

城乡居民消费差距与地区经济发展水平

朱诗娥 杨汝岱*

摘要：经验观察发现，三十年来，我国省际城乡居民消费一直存在“经济发展越落后的地区，城乡居民消费差距越大”的现象。本文构建 1978—2007 年省际面板数据，基于不同模型的计量检验结果表明这种现象的存在，在经历了改革开放初期的“集体贫困”之后，这种现象在 1980 年代中期以后的二十年间显得尤为突出。而一些省份在经济发展到一定阶段后，城乡居民消费差距开始下降，这是未来发展的希望所在。本文还从社会发展、经济现状、政府行为、基础设施和对外贸易五个方面对影响省际城乡居民消费差距的因素进行了较为详细的考察，研究表明，加快农村基础设施建设、促进教育公平和完善农村社会保障体系等措施有助于迈向理想的共同富裕。

关键词：地区差距 城乡居民消费差距 面板数据

一、引言

新中国成立初期，国民经济发展水平落后，资本稀缺，为了保障重工业的优先发展，必须依靠一种新的制度安排由政府统一调配资源，并减轻工业化过程中由于劳动力转移带来的城市化压力，由此形成了一整套以户籍制度为基础的城乡二元体制（杨汝岱 2008）。这种发展战略城市化偏向的赶超模式（陈钊、陆铭 2004；林毅夫、刘明兴 2003）打破了经济发展固有的规律，强制形成的以社会化生产为主要特点的城市经济和以小生产为主要特点的农村经济并存的经济结构对随后的经济发展产生了深远的影响（Nurkse, 1953; Rostow, 1990），不仅造成农业生产长期低速增长，也使农业内部的剩余劳动力不断积累，农村隐蔽性失业严重，从而使二元经济结构特征更加突出，城乡差距不断扩大。改革开放以来，重工业优先发展战略下的城市偏向政策有所改变，政府在农产品价格、城乡劳动力转移等方面的政策逐渐放开，但是，计划经济体制下形成的城乡二元体制并未真正打破，城乡差距问题依然是影响到国民经济能否持续健康发展的重要因素。

针对城乡差距不断扩大这一亟待解决的重要问题，学术界现有的研究主要集中于三个方面：测度、原因、影响。第一，城乡差距的测度多集中于收入方面。城乡收入差距处于较高水平，长期以来备受关注，很多学者都对此进行了深入的研究（陈宗胜、周云波 2001；蔡昉 2003；臧旭恒、裴春霞 2007，等等）。最近几年兴起的以微观农户调查数据为基础的实证研究，对此问题做出了更为规范的探讨（李实等 2005）。第二，对经验事实进行深度分析之后，我们必须思考形成这种现状的原因。现有的研究主要从经济发展战略模式选择（林毅夫等 1994；姚洋 2004）、经济发展过程中“公平”与“效率”问题的抉择（杨汝岱、朱诗娥 2007）、人口规模与人口迁移因素（蔡昉、王美艳 2009；阮杨等 2002）等角度进行分析。第三，研究表明，残缺产权制度安排与地方政府以 GDP 增长为主要发展目标的城市倾向特征导致农村投入严重不足和农村发展潜力不够（沈坤荣、张璟 2007）、进城务工人员无法享有同等的社会保障（陈钊、陆铭 2004）、技术进步和就业歧视导致二元体制出现恶化趋势（蔡昉、王美艳 2009）等诸多问题不断出现。二元经济体制下，持续扩大的发展差

* 朱诗娥，湘潭大学消费研究院，邮政编码：411105，电子信箱：zhushie@gmail.com；杨汝岱，北京大学林肯研究院，邮政编码：100871，湘潭大学消费研究院，邮政编码：411105，电子信箱：rudaiyang@gmail.com。

本文同时得到国家社科基金项目“有限赶超与全球化背景下的大国经济发展”（09BJL042）、国家自然科学基金项目“村庄治理约束条件下的农户借贷行为研究”（71003083）、湖南省社科基金重点项目“我省农村土地流转制度创新研究”（09ZDB132）的资助。作者感谢匿名审稿专家提出的宝贵修改意见。文责自负。

距将会导致资源错配 损失经济效率(田新民等 2009) ,而群体差异的扩大也会引发更多的社会矛盾 ,影响经济的可持续发展。

本文认为 ,现有关于城乡二元体制、城乡差距的研究在两个方面存在不足 ,有必要作进一步探讨。首先 ,现有研究多从收入角度分析城乡二元体制问题 ,而收入只是一个载体 ,人们更加关心的是实际的消费水平;其次 ,正如二元体制一样 ,我国区域经济发展不平衡问题同样在学术界有广泛而深远的讨论 ,而将二者结合起来研究的成果还很少(苏良军、何一峰 2006) 。正是基于以上的分析 ,本文将对我国省际经济发展水平与城乡居民消费差距的关系进行详细的考察。

本文余下部分结构如下:第二部分讨论城乡居民消费差距的经验事实以及“经济发展越落后的地区 ,城乡居民消费差距越大”的现象的存在及演变过程;第三部分构建 31 个省份 30 年的面板数据 ,检验城乡居民消费差距与经济发展水平的关系;第四部分讨论城乡居民消费差距问题的发展前景;第五部分是结论与扩展。

二、经验事实

(一)我国城乡居民消费差距的演变过程

新中国成立之后 ,为保障重工业的发展 ,形成了一整套包括户籍制度在内的城乡隔离的二元经济体制。经过几十年的“农业补贴工业”的计划经济时代 ,到 1970 年代中后期 ,农村问题已经非常严重。1978 年底开始的农村改革一度缩小了我国的城乡差距 ,然而 ,我国城乡经济不平衡发展并没有就此扭转。家庭联产承包责任制将计划经济体制下压抑的农村生产力释放出来 ,但这种原始的驱动力难以维持持续快速的发展。在农村改革取得了初步成效之后 ,随着我国工业化进程的加速 ,城市发展随之加快。1980 年代中后期开始 ,政府经济改革的重心再一次转向城市 ,在一轮又一轮的投资热潮中 ,农村投资所占比例不断下降 ,农村基础设施不断老化。农村金融机构成为转移农村资金的工具 ,城市偏向使农业发展缺乏必要的资金 ,农村经济不能与城市经济同步发展 ,城乡差距进一步扩大。在农村为城市提供积累的同时 ,公共投资也源源不断地流向城市 ,支持城市的发展 ,忽视了广袤的农村。1992 - 2001 年 ,财政基本建设投资支出中用于农业基本建设支出的比重在低位徘徊。公共投资在农村教育、医疗等农村社会事业方面的资金也与投资于城市的同类资金存在较大悬殊。在就业方面 ,传统体制下形成的城乡二元分割局面仍然得以维持 ,一些大中城市为了保障城镇居民就业 ,直接动用行政手段限制农民进入城市较好的行业和工种 ,农民工在城市里还受到社会保障、义务教育、公共服务和权益保护等方面的歧视性待遇。城乡不平衡的政策和体制高筑城乡交流壁垒 ,加剧了城乡鸿沟。城乡分割的户籍制度、社会保障制度 ,以及成文、不成文的对农村人口的就业歧视政策等 ,都在城市与乡村之间筑起了难以逾越的壁垒 ,阻断了城市人口与农村人口在资源、经济、文化等领域的交流 ,将农村人口排斥在现代文明之外。

