

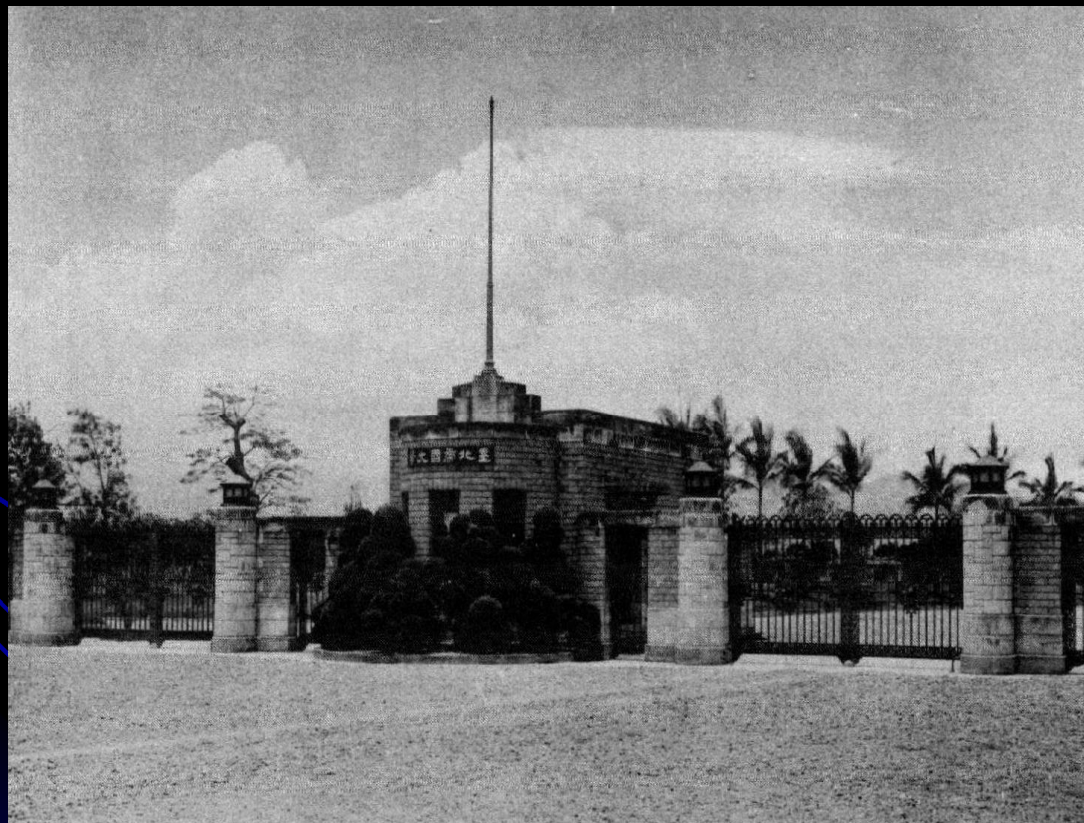
臺灣經濟計量研究的 過去, 現在與未來

中央研究院經濟研究所
管中閔

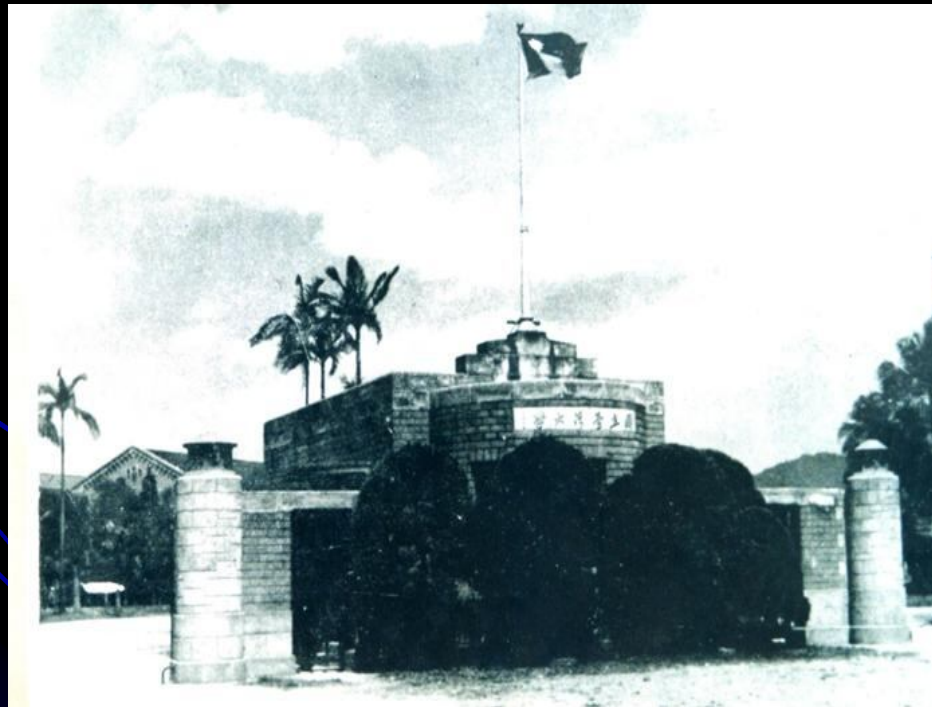
台灣經濟計量學會成立大會
2007 年 11 月 24 日

台灣的經濟學教育與研究：起源

- 台北帝國大學 (1928): 文政學部－經濟講座

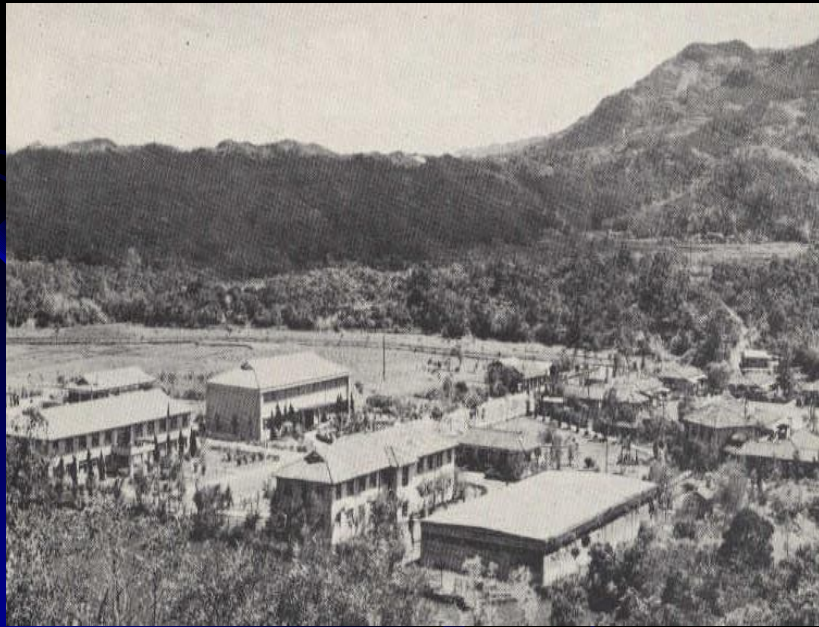


