

辽宁大学应用经济学系列丛书

学术系列



居民消费变动及影响因素的计量分析

Econometric Analysis of Residents' Consumption
and Its Influencing Factors

王 青 等著

中国财经出版传媒集团



经济科学出版社
Economic Science Press

辽宁大学应用经济学系列丛书·学术系列

辽宁省社科基金项目“提高消费对辽宁经济发展贡献率研究”(L12AJL004)

居民消费变动及影响因素的 计量分析

王 青 等著

中国财经出版传媒集团



经济科学出版社
Economic Science Press

图书在版编目 (CIP) 数据

居民消费变动及影响因素的计量分析/王青等著.

—北京: 经济科学出版社, 2017. 4

(辽宁大学应用经济学系列丛书·学术系列)

ISBN 978 - 7 - 5141 - 7892 - 0

I. ①居… II. ①王… III. ①居民消费 - 影响因素 - 经济计量分析 - 研究 - 中国 IV. ①F126. 1

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2017) 第 065279 号

责任编辑: 于海汛 周秀霞

责任校对: 靳玉环

版式设计: 齐 杰

责任印制: 潘泽新

居民消费变动及影响因素的计量分析

王 青 等著

经济科学出版社出版、发行 新华书店经销

社址: 北京市海淀区阜成路甲 28 号 邮编: 100142

总编部电话: 010 - 88191217 发行部电话: 010 - 88191522

网址: [www. esp. com. cn](http://www.esp.com.cn)

电子邮件: [esp@ esp. com. cn](mailto:esp@esp.com.cn)

天猫网店: 经济科学出版社旗舰店

网址: [http: //jjkxcbs. tmall. com](http://jjkxcbs.tmall.com)

北京汉德鼎印刷有限公司印刷

三河市华玉装订厂装订

710 × 1000 16 开 18.75 印张 270000 字

2017 年 5 月第 1 版 2017 年 5 月第 1 次印刷

ISBN 978 - 7 - 5141 - 7892 - 0 定价: 55.00 元

(图书出现印装问题, 本社负责调换。电话: 010 - 88191510)

(版权所有 侵权必究 举报电话: 010 - 88191586)

电子邮箱: [dbts@ esp. com. cn](mailto:dbts@esp.com.cn))

总 序

这是我主编的第三套系列丛书。前两套丛书出版后，总体看效果还可以：第一套是《国民经济学系列丛书》（2005 年至今已出版 13 部），2011 年被列入“十二五”国家重点图书出版物；第二套是《东北老工业基地全面振兴系列丛书》（共 10 部），在列入“十二五”国家重点图书出版物的同时，还被确定为 2011 年“十二五”规划 400 种精品项目（社科与人文科学 155 种），围绕这两套系列丛书还取得了一系列成果，获得了一些奖项。

主编系列丛书从某种意义上说是“打造概念”。比如说第一套系列丛书也是全国第一套国民经济学系列丛书，主要为辽宁大学国民经济学国家重点学科“树立形象”；第二套则是在辽宁大学连续获得国家社科基金“八五”、“九五”、“十五”、“十一五”重大（点）项目，围绕东北（辽宁）老工业基地调整改造和全面振兴进行系统研究和滚动研究的基础上继续探索，从而为促进辽宁大学区域经济学建设、服务地方经济不断做出新贡献。在这个过程中，既出成果，也带队伍、建平台、组团队，遂使辽宁大学应用经济学学科建设不断地跃上新台阶。

主编第三套丛书旨在使辽宁大学的应用经济学一级学科建设有一个更大的发展。辽宁大学应用经济学学科的历史说长不长、说短不短。早在 1958 年建校伊始，便设经济系、财政系、计统系等 9 个系，其中经济系由原东北财经学院的工业经济、农业经济、贸易经济三系合成，财税系和计统系即原东北财经学院的财信系、计统系。后来院系调整，将经济系留在沈阳的辽宁大学，将财政系、计统系搬到在大连组建的辽宁