从图 1 可以看出 ,1978 - 2007 年 ,我国城乡居民消费差距大体上经历了三个阶段。第一阶段(1978 - 1985 年):农村居民消费稳步上升 ,城乡居民消费差距逐渐下降。经过从建国初期到改革开放初期几十年以农业补贴工业为典型特点的计划经济时代 ,我国城乡居民消费差距已经非常大。1978 年 ,农村居民人均消费水平为 138 元 ,而城镇居民人均消费水平为 405 元 ,大约是农村的 3 倍。正是在这种背景下 ,改革在“无农不稳”的压力下从农村开始 ,这种被动的尝试取得了良好的效果 ,农民积极性大大提高 ,到 1980 年代中期 ,粮食生产大幅增产 ,农民收入也随之上升。到 1985 年 ,城乡居民消费水平差距缩小到 2 倍左右。

第二阶段(1986 - 1995 年):城乡居民消费差距迅速上升。改革初期的农村改革 ,提高了农民的积极性 ,释放了农村经济发展的活力 ,这种示范效应对城市经济的改革与发展产生了很大的促进作用。1980 年代中期以后 ,改革的重点重新转移到城市 ,以市场化改革和国有企业改制为核心的城市改革拉开大幕。在消费品极度短缺的时代 ,强大的市场需求极大地促进了工业经济的发展。在我国逐步向市场化经济体制迈进的过程中 ,这种原始的需求方拉动的经济使得工业迅速发展 ,工业产值大幅上升 ,农村又被甩在后面。这个十年 ,是农业经济基本维持原状、工业经济大放异彩的时期 ,城乡二元经济结构使得农民不能分享工业发展带来的好处 ,在城镇居民收入大幅提高的同时 ,农民收入并没有明显改善。这种二元经济体制的畸形安排的直接后果就是 ,农民被捆绑在农村 ,不能分享工业化的成果;城乡居民收入差距被迅速拉大 ,从而城乡居民消费水平的差距也迅速扩大 ,从 1985 年的 2 倍左右扩大到 1995 年的 4 倍左右 ,整整翻了一番。

第三阶段(1996 - 2007 年):城乡居民消费差距维持高位振荡。在经历了改革开放将近二十年的发展之

后,农村和城市开始新一轮的糅合之路。城市职工的基本就业问题已经解决,农民开始走出农村,进入城市,成为城市建设的一支重要力量。到1990年代中期,农村和城市的经济发展都进入了一个新的阶段。在此之前,由于计划经济时代的价格扭曲导致资源错配,使得各种工农业产品都供不应求,是典型的需求方决定模式。无论农村还是城市,都是一种粗放型发展方式,是一种原始力量的释放。而到1990年代中期,形势发生了改变,渐进型的改革模式在保持稳定的同时,也产生了很多问题。这使得我国从1990年代中期开始陆续进行了一系列的改革,如教育、医疗、住房、社会保障体系、国有企业改革等,每一项改革都关系到国计民生,对人民的的生活和社会经济发展产生了很大的影响。在随后的十来年间,我国城乡居民的收入和消费水平变化较大,出现了区域差异拉大等新特点。而从全国整体来看,城乡居民消费差距维持高位振荡。

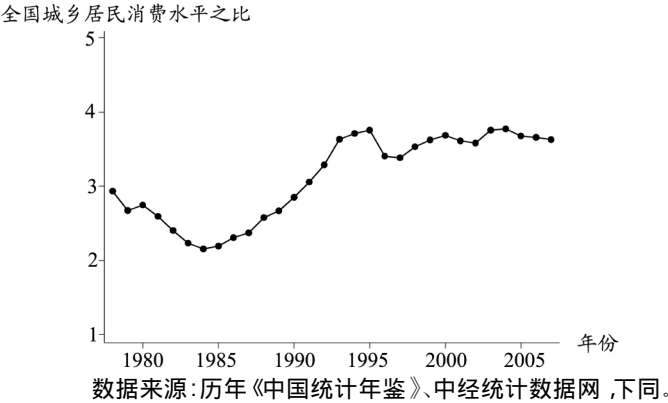


图1 1978-2007年全国城乡居民消费之比

(二)城乡居民消费差距与省际经济发展水平

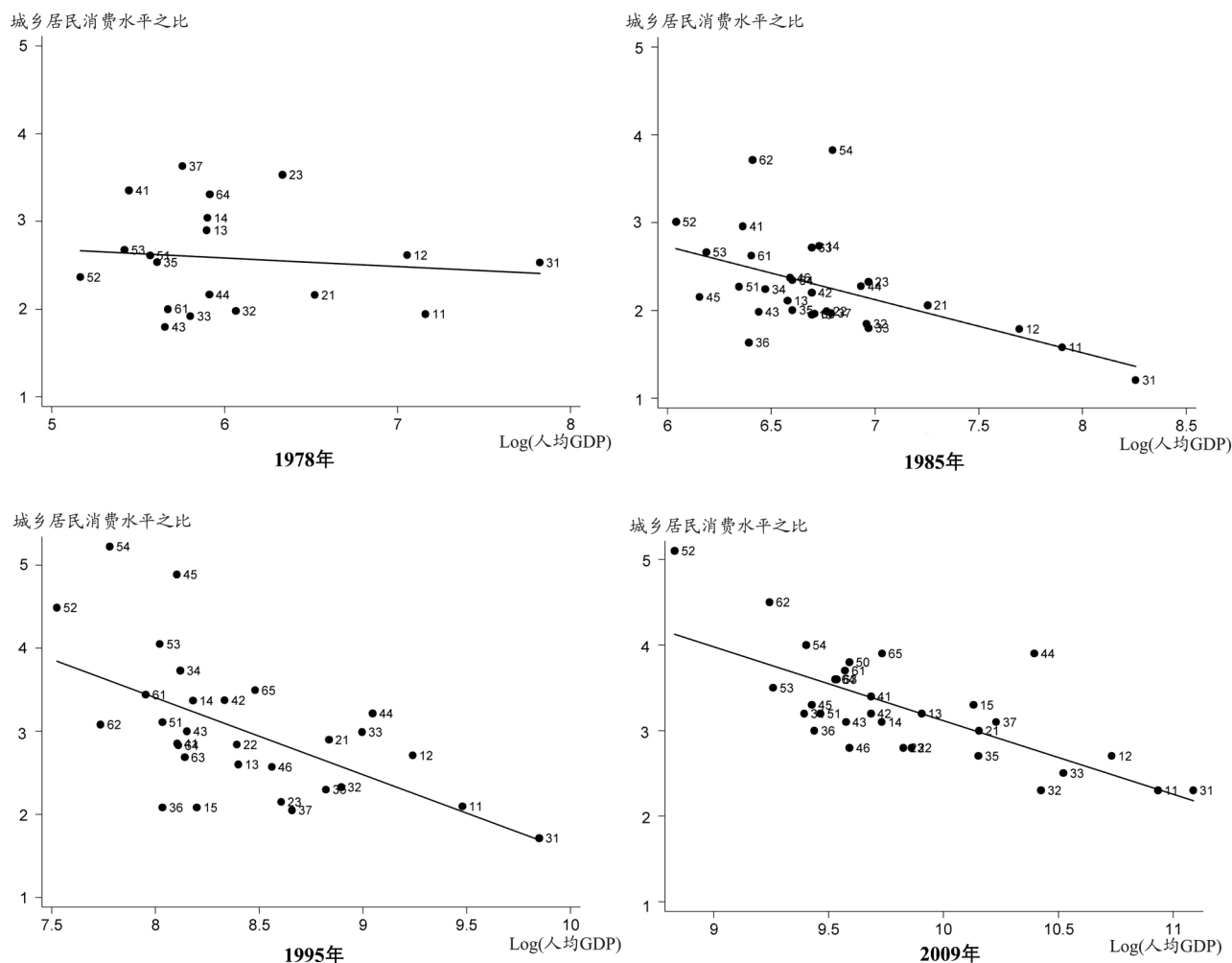
作为一个人口众多、幅员辽阔的发展中大国,我国与其他中小国家的发展有很大的差异,尤其是特有的城乡二元经济结构对社会经济发展产生了很大的影响,城乡、区域经济发展失衡问题日益凸显。根据很多学者对我国居民收入分配问题的研究(李实等,2005,等等),收入水平的城乡差距和区域差距都非常大。那么,城乡居民消费差距与经济发展水平之间的关系是怎样的?城乡居民消费差距在省际之间的表现有没有差异?

