

浅谈经济学中的实证分析方法

张瑜晴¹ 熊义杰²

(1. 青岛大学 山东 青岛 266071; 2. 西安理工大学 陕西 西安 710054)

实证分析(Empirical Analysis)是社会科学研究的重要方法之一,主要着眼于当前社会或学科现实,通过实例和经验等借助于一定的科学方法进行推理说明,以验证所提出的假设是否属实,就属于实证分析。也就是说,通常总是先有假设,然后才收集事实材料进行检验或验证,结果自然是两个方面,即或者是证实(真实),或者是证伪(虚假)。

英文Empirical的含义是“经验主义的,以经验或观察为依据的”,也就是说,更准确的翻译应当为“经验分析法”。不过,国内社会科学的研究文献中已经习惯地接受了这种说法。“实证”对应的反义词是“规范”,“经验”对应的反义词是“理论”。与“实证分析”对应的即“规范分析”。

(Normative analysis)是在20世纪60年代后期美国管理心理学家皮尔尼克(S. Pilnick)提出的一种方法,作为优化群体行为、形成良好组织风气的工具。是团队建设中经常用到的一种工具。规范分析涉及已有的事物现象,需要对事物运行状态做出是非曲直的主观价值判断,力求回答“事物的本质应该是什么”。实证讲是什么比较客观,通常不做任何评价,只给你一个客观道理,客观描述事物存在的一个状态。规范就是做评价,需要根据已有的理论或逻辑进行判断,有自己的主观观点,描述事物应该是一个什么样的状态。

这里举一个简单例子:根据经济学理论,一个人的消费支出取决于他可支配收入的多少,如果假定个人消费为C,可支配收入为Y,则有: $C=a+bY$

这就是一个假定。现在我们需要收集数据,对这个假定进行验证。假定我们对10名大学生假期实习进行调查后得到的数据是:

表1 10名大学实习生的月收入与月消费

序号	月收入Y	月消费C
1	2080	525
2	2117	536
3	2189	546
4	2216	565
5	2284	603
6	2339	641
7	2402	674
8	2467	689
9	2479	721
10	2515	737

现在我们使用上述数据构造回归方程,得到的结果是:
 $C=538.32 + 0.5033Y$

经检验回归方程中的两个参数a和b的估计值均为有效参数,因此,可以得出结论:上述假定成立,即一个人的消费支出取决于他可支配收入的多少,是成立的。这就是一个实证分析。当然,这里面涉及到计量经济学的一些基本理论,我们这里不做赘述。

另外一个实例,面对严重的就业压力,大学生创业成了学术界关注的一个热门话题。然而,大学生创业的成功率究竟受什么因素影响,应该如何提高大学生创业的成功率,就

是一个值得认真研究的重要课题。为此,基于已有的相关研究,我们可以设计如下的问卷,进行必要的问卷调查。

1.您的年龄是? 设为X1

如果是20-22,选1,23-25,选2,26-28,选3,28岁以上,选4。

2.您的专业是? 设为X2

如果是理工科,选1,文科,选2。

3.您的性格属于? 设为X3

如果属于外向型,选1,内向型,选2。

4.工作经验, 设为X4

无工作经验=1,一年以下=2,1到2年=3,2到3年=4,3到4年=5,5年以上=6。

5.个人财务状况, 设为X4

零收入=1,低收入=2,足以养活自己=3,收入丰厚=4。

6.家庭财务状况, 设为X5

贫困=1,温饱=2,小康=3,富裕=4。

7.创业初期资金规模, 设为X6

10万以下=1,10到20万=2,20到30万=3,30到40万=4,40到50万=5,50万以上=6。

8.团队人数, 设为X8

人数与数值对应,5人以上均以5代之。

9.创业教育, 设为X9

从未有过=1,听过一些讲座=2,学过几门课程=3,受过系统训练=4。

10.创业动机, 设为X10

生存需要=1,就业需要=2,积累经验=3,自我实现=4。

11.创业榜样, 设为X11

有=1,无=2。

12.创业环境, 设为X12

无政府支持=1,有政府舆论支持=2,有少量的资金支持=3,有较大力度的资金支持=4。

上述问题均属于自变量。因变量(设为Y)的调查相对地要难一些,可以分以下几种情况调查:

破产边沿=1,总是亏损=2,能自给自足=3,成长良好=4。

也可以将上述四种情况设为百分数,破产边沿=0,总是亏损=0.25,能自给自足=0.75,成长良好=1。这样回归分析的输出结果即成功的百分比,即成功率。也可以由被调查者在0到100%的成功率之间直接选择。

有了上述的调查数据,大学生自主创业的成功率究竟会受到哪些因素的影响,我们就可以通过实证分析(回归)的方法进行检验了。

实证分析是经济计量模型和数据的有机结合,模型需要大量的数据支撑,但是,毕竟数据调查获取时会存在一定偏差,甚至数据的扭曲,为此结论也会考虑适当的误差值。模型毕竟就是将复杂的计量简单化,可操作化,为某些经济管理提供了量化、提供了可参考的事实依据。

指导老师:熊义杰