

2010年诺贝尔经济学奖得主代表作

工资差异理论

——为什么相似的工人薪酬却不同

[美] 戴尔·莫滕森 著

王远林 译

WAGE DISPERSION

—— Why Are Similar Workers Paid Differently?



创于1897

商务印书馆
The Commercial Press

工资差异理论

——为什么相似的工人薪酬却不同

〔美〕戴尔·莫滕森 著

王远林 译



始于1897

商务印书馆

The Commercial Press

2013年·北京

图书在版编目(CIP)数据

工资差异理论:为什么相似的工人薪酬却不同 /
(美)莫滕森著;王远林译. —北京:商务印书馆,2013
ISBN 978-7-100-09113-8

I. ①工… II. ①莫…②王… III. ①工资率—研究
IV. ①F244

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2012)第 083155 号

所有权利保留。

未经许可,不得以任何方式使用。

工资差异理论
——为什么相似的工人薪酬却不同
〔美〕戴尔·莫滕森 著
王远林 译

商务印书馆出版
(北京王府井大街36号 邮政编码 100710)
商务印书馆发行
北京瑞古冠中印刷厂印刷
ISBN 978-7-100-09113-8

2013年1月第1版 开本 850×1168 1/32
2013年1月北京第1次印刷 印张 5%

定价: 24.80 元

Dale T. Mortensen

WAGE DISPERSION

Why Are Similar Workers Paid Differently ?

© 2003 Massachusetts Institute of Technology

All rights reserved. No part of this book may be reproduced in any form by any electronic or mechanical means (including photocopying, recording, or information storage and retrieval) without permission in writing from the publisher.

《茨威森讲座丛书》序言

茨威森讲座(Zeuthen Lectures)构筑了一个平台,便于一流学者发展形成理论经济学和应用经济学方面的创新成果。设立这个讲座的目的,就是把新知识用便于接受的形式,传授给广大经济学家和经济专业高年级学生。讲座的主题广泛,其范围从抽象的理论到经济史。不管讨论什么内容,讲座的重点在于原创性和适宜性。茨威森讲座由哥本哈根大学经济研究所负责组织实施。

这个讲座是以弗雷德里克·茨威森(Frederik Zeuthen)的名字命名的,他曾任哥本哈根大学经济研究所教授。

卡尔·冈纳·珀森

序 言

至少自从亚当·斯密(Adam Smith)对补偿性工资差异进行论述以后,经济学家就对工人工资为什么存在不同这个问题的研究产生了兴趣。该领域的主要理论持有这样的观点:工资差异是由工人之间生产能力的差别造成的,而生产能力或者人力资本的投资决策是企业利益的关注焦点。然而,根据简单分析和实证研究的结果,这种观点并不足以解释工资差异。

另一个主题就是对失业现象进行讨论,这个主题和“职业”的历史一样悠久。这个领域的主要理论就是工作搜寻理论,该理论假设在劳动力市场上工人面临不同的选择。在这种情形下,一个自然的问题就是为什么相似的工人会接受工资率不同的职位,这是局部工作搜寻模型的假设。

最近人们在使用前后一致的方法解释劳动力市场中人们职业的变换和劳动力市场中工资的分布方面取得了一些进展,本书介绍了这些最新的进展。本书的讨论从“伯德特—莫滕森模型”开始。在这个劳动力市场的一般均衡模型中,事前相同(ex ante identical)的工人在失业和事前相同的企业之间进行选择——这些企业支付的工资率不同。伯德特—莫滕森模型的出现快速引发了大量扩展性研究。这些研究既有在实证方面的贡献,也有在理

论方面的贡献。实证方面的贡献体现在估计模型的参数,理论方面的贡献体现在推广基本模型以提高模型上预测劳动力市场上各种现象的能力上。

本书介绍了基本模型的一个引论,从这个引论得到的转化率和工资分布都具有内生性。对推广的基本模型进行了重新检验,特别是针对那些考虑了企业生产率之间差别的模型以及在雇主、雇员之间存在不同合约的模型。此外,本书还说明了以适当的方式把其他工资决定理论也纳入这个框架之中,从而解释一些到目前为止还难以解释的实证结果。

