

# 面向共同富裕问题的因果推断

张征宇 陈浩文 郎旭华\*

**摘要:** 共同富裕是社会主义的本质要求,而将其与因果推断相结合,是中国特色社会主义实践与现代计量经济学方法融合的重要探索。本文立足于因果推断理论的演进历程与最新发展,系统阐释了建立面向共同富裕问题的因果推断理论框架的必要性与可行路径。研究认为,因果推断理论经历了平均处理效应、异质性效应和数智技术创新的探索过程,但传统方法在解决当前复杂高维共同富裕问题时仍有局限。从理论和现实必要性来看,因果推断理论与共同富裕问题具有方法契合性、现实研究延展性以及理论创新相容性。未来,学者们应当以共同富裕问题激发因果推断理论创新,利用异质性因果推断促进共同富裕理论发现,同时推动面向共同富裕的因果推断数智化。本文旨在探索如何结合中国现实问题推进经济学方法论创新,为实现具有中国特色的因果推断理论发展、促进中国经济学自主知识体系构建与国际传播提供有益参考。

**关键词:** 共同富裕;因果推断;异质性效应;收入分配

**中图分类号:** F08;F064.1

## 一、问题的提出

共同富裕是社会主义的本质要求,是中国式现代化的重要特征。如何立足中国国情、以中国特色问题为导向推进共同富裕理论创新,已然成为当前亟需深入研究和解答的重大时代课题之一。共同富裕作为一个内涵丰富、层次复杂的重大主题,相关研究主要从两个方面展开:其一是理论内涵层面,即从发展的历史逻辑与现实要求出发,阐明共同富裕的本质含义、价值取向以及构建共同富裕目标体系的必要性。这一层面关注的是为什么要实现共同富裕、要实现什么样的共同富裕等重大理论问题(王琳,2025)。其二是实现路径层面,即在明确目标导向的基础上,探讨通过怎样的制度安排与政策设计以推动共同富裕的实现。这主要包括促进经济增长、优化收入分配、完善公共服务与社会保障体系等政策工具的综合运用,同时离不开对政策效果的科学识别与持续优化。在这一过程中,因果推断理论通过揭示

\*张征宇,上海财经大学经济学院、上海财经大学数理经济学教育部重点实验室,邮政编码:200433,电子信箱:zy.zhang@mail.shufe.edu.cn;陈浩文(通讯作者),上海财经大学经济学院,邮政编码:200433,电子信箱:chenhw2021@163.sufe.edu.cn;郎旭华,上海财经大学经济学院,邮政编码:200433,电子信箱:langxuhua@mail.shufe.edu.cn。

本文获得国家自然科学基金面上项目“政策效应异质性的识别和推断:从因变量条件型参数视角”(72273076)的资助。感谢匿名审稿专家的宝贵意见,文责自负。

政策与结果之间的因果关系,帮助构建以实证证据为基础的政策评估体系,从而为共同富裕相关政策优化提供经验支撑,形成扎实推进共同富裕的逻辑起点。

当前国内学术界已经利用因果推断在共同富裕领域展开了多维度、多层次的研究探索。从研究方法看,学者们开始尝试测度各类共同富裕指数或收入不平等指数,并利用因果推断方法评估相关政策对其影响来完成实证分析(万广华等,2024;张金林等,2022;周亚虹等,2024)。此外,部分文献探讨了居民收入差距、社会不平等、包容性增长等与共同富裕内涵相一致的问题,主要采用分样本回归或交互项等简要异质性分析手段(张勋等,2019)。上述研究在因果推断方法引入共同富裕研究中发挥了积极作用,不仅推动了相关议题的实证探索,也在一定程度上为政府决策提供了有价值的经验依据和量化支撑。然而,目前的研究仍多集中于经典因果推断方法在政策平均效应评估中的简单应用,针对共同富裕问题的因果推断方法论改进或创新并不多见,特别是能够充分体现共同富裕内在要求的异质性效应因果推断理论亟待发展。

整体来看,国内关于共同富裕的实证研究在运用因果推断方法时仍存在一定的改进空间。一方面,由于方法适用性的局限,某些研究呈现出数据精细化程度提高但对共同富裕理论贡献有限的特征,这种理论与实证的脱节现象,在一定程度上影响了学界对因果推断数理分析方法价值的客观认知。另一方面,基于共同富裕问题的原创性因果推断理论并不多见。部分研究在分析中国特有的经济问题时,存在对因果推断计量模型的直接套用现象。上述情况导致研究过程复杂化而结论创新性不足,甚至导致某些领域的研究陷入“内卷化”困境,即虽然采用了更精细的数据处理技术,但在共同富裕因果机制发现和因果推断理论创新方面进展有限。值得肯定的是,近年来涌现出一批系统介绍因果推断方法应用的综述性研究(黄炜等,2025;余振等,2025),这反映出国内实证研究在方法论运用上正逐步走向规范化与科学化。尽管如此,这些研究本质上仍属于国际主流计量经济学方法在中国的应用拓展,因果推断理论创新并不多见。因此,我们有必要构建面向共同富裕问题的因果推断理论框架,不仅结合中国共同富裕问题的特点,进行具有本土特色的因果推断理论改进性应用或原创性创新,而且利用相关因果推断理论创新进一步应用于共同富裕的理论进展推进与实践路径研究。

实际上,共同富裕作与因果推断理论可以通过具体的问题解构和对策重构,找到二者有机结合的突破口,从而为发展具有中国特色的共同富裕因果推断理论提供坚实的学理基础。一方面,将因果推断框架引入共同富裕问题研究,是对中国特色经济实践方法论的深化与拓展,这有助于为扎实推进共同富裕的相关政策因果效应评估提供可靠定量分析依据。另一方面,共同富裕与因果推断理论的有机结合,对于构建中国经济学自主知识体系的具体实践逻辑、向上贯通整体性的发展理论具有重要的促进作用,从而为国内国际学术界更好认识中国经济问题,特别是认识共同富裕领域的新发展提供新的分析范式。

基于此,本文试图回答以下问题:第一,为什么我们要构建面向共同富裕问题的因果推断?作为客观的方法论工具,因果推断理论在研究共同富裕问题,提高相关政策的科学性和针对性上具有很大的潜力。以因果推断理论作为联系经济学理论与数据分析的桥梁,可以为收入分配相关政策提供有效建议或参考,从而回答共同富裕经济学的核心科学问题。目前国内研究在该领域仍主要集中于传统因果推断方法的应用层面,尚未形成能够回应中国

特色问题背景的理论创新。我们有必要推进因果推断方法在理念与技术层面的本土化重构,探索构建契合中国收入分配特征与共同富裕目标的因果推断理论体系。为此,本文将探索构建面向共同富裕问题因果推断的理论与现实依据,从方法论层面、理论融合层面和现实研究层面等维度讨论因果推断对研究共同富裕问题、构建中国经济学自主知识体系的积极影响。

第二,如何推动面向共同富裕问题因果推断理论框架的发展?从既有研究来看,面向收入分配与共同富裕的因果推断研究,应在充分吸收前沿计量经济学成果的基础上,推进其在中国情境下的改进性应用,并进一步推动具有中国特色的原创性方法论创新。因而我们从原创理论、机制理解和大数据技术应用等视角介绍了一些理论框架建设的思考,试图为推进相关理论的创新或引用提供思路。

余下结构安排如下:第二部分将系统梳理因果推断在共同富裕问题应用中的演进历程,以客观视角简要介绍因果推断理论从平均效应分析到异质效应分析的转变;第三部分回应为什么要构建面向共同富裕问题的因果推断,介绍了因果推断理论在解决共同富裕问题上的合理性与必要性,给出了相应的理论意义与现实依据;第四部分则提出了如何构建面向共同富裕问题的因果推断的一些思考,简要阐述其基本理论框架、典型应用实例与未来研究方向;最后是本文的结语。

