

国内收入差距对产业内贸易的影响研究

刘翠翠¹, 夏 蕾²

(1. 华中科技大学 经济学院, 湖北 武汉 430074;

2. 江西科技师范大学 经济管理学院, 江西 南昌 330031)

摘 要:文章从理论和实证两个层面探讨了国内收入差距对产业内贸易的影响。理论模型表明,当一国是制成品的净出口国时,制成品的产业内贸易水平与国内收入差距正相关;当一国是制成品的净进口国时,制成品的产业内贸易水平与国内收入差距负相关。此外,文章还运用 Johansen 协整检验实证检验了我国城镇收入差距对工业制成品产业内贸易水平的影响,发现城镇收入差距在长期提高了我国工业制成品的产业内贸易水平。

关键词:收入差距;产业内贸易;制成品

中图分类号:F710 **文献标识码:**A **文章编号:**1001-9952(2012)06-0091-11

一、引 言

产业内贸易是指一个国家或地区同时进口和出口同一个产业内产品的贸易活动,是衡量一国外贸竞争力的重要指标。与基于要素禀赋的差异和比较优势而产生的产业间贸易不同,产业内贸易主要源于产品差异、规模经济以及消费者需求的相似性和多样性等,它使得各国集中生产特定产业内某些式样的产品,深化了产业内分工和生产专业化。随着我国对外开放程度的不断提高,产业内贸易迅速发展,逐渐成为进出口贸易的重要组成部分。以工业制成品为例,基于《中国统计摘要 2010》数据的计算结果表明,自 1991 年起,我国工业制成品的产业内贸易指数均大于 0.5,产业内贸易份额已超过产业间贸易,成为制造业贸易的主要形式。

大量的经验研究表明,贸易会对国内收入差距产生影响。反过来,国内收入差距是否会影响产业内贸易呢?这是一个值得思考和研究的问题。对该问题的探究有助于明确我国以工业制成品为主的产业内贸易的影响因素,从而对于我国优化贸易结构、提升外贸竞争力具有重要的现实意义。鉴于我国城乡二元经济结构的典型特征,而且自 20 世纪 90 年代,城镇收入差距的扩大速

收稿日期:2012-02-28

作者简介:刘翠翠(1987—),女,山东菏泽人,华中科技大学经济学院博士生;

夏 蕾(1987—),女,江西九江人,江西科技师范大学经济管理学院讲师。

度就已超过农村,再加上城镇人口比重不断增加,城镇内部收入差距的重要性日益凸显,成为拉大全国收入差距的结构性因素(李实,2011),本文重点考察城镇收入差距对产业内贸易的影响。

二、文献综述

很多关于产业内贸易的文献都集中于研究产业内贸易的影响因素。产业内贸易的影响因素有很多,既有供给方面的因素,如产品的差异性、规模经济、市场结构等,也有需求方面的因素,如需求结构、收入水平等。Linder(1961)的偏好相似理论便是需求方面的代表性研究,他指出产业内贸易是由消费者需求偏好的相似性导致的,两个国家的消费者需求偏好越相似,其需求结构重叠程度越大,产业内贸易量就越大。这一理论可被直观地理解为在消费者存在异质性偏好的前提下,贸易类型除了依赖于两个国家的相对收入差距外,也取决于各国的收入水平及其收入分配状况。两国的收入分配状况和人均收入水平越相似,则产品的需求结构越相似,相互间开展产业内贸易的可能性就越大(Dalgin,2010)。

不少学者就人均收入水平对产业内贸易的影响进行了探讨,并得到了基本一致的结论:人均收入高会产生更多种差异性需求,从而推动产业内贸易的发展。譬如,Balassa等(1987)、Dalgin等(2008)和潘沁等(2006)的研究均发现,产业内贸易水平与贸易国的人均收入正相关。

相比之下,关于国内收入差距对产业内贸易影响的研究相对不足。Francois和Kaplan(1996)指出Linder(1961)关于收入水平对产业内贸易的影响研究中包含两个层面的含义:(1)若两贸易国的收入水平不同,对于人均收入较高的国家而言,其收入分配越平等,则消费差异性商品所占的收入份额就越高;(2)若两贸易国的收入水平相似,分配越不平等的国家,消费差异性商品所占的收入份额反而越高。前人的研究只强调了第一点,忽视了第二点。他们还指出发展中国家的收入分配状况是其从发达国家进口制成品数量的重要决定因素,一国收入分配越不平等,差异性较大的制成品进口量就会越大。从某种程度上讲,他们的研究已经表明制成品产业内贸易与一国收入分配状况密切相关。

