

中国要素 价格决定统计研究

国际经验与历史证据

郝枫◎著

Statistical Research on Factor Price
Determining Mechanism in China

International Experience and
Historical Evidence

 中国经济出版社
CHINA ECONOMIC PUBLISHING HOUSE

中国要素 价格决定统计研究

国际经验与历史证据

郝枫◎著

Statistical Research on Factor Price
Determining Mechanism in China

International Experience and
Historical Evidence



中国经济出版社
CHINA ECONOMIC PUBLISHING HOUSE

北京

图书在版编目(CIP)数据

中国要素价格决定统计研究:国际经验与历史证据 / 郝枫著.

北京:中国经济出版社,2014.2

ISBN 978-7-5136-1314-9

I. ①中… II. ①郝… III. ①对外贸易—研究—中国 IV. ①F752

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2013)第 297049 号

责任编辑 张利影

责任审读 霍宏涛

责任印制 马小宾

封面设计 久品轩

出版发行 中国经济出版社

印刷者 北京科信印刷有限公司

经销者 各地新华书店

开本 710mm × 1000mm 1/16

印张 18.25

字数 300千字

版次 2014年2月第1版

印次 2014年2月第1次

书号 ISBN 978-7-5136-1314-9

定价 52.00元

中国经济出版社 网址 www.economyph.com 社址 北京市西城区百万庄北街3号 邮编 100037

本版图书如存在印装质量问题,请与本社发行中心联系调换(联系电话:010-68319116)

版权所有 盗版必究(举报电话:010-68359418 010-68319282)

国家版权局反盗版举报中心(举报电话:12390) 服务热线:010-68344225 88386794

前言 PREFACE>>

1978年,中共十一届三中全会开启了改革开放历史新时期。改革开放以来,中国经济经历了引人瞩目的长期高速增长,经济社会发展取得巨大成就。然而,在经济总量迅速提高的同时,经济结构问题也日益突显,经济可持续发展仍面临严峻挑战。中共十八届三中全会,已为我国在新的历史起点全面深化改革提供了战略思路与综合方案。在此背景下,全面回顾改革开放发展进程,系统总结中国转型时期的发展经验与教训,对深入贯彻落实科学发展观、让发展成果惠及全体人民、实现中华民族伟大复兴具有重大意义。

改革开放是党在新的时代条件下带领人民进行的新的伟大革命。改革开放目的就是要解放和发展社会生产力,实现国家现代化;就是要实现人民富裕、民族振兴;就是要推动社会主义制度自我完善与发展,建设和发展中国特色社会主义。转变资源配置方式是改革的本质要求与核心内容,其目标是由高度集中的计划经济体制转变为充满活力的社会主义市场经济体制,真正使市场成为资源配置的基础、使价格成为经济信息传递的有效载体。资源配置归根结底是对各种生产要素的配置,其直接决定经济发展水平与运行效率,进而决定发展成果分配与社会公平。要素价格是资源配置的重要媒介与基础手段,要素价格决定机制是资源配置方式的根本实现工具,健全的要素价格决定机制是确保要素价格合理性的制度保障。

经过市场化改革,中国市场化进程已经取得重大进展,产品价格市场化改革已取得决定性胜利。然而,要素市场发育严重滞后,各类要素价格形成存在制度分割、发展极不均衡。多数劳动力和部分技术要素配置权由市场

主导,而(土地、能源)资源、资金要素配置主导权和定价权仍由国家掌握。在这种背景下,要素价格形成机制必然出现扭曲,无法保证资源配置效率,并传导至产品市场,导致产业结构、需求结构与分配结构等一系列经济结构失衡。要素价格扭曲实质如何、后果如何、如何改进,是中国转型时期和深化改革过程中必须认真探讨与回答的重要问题。

本研究旨在对中国要素价格决定机制进行系统考察,综合利用理论方法与历史方法,给出识别要素价格合理性的理论标准与经验标准。其理论意义在于,以价格决定研究推动转型经济体制理论研究,推动现代经济理论中国化,并推进统计学与经济学交叉研究。其现实意义在于,由价格改革视角回顾与反思中国改革进程,为我国摆脱经济结构失衡提供参考,并从理论上提供贯彻落实十八大重要精神之有益思路。