## 二、因果推断在共同富裕问题中的研究进展与应用

现代计量经济学体系中的因果推断理论在“可信度革命”推动下,逐步发展为当代社会科学的核心方法论之一。为明确构建面向收入分配与共同富裕的因果推断研究的现实意义与发展路径,首要任务是系统梳理现代计量经济学框架下因果推断理论在共同富裕和收入分配问题中的理论脉络,如此才能为探索契合我国国情的共同富裕理论创新提供支持。

### (一) 识别平均效应的因果推断

共同富裕的内涵不仅包括收入层面的均衡增长,更强调在机会、能力与公共服务等多维度实现包容性发展(李实、朱梦冰,2022)。伴随数据可得性与因果推断可信性的提升,学界在共同富裕问题上的研究逐渐从概念阐释转向可度量化与可识别化的实证分析阶段。研究者们通过构建综合性共同富裕指标体系,试图刻画不同地区、群体在经济富裕、社会共享与精神生活等维度的差距与趋同趋势(刘培林等,2021;万海远、陈基平,2021)。然而,仅仅揭示差异并不足以政策提供有效依据。判断某一具体政策是否真正促进了共同富裕,研究者亟需在实证上识别政策对共同富裕和收入分配的平均因果效应。在上述背景下,因果推断首先需要做的就是评估平均处理效应(Average Treatment Effect, ATE),核心目的在于回答这样的问题:一项政策的实施,是否以及在多大程度上能够提升共同富裕水平或改善收入分配结构?

20世纪70至80年代,学界对收入分配与社会公平的研究主要依托传统计量经济学框架,仅通过多元回归等方法刻画变量间的关系(Long et al., 1977)。然而因其结果容易受到内生性问题的影响,这些研究常被批评为数据挖掘或相关性分析,难以证实因果关系或用于指导政策实施(Leamer, 1983)。进入20世纪90年代后,计量经济学方法论迎来了以“可信度革命”为标志的深刻转向(Angrist and Pischke, 2010)。计量经济学“可信度革命”使得因

果推断逐渐受到重视,推动实证研究从传统的相关性分析转向因果关系的严谨识别。

在这一背景下,因果推断方法被系统引入共同富裕与收入分配的研究中。早期研究多聚焦于平均效应的识别——即某项政策对总体目标变量的平均影响。平均效应具有理论简洁、政策相关性强、计算要求较低等优势,因而成为研究共同富裕问题的重要内容。研究者通常先构建可度量的共同富裕指数或收入分配指标,再通过实验设计或模型设定模拟政策的“准随机化”情境,以估计其平均因果效应。常用方法包括随机对照试验(Randomized Controlled Trials, RCT)、依可观测变量选择(Selection on Observables)、工具变量(Instrumental Variables, IV)、匹配方法(Matching Methods)、双重差分法(Difference-in-Differences, DID)、断点回归(Regression Discontinuity Design, RDD)等等。

这些方法已在共同富裕和收入分配的实证研究中得到广泛应用。例如,张金林等(2022)从物质富裕、精神富裕和社会共享三个维度构建了家庭层面的共同富裕指数,并滞后一期自变量,使用线性回归发现数字普惠金融能够推动共同富裕,并且创业活跃度的提升是其重要路径;徐洁和李琳(2024)从经济实力、发展动力、收入分配和服务普惠4个维度构建县域共同富裕评价体系,并使用双重差分法识别电子商务进农村示范政策的平均影响,发现该政策显著提高了共同富裕水平,但区域间差距有所扩大;Gupta和Jalles(2022)采用基尼系数和贫困群体与富裕群体的收入份额来度量收入分配水平,然后利用局部投影法来估计脉冲响应函数,从而捕捉政策改革对收入分配影响的动态效应,结果发现加强税收管理对降低收入不平等的正向影响。

总体而言,这些研究推动了共同富裕与收入分配研究从传统相关分析向因果推断范式的转变,使政策评估更具实证支撑和可解释性。随着数据质量提升、理论深化及计算能力增强,研究者们正逐步从平均效应扩展至对异质性效应和复杂因果机制的深入探讨,以满足共同富裕实践中对精准识别和差异化治理的现实需求。

## (二) 异质性效应快速兴起的因果推断

共同富裕的目标要求政策既要“做大蛋糕”,又要“分好蛋糕”,即实现增长与公平的动态平衡。要实现精准施策,仅仅掌握政策的平均效应远远不够,政策制定者更需要了解“对谁有效、在何种条件下有效、效果如何不同”等关键问题。与此同时,随着因果推断理论体系的日趋完善,研究者逐渐意识到平均效应无法揭示政策对不同群体的差异性影响这一局限性<sup>①</sup>。从2000年代中后期开始,越来越多学者开始关注处理效应的异质性,由此产生了一系列以评估异质性效应为核心的因果推断理论创新。整体来看,此时期应用于共同富裕和收入分配问题的因果推断大概可以分为两类。

第一,基于均值回归的异质性分析方法。此类方法假设异质性可以通过协变量的线性或简单非线性形式捕捉,或通过回归模型估计因果效应的均值差异判断异质性是否存在,常

<sup>①</sup>基于静态模型估计政策的平均处理效应往往无法揭示政策的异质性作用,而不同人对同一政策反应不同,个体的选择在时间上也具有前后依赖性。一些更为细致的异质性共同富裕问题,也无法用指数构造或简单分样本回归来识别。例如,通过DID识别了某一政策实施缩小了地方收入差距,但无法识别究竟是哪一类收入群体的相对变化造成了这一结果;利用工具变量识别了税率减免对提升消费的平均效应,但无法识别究竟使得高消费家庭,还是低消费家庭的消费增长更多。

见做法有交互项模型和互斥分组回归 (Vivalt, 2015)。交互项模型一般使用异质性变量与政策变量进行交互并引入原线性回归模型,通过交互项系数判断异质性的有无。如张勋和万广华(2016)通过引入因变量滞后项与政策变量的交互项提出了一个研究包容性增长的实证框架,发现中国农村基础设施提高了农村居民水平并且低收入人群获益更多。互斥分组回归则将数据按某一特征(如性别、收入水平)分成互斥子群,分别估计各子群的平均处理效应,可视为交互项模型的离散形式。上述方法模型简单,易于解释,适合线性假设和引发异质性的变量较为明确的场景,然而难以捕捉复杂或非线性异质性效应,因此对共同富裕问题中更细致的子群体的分析仍显不足。

第二,基于分布或分位数效应的异质性分析方法。这些方法关注因果效应对结果(Y)分布的影响或处理(D)选择中的异质性,区别于通过识别方程外异质性变量所产生差异效果的方法。基于分布效应的异质性分析方法聚焦于刻画政策对结果变量(或不可观测变量)处于不同分布水平的边际影响,这一做法往往根据分位数展开,常见方法包括分位数处理效应(Quantile Treatment Effects, QTE)、条件分位数回归(Quantile Regression, QR)或无条件分位数回归(Unconditional Quantile Regression, UQR)及其各类变化形式(张征宇等, 2021; Chernozhukov and Hansen, 2005; Firpo et al., 2009)。例如王轶和刘蕾(2022)使用旨在实现无条件分位数回归的RIF模型,识别出返乡创业活动对低分位点的农民工资性收入提升作用更显著,从而发现了农民工返乡创业促进农民农村共同富裕的结论。