然而,本书不仅仅是理论方面的推理,它还介绍了相关的证据,这些证据就是现在工资形成方面的实证研究。另外,本书通过计算各种理论概念相应的实证结果,从而在实证研究方面也有所贡献。本书使用的数据源自劳动力市场研究综合数据库(IDA)中的丹麦雇主—雇员匹配的研究数据库。

在本书中,作者遵循一个有吸引力的思路进行了权威性的评述。这使得人们能够用几个很少的参数描述劳动力市场的一般均衡模型,该模型可以完全刻画劳动力市场的重要特征。此外,以实证研究为目的的研究者都怀疑估计得到的高度结构化模型的有用性,但是他们发现本书的基本思路与理解劳动力市场中的实证现象有关。

戴尔·莫滕森在整本书中都强调了可以用博弈论的观点来研究劳动力市场中工资形成和职业转换过程是如何联系的。在雇主和雇员之间就工资进行讨价还价的弗雷德里克·茨威森解,有时也称作茨威森—纳什(Nash)—海萨尼(Harsanyi)解,是雇主与雇

员进行博弈的结果,从这个角度说,本书非常适合纳入茨威森讲座丛书系列。

卡斯滕·阿尔拜克

前 言

本书始于 2010 年 11 月我在哥本哈根大学的茨威森讲座上所做同题报告的记录稿。本书前一稿的部分内容我曾于 2002 年 3 月在女王学院的麦金塔(MacIntosh)讲座和 2002 年 7 月在洪堡大学的熊彼特(Schumpeter)系列讲座上报告过。最近选修我的劳动经济学研究生课程的学生们也熟悉这些内容。

本书的实证部分基于我和 B.J. 克里斯坦森(B. J. Christensen)、拉斯马斯·伦茨(Rasmus Lentz)、乔治·纽曼(George Neumann)和阿克塞尔·韦瓦茨(Axel Werwatz)的合作研究项目。这个研究项目始于我 1998 年在丹麦奥胡斯劳动力市场和社会研究中心(CLS)的专职研究结束之后。正是在 CLS, 我了解到了丹麦雇主—雇员匹配数据库。在此, 我想感谢我的老朋友们和同事们, 他们是尼尔斯·韦斯特加德-尼尔森(Niels Westergaard - Nielsen)和亨宁·邦泽尔(Henning Bunzel), 作为 CLS 的研究主管, 他们支持鼓励我从事项目研究和本书的写作。我也要向本书的编辑凯西·卡鲁索(Kathy Caruso)表达感激之情。

我要向那些阅读全部或部分书稿并且提出具体意见、指出错误的专家表示感谢。他们是加迪·巴利维(Gadi Barlevy)、胡路珈(Loujia Hu)、拉斯马斯·伦茨、乔治·纽曼、肯尼思·伯德特

(Kenneth Burdett)、罗伯特·夏默(Robert Shimer)、卡斯滕·阿尔拜克和胡戈·纳波(Hugo Nopo)。本研究得到了美国国家自然科学基金会、丹麦国家研究基金会的支持,最后也要向西北大学表示感谢。

目 录

引言	1
1 工资差异的各种理论	11
1.1 工资差异存在的证据	12
1.2 工资差异的搜寻理论	20
1.3 工资差异的其他理论	34
1.4 总结	42
2 伯德特—莫滕森模型	44
2.1 引言	44
2.2 工资政策和保留工资	45
2.3 稳定状态的搜寻均衡	50
2.4 工资差异均衡	52
2.5 总结	56
3 工资差异程度的理论解释	58
3.1 工资分布和工作要约的分布	58
3.2 同质生产率	68
3.3 外生生产率异质	68
3.4 生产能力异质性的内生性	78
3.5 总结	85

4	工资差异和工人流动	87
4.1	引言	87
4.2	工资差异的结构模型	89
4.3	实证推断	99
4.4	总结	116
5	工资和工作任期之间的关系	118
5.1	引言	118
5.2	序贯拍卖	123
5.3	工资—任期合约	135
5.4	总结	150
	附录:存在性证明	153
A.1	买方垄断模型	154
A.2	双边讨价还价模型	155
	后记	157
	参考文献	160
	译后记	165

