财经研究
Journal of Finance and Economics
Vol. 38 No. 6
Jun. 2012

城镇居民收入差别"阶梯型"变动的理论解释与实证检验

陈宗胜[1],马草原[2]

(1. 南开大学 经济研究所,天津 300071;2. 西安交通大学应用经济学博士后流动站,陕西 西安 710049)

摘　要:文章对改革开放以来中国城镇居民收入差别变动过程中的"阶梯型"特征进行了研究。理论模型分析表明,劳动差别决定着城镇居民收入差别的基本走向,同时市场化体制改革措施的逐次推进,通过"制度诱发型"效率增进与收入差别的相互反馈效应在短期内会放大收入差别,然后政策的效果出现衰减,又引发了再一轮的改革,从而导致了收入差别扩大路径上的"阶梯型"特征。实证检验支持了理论模型的结论和前提。文章的政策含义是,制度变革过程中一定要注意市场化改革措施的收入差别效应及程度,防止单纯追求效率的增进而造成收入差别的拉大,有效而恰当的改革措施应充分考虑经济效率与收入差别的均衡关系。

关键词:城镇收入差别;"阶梯型"特征;劳动差别;制度变革

中图分类号:F126.2　**文献标识码**:A　**文章编号**:1001-9952(2012)06-0004-12

在以往的研究中,理论界较早注意到中国居民整体收入差别长期变动中的一个明显特征,即居民收入差别整体呈现"阶梯型"扩大,[①] 并提出用经济体制改革和制度创新来解释这种阶梯型变异。在后续研究中,一些经济学者发现城镇居民收入差别的变动轨迹实际上也具有相同的特征,并对这一问题进行了基于微观家户数据的讨论。但以往的分析大多属于直观推断和定性描述,本文则试图在一个数理模型基础上阐释城镇居民收入差别短期"阶梯型"变动现象,并给出经验数据验证。

一、改革与发展中城镇居民收入差别"阶梯型"变动模型

在我国学术界所熟悉的"公有经济收入差别倒 U 理论模型"中,陈宗胜证明了劳动差别是经济中决定收入差别的基本因素。本文借鉴这一研究成果,

收稿日期:2011-03-28

基金项目:国家社会科学基金重大项目"深化收入分配制度改革与增加城乡居民收入研究"(07&ZD045)

作者简介:陈宗胜(1954—),男,山东乳山人,南开大学经济研究所教授,博士生导师;
马草原(1979—),男,甘肃庄浪人,西安交通大学应用经济学博士后流动站研究人员。

也将劳动差别作为收入差别的基本影响因素。

(一)模型的基本假设。第一,假定经济中劳动者的收入差别主要来源于其劳动差别。这一假定与我国改革开放的基本举措(承认和激励劳动者的劳动差别并体现在居民收入差别中)是一致的。设劳动差别为 Y 且是时间 t 的函数,而时间 t 定义为经济发展的较长扩张期(如改革开放后的 30 多年)。因此,劳动差别从经济发展初期 t_0 时刻开始扩大,为简化模型,设扩大路径是线性的。但劳动差别的扩大有其极限,到达时刻 t^* 之后(即完成扩张期或完成二元结构转换),劳动差别不再扩大。劳动差别函数构造如下:

$$Y(t)=\begin{cases} Y_0 & t<t_0 \\ Y_0+\theta t & t_0\leqslant t<t^* \\ Y^* & t\geqslant t^* \end{cases} \tag{1}$$

第二,体制改革的基本目的是提升经济效率。在我国制度变革的过程中,追求效率增进并改革平均主义分配机制(即“大锅饭”)是各种改革措施的鲜明特征,改革措施引起的效率提升大多以弱化“平均主义分配”,即引起收入差别的扩大为条件,如城镇市场化改革措施中的“多劳多得”、奖金制度、计件工资制度等。也就是说,“制度诱发型”的效率增进将同时引起收入差别的扩大。[②] 以 X_t 代表经济效率的增进,G_t 是对收入差别的衡量。于是,某一时刻的收入差别既反映劳动差别的基本影响,也应反映效率取向的制度变革的影响:

$$G_t=Y_t+\beta X_{t-1},\quad \beta>0 \tag{2}$$

基于上述假设,劳动者的收入差别以其劳动差别为基础,为简化起见,假定劳动者的劳动差别在其收入差别中得到完全的体现,因此(2)式中 Y_t 的系数为 1。由(2)式可得,$G_{t-1}=Y_{t-1}+\beta X_{t-2}$,与(2)式结合并整理得:

$$G_t=G_{t-1}+(Y_t-Y_{t-1})+\beta(X_{t-1}-X_{t-2})=G_{t-1}+\Delta Y_t+\beta\Delta X_{t-1} \tag{3}$$