异质性效应识别的兴起,不仅丰富了共同富裕研究的分析维度,也推动了政策评估从“是否有效”走向“对谁更有效”的深入探讨。如图1所示,实现共同富裕的政策路径围绕解决发展的不平衡不充分问题展开,而在这一过程中识别哪些群体从政策中受益更多、受益较少或甚至受损的异质性效应则是必不可少的环节。近年来,越来越多的学者开始使用异质性效应识别来增进对共同富裕问题的机制理解(万广华等, 2024; 周亚虹等, 2024),但整体上在方法改进、假设检验等方面仍存在一定的提升空间。尽管如此,这一理论与方法的扩展,使因果推断在共同富裕与收入分配问题中具备了更强的解释力与应用价值,为实现精准、公平与可持续的共同富裕提供了坚实的实证支撑。

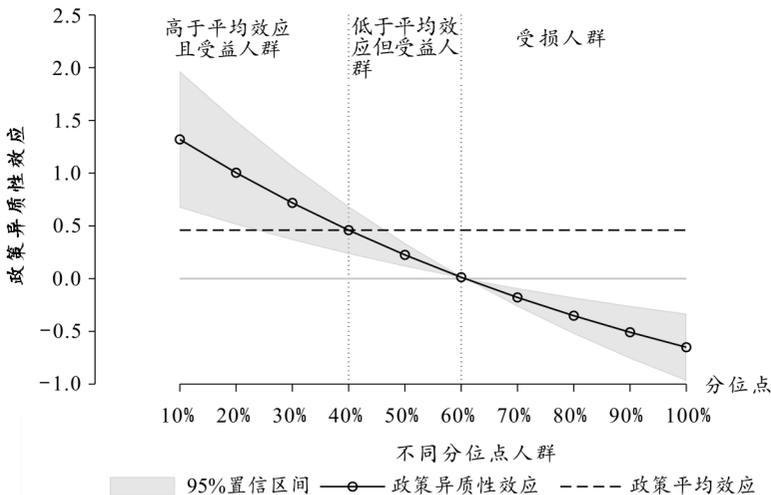


图1 共同富裕视角下的政策异质性效应与受益群体划分

### (三) 数智时代的异质性效应方法创新

传统异质性效应方法为研究政策在城乡、收入层次、产业或家庭间的差异化作用提供了重要分析框架,为理解共同富裕的实现路径奠定了基础。然而,随着经济社会运行环境日益复杂,传统方法在捕捉多维度、多层次异质性方面显现出局限性。当政策调整涉及高维度、动态性或非线性因素时,线性回归、分组回归等传统工具难以充分刻画各群体间的真实差异。在此背景下,因果推断的异质性效应研究正在向数据驱动、算法增强的新范式演进,并展现出了在共同富裕和收入分配问题上应用的广阔前景,为进一步精确评估政策在推动共同富裕中的作用机制提供了方法论指引。

近年来,依托大数据技术和人工智能算法,异质性效应分析方法经历了革命性的创新。一系列基于机器学习和大数据技术的改进方法显著提升了传统异质性分析的效率与准确性,例如使用 LASSO(Least Absolute Shrinkage and Selection Operator)及其衍生方法处理高维数据(Wang et al.,2007)、利用双重机器学习(Double Machine Learning,DML)通过分步估计消除内生性偏差对因果推断的干扰(Chernozhukov et al.,2018)、结合正则化技术的交互效应建模以避免高维数据中的过拟合(Bickel et al.,2009)等等<sup>①</sup>。此外,近年来涌现了许多利用机器学习和大数据的新型异质性效应评估方法,突破了传统方法在个体化分析上的局限(郭峰、陶旭辉,2023)。例如,基于集成学习的因果随机森林(Causal Random Forest)方法通过集成决策树有效识别不同子群体的条件平均处理效应,并捕捉非线性关系和高阶交互效应,大大提升了异质性分析的精度(Wager and Athey,2018)。由此衍生的政策学习(Policy Learning)框架可直接从数据中学习最优个体化政策分配规则,实现从传统的“效应识别”向“决策优化”的转变(Athey and Wager,2021)。再比如,深度学习(Deep Learning)凭借强大特征提取能力,可处理图像、文本等多模态数据,将个体层面异质性分析扩展至传统方法难以覆盖的领域(Dell,2025)。这些创新为因果推断提供了更精确的异质性分析工具,也将为未来在共同富裕政策评估中的应用提供潜力。

尽管如此,目前这些新型方法在共同富裕与收入分配的实证研究中应用仍有限,仅有少量研究开始尝试使用大数据和机器学习方法进行因果推断(Motahar and Mamipour,2025),多数仍处于探索阶段,主要受制于数据可得性、样本规模、计算资源和模型解释性等因素。然而,随着理论和方法的不断发展,这类因果推断工具有望在未来成为共同富裕政策评估与精准施策的重要手段,实现更进一步的政策设计优化,从而更有效推动共同富裕目标的实现。例如,机器学习有助于超越传统上单一社会环境因素对收入分配影响研究的范式(马艳、张建勋,2015;Roemer,1993),深度刻画由各类环境因素交互引致的机会不平等对收入不平等的复合影响,从而为深度探究机会因素在我国财产制度与收入分配之间的作用机制,完

<sup>①</sup>从近年来的因果推断理论演进来看,以机器学习为代表的大数据技术一方面催生了诸多新的理论方法,例如政策学习、因果树等;另一方面对一些经典方法进行了很大程度上的革新,例如双重差分法的各种变形。由于本文主题并非因果推断方法介绍综述,因此限于篇幅仅对部分因果推断方法进行了简要梗概,供读者参考。

善面向共同富裕的“机会公平—结果公平”的学理链条提供有益思考。

一般而言,因果推断理论可以按照识别条件进行划分,不同识别假设对应不同的因果识别策略,例如随机化、条件独立、平行趋势、局部连续性等。但回顾因果推断理论在共同富裕领域中的发展历程,我们可以从政策效应参数类型角度对因果推断理论进行区分。从平均处理效应的基础性探索,到异质性效应的系统性研究,再到数智时代的方法论革新,可以发现在不同识别条件下,因果推断理论已经在共同富裕问题研究中得到了广泛应用,并已初步展现出解决复杂性问题的能力(见图2)。基于共同富裕目标在统筹经济增长和收入分配上的复合性,传统政策效应参数的单一化解已难以全面涵盖收入和机会公平各方面的经济动态发展过程及其内在的交互关系。这要求我们进一步构建符合共同富裕内涵的新型效应参数,并在此基础上灵活设定识别条件、深化因果推断的理论和技术创新。

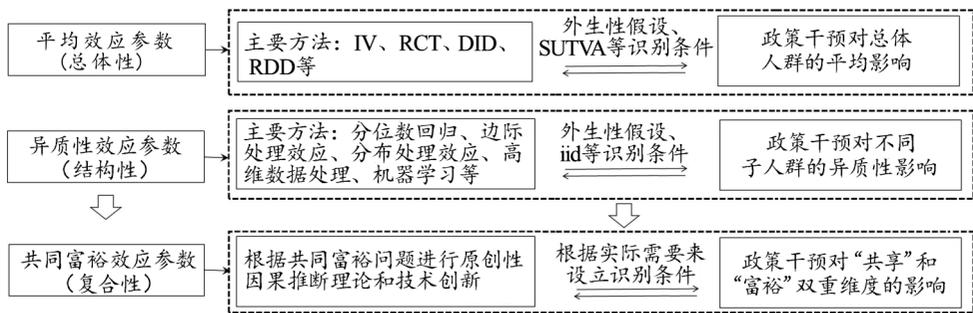


图2 依据政策效应参数对共同富裕相关因果推断的划分

### 三、构建面向共同富裕问题因果推断的理论意义与现实依据

共同富裕在中国的推进乃至最终实现的过程,必然都来自中国特色社会主义的具体实践。构建面向共同富裕的因果推断,可以通过因果关系的递延性,在理论上形成一个连续且复杂的因果网络。这将为我国系统梳理面向共同富裕问题的实践体系,推动形成方法科学、逻辑完备、概念鲜明的自主知识体系,为实现中国实践向中国经济学自主知识体系的转化与传播提供坚实的理论依据与现实支撑。

