

# 如何做好的经济学研究？

姚洋

北京大学国家发展研究院

中国经济研究中心

长江学者、博雅特聘教授

# 一、引言

# 中国现代经济学的发展过程

- 1980年代
  - 早期引进，停留在中级的水平
  - 研究尚未起步
- 1994年 – 2003年
  - 研究生教育的引进阶段，CCER发挥了主导作用
  - 科研处于起步阶段
- 2003年 –
  - 研究生教育完善和推广
  - 科研开始繁荣

# 现在的问题

- 科研处于跟随和模仿阶段
  - 跟随国外的研究热点
  - “猎奇式”研究
- 没有形成中国的研究议题
  - 中国是一个伟大的试验场，应该能够产生很好的研究议题
- 研究水平有待提高
  - 照搬国外形成的理论模型
  - 技术不过关
  - 就中国论中国，没有理论关照

# 今天讲什么？

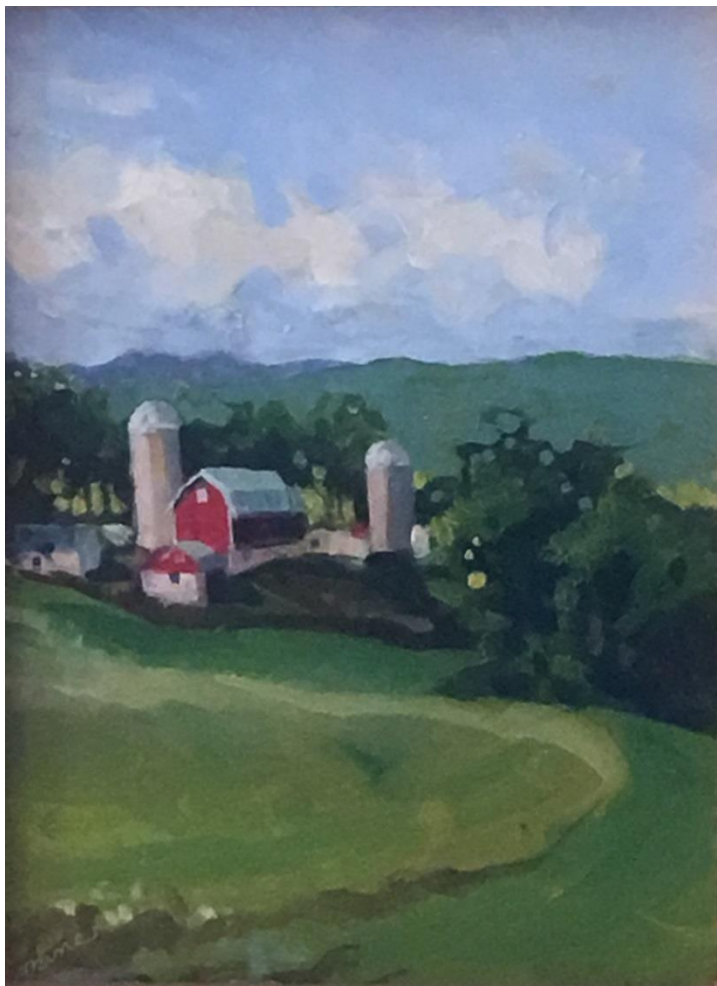
- 经济学的科学之辨
- 选题
- 技巧
- 写作

## 二、经济学的目标是产生思想

# 经济学是科学吗？

- 什么是科学？
  - 托马斯·库恩：可证伪性
- 在这个意义上，经济学离科学还有距离
  - 经济学的检验无法在实验环境下进行
  - 预测不是经济学研究的主要内容
- 经济学研究在很大程度上还是
  - 表述事实
  - 表达思想
- 科学方法和科学的差别
  - 用科学的方法去做研究不等于其产出就是科学的
  - 比如：基督教辩护士也用科学的方法去研究耶稣的复活，但那不是科学