(3)式是从动态角度对收入差别的解析,其中 ΔY_t 表示本期劳动差别的变化,ΔX_{t-1} 为制度变革导致的效率增进的变化,也就是说本期的收入差别来源于三个部分:一是上一期收入差别及其影响,二是劳动者劳动差别的变化,三是效率增进型制度变革对收入差别的影响。

第三,收入差别的扩大对效率的提高存在一种反馈效应,收入差别的扩大激励了劳动者的积极性和创造性,这将进一步提高经济效率。从而有:

$$X_t=X_0+\pi(G_t-G_{t-1}),\quad \pi>0 \tag{4}$$

其中,X_0 是在 t 期除制度变革以外的其他途径(如技术进步)引起的效率增进。

(二)效率取向制度变革与收入差别阶梯型变动的关系。为了研究导致收入差别呈阶梯状变动的基本因素,这里首先假定劳动差别(及其相关变量)不变,而集中研究经济体制改革措施对收入差别变动轨迹的影响。将(4)式代入(2)式并整理可得:

$$G_t - \pi\beta G_{t-1} + \pi\beta G_{t-2} = \beta X_0 + Y_t \tag{5}$$

根据(3)式和(4)式，π的大小决定了收入差别扩大(通过激励劳动的积极性)对效率增进的影响程度，而β则是效率取向的市场化改革措施对“平均主义”弱化效应的大小，即引起收入差别扩大的作用大小。因此，$\pi\beta$表示效率增进与收入差别扩大之间的相互作用程度(因π和β都为正)。若在某个时点上推行了一项效率导向的制度变革使经济效率开始提高，由(2)式可知，收入差别将因此而扩大。求解(5)式的差分方程如下：其特征方程为：$b^2 - \pi\beta b + \pi\beta = 0$。该方程的两个特征根为：

$$b_1, b_2 = [\pi\beta \pm \sqrt{(\pi\beta)^2 - 4\pi\beta}]/2 \tag{6}$$

由(6)式可知，体制改革导致收入差别呈阶梯型变动的轨迹可分为两种不同的情况：

第一种情况：当$(\pi\beta)^2 - 4\pi\beta < 0$，即效率增进与差别扩大相互影响较弱时收入差别的变动轨迹。

$(\pi\beta)^2 - 4\pi\beta < 0$，即$\pi\beta < 4$，说明$\pi\beta$较小，表明两者间反馈效应较弱。此时差分方程只有复根，G_t的时间路径为“周期波动型”，也可形象地称为“横向的阶梯型”，因为假定劳动者之间的劳动差别不变，即$Y = Y_0$，所以G_t围绕一个跨期的均衡水平波动。其波动中心是(5)式的特解，即$G_p = Y_0 + \beta X_0$，见图1a。也就是说，在经济体制改革措施的刺激和推动下，收入差别变动轨迹将围绕一个均衡水平周期性地波动，这个均衡水平恰好是制度变革措施出台之前，由劳动差别决定的收入差别(这里假定不变)，加上制度变革措施的影响。

那么，在这种情况下，收入差别G_t运行路径的周期波动具有怎样的敛散性特征？从数学逻辑上看，敛散性取决于方程共轭复根的绝对值是否小于1。然而，我国改革开放的实践表明，效率增进始终是改革开放的主旨。当G_t进入下行区间即收入差别下降时，由于G_t对效率变化率的刺激作用减小，效率增长速度会减缓。这预示着新的制度变革措施即将出台，从而会再次促进效率的改进或提升，并引致收入差别G_t在t_{n+1}时刻扩大到新的高度，从而突破周期性波动并呈现上升的“台阶”(见图1b)。

