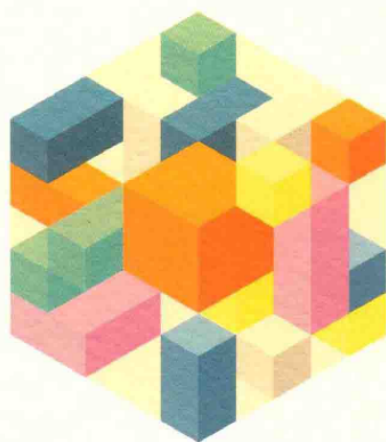


A Research on Curb of Commodities Speculation Based on
Measure of People's Livelihood Burden

基于民生负担测度的 抑制商品投机研究

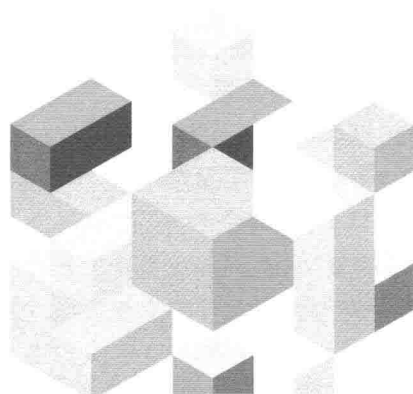
吴 军 著



A Research on Curb of Commodities Speculation Based on
Measure of People's Livelihood Burden

基于民生负担测度的 抑制商品投机研究

吴 军 著



图书在版编目(CIP)数据

基于民生负担测度的抑制商品投机研究/吴军著. —上海:上海财经大学出版社, 2019. 5

ISBN 978-7-5642-3177-4/F · 3177

I. ①基… II. ①吴… III. ①商业投机-研究-中国 IV. ①F713

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2018)第 291838 号

□ 责任编辑 石兴凤

□ 封面设计 贺加贝

基于民生负担测度的抑制商品投机研究

吴 军 著

上海财经大学出版社出版发行
(上海市中山北一路 369 号 邮编 200083)

网 址: <http://www.sufep.com>

电子邮箱: webmaster@sufep.com

全国新华书店经销

江苏凤凰数码印务有限公司印刷装订

2019 年 5 月第 1 版 2019 年 5 月第 1 次印刷

710mm×1000mm 1/16 17 印张(插页:2) 314 千字
定价:68.00 元

前 言

自古以来,民生问题都是国之计、民之本,是国家长治久安的基础,是百姓关心的重要问题,是政府工作的重要责任。

自中国改革开放以来,随着经济的飞速发展,人民的生活水平不断提高,中国在短短的几十年里一跃成为世界第二大经济体(2014 年以购买力平价计算,为世界第一大经济体)。但与高速增长的经济相伴而来的房价螺旋上升,“‘蒜’你狠”“‘豆’你玩”“‘姜’你军”等商品的价格波动加剧等现象均使得民众的生活成本增加,幸福度降低。面对不断来袭的投机事件,政府虽然屡次出台政策实施宏观调控,但这些措施往往是“亡羊补牢”,收效甚微。当前政府还缺乏一个全面的侦测和预警体系以对民生品投机进行防范,及时地控制潜在的民生品投机风险。

本书的核心是“三个盒子”模型,笔者从现象到本质创新性地构建了民生品盒子、投机品盒子和民生负担盒子,并抽象出了“三个盒子”的 9 个特征——功能、时间、空间、存储、持有成本、交易成本、生产成本、企业利润、消费杠杆。基于“三个盒子”模型的这九个维度,再考虑资金青睐问题,探索建立一套防范民生品投机的预警与监测机制。这套机制由封闭式和开放式两个环节组成。在封闭式模型中,本项目的研究对象选取了 CPI 篮子包含的 8 类商品和“商品住宅”体现民生,通过比较不同时点研究对象的各维度位置和趋势给出静态和动态的预警,并提出一套基于民生品本质属性的抑制投机方案作为政策储备。总体而言,民生品一旦在几个盒子中被定位,政府就应该对民生属性最强的商品给予最多关注,对投机属性最强的商品给予最多调控,对民生负担属性最强的商品给予最多预警,对综合属性最强的商品给予立即抑制。在开放式模型中,本书主张通过自由式的放开研究对象,由受访者的主观感受出发给出被投机的商品并基于此做动、静态分析,使其与封闭式模型构成互补并相互印证的研究体系。本书对“三个盒子”模型进行的实证分析通过访谈和网络问卷进行。项目的调研结论是,就类别来看,现阶段中国投机资金最青睐的是居住类和食品类民生品,并针对抑制该类民生品投机给