全书共7章。第1章,导论,是本书的总体纲要。介绍选题背景与选题意义,并对该领域之研究现状和已有文献进行回顾。在此基础上,明确研究目标、研究思路、研究方法、研究路径、结构安排、重点与难点。

第2章,基本理论分析框架。旨在建立中国要素价格决定机制研究的基本理论分析框架。以一般均衡理论为分析价格决定机制的根本理论依据,将价格调整路径作为联结理论均衡与现实状态的桥梁。提出识别价格决定与调整合理性的思路:从宏观初次分配结构视角对价格体系进行刻画,并将其与基于微观代表性比价关系变动的认识互为补充、互相验证。

第3章,相对价格调整:国际经验与历史证据。重点考察工业革命前后欧美国家价格决定与价格调整的历史证据,并将其作为研究中国价格问题的经验参照。研究方法上以史为鉴,选择小麦价格作为一般价格长期趋势代表,对欧美发达国家产品比价以及产品要素比价变化规律进行考察,得出若干有意义的认识。

第4章,要素份额演进:经验模式与统计规律。要素份额是各生产要素参与初次分配的宏观表现,也是特定微观价格体系与资源配置状态的作用结果。本章系统梳理“要素份额稳定性”典型事实之争,明确要素份额稳定性之条件性和适用边界。对6个发达国家要素份额长期演进趋势进行考察,

揭示要素份额演进背后的基本经济决定力量与运行规律。

第5章,中国价格决定机制发展变迁历史考察。集中考察中国价格决定机制之历史变迁,由此给出评估中国价格体系合理性与资源配置效率的历史背景与制度依据。对国家定价机制、价格双轨制、市场价格机制的形成背景及历史作用进行回顾与剖析,并就现存问题与深化改革方向进行分析。

第6章,中国市场价格扭曲测度。基于参数化随机前沿分析法,对生产可能性边界 PPF 进行估计与分析。选用超越对数生产前沿,利用中国省级面板数据,详细讨论三类市场扭曲的时期与地区差异。在统一分析框架之内,综合测度产品与要素市场价格扭曲及其变化趋势,评估市场分割和价格扭曲的经济社会成本,并给出政策讨论。

第7章,中国初次分配结构与价格合理性识别。以发达国家历史发展规律为经验参照,重点考察中国要素份额特征及其变化趋势。综合利用世界各国初次分配数据展开中外比较,以初次分配结构和要素份额特征作为识别中国价格体系合理性的基本工具。通过行业变动分解揭示国民经济要素份额形成机制,并以扩展的增量利益分配三角模型,就价格体系变化对要素份额的影响进行政策模拟。

本研究的创新工作,表现在如下几方面:

第一,系统讨论均衡价格决定与价格调整之间的内在联系,以价格调整路径作为理论均衡价格与现实价格体系之间的桥梁,达到降低难度、增强可操作性的目的。对增量利益分配三角模型进行扩展,给出明确的参数化界面,并以此为基础就价格体系变化对中国要素份额的影响进行政策模拟。

第二,系统梳理“要素份额稳定性”之争的背景与核心观点,揭示要素份额稳定性研究的实质与意义;通过考察欧美发达国家超长时期要素份额演进规律,澄清要素份额稳定性之条件性,并明确其适用边界。深入剖析要素份额演进与经济发展阶段之间的内在联系,探寻要素份额演进特征背后的基本决定力量与运行规律。

第三,以经济理论为依据,对各国长期历史数据进行经验分析,并用经验标准作为衡量价格合理性的重要现实依据。微观价格与宏观分配相结

合,通过代表品比价关系变动考察价格变动合理性,选用宏观分配数据反映要素比价与产品比价变动。二者结合,既能克服单独使用微观数据遭遇的可得性困难,也可减少单独使用宏观数据的信息损失。

第四,综合测度中国各类市场扭曲程度,评估市场价格扭曲的经济社会成本。构建中国1952—2006年市场扭曲测度专题数据集,扩展已有研究的考察范围。并在统一分析框架之内,对比研究计划经济时期与改革时期的市场分割和价格扭曲情况,以提取经济发展模式变迁产生的影响,并为分析当今市场价格扭曲提供有价值的历史背景信息。