财经学院（即现东北财经大学前身），对工业经济、农业经济、贸易经济三个专业的学生培养到毕业为止。由此形成了辽宁大学重点发展理论经济学（主要是政治经济学）、辽宁财经学院重点发展应用经济学的大体格局。实际上，后来辽宁大学也发展应用经济学，东北财经大学也发展理论经济学，发展都不错。1978年，辽宁大学恢复招收工业经济本科生，1980年受人民银行总行委托、经教育部批准招收国际金融本科生，1984年辽宁大学在全国第一批成立经济管理学院，增设计划统计、会计、保险、投资经济、国际贸易等本科专业。到20世纪90年代中期，已有西方经济学、世界经济、国民经济管理、国际金融、工业经济5个二级学科博士点，当时在全国同类院校似不多见。2000年，辽宁大学在理论经济学一级学科博士点评审中名列全国第一；2003年，在应用经济学一级学科博士点评审中并列全国第一；2010年，新增金融、应用统计、税务、国际商务、保险等全国首批应用经济学类专业学位硕士点；2011年，获全国第一批统计学一级学科博士点，从而成为经济学、统计学一级学科博士点“大满贯”。

在二级学科重点学科建设方面，1984年，外国经济思想史即后来的西方经济学、政治经济学被评为省级重点学科；1995年，西方经济学被评为省级重点学科，国民经济管理被确定为省级重点扶持学科；1997年，西方经济学、国民经济管理、国际经济学被评为省级重点学科和重点扶持学科；2002年、2007年国民经济学连续两届被评为国家重点学科；2007年，金融学被评为国家重点学科。

在一级学科重点学科建设方面，2008年应用经济学被评为第一批一级学科省级重点学科，2009年被确定为辽宁省“提升高等学校核心竞争力特色学科建设工程”高水平重点学科，2014年被确定为辽宁省一流特色学科第一层次学科，2016年被辽宁省人民政府确定为辽宁省一流学科。

在“211工程”建设方面，应用经济学一级学科在“九五”立项的重点学科建设项目是“国民经济学与城市发展”、“世界经济与金融”；“十五”立项的重点学科建设项目是“辽宁城市经济”；“211工程”三

期立项的重点学科建设项目是“东北老工业基地全面振兴”、“金融可持续协调发展理论与政策”，基本上是围绕国家重点学科和省级重点学科而展开的。

经过多年的学科积淀与发展，辽宁大学应用经济学、理论经济学、统计学“三箭齐发”，国民经济学、金融学、世界经济三个国家重点学科“率先突破”，由长江学者特聘教授、“万人计划”第一批入选者、全国高校首届国家级教学名师领衔，中青年学术骨干梯次跟进，形成了一大批高水平的学术成果，培养出一批又一批优秀人才，多次获得国家级科研、教学奖励，在服务东北老工业基地全面振兴等方面做出了积极的贡献。

这套《辽宁大学应用经济学系列丛书》的编写，主要有三个目的：

一是促进应用经济学一级学科全面发展。以往辽宁大学主要依托国民经济学、金融学两个国家重点学科和区域经济学省级重点学科进行建设，取得了重要进展。这个“特色发展”的总体思路无疑是正确的。进入“十三五”时期，根据高校和区域特色，本学科确定的目标是优先发展国家重点学科国民经济学、金融学，重点发展地方特色学科区域经济学、产业经济学、财政学和国际贸易学，协同发展重点支持学科经济统计学、数量经济学和劳动经济学，下设5个重点学术方向：国民经济与地方政府创新、金融财政与区域发展、产业经济与技术创新、国际经贸与东北亚合作，区域经济与东北振兴，努力把本学科建设成为重点突出、地域特色鲜明、为国家经济建设和东北老工业基地全面振兴做出重大贡献、具有较大国际影响的一流学科。因此，本套丛书旨在为实现这一目标提供更大的平台支持。

二是加快培养中青年骨干教师茁壮成长。目前，本学科已建成长江学者特聘教授、“万人计划”第一批入选者、全国高校首届国家级教学名师领衔，教育部新世纪优秀人才、教育部教指委委员、省级教学名师、校级中青年骨干教师为中坚，以老带新、新老交替的学术梯队。本丛书设学术、青年学者、教材三个子系列，重点出版中青年教师的学术著作，带动他们尽快脱颖而出，力争早日担纲学科建设。与此同时，还