出了相应的政策储备。同时,调研结果显示,在更宏观的政策调控方面,国家不必针对中、东、西部地区做出区别性对待,但应区分大、中、小城市进行分类调控。

在“三个盒子”模型之外,本书在大框架上通过构建基于预期转向的供需模型、基于博弈的政府责任模型、基于货币投机职能的一般均衡模型分别辅助“三个盒子”模型从民众微观决策到政府工作责任,再到宏观产业均衡进行了一般性分析,并使用了国家统计局的数据进行对比印证,以从更多角度揭示民生品投机现象,从更多层面探讨民生品投机之源,从更广义的维度储备抑制民生品投机方案。

目 录

前言/1

第1章 综述/1

- 1.1 研究背景/1
- 1.2 研究意义/2
 - 1.2.1 理论意义/2
 - 1.2.2 现实意义/3
- 1.3 文献述评/4
 - 1.3.1 与民生(品)相关的问题/4
 - 1.3.2 与商品投机相关的问题/8
 - 1.3.3 与政府职能相关的问题/14
 - 1.3.4 与货币职能相关的问题/22
 - 1.3.5 文献评价/24
- 1.4 研究目标与研究框架/25
 - 1.4.1 研究目标/25
 - 1.4.2 研究框架/25
- 1.5 研究方法/28
- 1.6 创新点与工作难点/28
 - 1.6.1 创新点/28
 - 1.6.2 工作难点/29
- 1.7 本章小结/30

第2章 相关概念厘定/31

- 2.1 民生(品)相关概念厘定/31
 - 2.1.1 民生、民生品相关概念/31
 - 2.1.2 本项目创新性民生(品)特性解释/32
- 2.2 投机(品)相关概念厘定/34

- 2.2.1 投机(品)概念/34
- 2.2.2 本项目创新性投机(品)特性解释/35
- 2.3 民生负担相关概念厘定/38
 - 2.3.1 民生负担概念/38
 - 2.3.2 本项目创新性民生负担特性解释/38
- 2.4 其他相关核心概念厘定/40
- 2.5 本章小结/41

第3章 基于供求和预期的民生负担分析/42

- 3.1 供需模型构建/42
- 3.2 理性预期模型/43
 - 3.2.1 基于理性预期的模型分析/43
 - 3.2.2 理性预期下方程含义的解读/44
- 3.3 适应性预期模型/46
 - 3.3.1 基于适应性预期的模型分析/46
 - 3.3.2 适应性预期下方程含义的解读/46
- 3.4 本章小结/50

第4章 基于内在属性测度的民生负担分析/51

- 4.1 研究标的/52
- 4.2 静态民生负担测度体系的封闭式分析框架/52
 - 4.2.1 民生品盒子介绍/53
 - 4.2.2 投机品盒子介绍/54
 - 4.2.3 民生负担盒子介绍/55
 - 4.2.4 三个盒子九个纬度的权重和资金青睐度/57
 - 4.2.5 静态测度体系的数据分析方法/58
 - 4.2.6 针对静态测度体系的抑制民生品投机备择方案分析/59
- 4.3 静态民生负担测度体系的开放式分析框架/62
 - 4.3.1 运作原理/62
 - 4.3.2 静态民生负担测度体系的开放式分析框架的开放对象/62
 - 4.3.3 针对静态民生负担测度体系开放式分析框架的建议/63
- 4.4 动态民生负担监测体系的封闭式分析框架/63
 - 4.4.1 运作原理/64
 - 4.4.2 两次监测时的情况/64

