



廈門大學

XIAMEN UNIVERSITY

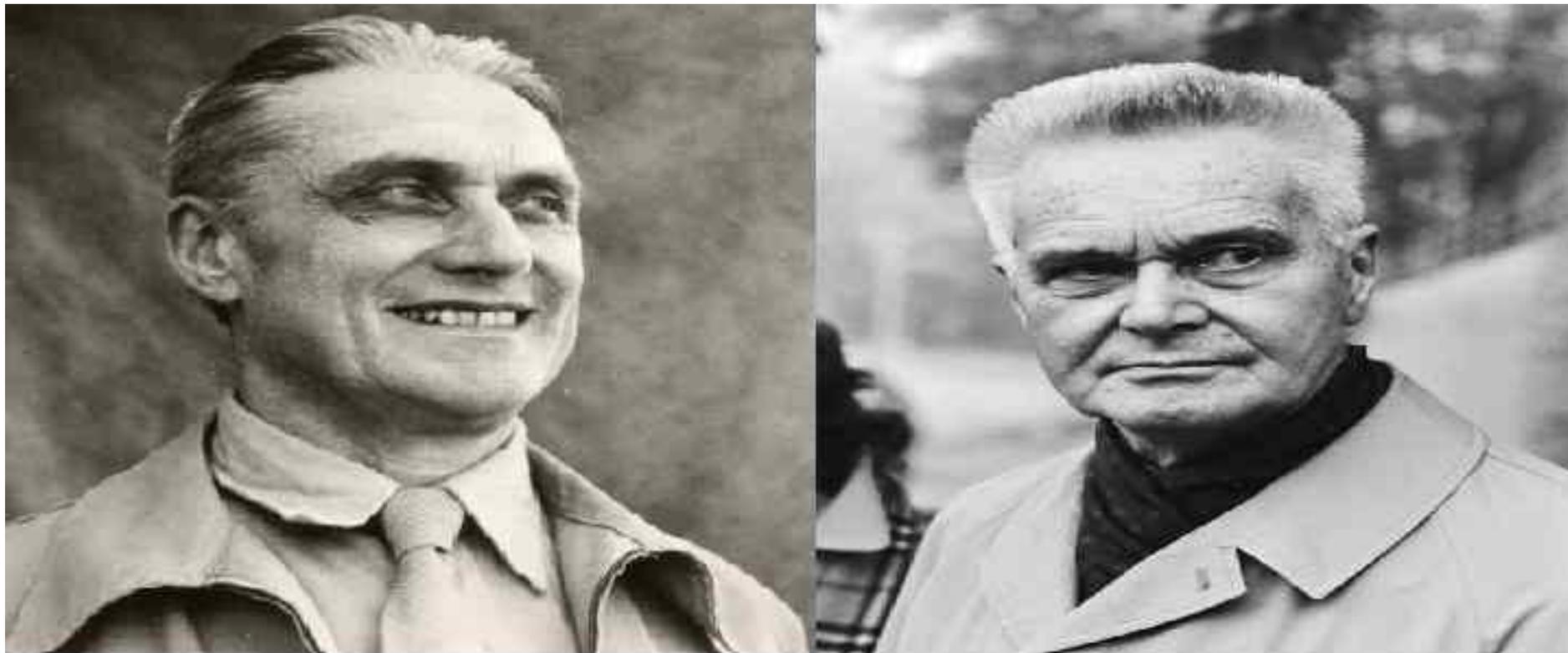
计量经济学训练与金融学研究 从实证经济学的可信性革命谈起

方颖

厦门大学

2020年3月14日

计量经济学奠基人



Ragnar Frisch

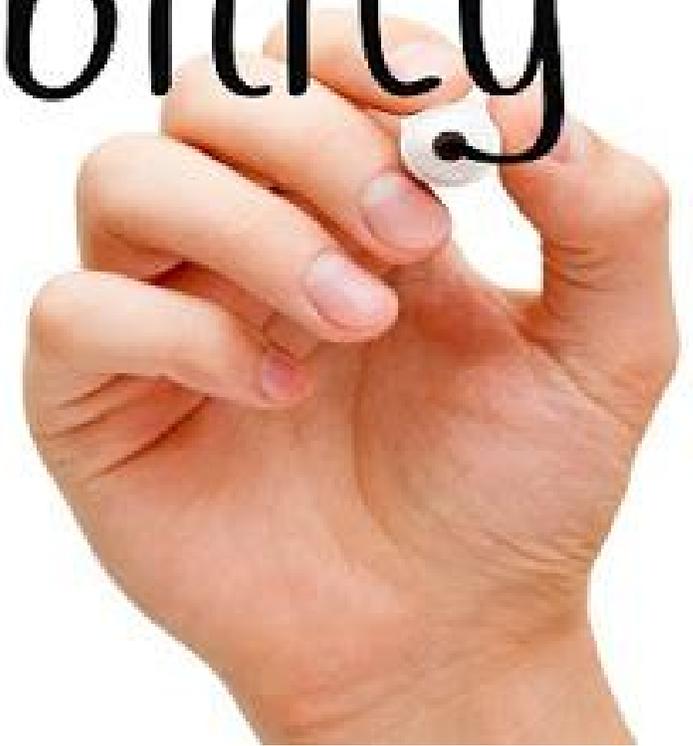
Norway

Jan Tinbergen

Netherlands

(1969)

Credibility



1

David Hendry (1980) : Econometrics:
Alchemy or Science ?

