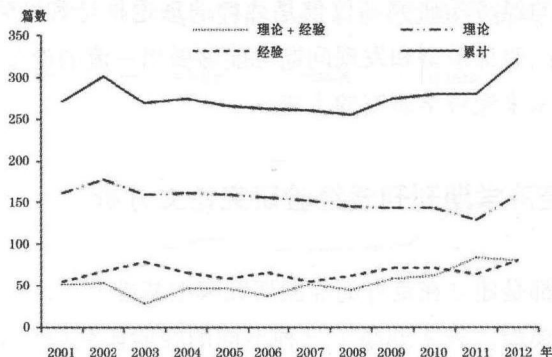


图1 三类论文数量变动情况(2001~2012年)

相较于2001~2006年的24.3%和16.4%有所提高。相应的,“理论”类论文占比就下降较多,从2001~2006年的59.3%降低到2007~2012年的52.3%。从每个期刊发表的论文来看,除 *AER* 的“理论”类论文维持稳定外,^②其余4个期刊的“理论”类均有不同程度的下降。值得注意的是, *Econometrica* 和 *RES* 这两个向来偏重发表理论研究的期刊,2007~2012年发表的“经验”类论文也大为增多。从图2中可以看到,2001~2006年的“理论”类论文占比, *Econometrica* 达到89.9%, *RES* 达到81.9%,而到了2007~2012年,这两个比例分别下降到80.2% (*Econometrica*) 和72.1% (*RES*)。经验研究论文在2001~2012年间数量

图2统计了2001~2012年每个期刊中三类论文前6年(2001~2006年)和后6年(2007~2012年)的平均值占论文总数的比例,^①以便更直观和细致地来考察每个期刊刊登的三种论文类型在两个较长时间段内的对比情况。从总体上看,2007~2012年“经验”类和“理论+经验”类论文分别占到当年发表论文总数的24.6%和23.1%,

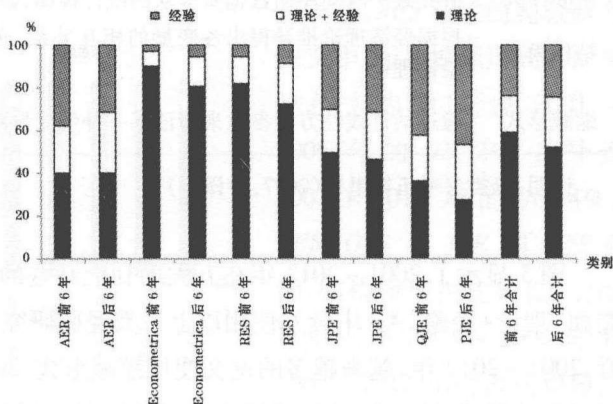


图2 每个期刊三类论文占比变动情况
(2001~2006年和2007~2012年)

① 我们统计了2001~2012年共12年的数据,在分段分析时,我们将时间段划分为2001~2006年和2007~2012年两个6年段进行均值计算,这样处理的好处是能够平滑掉短期的非趋势性波动,获得长期的平均变动情况,以验证我们所观察到的短期变化是否适应长期情况。

② 前后两个6年的对比并不意味着 *AER* 更偏爱“理论”类论文。在2007~2012年, *AER* 刊登的“理论”类论文占刊登论文总数的比重在迅速下降,2008年这一比重为55.6%,2012年降为30.6%,相关统计数字与 Hamermesh(2013)的统计结果基本一致。

增长较为迅速,其中一个重要的原因是数据可得性提高使得经验研究的成本降低(Hamermesh,2013)。^①这无疑说明好的经济学研究不仅仅是纯粹的理论推导和数学模拟,运用经验研究的方法去联系实际、验证模型和发现问题也能够做出一流的论文,并且,从目前的趋势来看,这有可能是未来经济学研究的主流。

三 2001 ~ 2012 年顶级经济学期刊刊载经验研究论文分析

经验研究的参数估计和假设检验都是建立在良好的经验研究模型基础上的,而不同的研究目的会产生不同的经验研究模型。表 2 列举了三种不同的经验研究模型结构:时间序列(time series)、结构模型(structural model)和缩减形式(reduced-form model)。

