

制度变迁对经济增长的影响研究

吴 肖, 寿建敏

(上海海事大学 水运经济研究所, 上海 201306)

摘要:主要是从经济制度的角度研究制度变迁对经济增长的影响,对于制度变量的量化,采取大多数学者普遍采用的指标进行研究:非国有化水平、市场化程度、对外开放程度和政府对财政的干预程度。通过研究 1981 年~2013 年全国的指标,运用柯布一道格拉斯生产函数模型,分析制度变迁因素对经济增长的影响,根据以上数据运用软件对数据进行一系列的检验得出结果并分析其经济含义,并在此基础上给出一些建议。

关键词:制度变量;经济增长;软件分析

中图分类号:F061.2 **文献标志码:**A **文章编号:**1671-1807(2016)03-0067-04

自 1978 年,中国经历了 30 多年的经济体制改革,尤其是加入 WTO 后,中国又逐渐主动靠近 WTO 成员国们的市场经济体制。改革开放后中国的经济发生了天翻地覆的变化,从而吸引了国内许多学者的关注,许多研究都是从理论上概述中国经济增长的原因。传统发展理论认为,经济增长的主要原因是本国的资本积累;新古典经济学理论中,加入资本和劳动力这两个因素,认为他们是经济增长的动力;而新古典增长理论则认为在假定制度是既定、外生的条件下,技术进步是经济增长的主要原因。

20 世纪 90 年代初始,我国就已开始定量研究制度与经济增长之间的关系。林毅夫^[1]认为 1978 至 1984 年间,我国农业快速增长的主要原因就是制度革新,家庭联产承包责任制的诞生对于本时段农业增长贡献了 46.8%。卢中原,胡鞍钢^[2]则首次对我国的制度变革进行量化,量化指标为市场化指数,他们的研究中表明 1978 至 1992 年间 GNP(国民生产总值)增长的比率中大约有 14% 都是市场化改革引起的。另外,郭克莎^[3]认为,中国改革最实质的就是产权结构的变化,并用非国有工业总产值的比重作为制度变量。许健等^[4]在对制度变迁与经济增长的关系研究中,采用结构化模型进行研究,结果显示出物质资本投资和制度变迁是两个最主要的因素。

金玉国^[5]认为我国宏观制度的变迁主要表现在产权制度变迁、市场化程度提高、分配格局变化和对外开放扩大四个方面,并首次从这四个方面进行了量

化测度,比较各个因素的影响力大小,其中贡献最大的就是制度变量因素的建立与提出。王文博等^[6]在金玉国专家的基础上首次加入产业结构这一因素。付晓霞,吴利学^[7]的研究中则通过运用柯布一道格拉斯生产函数研究制度变迁与经济增长的关系。洪华喜等^[8]采用了 Samuelson 动态模型,分两个角度来研究两者关系,研究结果显示制度变迁对经济增长有正向作用,我国的经济还会继续增长。

王金营^[9]通过对人力资本和物质资本因素的对比研究,在前人的经验上第一次建立了三种模型:人力资本外部性模型、人力资本增进型制度变迁模型、物质资本增进型制度变迁模型,并对这三种模型的结果进行对比发现物质资本积累在制度变迁中具有重要作用。潘慧峰等^[10]运用内生增长模型,创新在将制度变迁引入该模型,在一系列假设前提下研究了制度对于经济增长影响的内在机制。许多学者认为,制度变迁对经济增长有决定作用,但是靳涛^[11]通过 VAR 模型研究发现不是制度变迁对于经济增长具有决定作用,而是经济增长对于我国经济体制转向具有作用。

李艳华^[12]和李国璋等^[13]对于制度变迁和人力资本两者对于经济增长进行实质研究,他们两人的研究结果显示两个因素都影响着经济增长,人力资本因素的影响力不断增强,而制度因素在不断下降。金元等^[14]和季民河等^[15]采用面板数据,对于该方面进行了研究。

收稿日期:2015-10-30

作者简介:吴肖(1993—),女,安徽宿州人,上海海事大学水运经济研究所,技术经济及管理专业硕士研究生,研究方向:项目评价与决策;寿建敏,男,上海人,上海海事大学水运经济研究所,教授,硕士生导师,博士,研究方向:港航产业与经济研究。

上述众多学者对制度与经济的关系进行了多方面的研究,然而所用研究数据有点久远,没有根据最近发展数据进行探讨,而且对于时间序列的检验等方面研究尚少,因此本文通过1981—2013年时间序列数据的一些检验,研究制度与经济的最新发展关系。

