



华侨大学商学院·学术文库

BUSINESS SCHOOL OF
HUAQIAO UNIVERSITY

消费经济学

陈燕武 ● 著

——基于经济计量学视角

| Consumption Economics from
| **Econometrics View**



华侨大学商学院·学术文库
BUSINESS SCHOOL OF HUAQIAO UNIVERSITY

消费经济学

——基于经济计量学视角

Consumption Economics from
Econometrics View

陈燕武·著



社会科学文献出版社
SOCIAL SCIENCES ACADEMIC PRESS (CHINA)

图书在版编目 (CIP) 数据

消费经济学：基于经济计量学视角 / 陈燕武著 . — 北京：
社会科学文献出版社，2008. 10
(华侨大学商学院·学术文库)
ISBN 978-7-5097-0335-9

I. 消… II. 陈… III. 消费经济学 - 研究 - 中国
IV. F126.1

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2008) 第 134613 号

福建省高校人文社会科学研究基地
(国家级重点学科数量经济研究中心) 基金资助
华侨大学施子清教师学术著作出版基金资助

华侨大学商学院·学术文库

消费经济学

——基于经济计量学视角

著 者 / 陈燕武

出 版 人 / 谢寿光

总 编 辑 / 邹东涛

出 版 者 / 社会科学文献出版社

地 址 / 北京市东城区先晓胡同10号

邮政编码 / 100005

网 址 / <http://www.ssap.com.cn>

网站支持 / (010) 65269967

责任部门 / 财经与管理图书事业部 (010) 65286768

电子信箱 / caijingbu@ssap.cn

项目负责 / 周 丽

责任编辑 / 张景增 刘亚楠

责任校对 / 郭红生

责任印制 / 岳 阳

总 经 销 / 社会科学文献出版社发行部

(010) 65139961 65139963

经 销 / 各地书店

读者服务 / 市场部 (010) 65285539

排 版 / 北京鑫联必升文化发展有限公司

印 刷 / 北京季蜂印刷有限公司

开 本 / 787 × 1092 毫米 1/16

印 张 / 17.25

字 数 / 244千字

版 次 / 2008年10月第1版

印 次 / 2008年10月第1次印刷

书 号 / ISBN 978 - 7 - 5097 - 0335 - 9/F · 0119

定 价 / 45.00元

本书如有破损、缺页、装订错误，
请与本社市场部联系更换



版权所有 翻印必究

序

消费经济学作为理论经济学、应用经济学、社会学等学科交融发展的一个交叉领域，在 20 世纪 30 年代以后，尤其在第二次世界大战以后，随同消费经济这个学科的产生而产生，发展而至成熟，发展成为一门独立的学科。并且它与政治经济学等学科紧密联系，研究社会再生产中的消费关系，揭示人们在消费过程中的社会经济关系及其发展变化规律；同时它又与消费行为学、市场营销学等密切联系，研究人们消费需要的形成及其实现机理；此外，消费经济学的研究又与社会学、心理学、伦理学等密切联系，探索社会消费的发展变化的各种规律性问题。同时随着消费在社会经济运行中所处地位不断提高，消费经济学研究的问题也受到了越来越多的人的重视。在第二次世界大战后消费经济学对消费问题的研究逐渐分为两个方面。一是从微观的角度来研究消费者行为，采用实证分析的方法，通过对消费者动机、消费心理、消费者行为模式的研究，为厂商的产品销售服务。二是从宏观角度考察社会的消费活动、总消费支出的增减、社会消费结构、消费水平及其变化趋势等，采用总量分析的实证方法，非常注重数量分析，目的是通过对宏观消费的研究，为政府制定宏观经济政策，从而缓和经济波动。

改革开放以来，我国的经济生活和社会生活都发生了历史性的深刻变革。在迅速发展的消费实践的带动下，我国消费经济理论的研究取得了长足的进展，并向人们提出了一系列需要人们从新的角度、新的方法加以研究和概括的全新课程——中国特色的消费经济学。作为立足于我国城乡居

民消费,比较和借鉴世界各国消费的特色消费经济学,它着力于研究我国人民消费发展变化的规律性,努力建设中国特色的社会主义消费经济学,推进物质文明、精神文明和政治文明建设,加快实现社会经济现代化,促进中国人的全面发展。意愿从事消费经济研究的人才日益增多。加强消费经济研究对我国经济社会发展具有重要的意义。各级党政部门和社会科学研究机构普遍重视对消费经济问题的研究,各高等院校也纷纷开设消费经济方面的选修及必修课程,消费经济学科人才需求量必将日益增大,研究领域不断深入和扩展,具有广阔的发展前景。

