

目摇摇录

译者序	曾湘泉
中文版序	詹姆士·允 海克曼
提升人力资本投资的政策	员
员援美国全新的劳动力市场 :量化评价	员园
圆援关于教育和培训项目中信用约束及参与情况的证据 ...	员源
猿援初等和中等学校教育	圆猿
源援孩童时期的早期投资	圆怨
缘援青年期的干预	猿源
远援公共部门培训项目的有效性	源员
苑援税收政策	源怨
愿援经济效率与工作道德之间的矛盾	缘源
怨援结论 :生命周期的角度	缘缘
中国的人力资本投资	缘怨
员援人力资本投资的收益	远缘
圆援人力资本是否投资不足	远怨
猿援加大人力资本投资的政策和促进经济增长	苑怨
源援不平等	愿圆
缘援结论	愿猿
微观数据、异质性与公共政策评估	怨员
员援微观计量经济学 :起源与定义	怨远

经济政策、经济模型与计量经济学政策评估	愿
微观数据的新特征	远
潜在结果、与事实相反的状况和选择性偏差	愿
选择偏差与缺失数据	缘
微观动态分析和面板数据 状态依赖、生命周期中的	
劳动力供给与异质性	愿
政策效应	愿
宏观与微观计量经济学的统一：一般均衡政策评估 ...	愿
摘要和结论	缘
附录 愿：一致性条件与因果关系	远
附录 愿：边界分析与敏感性分析	愿
参考文献	愿

译摇者摇序

三年前,瑞典皇家科学院将新千年的第一个诺贝尔经济学奖颁发给了现任教于芝加哥大学经济系的詹姆士·允·海克曼教授,以表彰他在微观计量经济技术和劳动经济学的应用研究领域所做出的杰出贡献。当时,我们就萌生了将这位经济大师开创性的研究成果介绍给中国的经济学同行们和广大的经济学爱好者的想法。事隔三年,这个梦想终于成为现实。我们非常荣幸地承担了将海克曼教授三篇颇具代表性的著作译为中文的工作。

海克曼教授在微观计量经济和劳动经济领域的开拓性研究可以追溯到上世纪 40 年代。早在 1940 年,海克曼教授就以一篇研究妇女劳动供给的论文“影子工资、市场工资与劳动供给”,奠定了他无可争议的学术地位。在这篇文章及其后续论文中,海克曼教授开创了处理样本偏差和自选择问题的统计方法,从而从根本上解决了长期以来令社会科学研究者棘手的样本偏差问题。此举不仅为计量经济学奠定了坚实的微观基础,更意味着对经典应用研究的一种实质性突破。他的方法,如今被称为“海克曼校正”,已经成为经济学家和其他社会学家进行经验分析的标准分析工具。

海克曼教授的成就不仅在于他在微观计量经济学方法论上的开拓性工作,而且还在于他对微观计量技术与应用型实证研究的融合。尤其是他使用微观计量技术研究劳动经济学中关于个人的选择行为、劳动力供给、个人收益、工作动机、教育选择以及失业就业持续的时间等问题,并将微观计量技术应用于公共政策的评估等的创举,使他对该领域后续的研究和应用产生了深远的影响。

在中国,随着劳动市场体制改革的深入,各种劳动经济问题日益显露。诸如就业、失业、收入差距、劳动经济的统计指标体系设计和测量、教育培训政策、社会保障政策的评估问题等,已经迅速上升为中国经济学界的重大课题。而这些关系普通民众切身利益的问题恰恰也是海克曼教授关注的重点所在。熟悉了解海克曼教授在这些领域的思想和方法,对于分析和研究我国目前和未来的劳动经济难题,以及推进劳动经济学学科在中国的发展来说至关重要,这也是本次翻译工作的首要动因和目标。

此次被译为中文的三篇作品无论从理论和实践上都有十分重要的价值。“提升人力资本投资的政策”一文探讨了现代经济社会中人们获取技能的主要来源,并重点分析了认知技能和非认知技能在人们提高效率和赢得成功上的重要性;以及正式教育机构、家庭和企业等技能形成渠道各自的有效性等问题。

