



国家安全管理

韩传峰 编



同济大学出版社
TONGJI UNIVERSITY PRESS

国家安全管理

韩传峰 编



同济大学出版社
TONGJI UNIVERSITY PRESS

图书在版编目(CIP)数据

国家安全管理/韩传峰编. — 上海: 同济大学出版社, 2016. 4

ISBN 978-7-5608-6276-7

I. ①国… II. ①韩… III. ①国家安全—安全管理—研究—中国 IV. ①D631

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2016)第 062151 号

国家安全管理

韩传峰 编

责任编辑 马继兰 责任校对 徐春莲 封面设计 陈益平

出版发行 同济大学出版社 www.tongjipress.com.cn
(地址:上海市四平路 1239 号 邮编:200092 电话:021-65985622)

经 销 全国各地新华书店

印 刷 同济大学印刷厂

开 本 787 mm×1 092 mm 1/16

印 张 23.75

字 数 593 000

版 次 2016 年 8 月第 1 版 2016 年 8 月第 1 次印刷

书 号 ISBN 978-7-5608-6276-7

定 价 85.00 元

本书若有印装质量问题,请向本社发行部调换 版权所有 侵权必究

前 言

作为国家生存发展的基本前提和战略性需求,国家安全指国家政权、主权、统一和领土完整、人民福祉、经济社会可持续发展和国家其他重大利益相对处于没有危险和不受内外威胁的状态,以及保障持续安全状态的能力。

随着人类社会的进步、国际竞争态势的变化、全球经济政治一体化和利益格局的多样化,政治、经济、社会、文化、生态、科技等方面的因素对国家利益的影响日益增强。以互联网为核心的“无国界数字化空间”全面铺展,增加了国家安全威胁传导的复杂性,导致安全威胁不断耦合、共振,安全领域互嵌、衍生。尤其非传统安全威胁具有衍生性、非直观性特征,易被政治化、工具化运用,渐进、隐蔽地颠覆国家主权和政党政权,改变民族性格。非传统安全威胁与传统安全威胁交织,使得国家安全进入综合安全时期,具有有机性、系统性和复合性等时代性特征。

随着国际政治经济格局的深度调整和中国经济社会的深度转型,我国国家安全的风险因素明显增多,安全形势日益严峻,面临着对外维护国家主权、安全、发展利益,对内维护政治安全和社会稳定的双重压力。安全威胁多领域、多模态存在,并相互影响、相互转化,国际安全问题国内化、国内稳定问题国际化。

在此时代背景下,为有效预防与应对错综复杂的国家安全危机,2014年1月24日,我国成立中央国家安全委员会。2014年4月15日,习近平总书记在中央国家安全委员会第一次会议上提出总体国家安全观,即以人民安全为宗旨,以政治安全为根本,以经济安全为基础,以军事、文化、社会安全为保障,以促进国际安全为依托,维护各领域国家安全,构建集政治安全、国土安全、军事安全、经济安全、文化安全、社会安全、科技安全、信息安全、生态安全、资源安全、核安全等于一体的国家安全体系,走中国特色国家安全道路。总体国家安全观运用非传统思维統合了传统安全与非传统安全两个方面,契合了我国国家安全形势变化的新特点、新趋势,体现着对国家安全的全面性、综合性、系统性、辩证性地观察、认识和处理,具有丰富的非传统内容。

2015年7月1日,新《中华人民共和国国家安全法》通过并实施,将每年4月15日定为全民国家安全教育日,为国家安全治理体系和治理能力现代化提供根本的法律遵循,为有效维护国家安全提供根本的法律保障。

近年来,同济大学的学者坚持国家需求和问题导向,着眼长远性、战略性、前瞻性,

聚焦国家安全管理的科学问题进行深入研究,科研成果显著。在编者所主持的国家自然科学基金重大研究计划重点支持项目——中国应急管理体系顶层设计原理方法及模式重构(91224003)、非常规突发事件处置模式及应急技术集成原理与方法(91024023)的研究过程中,深感国家安全管理的基础理论与治理体系还较薄弱且不成系统,作为同济大学人文社会科学跨学科研究团队的团队负责人,萌生集结我校跨学科学者的学术论文成集,以丰富安全学科理论之意,得到了团队成员的支持。

本论文集共收录了39篇公开发表的学术论文,内容涉及经济与金融安全、能源与资源安全、网络与信息安全、社会安全与文化安全、反恐反恐与外部环境安全等主题。论文论证严密,具有一定的理论深度和应用广度,希望通过集结出版,发挥高校智库的战略研究、政策建言、人才培养、舆论引导和公共外交等功能作用,丰富安全学科理论,深化实践应用,助力国家安全治理体系和治理能力现代化。

本论文集可供从事国家安全复杂系统与管理体系、国家安全管理基础理论与应用、中国社会公共安全治理体系和国家安全管理平台研究的高等院校师生、科研人员,以及国家安全管理决策者阅读、参考,各部分自成一体,可根据兴趣和需要选择阅读。

感谢国家自然科学基金重大研究计划重点支持项目——中国应急管理体系顶层设计原理方法及模式重构(91224003)、非常规突发事件处置模式及应急技术集成原理与方法(91024023),以及同济大学人文社会科学跨学科研究团队建设项目,对本论文集的资助!

目 录

一、经济与金融安全

远距离贸易、技术变迁与长期经济增长	简 泽(2)
劳动无限供给下中国的经济波动	黎德福,唐雪梅(17)
绿色经济新理念及中国开展绿色经济研究的思考	诸大建(35)
生态福利绩效及其与经济增长的关系研究	诸大建,张 帅(46)
中国经济新常态趋势分析及战略选择	石建勋,张 悦(59)
对引发墨西哥金融危机原因的再认识	仇华飞(67)
国际金融危机背后的深层次原因探析	聂文星,吴奇志(73)
基于 FA-BPNN 的金融控股公司风险预警系统研究	闻岳春,王婧婷(78)
上海自贸区离岸金融中心建设的系统性金融风险研究	闻岳春,程天笑(92)
银信合作视角下影子银行对金融市场的影响	闻岳春,肖敬红(105)
系统性金融风险的影响因素研究	闻岳春,唐学敏(113)
中国移动互联网金融安全生态系统顶层设计	田 萃,王兴广,赵苏爽(123)
基于 CGE 模型的人民币外汇市场压力及央行外汇干预实证研究 ...	石建勋,金 政(128)

二、能源与资源安全

基于并列结构 CCGSS 模型的能源利用效率评价	段永瑞,贾莹莹,田 澎(140)
消费者视角的农民食品安全意识研究	马振鹏,吴宗法,孟秀焕(147)
我国食品安全治理工具多元化的探索	王晓博,安洪武(151)
农村劳动力转移对粮食安全的影响	程名望,黄甜甜,刘雅娟(158)

三、社会安全与文化安全

政策缝隙、风险源与社会稳定风险评估	朱德米(168)
社会稳定风险评估的社会理论图景	朱德米(176)
决策与风险源:社会稳定源头治理之关键	朱德米(189)
“维稳”的绩效困境:公共安全开支视角	谢 岳,党东升(200)
群体性事件治理视域下的社会组织研究	孙 荣,陈 莹(214)
我国 PX 类项目群体性事件的形成机理及成因消弭策略	韩传峰,田 萃,滕敏敏,刘兴华(222)
中国应急管理体系的动力结构分析及模式重构策略	徐松鹤,韩传峰,孟令鹏,吴启迪(231)

中国城市群区域环境治理模式构建	滕敏敏, 韩传峰(241)
国家文化安全之“安全困境”探析	沈洪波(247)
全球化背景下的国家文化安全问题	沈洪波(254)
网络文化产业公共治理全球化语境下的我国网络文化安全研究	解学芳(261)
政府主导社会参与培育应急文化	韩传峰, 赵苏爽, 刘兴华(270)

四、反恐与外交

后“9·11”时期美国的危机管理研究	邱美荣(280)
国家利益是国际危机管理中最重要变量	邱美荣(293)
边界功能视角的中印边界争端研究	邱美荣(297)
基于完全信息动态博弈的反恐设施选址模型	韩传峰, 孟令鹏, 张超, 孔静静(310)
后冷战时期宗教与国家安全的关联性讨论	刘 骞(319)
论民间宗教复兴对我国国家安全的影响	刘 骞(332)
论核恐怖主义与国际防范机制	夏立平(340)
论国际核安全体系的构建与巩固	夏立平(348)
国际格局演变中的当代中国周边外交环境	仇华飞(355)
北极环境变化对全球安全和中国国家安全的影响	夏立平(365)

一、经济与金融安全

远距离贸易、技术变迁与长期经济增长*

简 泽

摘要:改革开放以来,中国经济成功起飞,创造了世界经济发展史上的“中国奇迹”。然而,我们对中国经济起飞原因的认识主要集中在增长核算分析的基础上。本文的研究显示,在一个非线性增长的视角下,在经济转轨过程中,随着各个地区交通运输联系的改善,一些地区的远距离贸易和市场范围逐渐扩展。市场范围的扩展对经济增长的影响不是渐进的,它具有显著的门槛效应。在一些地区市场范围扩展门槛效应的作用下,中国经济从传统技术下的低收入均衡起飞到现代工业技术下的高收入均衡中。通过把市场范围扩展的门槛效应与中国经济增长的非线性行为联系起来,本文揭示了中国经济从贫困向现代经济增长起飞的一个重要驱动力量。

关键词:远距离贸易;门槛效应;经济起飞

0 引言

在整个近代史上,中国经济基本上是停滞的,在1820—1952年间,人均GDP还呈现下降的趋势。新中国成立后,尽管做出了巨大的努力,中国经济的增长仍然步履维艰:在1952—1978年间,人均GDP的年均增长率只有2.34%,低于同期世界平均2.56%的水平,中国GDP占世界生产总值的份额从1952年的5.2%下降到1978年的5%(林毅夫,2007)。然而,市场化改革以来,中国的人均收入水平以年均6.6%的速度高速增长,人均GDP从1978年的220美元大幅提高到2005年的1730美元,中国经济开始摆脱“马尔萨斯贫困陷阱”的束缚成功起飞,创造了世界经济发展史上的“中国奇迹”:按照世界银行每天消费1.25美元的贫困线标准计算,在1981年,中国84%的人口生活在贫困线以下,到2006年,这一比例下降到15.6%,在不到30年的时间里,6亿以上的人口摆脱了贫困(Lin and Wang, 2008)。

中国经济从贫困向现代经济增长的转变为我们提出了两个相互关联的问题:“贫困陷阱”为什么能够在那么长的时间里持续存在?近年来,中国经济是怎样摆脱“贫困陷阱”的束缚成功起飞的?这两个问题在理论和实践上都是重要的:一方面,从贫困向现代经济增长的转变是人类经济发展史上最重要的转变之一,因而对这些问题的理解是我们认识长期经济发展过程的关键(Lewis, 1956; Murphy, et al., 1989; Galor and Weil, 2000);另一方面,中国经济的发展在空间上是不平衡的,在东部沿海省份成功起飞的同时,中西部地区的一些省份仍然停留在贫困状态中,于是,理解发达地区经济起飞的机制能够为不发达地区促进起飞的政策提供有益的见解。

在现有的文献中,大规模的物质资本积累和生产效率的改善被认为是近年来中国经济

* 经济评论 2010(5)期收录。

高速增长的主要原因(Chow, 1993; Wang and Yao, 2003)。这些文献建立在增长核算的框架上,因而它们暗含假定转轨以来的经济增长是一个线性过程——除了全要素生产率的改善以外,国民经济的产出水平与其决定因素之间的关系是不变的。然而,在中国经济从贫困向现代经济增长转变的过程中,一些重要的变量,比如人均收入水平,表现出双峰分布和多重稳定状态的特征,生产的技术结构很可能发生了显著的改变。而且,在长期里,生产要素的积累和效率的改善是内生的,在这个意义上,物质资本积累和生产效率的改善是需要我们解释的现象,而不是解释本身。于是,我们需要探寻物质资本积累和生产效率改善背后更为根本的“基础要素”,以揭示中国经济从贫困向现代经济增长起飞的基本驱动力量。

在人类经济发展史上,从停滞向现代经济增长的起飞是通过工业革命实现的(Lewis, 1954; Murphy, et al., 1989; Galor and Weil, 2000),在发展经济学和现代经济增长理论的经典文献中,工业革命是具有较高生产率和规模报酬递增特征的大规模工业生产技术对规模报酬不变的传统小规模分散生产技术的替代(纳克斯, 1967; Murphy, et al., 1989; Parente and Prescott, 1994)。不过,这种替代不是自然发生的,它需要跨过经济发展的门槛(Murphy, et al., 1989; Azariadis and Allan, 1990; Goodfreind and McDermott, 1995):一方面,由于缺乏技术创新能力,一个尚未实现工业化的不发达经济可能面临技术供给的约束;另一方面,现代工业生产具有技术上的不可分性和规模报酬递增的特征,因此,当市场规模小于现代工业生产技术的最小临界规模时,工业化无利可图,经济停留在低生产率的传统技术中(Murphy, et al., 1989)。反过来,经济发展水平的落后又限制了技术的进步和市场规模的扩大。在这个循环积累因果机制的作用下,不发达经济锁定在贫困陷阱中(Myrdal, 1957)。

经济史的研究结果表明,中国经济的长期增长不是技术约束的:在英国进行工业革命的时候,中国已经掌握了推动工业革命的几乎所有的关键技术。而且,在随后的一个多世纪里,中国有机会和能力引进先行工业化国家发展起来的先进技术(Landes, 2006)。可是,这些技术并没有应用到生产活动中。^①在经济史学家看来,市场范围的扩大是一个社会从传统经济向现代经济增长转变的关键(吴承明, 2003; 赵凌云, 2003)。在中国经济史上,虽然早在明朝初年就开始出现稳定的市场和贸易,但是,由于缺乏交通运输基础设施把地理上分散的市场连接起来,高昂的运输成本使得贸易主要局限在大约 7 万个范围十分狭小的当地市场中:从 14 世纪中期到 20 世纪初,中国的省际贸易仅占国民产出的 5%~7%,国际贸易也只占国民产出的 1%~2%,以家庭作坊生产为基础的手工业对国民产出的贡献不超过 8%。在长达五个多世纪的时间里,省际的交通运输网络和远距离贸易几乎没有明显的改变。在市场范围受到严重限制并且各个地区的购买力水平十分低下的情况下,经济缺乏工业化的基本激励。于是,远距离贸易和市场范围的约束被认为是工业革命没有首先发生和迅速扩展到中国的重要原因(Reynolds, 1983)。

在从计划经济向市场经济转轨的过程中,通过经济领域各个方面的改革,中国经济发展的一些“基础要素”发生了重要变化:一方面,集市贸易和地方市场逐渐成长起来;另一方面,转轨期间独特的经济和政治制度激发了各级地方政府大规模的交通基础设施建设(张军等, 2007)。随着大规模基础设施建设形成的现代交通网络把地理上分散的地方市场连

① 这个问题存在不同的观点,强调技术供给约束的假说请参见林毅夫(2007)。

接起来,地区间的贸易自由度不断增加,远距离贸易逐渐发展,中国经济经历了重要的地区经济一体化过程(Bai, et al., 2004; Zhang, et al., 2008)。

本文把地区经济一体化过程中一些地区远距离贸易和市场范围的扩展与经济成长的门槛行为联系起来,在一个非线性增长的视角下,为中国经济从贫困向现代经济增长的转变提供一个新的解释性假说。我们的中心论点是,在地区经济一体化的过程中,一些地区的远距离贸易和市场空间范围逐渐扩展。然而,市场范围的扩展对经济发展的影响不是渐进的,它具有典型的门槛效应:当一个地区的市场范围较小从而市场规模低于现代工业生产技术的最低临界规模时,经济锁定在传统技术下低收入均衡的“贫困陷阱”中。然而,在地区经济一体化的过程中,当一些地区的市场规模随着地区间贸易自由度的增加和市场范围的扩展达到现代工业生产技术的最低临界水平时,引进和使用规模报酬递增的现代工业生产技术变得有利可图,从而激发了大规模的工业化,于是,这些地区相继从传统技术下低收入的增长均衡起飞到现代工业技术下高收入的增长均衡中,中国经济逐渐摆脱贫困陷阱的束缚,实现从贫困向现代经济增长的起飞。

在经验上,这个假说的核心含义是,一些地区市场空间范围扩展的门槛效应激发了中国经济从传统技术下的低收入政体向现代工业技术下高收入政体的起飞。把单一技术政体的生产函数嵌套在一个非线性的门槛回归模型里,我们发现,在地区经济一体化的过程中,贸易自由度和市场范围的扩展对经济发展具有显著的门槛效应。依据市场范围扩展的门槛效应,我们从近年来中国经济增长的统计数据中内生地识别出两个技术上存在显著差异的增长政体,非线性的两政体门槛回归模型不仅比单一政体模型具有更好地拟合和解释数据的能力,而且,两个政体的生产函数分别显示了传统技术下低收入增长均衡和现代工业技术下高增长均衡预期的技术特征。经验分析的结果表明,市场范围扩展的门槛效应激发了生产技术结构的显著变化,从而为我们的假说提供了系统的经验证据。

本文接下来的结构是这样的:第二部分提供一个基本背景;第三部分是一个简单的理论框架,从中演绎出本文的基本假说;第四部分介绍识别和检验假说的计量经济模型;第五部分报告实证分析的结果;最后讨论了研究结果蕴涵的理论和政策涵义。

1 背景与回顾

1978年以来,中国经济经历了市场导向的制度转型,通过经济领域各方面的改革,由家庭和企业组成的基本经济主体逐渐获得了独立的物质利益,并开始拥有生产和交换活动的经营自主权。随着基本经济主体开始在计划经济体制外依据以市场为基础的激励自主从事经济活动,集市贸易和地方市场逐渐成长起来。

在地方市场成长的过程中,中央政府逐步向地方分权,形成了独特的按行政区域进行资源配置的M型的经济结构(Dixit, Qian and Roland, 1998),地方政府开始具有独立的财政收入。在经济上分权的同时,中国的政治体制保持了相对集中的制度结构,中央政府一直保持着考核、奖惩和晋升地方官员的权力和能力。借助于这种集中的政治结构,中央政府在各级地方官员之间创造了以地方经济增长绩效为基础的“标尺竞争”(Li and Zhou, 2005)。在这个背景下,地方政府开始具备促进当地经济增长的激励。在转轨初期,落后的交通设施和昂贵(甚至是禁止性)的运输成本构成了各个地区经济发展的瓶颈。于是,为了

促进当地的经济增长,各级地方政府开始大规模地进行道路交通设施建设(张军等,2007)。改革开放以前,包括铁路、公路和机场在内的基础设施建设主要由中央政府以预算资金的方式提供。随着各个地区的地方政府开始大规模地投入以公路为主的交通运输设施建设,来自地方政府的预算外资金逐渐成为交通运输建设的主要资金来源,到1992年,预算外资金的比例增加到91%(Hayashi, et al., 1998)。地方政府大规模的交通运输建设极大地促进了交通运输网络的发展:在1978—2004年间,全国公路运输里程数从89.02万公里增加到187.07万公里,在二十多年的时间里增加了2.1倍。预算外资金的大量投入还使得中央预算资金可以集中配置在跨地区(尤其是跨省份)的铁路、民航和管道运输建设上。从1978—2004年,全国铁路运输里程数从5.17万公里增加到7.44万公里;全国民航运输里程数从14.89万公里增加到204.94万公里;管道运输也从0.83万公里增加到3.82万公里。随着现代交通运输网络把地理上分散的地方性市场连接起来,运输成本逐渐降低,地区间的贸易自由度不断增加,一些地区,特别是交通运输条件较好的东部沿海地区的市场空间范围逐渐扩展。这样,尽管转轨初期一些地区的地方政府采取了贸易保护主义政策,但是,随着地区间交通运输网络的发展,地区间的贸易联系还是显著增强了(张军,2005)。重要的是,随着地区间贸易联系的不断增强,一些地区的地方政府开始自愿成立协调组织、主动推动地区间的市场一体化进程(徐现祥,李郇,2005)。国务院发展研究中心组织的一项全国性调查结果表明,企业而非企业单位都认为,二十多年来地方保护主义的严重程度呈现逐步减轻的态势(李善同等,2004)。在这些物质技术和制度因素的共同作用下,转轨以来中国地区间的经济一体化处于不断加深的进程中(Bai, et al., 2004; Zhang, et al., 2008),从而极大地促进了以东部沿海省份为代表的一些地区远距离贸易和市场范围的扩展。

在地区经济一体化的过程中,以农村乡镇工业的异军突起为标志,一种新的生产模式——工厂体系迅速在交通运输条件比较好、远距离贸易比较发达的东部沿海地区成长,中国经济进入以大量工业企业的产生和快速资本积累为特征的工业化时期:在1985年,中国只有46.32万个工业企业。到1998年,中国工业企业单位数增加到797.46万个。中国经济的投资率在市场化改革初期大约在25%左右,随着大规模的工业化,固定资本形成一直保持显著上升的趋势,到2004年,投资率增加到44%的水平(吴敬琏,2005),同时,第二产业增加值占国内生产总值的比重从1980年的44.2%上升到53.0%,依据国民经济的产出结构,中国已经基本实现工业化(陈佳贵,黄群慧,2005)。

图1描述了1985—2004年间全国30个省份取对数后人均GDP水平的分布,它综合地反映了人均收入水平跨省份和跨时间的变化。该图直观地显示,对数刻度的人均GDP水平没有表现出正态分布的特征。偏度-峰度比或Shapiro-WilkW检验的结果表明^①,即使在1%的显著性水平上,我们也能够拒绝人均GDP水平服从正态分布的原假设。重要的是,这个非正态分布可以分解为两个正态分布的和:第一个正态总体围绕较低的期望人均收入水平6.7374分布,方差为0.5813,它包含样本69.4%的数据;第二个正态总体围绕较高的期望人均收入水平7.8084分布,方差为0.7380,它包含样本30.6%的数据。为了检验这种分解的合理性,我们用Pearson(1894)拟合优度检验方法对这个分解进行了正式的检验,

^① 偏度-峰度比检验卡方统计量的值为36.39,自由度为2, p 值为0.000;Shapiro-WilkW检验 z 统计量的值为5.989, p 值为0.000。

得到卡方统计量的值为 6.569 0。当自由度为 4 时,卡方分布 5%的临界值为 9.488,于是,我们不能拒绝人均 GDP 的分布可以分解为两个正态分布之和的原假设。人均 GDP 水平的双峰分布意味着,在 1985 到 2004 年间,经济增长很可能存在两个收入水平不同的稳定状态。因此,与这段时间发生的大规模技术变迁和工业化一致,一些省份相继从低收入政体起飞到高收入政体中,经济增长表现出典型的非线性特征。

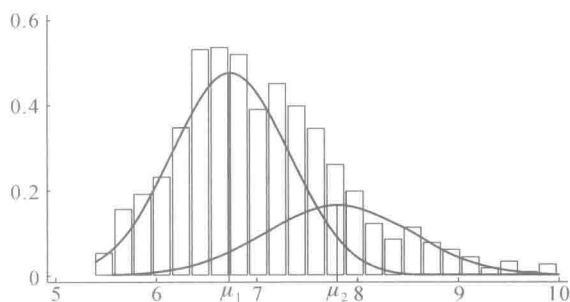


图 1 1985—2004 年间各省份人均 GDP 的分布

2 理论假说

在这个背景下,我们发展一个简单的概念框架,这个概念框架把近年来发生的地区经济一体化与中国经济从贫困向现代经济增长的起飞联系起来,从而在本部分的末尾形成一个新颖的解释性假说。

假定在我们考察的经济里存在两种生产技术:第一种技术是传统生产技术,它的生产分散在众多的家庭式手工业作坊中,生产率水平低并具有规模报酬不变的特征;第二种技术是现代工业生产技术,与传统技术比较起来,它具有更高的要素生产率,但是,不管生产多少,它必须首先投入较大规模的固定资本,固定资本的不可细分性使得大规模工业生产的技术表现出规模报酬递增的特征。

在标准经济增长理论的框架下,不同的生产技术对应不同的动态增长路径。在图 2 中,

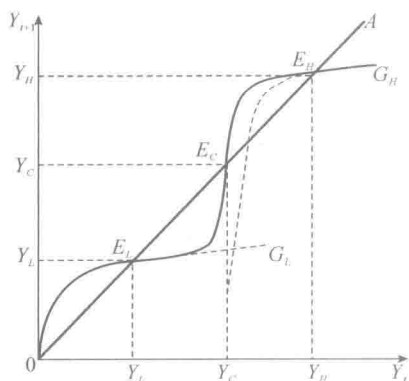


图 2 技术变迁、工业化与经济发展的轨迹

我们用横轴表示第 t 期的劳均产出水平,纵轴表示第 $t+1$ 期的劳均产出水平, OA 是从原点出发的 45° 线,两种技术下的增长函数分别用曲线 G_L 和 G_H 表示出来,因为现代工业生产技术具有更高的要素生产率,所以, G_H 位于 G_L 的右边。对于任何一条增长曲线,当它们位于 45° 线之上时,第 $t+1$ 期的产出水平高于第 t 期的产出水平,于是,地区经济呈现正的增长;相反,当它们位于 45° 线之下时,第 $t+1$ 期的产出水平低于第 t 期的产出水平,经济呈现负的增长。因此,增长曲线与 OA 的交点构成了经济增长的动态均衡。在图 2 中,传统技术条件下低要素生产率的动态增长路径 G_L 和现代工业生产技术下高要素生产率的动态增长路径 G_H 分别收敛

于低收入水平的增长均衡 E_L 和高收入水平的增长均衡 E_H 。

为了描述长期经济发展的轨迹,我们做出增长函数 G_H 和 G_L 的外包络线,这条 S 型的外包络线分别与 OA 相交于 E_L 、 E_C 和 E_H ,这意味着,在长期经济发展过程中,经济增长存在三个动态均衡。不过, E_C 是不稳定的: 当一个地区的收入水平低于 E_C 对应的收入水平 Y_C 时,经济存在向低收入均衡 E_L 移动的倾向; 反过来,如果一个地区的收入水平高于 Y_C ,那么,经济呈现正的增长,并最终收敛到高收入均衡 E_H 上。因为经济增长率的变化方向在 E_C 点发生突然的改变,即长期增长曲线在 E_C 处分岔,所以, E_C 成为一个地区从低收入传统经济向高收入现代工业经济起飞的临界点。

多个增长均衡和经济起飞临界点的存在意味着,长期经济增长是一个典型的非线性动态过程。因此,一个地区从贫困向现代经济增长的起飞必须跨过临界点,实现从传统技术下的低增长路径向现代工业技术下高增长路径的转换。在发展经济学和现代经济增长理论的经典文献中,从传统技术下的低增长路径向现代工业技术下高增长路径的转换构成了工业革命和经济起飞(纳克斯, 1967; Murphy, et al., 1989; Parente and Prescott, 1994)。

在图 2 中,工业革命和经济起飞依赖于一个地区的技术选择。一个地区的技术选择取决于两方面的因素: 一是现代工业生产技术的可获得性; 二是引进和使用现代工业生产技术的激励。通常,一个发展中经济可以利用后发优势从先行工业化国家中获得具有更高生产率的现代工业生产技术,于是,微观经济主体引进和使用现代工业生产技术的激励就成为一个国家或地区经济起飞的关键。

为了考察微观经济主体引进和使用现代工业生产技术的激励,我们假定代表性产品的传统生产技术和现代工业技术具有这样的形式: 传统技术的生产分散在众多的家庭式手工业作坊中,每个生产单位使用 $\alpha (\alpha > 1)$ 单位的劳动生产 1 个单位的产品; 现代工业生产技术掌握在一个现代工业厂商中,不管生产多少,它必须首先投入固定资本 K , 然后,使用 1 个单位的劳动生产 1 个单位的产品。由于众多手工业生产者的存在,在代表性产品市场的均衡状态,每个生产者的利润为零。如果我们用 W 表示劳动的工资率,那么,市场的均衡价格为 αW 。因为面临众多传统技术生产者的竞争,使用现代工业生产技术的厂商必须制定与传统生产者相同的价格。因为初始时刻固定资本 K 的投入,进入这个市场的现代工业厂商所获得的可变利润至少要能够补偿固定成本,即:

$$(\alpha W - W)Q^* = K \quad (1)$$

式中, Q^* 表示代表性产品的最小临界市场规模,从式(1)可以得到:

$$Q^* = K/(\alpha - 1)W \quad (2)$$

式(2)意味着,只有当市场规模大于 Q^* 时,微观经济主体才具有引进和使用现代工业生产技术的激励。于是,在最小临界市场规模的上下,长期经济增长过程存在两个稳定的均衡: 当市场需求规模小于现代工业生产技术的最低临界规模时,经济收敛到传统技术下的低收入均衡 E_L 。在这个均衡状态下,劳动生产率低,从而人均收入水平低,市场需求规模小。与规模报酬递增的现代工业生产技术比较起来,传统生产技术的生产者是生产者的理性选择,因此,经济锁定在低收入水平的“贫困陷阱”中; 相反,一旦市场规模大于现代工业生产技术的最低临界规模 Q^* ,引进和使用现代工业生产技术变得有利可图,微观经济主体开始引进

和使用现代工业生产技术。在工业化的推动下,经济系统起飞到高收入水平的增长均衡 E_H 。这意味着,实现从传统技术下的低增长路径向现代工业生产技术下高增长路径的转换必须打破市场规模的约束,跨过经济起飞的门槛。

一个地区的市场规模取决于人均收入水平、人口规模和市场空间范围。在经济锁定在低收入贫困陷阱中时,人均收入和当地人口的购买力水平受到传统技术下低劳动生产率水平的束缚,并且,在长期里,人口规模是内生的。因此,通过大规模的基础设施建设,兴修公路、铁路和运河把地理上分散的地方市场连接起来对于不发达经济市场规模的扩大具有十分重要的意义。在地理上,低收入经济的地方市场分散地分布在地理空间中,它们使用传统技术进行生产。如果用铁路、公路和天然水道将分散的地方市场连接起来,使得它们能够低成本地进行产品和要素的交换,那么,分散的地方市场便逐渐融合成一个规模更大的市场。一旦一些地区借助于市场空间范围的扩展达到现代工业生产技术的最小临界规模就会激发大规模的工业化。重要的是,工业化是自我加强的:现代工业生产技术的使用提高了劳动生产率和人均收入水平,扩大了当地的购买力和市场规模,从而反过来促进了进一步的工业化。在这种正反馈机制的作用下,这些地区逐渐打破传统经济的恶性循环,起飞到高收入水平的增长均衡中(Goodfreind and McDermott, 1995; 纳克斯, 1967)。

在近代中国经济里,尽管人口规模较大,但是,传统农业经济的劳动生产率和人均收入水平很低,单个地区的市场规模受到当地低购买力的严重限制。而且,低成本的铁路运输没有发展起来,中国经济长期处于自给自足的分割状态中,因而经济缺乏工业化的基本激励。转轨以来,随着各个地区大规模的交通运输建设和地区间远距离贸易的扩展,一些地区的市场空间范围逐渐扩展。市场空间范围的扩展对经济发展的影响不是渐进的,它具有典型的门槛效应:当一个地区的市场范围较小从而市场规模低于现代工业生产技术的最小临界规模时,使用具有规模经济特征的现代工业生产技术无利可图,经济锁定在传统技术下低收入均衡的“贫困陷阱”中。然而,在地区经济一体化的过程中,一些地区的市场范围逐渐扩展。当一些地区的市场规模随着地区间贸易自由度的增加和市场范围的扩展达到现代工业生产技术的最小临界水平时,引进和使用规模报酬递增的现代工业生产技术变得有利可图,从而激发了大规模的工业化。反过来,工业化推动了当地的经济增长和永久收入水平的提高,从而进一步扩大了当地的消费支出和市场需求规模。在工业化与市场规模扩大之间相互加强的正反馈机制作用下,这些地区相继从传统技术下低收入的增长均衡起飞到现代工业技术下高收入的增长均衡中,中国经济开始摆脱贫困陷阱的束缚,实现从贫困向现代经济增长的转变。

3 计量经济模型

在经验上,一些地区市场范围扩展的门槛效应激发的工业化和经济起飞意味着,在经济起飞过程中,中国经济存在两个不同的增长政体:一个是建立在传统技术基础上的低收入政体;另一个是大规模工业化进程中的高收入政体。本质上,经济起飞过程中不同增长政体之间的技术转换导致的非线性特征应该通过生产函数的差异表现出来。在现有的计量经济学方法中,生产函数的变化可以用非参数的计量经济学方法来考察,可是,这种方法不便于我们准确地识别和检验经济发展过程的“起飞点”。于是,我们采用具有典型结构特

征的门槛回归方法(Hansen, 2000),从一些地区市场范围扩展的门槛效应中识别近年来中国经济增长过程的“起飞点”,并通过估计“起飞点”上下不同增长政体的生产函数去考察它们的技术特征,从而在一个标准的计量经济程序下为我们的假说提供系统的经验证据。

具体地,我们的计量经济模型建立在一个扩展的生产函数上:

$$\begin{aligned} y_{it} &= \alpha_1 + u_i + v_t + \beta'_1 x_{it} + e_{it} & q_{it} < \gamma \\ y_{it} &= \alpha_2 + u_i + v_t + \beta'_2 x_{it} + e_{it} & q_{it} \geq \gamma \end{aligned} \quad (3)$$

这里,下标 i 和 t 分别表示省份和时间, y_{it} 表示取对数后的实际 GDP 水平, α 是模型的截距项, u_i 表示各省份不随时间变化的异质因素,它用来控制各个省份难以观察的制度差异、地缘经济和人文特征对当地产出水平的影响。 v_t 表示随时间变化但省际没有明显差异的同质因素,它用来控制经济周期性波动和宏观经济政策的变化对产出水平的影响。 x_{it} 是一组解释变量,它包括各个省份对数刻度的资本存量 k_{it} 、劳动使用量 l_{it} 和作为门槛变量的贸易自由度 q_{it} , β 是回归系数向量, e_{it} 是随机扰动项, γ 是门槛变量 q_{it} 的临界值。

在这个模型里,因为贸易自由度和市场范围的大小影响了一个地区的技术选择,所以,我们把它引入生产函数中。不过,市场范围的变化对经济增长的影响不是渐进的,它具有典型的门槛效应。在市场范围扩展门槛效应的作用下,经济增长可能出现两个不同的增长政体,即 $q_{it} < \gamma$ 时的传统增长政体和 $q_{it} > \gamma$ 时的工业化高收入政体。这两个政体通过技术的差异区别开来。这意味着,如果我们的假说在经验上是恰当的,那么,基于市场范围扩展的门槛效应,我们应该能够从近年来中国经济增长的统计数据中内生地识别出两个增长政体,这两个增长政体拥有显著不同的生产函数,高收入政体中资本和劳动的边际生产率应该明显高于低收入政体中资本和劳动的边际生产率,即 $\beta_2 > \beta_1$ 。自然地,如果市场范围扩展的门槛效应存在,那么,当 $q_{it} < \gamma$ 时,市场范围对技术的选择和采用不会产生重要影响,因而 q_{it} 的回归系数不应该具有统计上的显著性。相反,当 $q_{it} > \gamma$ 时,市场范围的扩展激发了技术变迁和工业革命, q_{it} 的回归系数应该大于零,并且统计上显著。

在统计上,这要求我们:(1)从经济增长的数据中内生地确定门槛变量 q_{it} 的临界值 γ ,并合理估计模型的回归系数;(2)检验门槛效应的显著性,即检验原假设 $H_0: \beta_1 = \beta_2$ 对备择假设 $H_1: \beta_1 \neq \beta_2$,从而帮助我们推断假说中预言的两种增长政体的存在是否具有统计上的显著性;(3)如果门槛效应是显著的,我们需要构建门槛值的一个置信区间;(4)比较 β_1 和 β_2 的大小,以衡量两种增长政体的技术效率差异。

按照 Hansen(2000)的方法,门槛变量 q_{it} 临界值 γ 应该使式(3)最小二乘估计的残差平方和 $S_1(\gamma)$ 最小,即:

$$\hat{\gamma} = \operatorname{argmin} S_1(\gamma) \quad (4)$$

在理论上,我们可以把门槛变量的各个观测值作为可能的门槛值逐一进行考察,以确定满足式(4)的门槛值。一旦门槛值确定下来,其他参数的最小二乘估计也随之确定了。

对市场范围扩展门槛效应的统计检验在计量经济学意义上等价于考察生产函数的结构是否因为门槛变量在门槛值上下的变化发生显著的改变,从而使模型表现出非线性特征。如果市场范围扩展的门槛效应不显著,那么,线性增长条件下单一政体的生产函数在统计上是适当的,即对所有的 q_{it} ,有:

$$y_{it} = \alpha + u_i + v_t + \beta' x_{it} + e_{it} \quad (5)$$

显然,模型(5)嵌套在门槛回归模型(3)之中,因而我们可以构造一个标准的 F 检验、LM 检验或似然比检验。然而,Hansen(2000)指出,由于在原假设 H_0 下门槛变量的门槛值是无法识别的,所以,检验统计量的分布随着样本的变化而变化,因而不具有标准的分布形式。Hansen(2000)认为,在原假设 $H_0: \beta_1 = \beta_2$ 下,我们可以构造一个似然比统计量:

$$L = [s_0 - s_1(\hat{\gamma})]/\hat{\sigma}^2 \quad (6)$$

式中, s_0 表示原假设下的残差平方和, $\hat{\sigma}^2$ 是备择假设下的残差方差。虽然这个统计量不服从标准的卡方分布,但是,我们可以利用“自助法”(Bootstrap)来获得它的渐进分布,具体程序是这样的:首先,估计门槛回归模型(3),计算模型的残差 e_{it} ,并将它们按省份分组得到 $e_i = (e_{i1}, \dots, e_{it})$;然后,估计模型(5),利用模型(3)和(5)的估计结果计算观察到的 L 统计量 L_A ;接下来,采用重复抽样的方法从经验分布 $\{e_{i1}, \dots, e_{it}\}$ 中抽取样本容量为 n 的样本(n 是截面个数),并把解释变量当作固定的回归元,在原假设下产生一个被解释变量的 Bootstrap 序列,从而得到一个自助样本;最后,利用自助样本估计模型(3)和(5),并计算模拟的 L 统计量 L_M 。重复上述步骤 200 次,模拟 L 统计量 L_M 超过观察值 L_A 的百分比就是 L 统计量 Bootstrap 程序下的渐近 P 值。这样,我们就能在一个标准的统计程序下检验市场范围扩展的门槛效应是否具有统计上的显著性。

一旦门槛变量的门槛值 γ 被识别出来并具有统计上的显著性,我们应该进一步构造它的置信区间。Hansen(2000)认为,构造门槛值置信区间的最好方法是找到门槛值似然比检验的一个非拒绝域,这个检验的原假设是 $H_0: \gamma = \gamma_0$,检验统计量为

$$LR_1(\gamma) = [s(\gamma) - s_1(\hat{\gamma})]/\hat{\sigma}^2 \quad (7)$$

这个统计量不服从标准的卡方分布,但是,Hansen(2000)推导出了准确的分布函数,并给出了该分布的渐近临界值。据此,我们可以非常方便地得到门槛变量的门槛值 γ 在特定置信度下的置信区间。

在这个基础上,我们可以估计两个政体的生产函数,利用估计出来的生产函数推断 β_1 和 β_2 的大小,以比较两个增长政体的技术效率差异。需要说明的是,如果经济发展过程存在显著的正反馈机制,那么,解释变量的未来值很可能与模型的随机扰动项相关,进而产生变量内生性问题。不过,考虑到正反馈机制的方向和时滞,被解释变量 y_{it} 不会对解释变量的当期和过去值产生影响,即模型的随机扰动项与解释变量的当期和各期滞后不相关。因此,模型(3)是序列外生的。这意味着,利用解释变量的滞后项作为工具变量可以降低变量内生性导致的偏误(伍德里奇,2007),进而通过模型估计结果间的比较帮助我们了解偏误的方向。特别地,这个模型的一阶差分允许我们使用内生解释变量滞后一期和两期的水平值作为其一阶差分的工具变量,并且,在经济意义上还能提供两个政体经济增长率差异源泉的动态信息,因而一阶差分估计量很有吸引力。

4 经验分析的主要结果

在这一部分里,我们报告经验分析的主要结果:首先,介绍我们使用的数据集和初步统