

“十一五”国家重点图书出版规划

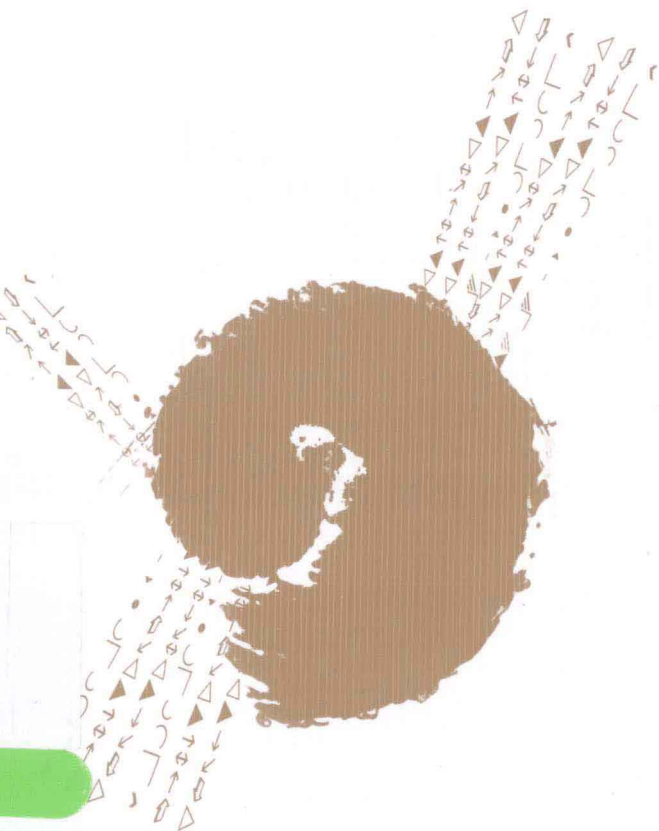
中国经济问题丛书

DIFANG ZHENGFU JINGZHENG HE JINGJI ZENGZHANG

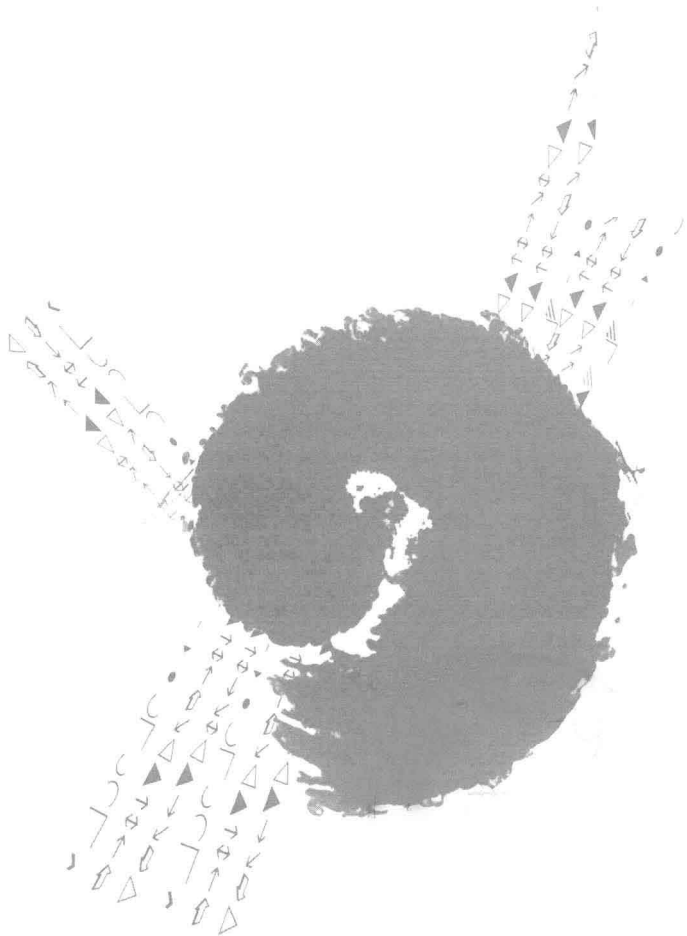
地方政府竞争和经济增长

——基于我国省级面板数据的空间计量经济学研究

周业安 李涛 著



中国人民大学出版社



“十一五”国家重点图书出版规划



中国经济问题丛书

ZHONG GUO JING JI WEN TI CONG SHU

地方政府竞争和经济增长

——基于我国省级面板数据的空间计量经济学研究

DIFANG ZHENG FU JINGZHENG HE JINGJI ZENGZHANG

周业安 李 涛 著

中国人民大学出版社

· 北京 ·

图书在版编目 (CIP) 数据

地方政府竞争和经济增长: 基于我国省级面板数据的空间计量经济学研究 / 周业安
李涛著. —北京: 中国人民大学出版社, 2013. 5

(中国经济问题丛书)