海克曼教授认为技能投资过程具有极强的动态累积特征。技能本身催生新的技能,初期投资会使后续投资更加容易。非认知型技能和动机是个人成功的两大决定性因素。而且较之认知型技能,非认知型技能更容易在后天得到持续的增进。因此,海克曼教授主张政府的投资政策应该优先重视对青少年在非认知型技能和动机方面的投资,这样会大大提高人力资本的投资效率。此外,政府还应一改过去重视正式教育、忽视非正式教育方式的政策倾向,因为家庭和其他非正式教育机构对个人的能力、动机产生着持续的影响,进而也决定着个人最终的成功。所有这些观点对于探讨我国教育改革方向、人力资本投资策略的选择等都具有极高的参考价值,其对我国“人才强国”战略的最终实现更具有深远的意义。

在“中国的人力资本投资”一文中,海克曼教授探讨了自上世纪 80 年代中期以来中国人力资本投资的实践以及相关的政策。他通过对微观数据的实证分析得出如下结论:无论是在 20 世纪 80 年代

晚期、20世纪年代早期,还是在今天,中国劳动力市场支付给个人的工资都远不及教育和技能投资所带来的生产力的提高。这种低回报率大大削弱了个人进行人力资本投资的积极性,致使中国目前人力资本投资严重的不足。海克曼教授认为中国劳动力市场的扭曲是人力资本投资低回报的主要根源。在这种扭曲的市场制度下,工资无法正确地反映受过教育和培训的劳动力所做出的真实边际贡献。

有鉴于此,海克曼教授提出了一系列旨在提高中国人力资本投资收益的政策建议,包括加大政府对教育的投入;实行灵活自由的劳动力市场;开放和发展资本市场;平衡物质资本和人力资本投资战略;平衡各地方对人力资本的投资;允许学校在提高办学质量上展开竞争;加强产业和大学之间的联系等。其中,进一步开放劳动力市场以及资本市场是海克曼教授特别强调的。他认为无论从长期还是短期来看,此举都有助于中国收入分配不平等的降低。

以上两篇文章从不同的角度体现了海克曼教授在人力资本投资方面的核心思想。而奠定这些思想的基础就是海克曼教授开创的微观计量经济学的方法论。在他的获奖演说“微观数据、异质性和公共政策评估”一文中,他着重总结了微观计量经济学对整个经济学的贡献。其中,有一大部分可以归功于他本人的研究成果,包括应用选择性数据建立劳动力供给模型;基于模型进行选择性偏差分析与政策评价;通过实证分析揭示出个人行为的多样性和异质性特征等。了解这些前沿的理论、方法和模型,不但对我国的微观计量经济学研究很有价值,更重要的是还能强化我们对微观计量技术的利用,以研究和解决我国劳动力市场中所面临的一系列重大问题。

作为本次翻译工作的发起者,中国人民大学劳动人事学院一直将及时追踪并学习借鉴国际前沿的劳动经济理论和研究方法作为自己的使命。从1982年建院至今,学院现已成为中国最重要的劳动经济、社会保障和人力资源管理专业的人才培养基地和学术

研究机构。1985年,经国家批准学院设立了当时国内惟一的一个劳动经济学博士点,1986年,劳动经济学以高票同意率和免于答辩的待遇成为全国优势显著的国家级重点学科,也是迄今全国惟一的劳动经济学国家级重点学科。1988年学院又相继设立了社会保障博士学位点和全国惟一的人力资源管理专业博士学位点。学院的蓬勃发展离不开我们历来对国际学术交流与合作的高度重视。迄今为止,学院已经与国际劳工组织劳工研究所、美国康乃尔大学产业和劳工关系学院、德国奥斯纳布鲁克大学社会科学院、英国卡地夫商学院等一批国外著名的学术组织建立了长期良好的合作关系。在建院 100 周年之际,我们不但有幸将海克曼教授的三篇代表作呈现给中国的读者,更有幸邀请到他本人在“人才强国论坛暨劳动人事学院建院 100 周年庆祝大会”上发表关于人力资本投资问题的演说。我们深切地期待着海克曼教授此行能掀起中国劳动经济学、人力资本理论和公共政策评估等领域的研究热潮。今后,学院还计划邀请更多的国际知名经济学家到访,以进一步增进国际间的学术合作与交流,为推动劳动经济学理论和实证研究在中国的日臻完善贡献自己的力量。