表 2 经验研究模型结构分类	
类别	描述
时间序列	研究某一时间序列数据所遵从的统计规律,研究发展趋势。
结构模型	根据经济理论推导出各变量的相互关系,通过严格估计系统内的所有参数,以验证理论。
缩减形式	通过估计线性方程参数来验证某一外生变量对于另一变量的影响。

说明:分类参考伍德里奇(2007,中译本)。

图 3 显示了 2001 ~ 2012 年在五大期刊上刊登的所有经验研究论文(包括“经验”类和“理论+经验”类)中分别使用以上三类经验研究模型结构的论文数量。从总量上看,2001 ~ 2012 年,越来越多的论文使用缩减形式,2001 年有 92 篇经验研究类论文使用了缩减形式,这一数字在 2012 年达到 132 篇;从结构上看,这 12 年中缩减形式占经验研究论文的比例均超过 80%,2008 年甚至达到 90.8%。由此可见缩减形式在经验研究类论文中最为重要。而使用时间序列模型的经验研究论文占经验研究论文的比例只有 2001 年超过 10%,其余年份均在 10% 以下,这说明时间序列模型受限于其数据结构,很难成为最主要的经验研究模型。对于结构模型的论文,尽管数量不多,2001 年只有 3 篇,2012 年也只发表了 23 篇,但可以看到的是,在这 12 年中使用结构模型的

^① Hamermesh(2013)认为理论研究主要被基于自有数据的经验研究所取代,研究者能够比以前更容易获取自有数据可能是经验研究快速增长的原因之一。

经验研究论文总体上是在增加的。随着时间的推移,相关数据的获得逐步成为可能,可以预见结构模型的占比在未来将会继续提高。

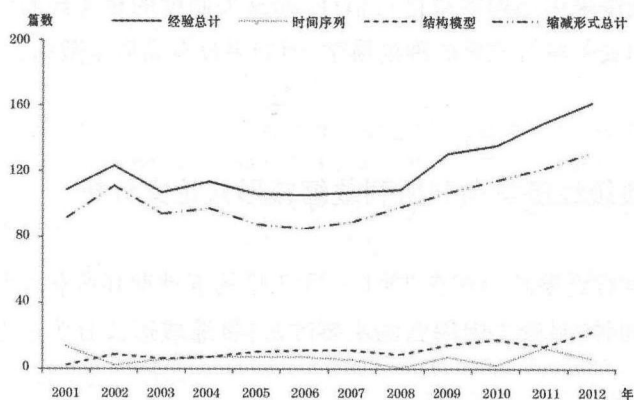


图3 经验研究论文使用模型结构的数量变动情况
(2001~2012年)

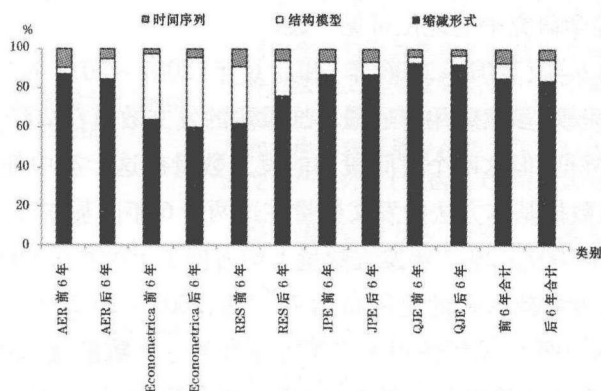


图4 每个期刊经验研究论文使用模型结构占比
(2001~2006年和2007~2012年)

图4统计了前6年(2001~2006年)和后6年(2007~2012年)每个期刊中经验研究论文使用三类模型结构比例的平均值。由图4可见, *Econometrica* 和 *RES* 中缩减形式虽然占据主导地位,但结构模型占比也较为可观。*Econometrica* 中结构模型在2001~2006年和2007~2012年占比均超过30%, *RES* 占比也均在15%以上。值得一提的是, *RES* 刊载的经验研究论文中,应用缩减形式的论文比例大为增加,从2001~2006年的62.2%上升到2007~2012年的76.4%。*AER*、*QJE* 和 *JPE* 则有所不同,结构模型占比较低,而缩减形式在2001~2006年和2007~2012年的占比均超过80%。另外, *AER* 和 *QJE* 中采用结构模型的论文占比有所上升,^①*JPE* 中采用结构模型的论文占比基本未变。^②