4.4.3	多次监测时的情况/65
4.5	动态民生负担监测体系的开放式分析框架/65
4.6	本章小结/65
第5章 基于数据调研的民生负担分析/67	
5.1	民生负担静态测度体系及动态监测体系问卷设计/67
5.1.1	封闭式问卷设计/69
5.1.2	开放式问卷设计/69
5.2	问卷发放工作/70
5.3	基本数据汇报/70
5.4	民生负担体系全样本数据汇报/72
5.4.1	封闭式问卷全样本数据汇报/72
5.4.2	开放式问卷全样本数据汇报/74
5.5	民生负担静态测度体系数据分类统计汇报/75
5.5.1	封闭式数据分类汇报/76
5.5.2	开放式数据分类汇报/106
5.6	民生负担动态监测体系数据分类统计汇报/108
5.6.1	封闭式数据分类汇报/108
5.6.2	开放式数据分类汇报/114
5.7	典型案例分析——以上海市为例/115
5.7.1	上海市封闭式数据汇报/115
5.7.2	上海市开放式数据汇报/120
5.8	数据分析及相关建议/120
5.8.1	民生负担体系全样本数据分析及建议/121
5.8.2	民生负担体系分区域数据分析及建议/138
5.8.3	民生负担体系城市规模数据分析及建议/144
5.8.4	针对上海的典型案例分析/151
5.9	本章调研关键数据与权威数据的对比结论/154
5.10	本章小结/156
第6章 基于博弈均衡的政府民生责任分析/157	
6.1	博弈模型构建基础/157
6.2	政府与投机群体博弈的短期分析/158
6.2.1	概念假设与模型表述/158

- 6.2.2 政府以概率 P 监测到投机群体投机时的博弈分析/160
- 6.2.3 政府承担抑制投机失败责任时的博弈分析/161
- 6.3 政府与投机群体博弈的长期分析/162
- 6.4 本章小结/165

第7章 基于货币投机职能的产业均衡分析/166

- 7.1 实体经济、虚拟经济与货币/166
 - 7.1.1 实体经济与虚拟经济的划分依据/166
 - 7.1.2 货币的传统交易职能和现代投机职能/167
- 7.2 不考虑货币的投机职能时的静态产业均衡模型/169
 - 7.2.1 两部门供求关系描述/169
 - 7.2.2 福利函数描述/170
 - 7.2.3 模型分析/170
 - 7.2.4 经济结构均衡实现的条件/172
 - 7.2.5 产业结构均衡下的经济描述/173
- 7.3 加入货币投机职能后的动态产业均衡模型/174
 - 7.3.1 描述性分析/174
 - 7.3.2 考虑货币投机职能的分析/176
 - 7.3.3 基于虚拟层面的广义货币流通速度分析/178
 - 7.3.4 基于实体层面的投机边际效率动态分析/182
- 7.4 本章小结/184

第8章 总结与展望/186

- 8.1 总结/186
- 8.2 展望/187

参考文献/189

附录1 调查问卷/198

附录2 问卷全样本统计汇总/203

附录3 问卷一、二、三分项目封闭式数据统计汇总/214

第 1 章

综 述

1.1 研究背景

自古以来,解决民生问题都是国之计、民之本,是国家长治久安的基础,是百姓关心的重要问题,是政府工作的基本着力点。

改革开放以来,中国经济一直以强劲的势头增长,2010 年成为世界第二大经济体。2014 年,国际货币基金组织和世界银行按照“实际”价值测算,中国已经成为世界第一大经济体。

但是与中国经济增长不匹配的是中国的民生问题依旧突出,民生品投机行为屡见不鲜。近年来,中国的商品住宅价格扶摇直上。同时,“‘蒜’你狠、‘豆’你玩、‘姜’你军”,你方唱罢我登场,掀起一次又一次的商品投机浪潮。此起彼伏的商品投机行为严重影响着人们的正常生活,部分城市家庭继住不起房、租不起房之后,还要面临生活必需品价格宽幅波动的窘境。

