

农村居民收入结构与消费关系的再检验

——基于省级面板数据的实证分析

刘苓玲, 李培

(西南政法大学 劳动经济研究中心, 重庆 401120)

摘要: 基于拓展的凯恩斯绝对收入假说理论, 运用东、中、西部三个地区 31 个省份 1997—2008 年的面板数据, 按照农村居民收入来源, 实证分析了工资性收入、家庭经营性收入、财产性收入和转移性收入各自对消费支出的影响。研究表明: 随着农村居民收入结构的改变, 工资性收入对消费的影响日益显著, 与家庭经营性收入一并成为农村居民消费的双动力, 财产性收入和转移性收入对消费的影响虽然有限, 但却具有乘数效应; 不同地区的收入结构对消费支出的影响存在差异。据此, 提出了在不同地区促进农村消费的政策建议。

关键词: 农村居民; 收入结构; 生活消费支出; 工资性收入

中图分类号: F249.27

文献标志码: A

文章编号: 1009-2013(2011)01-0015-05

Reevaluation of the relationships between rural residents' income structure and consumption: Based on the empirical analysis of provincial panel data

LIU Ling-ling, LI Pei

(The Center for Labor Economics, Southwest University of Political Science & Law, Chongqing 401120, China)

Abstract: Based on the extended Keynesian's absolute-income hypothesis theory, using the panel data of 31 provinces of China from 1997 to 2008, this paper empirically analyzes the effects of salary-income, family-operating-income, property income and transfer income on rural residents' consumption. The results show that: with the structure changing of rural income, the wage income and the family-operating-income have a kind of dual effect on consumption of rural residents; property and transfer income have limited and multiplier impact on consumption; the income structures have different effects on consumption expenditure in different regions. According to those mentioned above, this paper proposes some policy suggestion to promoting the rural consumption in the different area.

Key Words: rural residents; income structure; living consumption expenditure; salary-income

一、问题的提出

在我国, 农村是亟待开发的消费市场。增强农村居民的消费能力对于扩大内需来说重要性日益凸显, 正成为统筹城乡发展的必由之路。农村居民消费问题是当前政府农村工作的重中之重, 也是我国经济增长新支点的希望所在。2009 年中央经济工作会议指出, 保持我国经济平稳较快发展要以扩大

内需特别是增加居民消费需求为重点, 稳步扩大农村需求的增长空间, 增强消费对经济增长的拉动作用。然而, 收入是提高消费水平的最大掣肘因素, 因此, 如何提高农村居民收入进而促进消费应是当今三农问题研究的重点之一。

关于农村居民收入与消费的关系, 国内学者从不同角度进行了实证分析。第一种观点认为我国农村居民家庭的平均每人年消费和年收入之间存在长期的均衡关系, 并且农村居民具有非常高的边际消费倾向;^[1-3] 另外一种观点基于状态空间模型和协整理论认为在经济转型时期, 我国农村居民消费与收入之间存在以 1996 年为分界点的两段式均衡关系, 1996 年以后农村居民存在更低的边际消费倾

收稿日期: 2010-12-25

基金项目: 国家社会科学基金项目(07ASH008); 西南政法大学博士科研基金项目

作者简介: 刘苓玲(1971—), 女, 重庆市人, 博士、教授, 研究方向: 劳动经济学、社会保障、人力资源管理。

向；^[4]第三种实证结论则是农民的消费支出与持久性收入呈正相关关系，持久性收入及其边际消费倾向是影响农民消费的最主要因素。^[5]这种观点在李锐、项海容采用GARCH(1, 1)模型的实证分析中得到了验证。^[6]已有研究得出了收入与消费呈正相关关系的结论，且证实收入水平是促进消费的主要因素。但这些研究多是以时间序列数据为样本，动态地分析基于收入总量对消费总量的影响，仅仅是纵向时间、总量的比较，横向空间性、地域性、结构性比较不足。例如，李锐等把收入分为持久性收入和暂时性收入研究其对消费支出的影响，但并没有严格划分收入来源。^[6]我国统计上将农村居民收入分为工资性收入、家庭经营性收入、财产性收入和转移性收入，这四部分各自影响消费支出，但国内很少有这方面的研究成果，尤其是基于时间和横截面的面板数据分析。由于我国地域广阔，地区经济发展情况和农民收入来源的构成差异很大，笔者拟利用1997—2008年省级面板数据来研究农村居民四种收入来源对消费支出的影响，并对不同区域的情况进行比较分析。