由此可见，收入差别变动轨迹由“横向的阶梯”变为“上倾的阶梯”正是持续出台的体制改革措施推动和提升的结果。

第二种情况：当$(\pi\beta)^2 - 4\pi\beta \geqslant 0$，即效率增进与差别扩大相互影响较强时收入差别的变动轨迹。

$(\pi\beta)^2 - 4\pi\beta \geqslant 0$，即$\pi\beta \geqslant 4$，说明$\pi\beta$较大，表明效率的增进与收入差别扩大之间有较强的反馈效应。此时，差分方程有实根，由特征方程和假设条件可知：

$$b_1 + b_2 = \pi\beta, b_1 b_2 = \pi\beta, \beta > 0, \pi > 0$$

可见，$b_1 > 0$，$b_2 > 0$，因此收入差别G_t的运行路径是非振荡的。由于$\pi\beta \geqslant$

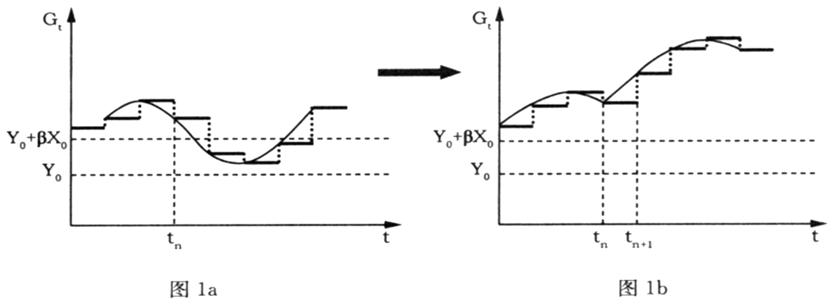


图 1a　　　　图 1b

图 1　收入差别运行轨迹由周期波动(图 1a,左)转换为上倾阶梯型(图 1b,右)

(假定劳动差别不变、效率增进与差别扩大相互影响较弱)

4,而且 $b_1+b_2=\pi\beta$,$b_1b_2=\pi\beta$,所以 $|b_1|<1\cap|b_2|<1$ 不可能成立。由此可知,收入差别 G_t的运行路径必然持续发散,即呈现持续扩大趋势。

随着收入差别的持续扩大,经济效率将会不断提高,但在劳动差别不变即劳动者付出的劳动努力不变的基础上,收入差别的不断扩大会使劳动者的不满逐渐累积,差别扩大的容忍度下降。这预示着抑制收入差别扩大的政策将会出台,从而导致收入差别 G_t在 t_{n+1}时刻扩大的增幅减小,由持续发散转为较平缓的台阶,即呈现“台阶式”特征(见图 2)。

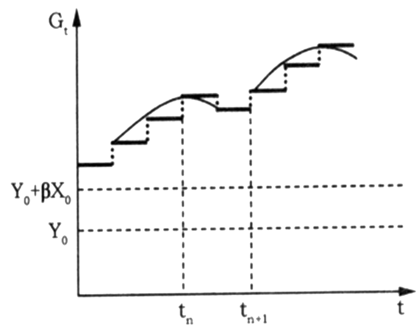


图 2　收入差别运行轨迹由持续发散转换为阶梯型(假定劳动差别不变、效率增进与差别扩大相互影响较强)

需要说明的是,图 2 和图 1b 形式上颇为相似,但二者运行机制有本质区别:在图 1b 中,收入差别 G_t在 t_n时刻的下降是效率增进速度变化和收入差别相互作用的内生结果;而在图 2 中,收入差别 G_t在 t_n时刻的下降则是体制改革政策调控的外生结果,此时政府不但要注重经济效率的提高,而且必须采取相应措施抑制与效率提高相伴的收入差别的不断扩大,即收入差别 G_t运行方向的改变都是改革政策所致。这一情形本质上体现了“效率导向”与“追求均等”两种改革措施的平衡和对改革方向的把握。

(三)劳动差别变动与收入差别“阶梯”斜率的关系。上述分析假定劳动差别及其导致的收入差别不变,在这种情况下收入差别的阶梯型变动正是体制改革措施在不同时期推出所致。那么,劳动差别的扩大会有怎样的影响?

当劳动差别不再是常数而是关于时间 t 的线性函数时,(5)式将变为:

$$G_t - \pi\beta G_{t-1} + \pi\beta G_{t-2} = \beta X_0 + Y_0 + \theta t \tag{7}$$