针对以上问题,政府出台了一系列抑制投机的措施,但收效甚微。房价依旧昂首向上,“‘辣’翻天、‘糖’高宗、‘煤’超疯”一次次地冲击着人们的正常生活。

实际上,当下政府处在一个两难境地:一方面,维持经济增长和保持经济活力,要有充裕的资金并保证其流动性;另一方面,一旦资金过剩,由此导致的流动性会促进投机产生,影响民众的正常生活。那么,如何处理好充裕资金的流动性和投机行为的关系,就成了政府不得不面对的课题。

究症结之所在,解问题之根源。投机的泛滥与政府对投机行为的意愿、采取的方式与约束力度有直接关系。首先,投机行为部分地反映了资金的充裕程度和经济活力,因此,在当前政府以追求经济增长为主要目标的大背景下,投机行为引

致的民生问题在某些地方政府眼里变得次要。其次,当前并无全面、有效的民生品价格监测与预警体系,政府无法防患于未然,即使是政府想要对民生品投机行为有所动作,也无从提前下手,而只能是事后的“亡羊补牢”。再者,就现行的政策来看,政府在抑制投机的过程中对已通过投机获利的群体基本上既往不咎,这也进一步导致靠投机暴富的投机者可把其投机资金从一个领域转向另一个领域,引起商品价格轮番上涨和消费者恐慌,扰乱生产者的生产计划。政府的这种处理方式实际上是部分地默认投机的合理、合法性,这虽然增强了市场活力,但也潜在地鼓励了商品投机行为,造成了社会公众即便不是为了一夜暴富,但为了自己的资产保值,也要加入投机的队伍中去。投机成风,真正能保证经济持续增长的实体经济却不能因此获得所需要的长期资金,这从长远看必定会侵蚀中国的经济增长,危害社会稳定。

因此,如何引导政府主动关心民生问题,在民生问题和增长问题冲突时找到一套较好的机制对两者进行平衡,“防患于未然”,尽可能地建立一套侦测及预警机制成了当务之急。我国民生品投机愈演愈烈的原因,一方面是因为政府在民生和增长的权衡上顾此失彼,另一方面也的确缺乏这样一套机制来将投机行为扼杀在萌芽状态。国内外相关学者的研究给出的投机预警的方案一般是针对某一类商品,例如房地产、粮食等,没有将所有民生品纳入一个完整的侦测及预警系统中。这样的侦测及预警体系成本高、收效低、适应性差。因此,建立一套完善、可行的民生负担测度和预警机制,并储备一套相机抉择的抑制投机的方法势在必行。一个有效的预警机制能够妥善地分辨具有流动性与投机性的资金,将市场行为约束在一个合理可控的范围之内。

因此,本书计划基于民生负担测度,建立一个针对民生品被投机现象的普遍适用的、较为全面的侦测和预警框架,并基于对此框架的数据分析提出可供政府相机抉择的抑制商品投机并保持经济活力的政策路径。

1.2 研究意义

1.2.1 理论意义

民生问题一直都与民众的生活密不可分,伴随着以人为本理念的深化,更是成为当代的重要话题,对于我们和谐社会的发展有着重要的意义。但成体系的民生问题及与民生品相关的问题的研究框架和模型并不多见,关于民生品投机问题的研究更是稀有。如何准确地了解民生状况和测度民生负担,给广大的社会学、

经济学学者提出了很大的挑战,是具有重要理论意义的新课题。

随着世界经济的发展,许多国家都出现过投机活动。由于投机行为会对一个经济体的平稳运行带来很多负面影响,因此相关专家、学者对于投机现象的研究不在少数,但是关于投机现象对人们生活带来的负担测量方面的文献却比较鲜见。本书基于对民生负担的测度,研究了商品投机的后果强弱,并根据衡量民生负担的几个维度提出了相应的抑制商品投机的对策方案。本书将民生问题的研究和投机行为的研究有机结合,从民生负担测度角度分析了商品投机的研究,并利用民生负担监测体系对可能发生的投机行为进行预警与防范。