ISBN 978-7-300-17379-5

I. ①地… II. ①周… ②李… III. ①区域经济-计量经济学-研究-中国
IV. ①F127

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2013) 第 110157 号

“十一五”国家重点图书出版规划

中国经济问题丛书

地方政府竞争和经济增长

——基于我国省级面板数据的空间计量经济学研究

周业安 李 涛 著

Difang Zhengfu Jingzheng he Jingji ZengZhang

出版发行 中国人民大学出版社

社 址 北京中关村大街 31 号

邮政编码 100080

电 话 010-62511242 (总编室)

010-62511398 (质管部)

010-82501766 (邮购部)

010-62514148 (门市部)

010-62515195 (发行公司)

010-62515275 (盗版举报)

网 址 <http://www.crup.com.cn>

<http://www.ttrnet.com>(人大教研网)

经 销 新华书店

印 刷 涿州市星河印刷有限公司

规 格 148 mm×210 mm 32 开本

版 次 2013 年 6 月第 1 版

印 张 13.5 插页 4

印 次 2013 年 6 月第 1 次印刷

字 数 359 000

定 价 39.00 元

·权必究

印装差错 负责调换



《中国经济问题丛书》

总 序

经济理论的发展与变化是和经济实践紧密联系的，在我国继续向社会主义市场经济体制过渡的今天，实践在呼唤经济学的发展和繁荣；同时，实践也为经济学的发展创造着条件。

中国的市场化改革是没有先例的，又没有现成的经济理论作指导，这是中国学者遇到的前所未有的挑战。他山之石，可以攻玉。随着一大批西方经济理论译介进来，以及一大批具有现代经济学素养的人成长起来，认识和解决中国问题开始有了全新的工具和视角。理论和实践是互动的，中国这块独一无二的“试验田”在借鉴和运用现代经济理论的同时，势必会为经济理论的发展注入新的活力，成为其发展的重要推动力量，而建立在探讨中国经济问题基础之上的经济学也才有望真正出现。中国经济问题正是在这个大背景下获得了特别的意义。

我们策划出版《中国经济问题丛书》的主要目



的是为了鼓励经济学者的创新和探索精神，继续推动中国经济学研究的进步和繁荣，在中国经济学学术著作的出版园林中，创建一个适宜新思想生长的园地，为中国的经济理论界和实际部门的探索者提供一个发表高水平研究成果的场所，使这套丛书成为国内外读者了解中国经济学和经济现实发展态势的必不可少的重要读物。

中国经济问题的独特性和紧迫性，将给中国学者以广阔的发展空间。丛书以中国经济问题为切入点，强调运用现代经济学方法来探究中国改革开放和经济发展中面临的热点、难点问题。丛书以学术为生命，以促进中国经济与中国经济学的双重发展为己任，选题论证采用“双向匿名评审制度”与专家约稿相结合，以期在经济学界培育出一批具有理性与探索精神的中国学术先锋。中国是研究经济学的最好土壤，在这块土地上只要勤于耕耘，善于耕耘，就一定能结出丰硕的果实。



目 录

第1章	导论	1
	一、选题背景和意义	1
	二、财政分权和地方政府的崛起	5
	三、几个核心概念的界定	9
	(一) 分权	9
	(二) 财政分权	10
	(三) 地方政府	12
	(四) 地方政府竞争	14
	四、研究思路、研究方法和研究设计	17
	(一) 研究思路——有限的财政分权下有限的地方政府竞争	17
	(二) 研究方法	21
	(三) 研究框架和设计	23
	五、本书的具体结构安排	26
	六、本书的创新之处	28