设立了教材系列，促进教学与科研齐头并进。

三是在经济新常态、新一轮东北老工业基地全面振兴中做出更大贡献。对新形势、新任务、新考验，提供更多具有原创性的科研成果，具有较大影响的教学改革成果，具有更高决策咨询价值的“智库”成果。

这套系列丛书的出版，得到了辽宁大学校长潘一山教授和经济科学出版社党委书记、社长吕萍总编辑的支持，得到了学校发展规划处和计划财务处的帮助，受辽宁省一流特色学科和辽宁省 2011 协同创新中心建设经费共同资助。在丛书出版之际，谨向所有关心支持辽宁大学应用经济学建设和发展的各界朋友、向辛勤付出的学科团队成员表示衷心的感谢！

林木西

2016 年国庆节于蕙星楼

目 录

第一章 居民消费总量变动分析	1
第一节 中国居民消费需求演进过程及其特征	1
第二节 中国居民消费需求变动分析	10
第三节 影响居民消费需求的因素分析	15
第四节 中国居民消费需求的国际比较	20
第五节 消费需求总量对经济增长的影响	28
第二章 中国居民消费结构变动分析	39
第一节 居民消费结构演变的过程及其特征	39
第二节 我国城乡居民消费结构的差异	53
第三节 居民消费结构的计量分析	64
第三章 收入对城乡居民消费的影响	78
第一节 收入对消费影响的相关理论	78
第二节 中国城乡居民收入的现状	86
第三节 协整的相关理论	90
第四节 中国城乡居民收入与消费的协整分析	94
第五节 城乡居民不同来源收入对消费的动态影响	101

第四章	收入差距对城乡居民消费的影响	111
第一节	收入差距对消费需求影响的理论分析	111
第二节	城乡居民收入差距对消费影响的统计分析	117
第三节	城乡居民收入差距对消费影响的计量分析	133
第四节	城镇居民收入差距对城镇居民消费结构的影响	143
第五章	不确定性对居民消费的影响	149
第一节	不确定性概述	149
第二节	凯恩斯的不确定性理论	153
第三节	ARI - ARCH 模型的建立与解析	155
第四节	不确定性的测度	159
第五节	不确定性对居民消费影响的实证分析	165
第六章	财政分权对居民消费的影响	170
第一节	中国财政体制改革历程及居民消费现状分析	170
第二节	财政分权对居民消费影响的理论模型	177
第三节	财政分权对居民消费影响的实证分析	185
第四节	结论及政策建议	209
第七章	消费结构变化对经济发展的影响	212
第一节	消费结构对经济发展影响的相关文献综述	213
第二节	消费结构变化与经济发展关联性理论分析	217
第三节	消费结构升级现状	227
第四节	消费结构变动促进产业结构调整的分析	236
第五节	消费结构变动促进经济结构调整的分析	248
第六节	结论与政策建议	252

第八章 消费需求与经济增长	256
第一节 消费在国民经济总体结构及其运行的作用	257
第二节 由消费需求到经济增长的传递机制的历史考察	259
第三节 由消费需求到经济增长的理论分析	261
第四节 扩大消费需求对经济增长拉动作用的对策建议 ——以辽宁为例	269
参考文献	275
后记	288

第一章

居民消费总量变动分析

消费是宏观经济运行中极为重要的变量，市场经济的实质也就是通过消费选择和消费引导来配置资源。改革开放以来，随着我国城乡居民的人均收入水平不断提高，城乡居民的消费总量得到了迅速增长，由消费需求规模决定的市场容量已成为经济增长的约束条件。深入分析我国城乡居民消费需求总量变动，对于正确认识城乡居民消费需求的层次性变化规律、揭示消费市场的未来变化趋势，并针对居民消费需求的变化，合理调整产品结构、刺激经济的持续发展，都有着十分重要的意义。

第一节 中国居民消费需求演进过程及其特征

我国是一个发展中国家，和世界其他国家相比，我国居民的消费需求与经济增长的关系，既有广泛的同一性规律，也有自己的特殊性表现。我国是一个曾长期实行计划经济体制的国家，市场经济仍处于起步阶段，无论是在改革开放前还是改革开放后的相当长一段时期里，我国居民的消费需求与经济增长过程均带有浓厚的计划经济色彩。由于我国国情的特殊性，在分析我国经济增长与消费需求的关系时，必须结合我国实际情况，正确认识我国消费需求的演进规律。

