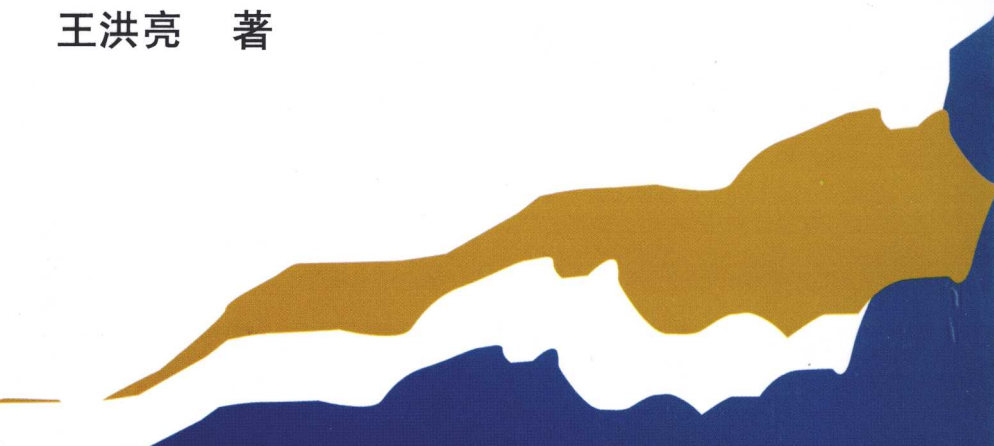




# 收入不平等与收入流动性的 实证研究

王洪亮 著



An Empirical Study  
on Income Inequality and  
Income Mobility



东南大学出版社  
Southeastern University Press

南京审计学院学术专著出版基金资助项目

# 收入不平等与 收入流动性的实证研究

王洪亮 著

东南大学出版社  
·南京·

## 内 容 提 要

本书对区域居民收入不平等及收入流动性进行了较为系统的定量研究。作者首先从静态和比较静态上采用基尼系数、泰尔指数等方法考察了区域居民收入不平等的大小、结构和年际变动,从动态上采用计量经济模型探究了区域居民收入的收敛性;然后采用收入转换矩阵和收入流动性指数等方法分析了居民收入流动性,辨析收入不平等扩大过程中区域居民收入位置格局是否缺乏变动性;最后,采用联立方程估计了收入不平等对经济增长产生的影响,并提出了解决收入不平等问题的相应政策建议。

### 图书在版编目(CIP)数据

收入不平等与收入流动性的实证研究/王洪亮著.  
南京:东南大学出版社,2010.7  
ISBN 978-7-5641-2291-1

I. ①收… II. ①王… III. ①国民收入分配—研究 IV. ①F014.4

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2010)第 110773 号

---

出版发行:东南大学出版社  
社 址:南京四牌楼 2 号 邮编:210096  
出 版 人:江 汉  
网 址:<http://press.seu.edu.cn>  
电子邮件:[press@seu.edu.cn](mailto:press@seu.edu.cn)  
经 销:全国各地新华书店  
印 刷:南京新州印刷有限公司  
开 本:850mm×1168mm 1/32  
印 张:7.75  
字 数:220 千字  
版 次:2010 年 7 月第 1 版  
印 次:2010 年 7 月第 1 次印刷  
书 号:ISBN 978-7-5641-2291-1  
定 价:20.00 元

---

本社图书若有印装质量问题,请直接与读者服务部联系。电话(传真):025-83792328

# 前 言

1978年前,我国经济收入分配的重要特征是平均主义,收入分配的基尼系数比世界上大多数发展中国家都要低。1978年后,中国采取了“摸着石头过河”的渐进改革方式,改革开放给中国注入了前所未有的活力,居民收入水平和生活质量有了明显提高。与此同时,随着经济体制改革的逐步深入,如以效率优先为导向的农村改革在80年代初期启动,城市改革在80年代中期启动,中国经济开始转型,市场机制的调节作用日益强化,中国的收入不平等问题也开始发生演化,并在改革的不同阶段表现出不同的特征。可以从几个维度来看中国居民的收入不平等。一是中国全体居民收入分配,中国的基尼系数在1980年为0.32,到1984年曾一度下降到0.28,而后在1990年上升到0.36,2004年进一步达到0.47。二是城镇居民收入分配,1978年其收入基尼系数为0.16,1995年扩大到0.28,2003年达到0.33。三是农村居民收入分配,1978年中国农村居民的收入基尼系数为0.22,从1984年开始,农村居民内部收入不平等基本上呈现出持续平缓上升趋势,2002年达到0.36。四是城乡间居民收入不平等,1978年城乡居民人均收入比为2.6:1,但到1994年该比例扩大为2.9:1,2002年城乡收入的差距进一步扩大到3.1:1。几个维度均表现出我国居民收入不平等明显扩大的态势,中国正在从一个收入比较平等的国家转变为一个收入差距非常大的国家。在世界银行2005年发展报告中列出数据的120个国家和地区中,按由低到高的顺序排列,中国的基尼系数列到第85位,有些学者认为我国居民收入不平等已经接近某些社会分化严重、经济增长停滞的拉美和非洲国家的