第五,揭示国民经济要素份额形成机制,是以行业增加值比重为权数对行业要素份额的加权平均过程。利用指数体系因素分解方法,对1952—2005年期间中国国民经济劳动份额变动进行分解,明确区分劳动份额下降的长期原因与短期原因,并探讨其变化趋势背后的政策涵义。在此基础上,进一步考察产品比价与要素比价对该机制的影响与作用。

本研究就中国要素价格决定问题进行探索,基于经济学与统计学交叉研究方法开展研究,得到若干有意义的结论与政策涵义。鉴于该问题的重要性和紧迫性,本项研究工作还远远不够,只是抛砖引玉。该领域未来研究的深入与扩展,需要在理论、方法、数据等方面做大量艰苦努力和实质推进,我们愿与学界同仁一道努力。

郝枫

2013年11月

目录 CONTENTS >>

第1章 导论

1.1 选题背景与意义	1
1.1.1 选题背景	1
1.1.2 选题意义	4
1.2 文献综述	7
1.2.1 要素市场分割研究	7
1.2.2 要素价格扭曲表现与成因研究	9
1.2.3 要素价格扭曲测度研究	10
1.2.4 要素价格扭曲影响研究	11
1.3 研究思路与方法	13
1.3.1 研究思路	13
1.3.2 研究方法	14
1.4 结构安排	14
1.4.1 研究路径	14
1.4.2 结构安排	16
1.5 难点与创新	17
1.5.1 研究难点	17
1.5.2 创新工作	19

第2章 基本理论分析框架

2.1 一般均衡分析框架与价格决定机制	21
2.1.1 一般均衡基本分析框架简述	21
2.1.2 一般均衡分析之价格决定	23
2.1.3 竞争均衡与配置效率	26
2.2 价格调整路径与相对价格变动	28
2.2.1 价格调整:联结理论与现实的桥梁	28
2.2.2 相对价格变动:内容与方式	30
2.3 价格决定与调整之微观—宏观联系	32
2.3.1 价格变动的分配含义	33
2.3.2 价格调整的宏观表现与微观基础	37

第3章 相对价格调整:国际经验与历史证据

3.1 欧洲前工业时期价格长期趋势考察	40
3.1.1 价格长期趋势分析:基本思路与方法	40
3.1.2 价格长期变动趋势:由个案到一般	42
3.1.3 价格指数与工资变动	47
3.1.4 农业发展、物价与人口动态	48
3.1.5 基本结论与判断	50
3.2 欧美工业革命以来相对价格演进	50
3.2.1 研究思路与数据来源	51
3.2.2 产品比价变化	53
3.2.3 要素与产品比价变化	61
3.2.4 几点认识	67
3.3 相对价格变化:补充证据	69
3.3.1 日本产品比价变化	69
3.3.2 日本要素与产品比价变化	71
3.4 简要总结	73

第4章 要素份额演进:经验模式与统计规律

4.1 要素份额稳定性:典型事实之争	75
4.1.1 赞同观点与证据	76
4.1.2 反对观点与证据	77
4.1.3 争论焦点与意义	79
4.2 要素份额稳定性:历史视角考察	81
4.2.1 要素份额演进:发达国家的证据	82
4.2.2 基本认识	92
4.3 要素份额演进与经济发展阶段	93
4.3.1 要素份额与人均收入演进特征	93
4.3.2 要素份额与产业结构演进特征	98
4.3.3 要素份额分解:资本收益率 r 与资本产出比 K/Y	104
4.3.4 相对收入份额与资本劳动比率演进特征	107
4.3.5 主要变量经验分布之补充分析	109
4.4 简要总结	114

第5章 中国价格决定机制发展变迁历史考察

5.1 计划经济时期:经济赶超战略与国家定价机制	116
5.1.1 国家定价的历史背景	117
5.1.2 国家定价的形成与强化	119
5.1.3 国家定价的作用与影响	123
5.2 改革初期:价格改革与双轨制	126
5.2.1 价格改革的背景与目标	127
5.2.2 价格改革过渡方式:双轨制	128
5.2.3 价格形成机制转换与价格并轨	131
5.3 市场经济时期:市场价格机制形成与发展	133
5.3.1 市场价格机制的作用范围	133
5.3.2 产品市场与要素市场发展不平衡	136
5.3.3 现存问题与深化改革之方向	145