在此基础上,一些国外学者开始关注国内收入不平等对产业内贸易的作用。Mitra和Trindade(2005)从需求的角度探讨了收入不平等与贸易的关系。他们指出在消费者异质偏好的假设下,当两个国家的收入分配状况不同,而其他所有的条件(要素禀赋、技术水平等)都相同时,两个国家仍会产生贸易,而且产业间贸易与产业内贸易之比与一国的收入不平等程度呈“V”形关系。Dalgin等(2008)通过引力模型研究了一国收入分配状况对贸易量和贸易类型的影响。结果表明,奢侈品(差异性较大)的进口量与进口国的收入不平

等程度正相关,必需品(差异性较小)的进口量与进口国的收入不平等程度负相关。因此,当进口国的收入差距扩大时,该国奢侈品的产业内贸易量会随之改变。Dalgin (2010)实证考察了一国收入分配与产业间及产业内贸易的关系。检验结果表明,一国收入不平等程度对产业间贸易的影响不显著,而对产业内贸易则有显著的正向影响。

目前,我国大多数学者关于产业内贸易的影响因素研究主要集中于实证研究。他们通过分析主要得出产品的多样化、外商直接投资、规模经济、市场结构、贸易国之间的收入差距等因素与我国的产业内贸易显著相关(马剑飞等,2002;邵玲和谢建国,2008;程大中,2008;周茂荣和吕婕,2009;等)。

不难发现,我国学者关于产业内贸易的影响因素研究主要侧重于供给角度,在需求方面主要考察了贸易国之间的收入差距及各国的人均收入水平,而鲜有学者研究我国收入分配状况对产业内贸易的影响。国外学者的研究已经证实,收入结构通过影响需求结构影响产业内贸易水平。而对于收入结构与产业内贸易之间关系的研究,仅仅考虑人均收入水平是远远不够的,国内收入差距也是产业内贸易的重要影响因素。国外学者的研究结论在我国是否适用?我国收入差距对产业内贸易的作用又如何?本文拟从这一层面着手分析,为研究收入结构对我国产业内贸易的影响提供一个更广阔的视角。

三、理论模型

理论模型借鉴了 Mitra 和 Trindade(2005)的基本建模思路,不同之处在于,他们只分析了产业间贸易与产业内贸易之比与一国收入不平等程度的关系,而未对产业内贸易水平与国内收入差距的关系进行探讨,而本文正是从这一角度出发,研究国内收入差距对产业内贸易水平两种不同的影响路径,重点考察制成品净出口国的国内收入差距对制成品产业内贸易水平的影响。

(一)封闭经济

假定经济体中只有两类产品:生活必需品(F)和制成品(M),其生产都需要投入两种生产要素:资本(K)和劳动力(L)。商品 F 是同质的,商品 M 是异质的,每个制成品厂商的产品都存在差异性,制成品市场是垄断竞争市场,消费者对制成品的偏好存在异质性。为了分析方便,假定 F 的价格为 1, M 的价格为 p ,其中 p 是 n 类制成品价格的加权,定义为 $p = [\sum_{i=1}^n p_i^{(1-\epsilon)}]^{-\frac{1}{\epsilon}}$ 。其中, p_i 为第 i 类制成品的价格, $\epsilon (> 0)$ 为不同制成品之间的替代弹性,同时也是每一类制成品的需求弹性。 ϵ 越大,制成品的异质化程度越低。

对于任何一个消费者 j 而言,假定他对 F 和 M 的消费量分别为:

$$C_F^j = [1 - \varphi(p, Y^j)] Y^j, C_M^j = \varphi(p, Y^j) Y^j / p$$

其中, Y^j 为消费者 j 的收入水平, $\varphi(p, Y^j)$ 为消费者 j 用于消费制成品的收入份

额, $1-\varphi(p, I^j)$ 为消费者 j 用于消费必需品的收入份额。相对于生活必需品而言, 制成品可被看作是奢侈品, 其需求收入弹性大于 1。因此, 我们可以假定 $\partial\varphi(p, I^j)/\partial I^j > 0$, 即当消费者的收入水平提高时, 用于购买制成品的收入份额会随之增加。

假定经济体中有两个消费群体: 富人(R)和穷人(P), 各占总人口数 L 的一半。所有消费者的收入来源均有两种: 提供劳动获得工资和投入资本获得利息。自我国经济体制改革以来, 国民收入逐渐多元化, 由单一的工资性收入演变为劳动报酬和资本收入并存。而且在国民收入分配中, 资本收益所占份额越来越高, 近几年已经超过劳动报酬, 成为造成我国收入差距不断拉大的主要因素。在此, 假定劳动者的工资水平相同, 消费者的收入差距主要是通过资本拥有量的差别体现的。R 和 P 的资本拥有量占全社会总资本 K 的比例分别为 σ 和 $1-\sigma$ ($1/2 \leq \sigma < 1$)。当 $\sigma=1/2$ 时, 富人和穷人拥有的资本量相等, 社会不存在不平等; 当 $1/2 < \sigma < 1$ 时, 富人的资本拥有量大于穷人, 社会存在不平等。