二、农村居民收入结构变化趋势

随着我国经济的发展，农村居民收入结构多元化趋势比较明显，“家庭经营仍是农民收入的主要来源，工资性收入成为农民增收的重要来源，转移性收入成为农民收入新的增长点，财产性收入为农民增收开辟了新的空间”^①。2000年以来各种收入在总收入中的比重不断变化(表1)。

由表1可以看出近年来农村居民收入的变化趋势：首先，家庭经营性收入在人均年纯收入中占有重要位置，虽然呈现下降趋势，但一直保持在50%以上；其次，工资性收入占据了人均年纯收入的30%~40%，并且呈上升趋势，说明工资性收入逐渐成为农民收入的支柱；再次，财产性收入和转移性收入呈逐步增长趋势，转移性收入的年增幅要快于财产性收入。同时，我国31个省(区、市)6.8万个农村住户的抽样调查结果显示，2009年上半年农村居民现金收入人均2733元，同比增长8.1%，扣除价格因素，实际增长8.1%。其中，出售农产品收入

人均1124元，同比增长4.1%；家庭二、三产业生产经营现金收入人均369元，同比增长9.8%；工资性收入人均954元，同比增长8.4%；财产性现金收入人均78元，同比增长9.9%；转移性现金收入人均189元，增长31.4%。^[7]由此可以看出，虽然农产品收入绝对数依然很大，但增长速度远不及绝对数额占第二位的工资性收入，增长速度最快的是转移性收入。

表1 农村居民各类收入占纯收入的比重(1997—2008年)%

年份	工资性收入 占比	家庭经营收入 占比	财产性收入 占比	转移性收入 占比
1997	24.62	70.46	1.13	3.80
1998	26.53	67.81	1.41	4.26
1999	28.51	65.53	1.43	4.53
2000	31.17	63.34	2.00	3.50
2001	32.62	61.68	1.99	3.71
2002	33.94	60.05	2.05	3.97
2003	35.02	58.78	2.21	3.69
2004	34.00	59.45	2.61	3.93
2005	36.09	56.67	2.72	4.53
2006	38.33	53.83	2.80	5.04
2007	38.55	52.98	3.10	5.37
2008	38.94	51.16	3.11	6.79

注：资料来源于1998—2009年中国统计年鉴

三、理论模型建立与数据说明

(一) 理论模型建立

凯恩斯认为人们的消费支出主要决定于现期可支配收入，在这一理论下，其绝对收入函数表示为：

$$C_t = \alpha + \beta Y_t + \varepsilon \quad (1)$$

(1) 式中， C 表示消费支出， Y 表示收入， α 、 β 为待估计参数，经济含义是 α 表示自发性消费， β 表示边际消费倾向， $\alpha > 0$ ， $0 < \beta < 1$ 。

国内学者多根据凯恩斯理论建立农村居民的消费函数。马学、王慧霞通过实证分析认为改革开放至今，我国农村居民的消费与当期收入之间存在着密切的协整关系，凯恩斯关于消费与收入关系的心理经验法则非常适合分析我国农村居民的消费

与收入关系。^[9]另外,由于流动性约束和农村居民因自身素质不高而缺乏远见两种因素的存在,在市场经济体制还不完善的我国农村,上述两种因素导致当期收入对消费的影响力更强,在分析我国农村居民纯收入中不同来源与消费水平关系时,选取当期收入作为消费的重要影响因子从理论上讲是可行的。^[10]同时,在我国农村,由于信息不对称以及农户收入的不确定性及抵押品不足等原因,正规金融机构对农户的消费性贷款普遍存在着“惜贷”行为,^[11]这也导致了农民主要依靠当期收入来消费。最近,有学者将绝对收入假说、相对收入假说、生命周期假说和持久收入假说应用于我国农村居民消费行为的实证研究上,其结果依然表明绝对收入假设理论及其消费函数模型比较符合当前我国农村居民的消费实际情况。^[12]

