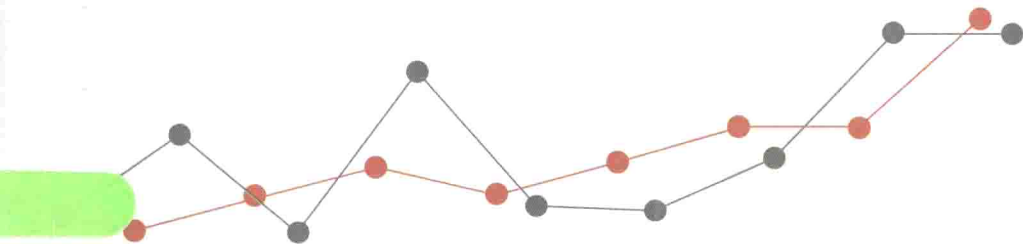


■ 习明明 / 著

人力资本、贫困陷阱 与经济增长

HUMAN CAPITAL, POVERTY TRAPS AND
ECONOMIC GROWTH



江西人民出版社 / 全国百佳出版社

人力资本、贫困陷阱 与经济增长

HUMAN CAPITAL, POVERTY TRAPS
AND ECONOMIC GROWTH

■ 习明明 / 著

江西人民出版社 / 全国百佳出版社

图书在版编目(CIP)数据

人力资本、贫困陷阱与经济增长/习明明著.

—南昌:江西人民出版社,2013.12

ISBN 978-7-210-06265-3

I. ①人… II. ①习… III. ①发展中国家-人力资本-研究②发展中国家-经济发展-研究③发展中国家-经济增长-研究 IV. ①F241②F112.1

中国版本图书馆CIP数据核字(2013)第270888号

书名:人力资本、贫困陷阱与经济增长

作者:习明明

责任编辑:万春花

封面设计:游珑

出版:江西人民出版社

发行:各地新华书店

地址:江西省南昌市三经路1号附1号

编辑部电话:0791-86898650

发行部电话:0791-86898815

邮编:330006

网址:www.jxpph.com

E-mail:jxpph@tom.com web@jxppj.com

2013年12月第1版 2013年12月第1次印刷

开本:787毫米×1092毫米 1/16

印张:13

字数:180千

ISBN 978-7-210-06265-3

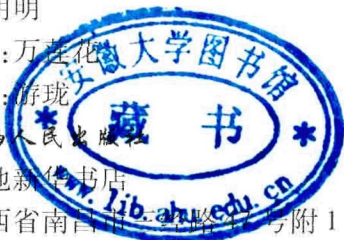
赣版权登字—01—2013—413

版权所有 侵权必究

定价:25.60元

承印厂:江西千叶彩印有限公司

赣人版图书凡属印刷、装订错误,请随时向承印厂调换



HUMAN CAPITAL, POVERTY TRAPS
AND ECONOMIC GROWTH

Period	Series 1 (Solid line)	Series 2 (Dashed line)
1	0.0	0.0
2	0.1	0.0
3	0.0	0.0
4	0.2	0.0
5	0.1	0.0
6	0.0	0.0
7	0.3	0.1
8	0.4	0.1
9	0.2	0.1
10	0.4	0.2
11	0.3	0.1
12	0.4	0.1
13	0.5	0.2
14	0.5	0.3
15	0.5	0.3

前 言

传统的经济学理论认为,无论是物质资本还是人力资本,要素的边际报酬都呈现递减的趋势。落后国家投资物质资本和人力资本的收益或回报率要高于发达国家,具有追赶发达国家的潜在优势。Psacharopoulos(1994)研究发现低收入国家、中低收入国家教育投资的社会收益率和私人收益率都要明显高于高收入国家。其中,低收入国家、中低收入国家和高收入国家对中等教育投资的社会收益率分别为 0.152, 0.134 和 0.103,私人收益率分别为 0.193, 0.187 和 0.128,都呈现出边际报酬递减的趋势。因为与发达国家相比,发展中国家人力资本存量要低得多。人力资本投资像物质资本一样,也具有报酬递减的性质,这是因为人的智力开发是有限度的,开发一个文盲的智力与开发一个大学学生的智力在效果上是不一样的,同样一元钱投入前者的效果就要好得多。发达国家智力开发已达到较高水平,而发展中国家的智力开发水平比较低。因此,发展中国家智力开发的效益就要高于发达国家,同样一美元的教育投资,在发展中国家的边际收益就会高于在发达国家的边际收益。(郭熙保,2009)