由此, 富人和穷人的收入水平可分别表示为: $I^R = r\sigma K + wL/2$, $I^P = r(1-\sigma)K + wL/2$ 。其中, r 表示资本回报率, w 表示劳动力的工资水平。

若整个社会的不平等程度用基尼系数来衡量, 则基尼系数 $\text{gini} = \frac{I^R}{(rK + wL)} - \frac{1}{2}$ 。显然, 基尼系数与 I^R 同方向变动, 而 I^R 又是 σ 的增函数。因此, 基尼系数是 σ 的增函数。由此我们得出命题 1:

命题 1: 当富人的资本占比 σ 增加时, 整个社会的不平等程度加剧。从某种意义上讲, 可以用 σ 来测量社会的不平等程度, 当 $\sigma = \frac{1}{2}$ 时, $\text{gini} = 0$, 社会绝对平均。 σ 越大, 基尼系数越大, 社会不平等程度越大。

由于社会中有 R 和 P 两个消费群体, 那么整个社会对 M 和 F 的消费总量可以表示为: $C_M = C_M^R + C_M^P$, $C_F = C_F^R + C_F^P$ 。对于任一消费者而言, 随着收入的增加, 他对 M 和 F 的消费都会增加, 但由于 $\frac{\partial C_M^j}{\partial I^j} = \frac{\partial}{\partial I^j} \left[\frac{\phi(p, I^j)}{p(1-\phi(p, I^j))} \right] > 0$ ($\partial\phi(p, I^j)/\partial I^j > 0, 0 < \phi(p, I^j) < 1$), M 的消费增加量会大于 F 的消费增加量。因此, 在以 M 的消费量为纵轴、F 的消费量为横轴的坐标系中, 任一消费者的消费路径(所有收入水平上制成品和必需品消费量的组合形成的轨迹)都是从原点出发且往右上方倾斜的凸曲线, 则总消费路径也是从原点出发且往右上方倾斜的凸曲线(见图 1)。由此, 不难推导出命题 2:

命题 2: $\frac{\partial C_M}{\partial \sigma} > 0$ 。随着社会不平等状况的改善, 即 σ 减小, 制成品 M 的总消费量会减少。随着社会不平等程度的加深, 即 σ 增大, 制成品 M 的总消费量会增加。

证明: σ 减小,相当于从富人手中转移一部分财富到穷人手中。假设 σ 减少 $\Delta\sigma$,则穷人的财富会增加 $rK\Delta\sigma$,富人的财富会减少 $rK\Delta\sigma$ 。富人的预算线 I^R 下移,穷人的预算线 I^P 上移。于是,穷人对 M 的消费量增加,而富人的消费量则减少。但富人对制成品消费的减少量超过了穷人对制成品消费的增加量,这一点不难从图 1 中看出。所以,整个社会对 M 的总消费量就会减少。同理,当 σ 增大时,整个社会对制成品 M 的消费量会增加。命题得证。

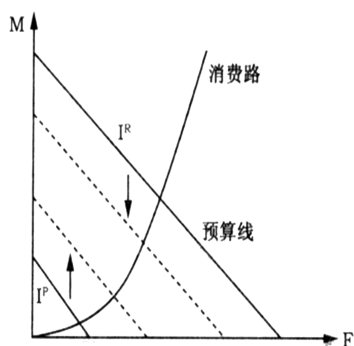


图 1 收入再分配对两类商品消费量的影响

(二) 开放经济

假定世界上只有两个国家:本国 H 和外国 F 。在开放经济条件下,各生产厂商面临的消费市场不再局限于国内,而扩展为整个世界市场。两国产生双边贸易,既有产业间贸易,也有产业内贸易。假定本国为制成品净出口国,外国为制成品净进口国。