引 言

“好工作”和“坏工作”并存。在美国，一份好的工作不仅报酬丰厚、为职工提供带薪假期，而且还提供健康保险和其他一些相关的福利待遇。当然，对于那些从这几个方面来看算是较好的工作，其中很大一部分都要求工人有更多的技能。与此同时，我们也发现在好工作和坏工作中，也有素质非常接近的员工。这些现象促使我们在这个讲座中提出这样一个问题：为什么相似的工人薪酬不同？

假设在一个完全竞争市场中，每个工人都从所有工作机会中选择能够带来最大效用的工作。在这种情况下，工人之间工资的差异只反映具体工人能力的不同，或者工作职位所具有的非货币方面的差异。尽管人们做了没有上千次、也有上百次的实证研究来评估所谓的人力资本工资的方程，证实了可以把工人具有的某些特征视为劳动生产率的指示器，这些特征与工人赚得的工资正相关，但是此理论的解释能力非常差。在这些实证研究中，那些人们认为能够用于解释生产率差异，并且能够观察到的工人特征，通常只能解释不超过 30% 的工人报酬波动。在随后的讨论中，我把剩余部分，就是那些工人特征无法解释的 70% 的工人报酬波动称为工资差异。

我们的兴趣集中在构建令人信服的工资差异理论上,这有多方面的原因。首先,工资不平等是造成各个家庭在健康和消费方面不平等的主要因素。劳动收入大约占总收入的 $2/3$,它占大部分家庭收入的比例更大。实际上,在任何国家中,那些赚取最低工资的家庭往往都是最贫困的。此外,在过去的二十年里,美国低工资工人的真实收入实际上是下降的,而高工资工人的收入却在显著增长。如果保持工人特征不变,那么工资差异的增长是造成近期美国工人工资差距增大的主要原因。¹ 第二,由于工资差距不能用工人能力差异来解释,这就提出了经济效率问题。例如,如果观察到的工资差异反映了雇主之间劳动的边际生产率差距,而不是工人之间劳动的边际生产率差距,那么通过鼓励工人从生产率低的企业重新配置到生产率高的企业中,将会增加总产出。最后,雇主之间存在的工资差距较大,这意味着存在显著的匹配租金。工人与雇主之间进行分配的方式也会影响工人职位分配的效率。因此,任何对劳动力市场效率或公平感兴趣的研究者,都必须了解工资差异。

标准工资方程只能解释工人工资波动相当少的一部分,正如这个事实所揭示的那样,证明工资差异的存在性是件很容易的事。对于大家都接受的工资决定机制的标准竞争模型,上述事实应该很早就会使劳动经济学家对这个模型的有效性提出质疑。然而,很多人认为工资对数波动的 70%,不能用观察到的工人能力方面存在的差别进行解释,而可以用不可观察的因素进行解释。未被解释的工资波动,可以简单地看作是由那些相关的不可观察的工人特征引起的,这可能吗?

工资差别的系统规律支持各个企业之间薪酬政策不同的新命题。这种证据,意味着不同的雇主确实支付给相似工人的薪酬不同。例如,工资决定方面的实证研究发现,企业支付的工资与企业规模之间存在正相关关系,并且还很好地证明了行业间工资差别大;并且持续时间长。克鲁格(Krueger)和萨默斯(Summers)(1988)认为不同国家特定行业的工资支出大致相当。也有一些学者对美国和其他国家企业规模的差别进行了实证研究,这包括布朗(Brown)和梅多夫(Medoff)(1989)、维(Oi)和伊德松(Idson)(1999)。戴维斯(Davis)和霍尔蒂万格(Haltiwanger)(1996)对美国制造业公司薪酬的研究发现,规模效应增加的幅度对平均工资差异有显著的影响。因为所有这些作者都控制了观察到的工人特征,所以,企业规模和行业差别反映了工资差异,这里的工资差异和我们前面的定义相同。尽管如此,这些度量到的差别也可能是由不可观察的职工能力、工作属性方面的差异与用人企业的规模、行业之间的相关性造成的。