参加本次翻译工作的有曾湘泉、汪泽英、毛炳寰、汪雯、李莉、张珂、王月雅、朱飞等,曾湘泉和李雪松等承担了译文的校对工作。感谢复旦大学出版社,特别是苏荣刚先生对这本论文集出版所做出的努力。也感谢海克曼教授本人的大力支持,李海峥教授和博士生萨哈德的不懈努力。由于翻译时间紧迫,加之微观计量经济分析的一些表达在中英文里都十分生疏,译文中难免有不尽如人意之处,敬请同行专家见谅。

曾湘泉

1988年 10月 20日

中文版序

本文中译版的面世 ,是为了将我在微观计量经济学领域的研究成果更为直接地呈现给中国的广大读者。至此 ,我已有三篇文章被译成了中文 ,其中包括“提升人力资本投资的政策”、“中国的人力资本投资” ,以及题为“微观数据、异质性和公共政策评估”的诺贝尔经济学奖获奖演说。三篇文章虽然具有同等重要的地位 ,但各自涉及的领域却不尽相同。

前两篇文章的核心内容较为相似 ,均侧重于人力资本投资问题的论述。但获奖演说的关注点则与前两者迥异 ,在这篇演说词中我着力于总结微观计量经济学的理论、方法和模型对整个经济学的贡献。

“中国的人力资本投资”一文探讨了自上世纪 80 年代中期以来中国人力资本投资的实践以及相关的政策。其中 ,人们通过学校教育对人力资本的投资是本文特别的关注之处。文章首先探讨了人力资本投资的各种潜在收益。在此基础上 ,对中国教育人力资本投资的收益率进行了实证分析。最后 ,文章提出了促进技能资本投资的相关政策建议 ,以期使中国从人力资本投资中获得更大的回报。

“提升人力资本投资的政策”一文探讨了现代经济社会中人们获取技能的主要渠道 ,并重点分析了认知技能和非认知技能在人们提高效率和赢得成功上的重要性 ;以及正式教育机构、家庭和

企业作为人们获取技能的不同渠道,各自的重要性等问题。技能形成过程是一个具有极强的协同性的动态过程。由一项技能可以促成另一项技能,通过早期的投资可以促进后期的投资。非认知型技能和个人动机是个人成功的两大决定性因素。与基本的认知型技能不同,非认知型技能和动机可以随着年龄的增长得到持续的增进。然而,近来人们所使用的教育介入评价法忽视了非认知型技能的重要性,因此,大大地低估了早期介入项目、顾问指导方式和青少年动机培养项目的益处。从目前的投资水平来看,美国社会对青少年非认知型技能的投资明显不足,而对技能水平低下的成年人而言,这方面的投资却出现了过剩。

“微观数据、异质性和公共政策评估”一文主要总结了微观计量经济学对整个经济学的贡献。本文的主要观点可以概括为四个方面:首先,微观计量经济学家开发了一些新型工具来应对计量经济学在分析二战后涌现出的大量微观数据时所面临的难题;第二,微观计量经济学运用个人行为数据建立起了个人决策模型,从而推进了加总时间序列分析法的完善;第三,实证分析揭示出了该研究领域的一个重要规律,即个人行为的多样性和异质性;最后,微观计量经济学对公共政策的科学评价做出了实质性的贡献。

本译文是在中国人民大学劳动人事学院的鼎力支持下完成的。中国人民大学是我所知的中国最顶尖的高等学府之一。隶属于其中的劳动人事学院则以它为劳动经济学的教学和研究工作所做出的卓越贡献,以及它在中国劳动经济政策和改革层面的影响力在海内外享誉盛名。能接受学院的邀请,在即将到来的中国人民大学劳动人事学院建院 100 周年庆典上发表演说,我深感荣幸!我非常高兴能与该学院一同庆祝它 100 年来所取得的辉煌成就,更深切地期待着学院能再接再厉,在不久的将来发展为国际一流的劳动经济学的教育和研究中心。

在此 ,我要向本次翻译工作的发起者——中国人民大学劳动人事学院院长曾湘泉教授致以我个人最诚挚的谢意！译著的成功出版离不开他坚持不懈的努力。此外 ,我还要对本文的所有译者表示深深的感谢 ,他们的工作的确非常出色。