水平。在上述背景下,本书在前人研究的基础上,分析了区域间居民收入不平等及其对经济增长的影响。本书主要内容和基本结论如下:

首先,本书用基尼系数对城镇居民区域收入不平等进行测算,并将基尼系数分解为人口因素和经济因素,同时还将基尼系数在不同省份间进行分解,考虑不同省份对全国地区居民收入不平等的贡献和贡献率。采用 $\sigma$ 指数、经济收敛的研究方法对城镇居民的收敛性进行检验。在分析城镇居民收入不平等变动及收敛性的基础上,采用方差分解方法,分析城镇居民收入不平等的主要来源。主要结论有:1978—2003年城镇居民收入不平等呈现扩大趋势。从经济因素和人口因素看,收入不平等扩大的原因是由经济因素导致的,人口因素有促进收入不平等缩小的作用,但是强度很弱;从省份来看,导致收入不平等扩大的省份主要有江苏、浙江、山东、湖南、广东和四川;从区域来看,近十年来东中西三大地区之间的城镇居民收入不平等占到总收入不平等的50%以上,且呈扩大趋势,区域内收入不平等小于区域间收入不平等。从城镇居民收入收敛性上看,全国整体不存在 $\sigma$ 收敛,地区内部存在 $\sigma$ 收敛,城镇居民收入均存在着显著的绝对 $\beta$ 收敛,收敛速度由大到小的顺序是:中部>西部>全国>东部。从收入不平等来源上看,我国城镇居民收入不平等主要来源于物质资本和TFP。

其次,本书在对农村区域收入不平等进行统计描述的基础上,采用基尼系数对收入不平等在收入不同分项间进行分解,明确收入不平等的结构原因;采用基尼系数变动的分解公式,将收入不平等的年际变动增量进行分解为结构效应和集中效应,从比较静态的角度明确其分别对收入不平等变动的作用;采用泰尔指数对农村居民收入不平等进行分解,从而考察收入不平等中的组内不平等和组间不平等;还采用收敛性方法分析了农民收入收敛性问题,同时应用方差分解公式计算了农民收入不平等的来源。主要结论

有：农村经济发展的二十多年中，收入不平等程度明显扩大了。基尼系数的分解显示农民纯收入中的工资性收入是导致收入不平等扩大的重要原因，其相对集中系数始终大于1，且从1998年以来在基尼系数的构成中一直占50%以上。基尼系数的变动分解显示农民省际间收入不平等的扩大主要源于收入结构效应，不平等促增的工资性收入在农民收入中的比重越来越大，这种收入结构的变化促进了省际间农民收入基尼系数的上升。泰尔指数的分解显示东、中、西部间的农民收入不平等是我国农民省际间收入不平等的主要构成部分。三大区域间收入不平等占全部不平等的比重一直在57%以上，更有甚者是在1995—2003年居然占到72%以上。1978—2003年全国农民收入整体上不存在 $\sigma$ 收敛，但分地区看，东部地区和中部地区农民收入存在 $\sigma$ 收敛，西部地区不存在 $\sigma$ 收敛。全国农民收入 $\beta$ 收敛速度在15%~18%之间，但东中西部地区的收敛速度存在着较大差异，收敛速度由低到高的顺序是：东部地区<中部地区<西部地区。农民收入不平等主要来源于物质资本的差异，其次是全要素生产率(TFP)，再次是人力资本，土地有一定缩小收入不平等的作用，但作用较弱。