- 國立台灣大學 (1945):
 - 法學院經濟系 (1947)
 - 經濟系碩士班 (1956)
- 早期師資：施建生, 林葭蕃, 張漢裕等



台灣的經濟學教育與研究：新力量

- 中央研究院經濟研究所
 - － 籌備處 (1962), 正式成所 (1970)
 - － 籌備處主任與首任所長: 邢慕寰先生



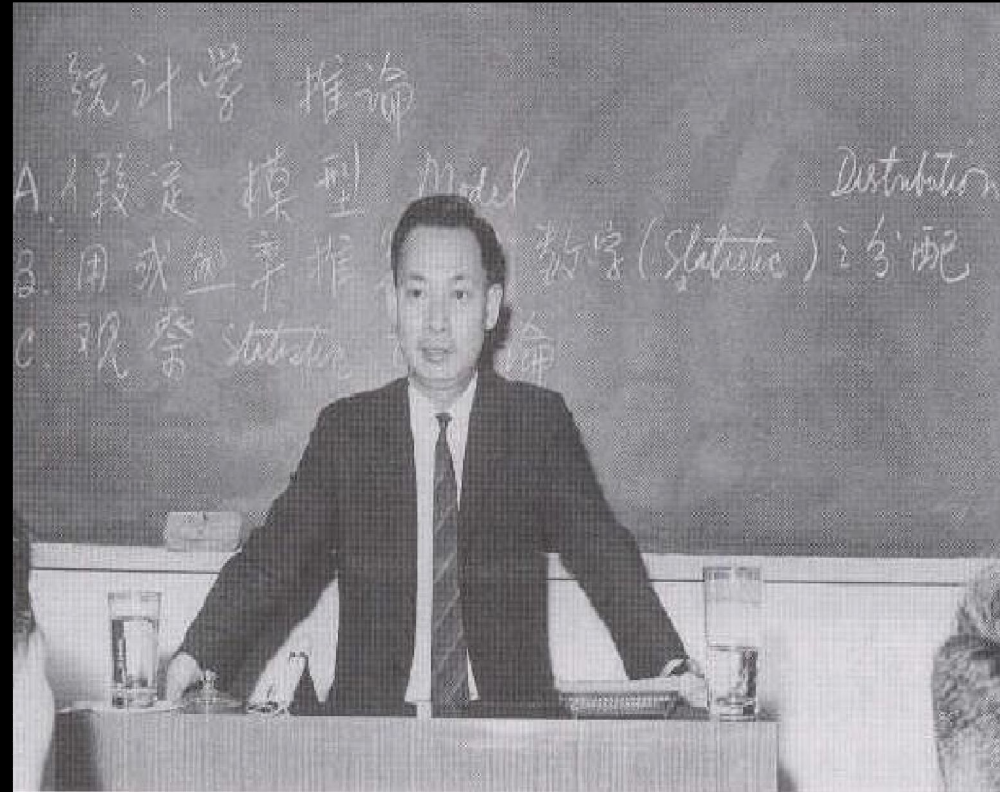
- 暑期講學班 (1966): 劉大中, 蔣碩傑, 顧應昌, 鄒至莊等在美任教的學者