现在,我把对行业和规模差别的解释分成两大类。产生差距的原因可能是由于不同企业的工资政策不同,或者薪酬高的企业总是雇用那些生产率高的工人,而由于多种原因,观察到的数据没有反映这些因素。在研究行业差异的文献中,克鲁格和萨默斯(1988)强调了前一种解释,而墨菲(Murphy)和托佩尔(Topel)(1990)认为,未观察到的个人能力差异才是主要原因。尽管迪肯斯(Dickens)和卡茨(Katz)(1987)、吉本斯(Gibbons)和卡茨(1992)尝试解决这场争论,但是他们的努力由于缺乏合适的数据而化为泡影。

确实,由于差异工资政策假设意味着工资方程存在企业固定效应,而不可观察的个人能力存在差异这个论据意味着工资方程应该包括工人固定效应,因此,要解决这个争论,必须使用单个工人与其雇主匹配的面板数据(Panel data)做实证研究,而这类数据最近才刚刚能得到。在阿波德(Abowd)、克拉马日(Kramarz)和马尔戈利斯(Margolis)(1999),阿波德、芬纳(Finer)和克拉马日(1999)以及阿波德和克拉马日(2000,b)的开创性工作中,他们分析了来自法国和美国华盛顿州的数据,把行业和规模差异平均分解为雇主和工人两部分。²他们发现,不论是在华盛顿州还是在法国,我们上面提到的两种固定效应,解释行业间差距问题的重要性大致相同,同时,在两个例子中雇主平均效应都可以解释超过70%的规模差异。这些研究结果充分证明了工资政策的重要性,也证明了未观察到的个人能力差异是行业间和企业规模所引起的工资差距的根源。

工人薪酬政策的差别到底解释了什么?显然,需要考虑具体的不完全竞争的形式。因为雇主能够确定自己企业的工资水平,所以,从这个意义上说,雇主具有市场势力,这是薪酬政策这个概念的前提假设。这种势力不是字面意义上劳动力市场只有一个“单独买家”的买方垄断,而是从另一个角度说的,即在给定竞争者的工资水平的条件下每个企业都面临一条向上倾斜的供给曲线。³有意思的是,萨缪尔森(Samuelson)(1951,554)在他的《经济学原理》教材中概述了薪酬政策理论的基本要素:⁴

任何规模的企业必须有自己的工资政策。这样一个事实

是劳动力市场不完全的又一佐证。在完全竞争市场中,企业不需要制订工资支付计划,取而代之的是,它可能转而通过从当天早报中了解应该采取怎样的工资政策。任何企业只要稍微把工资提高一点,就能够雇用到它想要的所有新工人;另一方面,如果把工资降低一点,就会一个工人也雇用不到。

但竞争不是百分之百的完全竞争,并不意味着不存在任何竞争。在工资支付这个问题上,实际状况是竞争和某种程度垄断势力的混合。一家试图把工资定得过低的企业很快就会明白这一点。起初不会有多少变化,但是,最终该企业会发现辞职的工人比正常情况下多一些,招聘相同质量的新工人越来越困难,而那些仍在职的工人的工作状态和生产效率的减缓将变得非常明显。

因此,在不完全竞争的现实情况下,劳动供给的多寡确实会影响企业支付工资的多少。如果企业规模很小,那么企业甚至可以和应聘的工人讨价还价,从而使企业支付的工资不比企业必须支付的工资多。但是,如果企业稍具规模,企业便要对每种工作规定工资,然后决定在应聘者中录用多少。

为什么单个雇主面临的劳动力供给曲线的弹性小于无穷?我的老师,马丁·布朗芬布伦纳(Martin Bronfenbrenner)(1956, 577—578)明确地阐述了萨缪尔森言语间隐含的观点:

在一个无组织的劳动力市场中,典型雇主面临不可改变的市场工资,绝不可能是完全竞争者。由于工人不会坐等就