

中国政府消费与城乡居民 消费状况比较研究: 1978 – 2010^{*}

薛 鹏 徐康宁

(东南大学经济管理学院 211189)

内容摘要: 消费需求是国民经济运行管理中一个很重要的环节,也是当下宏观经济调控的重点所在;而政府消费与居民消费的关系及其对宏观经济的影响则是其中一个较重要的问题。采用对比分析和计量估计方法,以统计资料为依据,分别从消费倾向、消费支出、国际比较和模型计量四个方面,全面分析和研究了 1978 年改革开放以来我国政府消费与城乡居民消费状况,并得出了一些有意义的观点和结论。

关键词: 政府消费 城乡居民消费 经济增长 比较研究 向量误差修正模型

中图分类号: F812.45 文献标识码: A 文章编号: 1005 - 1309(2012)06 - 0051 - 016

引 言

2010 年 3 月 14 日,第十一届全国人民代表大会第四次会议审查批准了国务院提出的《中华人民共和国国民经济和社会发展第十二个五年规划纲要(草案)》(以下简称“十二五”规划)。“十二五”规划的主题是转变方式,开创科学发展新局面,目标是着力提升中国经济的增长质量和核心竞争力,建设更加美好幸福的中国社会。基于此,“十二五”规划中明确提出:坚持把经济结构战略性调整作为加快转变经济发展方式的主攻方向,构建扩大内需长效机制,促进经济增长向依靠消费、投资、出口协调拉动转变;建立扩大消费需求的长效机制,把扩大消费需求作为扩大内需的战略重点,通过积极稳妥推进城镇化、实施就业优先战略、深化收入分配制度改革、健全社会保障体系和营造良好的消费环境,增强居民消费能力,改善居民消费预期,促进消费结构升级,进一步释放城乡居民消费潜力,逐步使我国国内市场总体规模位居世界前列。

实际上,自 20 世纪 90 年代中期的“软着陆”以来,内需不足一直都是困扰我国宏观经济的现实难题。这主要与三个方面有关,一是我国经济对“外需”的粘性较大^[1],一旦外需层面发生危机,刚刚还处于热乎的中国经济可能马上就面临趋冷的风险;二是长期以来对经济增长的迷恋,侧重投资,容易使部分行业出现较严重的产能过剩^[2],也容易造就财富集中^[3],三则于改革的进程和市场的结构有关。近代以来国际经济发展的实践经验表明,内需不足是隐藏在一国经济增长中的炸弹,存在爆发的可能和危险。近些年,党中央、国务院非常重视内需问题,本届中央政府更是将民生和科学发展作为执政为民的重要任务,下大力度狠抓“三农”、改善民生,严格要求和落实节能减排与转变发展方式等。

收稿日期: 2012 - 03 - 25

^{*} 基金项目: 本项研究得到 2009 年国家社科基金重点项目“当前国际资源环境变化背景下加快我国经济发展方式转变的研究”(09AZD047)的资助。

我国政府重视内需,实质是统筹国内、国际两个市场,以减小外部经济对华的不利冲击,促使拥有 13 亿多人口的中国经济早日步入“内生增长、创新驱动”的轨道之中,致力中国经济的健康、均衡和长远增长。那么,自 1978 年改革开放以来,处于消费需求层面的我国政府消费和居民消费的现状是什么?和国际上一些国家相比,我国的政府消费和居民消费有怎样的特点和趋势?我国政府消费和城乡居民消费关系如何?当前扩大居民消费需求应如何采取措施?

本文拟对这几个问题进行分析和回答,主要采用对比分析和计量估计方法,即用数据和事实,研究和比较我国政府与城乡居民的消费状况。文章的结构如此安排:第一部分是対前人相关研究的简要述评;第二至第五部分是文章的主体内容,分别从消费倾向比较、消费支出比较、国际比较和计量估计四个方面对我国政府和城乡居民的消费状况进行研究和阐述;第五部分为全文的结论和一点启示。

一、文献综述

国际上, M. J. Bailey(1962, 1971)^[4, 5]较早的涉及政府消费与居民消费的研究,并引发了后来的大量研究。Bailey(1971)、Hall(1980)^[6]、Barro(1981, 1989)^[7, 8]认为政府消费的变化对经济总量的影响取决于政府消费与私人消费间的关系,他们对此建立了模型。Kormendi(1983)^[9]和 Aschauer(1985)^[10]拓展了 Barro 模型,进一步将“生命周期—持久收入假说”应用于对政府—居民消费的研究中。通过建立在消费函数跨期最优化基础上的一阶条件,将对政府—居民消费的研究纳入到现代消费理论的分析体系中。Kormendi(1983)、Aschauer(1985)和 Bean(1986)^[11]运用美国不同的样本数据发现政府消费和私人消费间存在弱的替代效应。Ahmed(1986)^[12]使用英国跨度较长的样本数据也发现了政府消费和私人消费之间的替代证据。然而, Campbell 和 Mankiw(1990)^[13]运用战后美国的样本数据集却没有发现任何的显著效应。Karras(1994)^[14]通过对一部分跨国的研究发现政府消费和私人消费存在互补关系。对于这些不确定的结果, Ni(1995)^[15]进行了验证,他指出私人消费和政府消费的关系易受效用函数的选择和利率测量的影响。与这些研究同时,政府和私人消费的关系对构成当代宏观经济学主流范式的随机动态一般均衡模型的理论 with 实证研究,都已发挥了重要作用。

Paul Evans(1997)^[16]使用了包含外生和内生增长的简单随机增长模型,研究表明:如果增长是外生的,经济增长率应该是均值稳定;如果增长是内生的或任何影响投资的变量出现波动,那么增长率也会波动。假如也只有假如增长是内生的,那些完全用于政府消费的部分产出的永久性变化将会永久性的影响经济增长率。通过检验,文章没有发现增长是内生的迹象。此外,即使增长是内生的,证据表明内生的程度可能较小。Masakatsu Okubo(2003)^[17]以日本的季度数据为样本,应用两步估计程序,发现政府消费和居民消费的关系是互补或者无关。Fiorito 和 Kollintzas(2004)^[18]将政府消费划分为两类:公共产品(public goods)和有益品(merit goods)。通过构建一个总的政府支出数据集,运用 GMM 估计了一个相对一般永久收入模型,考察了欧洲 12 国政府消费和私人消费的关系。估计强烈表明,公共产品替代私人消费,而有益品和私人消费互补。有益品和私人商品的关系结果是比公共产品和私人商品的关系要强烈。因此,总的政府消费和私人消费是互补的。Yum K. Kwan(2006)^[19]使用面板协整回归发现东亚 9 国政府消费和居民消费具有显著的正的替代弹性;中国、香港、日本、韩国的替代弹性倾向于相近而且适中,马来西亚和泰国的替代性强,而印尼和新加坡呈互补关系,菲律宾的替代弹性接近于零。

国内的相关研究也是侧重应用计量经济模型进行估计。袁晓玲、杨万平(2008)^[20]运用协整、格兰杰因果检验和向量自回归模型,利用 1978—2006 年的年度经济数据对我国政府消费、居民消费和经济增长的关系进行层次递进的实证分析,结果表明:我国居民消费、政府消费和经济增长之

间存在长期均衡关系,居民消费增长是经济增长的因果原因,政府消费增长是居民消费增长的因果原因。邹洋(2009)^[21]将欧拉方程和“有效”消费理论结合起来,利用1985-2005年我国的统计数据分析了政府消费和公债发行对居民消费支出的影响。并考察了政府收入和公债发行对政府消费支出的影响。结果表明:(1)当期的政府消费支出对居民消费支出的影响较大;(2)当期的国内外公债发行对居民消费支出的影响较小,但是滞后一期的国内外公债发行对居民消费支出合计及其中的城镇居民消费支出的影响较大,说明居民在某种程度上视政府公债为财富;(3)政府消费支出受政府财政收入的影响比较大,而受国内外公债发行的影响较小。