#### (一) 方法论层面:因果推断理论有助于形成系统阐释推进共同富裕的理论研究体系

自党的十九大以来,共同富裕理论进入了系统化、深化发展的新阶段。学界围绕这一主题的研究大体可以分为两个方面:一方面,研究者对共同富裕的理论内涵与思想渊源进行系统阐释,并构建相关的测度指标(李实,2021;刘培林等,2021)。由于共同富裕被视为社会主义的本质特征,相关研究多从中国特色社会主义理论体系的视角展开,强调在发展中实现共享的辩证统一(刘长明、周明珠,2020)。从理论维度看,共同富裕内涵涵盖了“发展”与“共享”两个核心主题,既关注经济增长质量,又注重成果的公平分配。这一理论取向在经济学意义上与“共享繁荣”“包容性增长”“降低收入不平等”等概念具有一定的相似性。另一方面,在明确理论内涵的基础上,研究重心逐渐转向对扎实推进共同富裕的探讨,以寻找可能政策路径。学者们不仅对扎实推进共同富裕的实现路径进行系统化论述(李实、朱梦冰,

2022),而且通过定量分析和因果推断方法,研究经济变量、政策调整与共同富裕之间的因果关系,以识别促进共同富裕的有效机制和政策工具(唐高洁等,2023;万广华等,2022;周亚虹等,2024)。这类研究不仅深化了对共同富裕实现条件的理解,而且为制定更具科学性和针对性的政策提供了实证依据。

就计量经济学而言,因果推断理论的核心在于通过严谨的识别策略验证变量间的因果关系,注重在循证中实现现实经济问题的“科学解构—对策重构”。共同富裕问题是贯通抽象理论与现实阐释的重要时代命题,是多维度、多层次的系统性问题。从共同富裕问题的解构来看,因果推断基于应用数学和统计学原理,通过工具变量、反事实框架等识别策略剥离混淆因素,能够实现对政策与经济社会发展结果之间因果关系的准确识别,增强共同富裕理论针对实践问题的现实解释力,甚至推动理论本身的进一步完善(见图3)。在完善的研究框架下,它完全具备对既有理论进行重新审视乃至发现新理论的能力(李子奈、齐良书,2010)。例如,在异质性分析中,通过系统考察政策在不同子群体中的差异化效果,因果推断可以精准识别弱势群体或基础性人群的政策受益程度,从而有可能发现新的经验结论。另外,从对策重构来看,因果关系链条的递延性可以进一步通过结合特定问题的理论依据、历史依据或现实依据,形成系统化的机制阐述,为提出具有战略性、针对性和可操作性的政策方案提供依据。因此,前沿因果推断理论适用于为共同富裕相关政策的设计与评估提供明确的因果识别和指导,有助于以具体问题为立足点串联形成有效的因果推理结构,丰富和发展出与实践相一致的共同富裕理论。

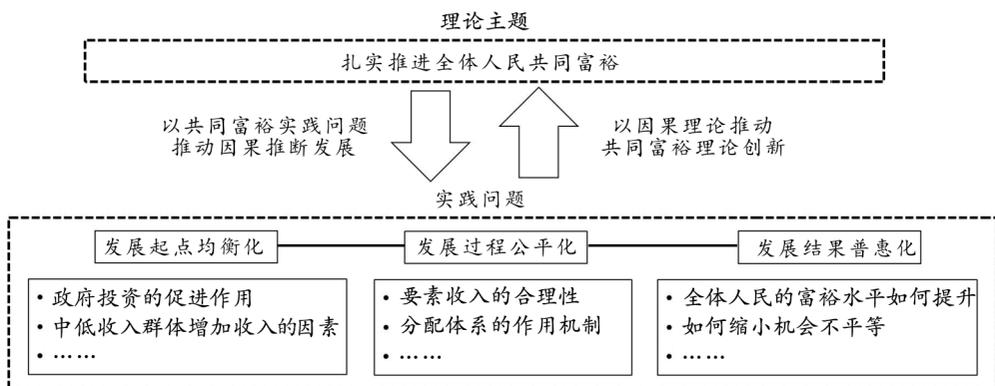


图3 因果推断促进共同富裕理论创新的逻辑链条

## (二) 现实研究层面:因果推断理论有助于构建面向共同富裕问题的研究图谱

由于因果推断能对共同富裕问题中因果关系进行有效探讨,近年来使用因果推断相关理论与方法来进行共同富裕问题研究的实证文章呈现井喷式增长态势。总的来看,相关文献主要集中于在测度指标的基础上评估某一政策或经济因素的共同富裕效应(方明月等,2022;万广华等,2024)。从具体研究的角度看,尽管共同富裕研究数量众多,但定量分析的创新主要集中于指标构建,如各类共同富裕指数的开发。通过构造共同富裕指数并结合回归分析,研究者在宏观和中观层面为探讨共同富裕的发展程度及政策效应提供了较为成

熟且多元的分析框架。然而,此类方法在微观层面难以直接反映居民福利水平,且在识别清晰的政策因果效应、指导具体政策实施方面存在一定局限性。整体上看,国内研究针对共同富裕专门设计的因果推断理论或将因果推断前沿理论应用于共同富裕问题的相关文章仍比较少见。实际上,通过对“共同富裕”这一标识性概念的学理解构,可以形成涵盖“研究主题—核心目标—具体问题”三层次的研究框架,如图4所示。

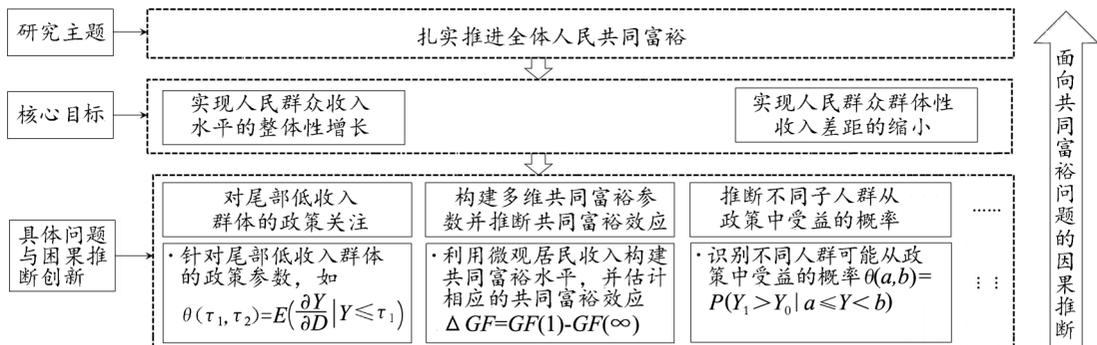


图4 因果推断理论与共同富裕问题现实研究图谱

从原理上看,构建面向共同富裕问题的因果推断的核心做法是在现有理论上,设计能够反映“共享发展”“结构均衡”等目标共同富裕效应参数,解决当前研究的堵点,以此实现“做大蛋糕”和“分好蛋糕”的核心目标。例如,估计某一政策对低收入尾部分位区间家庭的处理效应,细致刻画政策如何作用于不同收入群体,从而为推动共同富裕提供精准指导(张征宇等,2021;Firpo,2007):

$$\theta(\tau_1, \tau_2) = E\left(\frac{\partial Y}{\partial D} \mid Y \leq \tau_1\right) \quad (1)$$