第三，在分析泰尔指数分解先后次序对收入不平等测算的影响后，本书采用两种基本分解过程来分解居民收入不平等，并提取了纯地区间收入不平等和纯城乡间收入不平等，从静态角度分析孰轻孰重的问题。然后沿用并扩展了Mookherjee和Shorrocks给出的研究方法从比较静态角度对收入不平等的变动进行分解，考察收入不平等增量中地区间收入不平等变动与城乡间收入不平等变动及人口流动等因素的贡献。主要结论为：从静态角度看，居民收入不平等的决定力量是城乡间收入不平等，其次是地区间收入不平等，前者平均占到总收入不平等的60%以上，后者占不足25%，两者之和占到总收入不平等的80%以上。从比较静态角度看，改革以来全国居民收入不平等不具有收敛特征而呈发散趋

势,其波动类似“W”形。在总收入不平等变动的四个阶段中,城乡间收入不平等变动始终是前者变动的决定力量,其对总收入不平等变动的贡献率均高于60%;地区间收入不平等对总收入不平等变动也有较强影响,其贡献率绝对值基本上都大于10%。城乡间收入不平等和地区间收入不平等对总收入不平等变动影响方向是有差异的,城乡间收入不平等变动与总收入不平等变动有很强的同步性;而地区间收入不平等变动则基本呈现单调递增的特征。从1978—2003年整个时期看,城乡间收入不平等变动对总收入不平等变动贡献率为小于地区间收入不平等变动贡献率;而80年代中期后的渐进改革相对稳定期,城乡间收入不平等变动对总收入不平等变动贡献率高于地区间贡献率。

4 第四,在分析了收入不平等测算指数存在的不足后,本书沿用了Shorrocks定义的时间依赖和转换矩阵(transition matrix)来测算居民收入流动性,同时构造收入流动指数来详细地描述每隔一年的居民收入流动,并指出该指数的优越性,最后我们还计算了相隔任意年份,分城乡的居民收入年际相关系数,并采用回归分析研究各因素对其的影响,从而验证我国居民收入流动的特征。主要结论为:我国地区居民收入流动越来越具有时间依赖性了,即地区居民收入越来越缺乏变动性了,且人口比重较大的地区收入流动更慢。2000年之前地区居民收入流动主要来源于农村居民,而之后城镇居民收入流动成为收入流动的主要来源。从收入年际相关系数回归方程上看,如果不考虑人口因素,城镇居民收入流动性要强于农村居民;间隔时间越长,收入流动性越强。从收入流动中的持久收入不平等上看,收入不平等指数大约经历20年的时间之后均达到“持久性”不平等点。基尼系数大约稳定在0.26左右,泰尔指数、变异系数和极值差率分别稳定在0.10、0.45和5.5左右。

第五,采用了联立方程的估计方法,从收入不平等对经济增长影响的三条机制来展开,一是收入不平等对于投资的影响,进而表

现为对物质资本增长率的影响；二是收入不平等对人力资本投资的影响，进而表现为对人力资本增长率的影响；三是收入不平等对居民消费率的影响。分析收入不平等通过影响物质资本增长率、人力资本增长率和消费率来对经济增长的影响。主要结论为：从长期来看，收入不平等有利于物质资本增长，从而使储蓄投资机制促进经济增长；但收入不平等不利于人力资本增长率的提高，从而通过教育生育机制对经济增长产生阻碍作用；同时收入不平等也不利于居民消费的增长，从而通过市场规模机制对经济增长产生负面影响。三条机制的合力使收入不平等在前五年对物质资本的影响大于对人力资本和消费的影响，从而收入不平等有利于经济增长，而五年后，收入不平等对于人力资本和消费的负面作用大于对物质资本的影响，从而收入不平等在长期对经济增长构成不利影响。



## 目 录

第 1 章 导论	(1)
1.1 问题的提出	(1)
1.2 研究目标与研究假说	(3)
1.3 技术路线与研究内容	(6)
1.4 可能的创新与不足之处	(9)
第 2 章 相关理论回顾	(11)
2.1 经济学说史中的收入分配理论	(11)
2.2 收入分配与增长:新古典学派与新剑桥学派之争	(18)
2.3 倒 U 理论及其论争	(21)
2.4 地区收入不平等理论	(27)
2.5 规模收入分配理论	(29)
第 3 章 收入不平等的国内外研究动态	(34)
3.1 国内研究动态	(34)
3.2 国外研究动态	(38)
第 4 章 收入不平等研究方法	(47)
4.1 绝对差异和相对差异	(47)
4.2 洛伦兹曲线与基尼系数	(49)
4.3 广义熵指数	(52)
4.4 收敛性检验方法	(53)
第 5 章 城镇居民区域间收入不平等	(57)
5.1 城镇居民收入的变动轨迹	(57)
5.2 城镇居民收入不平等变动轨迹	(58)