姜洋、邓翔(2009)^[22]基于代表性消费者均衡模型,利用11个省份的面板数据分析政府消费与居民消费的关系及其影响程度。面板数据的单位根检验和协整分析表明:中国的政府消费对居民消费产生长期替代效应,替代系数为1.04-1.44;进一步分析省际的替代系数也验证了中国政府消费对居民消费的替代效应。由此建议:节制政府消费支出,国民收入分配应更多地向居民倾斜,同时通过减税和加大转移支付力度等方式提高居民的消费倾向。徐小鹰(2011)^[23]利用1999-2008年我国31个省(市、自治区)相关数据,采用面板协整检验分析了我国城乡居民消费和政府消费分别对经济增长的影响。实证分析表明,城镇居民消费对经济增长促进作用更为明显,但区域之间又有所差别,东中部经济增长主要来自于城镇居民消费的推动,而西部则更多倚重于农村消费的贡献;政府消费也会促进经济增长,但不及城乡消费作用显著。申世军、马建新(2008)^[24]还用Theil指数对中国八大区域消费差异进行了区域内和区域间差异的分解,发现中国区域消费总体差异呈现出上升趋势,并且区域间差异逐渐处于主导地位。政府消费差异大于居民消费差异。就当前消费而言,需要重点关注东部沿海和北部沿海,因为二者区域内差异最大。

1978年改革开放以来,国内的一些学者对我国城乡居民的消费状况也一直在关注和研究。凌宏城(1982)^[25]指出消费结构是国民经济中一系列重大比例因素之一,他分析了影响消费结构变化的主要因素,并对我国城乡居民消费结构发展变化的主要倾向进行了论述。林白鹏(1994)^[26]实证分析了1985-1990年间我国城乡居民收入水平、消费水平和消费倾向以及储蓄存款等的差别,得出一些结论并提出对策。范剑平、向书坚(1999)^[27]着重讨论了人口城乡二元社会结构对我国居民消费率的影响,并提出通过加快农村人口城市化为扩大内需扫清障碍的对策建议。刘建国(2002)^[28]通过对我国同一收入层次的城乡居民消费倾向的比较,进一步论证了“农户消费倾向偏低”的假说,并从城市化角度分析了农户消费倾向偏低的原因。吴炜锋(2009)^[29]研究认为,转型时期我国城乡居民居住消费基本不能用完全消费保险假设来解释,而能较好的适用持久性收入-生命周期理论;农村居民居住消费较多的受当期收入变动的影响,而城镇居民更多的受持久性收入影响。纪江明等(2011)^[30]实证研究了城乡社会保障差异对居民消费的影响,结果表明,把城乡居民人均可支配收入差距(GINI系数)作为控制变量的情况下,我国城乡社会保障不但没有缩小城乡居民消费差距,反而加剧了城乡居民消费差距。而且,城乡居民人均社会保障差异是导致城乡居民人均消费支出差距的格兰杰因果原因。张邦科、邓胜梁(2012)^[31]运用基于持久收入和暂时收入的两种分解方法的省际面板模型检验了持久收入理论的两个假设。结果发现,我国城镇和农村居民消费与其持久收入均显著相关。城镇居民消费与其暂时收入显著相关。“ λ 假说”检验表明,我国城镇和农村居民消费对当期收入都是过度敏感的,导致持久收入理论的局限性。

综上,可以看出,过去40多年间,国内外的一些学者已对政府消费和居民消费以及经济增长进行了相关理论研究。这些研究主要是采用计量经济学的方法来分析问题,或者试图在理论上予以提炼和拓展。最近的研究还表现出了发散、交叉和细化的特征。但是,他们的研究结论不尽相同,这主要与各自所选择的计量估计方法不同和研究对象的差异有关。我国是一个城乡二元结构比较突出的国家,如果也和国际同行一样,注重从宏观上对我国居民消费和政府消费以及经济增长进行研究的话,可能会有些不够深刻,难以深入发掘一些有价值的信息。此外,除了采用计量经

济方法外,目前,尚没有文献对改革开放 30 多年来我国政府和城乡居民三者的消费状况进行全面、系统的回顾与比较。本文的研究可以弥补这一缺憾。本文紧贴当前国际和国内经济发展实际,主要从消费倾向、消费支出、国际比较、模型计量四个方面,全面分析和研究了 1978 年改革开放以来我国政府消费与城乡居民的消费状况,以期获得一些有意义的观点与结论,或形成一些合理有效的思路与对策,欲为扩大我国的消费需求做出点滴贡献。

二、消费倾向比较

消费倾向,是居民消费的意愿和能力。从 1978 年来我国城乡居民和政府平均消费倾向的时间序列数据来看,30 多年来,我国城乡居民的平均消费倾向呈下降趋势,农村居民的消费倾向从改革初期的 0.85 以上,降至近些年的 0.75 左右;城镇居民的消费倾向下降幅度较大,由改革初期的 0.9 附近,降至近些年的 0.7 以上;此间,我国政府的消费倾向是先逐渐大幅增长然后慢慢回落的“山峰”状趋势(图 1)。

经济学中,消费联系着储蓄,二者一般是此消彼长的关系。正处于城市(镇)化阶段的我国,城乡居民消费倾向逐渐下降和人均收入连年增长,无疑使各自的储蓄金额增加,尤其是城镇居民。理论推断需要实际验证,数据显示,1978-2010 年,我国城乡居民的年底人民币储蓄余额确有大幅上升:(1) 城乡居民储蓄总额从 1978 年的 210.6 亿元,增长至 2011 年的 348046 亿元,34 年间,居民储蓄规模名义增长了 1653 倍,年均名义增长率为 25.2%,远远高出国内生产总值(GDP,下同) 15.9% 的年均名义增长率。对应的,全国人均存款额由 1978 年的 21.9 元快速增加至 2011 年的约 25831.9 元,34 年名义增长了 1180 倍。(2) 分城乡角度看,30 多年来,随着城镇化、人口迁移以及城乡二元经济的发展,我国城镇居民的储蓄规模远远高于农村居民。城、乡居民人民币储蓄金额比由改革开放初期的 2.78 倍,扩大到当前的 4.3 倍左右(图 2),城镇居民的人民币储蓄额占全国人民币储蓄总额的八成多。

相反,30 多年间,我国政府的平均消费倾向表现出了整体上升态势,政府收支也几乎年年赤字,2009 年的赤字规模更是达到了空前的 7781.6 亿元。民众将钱储存起来不花,政府几乎年年赤字且持续高消费。

这就引出两个问题:第一,如何看待和解释我国经济发展中的这种现象?第二,当前努力扩大消费需求,尤其是居民消费需求的方向何在?

勤劳节俭,注重长远是中华民族的一项传统美德,祈愿“年年有余、岁岁平安”的思想便是习俗传统在人们经济生活中的亲切反映。中国人民银行周小川行长就认为,东亚国家和产油国的储蓄率高是与民族传统、文化特征、家庭结构、人口结构和经济增长阶段、社会保障体制等很多因素有关,而且,在短期内很难改变^[32]。除受传统文化影响外,再加上我国人口众多,尚处于发展阶段,普通民众出于对现实和长远的传统考虑,选择将现金储蓄起来的行为,就不难为人们所理解^[33]。而 30 多年间,城镇居民的年底人民币储蓄余额之所以增长较快,主要与我国城乡二元经济结构和 1984 年党的十二届三中全会做出的“经济体制改革重点开始由农村转移到城市”有关。据最近第六次全国人口普查数据,居住在我国城镇的人口约为 6.66 亿,占 49.68%;居住在乡村的人口约为 6.74 亿,占 50.32%。

1936 年,英国经济学家凯恩斯出版了《就业、利息和货币通论》一书,在全世界掀起了一场“凯恩斯革命”,形成了凯恩斯主义这一新的名词并使得这一名词在世界范围内流行^[27]。凯恩斯主义强调有效需求和政府干预的经济思想理论,拯救了陷入危机中的资本主义世界^[34],也对改革开放后的我国宏观经济产生了重要影响^[35-36]。上世纪 90 年代至今,我国宏观经济先后遭遇经济疲软、亚洲金融危机和美国金融危机等困境,为振兴经济、应对危机,政府先后采取了一系列刺激干预措