依照传统的新古典理论,如果资本和技术都是自由流通的,政策和市场都是有效的,那么根本不会有贫困国家的存在,至少不会有长期贫困或持久贫困存在。因为穷国总是可以通过采用富国的先进技术,引

进富国的资本来获得发展。对于个人而言,在一个完全竞争的瓦拉斯均衡中,人们只要肯努力工作,是不会处于长期或持久贫困的,同时富裕的人也只有通过长期努力才能保持富裕,只有懒惰的人才会陷入贫困。然而现实并非如此,勤奋的人不一定能富裕,富裕的人不一定勤奋,总是存在各种各样的因素导致人们陷入贫困陷阱而不能自拔。穷国不能有效使用先进技术,资本也没有源源不断地从富国流向穷国。此外,除了受到各种自然灾害、饥荒、疾病等影响外,穷国内在的各种体制弊端也层出不穷,例如政治腐败、缺乏管治、暴力动乱等,导致价格不能有效调节市场,私有产权得不到有效保护,例如利比亚、安哥拉、刚果民主共和国、苏丹等。即便是没有这些体制弊端的国家,如马里、加纳以及非洲的大部分地区,仍然有超过一半的人口一天生活开支不超过 1.25 美元。人力资本没有大量地从发达国家流向发展中国家,反而是从发展中国家不断地流入发达国家的现象。其原因是什么?学术界对此有两种解释。

第一种解释是从人力资本投资的外部性角度来阐述的。Romer (1986), Lucas (1988, 1990) 等从技术外部性或知识外溢的角度,对这个问题进行了详细的阐述。他们将知识的溢出效应或人力资本的技术外部效应加入总生产函数中,从而产生一个递增的收益,因此人力资本投资的收益率在富国要大于穷国,从而人力资本不会由富国流向穷国,而是由穷国流向富国。与 Romer (1986), Lucas (1988, 1990) 所考虑的技术外部性不同的是, Acemoglu (1996) 通过人力资本投资的货币外部性 (Pecuniary Externalities), 即人力资本与物质资本的相互作用,构建了人力资本投资报酬递增的微观经济基础。Acemoglu 假定企业的生产函数是规模收益不变的,市场由劳动者和企业组成,社会生产投资过程分为两期,在第一期劳动者决定其对人力资本投资时,企业决定其对物质资本投资;第二期企业与劳动者进行一对一的匹配,假如企业与劳

动者之间匹配是有成本的,在一个不完美信息博弈中,当一部分劳动者增加其人力资本投资时,企业为了提高产出就会增加相应的物质资本投资,而那些没有对自身人力资本进行投资的劳动者的人力资本也会相应增加,最终导致报酬递增。

第二种解释从扩展的新古典增长模型出发,保留规模报酬不变和外生技术进步这些基本假定,将阻碍人力资本从富国流向穷国的因素归于制度和政治差异。例如 Mankiw, Romer & Weil (1992, 以下简称 MRW) 从扩展的索洛增长模型考察了跨国经济增长。与 Lucas (1988, 1990) 和 Acemoglu (1996, 2000) 等分析不同的是,MRW 对内生增长模型的物质资本规模报酬递增或不变的观点提出了质疑,MRW 将人力资本积累作为一个额外解释变量进行回归,结论表明即便维持要素边际收益递减的假定,模型仍然能够足够地解释跨国收入差距。由于假定要素边际收益递减,模型预测穷国的要素边际收益高于富国,但是人力资本为什么没有从富国流向穷国,MRW 提出的一个解释是:穷国面临各种金融约束,并且也有政治风险,所以尽管穷国的要素边际收益高于富国,富国的人力资本也不会流向穷国。

经验研究对传统假定提出了质疑和挑战,当现实的经验研究与传统的理论假定相违背时,我们不禁要问,到底是现实的经验研究方法和结论有问题,还是传统的理论假定有误。这不是一个孰是孰非的问题,很难简单地回答谁对谁错。本书使用动态面板数据和分位数回归分析方法,对国际和国内的人力资本投资、贫困陷阱与经济增长进行全面分析。研究发现,人力资本投资收益率无论是从国际还是国内的数据来看,都呈现递减的趋势。部分实证研究之所以会得出收益率递增的结论,主要是没有考虑到人力资本投资的门槛效应,我们认为不论是物质资本还是人力资本投资,都存在一个最小投资规模,低于最小投资规模的投资都是无效的。正是因为存在最小投资规模,导致一些投资不足