关于城乡居民消费差异与经济发展水平之间的关系问题,一般有两种观点。其一认为城乡居民消费水平差异类似于收入差距,根据库兹涅茨假设,经济发展水平与收入差距之间存在倒U型关系,经济发展水平较低时,差距较小,随着经济的不断发展,差距开始扩大,当经济发展水平达到一定的高度,社会开始重视公平问题,收入或消费的差距又将开始缩小。这种观点在西方发达国家的经济发展过程中得到了一定的印证。另一种观点则源自于拉美国家的发展事实,无论经济如何发展,收入和消费水平的差距都在日益恶化,看不到改善的迹象。一些拉美国家的发展有着浓厚的民粹主义特点,少数特权阶层掌握着国家机器和社会资源,国家机器并没有代表大多数普通民众的利益,而是为少数人服务,这导致国民收入和消费差距一直维持在高水平状态,从而导致社会政局的动荡不安。

我国和西欧、拉美国家的发展模式均有很大的差异,既不同于成熟发达经济的福利国家模式,也有别于少数人控制国家资源的拉美国家的发展模式。我国改革开放以来的经济发展有三个非常重要的特点:一是经济发展较快,从1978年的温饱到现在的小康水平,人民生活水平和生活质量都有较大的提高;二是城乡二元经济结构、计划经济时代用农业补贴工业的发展模式所带来的收入不平等是我国现阶段很多矛盾和问题的根源所在;三是我国人口众多、幅员辽阔,地区之间的发展差别非常大,沿海地区发展非常迅速,城乡居民的收入和消费水平都有很大的提高,而中西部地区的发展则相对落后,还存在很多问题。

图2表明了几个主要年份我国省际城乡居民消费水平之比与人均国内生产总值(GDP)的关系,结论是非常直观而有意义的。1978年,省际城乡消费差距和人均GDP之间几乎不存在显著的关系,回归系数为-0.01,在当时,我国刚刚从完全的计划经济时代走来,结束“大锅饭”时代,居民内部的收入和消费差距还比较小。“共同贫穷”是当时的真实写照,但是,由于实行重工业优先发展的赶超战略,人为划定城乡区别,在当时,虽然农村内部和城市内部之间的差距比较小,但城乡之间还是存在较大的收入和消费差距。城乡居民消费水平之比维持在2.5左右,山东、河南和宁夏等地的差距稍高,但也没有超过3.5,湖南、浙江等地差距最小,在1.8左右。

随着经济的不断发展,省际之间城乡居民消费差距与经济发展水平之间的关系也在不断发生变化。我国的改革实际上是一个在原有体制上不断进行制度创新的过程,最开始都是一种原始发展潜力的释放,到一定的时候,内在的发展动力得到释放,原有的体制不再足以支撑持续快速的的增长,又开始对限制其发展的体制进行改革。改革初期的重点是释放经济个体的潜在活力,赋予经济个体自主权,这样,由于经济基础与区位等差异,以前那种各个地区“共同贫穷”的发展模式彻底改变,个人与地区之间的差异尽显。“允许一部分人、一部分地区先富起来”的政策在释放经济活力、促进经济发展的同时,也造成个体与地区之间收入和消费差距的不平衡。由于初期的改革重点在农村,农民的收入和消费增长比城市要快,从全国来看,整体的城乡居民消费差距有较大幅度的缩小。但是,随着经济的不断发展,地区差距开始凸显,越落后的地方,城乡居民消费差距越大,1985年省际截面数据城乡消费差距对人均GDP的回归系数为-0.61,在1%的显著性水平下显著。相对于1978年,到1980年代中期,虽然整体的城乡消费差距在缩小,但地区间的差距在扩大。上海、北京、天津三个直辖市的城乡消费差距缩小最快,尤其是上海,城乡居民消费水平之比由2.6下降到1.1。而甘肃、西藏则成为低增长、高差距的典型代表。1980年代中期以后,虽然全国整体的城乡居民消费差距经历了先上升后维持高位振荡的过程,但越落后的地方差距越大的现象并没有得到改善。



注:(1) 省份采用GB代码: 11 北京, 12 天津, 13 河北, 14 山西, 15 内蒙古, 21 辽宁, 22 吉林, 23 黑龙江, 31 上海, 32 江苏, 33 浙江, 34 安徽, 35 福建, 36 江西, 37 山东, 41 河南, 42 湖北, 43 湖南, 44 广东, 45 广西, 46 海南, 50 重庆, 51 四川, 52 贵州, 53 云南, 54 西藏, 61 陕西, 62 甘肃, 63 青海, 64 宁夏, 65 新疆。(2) 1978年、1985年、1995年、2007年城乡居民消费支出之比与人均GDP对数的简单回归方程分别为 $y = 3.18^{***} (2.53) - 0.01 (-0.48) x$; $y = 6.37^{***} (5.04) - 0.61^{***} (-3.24) x$; $y = 10.81^{***} (5.30) - 0.93^{***} (-3.83) x$; $y = 11.74^{***} (7.63) - 0.86^{***} (-5.52) x$ 。

图2 主要年份(1978年、1985年、1995年、2007年)省际城乡居民消费水平之比与人均GDP关系

图3列出了五个年份城乡居民消费差距与人均GDP的省际截面数据拟合直线,比照图2,我们可以大体看出这种关系的演变过程。1978年,城乡消费差距与人均GDP没有显著的关系,拟合直线的斜率几乎为0。改革开放以来,随着经济的不断发展,城乡消费差距的地区差异性越来越明显,越穷的地方差距越大。从