1 制度与经济增长关系

所谓经济制度,是指内在规定了人们从事经济活动的激励水平及交易成本的规则体系,这个规则体系的目的是促进经济活动,进而促进经济增长。另一方面,经济增长的影响因素有内生因素也有外生因素,内生因素主要有投资、贸易的影响,外生因素有制度变迁的影响。这篇文章主要从外部因素来研究经济增长的影响因素。马克思很早以前就提出生产力决定生产关系,生产关系反作用于生产力,一旦生产关系适应不了生产力,就会阻碍发展,需要建立新的生产关系,而生产关系的本质就是制度,通过生产关系更替来适应生产力的发展就是对制度变迁影响经济这一观点的论证。除此之外,诺斯的产权理论中认为,产权理论可以有效地解释经济增长,产权具有引导人们最大化地实现外部性激励功能,可以降低交易费用等功能,从而产权成为影响经济绩效的重要因素。从中国历史悠久的发展中,我们可以看出制度变迁对于经济的重大影响,从建国后的计划经济到改革开放之后的市场经济,以及历代历朝安邦定国的新政对于经济都产生了举足轻重的作用。

而我国制度与经济的现状则是:社会主义市场经济体制已经初步建立,市场化程度大幅度提高,宏观调控体系更为健全,我国经济发展已经处在一个新的起点上。但是我国的社会主义市场经济在运行中还存在着很多问题,主要是市场秩序不规范,以不正当手段谋取经济利益的现象广泛存在;生产要素市场发展滞后,要素闲置和大量有效需求得不到满足并存等。

2 变量选择与模型建立

2.1 变量选择

在对制度变量的量化上,根据国内学者们对于制度变迁和经济增长的研究,可以看到很多人采用的是金玉国对于制度变量的量化方法。因此本文也采用同样的方法,选用金玉国老师对于制度的量化方法进行研究。金玉国的研究中主要有四个变量:非国有化水平、市场化程度、政府干预程度和对外开放程度。其中,非国有化水平用非国有经济的总值占国内生产总值的比重表示;市场化程度用投资的市场化指数表

示,即全社会固定资产投资中“外资、自筹资金和其他投资”占总投资的比重;政府干预程度用政府财政支出占GDP的比重来衡量;对外开放程度用对外贸易依存度表示,即进出口总额与GDP的比率;本文也选用这些变量来衡量制度的影响。

2.2 模型建立

根据柯布一道格拉斯函数模型,引入制度变量,建立模型:

$$Y = AK^a L^b e^{r_1 x_1 + r_2 x_2 + r_3 x_3 + r_4 x_4 + \epsilon}$$

其中:Y代表产出(gdp),A代表技术进步、人力资本等其他未显示的进步生产函数的增长因素,K和L分别代表资本投入和劳动投入,分别用全社会固定资产投资和分行业就业人数来衡量; x_1 、 x_2 、 x_3 、 x_4 是制度变量量化后的变量,分别为非国有化水平、市场化程度、对外开放程度和政府干预程度;a和b为参数, ϵ 为随机干扰项。对变量取对数不会改变其计量关系且能减少时间序列的波动性以及异方差,因此对上式取对数后得到:

$$\ln gdp = \ln A + a \ln K + b \ln L + r_1 x_1 + r_2 x_2 + r_3 x_3 + r_4 x_4 + \epsilon$$

3 实证研究

根据EViews 6.0软件回归之后,根据最初模型得到:

$$\ln gdp = -8.093 + 0.425 \ln K + 0.875 \ln L + 0.005 x_1 + 0.002 x_2 + 0.065 x_3 + 1.769 x_4$$

$$T \text{ 值} \quad -3.21 \quad 15.266 \quad 3.905$$

$$0.725 \quad 0.006 \quad 0.556 \quad 4.601$$

$$P \text{ 值} \quad 0.0035 \quad 0.0000 \quad 0.0006$$

$$0.475 \quad 0.9953 \quad 0.5827 \quad 0.0001$$

$$R^2 = 0.9986 \quad \hat{R}^2 = 0.9982 \quad F = 2998.93$$

3.1 单位根检验

首先对变量进行ADF单根检验来验证数列是否平稳。运用Eviews6.0软件得到表1。

由表1可知各个变量都是在二阶时达到平稳性的,且是在1%的显著水平下达到平稳,因此可以进行时间序列分析。

3.2 协整检验

当变量同处平稳时,对其进行协整检验,因为检验的主要是制度和经济增长的影响,且制度便令用四个指标来衡量,就相当于多个变量之间的协整检验,因此这里采用JJ协整检验对变量进行检验。结果见表2。