施,高财政收支、赤字以及高消费便是刺激干预的体现。

我国城乡居民消费倾向下降的原因是多方面的,但主因还是居民收入偏低,特别是中低收入群体的收入偏少,收入差距较大(方福前,2009)^[37]①。对此观点形成支持的是:(1) 本世纪以来,由于党和政府对“三农”和民生问题的大力重视,连续采取一系列“便民、利民、惠民”措施,改革、调节、提高了一些弱势群体的收入和待遇,积极建设惠及全民的社会保障体系。在这些宏观调控政策的实施和运行下,2004年以来我国农村居民人均纯收入显著提高^②,居民平均消费倾向也有所上升;据国家统计局消息,2011年一季度,农村消费增长15.8%,城镇消费增长16.4%,城乡消费增速相差0.6个百分点,比上年同期缩小2.4个百分点。(2) 罗楚亮(2004)研究了转轨时期收入不确定性、失业风险、医疗支出不确定性、教育支出等因素对城镇居民消费行为的影响,研究结果表明这些不确定性因素对城镇居民消费水平具有显著负效应,但一旦相关收入下降或支出增长因素被居民所预期,它们对消费所产生的负面影响相对而言要小得多,甚至可能会没有显著影响^[38]。(3) 尹向飞和陈柳钦(2008)的研究表明,收入差距过大,容易造成资产(房地产)价格上涨,使得高收入阶层的收入增长速度加快,从而进一步促进收入两极分化^[39];而资产(商品房)价格的上涨有降低个人消费支出的压力,总体上房地产价格波动与消费增长之间呈负相关关系^[40]。最近,陈健、高波(2012)的探讨发现,收入差距与房价之间存在着正向的互动关系,但对消费的影响却呈现出区域差异,在东中部地区,收入差距与房价之间这种相互强化的关系,使得代表消费主体的广大中低收入群体的住房负担加重,不得不减少消费;但在西部地区,由于住房负担相对较轻,能正向发挥财富效应,因此收入差距与房价之间的互动影响,反而促进了消费。他们认为,这种差异性体现出我国区域经济发展程度的不平衡性^[41]。

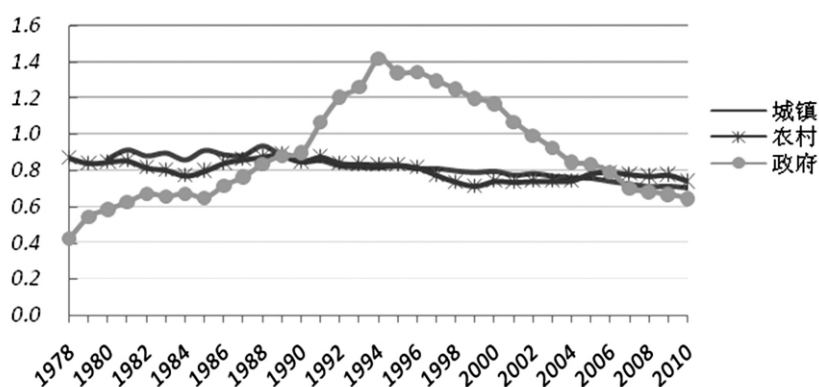


图1 1978年以来我国城乡居民和政府平均消费倾向线图

我国是一个辖有31个省区市,国土面积960多万平方公里,幅员辽阔的人口大国。因历史地理和改革进程等因素,我国各地区的经济社会发展水平不尽相同。表1统计了2009年全国31个省(区、市)城乡居民和政府平均消费倾向(按农村居民平均消费倾向降序排列)。可以看出:

受惠于近些年中央和地方对“三农”问题、民生工程以及支持落后地区发展的重视,2009年,各

① 方福前(2009)运用1995-2005年中国除西藏和台湾外30个省、自治区和直辖市城乡面板数据,建立随机效应模型对中国城乡居民消费需求的影响因素分别进行的计量结果发现:中国居民人均可支配收入与人均消费支出高度相关;并进一步运用1992-2004年中国的资金流量表(实物交易)数据,解释了1997-1998年以来中国居民消费需求持续低迷的原因之一:在国民收入分配和再分配过程中,政府在总收入和可支配收入中占有的份额越来越大,而居民占有的份额不断下降。

② 国家统计局信息,2010年,我国城乡居民人均收入比上年分别实际增长7.8%和10.9%,这是自1998年以来,我国农村居民人均纯收入实际增长速度首次超过城镇。数据还显示,低收入群体收入增长较快,东北及中西部地区农村居民收入增速较快。

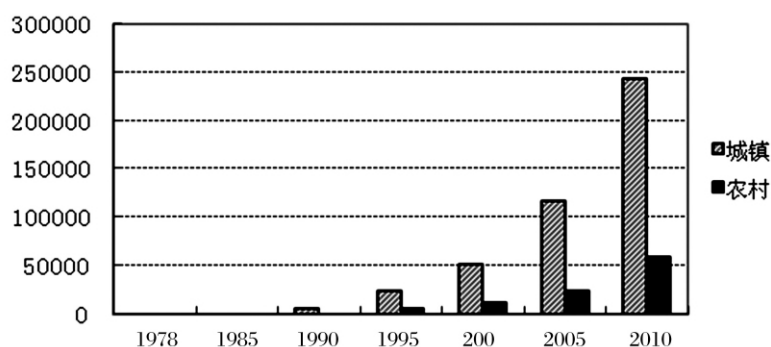


图2 1978年来城乡居民年底人民币储蓄余额比

数据来源:《中国统计年鉴》(1985-2011)、《新中国60年统计资料汇编》;

1997年及以后城乡居民人民币年底储蓄余额采自“国研网数据中心”。

地区农村居民的消费倾向多数都高于其城镇居民,有的甚至高出0.2以上(青海、陕西),中西部地区城乡居民的消费倾向明显高于东部地区。农村居民消费倾向超出0.80的省区,全都来自中西部地区,中部3个,西部9个。其次2009年,除上海和辽宁外,其余29个省区市的政府平均消费倾向都大于1.0,西藏最高,达到6.0以上。各地方政府平均消费倾向高出2.0的9个省区市中,除河北外,中西部地区各占一半。再次2009年,31个省区市的一般预算收支都呈现赤字(财政收支差额均为负数),中西部省区的赤字规模大,东部省区市政府收入和消费支出的数额高,西部省区政府消费占最终消费支出的比例多。最后,截至2009年,各地区城乡居民人民币年底储蓄余额超过万亿的,共有10个省区市,东部沿海地区8个,还有四川与河南(人口大省);储蓄余额在3000亿元以下的,共有7个省区(总人口数小或地理环境恶劣),由高到低分别是新疆、甘肃、贵州、海南、宁夏、青海和西藏。2009年,10个过万亿元省区市的储蓄之和为16.3万亿元,约占全国城乡居民人民币年底储蓄余额的63%。

人均GDP和人均可支配收入可反映出一国的经济发达程度和人民富裕状况,一个地区或城市则更要看人均可支配收入。世界上的富裕国家,人均可支配收入可以占到人均GDP的六成。如果人均GDP1.2万美元,人均可支配收入达到7000美元,差不多相当于土耳其的富裕水平。从表1可知,31个省区市农村居民的人均纯收入占各自人均地区生产总值的比例很低,基本在0.2左右;城镇居民的人均可支配收入占各自人均地区生产总值的比例大概在0.63上下。然而,一个很有趣的现象是:越是沿海发达省市,这两个数字越低,比如京津沪三市,城镇仅为0.36,农村仅为0.15;而中西部落后地区这两个比例反而较大,安徽、甘肃、广西等省区城镇的比例均在0.85以上,广西、安徽、江西等省区农村的比例皆高于0.24。这说明东部地区的GDP高,但投入也大,也表明我国离真实的中等富裕水平差距甚远。人均GDP,反映了财富创造的面貌,但和富裕不能直接划等号。

从消费倾向的研究来看,改革开放三十多年来,我国城乡居民的平均消费倾向整体上是下降的,尤其是城镇居民的下降幅度较大。究其原因,主要还是与中低收入群体的实际收入偏低、收入差距较大有关。进入新世纪以来,党和政府对“三农”问题的高度重视,近些年,农村居民的实际收入增幅较高,消费倾向也相应较强。同样,在“西部大开发”和“中部崛起”等战略的实施推进下,中西部地区的经济发展较快,居民收入快速增长,当前中西部地区城乡居民的消费倾向明显高于东部地区。与城乡居民消费倾向整体下降相反,改革开放三十多年来,我国政府的平均消费倾向整体呈上升态势,而中央和地方政府的财政收支几乎年年赤字,当前的赤字规模已处于较高水平。以2009年为例,东部省区市的政府收入和消费支出数额高,中西部省区的财政赤字数额大,西部省区政府消费占其最终消费支出的比例较高。因此,当前适度控制政府消费,着力提高财政支出的质量和效率就很有必要。