(7)式实质上是引入时间趋势项的二阶差分方程,劳动差别随着时间不断扩大将会改变收入差别 G_t 的变动路径。这一路径取决于(7)式的特解。(7)式的特解为:

$$G_p' = Y_0 + \beta X_0 + \theta\pi\beta + \theta t \tag{8}$$

(8)式是引入劳动差别变化之后收入差别 G_t 运行路径的动态均衡。显然,这个动态均衡水平是关于时间的线性函数,这相当于提高了收入差别 G_t 变动路径的斜率(见图 3)。从长期看,收入差别将随着劳动差别的上升而上升,制度变革措施对收入差别的影响会引起收入差别的短期表现形式发生变化,即发生阶梯型变异,而不是在没有体制改革的情况下较光滑的轨迹。也就是说,引入劳动差别的影响后,收入差别"阶梯型"由平缓会变得更加陡峭了,即阶梯型更加向上倾斜,差别程度更大,但是否呈现阶梯型与劳动差别无关,只与体制改革措施有关,需要分析。将(8)式的截距与在 $Y = Y_0$ 时收入差别 G_t 的稳定均衡水平 $G_p = Y_0 + \beta X_0$ 进行比较可知,与劳动差别不变的情况相比,经济体制改革和政策变革所导致的收入差别是以劳动差别为基础的(见图 3中的较粗虚线)。

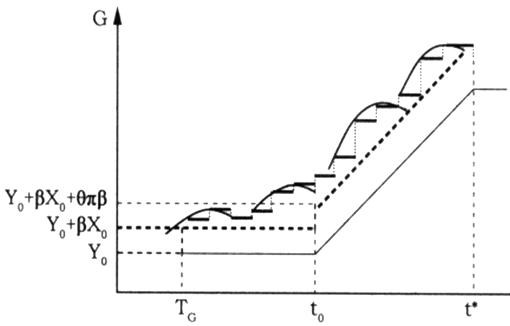


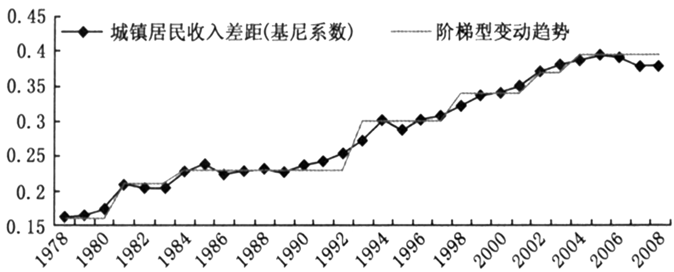
图 3 劳动差别不变、扩大和制度变革与收入差别的"阶梯型"特征

图 3 刻画了三种不同条件下收入差别的变动轨迹。纵轴表示收入差别的大小,横轴代表时间。细实线表示劳动差别的变动走向,即在 t_0 之前保持不变,在 t_0 之后线性扩大;粗虚线表示三种不同条件下收入差别变动所围绕的均衡水平,即劳动差别对收入差别运行路径的制约,与劳动差别相比,这一均衡水平不仅包含了劳动差别,还包括了制度变革的影响,因此高于劳动差别(当体制改革未推行,即 $t < T_G$ 时,收入差别等于劳动差别,在图中表现为细实线和粗虚线的重合);间断的粗实线表示收入差别 G_t 的变动路径。当劳动差别等于收入差别时,即在 T_G 之前,收入差别保持常数不变;当劳动差别仍假定不变,但制度变革从 T_G 开始,即 $T_G < t < t_0$ 时,效率取向政策变革力度的逐次提升将引起收入差别出现较小斜率的阶梯型上升;当制度变革和劳动差别的上升并存,即如 $t_0 < t < t^*$ 时,收入差别 G_t 运行路径将以更大斜率出现阶梯型扩大。

二、计量检验

上述模型分析表明,劳动差别是决定收入差别的基本因素。随着经济发展和改革开放的推进,劳动差别逐步扩大,因而收入差别必然相应上升;在此期间出台的效率导向的体制改革举措也会推动收入差别扩大,但改革措施推出时间和力度的不同导致了收入差别变动轨迹呈现阶梯型。这大致契合了城镇居民收入差别的历史轨迹(见图 4)。

自 1978 年以来,中国城镇体制改革在初始阶段主要表现为公有制企业和集体企业内部奖罚制度的激励,这促进了人们的劳动积极性,在短期内拉开了劳动差别,从而引起收入差别上升到基尼系数 0.2 的水平,并在这个台阶上稳定了几年;1984 年后城镇借鉴农村的做法实行全面的承包制等措施,再次引起收入差别的上升。但城镇改革的初期是试探性的,可以认为这一阶段的劳动差别并未迅速扩大,体制改革只使城镇收入差别表现为温和的阶梯型扩大,其中 1989—1991 年中央政府采取了一系列整顿措施,经济体制改革的力度减缓,导致收入差别在这一阶段变化很小,甚至在 1989 年还出现了下降。



数据来源:1978—1991 年基尼系数数据(陈宗胜,1994),1992—2001 年(陈宗胜和周云波,2002),2002—2006 年(周云波和覃晏,2008),2007 年和 2008 年数据由作者测算得到。