劉大中



鄒至莊



1966年鄒至莊講學於中央研究院經濟研究所。

台灣的經濟學教育

- 經濟系: 東吳 (1954), 東海 (1956), 中興 (1961), 輔仁 (1963), 淡江 (1964), 文化 (1964), 政大 (1967), 逢甲 (1970), 清華 (1984); 90 年代後增加九系
- 碩士班: 文化 (1962), 東吳 (1970), 政大 (1972), 逢甲 (1976), 中興 (1979), 清華 (1988); 90 年代後增加 12 班
- 博士班: 台大 (1968), 文化 (1974), 政大 (1985), 中興 (1987), 東吳 (1989), 中正 (1992), 東華與逢甲 (2000), 清華 (2004), 中央 (2005)

臺灣的經濟研究

- 第一次經濟國際學術會議：1967
 - 第一個經濟博士班 (劉大中與林霖)：1968
 - 主計處全國總供需模型：1969
- 邢慕寰與中研院經濟研究所
 - 自行培訓, 遴選人員出國學習
 - 大台北地區經濟學研討會 (于宗先)
 - 臺灣經濟預測 (于宗先)
 - 開始對台灣經濟發展的研究

臺灣的經濟研究

- 經濟學術期刊

- 經濟論文叢刊：年刊 (1970 - 1986)，半年刊 (1987)，季刊 (1988 -)
- 經濟論文：半年刊 (1973 - 1995)，季刊 (1996 -)
- 其他，如財經學報 (1960 – 1973)，後改為經濟學報，經濟研究