① *AER* 在2007~2012年的结构模型占比超过10%。

② *JPE* 的情况较为特殊,2001~2006年共刊登了112篇缩减形式、8篇时间序列和8篇结构模型的论文,而在2007~2012年则刊登了83篇缩减形式和6篇时间序列、6篇结构模型的论文。这是因为 *JPE* 每年刊登论文的总数有所下降,从2001~2006年的年均42.3篇减少到2007~2012年的年均29.7篇。

这些都表明了缩减形式在经验研究中的主导地位。之所以缩减形式在经验研究中占据如此重要的位置,一个可能的原因是解决的问题涉及的相关经济学领域缺乏成熟理论模型,导致经验研究工作无法采用结构模型进行估计,如有关制度的相关经验研究;另一个可能的原因是即使相关领域有成熟的理论模型,但如果没有高质量数据,也难以采用结构模型进行估计。

四 2001~2012年顶级经济学期刊所刊载缩减形式论文分析

从以上的分析中,我们已经看到缩减形式在2001~2012年的五种期刊所载经验研究论文中占据80%以上。我们按照论文中用到的主要方法,将缩减形式分为十个类别,详见表3。^①

值得注意的是,我们所关注的这十个类别,在2001~2012年发文总数为1237篇,占刊登论文总数的37.4%;在2001~2006年中共计571篇,占论文总数的34.8%;在2007~2012年中共计666篇,占论文总数的39.9%。^②2007~2012年缩减形式的这十个类别发文总数比2001~2006年增长了16.6%,占五大期刊刊登论文总数的比例增长了5.1%,缩减形式在当今经学研究中的地位可见一斑。

图5统计了这十个类别在前6年(2001~2006年)和后6年(2007~2012年)两个时间段内的发文数量。^③可以发现,虽然应用普通最小二乘法的发文数量在2007~2012年相对2001~2006年有所降低,但这两个时间段内的发文数量在这十类中都是最多的。应用工具变量法和面板数据基本方法的发文数量在这两个6年内基本持平。以上三类方法在2001~2006年和2007~2012年发文数量上均占据了十类方法的前3位,其中2001~2006年三类方法占缩减形式的比例高达74.7%,2007~2012年间三类方法占缩减形式的比例也达60.0%。采用除以上三类方法外的论文数量,在2007~2012年相比2001~2006年出现了快速增长。其中,应用自然实验、实验室实验和倍差法等方法的发文数量增长了50%以上。应用田野试验、断点回归和匹配等方法的发文数量则增加了1倍以上。

① 主要参考Todd(2006)的分类方法,依据他的分类将五大期刊的论文整理归类为十类。分类方法及定义我们还参考了以下文献:余静文和王春超(2011)、洪永森(2007)、李子奈(2008)、李子奈和齐良书(2010)、孟大虎(2008)、Angrist和Pischke(2009)、Heckman和Smith(1995)及Levitt和List(2009)等。