图 4 改革开放以来城镇居民收入差别的"阶梯型"变动

1992 年中央明确提出了建立市场经济体制的改革目标,改革力度加大,外资逐渐引进,所有制控制开始逐步放松,尤其是从 1995 年开始,国有企业改革进入攻坚阶段,民营、私有经济的比重迅速增加,基于不同所有制的劳动差别迅速拉大,推动了城镇居民收入差别呈现明显的阶梯型上升。这种趋势一直持续到 2005 年前后(之后城镇居民收入差别变动不大,甚至有所回落,这是否意味着收入差别进入倒 U 型的后半段,即进入到收敛阶段,还需要验证)。可见,城镇居民收入差别的历史轨迹大致与理论模型的推导是一致的。当然,这还需要进行严格的计量分析和证明。

为了进一步检验经济体制改革与城镇居民收入差别阶梯型轨迹的相互关

系，下面使用1978—2008年城镇总体时间序列数据，对理论模型的结论和前提进行验证。

（一）变量选取与样本说明。

1. 以基于数据调整测算的“城镇居民收入基尼系数”（GINI）作为衡量城镇收入差别的变量。③

2.“效率取向”的制度变革（REFORM）指标的选取。不断提升经济效率是1978年以来我国制度变革的基本目的，效率取向的改革措施有很多，收入差别的扩大是各项制度变革共同作用的结果。进一步看，所有重要的改革措施都可归结于市场化程度的提高。但在中国现实经济中，市场化程度可以从很多方面进行测量，如企业市场化、产业市场化、价格市场化以及劳动力市场化等。考虑到本文的主要研究对象是城镇居民收入差别，而在上述所有市场化程度的测量指标中，劳动力市场化程度的“收入分配效应”无疑是最大的，本文以“城镇劳动力市场化程度”来代表与“城镇居民收入分配”最相关的制度变革措施，具体使用“城镇非公有制经济就业比重”来测度。从整体改革进程看，这一比重反映了劳动力市场化程度的最主要部分，但也难免有所疏漏。比如，在改革的某些阶段城镇劳动力市场化并非主要体现在公有和非公有制劳动力的比重上，而在于公有制经济内部“用工自由”和“薪酬激励机制”等政策的逐步实施，遗憾的是这些制度变革很难量化。因此，本文主要关注由“城镇非公有制经济就业比重”所测度的城镇劳动力市场化程度，并以此近似代表整体情况。④

（二）市场化改革与收入差别变动之间因果关系和脉冲响应关系检验。本文计量分析的样本期间为1978—2008年，⑤所有计量过程均在Eviews5.0上实现。由于对收入差别“阶梯型”问题的研究有赖于刻画变量之间的短期关系，而这类研究很难用单方程模型估计加以解决，这里使用Sims（1980）提出的向量自回归模型（VAR）进行短期动态分析。我们首先进行了变量单位根检验和变量协整关系检验，结果见表1和表2。

表1　变量单位根检验(ADF检验)

变量	检验类型	ADF统计值	5%临界值	p值
GINI	(c,0,0)	－0.9509	－2.9639	0.7574
REFORM	(c,0,1)	0.3495	－2.9678	0.9769

表2　变量GINI和REFORM的协整检验

零假设	特征值	迹统计值	10%临界值	P值
没有协整关系	0.3862	0.4955	13.4288	0.0786
至多1个	0.0175	14.1601	2.7055	0.4815

由表1可知，市场化程度（REFORM）和城镇收入差别（GINI）都是一阶单整序列。由表2可知，GINI和REFORM之间具有协整关系。于是我们建

立了基于收入差别与劳动力市场化程度协整基础上的 VAR 模型进行动态分析,最优滞后期的选择依据似然比统计量 LR、赤池准则 AIC 和施瓦茨准则 SC 联合确定。通过反复比较,最终确定滞后 2 阶的 VAR 模型为最优模型,模型稳定性和残差检验结果见表 3。

表 3　VAR(2)模型稳定性和残差检验

自相关检验	滞后期	1	2	3	4	5	6	7	8
	LM 值	3.25	1.93	1.3	2.79	8.71	3.21	0.92	2.94
	P 值	0.52	0.75	0.86	0.59	0.07	0.52	0.92	0.57
模型稳定性检验	Root	0.97	0.78	0.01−0.06i	0.01+0.06i				
	Modulus	0.97	0.78	0.0642	0.0642				
异方差检验	$\chi^2(24)=32.56$,P=0.12								