和资本稀缺的地区或国家的要素收益率低,而一些资本充足的国家和地区的要害收益率反而要更高,呈现出表面的报酬递增的趋势。尽管存在部分落后国家教育投资收益率低的情况,但就全世界范围而言,人力资本的边际报酬和收益率,无论是从时间上还是空间上,都呈现递减的趋势。对中国的经验分析也表明,尽管短期内收入差距有扩大的趋势,但就长期而言,收入差距必定会缩小,现有的研究只是考虑到人力资本投资对工资水平的影响,而忽略了人力资本投资在人口流动和推进城镇化中的作用,而人口流动和城镇化又会对收入差距产生重要的影响,研究发现人口流动和城镇化对收入差距的影响呈现出倒“U”形关系,人口流动和城镇化扩张的初期会加剧收入不平等。但随着城镇化水平的提高,达到一定水平之后,又会减缓收入差距的扩大。因此简单地用收入差距扩大来否定边际报酬递减可能是错误的。实证研究结果表明,人力资本投资的回报整体而言呈递减的趋势,后进国家在人力资本投资方面仍然是具有潜在优势的,但是投资必须达到一定的规模,这种潜在的优势才能发挥出来,否则投资就是无效的,后进国家将因为投资的低回报而陷入贫困陷阱。



前 言 ∠1

第 1 章 引 言

- 1.1 研究背景 ∠2
- 1.2 研究结构与思路 ∠15
- 1.3 可能的创新与局限 ∠20

第 2 章 人力资本投资的收益率问题研究

- 2.1 教育投资的收益率研究 ∠22
- 2.2 教育投资收益率测算存在的问题 ∠31
- 2.3 人力资本投资在经济发展中的作用 ∠34
- 2.4 人力资本后发优势理论的研究 ∠40

第 3 章 贫困陷阱的机制和类型

- 3.1 引言 ∠45

3.2	贫困陷阱的形成机制	∠51
3.3	贫困陷阱的各种类型	∠55
3.4	贫困陷阱的实证检验	∠57
3.5	本章小节	∠60

第4章 人力资本、贫困陷阱与经济增长

4.1	引言	∠65
4.2	基本模型	∠70
4.3	数据与回归估计	∠74
4.4	人力资本报酬递减与人力资本逆向流动	∠87
4.5	本章小结	∠89
附录 A:公式(4-16)证明		∠91
附录 B:98 个国家或地区样本选择		∠93
附录 C:分地区面板数据回归		∠94

第5章 人力资本、收入分配与经济增长

5.1	引言	∠95
5.2	教育与收入不平等	∠101
5.3	分位数回归分析	∠108
5.4	本章小结	∠117
附录 A:农村与城镇居民文化教育支出对比		∠120

第6章 人力资本、贫困陷阱与大推进

6.1	引言	∠121
-----	----	------

6.2 一个基本的模型	∠125
6.3 模型的扩展:考虑生产率差异与互补性	∠130
6.4 本章小结	∠137
附录 A:公式(6-12)证明	∠139
附录 B:Cobb-Douglas 生产函数证明	∠141

第 7 章 增长与发展理论的融合:过去与未来

7.1 引言	∠142
7.2 从“华盛顿共识”到“后华盛顿共识”	∠144
7.3 增长与发展理论的融合	∠151
7.4 制度与政策	∠155
7.5 社会资本和其他	∠161
7.6 本章小结	∠169

第 8 章 结 论 ∠171

参考文献	∠178
------	------

后 记	∠197
-----	------

“不是资本,不是收入,也不是物质资源,而是
人力资源构成了各国财富的最终基础。资本
和物质资源是生产的被动因素,人类则是积累
资本,输出自然资源,建立社会、经济和政治组
织并推动国家发展的能动主体。显然,如果一
个国家不能发展它的人民的技能和知识,并使
其有效地被利用在国民经济中,它就不可能发
展任何别的东西。”

——哈比森^①

^① Harbison, F. H.: Human Resources as the Wealth of Nations. 1973.

第1章 引言

1.1 研究背景

本书主要研究人力资本、贫困陷阱与经济增长之间的相互关系,探讨人力资本投资对跨国收入差距与区域经济发展不平衡的影响。例如,人力资本投资与收入分配的“马太效应”之间是否存在显著的关系?如果说人力资本投资的收益率不是递增的,那么人力资本投资收益递减如何能够解释跨国收入差距扩大、区域经济发展差距扩大的现实?此外,收入差距扩大必然涉及贫困问题,落后国家或地区如何才能摆脱贫困陷阱,实现经济持续快速增长?教育投资一直被视为摆脱贫困的最有效途径,如果说教育投资的收益率是递增的,教育投资的增加必然导致富者愈富、穷者愈穷。既然如此,我们拿什么来与发达国家竞争,拿什么来摆脱贫困陷阱?