表 1 2009 年全国 31 个省(区、市)城乡居民和政府平均消费倾向统计

	人均地区生产总值(元)	人均可支配收入占比(%)	平均消费倾向	人均纯收入占比(%)	平均消费倾向	城乡储蓄余额(亿元)	一般预算收入(亿元)	政府消费支出(亿元)	平均消费倾向	政府消费占比(%)	财政收支差额(亿元)
陕西	21688	0.651	0.758	0.159	0.974	6743.8	735.3	1234.2	1.679	31.7	-1106.4
青海	19454	0.652	0.692	0.172	0.959	711.3	87.7	255.2	2.909	41.4	-399.0
甘肃	12872	0.927	0.745	0.232	0.928	3026.9	286.6	720.6	2.514	34.1	-959.7
四川	17339	0.798	0.785	0.257	0.928	11575.2	1174.6	1611.2	1.372	22.3	-2416.1
云南	13539	1.065	0.707	0.249	0.868	4668.6	698.3	1045.3	1.497	27.9	-1254.1
宁夏	21777	0.644	0.733	0.186	0.827	967.7	111.6	164.0	1.470	25.1	-320.8
湖南	20428	0.738	0.718	0.240	0.819	7809.8	847.6	1575.7	1.859	23.7	-1362.8
黑龙江	22447	0.560	0.766	0.232	0.815	6430.1	641.7	1819.8	2.836	38.1	-1236.1
广西	16045	0.963	0.670	0.248	0.812	4686.2	621.0	1006.0	1.620	23.2	-1000.8
安徽	16408	0.858	0.727	0.275	0.811	6619.5	863.9	990.8	1.147	19.1	-1278.0
贵州	10309	1.248	0.703	0.292	0.806	2676.1	416.5	657.3	1.578	25.6	-955.8
内蒙古	40282	0.393	0.780	0.123	0.804	3914.0	850.9	1622.3	1.907	41.0	-1076.0
上海	78989	0.365	0.728	0.158	0.785	13707.3	2540.3	2085.8	0.821	27.0	-449.4
山西	21522	0.650	0.668	0.197	0.779	8099.4	805.8	1042.0	1.293	30.8	-755.9
浙江	44641	0.551	0.678	0.224	0.773	17833.4	2142.5	2544.2	1.187	23.8	-510.8
北京	70452	0.380	0.669	0.166	0.763	14672.1	2026.8	2932.2	1.447	43.4	-292.6
新疆	19942	0.615	0.761	0.195	0.760	3050.8	388.8	981.5	2.525	43.3	-958.1
福建	33840	0.579	0.687	0.197	0.751	7078.8	932.4	1436.2	1.540	26.6	-479.4
吉林	26595	0.527	0.779	0.198	0.741	4614.4	487.1	1080.3	2.218	31.9	-992.1
湖北	22677	0.634	0.716	0.222	0.740	8163.5	814.9	1868.8	2.293	29.5	-1276.1
广东	41166	0.524	0.781	0.168	0.727	31411.4	3649.8	3918.1	1.074	21.1	-684.6
江苏	44744	0.459	0.640	0.179	0.725	20080.6	3228.8	5140.0	1.592	35.8	-788.6
山东	35894	0.496	0.674	0.170	0.722	17082.8	2198.6	3664.6	1.667	27.0	-1069.0
辽宁	35239	0.447	0.782	0.169	0.714	12030.9	1591.2	1590.7	1.000	25.4	-1091.2
河南	20597	0.698	0.666	0.233	0.705	11207.4	1126.1	2493.8	2.215	28.5	-1779.7
重庆	22920	0.687	0.771	0.195	0.702	4908.7	655.2	817.2	1.247	25.7	-636.9
江西	17335	0.809	0.695	0.293	0.696	5092.7	581.3	795.1	1.368	22.4	-981.1
西藏	15295	0.886	0.667	0.231	0.679	226.4	30.1	190.0	6.315	61.9	-440.0
海南	19254	0.714	0.734	0.246	0.651	1282.9	178.2	233.5	1.310	28.9	-307.8
河北	24581	0.599	0.658	0.209	0.650	13551.1	1067.1	2177.5	2.041	30.2	-1280.5
天津	62574	0.342	0.692	0.139	0.492	4885.9	822.0	1052.1	1.280	36.6	-302.3

数据来源:《中国统计年鉴》(2010);“政府消费占比”是各地区政府消费支出占最终消费支出的百分比,“财政收支差额”=“一般财政收入”-“一般预算支出”。

三、消费支出比较

最终消费支出指常住单位为满足物质、文化和精神生活的需要,从本国经济领土和国外购买的货物和服务的支出。它不包括非常住单位在本国经济领土内的消费支出。最终消费支出分为居民消费支出和政府消费支出。政府消费支出是政府部门为全社会提供的公共服务的消费支出和免费或以较低的价格向居民住户提供的货物和服务的净支出,前者等于政府服务的产出价值减

去政府单位所获得的经营收入的价值,后者等于政府部门免费或以较低价格向居民住户提供的货物和服务的市场价值减去向住户收取的价值^[42]。

从1978年以来我国政府和城乡居民消费支出数据,可以看出,30多年来:(1)我国最终消费支出一直保持增长,但增长的速度自1997年亚洲金融危机以来有所减缓,反映在GDP的构成结构上,最终消费率在过去30多年间呈平稳下滑趋势,而资本形成率则表现出阶段性递升态势^①,二者从改革之初的62.1%、38.2%发展演变到当前的48.0%和47.7%,最终消费率相对偏低。

(2)政府和城乡居民的消费支出额也几乎一直都保持增长。然而,和上文平均消费倾向下降相对应,1996年以后农村居民消费支出的增长速度明显放缓,甚至在1998年还出现负增长,这也是30多年政府和城乡居民消费支出增长速度中唯一的负增长。而政府和城镇居民消费支出的增长速度在1996年后也有点放慢,但两者一直保持平稳增长。1996年以后我国政府和城乡居民消费支出出现的这个情况,与“软着陆”后亚洲金融危机对我国宏观经济的冲击密不可分。

(3)在支出比例上,如图3,随着我国城乡二元经济的不断发展,政府和城乡居民的消费支出构成比例也发生了巨大变化。1978年,最终消费支出总额中,农村居民的消费支出占48.8%,城镇居民占29.8%,政府的消费支出占21.4%;1990年,政府的消费支出占21.8%,城乡居民各占约39%;到2010年,农村居民消费支出仅占16.5%,政府消费占28.7%,城镇居民则占到54.8%。

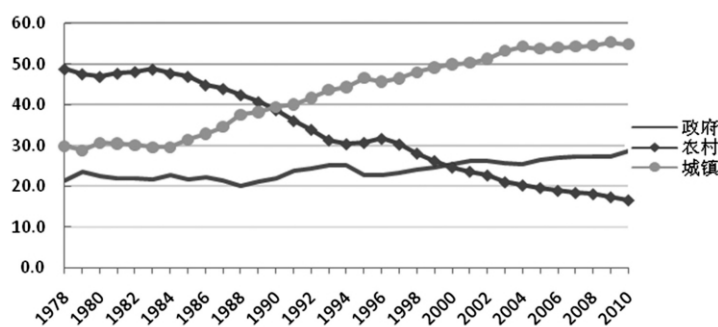


图3 1978年以来我国城乡居民和政府各自消费支出构成(%)

数据来源:《中国统计年鉴》(2011)。

综观30多年政府和城乡居民消费支出的比例构成变化,好似一把张开的“剪刀”在“剪纸”。即30多年间,随着城乡二元经济、社会的发展,城镇化的加快,人口迁移等,尽管我国农村居民的消费支出每年都在增长,但所占最终消费支出额的比重却逐年降低;相反,我国城镇居民的消费支出逐渐增长,而且所占比重也逐年增大。这个期间,我国政府消费支出所占的比重稳中有升。

四、国际比较

21世纪的今天,国际化和全球化正在以前所未有的速度广泛进行,地球正变得越来越小。随着我国改革开放事业的不断深入和经济社会的不断发展,我国同世界的联系愈加紧密,中国已成为国际大家庭中的重要一员。这就要求我们在研究问题时,不仅要埋头着眼于国内,也要主动联系世界,放眼国外,只有这样,才能更清晰的认识和处理一些问题,利于我国经济社会更好发展。