一、最终消费率与最终消费构成的演变

国内生产总值的支出构成分为总消费、总投资和净出口，总消费是其重要的组成部分。改革开放三十多年来，尤其是中国近十年来，经济发展虽然取得了相当的进步，但我国最终消费占 GDP 的比例呈较稳定的下降趋势，见表 1-1。

表 1-1 1978 ~ 2014 年中国最终消费率

年份	最终消费 (亿元)	居民消费 (亿元)			最终消费占 GDP 比重 (%)
		总数	农村居民消费	城镇居民消费	
1978	2232.9	1759.1	1092.4	666.7	61.44
1980	2966.9	2336.9	1414.9	922	64.67
1985	5917.9	4627.4	2786.7	1840.7	65.04
1990	12001.4	9435	5240.9	4194.2	63.59
1995	36197.9	28072.9	11537.7	16535.2	59.01
2000	63667.7	46987.8	15611.8	31375.9	63.49
2001	68546.7	50708.8	16297.5	34411.3	61.83
2002	74068.2	55076.4	17016.7	38059.7	60.85
2003	79513.1	59343.8	17775	41568.8	57.86
2004	89086	66587	19232.6	47354.4	55.05
2005	101447.8	75232.4	20912	54320.4	54.16
2006	114728.6	84119.1	22639.6	61479.5	52.28
2007	136229.4	99793.3	25588.5	74204.8	50.41
2008	157466.3	115338.3	28840.7	86497.5	49.28
2009	172728.3	126660.9	30666.2	95994.7	49.48
2010	198998.1	146057.6	33610.3	112447.2	48.18
2011	241022.1	176532	41075.3	135456.6	49.26
2012	271112.8	198536.8	45222.8	153313.9	50.17
2013	300337.8	219762.5	49432.1	170330.4	50.46
2014	328312.6	242539.7	54366.1	188173.6	50.98

注：按当年价格计算。

资料来源：《中国统计年鉴 2015》。

改革开放以来，我国最终消费率大致走势是：上升→下降→小幅上升→下降。1978 ~ 1983 年首先经历了 5 年上升阶段，于 1983 年达到峰

值 67.43%，这一上升阶段与我国当时长期压抑的消费欲望得到满足，实行消费补偿政策有关。此后，虽然从短期经济运行来看，1989 年曾经出现过居民消费需求膨胀，消费率出现了小幅反弹，但从 1984 ~ 1994 年经济运行趋势来看，我国最终消费率基本上以平均每年 0.7 个百分点的幅度下降，1994 年已降到最低点 58.13%。1995 年以来，因对投资控制较严而导致消费率小幅回升，2002 年以后最终消费率逐年下降，2012 年、2013 年和 2014 年的最终消费率分别为：50.17%、50.46% 和 50.98%。从 2000 年起我国消费率下降呈加速趋势。在 1981 ~ 1995 年间的 15 年时间里，我国消费率从 66.4% 下降到 59.0%，相当于每年下降了 0.5 个百分点，而 2000 ~ 2010 年间的 11 年时间里，我国的消费率从 63.49% 下降到 48.18%，平均每年下降了 1.39 个百分点，见图 1-1。



图 1-1 1978 ~ 2014 年最终消费率

注：数据按当年价格计算。

资料来源：《中国统计年鉴 2015》。

我国最终消费率不仅低于与我国发展水平相当的国家,更远远低于一些发达国家。由于消费需求不足,我国经济增长越来越依赖于投资增长或对外贸易顺差的扩大。但是,对于一个人口众多的大国来说,经济增长过分地依赖对外贸易,不仅给外贸部门带来巨大压力,也不是经济长期增长的基本力量。作为一个大国,经济长期增长的根本动力在于国内有效需求的持续增长,特别是居民消费需求的持续增长。从这个角度看,如果不能扭转消费需求不断下滑的局面,我国经济要保持持续、快速健康发展是不可能的。