1981 年开始 ,二者之间的负相关关系越来越显著 ,简单回归系数也越来越大 ,从 1981 年到 1985 年 ,再到 1990 年 ,拟合直线的斜率逐年都在上升,“越落后的地区城乡居民消费差距越大”的现象越来越明显 ,越来越严重。不过 ,1990 年代以后 ,这种现象更多地表现为各省份之间的内部调整 ,从回归系数和拟合直线的斜率来看 ,并没有反映出不断扩大的迹象。

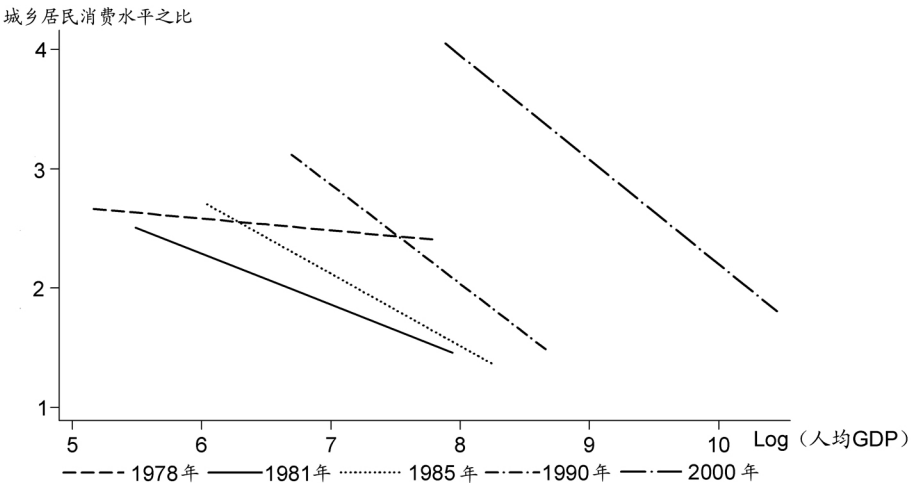


图 3 城乡居民消费水平之比与人均 GDP 的拟合直线

(三) 希望在哪里？

这部分纵向考察城乡居民消费差距的演变过程 ,并对比分析一些代表性省份的城乡居民消费差距的演变过程。图 4 列出了北京、江苏、浙江、福建四个经济较发达地区城乡居民消费差距的变化过程。图 5 列出了贵州、甘肃、青海、新疆四个经济不发达省份城乡居民消费差距的变化过程。改革开放以来 ,我国各地区城乡居民消费差距大致都呈上升趋势 ,但是 ,不同地区城乡居民消费差距演变趋势差异很大。根据前面的分析 ,改革初期 ,各地区的城乡消费水平之比差别不大 ,均处于较低水平。1978 - 1985 年 ,各地区的城乡消费水平之比大致都经历了一个缩小的过程 ,这与我国的经济体制改革始于农村相关 ,在这一阶段 ,我国农村经济取得了相比城镇更快的发展。1985 年之后 ,尤其是 1990 年代以来 ,我国各地区城乡居民消费差距基本呈上升趋势。相比发达地区 ,不发达地区城乡居民消费差距上升速度很快。1980 年代 ,贵州省的城乡居民消费水平之比为 2.3 左右 ,而 1998 年上升到 5.16 ,近年来 ,虽然这一比例有所缓和 ,但是也基本维持在 5 左右;青海省城乡居民消费水平之比在 1990 年代中期还不到 3 ,1990 年代中期之后 ,差距迅速扩大 ,到 2004 年达到了 4.06。总体而言 ,最近十年来 ,几个欠发达省份的城乡居民消费差距基本上都在 4 以上 ,远远高于全国同期的水平。

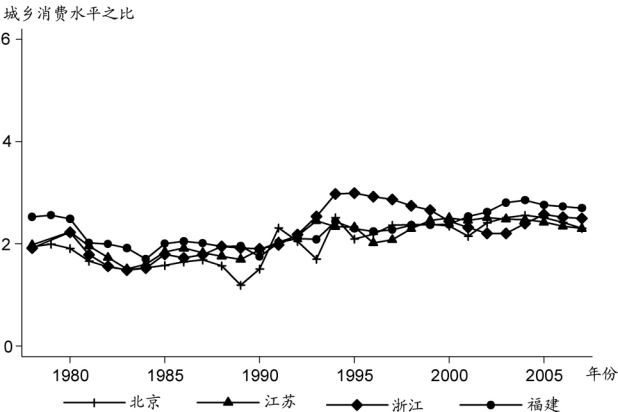


图 4 经济较发达地区城乡居民消费水平之比

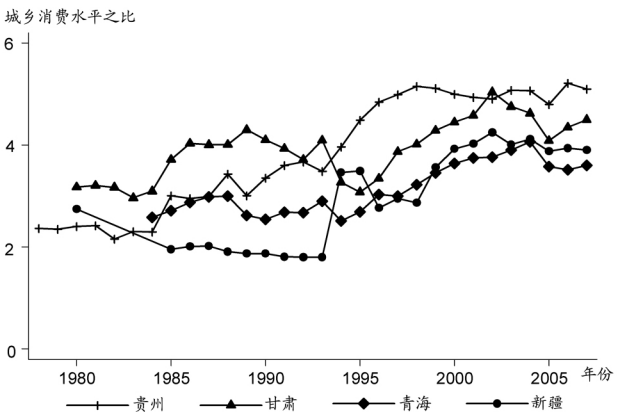


图 5 经济欠发达地区城乡居民消费水平之比

相比之下 ,较发达地区城乡居民消费差距变化比较缓和。1978 年北京市城乡居民消费之比为 1.94 , 1983 年下降至 1.49 ,1989 年一度达到 1.19 的最低水平 ,1990 年代以来 ,北京市城乡居民消费差距有所扩大 ,但是上升幅度不大 ,2004 年达到峰值 2.56; 上海、江苏、浙江、福建等发达地区的情况与北京类似。1990 年代之前 ,除 1980 年以外 ,江苏省各年城乡居民消费之比均在 2 以下 ,1990 年代以来 ,江苏省城乡居民消费

差距有所扩大,但峰值也不过 2.51;上海的差距更小,1980 年代城乡居民消费水平之比维持在 1.5 以下,1990 年代处于 1.5 至 2 之间,2000 年以来基本在 2.3 以下徘徊。总体而言,这十多年,几个经济较为发达省份的城乡居民消费差距基本维持在 2 左右,这与改革开放初期的水平相当,比经济欠发达地区的城乡居民消费差距小了很多。这种现象非常值得进一步研究和深入思考。

通过分析经济较发达地区城乡居民消费差距的演变过程,可以发现一个非常重要的现象:2003 年以来,我国经济较发达地区城乡居民的消费差距出现了缩小的趋势,较发达地区随着经济的进一步发展,越来越重视农村居民收入和消费水平的提高。这对促进社会和谐、保持国民经济健康可持续发展有非常重要的意义,这也使我们看到了妥善解决城乡分割这一历史遗留问题的希望。