(1)式中: $(0, \tau_1)$ 是因变量的分位区间。(1)式表明了政策D针对因变量位于 $(0, \tau_2)$ 水平群体的平均处理效应,更贴近政策实际制定的区间划分<sup>①</sup>。再例如,在DID识别条件下,我们可以尝试评估政策实施前后的共同富裕效应:

$$\Delta GF = GF(1) - GF(\infty) \quad (2)$$

根据微观居民的收入增长和不平等情况(或包含发展机会、精神文化等其他维度的增长和不平等情况)可分别构建政策实施后和实施前的共同富裕水平 $GF(1)$ 和 $GF(\infty)$ ,并基于潜在结果分布函数估计政策对因变量的共同富裕效应。此外,罗伊模型(The Roy Model)假定个体完全具备搜集并处理信息能力的概率等于其参与社会项目的概率,研究者们可以在这一基础上进行理论改进,考虑提出反映异质性微观个体的政策受益比例参数(张征宇、曹思力,2021):

$$\theta(a, b) = P(Y_1 > Y_0 \mid a \leq Y < b) \quad (3)$$

①这一做法与条件分位数回归存在经济含义上的差异。在条件分位数回归中,由于 $Y = m(D, X, U)$ ,在固定 $(D, X)$ 后Y完全由扰动项U决定,因此该估计系数其实表示的是其随机干扰项的无条件分布上的影响,不具有清晰的经济学含义。

(3)式中: $a$ 和 $b$ 分别代表因变量不同分位点,可以用这一改进后的参数研究某一政策对不同收入区间个体的收入提升作用,同样呼应共同富裕内涵。

但相较于已广受关注的 DID 评估政策平均处理效应,分位数处理效应或其他相关的异质性理论和应用研究仍与国外存在明显差距(朱平芳、邸俊鹏,2017;Powell,2020)。除个别国际前沿因果推断理论的应用尚存不足外,国内关于共同富裕的原创性因果推断理论研究仍较为匮乏。实际上,共同富裕作为一个多维、动态的中国实践议题,可谓是因果推断理论研究,尤其是异质性分析手段的一座“富矿”,为其理论创新提供了极为广阔的空间。如上所述,针对尾部低收入群体的政策关注可推动因变量异质性分析方法的理论突破,设计更适合捕捉极端值影响的因果推断工具;针对部分微观数据质量较弱等问题,可以开发适应数据局限性的因果推断方法等等。这些创新不仅根植于中国经济实践,还因其方法论的普适性而具备国际推广潜力。部分研究者因开发新方法的成本较高或理论门槛较严而选择回避,导致研究深度不足。甚至部分实证研究存在“拿来主义”倾向,直接套用经典因果推断方法而忽视其适用性,从而易造成方法误用或结果偏差(江艇,2022)。

### (三)理论融合层面:因果推断理论有助于拓展中国经济学自主知识体系的学理化传播渠道

现代计量理论体系为因果推断提供了严谨的识别和估计框架,基于这一框架来针对中国特色问题进行理论创新,则体现了中国经济学自主知识体系构建在计量经济学领域的推进。构建中国经济学自主知识体系的核心挑战在于如何调和经济学理论与经济实践之间的冲突,将理论还原到具体实践情境中,通过中国持续推进的经济实践不断完善和发展其知识理论框架。从这一视角出发,我们既要避免盲目信奉某一特定经济学理论,也要摒弃过度依赖严密数理模型进行理论验证或证伪的循环模式,而应以中国经济实践中的现实问题为导向,寻求技术手段、理论建构与实践指导之间的动态平衡。当前,以因果推断为核心的计量经济学理论创新因其客观性、价值中立性和局部普适性,相较于其他经济学理论,在推动经济学本土化方面面临更少的限制,并且能够基于中国经济实践直接开展理论创新,成为中国经济学自主知识体系的重要组成部分。此外,因果推断作为现代计量经济学理论的核心,结合华人经济学家在计量经济学领域的国际影响力,其不仅适用于探索中国经济实践中的因果关系,也可广泛应用于国际上社会不平等、包容性增长等其他问题的因果分析。这种特性使其更容易为国际学术界所接受和传播,从而成为中国经济学自主知识体系走向国际视野的先行者。

一是有助于对“共同富裕”标识性概念的学理化传播。共同富裕作为中国提出的标识性概念,与西方的收入不平等既有相似之处,又具有鲜明的中国特色。共同富裕不仅关注收入差距的缩小,更强调全体人民在物质、精神和社会福祉等多个维度的共同提升,追求的是全面、共享的发展目标(李实,2021)。针对共同富裕的因果推断理论创新,不仅能够有效回应这一独特实践议题,还能为中国经济学自主知识体系的构建提供重要支撑。共同富裕的复杂性体现在其宏微观分析的难度上,涉及多维度的经济社会因素,且模型设定与假设往往牵一发而动全身,难以构建全面或局部的理论框架。然而,计量因果推断作为一种识别因

果关系的客观方法论工具,聚焦于识别共同富裕相关政策或变量的因果效应,能够灵活融入共同富裕的分析框架,直接服务于这一中国特色问题的研究。

二是有利于推动中国经济学自主知识体系的范式变革和学科融通。从学科交叉的视角看,因果推断理论正与中国特色社会主义政治经济学领域的具体问题研究相融合,逐步形成涵盖面向社会形态“一般原理—发展阶段—现实状况”在内的学科范式(谢富胜、杜欣林,2023)。作为中国经济学自主知识体系的基础学科,中国特色社会主义政治经济学聚焦社会主义市场经济建设,秉持以人民为中心、逐步实现共同富裕的全面理论目标,亦积极吸纳现代科学方法(逢锦聚,2023)。相较于抽象的辩证逻辑体系,因果推断作为一种工具化的数理方法,为政治经济学面向现实问题形成彰显中国特色和时代特征的理论体系提供了重要借鉴,不仅实现了定性分析与定量分析的相互促进,而且实现了马克思主义政治经济学基本原理与数理方法间的相互应用和转化(乔晓楠,2025)。时至今日,因果推断已经在包括数字经济与实体经济融合发展等在内的问题上形成了一定的理论创新(谢富胜等,2025),进一步在学科融通中开辟了当代中国马克思主义发展的新境界。因果推断作为当前计量经济学的核心,融合了经济理论、统计学和数学(Frisch,1933),为识别复杂经济现象中的因果关系提供了统一而严谨的分析框架。在此基础上,因果推断能以中国特色社会主义政治经济学等本土原创经济理论为指导,结合统计学和数学的严谨方法,聚焦中国经济问题,从而推动具有中国特色的因果推断理论创新。从这一角度看,因果推断理论与中国特色社会主义政治经济学的结合,不仅在方法论上具有高度相容性,还为构建中国经济学自主知识体系提供了坚实的理论和实践基础。

#### 四、如何构建面向共同富裕问题的因果推断

面向收入分配与共同富裕的因果推断研究,本质上是将现代因果推断理论置于具有中国特色的共同富裕的语境下进行理论框架的创新性构建。总的来看,这一研究主要包括两部分内容,一部分是要根植于共同富裕问题,在现代计量经济学体系下实现因果推断原创性理论创新,隶属于中国经济学理论体系;另一部分则是结合共同富裕具体实例,引入或改进前沿因果推断理论方法。此外,面向共同富裕问题的因果推断还要积极拥抱数智时代的新技术,不断拓宽未来研究方向。

##### (一)从引入理论到原创理论:以共同富裕问题激发因果推断理论创新

面向收入分配与共同富裕的因果推断研究,核心在于必须有原创性的理论创新。从实践层面而言,该研究旨在运用因果推断方法,准确识别各类政策对收入分配格局和共同富裕进程的影响效应,从而为制定科学有效的共同富裕政策提供实证依据。从理论层面来看,其核心目标在于构建具有中国特色的因果推断理论体系,并通过国际学术交流实现理论输出。因此,推动该领域研究发展的关键在于坚持以中国现实问题为导向,实现因果推断理论的原创性突破,需要重点注重以下两个方面。