最终消费可分为政府消费和居民消费,改革开放以来,从居民消费与政府消费的绝对量看,二者均呈上升趋势。居民消费从1978年的1759.1亿元增加到2014年的242539.7亿元,增长约138倍。政府消费从1978年的473.8亿元,增加到2014年的85772.9亿元,增长约181倍。从最终消费的构成看,居民消费需求下降,政府消费需求上升。在最终消费中,政府消费在最终消费中所占比重大约在20%左右,其变化幅度的最高值与最低值相差约5.6个百分点,无论是与低收入国家相比,还是与东亚、南亚国家相比,我国政府消费率都是不低的,与国际平均水平接近,见表1-2。而通过居民消费率的中外对比,我们发现,我国的居民消费率大约比低收入国家低18个百分点,比居民消费率最低的东亚国家低2~6个百分点。

表1-2 1978~2014年中国最终消费构成

年份	居民消费 (亿元)	政府消费 (亿元)	在最终消费中(%)		在居民消费中(%)	
			居民消费	政府消费	农村居民	城镇居民
1978	1759.1	473.8	78.78	21.22	62.10	37.90
1980	2336.9	630	78.77	21.23	60.55	39.45
1985	4627.4	1290.5	78.19	21.81	60.22	39.78
1990	9435	2566.4	78.62	21.38	55.55	44.45
1995	28072.9	8125.1	77.55	22.45	41.10	58.90
2000	46987.8	16679.9	73.80	26.20	33.23	66.77
2001	50708.8	17837.9	73.98	26.02	32.14	67.86

续表

年份	居民消费 (亿元)	政府消费 (亿元)	在最终消费中 (%)		在居民消费中 (%)	
			居民消费	政府消费	农村居民	城镇居民
2002	55076.4	18991.8	74.36	25.64	30.90	69.10
2003	59343.8	20169.3	74.63	25.37	29.95	70.05
2004	66587	22499.1	74.74	25.26	28.88	71.12
2005	75232.4	26215.4	74.16	25.84	27.80	72.20
2006	84119.1	30609.5	73.32	26.68	26.91	73.09
2007	99793.3	36436.2	73.25	26.75	25.64	74.36
2008	115338.3	42128	73.25	26.75	25.01	74.99
2009	126660.9	46067.4	73.33	26.67	24.21	75.79
2010	146057.6	52940.5	73.40	26.60	23.01	76.99
2011	176532	64490.1	73.24	26.76	23.27	76.73
2012	198536.8	72576.1	73.23	26.77	22.78	77.22
2013	219762.5	80575.3	73.17	26.83	22.49	77.51
2014	242539.7	85772.9	73.87	26.13	22.42	77.58

注：按当年价格计算。

资料来源：《中国统计年鉴 2015》。

1995 ~ 2008 年的 14 年间，我国居民消费占总消费的比重逐年下降，由 1995 年的 77.55% 下降到 2008 年的 73.25%，2009 ~ 2013 年居民消费占总消费的比重在 73.2% 左右，2014 年稍有上升，居民消费占总消费的比重在 73.87%。与此相反，这 14 年间，我国政府消费占 GDP 的比重逐年上升，由 1995 年的 22.45% 上升到 2008 年的 26.75%，见图 1-2。

20 世纪 90 年代以来，居民消费支出增长幅度明显下降。1991 ~ 1994 年城镇居民人均生活消费支出年实际增长幅度均在 8% ~ 10% 之间，1995 年下降到 6%，1996 年进一步下降到 2%，1997 年和 1998 年略有回升，也只达到 4%，1999 年达 8%，2002 年达到 9.1%，相当于 90 年代前期的水平。农村人均消费增长幅度，与农产品价格的涨跌密切相关，1991 ~ 1993 年处于低谷，不到 3%，1994 年为 6%，1995 ~ 1996 年分别达 10%、11%，1997 年为 0，1998 年为 -1%，1999 年