长期以来,对于民生品的界定成为学术界的难题,大多数学者都给民生品下过一个抽象的定义,这就难免导致定义过于宽泛,在实际界定时存在分歧。笔者(2011)^①将民生品分为广义民生品和狭义民生品,将对于百姓生活最重要的柴米油盐与烟酒奢侈品区分开,使对民生品的界定具有了更多实际意义。而本书采用的模型“三个盒子”中的“民生品盒子”又为民生品的界定提供了一种新的思路,即将所有商品均视为具有一定的民生属性,通过对不同维度赋值的方法将其民生属性量化,只讨论商品民生属性的强度,由此将民生品界定中“是与否”的问题转化为“强与弱”的量化指标,从而解决了民生品的定义难题。

此外,关于民生负担测度的研究多数集中在民生水平体系的建立上,而且多数是将测度进行量化或排序设置优先级,如“幸福指数”“HDI 指数”“PQLI”等(袁国敏,2011),并未见利用空间直角坐标系来形象、立体地展现民生负担和投机行为。因此,在研究模型时,本书也增加了相关领域的研究方法,具有多样性。

同时,关于投机对象的研究多集中在房地产市场、外汇市场和股票市场,尤其对于房地产市场的研究国内外均有很多,但少有延伸至商品市场特别是民生品市场范畴的,所以本书在研究投机对象方面具有特殊意义。

总体而言,本课题构建了与民生品问题相关的研究框架,创新性地提出了“三个盒子”模型,阐释了民生品、投机品及民生负担的本质特征,从“三个盒子”的九个维度浓缩了民生品投机及民生负担的基本维度,并基于此形成抑制民生品投机问题的框架,为学者们的进一步深化研究提供了一个新的思路,为进一步的定量研究提供了框架和基础。

1.2.2 现实意义

民生问题的解决程度关系到社会进步程度甚至政权的兴亡,但民生问题在中

^① 该文章为本项目的阶段性研究成果,其主要内容发表于2011年。

国历史长河中很少受到持续长久的真正重视。改革开放以来,民生问题受到普遍关注。中央领导人多次明确提出要把是否有利于提高人们的生活水平作为判断是非得失的重要标准。以习近平同志为核心的党中央领导集体更是将民生问题作为工作的重中之重。可见,对于民生问题的重视和研究,对国家迈向现代化的全新发展阶段有着重要的现实意义。

与此同时,近年来物价不断攀升,各类投机现象此起彼伏,扰乱了经济的平稳发展,给人们的生活带来诸多不利影响。其中对于民生必需品的投机更是严重地影响了人们的生活质量,若任其发展,则可能动摇国之根基。解决好民生必需品的投机问题,对于弘扬十八大所提倡的稳步发展和全面建设小康社会的精神就显得尤为重要和迫切。

然而,在理论和现实中,经济增长和物价稳定被作为经济体追求的重要目标总是存在着复杂的取舍关系。所以经济政策制定者在不打压经济增长的情况下抑制投机是存在很大难度的。若解决好这一复杂难题,则将对经济体的健康发展及人们生活质量的提高产生很大帮助。本书旨在为政策制定者提供打击商品投机的思路,针对商品本身被投机的特性提出相应的解决办法,使政策的制定更有目标性和前瞻性。

此外,关于民生体系指标的建立十分需要反映公众的感受,因为民生指标的建立归根结底是为了更好地了解民众的生活状况,更好地服务民众生活,所以应当展开专项调查,将民众的主观感受量化并纳入民生指标体系中(民生统计研究课题组,2010)。而本书所用模型的数据正是通过问卷调查,请普通民众根据自己的感受作答,从而将民众的主观因素反映在结论之中,使得结论更贴近民众的切身体会。

1.3 文献述评

国内外关于本课题的相关研究非常稀少,但把本课题的关键词分解并结合本书将要使用的分析主题和方法后,主要存在以下几类关联度不是很强的文献。本课题试图把这几类文献有机糅合在一起,借鉴相关领域的研究成果,形成一套系统、全面的抑制民生品投机的侦测体系和解决方案。这几类文献为:(1)以民生(品)为主题的文献;(2)以投机为主题的文献;(3)与政府职能相关的问题;(4)与货币职能相关的问题。