- 經濟計量的相關研究研究

- 政策研究，總體計量模型
- 以實證研究為主

台灣的財經政策

- 梨山會談 (1967): 劉大中, 蔣碩傑, 顧應昌, 費景漢與蔣介石會談, 討論國家資源的籌措與分配

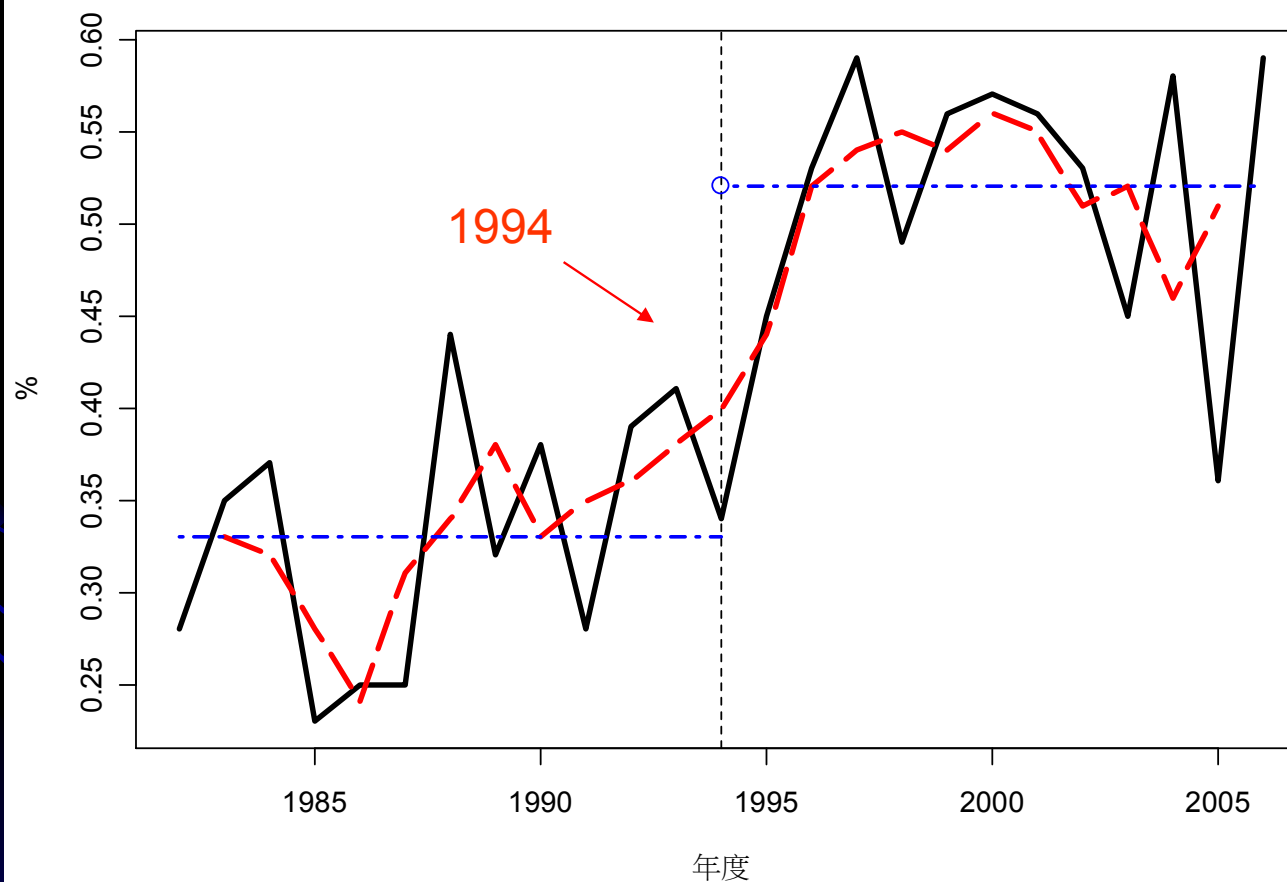


- 1970 年代「財經六院士」：劉大中, 蔣碩傑, 顧應昌, 邢慕寰, 鄒至莊, 費景漢致力推動經濟自由化, 並強調政策與市場相配合
 - 1974: 「今後台灣財經政策的研討」
 - 1976: 「台灣財經政策之再研討」
 - 1978: 「經濟計劃與資源之有效利用: 五院士建言」
- 其他: 國民所得統計, 產業關聯表, 賦稅改革, 獎勵投資條例, 滙率與利率政策, 加工出口區等

台灣的經濟計量研究

台灣的計量相關之研究成果

國內計量相關論文佔發表論文之比率：1982-2006



計量研究成果的計量分析

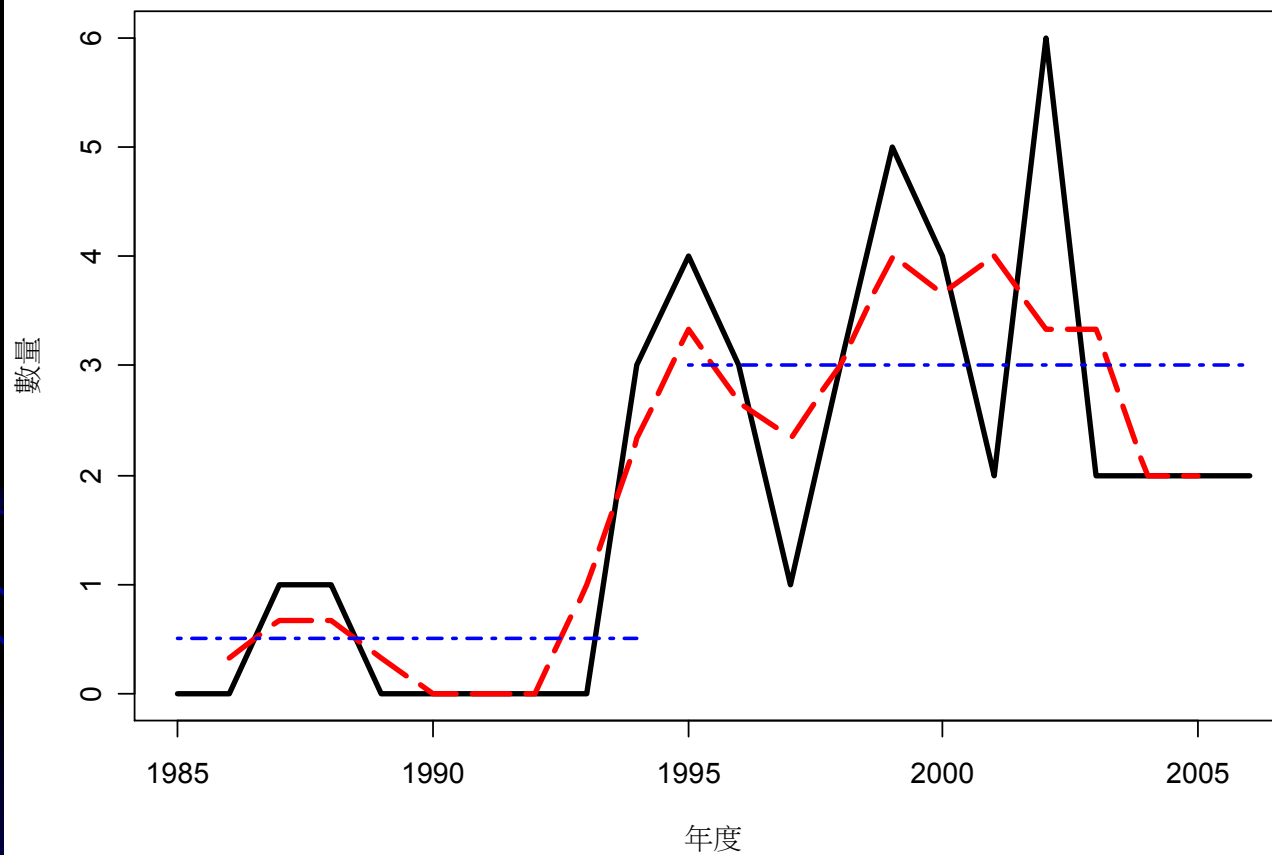
- Sup-Wald test for structure change = 47.86, significant at 1% level
- Change point: 0.52 (between 1994 and 1995)
- Sample averages before and after change:
 - 0.33 (1982 ~ 1994)
 - 0.52 (1995 ~ 2006)
- Autocorrelations:
 - $\text{Corr}(y_t, y_{t-1}) = 0.58$ (1982 ~ 2006)
 - $\text{Corr}(y_t, y_{t-1}) = -0.001$ (1982 ~ 1994)
 - $\text{Corr}(y_t, y_{t-1}) = -0.48$ (1995 ~ 2006)