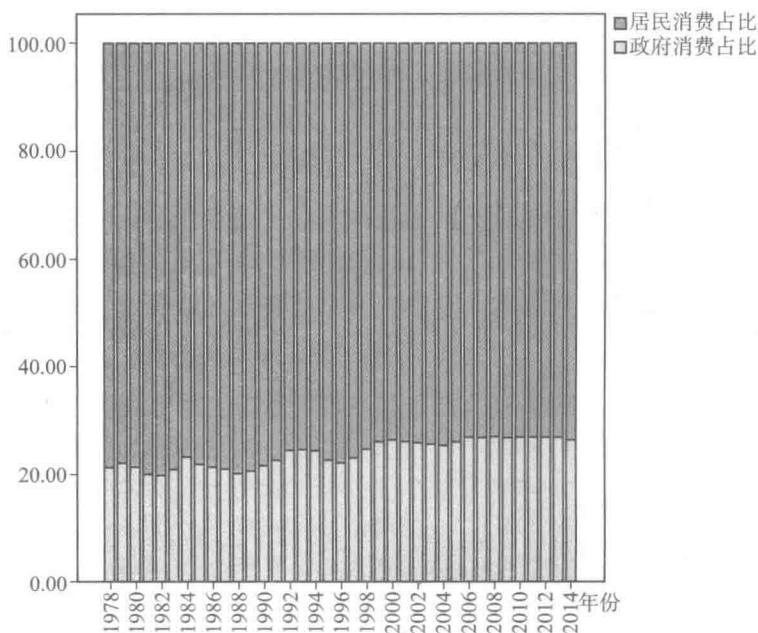


图 1-2 1978 ~ 2014 年政府消费与居民消费

注：数据按当年价格计算。

资料来源：《中国统计年鉴 2015》。

为 1%^①，2002 年为 6.0%。根据钱纳里分析，人均 GNP 在 1000 美元时，居民消费率平均为 61%，2003 年，我国的人均 GNP 已接近 1000 美元，但居民消费占 GDP 的比重仅为 45.1%，比国际平均水平大约低 15 个百分点。可以判断：我国消费率偏低主要是由居民消费率偏低造成的。

根据宏观经济理论，居民消费率 r_c 与居民收入份额 c 和居民平均消费倾向 i 存在以下关系：

$$r_c = \frac{C}{GDP} = \frac{C}{I} \cdot \frac{I}{GDP} = i \cdot c$$

^① 孙文博：《我国居民消费及刺激需求的实证分析》，载《宏观经济研究》2001 年第 7 期。

式中： C 为居民消费总额， I 为居民收入总额。

居民消费率由居民收入份额 c 和居民平均消费倾向 i 决定。从我国改革开放以来的现实情况来看，我国内需不足，GDP 增长率低于潜在增长率，主要是居民消费需求不足，居民消费占 GDP 比重为 47% 左右，明显低于低收入国家（68%）、下中等收入国家（57%）水平。而居民消费不足主要是农村居民消费不足，占 GDP 比重由 1978 年的 30.31% 下降为 2002 年的 19.7%。而农民消费不足主要是农民人均纯收入较低。2015 年，中国实际消费占实际国内生产总值的比重为 51%，不但低于美、德、日、韩等发达国家，而且低于“金砖”五国的所有其他四国。我国的居民消费率偏低正是由居民收入份额和居民平均消费倾向下降引起的。

二、居民消费规模与构成演变

居民消费又可分为城镇居民消费和农村居民消费。改革开放以来，人民生活水平得到了很大提高，从居民消费总额，即农村居民消费额和城镇居民消费额看，均呈上升趋势。从居民消费总额构成看，农村居民消费所占比重趋于下降，而城镇居民消费所占比重则趋于上升。城镇居民消费所占比重由 1978 年的 37.9% 上升为 2014 年的 77.58%，而农村居民消费呈现出先上升后下降的态势，1978 ~ 1982 年经历了五年上升阶段，于 1983 年达到高峰 63.39%，这一上升阶段与当时的政策有关。农民消费对经济增长发挥了拉动作用，农民的消费增长成为 1978 ~ 1983 年国民经济增长的主动因。此后出现了持续下降，从 1985 年的 60.22% 下降到 2014 年的 22.42%。这是因为主要农产品和生活必需品需求已基本得到满足，国民经济的发展进入新的转折点，以城市为中心的耐用消费品排浪式地增长，成为经济增长的主动因。农村消费额逐年下降，并带动总消费占 GDP 的比重下降。农村消费对国民经济的影响逐渐减少。1987 年以前农民最终消费占居民消费的比重一直保持在 57% 以上，从 1988 年开始这一比重开始下降，尽管最终消费总额从