本书将从人力资本与贫困陷阱的角度解释跨国和区域收入差距。人力资本后发优势理论认为,人力资本投资和物质资本投资一样,也具

有边际收益递减的性质,从而发展中国家的收益率要高于发达国家。经验表明,随着贸易的发展,人力资本存量水平低的国家,更倾向于增加他们的人力资本积累(Owen,1999)。如果要素边际收益递减是成立的,穷国要素投资的回报要高于富国,富国与穷国的收入差距就会不断缩小。但实证研究表明,最近几十年富国与穷国的收入差距不但没有缩小,反而逐渐扩大。1960 年世界最富裕的国家瑞士的年人均收入是 3414 美元,最穷的国家坦桑尼亚的年人均收入为 111 美元,前者是后者的 31 倍。2000 年,最富裕的国家是卢森堡的年人均收入为 48967 美元,坦桑尼亚仍然是世界最穷的国家,年人均收入为 490 美元,但贫富差距已经从 1960 年的 31 倍扩大到将近 100 倍。^① 以 2008 年世界银行的统计数据计算,挪威的年人均收入(94759 美元)是刚果的年人均收入(182 美元)的 500 倍左右。最富的 10 个国家的年人均收入是最穷的 10 个国家年人均收入的 200 倍左右(详见表 1-1):

表 1-1 穷国与富国年人均收入对比

最富的十国	人均收入	最穷的十国	人均收入
奥地利	\$ 49,599	刚果	\$ 182
芬兰	\$ 51,323	利比里亚	\$ 222
瑞典	\$ 51,950	津巴布韦	\$ 274
冰岛	\$ 52,479	马拉维	\$ 288
荷兰	\$ 52,963	塞拉利昂	\$ 352
科威特	\$ 54,260	尼日尔	\$ 364
爱尔兰	\$ 60,460	阿富汗	\$ 366
丹麦	\$ 62,118	尼泊尔	\$ 438

① Summers, Lawrence and Alan Heston. Penn world table version 6.1. 2002, <http://datacenter.chass.utoronto.ca/pwt/>.

续表:

最富的十国	人均收入	最穷的十国	人均收入
瑞士	\$ 64,327	莫桑比克	\$ 440
挪威	\$ 94,759	多哥	\$ 449
平均值	\$ 59,424	平均值	\$ 338

资料来源:世界银行世界发展指数 2008 年数据。

如果说穷国的人力资本边际报酬要高于富国,按照传统经济学理论,人力资本会不断从富国流向穷国,直到穷国与富国的人力资本边际报酬相同为止。然而数据表明人力资本并没有从富国流向穷国,反而是从穷国流向富国。^① 以中国为例,1978—2000 年有 58 万人出国留学,回国的仅有 15 万人,回国人员大约只有四分之一;2001 年出国人数同比增长 115%,但回国的人数仅仅增长了 34%,智力外流现象十分严重。^② 理论预期与事实的矛盾让我们不得不怀疑,人力资本投资的收益率是递增还是递减? 后进国家存在人力资本后发优势吗?

人力资本投资的收益率是递增还是递减? 要回答这个问题,首先我们要弄清楚什么是人力资本投资的收益率^③。假定 I (且 $I > 0$) 代表

① Lucas (1988) 在其讲座中最早提出关于资本为什么没有从富国流向穷国的问题,在 Lucas 的著作《资本为什么没有从富国流向穷国》最后一节, Lucas 提出他使用的方法同样可以解释为什么人力资本没有从富国流向穷国, Lucas 说:“本文的研究同样适合于人力资本。”这句话同样也出现在 Acemoglu (1996) 关于人力资本投资的文章中,但是却以相反的方式表达:“本文的研究同样适合于物质资本。”必须说明的是,本文的主要目的并不是要研究为什么人力资本没有从富国流向穷国,而是借由 Lucas 提出的方法来探讨人力资本投资收益率的变动趋势问题,但是又会涉及人力资本流动这个问题,本文的研究并不拘泥于 Lucas 的研究方法。而研究人力资本投资的收益率的变动趋势涉及跨国收入差距与区域收入差距,例如人力资本投资如何解释跨国的收入差距扩大,人力资本投资在中国的城乡收入差距扩大的过程中充当什么角色等等,显然,在讨论人力资本投资的收益率的变动趋势问题时不能撇开这些问题不谈,这或许也是本文研究的一个思路。