通过对三十年来我国城乡居民消费差距演变过程的回顾,总结出两个主要问题:第一,从截面上看,经济越发达的地区,城乡居民消费差距越小,经济越落后的地区,城乡居民消费差距越大,这种模式主导了过去几十年的发展;第二,纵向来看,发达地区城乡居民消费差距上升较为平缓,最近几年,一些经济较为发达的省份出现了城乡居民消费差距下降的趋势,这是未来我国经济改革与发展的方向所在。

三、实证检验

第二部分从不同的角度详细分析了我国城乡居民消费差距的省际差异和历史演变,接下来用规范的计量检验方法对城乡居民消费差距与地区经济发展水平的关系进行实证检验,并进一步探讨其影响因素。

(一) 变量选择与计量模型设定

综合现有的研究成果(李军 2003;罗楚亮 2004;吴晓明、吴栋 2007)和本文的分析,我们认为除本文重点关注的地区经济发展差异外,主要还有如下五个方面的因素对城乡居民消费差距有重要影响。第一,社会发展水平。从我国现在的发展情况看,社会发展水平可以体现在收入、教育和医疗三个方面。我们选择农村居民人均纯收入、城镇居民人均可支配收入、城乡居民人均储蓄余额、小学在校人数占总人口的比例、中学在校人数占总人口的比例、每万人床位数和每万人医生数等作为表征各地区社会发展水平的代理变量。第二,经济现状。经济发展现状是影响城乡居民消费差距的重要因素,本文选择第一产业和第二产业产值占 GDP 的比例、固定资产投资占 GDP 的比例、人均商品零售额、实际利用外资情况等作为地区经济现状的代理变量。第三,政府行为。到 2009 年,我国中央财政收入已经达到 6.8 万亿元,占 GDP 的比例超过 20%,是典型的“大政府”,政府行为在国家经济发展过程中的角色异常重要。有理由认为,政府在转移支付、城乡基础设施建设、城乡社会保障体系的建设等方面的政策都将对城乡居民消费差距产生较大的影响。本文选择地方财政支出占 GDP 的比例、政府消费占总消费的比例、农业财政拨款和文教卫生等支出分别占财政支出的比例等作为政府行为的代理变量。第四,基础设施。基础设施建设是影响居民消费的外在环境因素,我们选择公路里程密度和铁路里程密度作为基础设施建设的代理变量。第五,对外贸易。很多的研究讨论了对外开放程度与我国地区经济发展差异的关系(李坤望、黄玖立 2006),本文认为对外开放程度同样对城乡居民消费差距有一定的影响。根据海关总署和商务部提供的数据,本文控制每个省商品出口的详细属性,包括国有企业出口份额、三资企业出口份额、向发达国家(OECD)的出口份额、初级产品出口份额、加工贸易出口份额等。

根据对控制变量的分析,本文收集 31 个省份从 1978-2007 年 30 年的数据,构建省际面板数据,由于截面和时间维度值 N 和 T 的值几乎相同,而且年份为连续,这和一般的跨国分析计量模型有较大的区别,这种省际面板数据对计量方法的要求更高一些,需要对方差来源做更为细致的分析。本文设定基本回归模型为:

$$ratio_{it} = \alpha + \beta_i + \gamma \ln gdp_{it} + \delta X_{it} + \varepsilon_{it}$$

其中 $ratio_{it}$ 表示 i 省 t 年的城乡居民消费之比, $\ln gdp_{it}$ 表示 i 省 t 年的人均 GDP 的对数值。除一般面板数据模型检验所关心的固定效应方式、残差形式等常见问题,从计量方法的角度来看,由于选择的是年度数据,须考虑自相关,此外,异方差的处理也非常重要。为了从不同的角度分析,可以设定不同的计量检验模型,考察检验结果的稳定性。根据以上对数据和检验目标的分析,本文设定三个计量检验模型。模型一为时间固定效应模型,控制年份固定效应。模型二和模型三主要考虑到本数据集检验中时间序列自相关结果的模糊性,采用广义最小二乘法(GLS),两个模型的差异在于对自相关方式的设定,模型二假设不存在自相关,模型三假设存在 AR(1) 的自相关。

(二) 计量结果与分析

表 1 列出了主要的检验结果。显然 整体来看 经济发展水平和城乡居民消费差距存在稳定的负相关关系 三个模型在三组不同控制变量下的检验结果均非常显著。从模型的检验结果看 模型一和模型三的回归系数较为接近 这可能是因为模型一控制了年份的固定效应 而模型三则考虑了服从 AR(1) 的面板自相关过程 相对于模型二假设不存在面板自相关 模型三和模型一的处理方式更为接近。