第一,理论创新需根植于中国经济实践,以收入分配与共同富裕的实践需求为导向推动因果推断方法的发展。事实上,中国计量学者已在现代计量理论创新方面取得显著进展,相关成果频繁发表于国际权威计量期刊;同时,中国特有的经济社会问题为因果推断理论提供

了独特的研究视角,这与方法论本身的问题导向特性高度契合。例如,政策学习方法(Policy Learning)通过结合大数据分析个体异质性效应,根据个体效用大小优化政策设计,以实现社会福利最大化。共同富裕需要从注重“结果公平”转向“过程公平”,从“被动调整”转向“主动分配”(王琳,2025)。根据这一思想,政策学习的社会福利目标函数同样可以调整为内嵌共同富裕问题的结构性函数,如包括平均收入 $\mu$ 和基尼系数 $gini$ 的 $E[\mu(1-gini)]$ ,进而用该方法研究政策补贴、二次分配、精准扶贫等一系列“主动分配”的政策设计。这种方法与共同富裕“以人民为中心”、促进全体人民福祉提升的目标高度一致,但是国内在相关方法的应用上尚处于起步阶段,相关研究较少。需要指出的是,因果推断理论创新不宜过度追求宏大问题的分析,因为问题规模越大,内生性因素往往越复杂,数理模型建构越困难,这反而会削弱因果推断方法的有效性。作为方法论工具,因果推断理论更适合聚焦于共同富裕进程中的局部政策评估,具体包括但不限于特定政策对群体收入分配的因果效应测度、基于反事实框架的政策设计异质性效应分析等中微观层面的实证研究。

第二,理论创新需要根植于现代计量经济学体系。因果推断理论的发展不能脱离现代计量经济学的基本框架,其理论创新必须建立在严格的识别与估计基础之上。这既需要计量经济学提供一些已达成共识的核心方法论支撑,也需要数学和统计学为识别定理的推导与估计方法的证明提供严谨的数理支持。既然要证明某一因果性存在,那么检验不能仅依赖描述性分析或逻辑推演。在进行理论创新时,必须系统梳理与共同富裕相关的现有因果推断理论,只有在确认现有方法确实无法有效解决中国现实问题时,才具备理论创新的必要性。当前,异质性效应、个体效应等仍是国际学术界关注的因果推断理论创新前沿方向,这一趋势与共同富裕研究具有天然的契合性,也为中国学者在该领域的理论创新提供了国际对话的可能。但是,这种以数理模型为基础的理论创新,需要明确其与“唯数理论”存在本质区别。数理模型作为因果推断理论的方法论基础,其根本目的在于服务共同富裕的政策评估与实践需求。因此在推进理论创新的过程中,同样需警惕过度追求数理形式化和复杂度从而导致理论与现实脱节,不具备经济学内涵的潜在风险。允许一定的纯理论导向,但不能完全专注于理论本身而不考虑其经济学意义,否则容易出现简单问题复杂化、理论应用价值缺失等问题。

## (二)从效应估计到机制理解:利用异质性因果推断推进共同富裕理论发现

改革开放以来,我国对西方经济学理论的引入经历了从批判性吸收到实践应用的转变过程(方福前,2018)。在这一背景下,包括因果推断理论在内的现代计量经济学方法已逐渐被国内学界所接纳,并广泛应用于经济政策制定的实证研究。然而,在因果推断理论应用方面,国内研究多侧重于政策对共同富裕总体水平的影响估计,而在进一步揭示共同富裕形成机制、提供更细致解释的异质性分析方法论上仍存在一定的滞后性。

从既有研究看,国内学者在因果推断方法的应用上呈现出明显的路径依赖特征,更倾向于采用对政策平均因果效应估计的标准化方法。这种倾向性在一定程度上导致了某些方法在国内经济研究中的过度使用,引发学术审美疲劳,甚至造成了研究问题的单一性、趋同性,研究内容的“内卷化”。尽管部分文献已经尝试使用某些更细致的异质性分析手段(万广华

等,2024),但整体来看,国内因果推断研究在与共同富裕研究密切相关的异质性因果分析方法的应用上,仍滞后于国际前沿水平。具体而言,在共同富裕政策评估与设计研究领域,诸多方法论成熟且操作便利的异质性分析技术,如无条件分位数回归和分位数处理效应等方法,仍尚未得到充分应用。实际上,部分成熟的异质性因果推断方法在技术门槛上并不如想象中高,其与共同富裕研究议题具有天然的适配性,更可能为相关研究带来新的机制理解、理论突破和研究范式创新,其边际收益显著大于学习成本。例如,实现共同富裕是一个长远目标,其包含的“先富带动后富”的特色概念与收入不平等问题就存在明显的差别,某些政策设计可能需要涉及政策动态效应的因果推断全新理论来验证。如下式所示:

$$V(\pi) = E[Y(\pi_1(X_1), \pi_2(X_1), \pi_1(X_1), X_2(\pi_1(X_1))), \dots)] \quad (4)$$

(4)式中: $V(\pi)$ 是动态政策 $\pi$ 实施后的预期回报, $\pi_T$ 代表第 $T$ 期是否接受政策处理,其既考虑当期个体特征 $X_T$ ,同时考虑之前的政策处置对本期的影响,因此这是一个不断迭代的动态政策设计(Wager,2024)。这一方法同样可以应用于共同富裕的“先富带动后富”的研究问题,可以识别“后富”人群参考“先富”人群特征进而产生的动态决策调整所带来的政策效应。从这一点看,我国微观劳动经济学领域在因果推断理论框架构建和异质性分析方法应用方面取得了相对显著的进展,例如工资收入、就业市场相关研究等。但总的来说,国内研究在异质性因果推断方法的应用深度和创新能力方面,仍存在一定的提升空间。

除此之外,在将异质性因果推断理论应用于具有中国特色的共同富裕问题的研究过程中,一个关键性的挑战在于如何实现文章理论严谨性与实证应用性的平衡。根据笔者的研究经验发现,在结合中国特色问题科学引入异质性因果推断理论时往往面临一个两难困境:理论阐述不足会导致方法假设条件不完整、技术细节缺失,而实证分析薄弱则会使研究丧失中国特色和现实价值。这种困难导致部分研究虽然以应用前沿方法解决中国特色问题为出发点,但最终却易演变为方法介绍的文章。若对现实问题的理解深度不够或与因果推断理论契合度不高,则会成为现代计量经济学因果推断理论在中国问题的简单移植,学术价值相对一般。基于此,我们认为在结合中国特色问题引入异质性因果推断理论时,要秉持中国特色共同富裕问题为主,因果推断理论为辅的态度,依旧坚持问题导向的研究范式。首先,应当立足于具有显著现实意义的中国特色问题<sup>①</sup>,这些问题应当产生于中国特定的制度环境和发展阶段;其次,根据问题的本质特征选择或改造适当的因果推断方法,并不必然体现理论方法的全部技术细节,甚至在此过程中可能需要针对中国情境进行方法创新。引入异质性因果推断理论应当服务于问题解决,而非简单的现代计量经济学方法移植,只有当研究扎根于真实的中国问题才能实现方法论价值与现实意义的统一。