② 我们在这里及下文中之所以统计缩减形式具体类别占刊登论文总数的情况,是希望关注缩减形式的各个类别在经验研究中的地位,而不是仅仅关注缩减形式在经验研究中的地位。

③ 在后续的讨论中我们将分析2001~2012年逐年的变动情况。

表 3

缩减形式分类及定义

类别	描述
普通最小二乘法 (ordinary least square)	主要是指没有用特定方法有针对性地处理内生性问题的一般传统方法 (主要是 OLS, 也包括非线性 OLS、GLS 和离散选择模型等处理截面数据的方法)。
自然实验 (natural experiment)	能够对政策实施前后的微观个体特征进行观测, 通过比较政策实施前后微观个体特征的变化量可以解决政策评价问题。
田野实验 (field experiment)	运用科学的实验方法检查自然环境而不是实验室里发生的扰动, 随机招募被试人群进入控制组和其他任务组, 并进一步比较这些组别的实验结果。相对于实验室实验, 特点是更贴近真实世界。
实验室实验 (laboratory experiment)	可以允许实验者在实验室内通过控制其他条件不变的情况下, 改变价格信息、预算约束、信息结构或被试的行动集合来衡量这些因素对于人们的影响, 在一定程度上克服了一般计量分析中不能很好测度变量之间因果关系的问题。
面板数据基本方法 (panel data models)	利用 n 个不同个体在 T 个不同时期上的观测数据来进行分析, 在这里我们主要是指用固定效应、随机效应进行估计。
倍差法 (difference-in-differences)	在不能随机抽取受政策影响者时, 利用一个不受政策影响的对照组来解决政策评价问题的一种方法。对照组的质量决定了评价结果的质量。
工具变量法 (instrument variable)	当回归变量与误差项相关时获得总体回归方程未知系数一致估计量的一种方法。工具变量应当是一个不属于原解释方程并且与内生解释变量相关的变量。在线性模型中, 有效的工具变量应该满足两点: (1) 此变量和内生解释变量存在相关性; (2) 此变量和误差项不相关, 也就是说工具变量严格外生 (包括将 IV 用于其他模型)。
匹配 (matching)	主要是倾向评分方法 (PSM)。其理念是, 用尽量相似的控制组成员和对照组成员来进行比较以减少偏误。
断点回归 (regression discontinuity)	断点回归基于以下思想: 在我们的世界里, 有些规则的出现十分随意, 这种随意性提供了性质良好的实验。断点回归可以分为两类: 模糊断点回归和清晰断点回归。
其他	指以上方法之外出现频率较低的方法。

说明: 对于面板数据基本方法, 并不是指利用面板数据来进行经验研究的论文, 比如分类中的倍差法等方法很可能是基于面板数据的。在此处, 我们特指应用固定效应方法和随机效应方法所做的面板数据研究, 也包括采用面板数据相关计量方法处理群数据 (cluster sampling data) 的论文。少数论文采用了两种或两种以上的识别方法, 且方法同等重要, 我们将这类论文做特殊处理。以一篇论文采用两种识别方法为例, 我们将每种方法记为 0.5 篇。然而借助于特殊识别方法的情况并不在此列, 例如某些论文借助于自然实验来识别政策的影响, 在处理数据时使用了倍差法, 我们仅将其归类为自然实验, 不再归入倍差法。

从前 6 年(2001 ~ 2006 年)和后 6 年(2007 ~ 2012 年)发文数量的对比可以发现,应用传统方法如普通最小二乘法、面板数据基本方法的发文数量仍较为可观,依然在缩减形式中占据主导地位。而采用实验类方法、倍差法、匹配等较为新颖方法的论文数量在 2007 ~ 2012 年相比 2001 ~ 2006 年有了较大幅度的增长。然而仅仅分析前 6 年和后 6 年的均值,只能对两个时间段进行对比分析,获取的信息虽然可以阐明长期的情形但忽略了每年的变动情况,下面我们将基于 2001 ~ 2012 年的逐年数据对缩减形式的十个类别进行进一步分析。

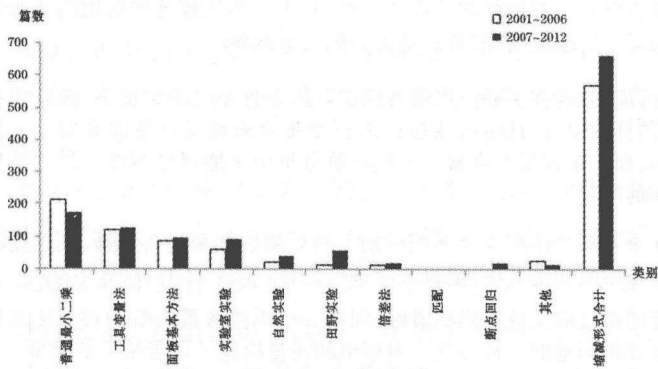


图5 缩减形式具体各类数目变动情况
(2001 ~ 2006 年和 2007 ~ 2012 年)

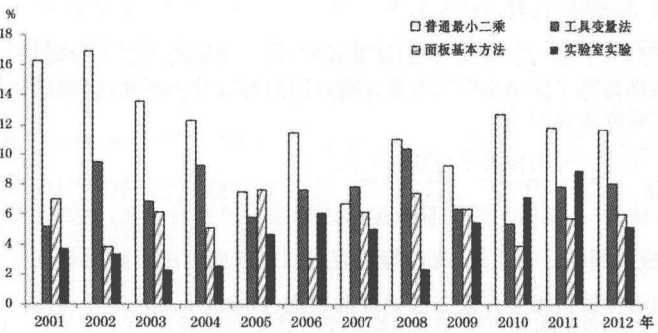


图6 缩减形式四类主要方法占论文总数比例变动情况
(2001 ~ 2012 年)