台灣實證研究的推動力量

- 新計量方法的發展
 - 時間序列方法: Unit root, cointegration, VAR, nonlinear (MS, threshold) models
 - 財務計量方法: GARCH-type, SV, ACD models
 - 個體計量方法: GMM, treatment effect, quantile regression, panel data models
- 更多學者的投入
- 新資料：全民健保，PSFD 等
- 新領域的發展

台灣的計量方法研究

在國際主要計量期刊論文的发展：1985-2006



台灣的計量研究：過去與現在

- 1990 年代中期可以視為一個改變點
- 以實證研究為主，計量方法的研究仍薄弱
 - 90 年代中期以前幾乎空白
 - 90 年代中期以後全台平均一年三篇
 - 研究「人口」相對偏少，研究的議題亦有限
- Ranking in *Econometric Theory*, 2007
 - Theory: 115 (89-05), 91 (95-05), 62 (00-05)
 - All: <150 (89-05), 126 (95-05), 86 (00-05)

什麼是 台灣經濟計量研究的未來？

未來的發展方向

- 實證研究

- 善用台灣特有資料庫 (全民健保，PSFD 等)
- 加強新計量方法的應用
- 開創新觀念與新議題

- 計量方法研究

- 修正改進現有之計量方法
- 新模型與新方法
- 開創方法上的新觀念

以計量方法改進政策研究

- 什麼不是政策研究？

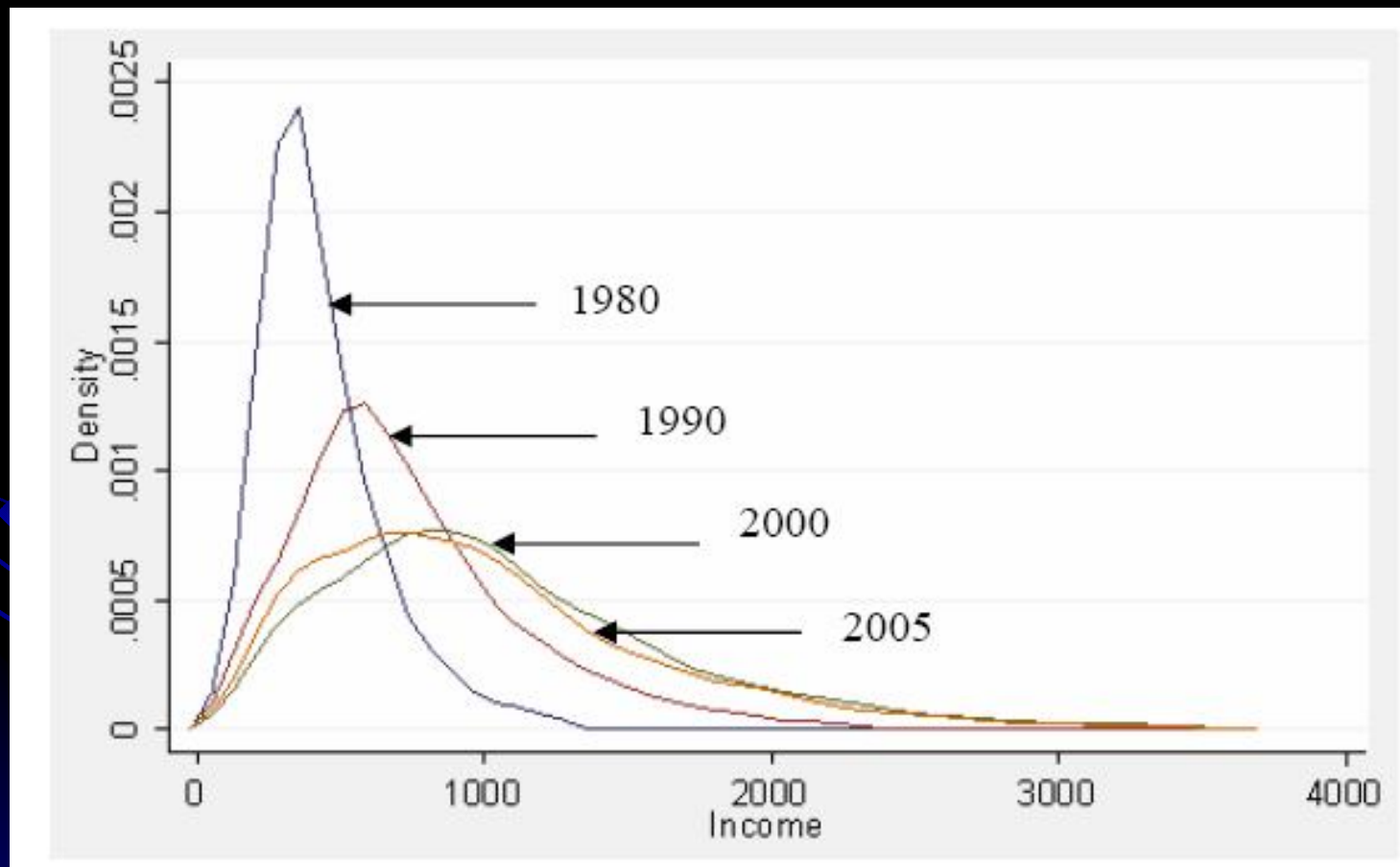
- 報紙評論或雜文不是政策研究
- 只看走勢圖或者只比較敘述統計量也不是政策研究
- 計量實證不會自動成為政策研究
- 沒有政策意涵或政策評量的研究不是政策研究

以計量方法改進政策研究

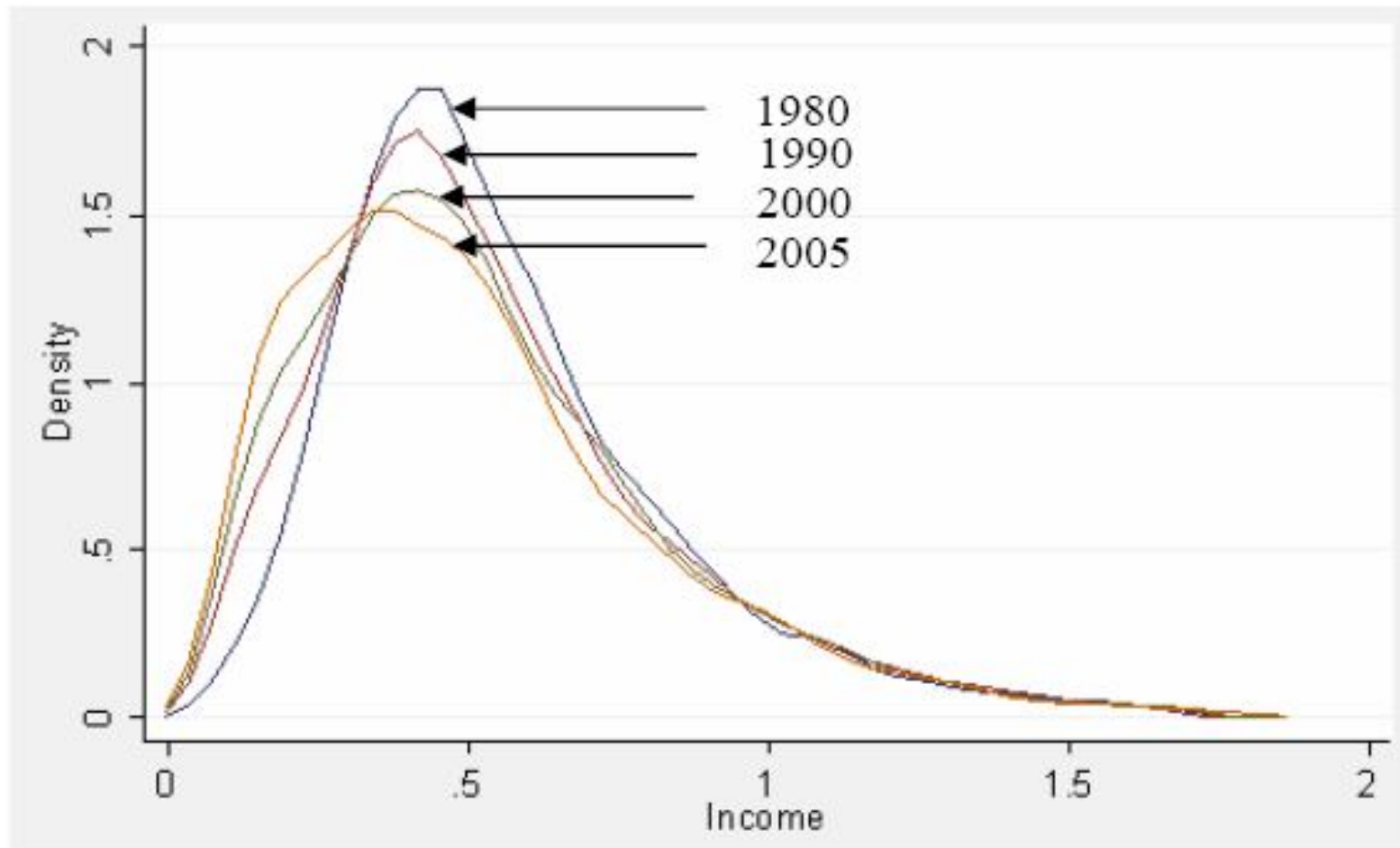
- 什麼是學術界該做的政策研究？
 - 要有分析性 (analytical)
 - 應用適當的計量模型與方法，避免 data mining
 - 要有政策意涵與嚴謹的政策評量
- 我們的政策研究也該隨著時代進步
 - 政策研究可以引導新計量方法的發展
 - 好的政策研究一樣可以成為學術界具有指標性的研究成果 (想想 Heckman, Granger, Hamilton, Stock and Watson, etc. etc.)