表2是1978年以来巴西、俄罗斯、印度、中国(合称“金砖四国”)和美国、德国的政府消费与居

^① 最终消费率指最终消费支出占支出法国内生产总值的比重;资本形成率指资本形成总额占支出法国内生产总值的比重。

民消费状况统计。通过国际比较,可以知道,过去30多年:1.中国的居民消费占GDP的比重最低,而且下降速度最快,由1980年的50.3%下降至2010年的34.9%。除中国外,巴西和印度的居民消费比重也有所下降,但他们的下降幅度较中国小,而俄罗斯、美国和德国的居民消费比重稳中有升。2.收入法GDP核算中,印度的劳动者报酬所占GDP的比重最低,约为30%,美国最高,一直在55%以上,德国一直在50%以上,但美、德两国过去30多年的劳动者报酬比重逐渐下降,德国的下降程度较大。中国劳动者报酬所占GDP比重约为50%。3.中国的财政收入和政府消费的比例趋中。俄罗斯、德国和巴西的财政收入占比较高,中国、美国次之,印度最低;相应的,政府消费方面,巴、德、俄三国的比例较高,美国、中国次之,印度最低。4.中国的国内总储蓄和资本形成总额占

表2 1978年以来“金砖四国”和美国、德国的政府消费与居民消费状况统计

	巴西(亿美元、%)								中国(亿美元、%)							
	GDP	财政收入	劳动者报酬	居民消费	政府消费	资本形成总额	国内总储蓄	M2	GDP	财政收入	劳动者报酬	居民消费	政府消费	资本形成总额	国内总储蓄	M2
1980	2350.2	22.6	-	69.7	9.2	23.3	21.1	18.5	1894.0	25.5	-	50.3	14.9	35.2	34.8	33.0
1985	2229.4	-	-	65.8	9.9	19.2	24.4	21.3	3066.7	22.2	50.3	51.3	14.4	38.3	34.3	47.0
1990	4619.5	22.8	-	59.3	19.3	20.2	21.4	17.2	3569.4	15.7	52.5	46.7	14.1	36.1	39.1	69.8
1995	7689.5	-	-	62.5	21.0	18.0	16.5	27.5	7280.1	10.3	50.1	42.7	13.8	41.9	43.5	83.0
2000	6447.0	19.9	-	64.3	19.2	18.3	16.5	43.4	11984.8	13.5	50.3	46.7	15.8	35.1	37.5	124.
2005	8821.9	22.7	-	60.3	19.9	16.2	19.8	50.2	22569.0	17.1	44.3	38.1	14.3	42.1	47.6	142.
2009	15944.9	23.1	-	61.7	21.8	16.5	16.5	65.8	49912.6	20.1	50.0	33.9	13.4	48.2	52.7	159.
2010	20878.9	22.7	-	60.6	21.2	19.2	18.3	65.9	59266.1	20.7		34.9	13.4	47.8	51.7	167.

	美国(亿美元、%)								俄罗斯(亿美元、%)							
	GDP	财政收入	劳动者报酬	居民消费	政府消费	资本形成总额	国内总储蓄	M2	GDP	财政收入	劳动者报酬	居民消费	政府消费	资本形成总额	国内总储蓄	M2
1980	27689.0	20.6	59.5	63.5	16.8	20.3	19.8	68.3	-	-	-	-	-	-	-	-
1985	41848.0	19.2	57.6	64.9	17.5	20.3	17.5	74.3	3637.1	-	-	-	-	-	-	-
1990	57508.0	20.5	57.8	66.6	17.0	17.7	16.3	72.9	5168.1	-	48.9	48.9	20.8	30.1	30.3	
1995	73384.0	20.9	57.1	67.7	15.4	18.2	16.9	61.3	3955.3	-	45.4	52.1	19.1	25.4	28.8	14.2
2000	98988.0	22.6	58.5	69.0	14.3	20.6	16.7	68.3	2597.1	24.6	40.2	46.2	15.1	18.7	38.7	17.6
2005	125797	20.5	56.2	70.1	15.8	19.9	14.1	72.0	7640.0	30.3	43.8	49.4	16.9	20.1	33.8	28.9
2009	140481	17.5	56.4	71.5	17.3	13.9	11.1	88.0	12220.0	35.7	52.8	52.5	21.0	18.9	26.5	45.6
2010	145867	16.4	55.2	71.2	17.3	15.1	11.5	83.7	14798.2	35.3	50.4	49.4	19.5	22.8	31.2	47.7

	印度(亿美元、%)								德国(亿美元、%)							
	GDP	财政收入	劳动者报酬	居民消费	政府消费	资本形成总额	国内总储蓄	M2	GDP	财政收入	劳动者报酬	居民消费	政府消费	资本形成总额	国内总储蓄	M2
1980	1838.0	11.7	-	74.6	10.0	18.5	15.4	32.5	9196.1	23.9	58.4	58.4	21.1	25.4	20.5	
1985	2299.4	-	-	67.7	11.3	23.5	21.0	37.1	7088.8	22.9	55.9	59.7	20.8	21.6	19.5	
1990	3174.7	12.6	-	65.6	11.7	24.2	22.7	39.9	17144.7	21.8	54.7	57.6	19.3	23.2	23.1	
1995	3563.0	12.3	-	63.7	10.9	26.6	25.4	41.9	25228.6	29.9	54.0	57.7	19.4	22.3	22.9	
2000	4601.8	11.9	-	64.1	12.6	24.2	23.2	52.0	18864.0	30.6	53.4	58.4	19.0	22.3	22.6	167.
2005	8340.4	12.1	27.2	57.2	10.9	34.7	31.9	60.1	27662.5	29.0	50.4	58.8	18.8	17.3	22.5	179.
2009	13772.6	11.9	28.5	56.0	12.0	36.5	31.3	71.0	32986.4	29.7	51.8	58.4	20.0	16.5	21.5	195.
2010	17271.1	-	-	57.0	11.5	34.8	31.5	69.6	32805.3	-	50.9	57.5	19.7	17.3	22.8	185.

数据来源:世界银行数据库、经济合作发展组织数据库、《中国统计年鉴》(1996-2011);国内生产总值的单位是亿美元,其余7项数据均为该项目数值占国内生产总值的百分比。个别数据因查找困难,以“-”表示。

GDP 的比率一直最高,国内总储蓄的比重从 1980 年的 34.8% 一路上升到 2010 年的 51.7%,资本形成率从 35.2% 提高至 2010 年的 47.8%。印度、俄罗斯次之。巴西、美国、德国的资本形成总额和国内总储蓄的比例相对较低,基本在 20% 上下,美国国内总储蓄的比例逐年降低,2010 年仅占 GDP 的 11.5%。5. 市场广义货币(M2)占 GDP 的比例方面,俄罗斯最低,2000-2010 年,俄广义货币占 GDP 的百分比从 17.6 上升到 47.7;巴西从 43.4 上升至 65.9;印度为 52.0-69.6;美国是 68.3-83.7;而中、德两国比例偏高,中国从 124.1 攀升至 166.5,德国是从 166.5 上升到 185.5。较多的广义货币数量在刺激经济增长的同时,也会给市场物价造成不小的冲击。2000 年至今,我国每年的经济增长率皆在 8% 以上,尤其是 2000-2007 年,增长率连续 8 年处于 8%-13% 的上升通道内。然而,这个期间,我国经济也出现了物价、房价等持续上涨的通货膨胀的问题。

可见,居民消费比重偏低,而且持续快速下降,而国内总储蓄和资本形成总额的比例一直高涨,广义货币 M2 占 GDP 的比重偏高,劳动者报酬所占 GDP 比重约为 50%,政府财政收入和政府消费的比例趋中,是我国宏观经济和国际相比所表露出来的特征。国际比较发现的一些情况和我们前面的分析基本一致。