表 1 计量检验结果

		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)	(7)	(8)	(9)
		第一组(1978 - 2007 年)			第二组(1978 - 2004 年)			第三组(1993 - 2004 年)		
		模型一	模型二	模型三	模型一	模型二	模型三	模型一	模型二	模型三
社会发展	人均 GDP(元 对数)	-0.466 ^{***} (0.147)	-0.818 ^{***} (0.059)	-0.415 ^{***} (0.084)	0.397 [*] (0.204)	-0.876 ^{***} (0.094)	-0.313 ^{***} (0.106)	0.803 ^{***} (0.362)	-1.066 ^{***} (0.162)	-0.673 ^{***} (0.158)
	农村居民人均纯收入 (万元)	-5.481 ^{***} (0.723)	-5.989 ^{***} (0.486)	-5.179 ^{***} (0.666)	-8.070 ^{***} (1.027)	-7.297 ^{***} (0.772)	-5.893 ^{***} (0.854)	-8.681 ^{***} (1.637)	-7.190 ^{***} (0.906)	-6.424 ^{***} (0.967)
	城镇居民人均可支配收入 (万元)	1.662 ^{***} (0.374)	1.823 ^{***} (0.208)	1.767 ^{***} (0.288)	2.069 ^{***} (0.495)	2.017 ^{***} (0.312)	1.465 ^{***} (0.374)	0.418 (0.874)	2.668 ^{***} (0.383)	1.895 ^{***} (0.393)
	人均储蓄余额(万元)	-0.128 (0.117)	-0.095 (0.087)	0.119 (0.105)	-0.295 (0.195)	-0.106 (0.145)	0.033 (0.146)	-0.243 (0.260)	-0.300 ^{**} (0.139)	-0.121 (0.143)
	小学在校人数占总人口 的比例(%)	0.026 [*] (0.014)	0.078 ^{***} (0.009)	0.053 ^{***} (0.014)	0.001 (0.016)	0.050 ^{***} (0.014)	0.043 ^{***} (0.017)	-0.015 (0.036)	0.069 ^{***} (0.021)	0.056 ^{***} (0.022)
	中学在校人数占总人口 的比例(%)	-0.023 (0.023)	-0.041 ^{***} (0.016)	-0.019 (0.022)	-0.012 (0.030)	-0.003 (0.023)	-0.011 (0.029)	-0.049 (0.056)	-0.133 ^{***} (0.037)	-0.035 (0.039)
	每十万人床位数				0.698 (0.553)	-0.577 ^{**} (0.240)	-0.261 (0.311)	2.408 ^{***} (0.790)	1.201 ^{***} (0.341)	0.477 (0.364)
	每十万人医生数				-0.082 (0.096)	-0.197 ^{**} (0.083)	-0.071 (0.082)	-0.178 (0.114)	-0.176 ^{***} (0.065)	-0.114 [*] (0.065)
经济现状	第一产业产值占 GDP 的 比例(%)	-0.026 ^{***} (0.007)	-0.024 ^{***} (0.004)	-0.010 ^{**} (0.004)	-0.009 (0.008)	-0.027 ^{***} (0.005)	-0.011 ^{**} (0.005)	0.024 (0.018)	-0.000 (0.009)	0.003 (0.010)
	第二产业产值占 GDP 的 比例(%)	0.002 (0.005)	0.011 ^{***} (0.003)	0.005 (0.003)	-0.010 [*] (0.006)	0.012 ^{***} (0.004)	0.004 (0.004)	0.022 (0.015)	0.027 ^{***} (0.008)	0.023 ^{***} (0.008)
	固定资产投资占 GDP 的 比例(%)	0.004 (0.002)	0.003 [*] (0.002)	0.002 (0.002)	0.016 ^{***} (0.003)	0.003 (0.003)	0.003 (0.002)	0.008 (0.006)	0.004 (0.004)	0.001 (0.004)
	人均商品零售额(万元/ 人)	1.240 ^{***} (0.422)	1.375 ^{***} (0.282)	0.336 (0.311)	1.716 ^{***} (0.660)	1.914 ^{***} (0.487)	0.777 [*] (0.449)	3.188 ^{***} (1.016)	1.793 ^{***} (0.545)	1.352 ^{***} (0.536)
	实际利用外资(万美元/ 亿元)			-0.018 ^{***} (0.005)	0.006 [*] (0.005)	-0.004 (0.004)	-0.002 (0.003)	0.013 ^{***} (0.009)	0.005 (0.005)	(0.005)
政府行为	地方财政支出占 GDP 的 比例(%)				0.032 ^{***} (0.011)	0.024 ^{***} (0.008)	0.021 ^{***} (0.008)	0.032 [*] (0.018)	0.022 ^{***} (0.010)	0.032 ^{***} (0.010)
	政府消费占总消费的比例 (%)				-0.000 (0.000)	-0.000 (0.000)	-0.000 (0.000)	-0.000 (0.000)	0.000 (0.000)	0.000 (0.000)
	农业财政拨款占财政支 出的比例(%)				0.023 ^{***} (0.010)	0.006 (0.007)	0.006 (0.007)	0.030 [*] (0.016)	0.019 ^{***} (0.009)	0.011 (0.009)
	文教卫财政拨款占财政 支出的比例(%)				0.024 ^{***} (0.007)	0.015 ^{***} (0.006)	0.010 ^{**} (0.004)	0.018 (0.011)	0.014 ^{***} (0.006)	0.012 ^{***} (0.005)
基础设施	铁路里程(公里/万人)	-0.003 (0.042)	-0.040 ^{***} (0.014)	0.006 (0.021)	0.035 (0.062)	-0.041 ^{***} (0.016)	-0.019 (0.025)	0.115 (0.078)	-0.071 ^{***} (0.028)	-0.051 (0.035)
	公路里程(公里/万人)	0.011 ^{***} (0.004)	0.002 [*] (0.001)	0.002 (0.001)	0.036 ^{***} (0.006)	-0.006 [*] (0.003)	-0.001 (0.005)	0.035 ^{***} (0.008)	-0.014 ^{***} (0.004)	-0.009 [*] (0.005)
对外贸易	出口总额(万美元)							0.122 (2.733)	-1.293 (1.191)	-0.245 (1.320)
	初级产品出口份额(万 分比)							0.133 (0.308)	0.450 ^{***} (0.160)	0.130 (0.159)
	一般贸易出口份额(万 分比)							-0.966 ^{***} (0.358)	-0.643 ^{***} (0.215)	-0.434 ^{***} (0.210)
	外资企业出口份额(万 分比)							-0.512 (0.784)	-1.710 (0.518)	-1.251 ^{***} (0.468)
	国有和集体所有企业出 口份额(万分比)							-0.189 (0.740)	-1.853 ^{***} (0.512)	-1.403 ^{***} (0.464)
	向 OECD 国家出口份额 (万分比)							-0.197 (0.472)	0.311 (0.239)	0.221 (0.237)
常数项		5.556 ^{***} (0.941)	6.481 ^{***} (0.516)	4.139 ^{***} (0.662)	-1.219 (1.448)	10.060 ^{***} (0.963)	5.484 ^{***} (1.049)	-5.126 (3.354)	12.260 ^{***} (1.711)	8.436 ^{***} (1.639)
观测值个数		795	795	795	517	517	517	253	253	253
R ²		0.658			0.695			0.537		
省份个数		31	31	31	30	30	30	29	29	29

注：(1) 所有的数据都为分省数据。贸易数据来自历年中国海关总署和商务部 其余数据主要来自历年《中国统计年鉴》

以及相关的各省的统计年鉴,一些较早年份的数据来自《新中国 55 年统计资料汇编》。由于“实际利用外资”等分省数据无法获得,第二组回归的时间跨度为 1978—2004 年。由于对外贸易相关数据无法获得,第三组回归的时间跨度为 1993—2004 年。(2) 本文所使用的贸易数据基于 SITC 五位数分类(1992 年之前)或 HS 六位数分类(1992 年之后,分类标准为 HS92 版本)。而本文对省际单位贸易数据的使用是从 1993 年开始,这主要有两个原因:一是 1993 年之前,在海关统计中,我国的对外贸易中有相当一部分是由国家进出口公司完成的,不能归口到省份;二是 1993 年以前的海关数据统计有很多不规范之处,存在对转口贸易的处理相当粗糙等诸多问题,这会影响相关指标的计算。(3) *** 表示 1% 的显著性水平, ** 表示 5% 的显著性水平, * 表示 10% 的显著性水平,括号内的数字表示标准误。(4) 9 个检验方程均控制年份固定效应。篇幅所限,表 1 中没有列出年份固定效应回归系数。(5) 关于面板数据回归的分组差异,根据非平衡面板数据的构建,并参考相关控制变量的数据可获得性,第一组回归中包含所有的 31 个省(自治区、直辖市),第二组剔除了重庆,第三组剔除了重庆和西藏。(6) 稳健性检验。我们对相关计量结果从价格调整与内生性处理两个方面进行了稳健性检验。其一,价格调整。表 1 的计量检验重点在于相对检验,并非要对具体的影响程度进行详细的分析,价格因子对本文的结果影响不大,表 1 中所列举的所有变量均没有经过价格调整。但是,为慎重起见,并检验结果的稳健性,本文对计量检验做了较为详细的价格调整,包括:城乡消费水平分别按照城乡消费价格指数调整,相关控制变量也进行相应的价格调整,基本结论没有变化,限于篇幅,结果没有列出。其二,内生性问题的处理。对于某些变量,如外商直接投资、收入水平等,采取存量指标或滞后指标进行简单的内生性处理。这两方面的调整对结果也没有产生显著影响。