5.3	城镇居民区域间收入不平等的测算——基尼系数	(61)
5.4	城镇居民区域间收入不平等的测算——泰尔指数	(72)
5.5	城镇居民收入收敛性判断	(77)
5.6	城镇居民收入不平等的来源分解	(82)
5.7	本章小结	(91)
<b>第6章</b>	<b>农村居民区域间收入不平等</b>	<b>(93)</b>
6.1	农村居民区域收入基尼系数及其分解	(93)
6.2	农村居民区域收入泰尔指数及其分解	(100)
6.3	农民收入的收敛性分析	(104)
6.4	农村居民收入不平等的来源	(115)
6.5	本章小结	(125)
<b>第7章</b>	<b>区域间与城乡间收入不平等的比较</b>	<b>(127)</b>
7.1	泰尔指数及其变动分解方法的拓展	(128)
7.2	居民收入不平等的结构：静态分析	(137)
7.3	居民收入不平等的变动：比较静态分析	(143)
7.4	本章小结	(149)
<b>第8章</b>	<b>区域居民收入流动性分析</b>	<b>(151)</b>
8.1	基于收入转换矩阵的收入流动分析	(151)
8.2	基于收入流动指数的收入流动分析	(156)
8.3	居民收入流动性——基于收入年际相关系数的验证	(168)
8.4	收入流动中的持久性收入不平等	(172)
8.5	本章小结	(174)
<b>第9章</b>	<b>收入不平等对经济增长影响的实证分析</b>	<b>(176)</b>
9.1	现有的研究及评述	(176)
9.2	收入不平等对经济增长影响的计量模型	(179)

9.3 收入不平等对经济增长影响的实证结果及解释	(182)
9.4 本章小结	(190)
<b>第10章 全文总结及进一步研究展望</b>	(192)
10.1 全文总结	(192)
10.2 政策建议	(195)
10.3 进一步研究展望	(199)
附录	(201)
参考文献	(217)
后记	(230)

# 第1章 导 论

## 1.1 问题的提出

收入分配问题是经济学中一个古老而又永恒的理论经济学命题,同时又是一个现实的应用经济学研究课题,加强对收入分配的认识也是经济学最为迫切和最为重要的任务之一。1979年诺贝尔经济学奖得主美国经济学家刘易斯指出:“收入分配的变化是发展进程中最具有政治意义的方面,也是最容易诱发妒忌心理和混乱动荡的方面。”

1978年前,我国经济收入分配的重要特征是平均主义,甚至被国内外学者称之为收入分配高度平均主义(Riskin,1987),在改革前夕或改革之初,收入分配的基尼系数比世界上大多数发展中国家都要低。城市的基尼系数在0.20以下,农村的基尼系数略高,但多数估计都在0.21至0.24之间。而许多发展中国家,城市的基尼系数则在0.37至0.43之间,农村的基尼系数则在0.34至0.40之间(世界银行,1983;李成瑞,1986;Irma Adelman等,1987;卡恩,1994;任才方等,1996;赵人伟,1997)。

1978年后,中国采取了“摸着石头过河”的渐进改革方式,改革开放给中国注入了前所未有的活力,居民收入水平和生活质量有了明显提高。与此同时,随着经济体制改革的逐步深入,如以效率优先为导向的农村改革在80年代初期启动,城市改革在80年代中期启动,中国经济开始转型,市场机制的调节作用日益强化,中国的收入不平等问题也开始发生演化,并在改革的不同阶段表现出不同的特征(李实,1998)。我们从几个维度来简略描述一下

中国居民的收入不平等,一是中国全体居民收入分配,中国的基尼系数在1980年为0.32,到1984年曾一度下降到0.28,而后在1990年上升到0.36,2004年进一步达到0.47(世界发展研究所,2004)。二是城镇居民,1978年其收入基尼系数为0.16,1995年扩大到0.28,2003年达到0.33<sup>①</sup>三是农村居民,1978年中国农村居民的收入基尼系数为0.22(赵人伟,1999),从1984年开始,农村居民内部收入不平等基本上呈现出持续平缓上升趋势,2002年达到0.36<sup>②</sup>。四是城乡间居民收入不平等,1978年城乡居民人均收入比为2.6:1,但到1994年该比例扩大为2.9:1,2002年城乡收入的差距进一步扩大到3.1:1(张晓强,2003)。