第2章	地方政府竞争文献综述	32
一、	财政分权和地方政府竞争	32
二、	政府竞争的一般理论分析	35
	（一）早期的政府竞争理论	35
	（二）早期政府竞争理论的发展	38
	（三）政府竞争的空间计量经济学模型	45
三、	政府竞争的存在性检验	45
	（一）税收竞争检验	47
	（二）支出竞争检验	48
	（三）标尺竞争检验	50
	（四）纵向竞争检验	51
	（五）横向和纵向竞争的混合检验	52
	（六）政策互动检验	52
四、	政府竞争的后果研究	53
	（一）区位效应	53
	（二）居民的居住区选择	54
	（三）经济增长	54
	（四）公共品供给	55
	（五）政府规模和腐败	55
五、	国内地方政府竞争研究综述	56
	（一）国内地方政府竞争的性质	57
	（二）地方政府竞争的经济后果	64
第3章	地方政府竞争和经济增长的基本分析框架	74
一、	有限地方政府竞争的定义和性质	75
	（一）地方政府竞争的定义	75
	（二）有限分权的性质	76
	（三）中国地方政府竞争的性质	79
二、	中国的有限地方政府竞争和经济增长	85
	（一）地方政府竞争与经济增长的内在关系	85



	(二) 地方政府的行为特征与竞争后果·····	88
	(三) 中国的有限地方政府竞争对经济 增长的作用路径·····	94
	三、地方政府竞争和经济增长的具体研究思路 ·····	98
	(一) 空间计量经济学的基本原理和方法·····	99
	(二) 空间计量经济学模型在政府竞争 理论研究中的运用 ·····	101
第4章	中国地方政府的税收竞争研究·····	106
	一、导言·····	106
	二、文献综述·····	109
	三、计量模型的构建与分析方法·····	115
	四、数据来源和统计分析·····	118
	五、回归分析·····	124
	六、稳健性检验·····	131
	(一) 变量选择和描述统计 ·····	131
	(二) 回归分析 ·····	135
	七、结论及其理论解释·····	141
第5章	中国地方政府的支出竞争研究·····	150
	一、导言·····	150
	二、相关文献回顾·····	153
	三、计量模型的构建与分析方法·····	157
	(一) 计量模型的构建 ·····	157
	(二) 计量模型的分析方法 ·····	160
	四、数据来源和统计分析·····	162
	五、基本回归分析·····	169
	(一) 空间相关性检验 ·····	169
	(二) 回归结果 ·····	171
	六、人均地区本级财政支出水平的回归结果·····	172
	七、人均地区本级基本建设支出水平的回归结果·····	182



	八、人均地区本级教育支出水平的回归结果·····	193
	九、人均地区本级科学支出水平的回归结果·····	202
	十、人均地区本级医疗卫生支出水平的回归结果·····	209
	十一、人均地区本级行政管理费用水平的 回归结果·····	218
	十二、人均地区本级预算外支出水平的回归结果·····	228
	十三、结论及其理论解释·····	237
第 6 章	分权、地方政府间税收竞争和中国经济增长·····	251
	一、导言·····	251
	二、文献综述·····	256
	三、计量模型的构建与分析方法·····	269
	(一) 计量模型的构建 ·····	269
	(二) 计量模型的分析方法 ·····	271
	四、数据来源和统计分析·····	272
	五、计量结果分析·····	277
	(一) 基于总体宏观税负水平的回归分析结果 ···	277
	(二) 基于各税种税负水平的回归分析结果 ·····	282
	六、结论和政策含义·····	288
第 7 章	地方政府间支出竞争和中国经济增长·····	292
	一、导言·····	292
	二、文献综述·····	294
	三、计量模型的构建与分析方法·····	298
	(一) 计量模型的构建 ·····	298
	(二) 计量模型的分析方法 ·····	300
	四、数据来源和统计分析·····	301
	五、回归分析·····	307
	六、结论和政策含义·····	325
第 8 章	我国地方政府竞争的未来·····	328
	一、地方政府在中国经济增长中扮演着重要角色·····	328



二、解答地方政府竞争之谜——对本书主要 结论的简要总结	335
(一) 税收竞争的主要结论	335
(二) 支出竞争的主要结论	339
(三) 税收竞争和经济增长关系之主要结论	341
(四) 支出竞争和经济增长关系之主要结论	343
三、本书的研究不足以及未来可能的改进	345
四、本书的政策含义	349
参考文献	357
致谢	420



第1章

导 论

一、选题背景和意义

中国的经济增长成就令世人瞩目，一些学者把近十年我国的经济增长变化称为“良性大变形”，即经济周期波动的上升阶段大大延长，经济在上升通道内持续平稳地高位运行，这在新中国成立以来的经济周期史上还是从未有过的（刘树成等，2007）。尽管一些学者怀疑中国经济持续高增长的真实性（比如罗斯基等人），但大多数学者还是同意，即使考虑到统计方法以及统计口径中存在的某些误差，中国改革开放以来仍然保持着经济持续高增长的事实 [具体的争论参见岳希明、张曙光和许宪春（2005）编的论文集]。

给定这种高增长的态势，剩下的关键问题就



是：究竟是何种原因导致了这种持续稳定的高增长？现有的研究主要基于索洛增长模型的视角，估计劳动和资本两大要素对中国经济增长的贡献，同时也有一部分研究估计了技术和制度等作为外生因素对增长的贡献。现有的研究表明，资本是中国改革开放以来经济持续高增长的最主要推动者；技术有一定的贡献，但没有资本那么明显；制度变革因素的确在起作用，但同样没有资本的作用大；劳动的贡献很小。比如，代表性的研究如王小鲁和樊纲（2000），他们的研究表明，1979—1999 年间中国经济增长率（调整后）为 8.3%，其中资本的贡献占 61.4%，劳动的贡献占 9.8%，而农业工业化和城市化的贡献占 16%。特别是在改革初期，1979—1990 年间，农业工业化和城市化对经济增长的贡献占 19.5%。邹至庄（2006）的研究发现，1978—1998 年间中国 GDP 的指数化增长率为 9.3%，其中资本的贡献为 62%，劳动力的贡献为 10%，全要素生产率（TEP）的贡献为 28%。邱晓华等（2006）估计了 1980—2004 年间经济增长率的来源，发现这段时期经济增长率平均为 9.8%，其中资本的贡献为 59.2%，劳动的贡献为 5.1%，技术进步的贡献为 35.7%；制度创新的贡献为 3.1%，人力资本的贡献为 8.2%，结构变动的贡献为 4.1%。经济合作与发展组织（OECD，2006）对改革开放以来的时期进行分段，分别进行估计，发现 1983—1988 年间，中国经济增长率平均 12.1%，其中资本的贡献占 41.3%，劳动力的贡献占 12.4%，TEP 的贡献占 19.8%；1988—1993 年间，中国经济增长率平均 8.9%，其中资本的贡献占 50.6%，劳动力的贡献占 11.2%，TEP 的贡献占 19.1%；1993—1998 年间，中国经济增长率平均 9.8%，其中资本的贡献占 56.1%，劳动力的贡献占 3.1%，TEP 的贡献占 34.7%；1998—2003 年间，中国经济增长率平均 8.0%，其中资本的贡献占 61.3%，劳动力的贡献占 3.8%，TEP 的贡献占 16.3%。

不过，这样一种基于新古典增长模型的经验研究只不过给出了我国改革开放以来的增长事实，但不能解释其原因。真正需要回答



的是,为什么在过去的30余年中,资本对中国经济增长的贡献最大?或者说,资本是由哪些因素决定的?标准的经济学理论强调资本市场的作用,家庭权衡得失来决定资本的供给,而企业按照利润最大化目标决定资本的需求。但这种理论仅仅适用于分散化的经济体。如果在一个政府控制和主导经济活动的经济体中,资本存量在很大程度上就不是取决于市场力量,而是更多地取决于政府行为。即政府影响微观组织的资本决策,进而影响到整个经济体的资本存量,并通过此来影响经济增长。甚至政府直接通过投资来实现资本的快速积累,从而实现经济快速增长。众多发展中国家和地区普遍采取赶超策略,这种策略的核心就是通过政府投资或者政府产业政策引导投资,来实现对发达经济体的赶超。因此,在这样一个经济体中,必须引入政府因素,才能真正理解经济增长的来源和路径。经济学家达成共识的一点是,在中国,即使是改革开放30余年的今天,政府仍然起着主导作用!政府不仅直接通过财政和其他行政活动来影响和控制经济,而且还通过大量的国有企业来主导经济。所以,不考虑政府行为,就无法真正理解中国的经济增长(周业安,2009)。而正如下一节将要分析的,改革开放以来,财政分权带来了地方政府作用的日益增强,地方政府承担了主要的支出功能,因而对经济增长的影响要更为深远。问题的关键就在于,在财政分权的基础上,形成了一种地方政府竞争的格局(何梦笔,1999a, b; 冯兴元,2001a, b),这种地方政府的竞争会影响到经济增长(周业安,2003),并且的确也影响到了经济增长(周业安等,2004; 沈坤荣和付文林,2006; 李涛和周业安,2008, 2010; 李涛等,2011)。

虽然对我国的地方政府竞争的讨论非常火热,相关的文献也不少,但仍然缺乏有力的证据支持下面两个关键的问题:首先,中国的地方政府存在竞争吗?早期何梦笔和冯兴元仅仅是借用了Breton (1996)的政府竞争的一些思想来规范分析中国这种转型经济的变迁轨迹,并没有给出相关的证据来证明是否存在政府竞争;同

样，后期国内文献的相关研究也都是受这些文献的启发来规范讨论地方政府的有关问题的，如果有经验研究的话，也主要集中在地方保护主义及相关问题的讨论上，而不是定量分析政府竞争本身。直到最近，沈坤荣和付文林（2006）、李永友和沈坤荣（2008）、周业安（2008）、郭杰和李涛（2010）从税收竞争的视角，邵军（2007）、李涛和周业安（2008）从财政支出竞争的视角开始定量研究我国地方政府间竞争的情形。这些研究发现，无论是从税收角度还是从支出角度，我国的地方政府之间的确存在策略行为，即存在某种形式的竞争。王守坤等（2008）、王美今等（2010）进一步分析了这种竞争的类型。另一些学者，如周黎安（2004，2007）、周黎安等（2005）提出官员在锦标赛制度下的晋升博弈本质上是一种标尺竞争，这种竞争从规范的视角应该存在，但缺乏相应的证据。进一步看，地方政府间竞争在不同的维度有何异同？竞争的程度如何？现有的文献也没有细致分析。

其次，假定存在地方政府竞争，这种竞争会影响到经济增长吗？在早期的规范分析当中，答案是肯定的。一般的逻辑是，地方政府竞争能够改善地方政府的激励，从而促进资本流动，甚至还能够影响到制度、创新等方面，从而带来经济增长。但如果地方政府采取破坏增长的竞争策略，则也可能阻碍经济增长。周业安（2003）曾分析了三种不同的竞争策略及其后果。特别是，关于地方保护主义及其相关问题的研究呈现出大量的扎实的证据，证明地方政府竞争不利于市场一体化，进而不利于长期的经济发展；而关于财政分权和经济增长的研究文献也表明，分权虽然有利于经济增长，但不利于经济稳定和社会福利的增进（如周业安和章泉，2008）。然而，所有这些都是间接的证据，难以支撑地方政府竞争和经济增长之间的关系。周业安等（2004）试图利用樊纲等人发展的市场化指数（樊纲等，2001，2003）来研究地方政府之间的制度竞争和经济增长的关系，但由于计量方法比较简单，实际上很难满足研究意图。相关的研究，代表性的如张晏（2005），从财政分权



的视角间接讨论了地方政府竞争和增长的关系，但也只是间接证据而已。直到最近，沈坤荣和付文林（2006）以及李涛和周业安（2008，2010）运用空间计量经济学模型首次分别尝试从地方政府税收竞争和支出竞争的视角讨论政府竞争和经济增长的关系，并且发现了有力的证据。但沈坤荣和付文林（2006）的研究比较简单，没有发现更为细致的分项证据；而李涛和周业安（2008，2010）的研究仅仅注重了税收竞争和支出竞争，没有关注其他方面的竞争。

我们将在第2章对相关文献进行详细的综述。不过很明显的一个问题就是，要真正理解中国的经济增长背后的故事，就必须理解中国的政府，尤其是地方政府的行为，而后者必须置于一个竞争的框架中才能体现出行为的本质。毕竟地方政府不是面临一个充分竞争的市场，而是一个近似寡头竞争的市场，在这种市场结构中，作为寡头之一的地方政府必须采取策略行为，才能实现自身利益最大化。正因为如此，我们在分析地方政府行为的时候，就不能采取地方政府同质假定，用一个代表性当事人的方式来加以研究。我们的意图是，应该采取产业组织模型的思路来理解地方政府行为，即理解其策略行为，才能够抓住问题的本质。如前所述，给定地方政府竞争的现实，但目前缺乏足够有力的证据来支撑上述的各种逻辑。所以，迫切需要对地方政府竞争本身及其对经济增长的影响进行全面而系统的研究，才能够把中国的经济增长的背后的故事呈现在大家面前。

二、财政分权和地方政府的崛起

中国的经济改革实际上是一个分权的过程。一方面，通过市场化，政府逐步退出竞争性领域，使这些领域的资源配置主要由价格和竞争机制实现；另一方面，在政府体制内部，中央也逐步向地方放权，无论是早期的财政包干制，还是后来的分税制，都使得地方



拥有了一定程度上的事实上的自主权。分权的结果是，居民、企业和地方政府作为资源配置的主体逐步参与到经济决策活动当中，并通过自主决策来获得必要的激励。这正是我国改革开放以后经济持续稳定增长的源泉。

我们在谈论改革开放以来的财政分权问题，并不意味着改革开放前没有分权。按照胡书东（2001）和张军（2007）的说法，改革前政府间一直不乏分权的试点和探索，并且胡书东（2001）把改革之前的财政分权划分为两个阶段，即 1958—1961 年、1969—1974 年。但问题在于，改革前的分权和改革后的分权是两种存在本质差别的分权改革模式。首先，从分权试验的平稳性看，改革前呈现断断续续的特征，而改革后的分权试验具有高度的稳定性。其次，从分权的内容上看，改革前的分权其实是上级政府对下级政府个别权力的下放，只有在极个别时期才偶然出现了较多的权力下放，这种权力下放甚至可以针对居民和企业，但仅仅是偶然事件；改革以后的分权则是事权和财权在各级政府之间的重新划分。最后，分权的层次不同。改革之前的分权仅仅是上级政府对下级政府、政府对企业和居民的偶然的局部的权力下放；而改革后的分权则是制度化的权力下放，包括不同层级政府之间（即分税制）以及政府和企业及居民之间（即市场化）。

由此可见，30 余年来的分权改革不仅具有稳定性，而且已经制度化。如果仅从财政分权的视角看，分权改革大致经历了两个阶段：一是分税制改革前的阶段，即 1980—1993 年间实施的各种“财政包干”制度，这期间包括 1980 年的“划分收支，分级包干”体制、1985 年的“划分税收、核定收支、分级包干”体制以及 1988 年的“多种形式财政包干”的体制；二是分税制改革后的阶段，即 1994 年之后实施的分税制财政体制。早期何盛明（1998）、贾康和阎坤（1999）等对过去的财政体制改革有一定的讨论，李萍（2006）对改革以来的政府间关系的变革做了详尽的论述。李晓西（2008）、刘尚希和邢丽（2008）最近也系统回顾了改革开放 30 余



年来的财政体制改革。

改革开放 30 余年中，分税制的实施称得上一个标志性的事件。1993 年 12 月 15 日，国务院发布了《关于实行分税制财政管理体制的决定》，按照该决定，分税制财政体制从 1994 年 1 月 1 日起在全国全面实行。分税制第一次通过法规的形式界定和固化了政府间关系，明确了中央和地方的收支范围和具体内容。分税制带来的一个最明显的变化就是地方财政收入下降的同时，地方财政支出却一直保持较高的比例，这表明分税制在试图加强中央财权集中的同时，也同时强化了地方政府在我国经济发展中的重要作用。表 1—1 表明，改革开放以来，地方财政收入占总财政收入的比重在下降，但地方财政支出在总体财政支出中越来越占据主要角色。特别是分税制以来，地方财政支出占总财政支出的比重一直保持在 70% 左右；如果从预算外支出看，90% 以上的预算外支出都是地方政府实施的。财政支出对应着地方政府的事权，从表 1—1 的数据可以看出，我国自 1994 年分税制实施以来，事权主要交给地方政府实施，而中央政府主要从事国防等公共产品的供给以及转移支付等功能。这就意味着从财政的角度看，真正对具体经济事务起主要作用的是地方政府。

表 1—1 地方政府财政支出和预算外支出的相对比重 (%)

年份	地方财政收入 占比总财政收入	地方财政支出 占比总财政支出	地方预算外收入 占比总预算外收入	地方预算外支出 占比总预算外支出
1978	84.5	52.6	—	—
1980	75.5	45.7	—	—
1985	61.6	60.3	—	—
1986	—	—	58.8	59.4
1987	—	—	59.2	59.7
1988	—	—	61.6	60.7
1989	69.1	68.5	59.7	61.0