为此,本书就是在承接中国特色消费经济学这一大背景之下孕育而生。本书以经济计量学的视角来研究消费问题,将微观消费与宏观消费问题研究相结合,系统论述了消费经济基本理论与实践的一系列问题,并通过传统和现代计量方法来实证分析福建省城乡居民的具体消费问题,进而达到阐释福建省实行改革开放以来消费领域出现的新思想、新观念、新情况、新问题和新经验,同时在着重研究建设社会主义和谐社会和建设资源节约型、环境友好型社会条件下的消费经济领域新内容的基础上,对市场经济条件下消费经济的发展趋势作了分析,对社会再生产中的消费关系进行了研究,从而揭示了人们在消费过程中的社会经济关系及其发展变化的各种规律性问题。

针对上述种种理论和实践问题,本书内容在撰写过程中,有些是在作者拥有资料的基础上作了较为系统的研究和分析,有些问题作者只进行了初步的探讨,而有的还仅仅是提出问题,有待今后继续与同行们共同就此进行研究。同时本书写作中力图在吸收本学科的最新观点和研究成果的基础上,辅之经济计量学新方法来研究消费经济问题,进而对新的消费理论和实践问题加以整理、提炼和概括,为指导消费实践的方方面面提供科学依据。这些探索是值得鼓励的。

但同时我们也要看到,由于作者的水平有限,加之我国经济改革实践的不断深化,未成定论的理论不断变化和消费行为创新层出不穷,本书缺点和不妥之处在所难免,望各位专家和读者批评指正。

1990年我来到华侨大学向管理类本科生开设经济计量学课程。当时，聪敏好学的陈燕武同学引起我的注意，她的经济学、数学和外语能力出众，又有志从事数量经济学研究并成为我带出的第一个博士研究生。希望本书的出版只是一个开始，希望数量经济学的新生一代能为中国特色的数量经济学研究作出更大的贡献。

华侨大学校长 吴承业
教授、数量经济学博士生导师

2008年4月22日

摘 要

消费经济学作为经济学的的一个分支,在 20 世纪 30 年代以后得到发展,并在 50 年代以后逐步成熟。约翰·梅纳德·凯恩斯 (John Maynard Keynes) 创立了绝对收入假设下的消费函数理论,近年来有三位获得诺贝尔经济学奖的学者与消费经济问题研究有着直接关系,他们是提出持久收入假设下消费函数理论的米尔顿·弗里德曼 (Milton Friedman)、提出生命周期假设下消费函数理论的佛朗哥·莫迪利亚尼 (Franco Modigliani)、把微观经济学分析的范围扩展到消费更为细分领域的加里·贝克尔 (Gary S. Becker)。

研究消费经济问题必须运用定量分析的方法,因为消费领域的经济现象,其数量关系是十分复杂的。无论居民收入、消费支出、消费水平、消费结构等,都具有明确的量的规定性,都存在复杂的数量依存关系。因此,必须根据大量统计数据,运用定量分析的方法,阐明消费领域中基本数量关系及其表现形式,这是揭示消费领域经济规律的重要手段。本书首次从数量经济学的逻辑出发,对消费经济学的基本问题进行系统的定量阐述,注意学科的交叉和融合,把宏观经济学、微观经济学、宏观经济计量学、微观经济计量学、消费经济学、宏观经济统计学、消费统计学、信息经济学等学科有机地结合在一起,进行跨学科研究。本研究大大丰富了消费经济学的定量分析方法,并以福建省居民消费为研究对象,展开细致深入的研究,并根据分析结果提出政策建议。

本书的结构安排如下:第一章是导论。第二章、第三章“消费需求问

题研究”从宏观经济角度对消费与经济增长的关系进行研究,融合了经济统计方法和经济计量方法。第四章、第五章“居民消费函数问题研究”从微观经济角度对消费与收入关系进行研究,融合了经典经济计量方法和现代经济计量方法的应用。第六章、第七章“消费结构问题研究”从微观经济角度对消费分项进行研究,并就模拟消费结构的扩展线性支出系统模型和几乎理想需求系统模型进行研究;运用平行数据模型分析收入差距、地区差距对消费结构的影响,以福建省城乡居民为研究对象,展开细致深入的实证研究。并根据福建省经济发展规划的实际情况,从三个层面对福建省城乡结构进行分析。第八章到第十一章是现代经济计量方法在消费经济学中的应用。第八章“基于单变量时间序列经济计量模型的消费物价指数研究”运用单变量时间序列经济计量模型对消费物价指数的变动规律进行分析和预测。第九章“基于EG检验的总体消费与收入之间关系研究”进行两两经济变量之间因果关系研究。第十章“基于JJ检验的居民消费、政府消费对经济增长的贡献及其关系研究”以多变量协整理论为基础,研究多变量之间的因果关系。第十一章“基于单方向因果关系理论的经济增长和能源消费的关系研究”运用单方向因果测度理论分析经济增长和能源消费之间的因果关系。第十二章是基于福建省居民消费状况研究的基本结论和需进一步研究的问题。