我们将首先基于稳定的 VAR(2)进行 Granger 因果关系检验,以确定市场化改革和收入差别两个变量之间的作用方向。同时,为了验证政策变革的推出是否造成了收入差别“阶梯型”扩大及贡献大小,我们将基于稳定的 VAR 模型进行脉冲响应和方差分解分析。

表 4 结果显示:“体制改革(REFORM)不是收入差别(GINI)的 Granger 原因”的原假设在 3%的显著性水平上被拒绝,而“收入差别(GINI)不是体制改革(REFORM)的 Granger 原因”的原假设在 18%的显著性水平上被拒绝。如果以 5%作为判断标准,上述检验说明由 GINI 和 REFORM 的滞后值所决定的 GINI 的条件分布与仅由 GINI 的滞后值确定的 GINI 的条件分布有显著差异。这说明体制改革确实是引起收入差别变动的 Granger 原因,但收入差别不是体制改革的 Granger 原因。其经济含义为体制改革的阶段性推进引起了城镇居民收入差别的不断扩大。

表 4　GINI 和 REFORM 之间的 Granger 关系检验

零假设	χ^2 统计值	滞后期	p 值
REFORM 不是 GINI 的 Granger 原因	6.897	2	0.03
GINI 不是 REFORM 的 Granger 原因	3.393	2	0.18

图 5a 显示了城镇居民收入差别对市场化改革措施新息过程一个标准差冲击的响应。来自市场化变革的冲击引起城镇居民收入差别扩大,冲击效应在第 2 期达到最大,然后逐渐减小。这形象地刻画了体制改革对收入差别拉大作用从较快放大到后期衰减的特征。

图 5b 是对城镇收入差别进行方差分解的结果。图中虚线代表来自 GINI 自身及除体制改革以外的所有因素对城镇收入差别的影响比例,而实线代表来自 REFORM 的影响比例。图 5b 清楚地显示,GINI 的预测标准误差中可由 REFORM 解释的比例逐步扩大,第 3 期达到 16.45%,第 7 期达到 20.31%,到第 10 期以后基本稳定在 21%—22%。考虑到现实中影响 GINI

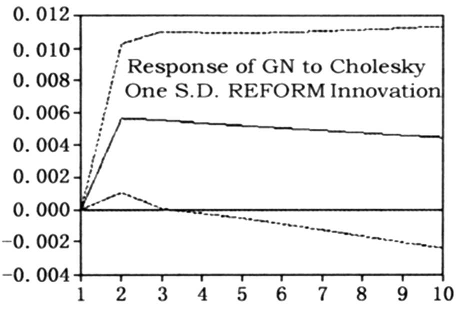


图5a

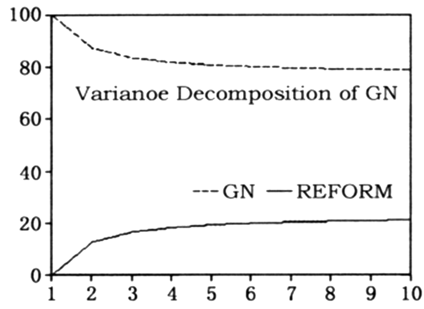


图5b

图5 GINI和REFORM之间的脉冲响应和方差分解

系数的因素很复杂,而其中仅由市场化程度一项就能解释近22%,这一解释力度还是比较大的。另外,需要对样本期间的影响做出说明。自2005年以来,中国城镇收入差别已经出现了下降,这种下降是否会持续目前还不得而知,但是在计量模型中是否包含这一阶段会对分析结果有一定影响。剔除2005年以后城镇居民收入差别下降的样本,以1978—2005年子样本建立VAR(2)模型,对GINI进行方差分解分析(见表5),结果显示体制改革措施对收入差别的总体解释力度提高至近27%,比全样本的解释力度提高近6%。这表明相对全样本而言,市场化取向的制度变革对收入差别上升阶段的子样本有更强的解释力。

(三)收入差别扩大与效率增进之间存在相互反馈效应的检验。收入差别扩大与效率增进之间具有相互反馈效应是本文理论模型的关键假设,因此应在实证研究中得到检验。但是通过计算城镇经济增长中生产率的变化直接验证理论模型中效率增进是否与收入差别之间相互反馈,使用目前已有的数据存在不少困难。

表5 1978—2005年子样本VAR(2)模型GINI方差分析

时期	SE	GINI	REFORM
1	0.0108	100	0
2	0.0148	87.43	12.57
3	0.0178	83.62	16.38
4	0.0203	80.93	19.07
5	0.0227	78.90	21.10
6	0.0248	77.27	22.73
7	0.0268	75.94	24.06
8	0.0288	74.82	25.18
9	0.0306	73.87	26.13
10	0.0325	73.06	26.94

这里借鉴黎德福和陈宗胜(2007)的研究结果。他们的研究证明,改革以来我国经济总体效率的增长比较迅速,对产出增长的贡献超过60%(黎德福和陈宗胜,2007)。由此推论,对城镇经济效率提高的贡献率可能更高(近70%)。本文使用对数收入(LNINCOME)的一阶差分变量(本质上是经济增长率的变化率)近似地反映经济效率的增进速度,并用其与GINI的差分变量

建立 VAR(2)模型,用于检验效率增进和收入差别扩大之间的相互反馈效应。

图 6 分析结果在一定程度上证明了本文"经济效率增进与收入差别扩大具有相互反馈效应"的前提假设,其反应机理是:市场化制度变革所诱发的效率增进促进了经济增长率的提高,而效率的提高要以收入差别的扩大为代价,表现在脉冲响应上恰好是经济增长率对收入差别有正向短期影响,并且这一影响是迅速的,收入差别变量的反应在第 2 期就达到最大;反之,收入差别的扩大激励人们发挥自己更多的劳动能力,这必然反馈到经济效率的增进上,进而体现在经济增长率的提升上,只是这一反应过程要相对滞后一些。

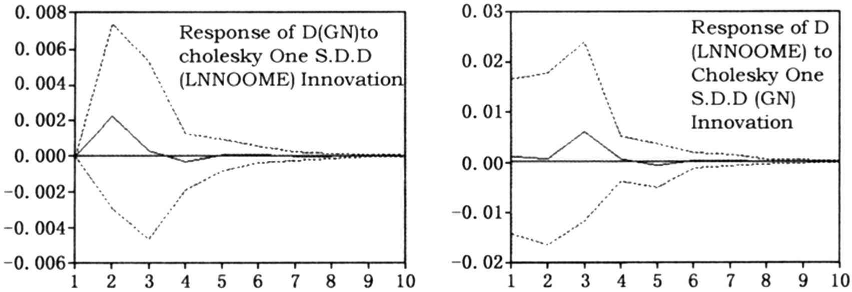


图 6　GINI 与 LNINCOME 差分变量的脉冲响应过程

三、总结与政策建议

本文针对以往讨论的城镇居民收入差别"阶梯型"变动这一现象,给出了进一步的规范证明。首先假定劳动差别是经济中决定收入差别的基本因素(或者其他因素的影响也归为劳动差别的影响),然后集中讨论了体制改革对城镇居民收入差别变动的影响,描述了逐次推出的市场化体制改革措施如何引起收入差别扩大路径上的阶梯型变动。这一模型为长期以来人们所观察到的中国城镇收入差别"阶梯型"扩大现象提供了一个理论解释。

本文还使用改革开放以来 31 年的时间序列数据,对理论模型的前提和结论进行了检验。经验分析支持了本文的理论模型假说。基于 VAR 模型的计量分析显示制度变革是城镇收入差别变动统计意义上的原因,表明市场化改革推进的影响效应在短期内达到最大之后转而衰减,即"阶梯型"变动。实证分析中还使用对数城镇人均可支配收入和收入基尼系数的一阶差分变量建模,证明了两者之间有正向相互作用,从而证明了本文理论模型中"收入差别扩大与效率增进之间存在反馈效应"的关键假设。

本文结论的政策含义是,在推动城镇市场化改革过程中,要充分关注其对收入差别的影响程度,阶梯型的每一个"台阶的高度"要以人们在相应时期内的承受力为限,欲速则不达。另外,在体制改革措施的推进过程中要注意收入

差别扩大与经济增长效率之间的均衡关系，二者相互影响的程度虽略有不同，但具有正向关系已得到证明，因此不能只顾一个方面而忽略了另一个方面。

注释：

①参见陈宗胜，“倒U曲线的‘阶梯型’变异”，《经济研究》，1994年第5期。此后，李实、赵人伟和张平(1998)也得出了类似的结论，他们将1978—1995年的改革划分成四个阶段，用来说明总体收入差别的阶段性变化。

②需要强调的是，这里的效率增进主要是制度变迁带来的效率变化，实际上效率的增进还来源于技术进步与人力资本提升等方面，与其他效率提高的途径相比，制度安排提升的效率往往要以收入差别的拉大为代价。当然，个别相反的例子总是有的，但基于科学研究的抽象方法，我们主要关注制度变迁对收入差距的影响，而对其他因素及个别例子则暂时不纳入模型进行考察。

③这里，城镇居民收入基尼系数(GINI)是在国家统计局公布的数据基础上经过调整得到。调整的原因是直接使用不加调整的国家统计局公布的数据测算中国城镇居民收入分配状况会造成较严重的低估，并且这种估算结果与基于典型调查测算的结果也有着较大差异。调整的详细方法见陈宗胜和周云波(2002)。为了审慎起见，我们曾专门就此方法咨询了相关部门的统计专家，国家统计局的许宪春先生曾与作者就此问题进行了讨论并认可这一调整的思路，认为由此计算得出的结果更为可靠。当然数据调整思路见仁见智，可以再另行讨论。

④测度城镇劳动力市场化程度的指标还有多种，或者也可是综合性的，请参见陈宗胜，《关于经济体制市场化程度的测度》，上海人民出版社，2000年版。

⑤数据来源于相关年份《中国统计年鉴》、《国民收入统计资料汇编(1945—1985)》以及《新中国五十五年统计资料汇编》。

主要参考文献：

[1]边燕杰，张展新.市场化与收入分配——对1988年和1995年城市住户调查的分析[J].中国社会科学，2002，(5)：97－111.

[2]陈宗胜.经济发展中的收入分配[M].上海：上海三联书店，1991；上海人民出版社，1994.

[3]陈宗胜.关于收入差别倒U曲线及两极分化研究中的几个方法问题[J].中国社会科学，2002，(5)：78－82.

[4]陈宗胜，周云波.城镇居民收入差别及制约其变动的某些因素——就天津市城镇居民家户特征的影响进行的一些讨论[J].经济学(季刊)，2002，(2)：563－574.

[5](美)蒋中一，(加)温赖特.数理经济学的基本方法(第四版)[M].北京：北京大学出版社，2006.

[6]刘精明.市场化与国家规制——转型期城镇劳动力市场中的收入分配[J].中国社会科学，2006，(5)：110－124.

[7]罗楚亮.经济转型、非正规就业与城镇增长的穷人受益性[J].管理世界，2008，(10)，21－29.

[8]钱敏泽.库兹涅茨倒U字形曲线假说的形成与拓展[J].世界经济，2007，(9)：56－63.

[9]王检贵.倒U现象是不是一条经济法则？——对罗宾逊经典结论的质疑[J].经济研究,2000,(7):63－67.

[10]周文兴.中国城镇居民收入分配与经济增长关系实证分析[J].经济科学,2002,(1):40－47.

[11]周云波.城市化、城乡差距以及全国居民总体收入差距的变动——收入差距倒U形假说的实证检验[J].经济学(季刊),2009,(4):1239－1256.

[12]Bleaney M, Nishiyama A. Income inequality and growth: Does the relationship vary with the income level? [J]. Economics Letters, 2004, 84(3):349－355.

[13]Chen B-L. An inverted-U relationship between inequality and long-run growth [J]. Economics Letters, 2003, 78(2):205－212.

[14]Rauch J. Economic development, urban underemployment, and income inequality [J]. Canadian Journal of Economics, 1993, 26(4):901－918.

Theoretical and Empirical Research on Echelon Changes in Income Gap among Urban Residents in China

CHEN Zong-sheng[1], MA Cao-yuan[2]

(1. *Institute of Economics, Nankai University, Tianjin* 300071, *China*; 2. *Postdoctoral Station of Applied Economics, Xi'an Jiaotong University, Xi'an* 710049, *China*)

Abstract: This paper studies the echelon changes in income gap among urban residents in China since its reform and opening up. The theoretical analysis shows that labor differences determine the trend in income gap among urban residents and the gradual advance of market system reform leads to a widening income gap in the short term by an interaction of institution-driven efficiency improvement and income gap; the policy performance reduces, and another round of reform occurs, resulting in the echelon changes in income gap among urban residents. And the empirical study confirms the conclusions and premises of the theoretical model. This paper provides policy suggestions that we should pay attention to the effect of marketization reform on income gap in the process of institutional transition and effective and adequate reform measures should take full account of a balanced relationship between economic efficiency and income gap.

Key words: income gap among urban residents; echelon feature; labor difference; institutional transition

（责任编辑　许　柏）