

计量经济学的前世今生（上）：前世篇



微信公众号: shushuojun

微博: @数说工作室网站

从 17 世纪的微积分到 1920 年代的推断统计学，诸大神们为计量的形成发展奠定了理论基础，此后计量经济学历经了四个时期：

- 20 世纪 20 年代中~40 年代末：经典计量经济学产生与形成；
- 20 世纪 50 年代初~70 年代中：经典计量经济学发展阶段；
- 20 世纪 70 年代末~90 年代中：现代计量经济学形成阶段；
- 20 世纪 90 年代末~现在：现代计量经济学发展阶段；

➤ 计量经济学诞生之前的时代：诸神们奠定了伟大的理论基础

• 17 世纪 “微积分” 被提出



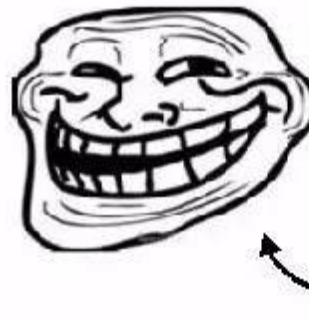
牛顿



莱布尼茨



某学渣



某学霸

• 1809 年 “最小二乘法” 得以应用



高斯

1809 年在我的著作《天体运行论》中使用了最小二乘法

三年前(1806 年)我就发现了最小二乘法



勒让德

二人曾为谁最早创立最小二乘法原理发生争执

• 1821 年 “正态分布” 得以应用发展



高斯

还是我。我率先将其应用于天文研究

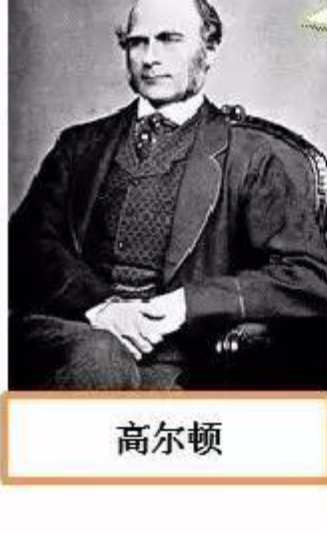
我后面还要出现.....

.....



勒让德

• 19 世纪末 “回归” 的概念被提出

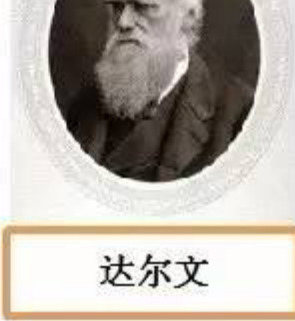


高尔顿

我在 1877 年发表的种子研究结果中，指出“回归到平均值”现象存在

“回归”一词的起源

表哥你真厉害！



达尔文

• 20 世纪 20 年代 “统计推断” 和 “假设检验” 理论的建立



内曼 Neyman

建立了假设检验的一种严格的数学理论



费雪

我论证了方差分析原理和方法；我最早使用“最大似然法”，对了，这个名字也是我起的；我创立了统计推断学；我还.....

那个，不好意思，“最大似然法”最早还是我先提出的。



高斯

统计学以费雪为分界点，从“描述性统计学”迈向了“推断统计学”

至此，数理统计的理论框架基本形成

➤ 20 世纪 20 年代中—20 世纪 40 年代末：经典计量经济学的产生与形成

• 1926 年 挪威经济学家费里希提出 “Econometrics”，它标志着计量经济学的诞生



费里希 (R.Frisch)

我不如模仿生物计量学 (Biometrics)，提出一个计量经济学 (Econometrics)



计量经济学诞生！

• 1930 年 世界计量经济学会成立



世界计量经济学会

• 其举办的世界计量经济学会是全球规模最大、水平最高的经济学会；

• 每 5 年召开一次；

• 2010 年中国承办，也是第一次发展中国家承办；

• 1933 年 由世界计量经济学会成立创办的学术刊物《Econometrica》出版，标志着计量经济学作为一个独立学科正式诞生了



Econometric

• 《Econometrica》是经济学领域顶级 top2 的期刊；

• 与同为 top2 的美国经济评论(American Economic Review,AER)不分伯仲；



AER

计量经济学成为独立学科！



- 30 年代，计量经济学研究对象主要是个别生产者、消费者、家庭、厂商等。基本上属于微观分析范畴。
- 40 年代起，计量经济学研究从微观向局部地区扩大至整个社会的宏观经济体系，如国民消费、投资、失业问题等。

计量经济学诞生后，被不断完善发展，并被大规模的运用于经济波动、国际发展战略和经济政策制定，发展成为现代计量经济学，经历了辉煌的后世时代.....