詹姆士·允·海克曼

2006年 10月 20日



詹姆斯·允 海克曼

2000年诺贝尔 经济学奖得主 简介

摇摇詹姆士·允·海克曼 1925 年生于美国芝加哥市,本科毕业于科罗拉多大学数学系。于 1951 年在普林斯顿大学经济系获得博士学位后,曾在哥伦比亚大学、耶鲁大学任教。从 1953 年起,他在芝加哥大学获任亨利·原舒尔茨杰出成就经济学教授。他和丹尼尔·麦克法登因在微观计量经济学领域所做出的杰出贡献而荣获 1996 年诺贝尔经济学奖。

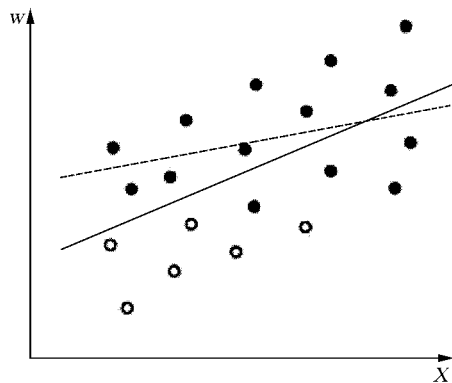
海克曼在微观经济学理论与方法论上做出了多项突出贡献，这些贡献多与自选择问题有关。他的方法论贡献是与其应用实证研究交织在一起的，特别在劳动经济学领域的研究。他在微观计量经济研究中对选择问题的分析，对于应用经济学研究乃至其他社会学科的研究都具有广泛而又深远的意义。

员爱选择偏差与自选择

选择问题在微观计量经济研究中大量存在。如果研究者得到的样本不能随机地代表其总体,就可能发生选择问题。一般来说,一个样本要么是数据收集规则的结果,要么是行为人个体行为的结果。后者就是一个自选择的过程。例如,就个人而言,我们只能获得有工作的人的工作时间及工资资料;我们只能观测到已经完成学业的大学毕业生的收入,等等。如果那些没有选择“工作”或“上大学”的人做出了相反的选择,他们的收入可能是多少?这些

信息的缺失给实证研究带来了许多问题。

选择偏差的问题可以用下图来说明,其中 w 代表每个人的工资, x 是某个决定工资的因素(比如说教育水平)。图中的每个点代表一个大的代表性样本中教育和工资水平相同的人。如果我们观测到所有人的工资和教育水平,我们估计到的统计关系(和真实关系)应当如图中的实线所示。现在假设只有那些市场工资超过某个阈值(保留工资)的个人会选择工作(这与经济理论是一致的)。在这种情况下,工资相对较高、教育年限相对较长的个体将会在我们实际观测的样本中有过多的代表(图中的实心点)。这一选择性样本导致了选择偏差问题:我们估计到的工资与教育的关系将会如图中的虚线所示。我们得到的关系将比真实的关系弱,因而会低估教育对工资的影响。



海克曼的贡献

海克曼在自选择方面的方法论突破发生在 20 世纪 70 年代中

期。这些突破与他本人对个人在劳动力参与和工作时间决策方面的研究密切相关。由于我们只能观测到那些已经选择工作的个体工作时间的变化,因此也遇到了自选择样本。在 1974 年发表的一篇研究已婚妇女劳动力供给的论文中,海克曼设计出一种解决自选择问题的计量经济方法。这份研究是将微观经济理论与微观计量方法结合起来研究重要课题的一个极好例证。

海克曼在随后的研究工作中又提出了另一种解决自选择问题的方法,即著名的海克曼矫正法(又称两阶段方法)。这个方法应用起来极为方便,因而影响十分深远。假设像上例中一样,一位研究人员想利用个体数据估计工资关系,但只有参加工作的人员的工资数据。海克曼矫正法分两个步骤:第一步,根据经济理论建立一个模型计算出个体工作的概率,通过该模型的统计估计可以得到每个个体的工作概率;第二步,将这些预测的个体概率合并为一个额外的解释变量,与教育、年龄等变量一起建立模型,从而矫正自选择问题。这样,估计工资关系的方法在统计上就适当了。

海克曼的研究成果带动了经济学和其他社会科学领域的大量实证研究。他本人及其他一些学者随后对海克曼这一创造性的方法进行了概括。

持续模型

持续模型在医学和工程学中有很长时间的应用。社会科学家经常使用这些模型,例如人口统计学家用它们来研究死亡率、出生率和迁移问题;经济学家用它们来研究失业持续期对就业概率的