### (三) 从传统推断到大数据技术应用:面向共同富裕的因果推断数智化

随着数智时代的到来,以机器学习为代表的大数据技术正在深刻改变现代计量经济学

<sup>①</sup>本文列举一些与共同富裕相关或其他具有中国特色的异质性问题:(1)精准扶贫与居民收入和消费:分析精准扶贫如何影响家庭的异质性消费,究竟什么样的家庭是扩大内需的主要群体;(2)最低工资制度与收入分配:最低工资制度是否提升了低收入人群的收入,进而过渡到对整体收入分配格局产生何种影响;(3)地方债务化解:中央政府的统一或差异化政策究竟对不同债务水平地区具有何种的债务化解作用。

的理论进程。构建面向共同富裕问题的因果推断理论,必须积极吸纳数智时代的前沿技术。大数据技术与因果推断理论的交叉融合本身就是当前国际学术界的前沿研究方向,存在大量尚未充分探索的研究领域,而且这一交叉领域的技术革新也为中国学者开展共同富裕的原创性理论建构提供了独特机遇。

大数据技术的出现使得因果推断理论突破了计算能力和数据规模的限制,数据处理能力、算法创新和模型融合,显著提升了对复杂因果关系的识别和分析能力。从数据维度看,传统方法在高维数据场景下容易过度拟合或计算成本过高,大数据技术通过分布式计算框架和机器学习算法(如 LASSO)能够筛选出与因果效应相关的关键特征,从而为因果推断处理高维数据提供了解决办法(Belloni et al., 2014)。从处理效应维度看,经典因果推断理论聚焦平均处理效应或分位点处理效应,而因果森林、深度学习等模型的出现使得我们可以在个体因果效应估计的基础上实现异质性效应理论创新,同时也为最优政策设计、政策推广等内容提供技术支撑,展现出较强的政策实践价值。例如,面对较为复杂的高维数据,我们可以在政策学习的基础上,结合共同富裕政策实施阶段较长、政策设计较为复杂的具体情景开展动态政策学习,即考虑历史依赖的政策学习(Sakaguchi, 2025)。

然而,需要指出的是,很多大数据技术的应用实际没有涉及因果推断的概念,仍属于相关性分析范畴。因果推断可以利用大数据手段挑选出一系列具有最佳预测效果的协变量来完成某一经济因变量的预测,但其无法准确估计特定协变量对结果变量的因果影响及其统计显著性(Mullainathan and Spiess, 2017)。部分实践场景下企业或政府利用机器学习基于大规模数据来预测复杂的经济结果并不具备因果性,仅仅是数据驱动的预测。因此,包括机器学习算法在内的技术手段在经济学研究中所充当的角色,更多的是对现有计量方法和因果推断的补充,而非替代(黄乃静、于明哲, 2018)。基于上述分析,在构建面向共同富裕问题的因果推断理论时,我们既要积极吸纳大数据技术的前沿成果,又要始终保持方法论自觉,要充分利用新技术在数据处理和模型估计上的优势,更重要的是必须坚守因果推断的理论内核,警惕陷入“技术至上”的误区。

正如前文所说,在推进面向共同富裕的因果推断理论创新过程中,必须始终坚持问题导向的研究范式。当前,大数据技术对因果推断理论的革新正如火如荼地进行着,其中基于机器学习、人工智能等前沿技术的因果推断方法必将成为未来方法论创新的重点方向。需要辩证看待的是,对于某些尚处于发展初期的大数据因果推断方法,如深度因果学习(Deep Causal Learning)、自动化因果推断(Automated Causal Inference)等,不一定要立即将其应用于中国实践问题的分析。一方面,这部分理论框架尚未成熟,学术争议较大,尤其是这些方法的“黑箱”性质使得因果效应的解释困难,同时实证应用场景有限,方法稳健性有待验证。另一方面,部分前沿因果推断理论与中国特色制度背景的适配性仍存在部分疑点,需进一步探讨中国的制度因素和数据质量能否支撑这些方法在中国问题上的实践,求证其应用于面向共同富裕因果推断的可行性。但必须强调的是,保持对这些前沿理论的持续关注具有重要的战略价值。对于大量关注中国问题的研究者来说,关注数智时代的因果推断前沿理论可以及时把握国际学术动态,避免理论应用的滞后性,同时也可以为中国特色因果推断理论的

发展提供持续的方法论启示和创新灵感。这种密切关注但不盲从的审慎态度,恰恰是构建面向共同富裕问题的因果推断理论体系所必需的方法论素养。

## 五、结语

中国特色经济实践蕴含丰富的研究场景,为因果推断理论的原创性创新提供了坚实的现实基础。本文探讨的面向收入分配与共同富裕问题的因果推断研究,其实可以被认为是一种具有中国特色的理论创新尝试,其具备扎实的理论与现实支撑。在共同富裕的理论与实践研究中,因果推断作为一种严谨的方法论工具,其方法论特征与研究议题具有高度契合性。与此同时,共同富裕研究的现实需求,为因果推断理论的应用提供了可行性。基于这一分析框架开展针对中国问题的理论创新,也可以被视为中国经济学自主知识体系构建在计量经济学领域的重要推进。

未来,构建面向收入分配与共同富裕的因果推断理论体系仍需实证研究者与计量理论研究者通力合作。一方面,以中国现实问题为导向的理论创新需要研究者们坚持问题意识,在收入分配与共同富裕领域实现因果推断理论的原创性突破;另一方面,如何将成熟的因果推断方法与中国特色问题有机结合,特别是在异质性分析等方法论层面的深入挖掘,亟待学界共同探索。大数据技术的广泛应用推动因果推断理论快速迭代,如何平衡技术工具创新与因果推断的经济学内涵阐释,同样值得深入研究。本文仅仅是对收入分配与共同富裕领域因果推断研究的初步探索,文中诸多论述难免存在疏漏与不足,需要学界同仁共同推进相关研究的深化与完善。可以预见,随着研究的深入和技术手段的革新,因果推断理论创新及其在经济学应用领域将迎来快速发展的机遇期,而根植于中国现实问题的原创性理论创新,亦有望走向国际学术舞台。

### 参考文献:

- 1.方福前,2018:《引进西方经济学40年》,《教学与研究》第12期。
- 2.方明月、林佳妮、聂辉华,2022:《数字化转型是否促进了企业内共同富裕?——来自中国A股上市公司的证据》,《数量经济技术经济研究》第11期。
- 3.郭峰、陶旭辉,2023:《机器学习与社会科学中的因果关系:一个文献综述》,《经济学(季刊)》第1期。
- 4.黄乃静、于明哲,2018:《机器学习对经济学研究的影响研究进展》,《经济学动态》第7期。
- 5.黄炜、向科谚、袁洛琪,2025:《断点回归设计的实证指南:操作规范、应用误区与实践拓展》,《数量经济技术经济研究》第6期。
- 6.江艇,2022:《因果推断经验研究中的中介效应与调节效应》,《中国工业经济》第5期。
- 7.李实,2021:《共同富裕的目标和实现路径选择》,《经济研究》第11期。
- 8.李实、朱梦冰,2022:《推进收入分配制度改革 促进共同富裕实现》,《管理世界》第1期。
- 9.李子奈、齐良书,2010:《关于计量经济学模型方法的思考》,《中国社会科学》第2期。
- 10.刘长明、周明珠,2020:《共同富裕思想探源》,《当代经济研究》第5期。
- 11.刘培林、钱滔、黄先海、董雪兵,2021:《共同富裕的内涵、实现路径与测度方法》,《管理世界》第8期。
- 12.马艳、张建勋,2015:《不同所有制条件下的收入差距问题研究——基于机会不平等理论的视角》,《财经研究》第5期。
- 13.逢锦聚,2023:《建构中国经济学自主知识体系的方法论和方法》,《经济研究》第8期。
- 14.乔晓楠,2025:《数理马克思主义政治经济学论纲》,《政治经济学评论》第3期。