1.3.1 与民生(品)相关的问题

就研究范畴来看,有关民生方面的研究多集中在对于民生、民生品的定义和

民生评价指标体系的建立上。尤其是近几年,随着国家层面对民生重视程度的提升,相关的研究成果也不断地涌现。

1.3.1.1 民生和民生品

了解民生及民生品的概念是解决民生问题的前提,对该问题的研究可谓非常广泛。

“民生”一词最早的出处是在《左传·宣公十二年》中“民生在勤,勤则不匮”,此后中国传统上对民生的理解多体现为百姓的生计。何景明(明朝)的《应诏陈言治安疏》中提道:“民生已困,寇盗未息,兵马弛备,财力并竭。”章炳麟在《馥书·商鞅》中写道:“国政陵夷,民生困敝,其危不可以终一哺。”1924年,孙中山先生在《民生主义》中给“民生”制定了详细的含义:“民生就是人民的生活,社会的生存,国民的生计,群众的生命。”“民生就是政治的中心、经济的中心和种种历史活动的中心。”“民生是社会一切活动的原动力。”《辞海》中对于“民生”的解释是“人民的生计”,老百姓的生活来源问题。

从古至今,有关民生的涉及说明了民生的重要性。民生既强调了生存条件,又强调了生活质量。民生是指人的全部生存权和普遍发展权。从需求角度看,民生是指与实现人的生存权利有关的全部需求和与实现人的发展权利有关的普遍需求,最后也是党和政府实施政策的最高准则。具体而言,民生问题主要涉及就业、教育、分配、社保以及稳定几大方面。其中,就业是民生之本、教育是民生之基、分配是民生之源、社保是民生之依、稳定是民生之盾(十六大报告)。十七大报告指出,“必须在经济发展的基础上,更加注重社会建设,着力保障和改善民生,努力使全体人民学有所教、劳有所得、病有所医、老有所养、住有所居,推动建设和谐社会”。构建和谐社会,就是要把民生问题作为重中之重,让广大人民群众有活干、有学上、有饭吃、有衣穿、有屋住、病有医、老有养、生活幸福,都过上好日子。十八大报告具体地论述了教育、就业、收入、社保、医疗这五个与人民群众关系直接、密切的现实问题,强调要“努力办好人民满意的教育”“推动实现更高质量的就业”“千方百计增加居民收入”“统筹推进城乡社会保障体系建设”“提高人民的健康水平”。总体而言,十八大报告贯穿着切实关注民生、重视民生、保障民生、改善民生这条主线,以努力让人们过上更好的生活为目标和归宿。

在学术文献中,吴忠(2008)提出,广义的民生泛指直接或间接有关的事情。邓伟志、卜佳慧(2008)认为,民生是指民众的生存、生活、生计,从人的生活的横断面来讲是衣、食、住、行、用,从人的一生纵断面来讲是生、长、老、病、死,并基于此将民生分为两类:生存型与发展型。其中,生存型社会的政策目标是构建应对基本生存问题所导致的风险与危机的社会安全网,发展型社会的政策目标是缓解

贫困、促进就业、支持生计、保护生态与环境、包容社会(反社会排斥)、促进人权等。林祖华(2009)则认为,广义的民生不仅包括人们的生计与生活,还包括人们的政治需求、文化需求与精神需求,以及生命价值、健康价值和尊严价值等内容;狭义的民生则为与国民生计和生活相关的所有问题。同时将民生划分为生存的民生、发展的民生与全面发展的民生三个阶段。