第6章 中国市场价格扭曲测度

6.1 引言	149
6.2 理论框架	150
6.2.1 市场扭曲分类	150
6.2.2 随机前沿分析技术	151
6.3 实证分析	154
6.3.1 数据说明	154
6.3.2 结果分析	156
6.4 基本结论与对策建议	167

第7章 中国初次分配结构与价格合理性识别

7.1 初次分配结构研究:目的与意义	170
7.2 中外初次分配结构测算	172
7.2.1 数据来源	173
7.2.2 指标计算	181
7.2.3 简要结果	183
7.3 中外初次分配结构比较	183
7.3.1 中国初次分配结构概貌	189
7.3.2 中外国民经济初次分配结构比较	191
7.3.3 中外行业初次分配结构比较	195
7.4 中外要素份额演进特征比较	198
7.4.1 中国劳动份额变化趋势	198
7.4.2 中外要素份额演进规律对比	207
7.5 要素份额形成机制与价格体系影响	214
7.5.1 国民经济 SL 形成机制	214
7.5.2 要素比价与收入份额	221
7.5.3 产品比价与权数结构	222

7.6 价格合理性评价与政策模拟	222
7.6.1 理论模型	223
7.6.2 要素比价变化结果分析	228
7.6.3 产品比价变化政策模拟	233
7.7 基本结论与政策空间	236
7.7.1 基本结论	237
7.7.2 政策空间	240
参考文献	242
重要术语索引表	253
附 录	255
后 记	279

第1章 导论

改革时期,中国经济经历了高速增长,但各类结构问题日益突显。要素市场发育严重滞后,要素价格形成机制扭曲成为制约中国经济健康、持续发展的重要桎梏。本研究旨在系统考察中国要素价格决定机制,给出识别要素价格合理性的理论与经验标准,为有效评估我国要素价格体系扭曲提供参照系,并探讨摆脱困境的政策空间。

1.1 选题背景与意义 >>

1.1.1 选题背景

1978年,中共十一届三中全会开启了改革开放历史新时期。改革开放以来,中国经济经历了引人瞩目的长期高速增长,经济社会发展取得巨大成就。然而,在经济总量迅速提高的同时,经济结构问题也日益突显,经济可持续发展仍面临严峻挑战。全面回顾改革开放发展进程,系统总结中国转型时期的发展经验与教训,对深入贯彻落实科学发展观、全面建设小康社会、实现中华民族伟大复兴具有重大的意义。

改革开放是党在新时期带领人民进行的新的伟大革命。改革开放,目的就是要解放和发展社会生产力,实现国家现代化;就是要实现人民富裕、民族振兴;就是要推动社会主义制度自我完善与发展,建设和发展中国特色社会主义。实现以上目标,要求大力推进技术进步,将发展生产力同提高全

民族文明素质结合起来;大力推进管理进步,将推动经济基础变革同推动上层建筑改革结合起来;彻底转变资源配置方式,将坚持社会主义基本制度同发展市场经济结合起来,将提高经济效益同促进社会公平结合起来,将坚持独立自主同参与经济全球化结合起来。

转变资源配置方式是中国改革的本质要求与核心内容,对推动技术进步和管理进步具有重要支撑作用。转变资源配置方式,就是由高度集中的计划经济体制转变为充满活力的社会主义市场经济体制,真正使市场成为资源配置的基础、使价格成为经济信息传递的有效载体。资源配置归根结底是对各种生产要素的配置,其直接决定经济发展水平与运行效率,进而决定发展成果分配与社会公平。要素价格是资源配置的重要媒介与基础手段,要素价格决定机制是资源配置方式的根本实现工具,健全的要素价格决定机制是确保要素价格合理性的制度保障。