表 1 单位根检验结果

变量	ADF 检验值	1%水平下	5%水平下	10%水平下	是否平稳
lngdp	-2.024	-4.273	-3.558	-3.212	不平稳
D(gdp(-1),2)	-4.553	-4.297	-3.568	-3.218	平稳
lnk	-1.967	-4.273	-3.558	-3.212	不平稳
D(k(-1),2)	-5.417	-4.297	-3.568	-3.218	平稳
lnl	-1.229	-4.273	-3.558	-3.212	不平稳
D(lnl(-1),2)	-9.394	-4.297	-3.568	-3.218	平稳
x1	-1.652	-4.273	-3.558	-3.212	不平稳
D(x1(-1),2)	-7.885	-4.297	-3.568	-3.218	平稳
x2	-2.569	-4.273	-3.558	-3.212	不平稳
D(x2(-1),2)	-6.184	-4.297	-3.568	-3.218	平稳
x3	-1.275	-4.273	-3.558	-3.212	不平稳
D(x3(-1),)	-7.927	-4.297	-3.568	-3.218	平稳
x4	-0.699	-4.273	-3.558	-3.212	不平稳
D(x4(-1),2)	-6.070	-4.297	-3.568	-3.218	平稳

注:表中类似 D(gdp(-1),2)格式的都表示是在二阶差分时的结果。

表 2 协整检验结果分析

Hypothesized No. of CE(s)	Eigenvalue	0.05 Critical Value	Trace statistic	0.05 Critical Value
None*	36.982 65	30.439 61	83.152 01	60.061 41
At most 1*	24.421 943	24.159 21	46.169 35	40.174 93
At most 2	12.587 17	17.797 30	21.739 93	24.275 96
At most 3	8.713 904	11.224 80	9.152 760	12.320 90
At most 4	0.438 856	4.129 906	0.438 856	4.129 906

由表 2 得知在最大特征值统计量检验和迹统计量检验下,检验结果都表明在 5%的显著水平下存在两个协整关系。协整模型为:

$$\ln gdp = 7.791x_2 + 1.860x_3 - 1.390x_4; x_1 = 43.082x_2 + 22.538x_3 - 167.641x_4$$

3.3 格兰杰因果关系检验

格兰杰因果检验主要是用于检验变量之间是否具有因果关系,以证实研究价值,所以用软件检验之后,结果见表 3。

表 3 格兰杰因果关系检验结果分析

Null Hypothesis;	Obs	F-Statistic	Prob.
X1 does not Granger Cause LNGDP	31	0.020 63	0.979 6
LNGDP does not Granger Cause X1		1.371 69	0.271 4
X2 does not Granger Cause LNGDP	31	1.268 56	0.298 1
LNGDP does not Granger Cause X2		10.255 9	0.000 5
X3 does not Granger Cause LNGDP	31	1.145 91	0.333 5
LNGDP does not Granger Cause X3		0.513 43	0.604 4
X4 does not Granger Cause LNGDP	31	1.172 73	0.325 4
LNGDP does not Granger Cause X4		1.705 79	0.201 3

由表 3 知, x_1, x_3, x_4 不是 GDP 增长的原因,即

非国有化率、对外开放和政府干预对经济增长的作用很小,但是市场化程度 x_2 对经济增长是有很大作用的,这在一定程度上说明了制度对经济的影响。

4 结果分析及建议

4.1 结果分析

通过上面进行一系列的分析得到最初建立的模型基本正确,且模型中系数也符合逻辑,在回归结果方程中,可以看出劳动和资本的投入对经济的增长产生的影响比较大,制度对于经济增长的作用在这二者的作用下显得不是特别明显,但从其四个指标的正系数可以看出是有正向影响的。

由此看出,推动经济增长更多的还是要从劳动投入和资本投入入手,主要是体现在以下方面:

1)资本要素的系数是 0.425,其含义是每增加 1%的资本投入,经济会增长 0.425%,这说明政府应当重点着手于资本的建设,即增加固定资产的购买或建设。

2)劳动要素的系数是 0.875,含义是每增加 1%的劳动投入,GDP 增加 0.875%,这就说明政府需要创造更多的就业机会,使得失业率降低,更多的人能

够自给自足,以带动经济的发展。

3)关于制度的系数,因为这里有四个指标,且其中影响最大的是第四个指标:政府对财政的干预程度,其系数是1.769,其含义和劳动、资本要素的含义相同。这就说明,在制度变迁的影响因素中,较为重要的是政府的干预程度,在之后的发展中,国家需要适度的进行干预,但不可用力过猛。