五、政府消费、居民消费与经济增长的计量分析

前文主要从时间和地域的角度对我国政府消费与城乡居民消费进行了比较分析;下面,笔者运用模型对二者与经济增长间的关系进行计量估计,以期进一步获取一些有价值的信息。

向量误差修正模型(VECM)是由 Sargan 首先提出,之后因 Engel 和 Granger(1987)而推广流行的^[43]。它是一种用非结构性方法来建立各个变量之间关系的模型,应用于具有协整关系的非平稳时间序列建模。VECM 既能反映不同时间序列之间长期均衡关系,也能反映短期偏离向长期均衡调整的速度。

VECM 的形式一般为:

$$\Delta Y_t = \mu + \prod Y_{t-1} + \sum_{i=1}^{p-1} \Gamma_i \Delta Y_{t-i} + \varepsilon_t \quad (1)$$

由于(1)式中的协整体系有多种表示形式,用误差修正模型来表示是当前处理这种问题的普遍做法,本文采用此方法,即:

$$\Delta Y_t = \alpha ecm_{t-1} + \sum_{i=1}^{p-1} \Gamma_i \Delta Y_{t-i} + \varepsilon_t \quad (2)$$

其中: ΔY_t 是变量差分向量, α 是系数向量, ecm_{t-1} 是误差修正项, $\sum_{i=1}^{p-1} \Gamma_i$ 为系数矩阵, p 为模型滞后阶数, ε_t 是随机误差项,要求 ε_t 具有平稳性。

运用 Eviews6.0 软件,以 1978-2009 年年度数据为样本,对经济增长、政府消费、城镇居民消费和农村居民消费四个变量进行计量估计。先分别将经济增长(GDP)和消费数据以 1978 年为基期进行调整,为消除时间序列数据中存在的异方差问题,取各自数据的对数值。由于建立向量误差修正模型要求非平稳数列,变量间需存在协整关系,此外为了防止伪回归,还要用格兰杰因果来检验变量间关系,所以建模之前须进行单位根检验、协整检验和格兰杰因果检验^[44]。

1. 单位根检验:

运用 ADF 单位根检验方法来检验时间序列的平稳性,检验结果如下:

表 3

ADF 检验结果

	代码	t 统计量	P 检验值	5% 临界值	检验形式(c t k)	结论
国内生产总值	LGDP	0.069086	0.9571	-2.976263	(c 0 2)	非平稳
	DLGDP	-3.56226	0.0138	-2.976263	(c 0 0)	平稳
政府消费	LCG	1.787599	0.9995	-2.976263	(c 0 0)	非平稳
	DLCG	-3.39534	0.0192	-2.963972	(c 0 0)	平稳
城镇居民消费	LCU	0.175282	0.9664	-2.960411	(c 0 0)	非平稳
	DLCU	-5.01467	0.0005	-2.986225	(c 0 5)	平稳
农村居民消费	LCR	-2.08769	0.2506	-3.661661	(c 0 0)	非平稳
	DLCR	-3.39534	0.0192	-2.963972	(c 0 0)	平稳

注: (1) ADF 检验的原假设 H_0 : 含有单位根, 即序列是非平稳序列, 检验方程为 $Dy_t = \gamma y_{t-1} + \beta_1 Dy_{t-1} + \beta_2 Dy_{t-2} + \dots + \beta_k Dy_{t-k} + \varepsilon_t$; (2) D 表示变量序列的一阶差分; (3) 检验形式中的 c 和 t 表示带有常数项和趋势项 k 表示滞后阶数。

以上结果可知, 国内生产总值(LGDP)、政府消费(LCG)、城镇居民消费(LCU)和农村居民消费(LCR)都是 $I(1)$ 序列。

2. 协整关系检验

本文使用 Johansen(1995) 多变量系统极大似然估计法对多变量时间序列进行协整检验。对于模型滞后期的选择, 我们运用 Akaike 信息准则(AIC) 和 Schwartz 准则(SC) 来进行 Johansen 协整检验结果见表 4、表 5。

表 4

迹统计量检验结果

假设协整向量个数	特征值	迹统计量	5% 临界值	P 值
None*	0.670218	54.29709	47.85613	0.0110
At most 1	0.353784	21.01741	29.79707	0.3566
At most 2	0.225772	7.91876	15.49471	0.4741
At most 3	0.008038	0.24211	3.84147	0.6227

注: * 表示在 5% 显著性水平下拒绝原假设。

表 5

最大特征值检验统计量

假设协整向量个数	特征值	最大特征值统计量	5% 临界值	P 值
None*	0.670218	33.27968	27.58434	0.0083
At most 1	0.353784	13.09865	21.13162	0.4432
At most 2	0.225772	7.67665	14.2646	0.4125
At most 3	0.008038	0.242114	3.8415	0.6227

注: * 表示在 5% 显著性水平下拒绝原假设。

Johansen 协整检验结果显示, 在 5% 的显著性水平下存在一个协整向量, 表示经济增长、政府消费、城镇居民消费、农村居民消费之间存在长期均衡关系。

3. 格兰杰因果关系检验

为避免在建模过程中出现“伪回归”现象, 要对时间序列进行格兰杰因果检验, 确定变量间因果关系是否存在。检验结果如表 6(非平稳数据一律运用差分平稳化方法将其平稳):

表 6 格兰杰因果关系检验 P 值

原假设	M = 1	M = 2	M = 3	M = 5	M = 6	M = 7	M = 8	M = 9
DLCU → /DLGDP	0.9579	0.8546	0.9843	0.6292	0.358	0.418	0.1736	0.523
DLGDP → /DLCU	0.4337	0.227	0.3643	0.0048*	0.0206**	0.0557***	0.0738***	0.4236
DLCR → /DLGDP	0.3491	0.5309	0.7393	0.3891	0.5298	0.851	0.9171	0.2016
DLGDP → /DLCR	0.5522	0.6426	0.7984	0.4007	0.3157	0.515	0.5253	0.0673***
DLCG → /DLGDP	0.0103**	0.0291**	0.1521	0.4184	0.3888	0.0857***	0.0189**	0.256
DLGDP → /DLCG	0.165	0.1135	0.0253	0.4105	0.7324	0.6818	0.0568***	0.1693
DLCR → /DLCU	0.8079	0.7885	0.9042	0.2487	0.1237	0.3533	0.1167	0.0897***
DLCU → /DLCR	0.5494	0.5649	0.8056	0.5404	0.619	0.4108	0.1889	0.2924
DLCG → /DLCU	0.0004*	0.0002*	0.0028*	0.1264	0.1231	0.3726	0.5288	0.8316
DLCU → /DLCG	0.6026	0.0263**	0.0636	0.4487	0.248	0.2503	0.5704	0.4122
DLCG → /DLCR	0.3152	0.5205	0.4058	0.5921	0.6482	0.6438	0.5152	0.7744
DLCR → / DLCG	0.3796	0.2385	0.5007	0.5963	0.6793	0.0313**	0.03**	0.1886

注: (*, **, ***) 分别表示在 (1% 5% 10%) 水平下显著, M 为滞后阶数; DLCU → /DLGDP 表示 DLCU 不是 DLGDP 的格兰杰原因, 其他以此类推。

由检验结果可知, 农村居民消费、政府消费与经济增长之间存在双向格兰杰因果关系, 政府消费与城镇居民消费之间也存在着双向格兰杰因果关系; 经济增长是城镇居民消费的格兰杰因果原因, 农村居民消费是政府消费和城镇居民消费的格兰杰因果原因。因此, LGDP、LCU、LCR、LCG 可以建立 VECM 模型。

4. 构建 VECM

依据 AIC、SC 准则, 确定模型的滞后阶数为 2, 构建模型如下:

$$DLY = \begin{pmatrix} 0.5441 & -0.2776 & 0.1103 & 0.2413 \\ 0.2522 & -0.0250 & -0.1155 & 0.2992 \\ -0.1530 & 0.0202 & 0.4231 & 0.0802 \\ -0.5099 & -0.0763 & -0.0101 & 0.2784 \end{pmatrix} DLY(-1) + \begin{pmatrix} -0.4374 \\ 0.2140 \\ 0.4171 \\ -0.5440 \end{pmatrix} VECM(-1) + \begin{pmatrix} 0.0441 \\ 0.0611 \\ 0.0346 \\ 0.1168 \end{pmatrix}$$