但也有学者根据我国的实际对凯恩斯函数中边际消费倾向的设定提出了质疑。吴克烈等从凯恩斯消费决定理论缺陷为切入点,认为在现实市场经济中,不仅 $MPC \geq 1$ 是十分正常的,而且在理论上还存在 $MPC < 0$ 和 $MPC = \infty$ 的情况。^[13]张秀利等通过1978年以来我国居民边际消费倾向的实证分析也同样质疑了 $0 < MPC < 1$ 的取值。^[14]这些质疑基于我国农村的实际情形都得到了验证。

借鉴已有研究,笔者以凯恩斯的绝对收入假说为理论基础,拓展凯恩斯边际消费倾向递减($0 < \beta < 1$)的条件,即边际消费倾向存在以下四种情况:1)当 $\beta > 1$ 时,表示消费的收入弹性大于1,边际消费倾向递增(意味着消费者对未来收入持乐观心态,当期有超前消费及借贷消费倾向);2)当 $\beta = 1$ 时,表示消费的收入弹性等于1,边际消费倾向保持不变;3)当 $0 < \beta < 1$ 时,表示消费的收入弹性小于1,边际消费倾向递减(意味着消费者对未来收入持悲观心态,当期减少消费增加储蓄,未雨绸缪);4)在理论上还存在 $\beta < 0$ 的情况。^[15]本文基于以上理论并运用我国1997—2008年省级面板数据实证分析农村居民收入对消费的影响。首先,笔者建立如下模型:

$$RCE_{it} = \alpha_{it} + \beta_{1it} SPI_{it} + \beta_{2it} FPI_{it} + \beta_{3it} PPI_{it} + \beta_{4it} TPI_{it} + \mu_{it} \quad (2)$$

(2)式中, RCE 表示农村居民人均生活消费支出, SPI 、 FPI 、 PPI 、 TPI 分别表示工资性收入、家庭经营收入、财产性收入和转移性收入; α 为常数项; β_1 、 β_2 、 β_3 、 β_4 分别表示 SPI 、 FPI 、 PPI 、 TPI 的系数,即各项收入对消费支出的弹性系数; μ 为误差项。其中 $i(=1,2,\dots,N)$ 代表第 i 个地区, $t(=1,2,\dots,T)$ 代表第 t 个时间的观察值。

(二) 数据选取说明

笔者选取1998—2009年《中国统计年鉴》中全国31省份(除港、澳、台地区)的农村居民按来源分组的收入和生活消费支出的面板数据,根据农村居民消费价格指数以1995年为不变价格对数据进行调整,并把31省份分为东、中、西部地区^②,各变量描述性统计情况如表2所示。

表2 面板数据变量描述性统计 元

变量	均值	最大值	最小值	标准差	样本数
RCE	1 422.460	4 724.980	710.260	734.592	372
SPI	530.505	4 464.420	52.650	852.201	372
FPI	1 327.315	2 283.280	703.400	327.321	372
PPI	48.575	263.740	6.970	49.931	372
TPI	55.740	268.460	1.430	61.004	372

四、面板模型检验及分析

(一) 面板模型选择

面板数据模型可以划分为三种形式,在对面板数据模型进行估计时,如果模型形式设定不正确,估计的结果将与所要模拟的经济现实偏差较大。因此,本文首先采用协变分析检验模型的正确形式,主要检验两个假设:

假设1 斜率在不同的横截面样本点上和时间上都相同,但截距不相同

$$H_1: y_{it} = \alpha_i + X_{it}\beta + \mu_{it}$$

假设2 截距和斜率在不同的横截面样本点和时间上都相同

$$H_2: y_{it} = \alpha + X_{it}\beta + \mu_{it}$$

如果接受了假设2,则没有必要进行进一步的检验。如果拒绝了假设2,就应该检验假设1,判断斜率是否都相等。如果假设1被拒绝,就应该采用如下模型:

$$y_{it} = \alpha_i + X_{it}\beta_i + \mu_{it} (i = 1, 2, \dots, N; t = 1, 2, \dots, T)$$

下面分别构造 F_1 和 F_2 统计量来检验上述两个假设,其中 F_1 对应假设1, F_2 对应假设2。

$$F_1 = \frac{(S_2 - S_1) / [(n-1)k]}{S_1 / [nT - n(k+1)]} \sim F[(n-1)k, n(T-k-1)]$$

$$F_2 = \frac{(S_3 - S_1) / [(n-1)(k+1)]}{S_1 / [nT - n(k+1)]} \sim F[(n-1)(k+1), n(T-k-1)]$$