4.2 建议

根据上面的模型系数结果可知,政府干预力度影响较为明显,因此在未来的一段时间内,可以根据国家政策的变化,适当的干预来发展经济,在“新常态”下,经济正在转型,这种时候经济制度就要更为的适合经济的发展。虽然中国现在已经摆脱计划经济,走向市场经济,但是一些新的制度尚未完全建立健全,因此就这方面,在此提出一些小建议。

首先,在所有制方面,坚持公有制为主体,多种所有制混合的基本经济制度,发展国有经济,让国有资本、集体资本、非公有资本等相互融合,充分建立国有资本主导地位,混合所有制的核心在于国有经济经营管理,因此在此方面,需要在国有经济的混合所有制改革方面取得成效。

其次,在土地制度方面,首先确保耕地红线,然后创新土地流转的方法,保护农民的权益。土地制度改革的成功与否是衡量新一轮经济体制改革成败的关键,政府需要总结各地经验,不断创新,尽可能的使土地流转灵活又能保证农民的合法权益。

第三,在分配制度方面,加大初次分配和再分配的调节力度,缩小贫富差距。收入分配制度改革主要是形成公平的分配机制,消除灰色收入,而随着中央对腐败这方面的打击力度,可以看到灰色收入在我国的猖獗,因此改革的重点在于继续加大反腐力度,规范垄断企业高管的收入以及加大转移支付的力度,努力提高低收入者的工资等。

最后,要适应经济“新常态”,实现新的跨越,需要抓紧经济制度改革这条主线。

参考文献

- [1] 林毅夫. 制度、技术与中国农业发展[M]. 上海:上海三联出版社,2005:64—67.
- [2] 卢中原,胡鞍钢. 市场化改革对我国经济运行的影响[J]. 经济研究,1993(12):49—55.
- [3] 郭克莎. 地区工业所有制结构变动及其与工业发展的关系[J]. 1996(4):72—81.
- [4] 许健,何晓群. 中国经济增长源泉的量化研究[J]. 经济经纬,2000(6):41—43.
- [5] 金玉国. 宏观制度变迁对转型时期中国馆经济增长的贡献[J]. 财经科学,2001(2):24—28.
- [6] 王文博,陈昌兵,徐海燕. 包含制度因素的中国经济增长模型及实证分析[J]. 当代经济科学,2002(2):33—37.
- [7] 付晓霞,吴利学. 制度变迁对中国经济增长贡献的实证分析[J]. 南开经济研究,2002(4):70—75.
- [8] 洪华喜,廖晓祥. 制度变革对云南省经济增长的贡献评价[J]. 经济问题探索,2003(1):63—67.
- [9] 王金营. 制度变迁对人力资本和物质资本在经济增长中作用的影响[J]. 中国人口科学,2004(4):11—17.
- [10] 潘慧峰,杨立岩. 制度变迁与内生经济增长[J]. 南开经济研究,2006(2):74—83.
- [11] 靳涛. 揭示“制度与增长关系之谜”的一个研究视角——基于中国经济转型与经济增长关系的实证研究[J]. 经济学家,2007(5):18—26.
- [12] 李艳华. 人力资本与制度变迁对中国经济增长的影响[J]. 中国经济问题,2009(6):64—69.
- [13] 李国璋,周彩云. 人力资本与制度变迁对我国经济增长作用的实证分析[J]. 西北师大学报:社会科学版,2010(1):106—111.
- [14] 金元,汪浩瀚. 制度变迁与中国经济增长关系检验——基于中国省际面板数据分析[J]. 商场现代化,2011(21):149—151.
- [15] 季民河,姜磊,武占云,等. 中国经济增长与制度变迁的空间面板数据分析[J]. 地域研究与开发,2011,30(6):1—5.

The Influence of System Change on Economic Growth

WU Xiao, SHOU Jian-min

(Academy of Science & Technology, Shanghai Maritime University, Shanghai 201306, China)

Abstract: This article aims to study the effect of institutional change on economic growth from the Angle of the economic system. For quantitative system variables, this paper adopt the index that most scholars generally adopt: denationalization level, degree of marketization, the degree of opening to the outside world and the government's intervention in the financial. Through the study of national index in 1981~2013, using Cobb-Douglas production function model, this paper analyzes the factors' influence on economic growth. Based on the above data, using software results and analyzes its economic meaning, and gives some suggestions.

Key words: system variables; economic growth; software analysis