式中,

$$LY = (LGDP \quad LCU \quad LCR \quad LCG)'$$

$$VECM = (1 \quad -0.9322 \quad -0.2296 \quad 0.1297) LY - 1.2307 \quad (3)$$

如表 7, 尽管拟合优度不是很高, 但对数似然值很大, AIC 和 SC 非常小, 所以构建的 VECM 整体效果较为理想。模型结果表明, 经济增长、城镇居民消费、农村居民消费、政府消费之间存在长期动态均衡关系。长期看, 城乡居民消费与经济增长呈正向关系, 其中, 城镇居民消费对经济增长的贡献程度较大, 而政府消费与经济增长呈负向关系。

短期内, 经济增长受其前期、政府消费以及城镇居民消费的影响大, 其中, 城镇居民消费的影响为负; 城镇居民消费受政府消费和经济增长的影响较大, 而农村居民消费则主要受自身前期的影响较大; 政府消费则受其前期和经济增长的影响较大, 经济增长的影响为负。

误差修正项前的系数表示扰动致使时间序列偏离长期均衡时, 时间序列向长期均衡水平调整的方向与速度。具体而言, 第 1、第 4 个数据为负, 表明经济增长与政府消费偏离长期均衡时, 将做逆向调整; 而第 2、第 3 个数据为正, 表明城镇居民消费和农村居民消费偏离长期均衡时, 将做正向调整。

表 7

VECM 检验结果

<i>R - squared</i>	0.589419	0.437189	0.296171	0.159698
<i>Adj. R - squared</i>	0.503881	0.319937	0.149540	-0.015365
<i>Sum sq. resids</i>	0.008047	0.015470	0.044848	0.066876
<i>S. E. equation</i>	0.018311	0.025389	0.043228	0.052787
<i>F - statistic</i>	6.890745	3.728620	2.019835	0.912234
<i>Log likelihood</i>	80.78715	70.98258	55.01684	49.02351
<i>Akaike AIC</i>	-4.985810	-4.332172	-3.267789	-2.868234
<i>Schwarz SC</i>	-4.705571	-4.051933	-2.987550	-2.587994
<i>Mean dependent</i>	0.095042	0.103340	0.052891	0.085553
<i>S. D. dependent</i>	0.025996	0.030787	0.046875	0.052386
<i>Determinant resid covariance (dof adj.)</i>			2.54E - 13	
<i>Determinant resid covariance</i>			1.04E - 13	
<i>Log likelihood</i>			278.1209	
<i>Akaike information criterion</i>			-16.67473	
<i>Schwarz criterion</i>			-15.36694	

5. 进一步的估计

为进一步考察我国政府消费、城镇居民消费和农村居民消费三者之间的数量关系,我们对这三个变量再次进行计量估计,构建 VECM。在建模之前,先需做协整检验。经过 Johansen 协整检验,发现三个变量之间存在协整关系。

根据 AIC、SC 准则,确定模型的滞后阶数为 6。模型的拟合优度达到 0.964,系数均显著,估计效果理想。为避免赘述,笔者主要给出模型中反映长期关系的部分:

$$VECM = (1 \quad -3.1982 \quad 4.7267) (LCG \quad LCU \quad LCR)' - 19.3351 \quad (4)$$

计量结果显示,长期上,我国政府消费与城镇居民消费呈现正向关系,而政府消费与农村居民消费存在负向关系。说明,从数量关系上看,30 多年来,政府消费促进了城镇居民消费,但挤出了农村居民消费。今后,政府消费应该适当向农村倾斜。

分别给政府消费和城镇居民消费一个单位正的冲击,得到城镇居民消费和农村居民消费的脉冲响应函数图(图 4)。由图 4 可知,在给政府消费一个单位正的冲击后,城镇居民消费首先反应为负向,但很快变为正向,随后呈波动状态,而农村居民消费起初反应为正向,在持续 6 期后转为负向,最后趋向于零;在给城镇居民消费一个单位正的冲击后,农村居民消费立即产生较大的正向反应,随后递减回落趋于稳定。

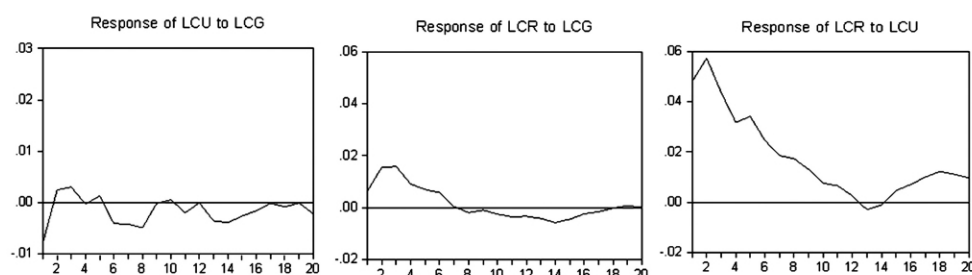


图 4 Response to Cholesky One S. D. Innovations

这再次表明政府消费应该适当向农村倾斜,以促进农村居民消费。此外,城镇居民消费可以给农村居民消费形成长期的推动,这就暗示,当前我们贯彻落实“十二五”规划扩大内需时,不仅要重视启动和扩大农村居民的消费需求,同样不能忽视城镇居民的消费需求。

结论与启示

本文以统计资料为依据,采用实证分析方法,从消费倾向、消费支出、国际对比和模型计量四个方面,全面分析和研究了1978年改革开放以来我国政府消费与城乡居民消费状况,通过研究,形成下述结论:

1. 和国际相比,我国宏观经济中的资本形成率持续高涨(居民消费比重偏低),1997年以来M2占GDP的比例逐渐走高,这既与民族文化传统偏好储蓄等所供给的大量资金有关,也与转型过程中宏观经济追求增长、激励和适宜投资紧密相连^{[2][45]}。细致一点的考察发现,当前城镇居民年底人民币储蓄余额占据全国居民储蓄总额的八成多,截至2009年,东部沿海等10个省区市的城乡居民储蓄额超过万亿元,它们之和约占全国居民储蓄总额的63%。资本逐利,偏重投资不仅容易导致经济大起大落,而且也易促使财富集中,产生两极分化^[3],而这将进一步加剧居民储蓄,有使经济陷入恶性循环的可能,对此必须引起重视,及时进行调控,防治一些行业投机过热。

2. 受凯恩斯主义影响和近些年积极财政政策的实施,中央和地方政府的财政赤字连年不断,当前赤字规模已达到空前水平;我国政府消费倾向整体较高,在上世纪90年代曾达到一次高峰。2009年,29个地方政府的平均消费倾向大于1,西藏最高,达到了6.315。相应的,政府消费支出稳步提升,占支出法最终消费支出总额的比重由1978年的21.4%提高至2010年的28.7%。计量结果显示,长期看,政府消费与经济增长呈负向关系,与城镇居民消费是正向关系,与农村居民消费存在负向关系;短期内,农村居民消费则主要受自身前期的影响较大。这可以解释为,我国的政府机构基本都驻地城镇,政府消费对城镇居民的收入和就业促进较多;但我国的政府消费可能对经济效率技术进步产生了负的影响。这就启示,我国政府消费的规模应有所控制,从区域上可适当向农村倾斜。

3. 当前扩大内需、扩大居民消费需求的对策思路是:逐渐提高劳动者报酬在国民经济中占有的比例,尤其要着力提高中低收入群体的实际收入;继续重视“三农”和民生工程,帮扶贫困等弱势群体,快速有效推进“西部大开发”和“中部崛起”等落后地区区域经济增长战略;同时也要尽快打破一些高收入垄断行业,扩大竞争,长期坚持并有针对性的改善民生^[46],将收入差距控制在合理状态。

然而,要真正实现扩大内需、扩大居民消费需求,在当前转变发展方式和开创科学发展新局面的时代召唤下,我们还要更加重视居民劳动技能、职业素养以及创业策略、产品竞争力等方面的内容,因为只有产品、产业的国际影响力提高了,生产发展了,充分就业了,所有的这一切才有可能实现。

4. 由于城乡发展基础不同,以及国情和发展阶段的影响,随着我国城乡二元经济发展,城镇化的加快和人口迁移等,我国城镇居民的收入和消费数额显著提升。城镇居民消费支出额占最终消费支出总额的比例,由1978年的29.8%大幅提高至2009年的55.3%;当前城镇居民年底人民币储蓄余额占据全国居民储蓄总额的八成多。计量结果显示,城镇居民消费不仅对经济增长的贡献程度大,而且可以长期推动农村居民消费。这与我国的城镇化战略和城镇居民的可支配收入一直较高有关;现实中,城镇居民消费可以带动和增加农村居民的就业与收入。这就表明,扩大居民消费需求,不仅要重视启动和扩大农村居民的消费需求,同样也要重视和激发城镇居民的消费需求。