其中, S_1 为变系数模型估计的残差平方和, S_2 为变截距模型估计的残差平方和, S_3 为不变系数模型估计的残差平方和, N 为截面数目, T 为时期数目, K 为解释变量数目。经过计算: $F_1=1.285$, $F_2=4.217$,在5%显著性水平下,查表 F 分布表得到相应的临界值为: $F_{0.05}(150, 217)=1.29$, $F_{0.05}(120, 217)=1.35$ 。由于 $F_2>1.35$,所以拒绝假设2;而 $F_1<1.29$,则接受假设1。因此,本文的数据符合变截距模型。

(二) 固定效应与随机效应模型选择

确定了模型正确形式后,需要进一步选择使用固定效应模型还是随机效应模型。对于模型:

$$y_{it} = \alpha_i + \beta_i X_{it} + \mu_{it} (i=1, 2, \dots, N; t=1, 2, \dots, T)$$

进行 Hausman 检验(表3)。

表3 Hausman 检验结果

Test Summary	Chi-Sq. Statistic	Chi-Sq. d.f	Prob.
Cross-section random	21.2827	4	0.0003

由表3可知,该检验拒绝了随机效应的原假设,应该建立固定效应模型。

所以,本文的变截距固定效应模型如下:

$$RCE_{it} = \alpha_i + \beta_{1it} SPI_{1it} + \beta_{2it} FPI_{2it} + \beta_{3it} PPI_{3it} + \beta_{4it} TPI_{4it} + \mu_{it} \quad (3)$$

其中 α_i 为各省自发的消费支出水平。

(三) 模型的估计

利用Eviews6.0软件对固定效应变截距模型对模型(3)进行广义最小二乘估计法(cross-section weights)回归,得到如下结果^③(表4)。

表4 全国及东、中、西部地区回归结果

解释变量	全国	东部	中部	西部
SPI	0.680 0*** (13.442)	0.653 6*** (14.045)	0.665 5*** (5.261)	0.847 1*** (6.648)
FPI	0.540 4*** (16.938)	0.772 3*** (14.498)	0.576 5*** (7.343)	0.591 6*** (10.452)
PPI	1.401 7*** (9.583)	-0.820 9 (-3.455)	1.685 2*** (5.617)	2.161 1*** (10.491)
TPI	2.604 2*** (8.993)	0.597 2** (2.303)	1.356 8 (1.927)	3.230 7*** (8.459)
$AR(1)$	0.497 8*** (17.957)	0.571 7*** (7.691)	0.519 8*** (15.787)	0.365 6*** (5.169)
Adjusted R-squared	0.995	0.996	0.9910	0.977
F-statistic	1 837.987	18 58.352	356.176	358.676
Durbin-Watson stat	1.846	1.749	2.069	2.087

注:括号内为 t 统计值,***、**分别表示在1%、5%水平上显著

从回归结果看,模型具有较好的拟合效果,四个方程的 F 检验值都通过了显著水平为1%的 F 检验,表明模型整体的拟合度也较高。同时,不同区域回归 $AR(1)$ 的过程都在1%水平上显著,以及 DW 值($DW=1.65$)均大于5%水平上的临界值,较好地消除了序列相关性,该回归结果适于分析。同时,本文的结果也验证了拓展的凯恩斯边际消费倾向的存在。

(四) 对模型结果的解释

从全国范围来看,工资性收入对消费的影响影

响日益显著,与家庭经营性收入一并成为农村居民消费的双动力;同时,财产性收入和转移性收入都具有乘数效应,收入增加1元,消费分别增加1.402和2.604元,具有明显的引致消费效应。因此从上述结论看,用拓展的凯恩斯绝对收入假说的条件解释我国农村居民的消费情况是符合实际的。

由于不同地区农村居民的收入结构并不一致,对消费支出的影响也不尽相同。因此,本文进一步划分了东、中、西部地区进行研究。从三个地区的横向比较来看,可以归纳有以下特征:

首先,三个地区工资性收入对消费支出的影响都是显著的,其中,西部地区工资性收入的边际消费倾向高达0.8471,对消费的拉动作用明显要高于东部地区和中部地区,也高于全国总体水平。近年来工资性收入以较快速度增长,已占总收入的38.94%,外出务工已成为农村居民增加收入的主要渠道,尤其是对于人口众多的农业大省来说,劳动力的流动非常明显。

其次,三个地区的家庭经营性收入对消费的影响也都较显著,其中东部地区家庭经营性收入促进消费的效应最好,系数为0.7723,相比之下,中部地区最弱,边际倾向为0.5765。20世纪90年代中期以来,家庭经营性收入遭遇瓶颈约束,虽然仍占50%以上,但是农业边际产出的下降和增收的困难,都使得农民将增收的精力放到农业之外。

第三,在财产性收入和转移性对消费影响的实证研究中,东部地区的财产性收入没有通过显著性检验,其他地区两种收入对消费的影响都具有乘数效应,财产性收入在推动农村居民消费支出方面并不存在明显的滞后效应^①。中西部地区转移性收入的消费效应较之东部较为明显。这和近几年中央的农村政策密切相关,连续多年的中央一号文件以及农业税的免除,对农业的各类补贴都致使引致消费较为明显。尤其是中西部的农业大省得到较多的补贴,进而对消费起到拉动作用。

五、结论与政策建议

本文通过对我国31个省份1997—2008年农村居民收入结构对生活消费支出影响的实证研究表明:从全国大范围来看,工资性收入已经成为拉动农村居民消费的主要动力,家庭经营性收入的作用在下降,而财产性收入和转移性收入对消费具有乘数效应。从东、中、西部三个地区的对比来看,中西部地区工资性收入对消费的拉动作用高于其他收入,而东部地区家庭经营性收入的消费效应高于我国整体水平和中西部地区。针对研究结论提出以下政策建议:

第一,虽然工资性收入已成为拉动消费的主导因素,但是作为农业大国和国民经济的基础产业,不应忽略农业的重要地位,而是要改变传统农业经

营方式,促进农业技术革新,调整农业产业结构,实现农业经营的规模化、集约化和专业化,同时要提高农民的知识化和专业化水平,促进农地科技和农户知识含量的双提升,努力实现农业增产和农户增收。

第二,东部地区二、三产业比较发达,市场机制较为完善,尤其是中小企业密布,较易实现农村劳动力的就地转移和全国剩余劳动力的集中。政府应加大对东部地区中小企业技术和政策的引导与支持,化解中小企业资金匮乏和出口瓶颈的约束;鼓励其转变生产结构,提高产品质量,提高经济效益,使其成为吸纳剩余劳动力的主力军,并以新《劳动合同法》为法律依据,保护就业者尤其是农民工的利益,确保农民工工资按时、足额发放。

第三,中部地区地少人多,农村人力资源十分丰富。一方面,政府应完善劳动力市场,促进劳动力流动,并加大对农村劳动力尤其是外出务工人员适应产业结构调整劳动技能培训,提升就业竞争力,并鼓励剩余劳动力自谋职业和自主创业。在中部崛起的关键时期,还应加大对农业的转移支付,用补偿性的财政政策促进农业的发展,提高农民收入水平^②。

第四,西部地区发展潜力巨大,市场前景广阔,现阶段西部大开发应该调整地区产业结构,改变传统小农生产的单一局面,充分利用地方优势资源,发展地方特色产业,发展城镇经济以促进农村劳动力转移,形成城镇化和新农村建设的联动发展;同时完善土地流转和土地收益分配机制,保护农民的利益;西部地区由于经济相对落后,农民收入较低,政府应利用财政积极建立与完善覆盖农村居民的社保体系,减轻农民养老、医疗等负担,增加农民收入,创造农民消费的有利环境。

注释:

- ① 见前农业部部长孙政才向全国人大常委会作的《国务院关于促进农民稳定增收情况报告》,2008-08-28。
- ② 根据国家西部大开发政策的相关规定,此处东部地区是指北京、天津、河北、辽宁、上海、江苏、浙江、福建、山东、广东、海南11个省级行政区;中部地区指黑龙江、吉林、山西、安徽、江西、河南、湖北、湖南8个省级行政区;西部地区指四川、重庆、贵州、

云南、西藏、陕西、甘肃、青海、宁夏、新疆、广西、
内蒙古 12 个省级行政区。

(下转第 32 页)