- 15.唐高洁、闫东艺、冯帅章,2023:《走向共同富裕:再分配政策对收入分布的影响分析》,《经济研究》第3期。
- 16.万广华、江葳蕤、赵梦雪,2022:《城镇化的共同富裕效应》,《中国农村经济》第4期。
- 17.万广华、宋婕、左丛民、胡晓珊,2024:《中国式现代化视域下数字经济的共同富裕效应:方法与证据》,《经济研究》第6期。
- 18.万海远、陈基平,2021:《共同富裕的理论内涵与量化方法》,《财贸经济》第12期。
- 19.王琳,2025:《习近平总书记关于共同富裕重要论述的原创性贡献》,《马克思主义研究》第7期。
- 20.王轶、刘蕾,2022:《农民工返乡创业何以促进农民农村共同富裕》,《中国农村经济》第9期。
- 21.谢富胜、邓可为、江楠,2025:《数字平台与制造业企业利润率》,《经济研究》第2期。
- 22.谢富胜、杜欣林,2023:《构建中国特色社会主义政治经济学理论体系》,《经济学动态》第8期。
- 23.徐洁、李琳,2024:《电子商务发展对县域共同富裕水平的影响——来自电子商务进农村综合示范县的证据》,《经济地理》第5期。
- 24.余振、李萌、庄颀嘉,2025:《Bartik 工具变量法在因果识别中的应用与检验》,《数量经济技术经济研究》第1期。
- 25.张金林、董小凡、李健,2022:《数字普惠金融能否推进共同富裕?——基于微观家庭数据的经验研究》,《财经研究》第7期。
- 26.张勋、万广华,2016:《中国的农村基础设施促进了包容性增长吗?》,《经济研究》第10期。
- 27.张勋、万广华、张佳佳、何宗樾,2019:《数字经济、普惠金融与包容性增长》,《经济研究》第8期。
- 28.张征宇、曹思力,2021:《“新农保”促进还是抑制了劳动供给?——从政策受益比例的角度》,《统计研究》第9期。
- 29.张征宇、孙广亚、杨超、周亚虹,2021:《异质性政策效应分析——一种新的因变量条件分位数回归方法及应用》,《经济研究》第6期。
- 30.周亚虹、邱子迅、姜帅帅、刘猛,2024:《数字经济发展与农村共同富裕:电子商务与数字金融协同视角》,《经济研究》第7期。
- 31.朱平芳、邱俊鹏,2017:《无条件分位数处理效应方法及其应用》,《数量经济技术经济研究》第2期。
32. Angrist, J. D., and J. Pischke. 2010. “The Credibility Revolution in Empirical Economics: How Better Research Design Is Taking the Con out of Econometrics.” *Journal of Economic Perspectives* 24(2): 3–30.
33. Athey, S., and S. Wager. 2021. “Policy Learning with Observational Data.” *Econometrica* 89(1): 133–161.
34. Belloni, A., V. Chernozhukov, and C. Hansen. 2014. “Inference on Treatment Effects after Selection among High-Dimensional Controls.” *Review of Economic Studies* 81(2): 608–650.
35. Bickel, P. J., Y. A. Ritov, and A. B. Tsybakov. 2009. “Simultaneous Analysis of Lasso and Dantzig Selector.” *The Annals of Statistics* 37(4): 1705–1732.
36. Chernozhukov, V., D. Chetverikov, M. Demirer, E. Duflo, C. Hansen, W. Newey, and J. Robins. 2018. “Double/Debiased Machine Learning for Treatment and Structural Parameters.” *The Econometrics Journal* 21(1): C1–C68.
37. Chernozhukov, V., and C. Hansen. 2005. “An IV Model of Quantile Treatment Effects.” *Econometrica* 73(1): 245–261.
38. Dell, M. 2025. “Deep Learning for Economists.” *Journal of Economic Literature* 63(1): 5–58.
39. Firpo, S. 2007. “Efficient Semiparametric Estimation of Quantile Treatment Effects.” *Econometrica* 75(1): 259–276.
40. Firpo, S., N. M. Fortin, and T. Lemieux. 2009. “Unconditional Quantile Regressions.” *Econometrica* 77(3): 953–973.
41. Frisch, R. 1933. “Editor’s Note.” *Econometrica* 1(1): 1–4.
42. Gupta, S., and J. T. Jalles. 2022. “Do Tax Reforms Affect Income Distribution? Evidence from Developing Countries.” *Economic Modelling* 110, 105804.
43. Leamer, E. E. 1983. “Let’s Take the Con out of Econometrics.” *American Economic Review* 73(1): 31–43.

44. Long, J. E., D. W. Rasmussen, and C. T. Haworth. 1977. "Income Inequality and City Size." *The Review of Economics and Statistics* 59(2) : 244–246.
45. Motahar, S. A., and S. Mamipour. 2025. "The Impact of Wealth Inequality on Economic Growth; A Machine Learning Approach." *Computational Economics*; Published Online.
46. Mullainathan, S., and J. Spiess. 2017. "Machine Learning: An Applied Econometric Approach." *Journal of Economic Perspectives* 31(2) : 87–106.
47. Powell, D. 2020. "Quantile Treatment Effects in the Presence of Covariates." *The Review of Economics and Statistics* 102(5) : 994–1005.
48. Roemer, J. E. 1993. "A Pragmatic Theory of Responsibility for the Egalitarian Planner." *Philosophy & Public Affairs* 22(2) : 146–166.
49. Sakaguchi, S. 2025. "Estimation of Optimal Dynamic Treatment Assignment Rules under Policy Constraints." *Quantitative Economics* 16(3) : 981–1022.
50. Vivalt, E. 2015. "Heterogeneous Treatment Effects in Impact Evaluation." *American Economic Review* 105(5) : 467–470.
51. Wager, S. 2024. *Causal Inference: A Statistical Learning Approach*. Draft Version.
52. Wager, S., and S. Athey. 2018. "Estimation and Inference of Heterogeneous Treatment Effects Using Random Forests." *Journal of the American Statistical Association* 113(523) : 1228–1242.
53. Wang, H., G. Li, and G. Jiang. 2007. "Robust Regression Shrinkage and Consistent Variable Selection through the LAD-Lasso." *Journal of Business & Economic Statistics* 25(3) : 347–355.

## Causal Inference on the Issue of Common Prosperity

Zhang Zhengyu<sup>1,2</sup>, Chen Haowen<sup>1</sup> and Lang Xuhua<sup>1</sup>

(1: School of Economics, Shanghai University of Finance and Economics;

2: Key Laboratory of Mathematical Economics (SUFE), Ministry of Education)

**Abstract:** Common prosperity is an essential requirement of socialism, and integrating it with causal inference represents an important exploration of combining the practice of socialism with Chinese characteristics and modern econometric methodologies. Based on the evolution of causal inference theory, this paper aims to establish a causal inference framework and research system focused on the study of common prosperity. The goal is to explore how to promote methodological innovation in economics with Chinese characteristics by addressing China's real-world issues. First, the paper reviews the research progress and applications of causal inference theory in the field of common prosperity. On this basis, we further propose the theoretical alignment, practical extensibility, and innovation compatibility between causal inference theory and the issue of common prosperity. Ultimately, this study advocates for stimulating theoretical innovation in causal inference through the examination of common prosperity, advancing theoretical discovery through heterogeneous causal inference, and promoting the digital-intelligent development of causal inference for the pursuit of common prosperity. This research provides valuable insights for developing a causal inference theory with Chinese characteristics and for building and disseminating an independent Chinese economic knowledge system internationally.

**Keywords:** Common Prosperity, Causal Inference, Heterogeneous Treatment Effects, Income Distribution

**JEL Classification:** C1, P2