例: 所得 M 型分配?

不同年度的實質所得分配。



不同年度的相對所得分配。



家戶特性

所得最低與最高 **20%** 家戶特性跨年度比較。

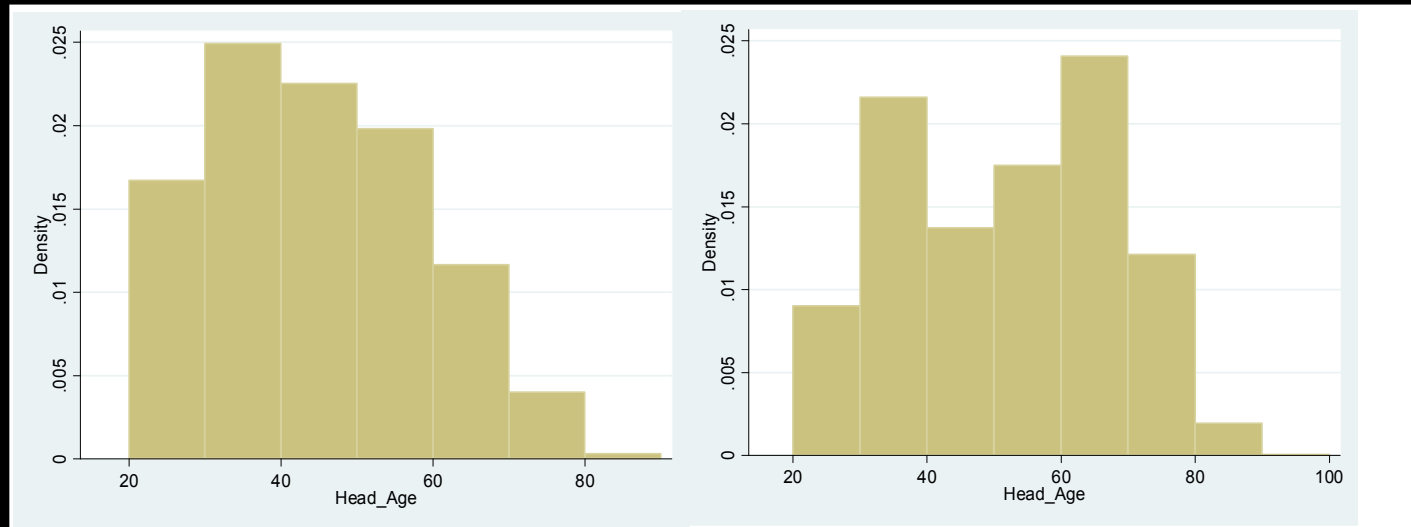
單位：新台幣元；%

資料年度	變數	所得最低20%家戶		所得最高20%家戶	
		平均數	標準差	平均數	標準差
1980	家戶總所得	193,046	51,605	826,806	318,421
	儲蓄率	0.15	0.25	0.38	0.17
1990	家戶總所得	281358	93152	1490752	609403
	儲蓄率	0.10	0.53	0.36	0.21
2000	家戶總所得	374,531	121,339	2,195,486	776,717
	儲蓄率	0.08	0.34	0.28	0.20
2005	家戶總所得	330,320	102,708	2,145,175	824,832
	儲蓄率	0.00	0.37	0.27	0.19