从几个维度看,我国居民收入不平等都呈现出明显扩大的态势,中国正在从一个收入比较平等的国家转变为一个收入差距非常大的国家。在世界银行2005年发展报告中列出数据的120个国家和地区中,按由低到高的顺序排列,中国的基尼系数列到第85位,已经接近某些社会分化严重、经济增长停滞的拉美和非洲国家的水平<sup>③</sup>。

但我国地区居民收入不平等背后的原因是什么呢?哪一因素是导致收入不平等扩大的主要原因呢?我国居民收入不平等主要表现为地区收入不平等和城乡间收入不平等,那么这两种收入不平等是否可以同时从总收入不平等中分解出来呢?哪一种收入不

---

① 孔泾源等:《中国居民收入分配年度报告》,经济科学出版社,2004年,第1页。

② 国家统计局:《中国农村住户调查年鉴(2003)》,中国统计出版社,2004年,第31页。

③ 在2005年世界银行报告中基尼系数高于或等于中国的国家有35个,其中有32个是拉美和非洲国家,这些国家中在2002—2003年经济负增长的有13个,占有经济负增长国家数(23个)的57%(世界银行,2004a)。这在某种程度上说明,收入分配悬殊可能引起社会矛盾激化,进而导致经济陷入停滞。参见王小鲁、樊纲:《收入分配与公共政策》,上海:上海远东出版社,2005,第1—3页。

平等是我国居民收入不平等的主要来源呢？收入不平等的测算指数如基尼系数、泰尔指数等是否能完全描述居民收入的有关情况，如果不能哪些研究方法可以对收入不平等测算指数予以补充呢？收入不平等对经济增长影响背后的机制如何？最终对经济增长产生了多大影响？

本书试图依据经典的宏微观经济理论和经济计量学知识，结合中国地区面板数据对上述问题予以回答，阐明影响收入不平等的影响因素，定量分析其对收入不平等扩大的影响程度。同时我们对现有的测算收入不平等的方法进行适当拓展，保证居民收入不平等可从地区间和城乡间两个维度同时分解，并提取纯地区间收入不平等和纯城乡间收入不平等，从而比较两者孰轻孰重的问题。以上主要是针对收入不平等及其变动的计量和描述，实际上测算收入不平等的方法并非完美，因为它对于居民收入的位置变动不能反映，为此我们采用了收入转换矩阵、收入年际相关系数和本书构造的收入流动指数分析了居民收入流动的情况，有了收入流动的分析，结合收入不平等的变动，我们就会对居民收入问题有一个较为清楚的把握。最后通过理论分析得出收入不平等对经济增长影响的机制途径，采用联立方程加分布滞后模型的形式估计了收入不平等对中介变量的影响，进而得出不平等对经济增长的影响。

3

## 1.2 研究目标与研究假说

### 1.2.1 研究目标

本研究拟通过上述分析达到如下研究目标：

(1) 详细分析我国自 1978 年以来，城镇区域间和农村区域间居民收入不等的变化趋势及其构成，从静态上找出我国居民收入不平等的结构原因。采用基尼系数变动分解方法和 Mookher-

jee et. al 给出的泰尔指数变动分解方法,从比较静态角度对收入不平等的变动进行分解,考察收入不平等增量中各种因素的贡献和贡献率。

(2) 在新古典经济学框架下,从动态上探讨我国区域间的收入不平等是否具有收敛趋势,如果存在其收敛速度是多少,收敛条件是什么。依据经典微观经济理论,确定物质资本、人力资本的产出弹性,并利用方差分解公式分析要素积累和全要素生产率在居民收入不平等中的贡献和贡献率,指出何种因素是导致居民收入不平等的主要背后原因。

(3) 沿用 Shorrocks 定义的时间依赖和转换矩阵(transition matrix)来度量区域收入流动的程度,获取 1978—2003 年每隔五年的收入转换矩阵,并计算转换矩阵的 chi-square 值、不流动率和平均五等分组流动比率,从而考察地区居民收入的变动性。构造不包含人口因素和包含人口因素的收入流动指数,测算我国地区居民收入不平等变动中的收入流动性。