图 6 和图 7 统计了 在 2001 ~ 2012 年这十个类别除“其他”以外的九个类别占发文总数比例的变动情况。通过这两张图,我们更加清晰直观地了解到,这九个类别在经验研究中的地位在这 12 年间逐年的变动情况。从图 6 可以发现,普通最小二乘法是缩减形式中占比最高的方法,2001 ~ 2012 年间占五大期刊发文总数的比例均值达 11.8%,占缩减形式论文总数的比例均值高达 31.6%。

应用工具变量法和面板数据基本方法的论文数量在多数年份占五大期刊发文总量的比例达到 5% 以上,占缩减形式的比例均值达 15% 以上,是这九类中除普通最

小二乘法以外占比最高的两个大类。而实验室实验作为除以上三类方法外的第四大方法,在 2001 ~ 2012 年总体处于上升趋势,尤其是在 2008 ~ 2011 年,平均每年增长 93.1%,在 2010 和 2011 年的发文数量更是超过了工具变量法和面板数据基本方法,成为仅次于普通最小二乘法的第二大方法。

从图 7 中我们可以发现,自然实验、田野实验、倍差法、匹配和断点回归这五类方法在 2001 ~ 2012 年间虽然占比有波动,但总体处于上升趋势,到 2012 年,这五类方法占五大期刊发文总数的比例加总为 10.1%,是 2001 年 1.5% 的 6.7 倍。其中只有匹配法出现频率比较低,12 年中有 7 年五大期刊中没有刊登使用匹配法的相关论文,其他四种方法在 2009 ~ 2012 年的占比均超过 1%。

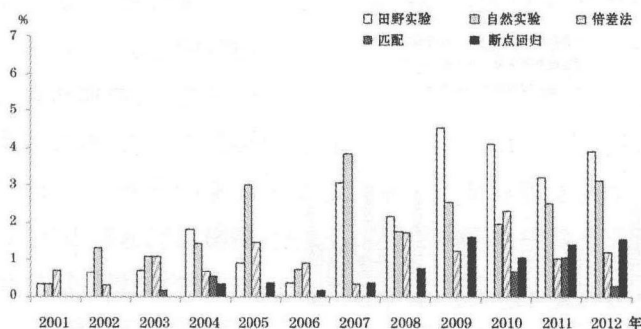


图 7 缩减形式五类出现频率较低的方法占论文总数
比例变动情况 (2001 ~ 2012 年)

下面我们以 *AER* 在 2001 ~ 2012 年缩减形式具体分类情况进行分析。之所以分析 *AER*,除了它是世界公认最好的经济学期刊之一以外,它刊登的论文数量也较可观。2001 ~ 2012 年 *AER* 共刊登 1109 篇论文,占五大期刊发文总数的 33.5%,其中 2012 年共刊登 124

篇论文,^①占到我们所分析的五大期刊当年所发论文总数的 38.6%,因而比较具有代表性。^②

从图 8 我们可以发现 *AER* 的情况与图 6 基本类似。^③ 由于 *Econometrica* 和 *RES* 主要刊登理论论文,我们也就不难理解 *AER* 中缩减形式各类别占发文总数的比例要高于五大期刊的相应比例了。值得注意的是,应用普通最小二乘法的论文,在 2001 年占到发文总数约 27.1%,在 2012 年占比达到 21.0%,12 年中占比虽有起伏,但始终在十类方法中占比最高,平均占比达 18.9%。作为世界上最优秀的经济学期刊之一,普

① 从 2011 年开始,*AER* 由季刊改为双月刊,刊登的论文数量有所增加。

② 其他四刊发文数量相对较少,将缩减形式细分为十类后再进行分析,会导致每个类别的论文数量太少,使分析失去意义。

③ 为便于展示,我们在图 8 中将出现频率较低的五类方法进行加总,由于使用这五类方法的论文数量较少,我们不再对其进行逐个分析。

通最小二乘法仍然占据如此重要的地位,在一定程度上反映了传统方法在经验研究中的重要性。采用面板数据基本方法的论文在这 12 年中的平均占比达到 5.8%,而采用工具变量法的论文平均占比达 9.1%。由此可知,在经验研究中,新技术新方法固然很重要,但是传统的技术方法并没有失去其主导地位。同时,AER 在 2008 年以来越来越青睐实验室实验的论文,相关论文数量大幅增长,2011 年占到发文总数的 17.0%,远高于五大期刊合计的 9.0%。另外,我们也可以发现使用五类出现频率较低的方法的论文占比在 2007 年以来也实现了较为快速的增长,^①使用这五类方法的论文篇数合计占发文总数的比例在 2012 年甚至高达 13.3%。这说明 AER 可能比较欢迎采用新颖识别方法的经验研究论文。