(續)：所得最低與最高 20% 家戶特性跨年度比較。

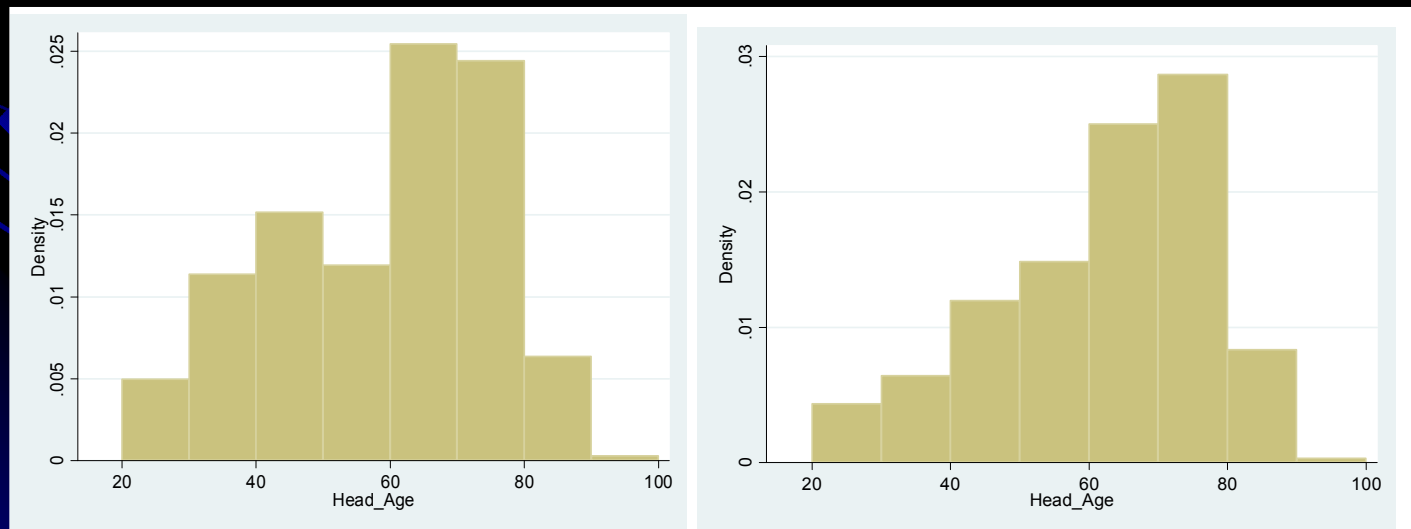
資料年度	變數	所得最低20%家戶		所得最高20%家戶	
		平均數	標準差	平均數	標準差
1980	戶長年齡	43.92	14.26	43.00	11.27
	戶長為女性	0.14	0.35	0.05	0.21
	家戶規模	3.66	1.89	5.67	2.37
	家戶所得人數	1.32	0.55	2.37	1.23
1990	戶長年齡	51.29	16.23	43.29	10.95
	戶長為女性	0.23	0.42	0.07	0.26
	家戶規模	2.66	1.55	4.96	1.93
	家戶所得人數	1.16	0.38	2.46	1.14
2000	戶長年齡	58.44	16.48	45.08	10.01
	戶長為女性	0.36	0.48	0.11	0.32
	家戶規模	1.93	1.02	4.50	1.68
	家戶所得人數	1.05	0.23	2.37	1.03
2005	戶長年齡	61.65	15.50	45.82	9.99
	戶長為女性	0.36	0.48	0.15	0.36
	家戶規模	1.87	0.88	4.24	1.54
	家戶所得人數	1.04	0.19	2.30	0.97

不同年度所得最低 20% 家戶的戶長年齡分佈



1980

1990



2000

2005

2005 年低所得家戶構成

所得最低 20% 家戶

- 戶長年齡超過 60 歲者佔 61%
- 戶長年齡小於 60 歲者女性戶長佔 45%
- 40 歲以下：無配偶者 86%
- 40--60 歲：無配偶者 66%
- 家戶規模 1.87；所得人數 1.04

我們自己應該做些什麼？

- Seminar, workshop and conferences
 - 討論的風氣，與國內學者間的互動
 - 與國際學界一齊發展進步
- 更高的學術標準
 - 不要只數論文篇數，也不要只看 SSCI
 - 但是要追求學術上可能的 impact
- 重要的是：保持對學術研究的熱忱
- 更要有讓台灣經濟計量研究在國際間出頭的雄心壯志



*You may say I'm a dreamer
But I'm not the only one
I hope someday you'll join us
And the world will live as one*

--John Lennon, 1971