影响。这些研究中共同存在的一个问题是,在仍然保持失业状态的人群中,缺乏劳动力市场前景的个体可能有过多的代表(选择偏差问题)。这种选择偏差引起的问题与自选择样本中遇到的问题完全类似:如果某一给定时点上失业者的样本受到未观察到的个体特征的影响,我们可能获得对失业“持续依赖”(长期失业)的误导性估计。在与詹姆斯·海克曼的合作中,海克曼发展了解决这类问题的计量经济方法。今天,这一方法论在整个社会科学领域得到了广泛应用。

源积极劳动力市场政策评价

随着许多国家中积极劳动力市场政策的推广(例如劳动力市场培训或就业补助),对这些政策进行评估的需求日益增加。传统的评估方法是,先确定一个具体项目对项目参与人员的收入或就业的影响,然后将其与这些人员未参加时的情况进行对比。由于同一个人不可能同时处于两种状态,我们只能使用未参加项目的人员的信息,这又一次引起了选择问题。在劳动力市场政策的微观计量经济评价领域海克曼居于世界领先地位。在与多位同事的合作中,他详尽分析了非实验评估方法的性质以及这些方法与实验方法的关系。海克曼还提供了自己的大量实证研究结果。尽管在不同的计划和不同的参与者中结果的差异非常显著,但这些结果大多是非常悲观的:许多项目对参与者只有很小的正效应,有时甚至还是负的,这与社会效率标准并不一致。



詹姆士·允 海克曼

提升人力资本 投资的政策

内 容 摘 要

本文^①讨论了在现代经济中获取相关技能的不同手段,强调了认知技能、非认知技能在经济生产和社会生活中的重要作用,以及正式的教育机构、家庭和企业在学习方面的重要性。技能形成是一个动态的过程,由若干相互影响和制约的重要因素构成;技能本身催生新的技能,初期投资直接带来后续的追加投资。非认知技能和动机是赢得成功的重要决定因素;同时,与认知技能相比,它们在后天得到显著改善的余地更大。由于当前被用来评价教育工作的不同做法都忽视了非认知技能,因此就导致了对早期教育工作、启蒙工作、青少年激励工作真正价值的显著低估。在人力资本投资的现阶段,美国社会在低龄人群上投资太少,在成年人的低水平技能上则投资过多。

① 见毛泽东《与章开沅书》，《美国国家经济研究局，辛炳基早于茅泽东回恩》，1989年10月，溧水：溧水增刊。

摇摇在当前的劳动力市场上,具备高技能、高学历的工人工资在持续上升,那些技能和学历水平较低的工人的实际工资则有所下降。为了应对这种全新的形势,世界各国都希望通过相关政策的制定来强化那些对社会生产有益的技能。一直以来,政治家和社会活动家们都在密切关注由经济发展不平衡所导致的政治和社会后果;而他们达成的共识是,提升非熟练工人的技术水平将有助于他们融入现代经济,并缓解当前的不平等状况;同时,增加熟练工人的供给也将有利于缩减熟练工人和非熟练工人之间在工资和就业状况上持续扩大的差异。

在美国,当前所有党派都认为在财政和教育管理领域进行改革是十分必要的。而在其他各国,政治家们也都对通过政策制定来提升技能水平十分感兴趣。

在这篇论文中,我审查了当前有关技能获取的不同政策所赖以存在的基础。通过参考近期内多个国家里的有关文献(很多文献都对国家相关政策的基本前提提出了置疑),我也对我们的政治家们在制定这些政策时的明智程度进行了考察。这篇论文指出,在现代经济中,政府应该以更广阔的视角去考虑那些可以获取和提升技能水平的途径。如果这一研究成果能够为主流社会所接受的话,它将大幅度改变当前社会关于技能获取的既有观念。

在当前,有关教育和职业培训的政策都建立在对个人掌握技能方式的错误认识之上。它们单纯关注由成绩或随测试体现出来的认知技能,对社会性技能、自我约束能力和其他一些决定成功与否的非认知技能则漠不关心。过于重视认知能力和由考试分数体现出来的“学术智慧”,忽视社会适应性和动机问题,就会导致对人力资本投资行为的评价出现偏差。

在大多数政治家、所谓的“有识之士”甚至很多专业学者的既有观念中,正式的教育机构都被看成是现代经济所需各种技能的