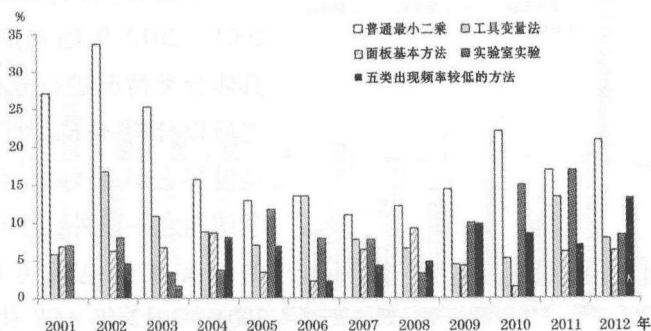


图 8 缩减形式各类占论文总数比例变动情况
(2001 ~ 2012 年, AER)

结合图 5、6、7 和 8 的简单分析,可以得出的结论是:在我们所关注的这九类方法中,普通最小二乘法在最顶尖的经济学期刊中依然占比最大,无论是逐年的分析还是取 6 年的均值都是如此。这 12 年中,经济学研究用到的技术有了很大提升,但是并未撼动传统方

法的地位。我们也可以发现,在 10 多年前很少见的一些方法如断点回归也开始频繁出现,即使它们的数量依然难与传统方法相比,但是它们经历了从无到有,从少到多,逐步为主流经济学期刊所接受,开始占有一席之地。这些发现说明,顶尖的英文经济学期刊刊登的经验研究论文往往并不艰深,相当数量的经验研究论文采用了较为简单的识别方法来处理问题,由此可知,重要的往往不是识别方法是否够复杂,而是采用的方法能否很好地解决问题。当然精巧的识别策略(如自然实验和断点回归等)有助于把经验研究做的“干净”,但是在精巧的识别策略难以实施时,找到能够解决问题的其他方法也能做出一流的经验研究论文。因而,在经验研究过程中,与其把重心过多的放在识别方法上,不如将问题摆到与方法同等重要的位置。

① 具体是指田野实验、自然实验、倍差法、匹配和断点回归这五类方法。

五 结论

本文通过对 2001 ~ 2012 年五大顶级英文经济研究期刊所刊论文的分析发现, 2001 ~ 2012 年经验研究类论文占刊登论文总数的 44.2%, 从 2001 年的 40.4% 增加到 2012 年的 50.5%, 12 年间增长 10.1%; 这 12 年间缩减形式占刊登论文总数的 37.4%, 从 2001 年的 34.1% 增加到 2012 年的 41.1%, 12 年间增长 7.0%; 这 12 年间普通最小二乘法方法占刊登论文总数的 11.9%, 2012 年占刊登论文总数的比例仍高达 11.7%, 一直是缩减形式中占比最高的方法。另外, 使用结构模型的论文占比从 2001 ~ 2004 年间的 3% 以下, 增加到 2009 ~ 2012 年的 5% ~ 7%, 成为经验研究中较为重要的方法。从这些数字中我们可以看出, 经验研究类论文相比 10 多年前有了一个较大幅度的增长, 而缩减形式则在经验研究中占据着毋庸置疑的数量优势, 普通最小二乘法方法占据着缩减形式的首要地位, 结构模型占比虽然不高, 但地位越来越重要。另外, 由于缩减形式中普通最小二乘法和面板数据基本方法占比出现一定程度的下降, 工具变量法的占比相对稳定, 因而缩减形式中除普通最小二乘法、面板数据基本方法和工具变量法之外的其他方法出现显著增长。此外, 我们还以 *AER* 为例, 具体分析了这个顶级期刊缩减形式论文的发文情况, 也印证了以上观点。