为什么会出现这种“经济发展落后的地区城乡居民消费差距越大”的现象呢?我们可以简要从三个方面来理解。第一,城乡分治的二元经济结构和渐进式改革道路决定了这种现象存在的必然性。重工业优先发展的赶超战略,不符合我国资本不足、劳动力富余的国情,而要实现这样的发展目标,必然要通过一种特殊的制度安排和国家的行政力量使得资源错配,而为此做出的最大的制度创新就是城乡二元经济结构,这成为城乡居民消费差距的历史根源。更进一步,从 1978 年开始的改革是典型的渐进式改革,“摸着石头过河”,这种以经济效率为第一目标的类似于“中原逐鹿”式的改革方式,更兼各个省份之间工业基础和区位等差异,必然导致各个省份之间经济发展的不平衡。在改革开放的最初十多年,“放权让利”是主旋律,这适合于国有企业改革,也适合于政府管理体制变革,一直到 1994 年的分税制改革,财政安排都是中央小、地方大的模式,中央没有足够的财力进行转移支付,这也是这种现象越来越严重的重要原因之一。第二,经济发达地区城镇经济的迅速发展带动了其周边农村地区的经济发展,从而促进了当地农村居民消费水平的提高。发展经济学中的扩散效应理论认为,一个地区的发展将通过辐射作用带动相邻地区的发展。发达地区城镇经济的迅速发展必然导致其对周边农村地区商品和服务需求的增加,从而提高其周边农村地区居民的收入水平,进而改善其生活状况。例如,在我国的北京、上海、深圳等地区,城市经济的迅速发展、城市的扩张增加了其对周边农村地区土地、劳动力、农产品等方面的需求,这些地区农村居民的收入水平都很高,收入增加了,消费水平自然提高了。第三,贫困的边缘化。蔡昉和万广华(2006)指出,随着我国贫困人口的减少,我国农村贫困人口出现了地理分布上的边缘化倾向,即农村贫困人口越来越集中在生活和生产条件恶劣的边缘化地区。本文也发现,城乡居民消费差距最高的几个省份基本都处于偏远的西部地区,这些地区的农村居民大多居住在不适宜人类生存、生产条件恶劣的地带,其经济难以发展,基础设施建设更是落后,居民消费水平难以提高,形成恶性循环。

根据计量检验的结果,也可以简单讨论其他因素对城乡居民消费差距的影响。在计量模型考虑到的五个方面的影响因素之中,社会发展方面的影响最大,如农村居民纯收入、城镇居民可支配收入等指标对城乡居民消费差距的影响最大。此外,对外贸易、基础设施建设、经济发展现状、政府行为等因素有着依次递减的影响程度。需要特别指出的是,基础设施较好的地区,城乡居民消费差距较小。本文用铁路密度和公路的人均密度表示一省的基础设施建设,而这些指标的差异主要是体现在农村,尤其是公路建设,城市在公路交通方面的差异是非常小的。这就说明,农村的道路等基础设施建设对农村居民收入和消费水平的提高有较大的促进作用。我国自 1980 年代中期到现在的二十多年间,发展战略一直都是重城市、轻农村,使得农村不能充分共享经济发展的成果。从本文的结论来看,在今后的发展过程中,我们应该更加注重农村基础设施建设,这对实现公平有效的可持续发展有积极意义。总体而言,在控制了社会发展情况、经济发展现状、政府行为、基础设施建设、对外贸易情况等因素的情况下,检验结果显著表明“经济发展越落后的地区城乡居民消费差距越大”现象的存在,而造成这种现象的原因是多方面的,对应于计量检验结果,本文初步探讨了一些改善这种现象的措施。当然,城乡二元经济结构是我国长久以来的一个非常严重的历史遗留问题,原因和解决方法都非常复杂,很多细节问题还有待进一步的研究。

四、城乡居民消费差距的发展前景

实证检验表明,改革开放三十年以来,我国地区经济发展水平与城乡居民消费差距之间存在显著的负相

关关系。如果长期按照这种模式,城乡一体化、区域协调发展都将成为“奢谈”,城乡二元经济结构还将在以后的发展中成为一道难以逾越的门槛。经验分析中我们已经提到,虽然从全国整体来看,这种现象一直存在,但从各个省份的横向比较和纵向发展来看,还是有一些值得重视的新发现。如果这种负相关从改革开放以来就一直存在,是否越来越严重呢?一个国家的经济发展过程中,不可避免要面临“公平”与“效率”的选择,在国家发展的初期,经济效率第一似乎也无厚非。这也是我国1980年代中期到1990年代中期的情况,当时的流行观点就是“效率第一,兼顾公平”,然而,当经济发展到一定程度以后,就必须考虑“公平”问题,如果城乡差距和地区差距不断恶化,是不可能实现可持续发展的。基于省际横截面数据,可以得到我国历年城乡居民消费差距对人均GDP的简单回归系数,回归系数的大小表示这种现象的程度,图6列出了1978-2007年的30组简单回归系数的绝对值。

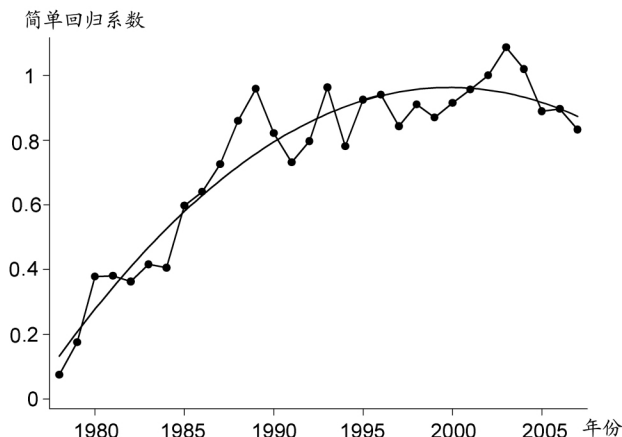


图6 1978-2007年城乡居民消费差距对人均GDP的简单回归系数

从图6可以看出,1978年以来,我国城乡居民消费差距与人均GDP的简单回归系数基本上也是经历了三个发展阶段。从1978-1989年,回归系数快速上升,回归系数由0.08上升到0.96,即经济越发达的地区,城乡居民消费差距越小,越落后的地区,城乡居民消费差距越大,且这一特征日益明显。这一时期,我国的发展模式是非常典型的“效率优先,兼顾公平”,一切以经济发展为前提,为此也产生了城乡差异、地区差异等诸多社会问题。回归系数在1989年达到一个高峰后,开始有所回落,并处于高位振荡状态,略有轻微上升趋势,这种情况一直持续到2003年,2003年的简单回归系数为1.10。回归系数从2003年开始下降,2004到2007年的回归系数分别为1.00、0.89、0.89、0.83,从2003-2007年,下降了25%,这也许意味着我国在经历了最开始的经济效率第一的情况下的发展之后,越来越注重发展的质量,注重发展的公平与正义。