事实上,城镇居民和东部沿海较发达地区居民的消费能量巨大,对于这部分居民,我国厂商特

别应该着重在商品和服务的品质、技术、创新、文化以及客户关系维系上,多下功夫^[47]。国际奢侈品、国外奶粉食品、餐饮、酒店旅游以及苹果公司推出的 iPhone、iPad 等高品质产品和服务在中国广受欢迎甚至流行就是明证^{[48][49]}。□

参考文献:

1. 魏杰. 基于国民生产总值的经济结构调整[J]. 学术月刊, 2010(6): 56-68.
2. 国家统计局课题组. 如何实现经济增长向消费拉动为主的转变[J]. 统计研究, 2007(3): 3-12.
3. 吴敬琏. 缩小收入差距不单靠再分配[J]. 中国改革, 2011(7): 41-42.
4. Bailey M J. 1962. National income and the price level: a study in macrotheory[M]. New York: McGraw-Hill.
5. Bailey, M. J., 1971. National Income and the Price Level: a study in macrotheory [M]. New York: McGraw-Hill. 2nd Edition.
6. Hall, R., 1980. Labor supply and aggregate fluctuations, Carnegie Rochester Conference Series on Public Policy 12, 7-33.
7. Barro, R. J., 1981. Output effects of government purchases. Journal of Political Economy 89, 1021-1086.
8. Barro, R. J., 1989. The neoclassical approach to fiscal policy. In: Barro, R. J. (Ed.), Modern Business Cycle Theory. Basil Blackwell, Oxford, pp. 178-235.
9. Kormendi, R. C., 1983. Government debt, government spending and private sector behavior. American Economic Review 73 (5), 994-1010.
10. Aschauer, D. A., 1985. Fiscal policy and aggregate demand. American Economic Review 75 (1), 117-127.
11. Bean, C. R., 1986. The estimation of surprise models and the surprise consumption function. Review of Economic Studies 53, 497-516.
12. Ahmed, S., 1986. Temporary and permanent government spending in an open economy. Journal of Monetary Economics 17, 197-224.
13. Campbell, J. Y., Mankiw, G. W., 1990. Permanent income, current income and consumption. Journal of Business and Economic Statistics 8, 265-279.
14. Karras, G., 1994. Government spending and private consumption: Some international evidence. Journal of Money, Credit, and Banking 26, 9-22.
15. Ni, S., 1995. An empirical analysis on the substitutability between private consumption and government purchases. Journal of Monetary Economics 36, 593-605.
16. Evans, P., 1997. Government consumption and growth. Economic Inquiry 35, 209-217.
17. Okubo, M., 2003. Intratemporal substitution between private and consumption government: the case of Japan. Economics Letters 79, 75-81.
18. Fiorito, R., Kollintzas, T., 2004. Public goods, merit goods, and the relation between private and government consumption. European Economic Review 48, 1367-1398.
19. Kwan, Y. K., 2006. The direct substitution between government and private consumption in East Asia. NBER working paper, No. 12431.
20. 袁晓玲, 杨万平. 政府、居民消费与中国经济增长的因果关系[J]. 当代经济科学, 2008(5): 49-55.
21. 邹洋. 中国政府消费和公债发行对居民消费的影响[J]. 公共管理研究, 2009(第7卷): 3-23.
22. 姜洋, 邓翔. 替代还是互补?——中国政府消费与居民消费关系实证分析[J]. 财贸研究, 2009(3): 1-7.
23. 徐小鹰. 城乡居民消费和政府消费对经济增长影响的实证分析[J]. 统计与决策, 2011(20): 87-89.
24. 申世军, 马建新. 我国政府消费和居民消费的地区差异研究[J]. 财经问题研究, 2008(1): 102-106.
25. 凌宏城. 论城乡居民消费结构的发展趋势[J]. 经济理论与经济管理, 1982(2): 26-35.
26. 林白鹏. 我国城乡居民收入水平、消费水平及其差别的实证分析[J]. 经济科学, 1994(4): 28-35.
27. 范剑平, 向书坚. 我国城乡人口二元社会结构对居民消费率的影响[J]. 管理世界, 1999(5): 35-39.
28. 刘建国. 城乡居民消费倾向的比较与城市化战略[J]. 上海经济研究, 2002(10): 54-60.
29. 吴炜锋. 转型时期影响我国城乡居民居住消费的因素分析——中国居住消费函数构造[J]. 财贸经济, 2009

(7): 123 - 126.

30. 纪江明 张乐天 蒋青云. 我国城乡社会保障差异对居民消费影响的实证研究[J]. 上海经济研究 2011(1): 46 - 53.
31. 张邦科 邓胜梁. 持久收入理论与我国城乡居民消费——基于省际面板数据的检验[J]. 上海经济研究, 2012(1): 30 - 41.
32. 周小川. 关于储蓄率问题的若干观察与分析[J]. 新华文摘 2009(8): 45 - 47.
33. 龙志和 周浩明. 中国城镇居民预防性储蓄实证研究[J]. 经济研究 2000(11): 33 - 38.
34. 高鸿业. 一本拯救资本主义的名著[M]. 济南: 山东人民出版社 2002: 1 - 7.
35. 杨继绳. 中国经济患上“凯恩斯依赖症”[J]. 领导决策信息 2002(25): 27.
36. 李俊英. 论凯恩斯主义经济理论在中国的实践[J]. 现代经济探讨 2005(10): 85 - 88.
37. 方福前. 中国居民消费需求不足原因研究——基于中国城乡分省数据[J]. 中国社会科学 2009(2): 68 - 82.
38. 罗楚亮. 经济转轨、不确定性与城镇居民消费行为[J]. 经济研究 2004(4): 100 - 106.
39. 尹向飞 陈柳钦. 城镇居民收入差距、财富差距、收入增长与房价关系的因果检验: 1992 - 2006 [J]. 河北经贸大学学报 2008(6): 16 - 21.
40. 洪涛. 房地产价格波动与消费增长——基于中国数据的实证分析及理论解释[J]. 南京社会科学 2006(5): 54 - 58.
41. 陈健 高波. 收入差距、房价与消费变动——基于面板数据联立方程模型的分析[J]. 上海经济研究 2012(2): 53 - 62.
42. 国家统计局. 中国统计年鉴[M]. 北京: 中国统计出版社 2010: 第二章主要统计指标解释.
43. Mehrzad Zamani. Energy consumption and economic activities in Iran [J]. Energy Economics 2007(29): 1135 - 1140.
44. 高铁梅. 计量经济分析方法与建模: EViews 应用及实例[M]. 北京: 清华大学出版社 2006: 249 - 301.
45. 徐康宁. 中国为什么盛产富豪? [N]. 环球时报 2011 年 3 月 15 日.
46. 李光炎. 民生问题的深层次思考[J]. 中国浦东干部学院学报 2008(4): 67 - 69.
47. 徐康宁. 扩大消费需求是一项系统工程[N]. 南京日报 2011 年 3 月 12 日“徐康宁专栏”.
48. 王飞 林晓丽. 全球 1/4 奢侈品由中国人买单 买奢侈品如同买菜[N]. 广州日报 2009 年 12 月 22 日, A22 版.
49. 林琳. 国际奢侈品商发现中国新秘密 年轻人成消费主力[N]. 环球时报 2011 年 5 月 30 日.

A comparative study on Chinese government consumption expenditure and Chinese household consumption expenditure: 1978 - 2010

Xue Peng Xu Kang-ning

(School of Economics Management , Southeast University 211189 , China)

Abstract: The consumption demand plays a very important part in the operation and management of national economics. It also is the accent of the current macro-regulation. Basing on statistical data , employing comparative analysis and econometrical methods , the paper studies and compares Chinese government consumption expenditure with household consumption expenditure just from consumption tendency , consumption expenditure , international perspective and econometric model 4 aspects since 1978 China's reform and opening up. Further it expresses and draws some significant views and conclusions.

Keywords: government consumption expenditure; household consumption expenditure; economic growth; comparative analysis; VECM