对于经验研究来说, 问题与方法同等重要, 方法服务于问题所需, 好的经验研究方法并不一定是在数学上复杂的方法, 而必定是对所研究问题而言最有利于得到精确估计的方法。当然, 经验研究的复杂性在很大程度上还取决于数据收集的难度、研究设计的精巧以及运用简单方法排除特定机制的技巧等。对于五大顶级期刊在这 12 年间出现的趋势, 我们认同哈佛大学 Wyne 就经济学未来发展方向咨询 8 位世界顶级的青年经济学家所得出的观点 (Wyne, 2012), ^①他们认为经验研究的分量将越来越重, 因为研究者在未来能更容易获得各种宏观和微观数据, 并且计算机技术的飞速发展使处理这些数据成为可能, 因此经验研究将比理论研究发展更快。未来丰富的数据有助于研究者估计模型的具体参数, ^②经验研究将能验证详细的理论假设及结论, 经济学的研究工具很可能会变得更为“经验化”。

① 这 8 位经济学家是 Nicholas Bloom、Gauti Eggertsson、Xavier Gabaix、Gita Gopinath、Peter Leeson、Glen Weyl、Raj Chetty 和 Justin Wolfers。

② 采用结构模型的论文数量在 2009 ~ 2012 年的增长在一定程度上验证了这个假设。

参考文献:

成九雁、秦建华(2005):《计量经济学在中国发展的轨迹——对<经济研究>1979-2004 年刊载论文的统计分析》,《经济研究》第4期。

洪永森(2007):《计量经济学的地位、作用和局限》,《经济研究》第5期。

李子奈(2008):《计量经济学应用研究的具体回归模型设定》,《经济研究》第8期。

李子奈、齐良书(2010):《关于计量经济学模型方法的思考》,《中国社会科学》第2期。

林良夫、陶小荣(2000):《<世界经济>研究论文统计分析》,《世界经济》第12期。

林毅夫(2001):《经济学研究方法与中国经济学学科发展》,《经济研究》第4期。

刘俊婉、苏新宁、邓三鸿(2004):《经济学研究现状:基于 CSSCI 的评析》,《经济学家》第4期。

孟大虎(2008):《转型中国的经济学转型——基于<北京师范大学学报>(社会科学版)的经验分析》,《北京师范大学学报(社会科学版)》第2期。

钱颖一(2002):《理解现代经济学》,《经济社会体制比较》第2期。

田国强(2005):《现代经济学的基本分析框架与研究方法》,《经济研究》第2期。

夏业良、王欣(2000):《中国理论经济学 50 年发展轨迹的缩影——对<经济研究>刊载文章的统计分析与简略评论》,《经济研究》第5期。

余静文、王春超(2011):《新拟随机实验方法的兴起——断点回归及其在经济学中的应用》,《经济学动态》第2期。

[美]杰弗里·伍德里奇(2007):《计量经济学导论:现代观点》(中译本),费剑平译,北京:中国人民大学出版社。

Angrist, J. and Pischke, J. *Mostly Harmless Econometrics: An Empiricist's Companion*. New Jersey: Princeton University Press, 2009.

Card, D. and DellaVigna, S. "Nine Facts about Top Journals in Economics." *NBER Working Paper*, No. 18665, 2013.

Hamermesh, D. "Six Decades of Top Economics Publishing: Who and How?" *Journal of Economic Literature*, 2013, 51(1), pp.162-172.

Heckman, J. and Smith, J. "Assessing the Case for Social Experiments." *Journal of Economic Perspectives*, 1995, 9(2), pp.85-110.

Levitt, S. and List, J. "Field Experiments in Economics: the Present, and the Future." *European Economic Review*, 2009, 53(1), pp.1-18.

Persky, J. "The Neoclassical Advent: American Economics at the Dawn of the 20th Century." *Journal of Economic Perspectives*, 2000, 14(1), pp.95-108.

Todd, P. "Evaluating Social Programs with Endogenous Program Placement and Selection of the Treated," in Prabhu Pingali and Robert Evenson, eds., *Handbook of Agricultural Economics* 4, Amsterdam: North Holland, 2006, pp.9-46.

Wyne, A. "Empirics and Psychology: Eight of the World's Top Young Economists Discuss Where Their Field Is Going." *Big Think*, July 25, 2012.

(截稿:2013 年 9 月 责任编辑:宋志刚)