关键词: 消费需求; 消费函数; 消费结构; 协整; 单方向因果关系

Abstract

As a branch of economics, consumption economics was promoted since the 1930's and being matured gradually after the 1950's. John Maynard Keynes founded the consumption theory under the absolute income hypothesis. In recent years there are three scholars whose Nobel Prize for Economics have direct connection with the research of consumption. They are Milton Friedman who put forth consumption theory under permanent income hypothesis, Franco Modigliani who put forth consumption theory under life cycle hypothesis, Gary S. Becker who expanded the scope of microeconomic analysis to the subdivided scopes of consumption.

Studying consumption economic problem should exert quantitative analysis. It is because for the economic phenomena in the world of consumption, the quantitative relationships are very complicated. No matter residential incomes, consumption expenditure, consumption level, consumption structure, they all possess specific quantitative characteristics exist complicated quantitative interdependency. Based on large quantities of statistical data, methods of quantitative analysis should be used to interpret the basic quantitative relations and their forms, which are important means to reveal the laws of economic development in the world of consumption. It is the first time that this paper enumerates the related problems of consumption economy from the logic of quantitative economics, paying attention to the intersection and fusion of several academic disciplines,

combining macroeconomics, microeconomics, macro-econometrics, micro-econometrics, consumption economics, macroeconomic statistics, consumption statistics, information economics and other subjects. This research enriches the quantitative analytical methods of consumption economy gradually, and furthermore, deals with the residential consumption of Fujian province, carries through intensive research. And suggestions were put forth according to the results of analysis.

This book is arranged as follows: The first chapter is the introduction of the whole book. Chapter 2 and 3 exert research on the relationships between consumption and economic growth from the macroeconomic view, combining the methods of economic statistics and classical econometrics. Chapter 4 and 5 study the relationships between consumption and income from the microeconomic view, combining the methods of classical econometrics and modern econometrics. Chapter 6 and 7 study the consumption structure from the microeconomic view, and carry on research on the extended linear expenditure system model and the almost-ideal demand system model, among which the study on the almost-ideal demand system model is at the preliminary stage. Furthermore, make an exhaustive study on the effects of income gap and regional disparity to the consumption structure by applying panel data model in micro-econometrics. And furthermore, according to the real situation of the expansion planning of Fujian economy, the research is carried on among the urban and rural consumption structure from three levels. Chapter 8 to 11 discuss about the utilization of newly econometric methods in consumption economics. Chapter 8 utilizes the single-variable time-series econometric model to analyze and forecast the variation rule of the Consumer Price Index. Chapter 9 performs Granger research between two economic variables and the method is used to study the relationships between two sets of macroeconomic data which are residential expenditure and residential income, governmental expenditure and governmental income of Fujian province.

Based on the multivariate co-integration theory. Chapter 10 does Johansen research between residential expenditure, governmental expenditure and GDP of Fujian province. Chapter 11 applies the methods of cointegration analysis and one-way effect causal analysis among the multivariate series to the investigation of the long-run and causal relationships between economic growth and energy consumption. Chapter 12 is the conclusion. And the whole book is concerned with studying the relationships between consumption and income of Fujian Province. After the positive study, the related suggestions are put forward. Furthermore, problems needed to be further studied are also discussed.