关于民生品的概念,把马斯洛的需求层次理论运用到民生品问题中是一个很好的创新与结合,作为最基本的需求,民众维持生计需要消耗的生活必需品构成了民生品的最底层。因此,根据林宝(2010)的研究,认为民生品基本为影响人们底层生存状态的商品,例如,人们的衣、食、住、行所涉及的住房、粮食、石油等。金碚(2011)认为,经济活动的目的是满足人类的生存、享受、发展和繁衍的需要,因此经济活动所产生出来的产品都应该被划入民生品的范畴。但这样广泛的民生品定义似乎失去了其本身被使用时的意义,违背了使用者对民生品和普通商品的区别的初衷。显然,与广大人民群众生活紧密相连的必需品如水、粮食、药品等更接近民生品的内涵表达(金碚,2011)。因此,吴军、李耀华(2011)指出,民生品也应该从广义和狭义上进行区分,狭义的民生品更接近于教育、就业、医疗、养老和住房这些生活必需品。

此外,还有很多学者直接将民生问题落地,调研分析汇报了中国现阶段的民生问题,代表性的著作主要有王岭一(2010—2015)的上海民生发展报告系列、北京师范大学政府管理研究院(2011—2013)的中国民生发展报告系列、唐任伍(2014)的《中国民生发展报告》、谢耘耕(2014)的《中国民生调查报告》、李培林(2013)的《当代中国民生》、谢宇(2013)的《中国民生发展报告》等。

1.3.1.2 民生评价指标体系

研究民生问题的基础是民生指标体系的建立,虽然相关学者在建立民生指标体系方面并未达成一致的观点,但多数人是将研究重点集中在影响人们生活质量的因素上,如社会保障、教育、收入、职业、环境等方面。赵彦云和王作成(2003)借鉴瑞士洛桑国际管理学院(IMD)的国际竞争力评价指标体系建立了包括11个方面37项具体指标的民生指标体系。纪竹荪(2003)提出的指标体系包括五方面的内容,分别是物质生活水平、精神文化生活、社会生活、个人身心健康和情感生活及个性发展空间和国民生活质量改进速度。2006年,深圳市民生净福利指标体系开始统计发布,这个体系由收入分配与公平、安全水平、社会保障水平、公共服务水平和人的全面发展水平五个方面的一级指标和21项二级指标组成。李志强(2010)尝试性地从生态学角度来建立民生指标,将民生问题看作若干子系统共同作用的大系统,研究方法颇具前瞻性。林宝(2010)则将马斯洛需求层次理论运用

在建立民生问题的预警系统中,从而划分出影响民生状况的因素。在构建民生体系方面,冯建军(2010)认为,学术与官方的研究指标与人们的实际感受之间存在着较大的差异,因此需要将公众感受纳入测量体系之内,以使民生指标的测量结果落在社会评价的“公认”区间。IUD 领导决策数据分析中心(2011)对外公布了基于 31 个省级行政区域面板,仅选取可能影响民生指数的客观因素构建民生指标体系。袁国敏(2011)研究发现,国外文献中并没有民生指标这一概念,却有类似民生指标的“社会指标”,且同样包含居住、教育、就业、健康等因素。曹玉红、尤建新、王瑞(2014)建立了一个可适合各级政府部门基于平衡计分卡(BSC)的民生项目评价指标体系及民生项目选择的模糊网络分析(FANP)模型,并提出了基于该模型的民生项目选择思路及决策流程。国务院发展研究中心“中国民生指数研究”课题组(2015)把中国的民生指数分为主观指数和客观指数,并针对此分类做了普遍、广泛的跟踪调研。

国内外有关民生问题的测度研究一般从“生活质量”到“主观幸福感”,在形成相应的指标体系的过程中不断地进行方法的深化。相关反映生活质量的社会指标主要有美国学者 Bauer 主编的《社会指标》(1966)、中国社会科学院发布的《社会发展与社会指标》(1988)等。相关的方法主要有基于 Zadeh(1965)以及 Van Laarhoven 和 Pedrycz(1983)的模糊测度法。高进云、乔荣峰、张安录(2007)和刘扬、刘泽琴、赵春雨(2010)使用上述相关方法分别测度了农户福利变化和民生感知。吴静(2013)使用结构方程模型分析和测度了幸福问题,并认为社会科学中测度的目的是为了提供完善的公共服务。另外,地区发展与民生指数(Development and Life Index, DLI)是由中国统计学会组织有关专家研究并测算的,它客观、全面地反映了各地区的发展与民生状况。该指标体系包括经济发展、民生改善、社会发展、生态建设、科技创新、公众评价六大方面,共 42 项指标。指数的计算与合成借鉴了联合国人类发展指数(HDI)等有关方法,根据指标的上、下限阈值来计算各个指标的评价指数(即无量纲化),指数介于 0 至 100 之间,根据指标权重合成分类指数和总指数。