当前,我国要素价格决定机制的重要特征是要素市场发育滞后,各类要素价格形成存在制度分割、发展极不均衡。集中表现在:国家掌握(土地、能源)资源、资金要素配置主导权,不仅具有高度定价权,甚至能够直接控制重要资源使用流向;个人掌握多数劳动力和部分技术要素的配置权,此类要素价格主要由市场力量决定。在这种背景下,要素价格形成机制必然出现扭曲。这种扭曲实质如何、后果如何、如何改进,无疑是中国转型时期和深化改革过程中必须认真探讨与回答的重要问题。

对改革开放伟大历史进程的成就与不足,我们有如下两方面思考。

一是渐进改革之历史功过。一方面,渐进改革的历史功绩毋庸置疑。在特定的国内外政治经济环境下,中国的渐进改革由易到难渐次推进,有利于减少阻力、避免动荡;有利于以改革成果增强改革信心,赢得广泛共识与支持;有利于在稳定中实现发展,在发展中巩固改革成果。另一方面,渐进改革也逐渐暴露出一系列问题。(1)改革逐渐推进,扭转原有利益格局需要较长时间,改革进程中可能出现新的利益集团。新老利益集团为维护既得利益,存在延缓、停滞、阻碍改革的强烈动机。渐进改革已经进入攻坚阶段,甚至面临局部领域出现倒退的风险。(2)自上而下的渐进改革,缺乏强力监

督与有效约束。在改革前期一系列浅层问题轻松攻克之后,深层问题面临的阻力逐渐加大。深化改革必然触及某些集团的既得利益,渐进改革之初“没有输者”的状态已不复存在。渐进改革能否造就确保自身持续推进的强大力量,能否克服抵制深化改革的阻力与障碍,值得深思!

二是中国市场化进程评价。经过20多年市场化改革,中国市场化进程已经取得重大进展。产品价格市场化改革已取得决定性胜利,20世纪90年代以来,市场价格占据主导,计划价格逐渐退出历史舞台。劳动力跨地区流动规模不断扩大,劳动力市场发展产生的“配置作用”成为中国经济强劲增长的重要动力。随着90年代中国资本市场启动市场化进程,国内资本市场日趋统一:地方政府对资金流动的阻碍明显减弱,商业银行主导金融资源在全国范围内配置;深圳和上海两个股票交易所迅速发展壮大,直接融资渠道不断拓展。最重要的是,市场配置资源的基础性作用已形成广泛共识,市场化改革深入人心;即使在若干非市场化领域,也往往披上市场外衣,不得不以市场化为改革方向。

然而,市场化改革绝非一帆风顺,道路艰难险阻,难免徘徊停滞。现存问题主要表现为:市场化覆盖范围不全、作用程度不高、各类市场发育不平衡。(1)要素市场发育滞后。土地市场和资金市场仍然受到严格管制,要素价格未能充分有效反映资源稀缺程度与市场供求关系,导致效率损失和资源浪费,并容易滋生寻租与腐败行为。劳动力市场虽取得较快发展,但导致城乡劳动力市场分割的体制障碍尚未彻底消除。最突出的难题则是体制内外劳动力市场分割严重,对中国经济持续和谐发展构成严重威胁。(2)要素市场发育不平衡。在土地、资金市场并未真正实现市场化的前提下,劳动力市场无法真正形成并有效发挥作用。要素之间存在不对称、不平等竞争,资金要素强势地位之下,劳动要素合理利益难以根本保证。这点已经为微观

企业劳资关系紧张和国民经济初次分配结构失衡所反映^①。(3)要素市场影响产品市场。在要素市场发育滞后、要素价格扭曲的情况下,产品价格市场化无法真正发挥作用,甚至存在“伪市场化”的严重风险。由于产品价格承袭了要素市场扭曲价格,其无法保证资源配置效率,并导致产业结构、需求结构与分配结构等一系列经济结构失衡。必须警惕扭曲的要素价格决定机制自我强化与制度化,防止其被行业或部门利益集团控制,冒市场之名,行垄断之实,假国家安全之口,谋集团利益之私。因此,推进要素价格市场化深化改革势在必行,迫在眉睫!