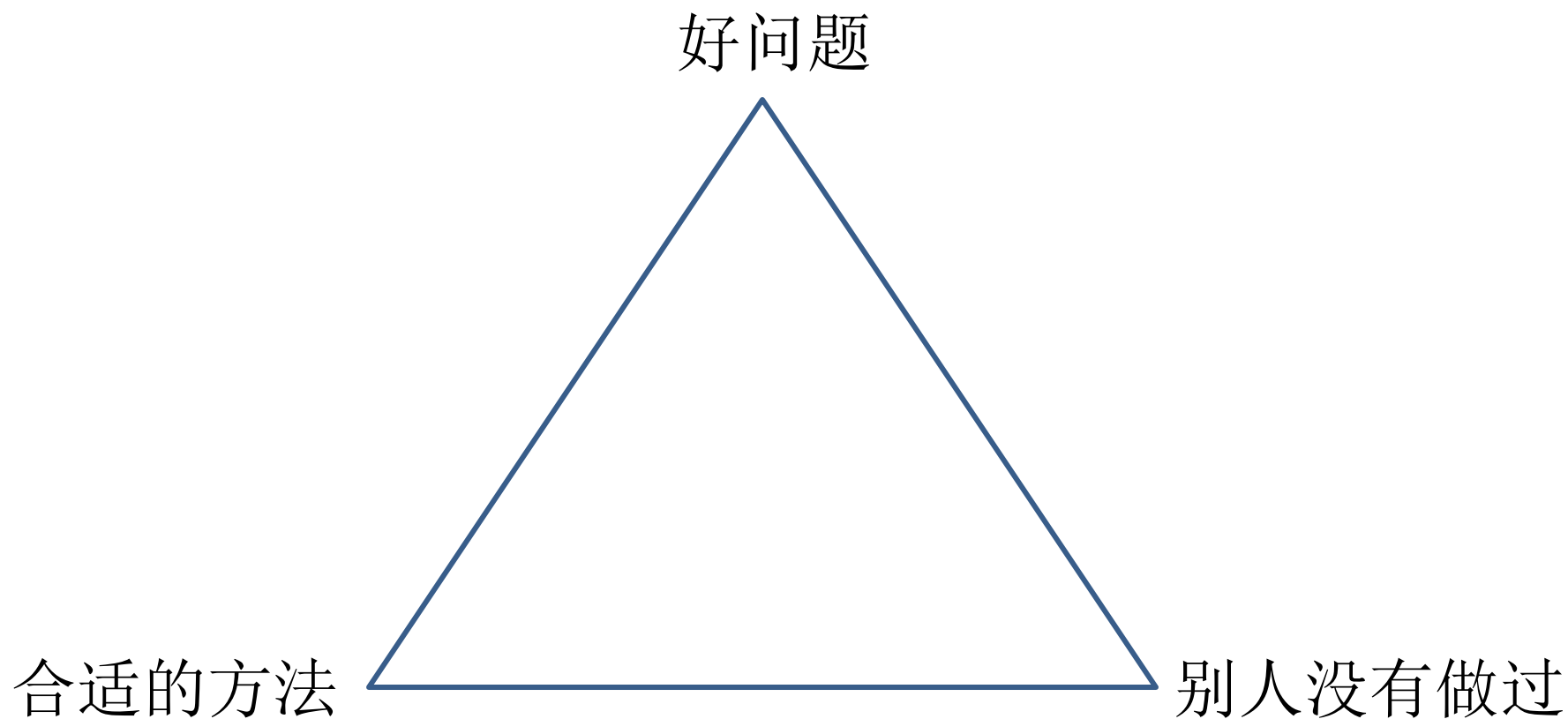
# 与绘画的异同



- 相同之处：表达一种思想
- 不同之处：技术路线不同



# 经济学研究的不可能三角



## 三、选题

# 好的选题

- 好的选题是论文成功的一半
- 问题导向的研究
  - 追逐文献不是中国学者的比较优势
  - 中国的实践为中国经济学家提供了很多研究素材
  - 但最终要问两个问题：
    - 你的研究对改造中国有什么贡献？
    - 你的研究对经济学文献有什么贡献？