在民生问题的解决对策方面,国内外学者大多通过建立各自的研究框架从不同角度提出。如陈群民等(2008,2012,2013)针对上海市的民生状况进行了广泛、持续的调研,在对不同民生问题分层聚类的基础上,依据其受关注程度设置相应的优先级。动态结果显示,物价、医疗、食品安全、购房压力始终是上海市民关注的焦点。就对策而言,作者总结出了民生的“三大支柱”,即收入、就业、住房,并利用分析结果有针对性地提出改善民生的可能线路。彭新友(2012)则认为当前民生问题产生的四大原因为生产力的发展水平、发展观、社会保障与心理因素,并据

此四大原因提出了相应的解决对策。赵彦云、王雪妮(2015)对民生发展与我国生产力发展及经济社会转型的相互促进机制进行了研究,在进行了广泛的国际比较后,指出了我国民生发展竞争力方面应着重解决的三方面问题。

综上,民生(品)相关问题的各个层面均广受关注,但因为问题综合而复杂,所以很难形成统一、权威的观点。

1.3.2 与商品投机相关的问题

在国内外相关文献的研究中,投机的话题汗牛充栋,这些文献多以被投机的原因、投机泡沫的测量及缓解泡沫的方法为研究点,并常与预警的研究有交叉。因为本书研究标的具有特殊性,所以本部分选择性地忽略了大量的金融投机类文献,只关注与商品投机相关的研究。该类文献的研究对象多集中于房地产和大宗商品,为我们研究民生品的投机问题提供了可供借鉴的思路。

1.3.2.1 投机泡沫及其度量

与民生问题的研究不同,关于商品投机泡沫存在与否的相关文献,有更多的理论模型可供套用。其研究标的主要集中在房地产和农产品、石油、有色金属等上。

Chan(2001)通过将市场价格与以固定利率无套利模型贴现房租现金流得到的房地产基础价格进行对比,证实了投机泡沫广泛存在于香港的房地产市场。随后,王艺明(2008)在此基础上改良该模型,将固定利率无套利模型替换为变动的风险贴水,从而证实了北京和上海两地房地产市场均存在显著的投机泡沫,广州则相对不显著。Brunnermeier 与 Juillard(2008)将时间序列法运用于住房租售比指标,通过分解住房租售比的理性分量和风险溢价分量,发现存在房价泡沫。此外,杨帆(2005)套用的 Carey 模型与王树强(2009)构建的消费者行为模型均说明了中国房地产市场存在投机泡沫。柳德荣(2010)通过计算现金流净现值、溢价率、内部收益率等指标来考察一个地区的住房市场是否存在泡沫及存在泡沫的程度。刘丽(2010)在将房价收入比、商品房空置率等五种因素结合的基础上,建立了可用于度量房地产投机泡沫是否存在的综合性指标。姚涛(2013)采用因子实验方法模拟房屋市场,考察了房产税与房价泡沫之间的规律性关系。贾生华、李航(2013)建立了状态空间模型,利用卡尔曼滤波对所建模型的参数和状态变量进行估计。彭宜钟(2013)基于随机贴现因子定价理论,对我国房价泡沫进行了甄别和判断。邓伟、唐齐鸣(2013)结合 Kapetanios 等(2003)关于单位根检验的思想,在指数平滑转移模型的框架下提出了一种新的泡沫检验方法:sup KSS 检验。与 sup ADF 检验相比,sup KSS 检验对于扰动项的异方差有一定的改进,同时对于