1.1.2 选题意义

本选题的现实意义在于由价格改革视角回顾与反思中国改革进程。(1)要素价格是市场经济运行的基础:要素价格是市场配置资源的重要手段,要素价格形成机制改革是中国价格改革必须攻克的最后堡垒,也是深化改革的重要目标与内容。(2)要素价格是践行科学发展的基础:要素价格对经济全面协调可持续发展具有重要影响,需求结构失衡是要素价格扭曲的

^① 劳资关系失衡不仅表现在工资过低,更深层次还表现为劳资之间缺乏平等协商的有效机制。近来引起广泛关注的两个事件集中突显这一问题。在竞争性行业,珠三角地区四川凉山童工的悲惨境遇,不仅反映“血汗工厂”对劳动者的残酷盘剥,众多童工贩运者、中介机构、甚至执法者对法律的漠视与良知泯灭尤其令人震惊。即使在新薪垄断行业,劳资关系也暗涛汹涌,东航飞行员集体返航事件无疑揭示了垄断企业劳资关系的紧张局面。

突出反映^①,产业结构失衡是要素价格扭曲的必然后果^②。(3)要素价格是构建和谐发展的基础;科学发展观的核心是以人为本,目标是促进人的全面

① 需求结构失衡突出表现为消费与投资关系失衡,内需与出口关系失衡。2000年以来,中国社会消费零售总额增长速度保持在11% - 13%之间,居民消费支出增长速度保持在9% - 10%上下;同期资本形成平均增长速度为16.3%,净出口平均增长速度高达38.7%。与2000年相比,2006年资本形成率由35.3%提高到42.5%,净出口率由2.4%提高到7.6%,而最终消费率则由62.3%下降为49.9%。消费需求对经济增长的贡献率,已由1999年的74.7%降至目前的40%以下。观察者普遍认为,未来一段时期内,中国“低消费、高投资、高出口”的需求结构将难以改变。

中国经济内需不振的同时,却出现出口激增、贸易顺差和外汇储备迅速增长的局面。出口主导型增长模式与国内有效消费需求不足互相强化,逐渐陷入恶性循环。中国以压低劳动力价格、资本价格、资源价格为代价,对世界进行巨额出口贸易补贴[卢麒元估计,中国2007年为美国提供的隐性贸易补贴可能高达2500亿美元,对全球的贸易补贴可能超过5000亿美元。沈明高指出,根据花旗银行的保守估计,中国制造业从投入品价格低估和扭曲中节约成本3.83万亿元人民币,其中很大比重通过出口形成对发达国家的利益补贴]。长此以往,丧失健康活跃的国内市场(这是普通民众收入低、增速慢的必然结果)而高度依赖国际市场(甚至仅靠美国市场),中国经济难免沦为世界经济的附庸。

② 要素价格扭曲直接导致产业结构失衡:一方面,低劳动价格、低资源价格和低成本排放造就了一大批高污染、高能耗产业,钢铁、有色金属、建材、石化和电力等行业发展很快;另一方面,低利率直接刺激资本密集型产业扩张,土地价格扭曲通过降低资本进入门槛,间接刺激资本密集型产业发展,导致经济快速增长而就业增长缓慢。

要素价格扭曲还通过影响分配结构和需求结构间接导致产业结构失衡。收入分配差距扩大引发商品需求结构变化,进而导致产业结构变化。整体消费需求和消费支出下降之际,高收入阶层的消费比重却持续上升,需求结构和产业结构明显向高收入阶层倾斜。1997年以来,房地产、汽车、通信和一些生产高档消费品的高新技术产业的增长率迅速提高,在第二产业中所占比重大幅上升。第三产业增长率高于第二产业,并日益分化为两部分:一是工资率极高的金融保险、影视广告和娱乐、体育等行业;二是工资率极低的传统服务业。这明确反映,产业结构已出现与收入差距过大形成的需求结构相适应的倾向。柳欣(2006)认为,这种需求结构与产业结构严重向高收入阶层倾斜的倾向,正在逐渐形成一种“富人经济”。其基本逻辑是:高收入阶层消费需求高,使消费品生产向高端消费品行业转移;推动这类行业工资率大幅提高,从而产生更多富人;不断强化新增GDP在富人内部流动,并导致分配结构、需求结构、产业结构之间的恶性循环。