2

Econometrics =
Economics + Tricks ?

3

Edward Leamer (1983): Let's Take the
Con Out of Econometrics

4

Angrist and Pischke (2010): Credibility
Revolution in Empirical Economics

为何实证研究的可信性广受质疑？



计量经济学
本身的问题

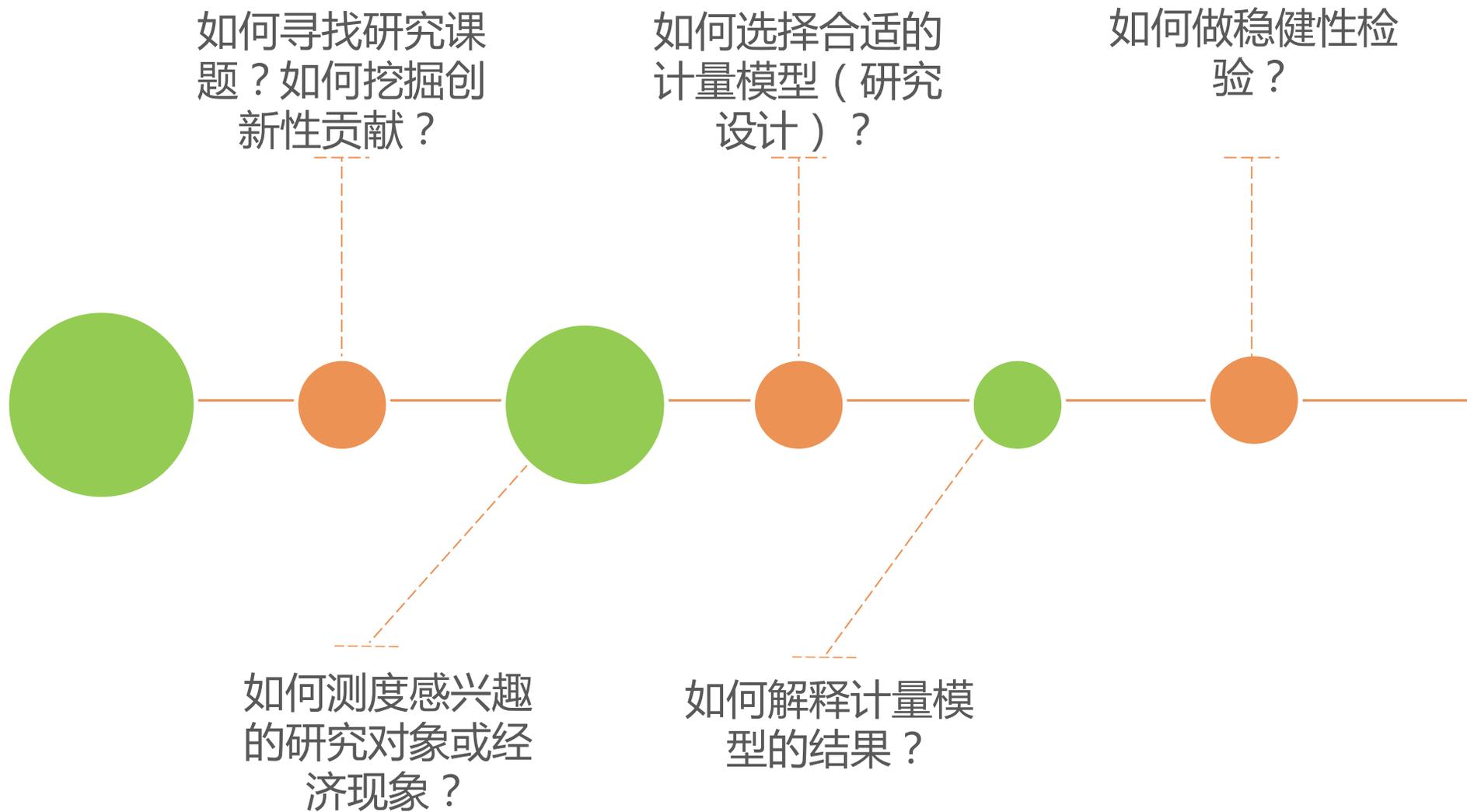


研究者的问题I：
计量经济学的
误用



研究者的问题II：
计量经济学的
滥用

计量经济学训练如何提高金融学实证研究？



几个研究实例



资源诅咒

中国是否存在“资源诅咒”现象？



环境信息披露

中国的环境信息披露政策是否有效？



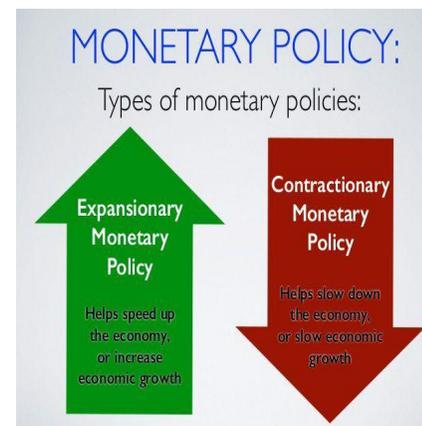
排污费征收

中国的工业二氧化硫排污费收费改革是否有效？



绿色信贷

绿色信贷政策评估



宏观政策

宏观经济政策评估

A fragile inference is
not worth taking seriously.





感谢聆听