# (1) 新的理论构想

- 抽象现实，发现新的benchmark理论
  - 阿罗不可能定理
  - 科斯定理
- 问题导向的研究
  - 纯理论不是中国学者的优势所在
  - 理论要有的放矢：解释现实中发现的现象
  - 如：如何解释政府在中国经济成功中发挥的作用？
  - 理论一定要有普适价值

- 研究文献

- 拾遗补漏，发现现有理论不完备的地方

- 有效制度变迁总是发生吗？
    - 如果完备合同是不可能的，委托-代理关系将如何改变？

- 扩大视野，发现新的理论

- 分权在中国成功，为什么在其他国家不太成功？
    - **Cross-breeding:** 把其他分支或领域的理论应用到本领域（如黄海洲和他的合作者Patrick Bolton把MM定理应用到国家层面）

## (2) 解释一个“谜”或“意外”

- “谜”：直接从经验发现出发
  - 逻辑上无法找到答案的经验发现
  - 如：“李约瑟之谜”
  - 再如：中国增长之谜：中国官员如此腐败，为什么中国经济仍然快速增长？
- “意外”：还是直接从现实出发
  - Benchmarking：和现有理论预测相左的经验事实
  - 如：汇率是名义价格，一般认为不会影响实际汇率，但为什么还有那么多的国家采取固定汇率？

# （3）应用现有理论解释现象

- 检验现有理论
  - 前人没有检验过的理论
  - 新的数据
  - 新的计量方法
- 应用微观计量学
  - 用微观经济学理论解释现象，并用数据做出证明
  - 如：新型农村合作医疗是否降低农民信教的概率？

# 不好的选题

- 修改别人模型的假设
- 生套理论模型
- 事后合理化
- 稻草理论
- 为了研究中国而研究中国
- 研究决定因素
  - 工资是由什么因素决定的？
  - 一个更好的问题：工会对工资决定有作用吗？



# 中国研究的陷阱

- 跟随式研究
  - 用中国的数据把文献中已经有的成果复制一遍，做一些边际上的改进
  - 能够发表，但不足以发现新的东西
- 讨好式研究
  - 暴露中国“坏的”一面
  - 迎合西方对中国的刻板印象
- 要学会设立自己的研究议题！
  - 对中国有意义、对经济学发展有意义的议题

# 总结

- 发现好的选题需要学会

联想！

## 四、技巧

# (1) 理论研究

- 如何做理论
  - 先想好一个符合直觉的“故事”，用日常语言表述出来
  - 然后找到适当的经济学模型，用严谨的数学语言表达这个“故事”
- 切记不要从现成的假设出发，用标准的模型来研究现实问题！

# 做理论模型的步骤

- (1) 确定结论（因果关系）
  - (2) 构造一个可以产生想要的结论的经济机制（防止“短路”发生！）
  - (3) 确定模型及其假设
- 以上步骤可能需要重复很多次，从而，最后确定的假设一定是通过模型的机制能够得到想要的结论的最少的假设。

# 忆秦娥 将进酒

- 原作：

将进酒，笙箫断处且怀古。且怀古，朱程孔孟，道德诗赋。  
倏忽一梦三千年，寰宇汹涌作新谱。作新谱，山河依旧，还把歌舞。

- 修改稿：

1.

将进酒，笙箫断处常怀古。常怀古，朱程孔孟，道德诗赋。  
倏忽一梦三千年，莽莽寰宇新作谱。新作谱，山河依旧，且把歌舞。

2.

将进酒，笙箫断处常怀古。常怀古，文章孔孟，李杜诗赋。  
倏忽一梦三千载，周邦新命重起谱。重起谱，山河依旧，且把歌舞。

3.