② 刘建,李国平,《新时期我国智力外流的特点与对策研究》,《人口学刊》,2004 年第 4 期。

③ 或者更准确地说,什么是收益率吧,这里主要分析收益率的变动趋势与边际收益的变动趋势,在讨论收益率概念时,不一定非要人力资本,物质资本也是一样的。

人力资本投资, R 代表人力资本投资的收益, 那么人力资本投资的收益率为: $(R - I)/I$; ①假定人力资本投资的收益率递增, 这意味着收益率 $(R - I)/I$ 是递增的, 也就意味着 $(R - I)/I$ 的一阶导数大于零:

$$d\left(\frac{R - I}{I}\right)/dt > 0$$

展开即得②:

$$\frac{dR}{dI} > \frac{R}{I}$$

上式中 $\frac{dR}{dI}$ 表示人力资本投资的边际收益, 整理可得:

$$\frac{dR}{dI} > \frac{R - I}{I} + 1$$

也即:

$$\text{边际收益} > \text{收益率} + 1$$

上式表明人力资本投资的边际收益必须大于收益率, 由于前文已经假定收益率是递增的, 所以人力资本投资的边际收益也是递增的。同理可证, 如果收益率是递减的, 那么得到的结果就是: 边际收益 $<$ 收益率 $+ 1$, 从而边际收益也必须是递减的。反过来, 边际收益递增意味着下一期的收益率会高于当期, 也就意味着收益率也是递增的; 边际收益递减意味着下一期的收益率会低于当期, 也就意味着收益率是递减

① 这里主要是分析收益率与边际收益之间的关系, 并不是要精确地计算人力资本投资的收益率, 所以使用的是最简单的成本—收益衡量法。其实, 不论如何计算, 一个正确的理论首先就应该能说明变量之间的简单关系, 如果不能解释简单的收益率与边际收益之间的关系, 就很难解释复杂定义条件下二者之间的关系。

② 展开 $d\left(\frac{R - I}{I}\right)/dt > 0$ 式即得 $-(R \frac{dI}{dt} - I \frac{dR}{dt})/I^2 > 0$ 也即 $R \frac{dI}{dt} < I \frac{dR}{dt}$, 整理即得 $\frac{dR}{dI} > \frac{R}{I}$ 。由于投资随着时间的推移而增加, 这里隐含假定 $dI/dt > 0$ 。这里加入时间变量 t 只是为了方便表述, 去掉 t 不会影响分析结果。

的。所以,收益率的变动趋势与边际收益的变动趋势是一致的。^①

其次,我们要弄清楚收益率 $(R - I)/I$ 、收益 R 、边际收益 dR/dI 之间的关系。前面已经证明,收益率的变动趋势与边际收益的变动趋势是一致的,但是,收益的变动趋势与边际收益的变动趋势未必一致。收益递增仅仅意味着 $dR/dI > 0$,在这种情况下,收益增长的方式可能是凹的(二阶导数小于0),也可能是凸的(二阶导数大于0),所以边际收益可能是递减,也有可能是递增。仅仅是出现收益递增和边际收益递减并不奇怪,任何投资都可能同时出现收益递增与边际收益递减。但是收益递增与边际收益递减显然是不能解释巨大的跨国收入差距扩大的事实,因为边际收益递减对收入差距是一种压缩效应,有利于收入差距缩小。另一方面,收益递增与边际收益递增同时发生,则可以解释任意的收入差距扩大。但是,边际收益递增又很难解释为什么三分之二的发展中国家的经济与发达国家的经济差距在逐渐缩小?如果边际收益是递增的,那么所有的发展中国家的人均收入与发达国家相比差距应该是逐渐扩大的,为什么有些发展中国家的发展速度快,另外一些发展中国家的经济则停滞呢?这显然不是边际收益递增所能解释的,而且边际收益递增还面临着一个非常尴尬的结果,那就是经济增长不是收敛的,这显然是违背经济增长的基本规律。

要解释这个问题是非常困难的,尽管过去几十年中,跨国的收入差距与区域收入差距有扩大的迹象,但世界银行全球监测报告(Global Monitoring Report, 2011)分析也表明,最近几年发展过程中,接近三分之二的发展中国家与发达国家的差距正在缩小,跨国收入差距与区域收入差距似乎呈现出先扩大然后再缩小的倒“U”形趋势。

^① 这里只是说明收益率的变动趋势与边际收益的变动趋势是一致的,并没有说收益率与边际收益是相同的。