五、结论与扩展

本文详细考察了我国省际经济发展水平与城乡居民消费差距的关系。结论主要包括三个方面。第一,城乡二元经济体制下,改革开放三十年来,随着经济的不断发展,我国总体城乡居民消费差距经历了先下降、再上升、后维持高位振荡的变化过程。而省际城乡居民消费差距一直存在这样一种现象:经济发展越落后的地区,城乡居民消费差距越大。第二,本文构建1978-2007年的省际面板数据,基于不同模型的计量检验结果均表明这种现象的存在,在经历改革开放初期的“集体贫困”之后,该现象在1980年代中期以后的二十年间显得尤为突出。而一些省份在经济发展到一定阶段后,城乡居民消费差距开始下降,这是我们迈向理想“渐进均富”的希望所在。第三,本文从社会发展、经济现状、政府行为、基础设施建设、对外贸易五个方面对影响省际城乡居民消费差距的因素进行了较为详细的考察,研究发现,扩大农村基础设施建设、促进教育公平、完善农村社会保障体系和重视社会经济的人类发展目标等措施有助于我们实现理想的“渐进均富”。

改革开放已经过去30年,短缺时代早已过去,原始的内生增长潜力也已挖掘殆尽,要保持国民经济的持续快速增长,就必须对发展过程中面临的问题进行全面深入的剖析,并由此做出合适的政策调整和制度变革。二元经济体制和区域经济发展差异是我国现阶段最重要的“国情”,城乡平衡、区域平衡并实现共同富裕的和谐发展方式是我们追求的终极目标。正如前文指出,现有的研究虽然对城乡差距和区域失衡等问题进行了大量的研究,但将二者结合起来的科研成果还不多见,本文的研究也还只是初步的探索,后续还有待收集更为详细的微观数据,进行更为详细深入的研究和讨论。

(下转第107页)

securities price linkage is also increasingly remarkable. In view of this ,this paper summarizes the existing theory literatures and the shortage of empirical results and build VAR – GJR – GARCH – DCC framework to make an rigorous and comprehensive analysis of linkage effects among the Shanghai and Shenzhen and Hong Kong stock market. The main results are: (1) three markets have the linkage effect ,directly or indirectly lead to each other; (2) to the Hong Kong market innovation shock ,Shanghai and Shenzhen stock markets make similar responses ,which even be the same. This conclusion provides new evidence for the integration of Shanghai and Shenzhen stock market; (3) three market correlation has time – varying dynamic characteristics ,and the “China factor” and “world factor” tend to be increasing. These empirical conclusions have important implications to understand the operation mechanism of the market and establish a reasonable investment strategy and to guard against stock market risk and promote market integration effectively for regulators.

Key Words: Shanghai ,Shenzhen and Hong Kong Stock Market; Economic Integration; Dynamic Linkage

JEL Classification: G14

(责任编辑: 孙永平、陈永清)

(上接第 84 页)

参考文献:

1. 蔡昉 2003 《城乡居民收入差距与制度变革的临界点》,《中国社会科学》第 5 期。
2. 蔡昉、王美艳 2009 《为什么劳动力流动没有缩小城乡收入差距》,《经济学动态》第 11 期。
3. 蔡昉、万广华 2006 《中国收入差距和贫困研究: 我们知道什么 我们应该知道什么》,载于蔡昉、万广华《中国转轨时期收入差距与贫困》,社会科学文献出版社,第 1 – 24 页。
4. 陈钊、陆铭 2004 《城市化、城市倾向的经济政策与城乡收入差距》,《经济研究》第 6 期。
5. 陈宗胜、周云波 2001 《非法非正常收入对居民收入差别的影响及其经济学解释》,《经济研究》第 4 期。
6. 李军 2003 《收入差距对消费需求影响的定量分析》,《数量经济技术经济研究》第 9 期。
7. 李坤望、黄玖立 2006 《中国贸易开放度的经验分析: 以制造业为例》,《世界经济》第 6 期。
8. 李实、魏众、丁赛 2005 《中国居民财产分布不均等及其原因的经验分析》,《经济研究》第 6 期。
9. 林毅夫、蔡昉、李周 1994 《中国的奇迹: 发展战略与经济改革》,上海人民出版社。
10. 林毅夫、刘明兴 2003 《中国经济的增长收敛与收入分配》,《世界经济》第 8 期。
11. 罗楚亮 2004 《经济转轨、不确定性与城镇居民消费行为》,《经济研究》第 8 期。
12. 阮杨、陆铭、陈钊 2002 《经济转型中的就业重构与收入分配》,《管理世界》第 11 期。
13. 沈坤荣、张璟 2007 《中国农村公共支出及其绩效分析——基于农民收入增长和城乡收入差距的经验研究》,《管理世界》第 6 期。
14. 苏良军、何一峰 2006 《中国存在消费的“库兹涅茨之谜”吗》,《经济科学》第 2 期。
15. 田新民、王少国、杨永恒 2009 《城乡收入差距变动及其对经济效率的影响》,《经济研究》第 7 期。
16. 吴晓明、吴栋 2007 《我国城镇居民平均消费倾向与收入分配状况关系的实证研究》,《数量经济技术经济研究》第 5 期。
17. 杨汝岱 2008 《制度与发展: 中国的实践》,《管理世界》第 7 期。
18. 杨汝岱、朱诗娥 2007 《公平与效率不可兼得吗? ——基于居民边际消费倾向的研究》,《经济研究》第 12 期。
19. 姚洋 2004 《转轨中国: 审视社会公正和平等》,中国人民大学出版社。
20. 臧旭恒、裴春霞 2007 《转轨时期中国城乡居民消费行为比较研究》,《数量经济技术经济研究》第 1 期。
21. Nurkse R. 1953. *Problems of Capital Formation in Underdeveloped Countries*. Oxford: Blackwell.
22. Rostow W. W. 1990. *The Stages of Economic Growth: A Non – Communist Manifesto*. Cambridge ,MA: Cambridge University Press.

Study on the Relationship between Urban and Rural Residents' Consumption Disparity and Regional Economic Performance

Zhu Shi'e¹ and Yang Rudai^{1,2}

(1: Academy for Consumption Studies ,Xiangtan University; 2: Peking University – Lincoln Institute)

Abstract: This paper probes into the relationship between urban and rural residents' consumption disparity and economic performance of regions. Empirical observation shows that disparity between urban and rural residents' consumption is negatively related to regional economic performance in China ,namely ,the poorer the region is ,the larger the urban and rural residents' consumption disparity will be. We construct panel data on provincial level in the period of 1978 – 2007. All the econometric analysis based on different models validates this relationship. It is worth noting that disparity between urban and rural residents' consumption in some regions tend to go down in recent years when economy has developed to a high extent. Besides economic performance ,other factors are included in our regression such as social development ,government behavior ,infrastructure structure ,foreign trade ,and so on. It is shown that these factors have positive effect on residents' consumption.

Key Words: Regional Disparity; Consumption Disparity; Panel Data

JEL Classification: D120 ,D910

(责任编辑: 彭爽)