Keywords: Consumption Demand; Consumption Function; Consumption Structure; Co-integration; One-way Effect Causal Relations



目录

第一章 导论	/ 1
第一节 选题的意义和国内外研究综述	/ 1
第二节 研究思路和研究框架	/ 9
第二章 消费需求问题研究 (一)	/ 16
第一节 消费需求的基本理论	/ 16
第二节 福建省消费需求的实证分析	/ 22
第三章 消费需求问题研究 (二)	/ 34
第一节 消费需求与收入分配关系的理论研究	/ 34
第二节 福建省城乡居民收入分配与消费需求关系的实证研究	/ 38
第三节 消费需求与消费信贷关系问题	/ 47
第四章 居民消费函数问题研究 (一)	/ 57
第一节 西方主要的消费函数及其理论假设	/ 57
第二节 基于第一、第二阶段发展的消费函数研究	/ 63
第三节 基于第三、第四阶段发展的消费函数研究	/ 69

第五章 居民消费函数问题研究 (二)	/ 75
第一节 基于非参数回归模型的消费函数研究	/ 75
第二节 基于半参数回归模型的消费函数研究	/ 83
第三节 基于均值结构变化模型的消费函数研究	/ 91
第四节 基于分位数回归模型的消费函数研究	/ 96
第六章 消费结构问题研究 (一)	/ 107
第一节 消费结构的基本理论	/ 107
第二节 消费结构的经济计量模型研究	/ 111
第三节 福建省居民消费结构的简单研究	/ 116
第四节 基于经济计量模型的福建省居民消费结构的实证研究	/ 126
第五节 基于关联度分析的我国农村居民消费结构的多层次性分析	/ 138
第七章 消费结构问题研究 (二)	/ 141
第一节 平行数据模型	/ 142
第二节 福建省居民消费结构研究	/ 147
第三节 从三个层面研究福建省城乡居民消费结构	/ 153
第四节 中国农村居民文教娱乐消费区域性差异研究	/ 157
第八章 基于单变量时间序列经济计量模型的消费物价指数研究	/ 166
第一节 马尔可夫转换模型在消费物价指数分析中的应用	/ 166
第二节 基于状态空间模型的消费物价指数分析	/ 171
第九章 基于 EG 检验的总体消费与收入之间关系研究	/ 178
第一节 协整与误差修正模型	/ 178
第二节 基于 EG 检验的福建省总体消费与收入因果关系研究	/ 184

第十章 基于 JJ 检验的居民消费、政府消费对经济增长的贡献 及其关系研究	/ 194
第一节 向量自回归模型和协整检验	/ 194
第二节 基于向量自回归模型的居民消费、政府消费对经济增长 贡献研究	/ 201
第十一章 基于单方向因果关系理论的经济增长和能源消费的关系 研究	/ 213
第一节 问题的提出	/ 213
第二节 单方向因果测度与沃尔德检验	/ 216
第三节 协整分析	/ 218
第四节 单方向因果关系分析	/ 221
第十二章 结束语	/ 225
第一节 关于福建省消费状况的分析结论	/ 225
第二节 需要进一步研究的问题	/ 231
参考文献	/ 232
后 记	/ 254



Contents

Chapter 1	Introduction	/ 1
1.1	Significance of Choosing Research of Quantitative Methods of Consumption Economics and the Literatures of the Related Research at Home and Abroad	/ 1
1.2	Basic Trace of Thought and Structure	/ 9
Chapter 2	Research on Consumption Demand (I)	/ 16
2.1	Basic Theory of Consumption Demand	/ 16
2.2	Positive Analysis of Consumption Demands of Fujian Province	/ 22
Chapter 3	Research on Consumption Demand (II)	/ 34
3.1	Theoretical Research on the Relationships between Consumption Demand and Income Distribution	/ 34
3.2	Positive Research on the Relationships between Consumption Demand and Income Distribution of Urban and Rural Residents of Fujian Province	/ 38
3.3	Relationships between Consumption Demand and Consumption Credit	/ 47

2 / 消费经济学

Chapter 4	Research on Residential Consumption Function (I)	/ 57
4.1	The Principal Consumption Functions and Their Theoretical Hypothesis	/ 57
4.2	Research on the Consumption Functions of Step One and Step Two Hypothesis	/ 63
4.3	Research on the Consumption Functions of Step Three and Step Four Hypothesis	/ 69
Chapter 5	Research on Residential Consumption Function (II)	/ 75
5.1	Research on Consumption Function Based on Nonparametric Regression Model	/ 75
5.2	Research on Consumption Function Based on Semi-parametric Regression Model	/ 83
5.3	Research on Consumption Function Based on Mean Structure Change Model	/ 91
5.4	Research on Consumption Function Based on Quantile Regression Model	/ 96
Chapter 6	Research on Consumption Structure (I)	/ 107
6.1	Basic Theory of Consumption Structure	/ 107
6.2	Research of Consumption Structure Based on Econometric Models	/ 111
6.3	Basic Study of Consumption Structure of Residents of Fujian Province	/ 116
6.4	Positive Research of Consumption Structure of Residents of Fujian Province Based on the Econometric Model	/ 126