(4) 探讨收入不平等影响经济增长的机制和收入不平等的影响因素,考虑加入分布滞后模型的联立方程来分析收入不平等对物质资本增长率、人力资本增长率和居民消费率的影响,进而传导至经济增长方程,从而分析收入不平等对经济增长的影响及背后原因,并且分析影响收入不平等的因素。

### 1.2.2 研究假说

基于以上研究目标,我们提出如下研究假说并予以验证:

假说一: 城镇和农村居民收入在水平上的不平等呈现扩大趋势,但在增长率上却存在收敛性,而收敛速度和显著性在不同地区存在差异,人力资本和物质资本是收敛的重要条件,同时两者也是居民区域收入不平等的主要来源。

本书将通过基尼系数和泰尔指数测算城镇和农村居民收入不

平等,分析其变动趋势;采用绝对 $\beta$ 收敛和条件 $\beta$ 收敛检验方法,分别考察城镇居民和农村居民收入收敛性,并分地区判断收敛性和测算收敛速度;同时研究将在估算各生产要素弹性基础上,采用方差分解公式考察居民区域收入不平等的来源,以验证假说一。

假说二:在静态上,地区收入不平等和城乡收入不平等是居民收入不平等的主要构成部分,但城乡收入不平等较地区收入不平等更甚;在比较静态上,城乡间收入不平等与总收入不平等变动具有很强的同步性且处于主导地位;地区间收入不平等变动弱于城乡间收入不平等变动,但它基本上呈单调递增的特征。

本书认为泰尔指数分解先后次序会影响我们对收入不平等问题的判断,为此,我们采用两种分解过程,并提取了纯地区间收入不平等和纯城乡间收入不平等,从静态角度分析孰轻孰重问题。然后沿用并扩展了 Mookherjee 和 Shorrocks 给出的研究方法从比较静态角度对收入不平等的变动进行分解,考察收入不平等增量中地区间收入不平等变动与城乡间收入不平等变动的贡献,以验证假说二。

假说三:区域居民收入的变动性呈现递减趋势,收入不平等的扩大具有越来越强的时间依赖性。

本书将采用 Shorrocks 定义的时间依赖和转换矩阵,计算相关指标来测算每隔五年的区域居民收入流动性,构造收入流动指数测算每隔一年的收入流动程度,同时构建计量模型分析区域居民收入年际相关系数的变动,以验证假说三。

假说四:居民收入不平等的扩大对经济增长具有重要影响,这种影响可通过物质资本、人力资本和居民消费三条机制传导,且影响方向和程度随着时间的变化而不同。

本书将构建联立方程,内生地处理收入不平等对物质资本增长率、人力资本增长率和居民消费率的影响,进一步分析收入不平等对经济增长的影响,同时考察到收入不平等对各变量的



影响是长期的,因此同时在方程组中加入了分布滞后模型,以验证假说四。

## 1.3 技术路线与研究内容

### 1.3.1 技术路线

6 本书从逻辑思路上讲可分为七部分,第一部分为第一章导论,这一部分主要是提出问题、研究目标和研究假说,并给出研究的逻辑思路和框架,同时指出本书可能的创新与不足。第二部分是第二章至第四章,这一部分主要是对收入分配的理论进行了回顾,然后对国内外有关收入分配近来的研究动态和研究方法进行综述,在理论上和方法上为下文将要进行的研究打下基础。第三部分是第五章和第六章,该部分主要是对城镇居民区域收入不平等和农村居民区域收入不平等进行研究,采用基尼系数、泰尔指数考察其变动态势及其结构原因,采用方差分解考察收入不平等的来源。第四部分是第七章,该部分主要是采用拓展的泰尔指数及其变动分解方法,从静态分析和比较静态分析两个角度,从区域间和城乡间两个维度将我国居民区域收入不平等及其变动进行分解,比较区域收入不平等与城乡收入不平等哪一个表现得更为突出。第五部分是第八章,该部分主要是分析区域居民收入不平等是否具有越来越强的惯性,即越来越具有时间依赖性,这一部分采用的方法主要有收入转换矩阵、收入相关系数和收入流动指数等。第六部分第九章,该部分主要是采用联立方程来分析收入不平等对经济增长的影响,从长期看收入不平等对经济增长产生了负面影响,这说明从经济增长的角度看,缩小收入不平等是有利的。第七部分第十章,即研究结论部分,主要是回顾前文主要研究结论,并据此提出相应政策建议。具体研究框架如图 1-1 所示: