


中国政府支出 与经济增长

理论和实证研究

CHINA'S GOVERNMENT
SPENDING AND
ECONOMIC GROWTH
THEORETICAL AND
EMPIRICAL RESEARCH

© 张治觉 著




湖南人民出版社

中国政府支出 与经济增长

理论和实证研究

CHINA'S GOVERNMENT
SPENDING AND
ECONOMIC GROWTH
THEORETICAL AND
EMPIRICAL RESEARCH

© 张治觉 著



湖南人民出版社

图书在版编目 (CIP) 数据

中国政府支出与经济增长——理论和实证研究 / 张治觉著.

—长沙: 湖南人民出版社, 2008. 9

ISBN 978 - 7 - 5438 - 5423 - 9

I. 中... II. 张... III. 财政支出 - 关

系 - 经济增长 - 研究 - 中国 IV. F812.45 F124

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2008) 第 141733 号

中国政府支出与经济增长——理论和实证研究

作 者: 张治觉

出 版 人: 李建国

责 任 编 辑: 刘德华

装 帧 设 计: 周 云

出版、发行: 湖南人民出版社

网 址: <http://www.hnppp.com>

地 址: 长沙市营盘东路 3 号

邮 编: 410005

经 销: 湖南省新华书店

印 刷: 长沙富洲印刷厂

印 次: 2008 年 9 月第 1 版第 1 次印刷

开 本: 850 × 1168 1 / 32

印 张: 8

字 数: 188000

书 号: ISBN 978 - 7 - 5438 - 5423 - 9

定 价: 20.00 元

营销电话: 0731 - 2226732

(如发现印装质量问题请与承印厂调换)



（国家发展和改革委员会）国家发展和改革委员会
 国家发展和改革委员会
 国家发展和改革委员会
 国家发展和改革委员会
 国家发展和改革委员会

摘 要

我国目前正处于市场经济发展的初级阶段，市场机制还不成熟，所有在市场经济发展早期出现的市场失灵都不同程度地存在且具有中国特色。另外，市场基础还很薄弱，民间抵御市场风险的能力还很有限，市场经济发展所要求的各种软件（如制度、机制和文化）和硬件环境还不充分。因此，我国政府的职责范围要比市场经济已经成熟的发达国家的政府更为宽泛。科学界定政府支出的范围更能充分发挥政府在经济增长中的作用。同时，考虑政府支出的规模过大或者过小都会对经济增长产生阻碍作用，因此，确定政府支出的适度规模将对经济的发展产生更大的推动作用。国内外学者对以上两个问题展开大量的研究，但还有许多问题值得进一步研究。本书围绕上述两个问题进行展开，期待能够为政府调整支出结构和确定政府支出的最优规模提供理论指导。

本书在结构安排上共 10 章，第 1 章是导论部分，主要内容
 包括选题的背景和意义、研究的基本思路和方法、本书的结构
 和主要内容以及主要的创新之处。第 2 章是国内外文献综述部
 分。第 10 章是主要结论以及进一步研究的内容。其余的 7 章从
 四个方面研究政府支出与经济增长的关系。首先，建立一个理
 论框架分析政府支出与经济增长的关系。其次，从总量和结构
 上分析政府支出的经济增长效应。然后，实证分析了政府支出



的投资效应（对私人投资的引致或挤出效应）、居民消费效应（对居民消费的引致或挤出效应）、技术进步效应、产业结构效应、就业结构效应等。最后，通过理论模型和经验研究，确定了经济增长中中国政府支出的最优规模和结构。

第2章是国内外文献综述部分，首先，沿着经济增长理论的发展脉络对政府支出与经济增长的理论研究进行回顾，将理论发展分为两个阶段。第一阶段是政府支出与经济增长理论研究的奠基与形成阶段：从古典增长理论到新古典增长理论；第二阶段是政府支出与经济增长研究的成熟阶段：内生经济增长理论的形成与发展。然后，从六个方面回顾了有关政府支出与经济增长关系的经验研究。第一是政府支出总量与经济增长的关系；第二是政府支出总量与私人投资的关系；第三是政府基础设施建设支出与经济增长的关系；第四是政府教育支出与经济增长的关系；第五是政府支出与居民消费的关系；第六是政府支出的最优规模与经济增长的关系。最后对理论研究和经验研究方法进行了述评。

第3章建立一个理论框架来分析政府支出与经济增长的关系。首先从供给的视角分析政府支出的就业效应、投资效应和技术进步效应。其次，从结构的视角分析政府支出的居民消费效应、产业结构效应和就业结构效应。最后，从制度的视角分析政府支出的经济增长效应。本书主要分析了财政分权制度的经济增长效应和税式支出效应。

第4章从总量和结构上分析了政府支出的经济增长效应。首先，对我国政府支出的范围进行了重新界定；然后，利用指标法和HP模型法反映我国政府支出规模的变动和发展趋势，利用ARMA模型对我国政府支出规模进行了预测；其次，利用非线性模型、时变参数模型和面板数据模型从总量上研究政府支出的经济增长效应。从非线性模型的结果看，政府支出与经济增长之间的关系可以用三次多项式模型来拟合。从时变参数



模型的结果看,自1979年来政府支出对经济增长的贡献呈上升趋势,到1999年达到最大为4.976443,政府支出增长1亿元,国内生产总值增长4.976443亿元,在随后的几年间有所下降,但下降幅度不大。从面板数据模型的结果看,地区的政府支出对地区经济增长的影响有较大的差异,其中东部和中部地区(山东、江苏、河北等)的政府支出对地区经济增长的影响相对较大,而西部地区(西藏、青海、宁夏等)的政府支出对地区经济增长的影响较少。然后,利用时变参数模型研究政府支出结构的经济增长效应。1979~1992年(除1981年外)间政府投资性支出对国内生产总值的弹性为正;1993~2004年间政府投资性支出对国内生产总值的弹性为负;1984~1991年政府消费性支出对国内生产总值的弹性为负,其他年分为正。政府转移性支出在大多数年对经济增长产生正的效应。

第5章首先分析了政府支出总量的投资效应。在长期内政府支出对私人投资产生了引致效应,在短期内政府支出对私人投资产生了挤出效应,但挤出效应并不明显;在短期内外商直接投资对私人投资产生了引致效应,在长期内外商直接投资对私人投资产生了挤出效应;从总量上看,外商直接投资对私人投资产生的引致效应小于政府支出对私人投资产生的引致效应。其次,利用时变参数模型分析了政府支出总量对私人投资的动态效应,政府支出在1981年和1982年为负数,1983~1998年间对私人投资产生了引致效应,从1999年开始对私人投资产生了挤出效应。然后,分析了政府支出结构对私人投资的动态效应,研究表明政府消费性支出和转移性支出对私人投资产生了挤出效应,但效果不明显;政府投资性支出在长期内对私人投资产生了引致效应,但在短期内产生了挤出效应。最后,以私人投资为中间变量,利用VAR模型和SVAR模型分析了政府支出对经济增长的传导机制,通过比较发现,SVAR模型比VAR模型更能解释政府支出通过对私人投资产生作用从而促进经济



增长的传导机制的存在性。第6章首先分析了政府支出总量和结构的居民消费效应。不论是长期还是短期内，政府支出对居民消费产生了引致效应；不论是长期还是短期内，政府投资性支出和政府转移性支出对居民消费产生了引致效应；政府消费性支出在短期内对居民消费产生了显著的挤出效应，但长期挤出效应不明显。其次，利用时变参数模型分析了政府支出对居民消费的动态效应，研究表明1981~1994年间政府支出对居民消费产生了挤出效应，1995~2004年间政府支出对居民消费产生了引致效应；政府投资性支出在大部分年分对居民消费产生了引致效应（1981年除外）；政府转移性支出在所有年分对居民消费产生了引致效应；政府消费性支出在大部分年分对居民消费产生了挤出效应（1979、1980、1981年除外）。然后，利用面板数据模型分析了政府支出与居民消费的关系，发现江苏、安徽、福建、山东、河南、湖北等地区政府支出的居民边际消费倾向较高，新疆、青海、宁夏、广东等地区政府支出的居民边际消费倾向较低。最后，以居民消费为中间变量，利用VAR模型和SVAR模型分析了政府支出对经济增长的传导机制，通过比较发现，SVAR模型比VAR模型更能解释政府支出通过对居民消费产生作用从而促进经济增长的传导机制的存在性。

第7章首先分析了中国政府支出的技术进步效应。研究发现外商直接投资和政府支出对专利授权数量和发明专利数量的影响不显著；外商直接投资和政府支出对实用新型专利数量和外观设计专利数量的影响显著，并且政府支出对实用新型专利数量和外观设计专利数量的影响要大于外商直接投资；然后，将模型进行扩展，研究表明外商直接投资、政府教育支出对专利授权数量产生了不显著的正效应，政府科技投入对专利授权数量产生了不显著的负效应；政府教育支出和政府科技投入对发明专利数量产生了不显著的正效应，外商直接投资对发明专



利数量产生了不显著的负效应；外商直接投资对实用新型专利数量产生了显著的正效应，政府教育支出和政府科技投入对实用新型专利数量产生了不显著的正效应；外商直接投资、政府教育支出对外观设计专利数量产生了显著的正效应，并且政府教育支出对外观设计专利数量的影响大于外商直接投资，政府科技投入对外观设计专利数量产生了显著的负效应。最后，以技术进步为中间变量，利用 VAR 模型和 SVAR 模型分析了政府支出对经济增长的传导机制，通过比较发现，SVAR 模型比 VAR 模型更能解释政府支出通过对技术进步产生作用从而促进经济增长的传导机制的存在性。但是，政府支出通过促进技术进步从而影响经济增长的作用机制还没有理顺，这主要由于有很大一部分科技成果没有转化为生产力。

第 8 章首先从总量上分析了政府支出的产业结构效应。研究表明，无论是在长期内还是在短期内，政府支出都对我国产业结构的调整和升级产生了较大的促进作用，政府支出对我国产业结构的促进作用大于外商直接投资对我国产业结构的促进作用。从结构上分析，政府投资性支出都对我国产业结构的发展起了一定的促进作用，但影响不显著；政府消费性支出对我国产业结构产生了较大的促进作用；政府转移性支出对我国产业结构产生了负面影响。然后，从总量上分析了政府支出的就业结构效应。研究表明，政府支出对我国就业结构的变迁产生了显著的影响，政府支出规模的增加使得劳动力从第一产业和第二产业中转移到第三产业中来；外商直接投资的增加使得劳动力从第一产业中转移出来，分别转向第二产业和第三产业就业。同时发现，政府支出对就业结构的影响大于外商直接投资对就业结构的影响。

第 9 章首先拓展了巴罗模型和富塔格米模型，将政府投资性支出和消费性支出引入到生产函数中，同时考虑家庭和政府资源约束，最大化国家效用函数，建立最优经济增长模型，通



过严密的证明和推导得到政府投资性支出最优规模和消费性支出最优规模。然后,根据“巴罗法则”确定我国政府投资性支出的最优规模为占 GDP 的 8.5%,政府消费性支出的最优规模为占 GDP 的 21.7%。并计算了政府投资性支出的边际收益为 1.18,政府消费性支出的边际收益为 4.93,政府投资性支出的边际收益和政府消费性的边际收益都大于 1,说明政府投资性支出和政府消费性支出不足。所以,政府应该适度增加投资性支出的规模,调整投资性支出的结构。政府应该增加消费性支出用于自身的建设,进行一系列的体制改革,提高自身管理效率,为经济增长创造更好的平台。

关键词: 政府支出; 经济增长; 时变参数模型; 面板数据模型; SVAR 模型



目录

1	导论	(1)
1.1	时代背景	(1)
1.2	选题的意义	(3)
1.3	研究的基本思路和方法	(6)
1.3.1	研究的基本思路	(6)
1.3.2	研究的基本方法	(6)
1.4	结构及主要内容	(7)
1.5	本书的创新之处	(9)
2	政府支出与经济增长：理论和经验研究回顾	(11)
2.1	政府支出与经济增长理论研究回顾	(12)
2.2	政府支出与经济增长经验研究回顾	(20)
2.3	理论和经验研究方法述评	(34)



3 中国政府支出与经济增长——一个新的分析框架	(36)
<hr/>	
3.1 中国政府支出范围的界定	(36)
3.1.1 政府投资性支出的界定	(38)
3.1.2 政府消费性支出的界定	(40)
3.2 经济增长的影响因素	(41)
3.3 政府支出与经济增长——一个新的分析框架	(42)
3.3.1 政府支出的供给效应	(43)
3.3.2 政府支出的结构效应	(50)
3.3.3 政府支出的制度效应	(54)
3.4 小结	(57)
<hr/>	
4 中国政府支出对经济增长的整体效应	(58)
<hr/>	
4.1 中国政府支出规模及其结构的演进	(58)
4.1.1 中国政府支出规模的变动及发展趋势	(58)
4.1.2 中国瓦格纳法则的解析	(67)
4.1.3 中国政府支出结构发展变化的一般趋势	(68)
4.2 中国政府支出规模的趋势预测	(71)
4.3 中国政府支出总量的经济增长效应	(73)
4.3.1 政府支出与经济增长的非线性模型	(74)



4.3.2 政府支出与经济增长的时变参数模型	(75)
4.3.3 政府支出与经济增长的面板数据模型	(78)
4.4 中国政府支出结构的经济增长效应	(83)
4.5 小结	(89)
<hr/>	
5 中国政府支出的投资效应与经济增长	(91)
<hr/>	
5.1 中国政府支出的投资效应	(92)
5.1.1 变量的选择	(92)
5.1.2 命题的假设	(93)
5.1.3 分布滞后模型的建立与估计	(95)
5.1.4 中国政府支出对私人投资的动态效应	(100)
5.2 中国政府支出结构的投资效应	(103)
5.2.1 中国政府支出结构与私人投资的协整分析	(103)
5.2.2 中国政府支出结构对私人投资的动态效应	(107)
5.3 中国政府支出、私人投资对经济增长的动态冲击效应	(108)
5.3.1 政府支出、私人投资与经济增长——基于VAR模型的分析	(109)
5.3.2 政府支出、私人投资与经济增长——基于SVAR模型的分析	(117)



5.3.3 政策建议	(126)
5.4 小结	(127)
<hr/>	
6 中国政府支出的居民消费效应与经济增长	
	(129)
<hr/>	
6.1 中国政府支出的居民消费效应	(130)
6.1.1 政府支出与居民消费的协整分析	(131)
6.1.2 政府支出结构与居民消费的协整分析	(132)
6.2 中国政府支出对居民消费的动态效应	(135)
6.2.1 政府支出总量对居民消费的动态效应	(136)
6.2.2 政府支出结构对居民消费的动态效应	(137)
6.3 中国政府支出与居民消费——基于面板数据模型的分析	(139)
6.4 中国政府支出、居民消费对经济增长的动态冲击效应	(143)
6.4.1 政府支出、居民消费与经济增长——基于VAR模型的分析	(144)
6.4.2 政府支出、居民消费与经济增长——基于SVAR模型的分析	(151)
6.4.3 政策建议	(158)
6.5 小结	(160)



7	中国政府支出的技术进步效应与经济增长	(162)
7.1	中国政府支出的技术进步效应	(164)
7.1.1	简单线性回归模型的建立	(164)
7.1.2	简单线性回归模型的估计和检验	(166)
7.1.3	简单线性回归模型的扩展	(168)
7.2	中国政府支出、技术进步对经济增长的动态冲击效应	(170)
7.2.1	政府支出、技术进步与经济增长——基于VAR模型的分析	(170)
7.2.2	政府支出、技术进步与经济增长——基于SVAR模型的分析	(177)
7.2.3	政策建议	(183)
7.3	小结	(185)
8	中国政府支出的结构效应	(186)
8.1	中国政府支出的产业结构效应	(186)
8.1.1	政府支出与产业结构的关系模型	(187)
8.1.2	模型的扩展	(189)
8.1.3	模型的进一步改进	(191)
8.2	中国政府支出的就业结构效应	(194)
8.2.1	政府支出与就业结构的关系模型	(197)
8.2.2	模型的进一步改进	(200)



8.3 小结	(203)
<hr/>	
9 中国政府支出规模和结构的优化与经济增长	
9.1 最优的经济增长模型	(204)
9.1.1 巴罗模型	(205)
9.1.2 富塔格米模型	(206)
9.1.3 巴罗模型和富塔格米模型的推广	(206)
9.2 经济增长中最优政府支出规模的估计	(211)
9.3 小结	(217)
<hr/>	
10 主要结论与进一步研究的内容	(218)
<hr/>	
10.1 主要结论	(218)
10.2 进一步研究的内容	(220)
<hr/>	
参考文献	(222)
<hr/>	



中国中，不整经济结构全齐登齐。煤炭行业委会并移煤商主
 登除同利同商时管进承五训如，一女村齐登最宽的大景界世改
 要训如。升重的全安齐登案国作集，修修输商，舞舞最宽麻齐
 兵火总市林港空视如群武更期大量，蒲期由自许数跳我更联
 出支视如空界学样县一第1：导论我齐舞聚心，①用齐中
 训如想创同不的舞武齐登齐了宝齐世得如兵火总市。同商
 血齐登齐，齐舞由济博更案齐登团美照选，同不县责期由
 齐舞团商由出支共公商空齐由更责理如训如，想同不的齐
 齐舞县要主责理如训如，想同早的舞武齐登齐。同不县用
 ，商舞版基共公麻业齐商基商要需视得舞齐主麻齐主再会并改
 齐舞县友，齐舞代人麻齐同更以齐舞齐主上，齐舞舞齐，商舞
 限中的齐舞齐登齐。1.1 时代背景

1.1 时代背景

我国目前正处于市场经济发展的初级阶段，市场机制还不成熟，所有在市场经济发展早期出现的市场失灵都不同程度地存在且具有中国特色。另外，市场基础还很薄弱，民间抵御市场风险的能力还很有限，市场经济发展所要求的各种软件（如制度、机制和文化）和硬件环境还不充分。因此，我国政府的职责范围要比市场经济已经成熟的发达国家的政府更为宽泛。具体来说，在现阶段，我国政府还不得不承担大量的、在发达市场经济国家可以通过市场解决而在中国还必须由政府承担的经济建设、培育与完善市场体系、弥补市场失灵和市场缺陷的任务。如政府要为经济和社会发展提供如道路、运输系统、卫生系统以及司法和人力资本开发等基础产业和公共基础设施。同时，我国还是一个处于经济转型、体制转轨的发展中大国，政府一方面必须承担各种改革和社会转型成本，防止经济和社会的过度振荡，另一方面还必须投入大量的精力和财力用于调节地区发展差距、构建社会保障系统以及支持教育、科学和卫



生福利等社会事业的发展。在经济全球化的新形势下，中国作为世界最大的贸易经济体之一，政府还承担着协调国际间的经济和贸易摩擦、调解纠纷、维护国家经济安全的重任。政府要想更好地履行自己的职能，最大限度发挥政府在弥补市场失灵中的作用^①，必须解决好两个问题：第一是科学界定政府支出的范围。市场失灵的阶段性决定了在经济发展的不同阶段政府的职责是不同的。按照美国经济学家罗斯托的研究，在经济成长的不同阶段，政府的职责及由此决定的公共支出的范围和作用是不同的。在经济发展的早期阶段，政府的职责主要是尽快为社会再生产和生活提供所需要的基础产业和公共基础设施，如道路、运输系统、卫生系统以及司法和人力投资，这是促进经济起飞到经济发展的中期阶段所必需的。在经济成长的中期阶段，政府的职责主要是消除外部性、克服垄断、提供公共产品，政府投资主要是对私人投资增长的补充，以弥补市场经济的不足。在经济达到成熟阶段，政府的职责转向收入分配的调节、构建社会保障系统以及支持发展教育、保健和福利等。在这一阶段，政府支出中用于社会保障和收入再分配政策的社会消费性支出比用在其他方面的支出有更大的增长。因此，我们必须根据经济发展的阶段及时调整政府支出结构，使政府能够很好地履行自己的职责。第二是确定政府支出的适度规模。在市场经济体制下，满足社会需要的两个系统：一是市场；二是政府。市场提供私人商品，政府提供公共产品。这样，一国在一定时期内创造的新增价值就由私人部门和政府部门分别支配一部分。于是，如何在私人 and 政府之间合理分配社会新增价值，即如何确定一国政府支出的规模，就成为一个很重要的问题，它关系到国民经济的发展和社会的稳定。政府支出规模过大或

^① 当市场失灵时，政府应该运用财政政策手段来对经济活动进行干预，财政政策手段主要有两个：税收与政府支出，本书的研究只涉及政府支出，没有将税收纳入分析框架。