将进酒，笙箫断处常怀古。常怀古，朱程孔孟，道德诗赋。  
倏忽一梦三千载，几回陈桃换新符？换新符，山河依旧，且把歌舞。

4.

将进酒，笙箫断处常怀古。常怀古，朱程孔孟，道德诗赋。  
倏忽一梦三千载，几回陈桃换新谱？换新谱，山河依旧，且把歌舞。

- 如何检验一个理论模型的好坏？
  - 机制是否合理？
  - 假设是否合理？
  - 模型是否应用得当？
  - 逻辑是否清晰？
  - 模型是否精巧？
  - 结论是否符合直觉？
  - 是否比现存理论得到更多、更一般化的结论？
  - 结论是否经得起数据的检验？

## (2) 经验研究

- 好的数据是第一要务
  - 微观调查数据：CFPS, CHARLES, CHIPS, CHNS
  - 省际数据
- 经验研究也要讲一个故事
  - 最好是有有一个理论模型，不是构建一个理论，而是提供一个分析框架，告诉你哪些变量是解释变量，哪些变量是控制变量
  - 用回归来讲故事
  - 做一万个回归，挑选十个来讲一个逻辑自洽的故事
  - 但要避免cherry picking



# 内生性问题

- 共时性问题（伪相关）：两个变量之间的相关性完全来自偶然因素
  - 街上的流行服装与股市价格
  - 时间趋势
- 遗漏变量：因变量和解释变量都受其它未控制变量（遗漏变量）的影响
  - 在不控制收入的情况下，需求可能是价格的增函数
- 联立方程偏差：一个变量影响另一个变量，但两者又都是市场均衡决定的
  - 市场需求和价格

# 如何处理内生性问题？

- 使用但不迷信工具变量
  - **Rule of the thumb:** 一个合格的工具变量必须和处理的内生变量高度相关（相关性），同时又对因变量没有直接作用（排他性）
  - 殖民地死亡率作为制度的工具变量？
- 多从其它方面想办法：
  - 做无数回归！
  - 如果有面板数据，就“打时间差”！
  - 断点回归
  - 利用自然实验或拟自然实验

# 从多个方面验证自己的结论

- 通常，我们只是检验一个理论预测；但是，现有数据支持理论预测，不等于理论就是对的，因为可能存在其它理论，它们的结论也和经验发现一致。
  - 所以，必须总是问一个问题：是否存在其它理论解释你的经验发现？
  - 构建反事实检验（Placebo tests）：
    - 村庄选举增加村干部为群众办事的积极性，但无法解决孩子上中学的问题。
    - 用领导人任期的经济增长推算他们的个人能力，但这个推算是否是基于偶然因素得到的？

# 总之.....

在做经验研究的时候，总是想象有一个审稿人坐在你对面，追问你各种各样的问题，并想方设法用计量结果回答他。

## 五、写作

# 经济学带有强烈文学色彩

- 模仿范文
  - 找到同领域的好文章，模仿它的写作框架和技巧
- 几个关键：
  - 说清楚文章在文献中的定位；
  - 说清楚自己的故事；
  - 详细说明数据来源；
  - 不要躲避，直面你的假设和数据局限，承认它们，但认真地为自己辩护；
  - 条理清晰，不要只写给自己看，而是时刻想象是写给读者看；
  - 行文做到有血有肉，重要的等式需要直观的经济学解释。

# 尊重规范

- 文字
  - 符合语法；
  - 精练；
  - 不要有打字错误。
- 引用
  - 出现在文章中的文献，一定要在参考文献中出现；反之亦然；
  - 引用和参考文献体例符合刊物的要求。
- 图表
  - 认真按照刊物要求制作。

# 最后.....

- 在把文章送出去之前，自己务必通读两遍

- 切记：

如果你自己都不愿读自己的文章，你如何期望其他人读你的文章？