先讨论生产者的行为。由于我们重点考察收入分配对制成品产业内贸易的影响,因此下面的分析只考虑制成品厂商。假定每个厂商只生产一类制成品,每类制成品的边际成本相同且定义为 $\mu_M(w, r)$ 。每类制成品生产之前都需要投入一定的资本品作为固定投资,假定这部分固定投资的最优要素组合与边际成本部分的要素使用比例相同,所支付的成本可定义为 $\alpha\mu_M(w, r)$,其中 $\alpha > 0$,则对于每个制成品厂商,其生产总成本 $C(w, r, x_M) = \alpha\mu_M(w, r) + \mu_M(w, r)x_M$,其中 x_M 为该厂商的生产总量。平均成本则可表示为:

$$AC(w, r, x_M) = \frac{\alpha\mu_M(w, r)}{x_M} + \mu_M(w, r)。 \quad (1)$$

根据厂商利润最大化的条件 $MR = MC$,可得:

$$p(1 - \frac{1}{\epsilon}) = \mu_M(w, r) \quad (2)$$

在垄断竞争市场上,当市场达到均衡时,每个厂商的利润为零,即 $p = AC$ 。结合式(1)可得:

$$p = \frac{\alpha\mu_M(w, r)}{x_M} + \mu_M(w, r) \quad (3)$$

式(2)和式(3)联立可得厂商的均衡产量为: $x^* = \alpha(\epsilon - 1)$ 。当市场均衡时,每个厂商的制成品产量只与 α 和 ϵ 两参数有关,与其他变量无关。

下面我们研究国内收入差距对制成品产业内贸易的影响。假定本国和外国对每个厂商制成品的需求量分别为 D^H 、 D^F ,则有 $D^H + D^F = x^*$ 。两个国家

的制成品种类分别为 n^H 和 n^F , 且 $n^H = n^F$ 。则本国制成品的出口量为 $D^F n^H$, 进口量为 $D^H n^F$, 总贸易量为 $D^F n^H + D^H n^F$ 。

由于本国是制成品的净出口国, 用 GL 指标测量的制成品产业内贸易水平可以表示为 $GL = 1 - \frac{D^F n^H - D^H n^F}{D^F n^H + D^H n^F} = \frac{2D^H}{D^F + D^H} = \frac{2D^H}{x^*}$ 。不难看出, 制成品产业内贸易水平与 D^H 正相关。由命题 2 可知, 本国对制成品的需求量 D^H 与 σ 正相关, 而 x^* 与 σ 不相关。因此, 产业内贸易水平与 σ 正相关, 即产业内贸易水平与本国收入不平等程度正相关。由此我们得出命题 3:

命题 3: 当一国是制成品的净出口国时, 制成品的产业内贸易水平与该国的收入差距正相关。即当该国的收入差距扩大时, 产业内贸易水平将会提升; 反之, 当该国的收入差距缩小时, 产业内贸易水平会随之降低。

当本国是制成品的净进口国时, 同理我们可以推导出命题 4:

命题 4: 当一国是制成品的净进口国时, 制成品的产业内贸易水平与该国的收入差距负相关。即当该国的收入差距扩大时, 产业内贸易水平将会降低; 反之, 当该国的收入差距缩小时, 产业内贸易水平将会提高。

四、实证分析

本文通过把工业制成品产业内贸易和城镇收入差距、FDI、规模经济纳入一个统一的分析框架中, 实证检验城镇收入差距和工业制成品产业内贸易的相关性。实证分析取 1981—2009 年为样本区间。

(一) 变量设计和数据来源说明

1. 收入差距。测度城镇收入差距的指标有很多, 包括基尼系数、泰尔指数、极值比等。鲁晓东(2008)结合洛伦兹曲线和统计资料的特点, 设计了一个简单易行的非等分组的计算方法: $gini = 2 \sum_i (\sum_i P_i) Y_i - 1 - \sum_i Y_i P_i$ 。其中, $gini$ 表示基尼系数, Y_i 表示第 i 组人口总收入占全部总收入的比例, P_i 表示第 i 组人口数占全部人口总数的比重, $\sum_i P_i$ 表示累积到第 i 组的人口总数占全部人口总数的比重。本文正是采用该方法来定义城镇内部收入差距的, 并参考《中国统计年鉴》中的分类方法, 把城镇居民按照收入水平分为 7 个等级, 每个等级的收入数据来自《中国统计年鉴》(1982—2010)。

2. 产业内贸易。关于产业内贸易的测量指标有很多, 而 GL 指标是迄今为止最具权威, 其表达式为: $GL_{ij} = 1 - \frac{|X_{ij} - M_{ij}|}{X_{ij} + M_{ij}}$ 。其中, X_{ij} 和 M_{ij} 分别表示 i 国 j 产业的出口额和进口额。 $0 \leq GL_{ij} \leq 1$, GL_{ij} 越大, 产业内贸易水平越高。如果 $GL_{ij} = 0$, 则 i 国 j 产业的贸易全部为产业间贸易; 如果 $GL_{ij} = 1$, 则 i 国 j 产业的贸易全部为产业内贸易。

按照联合国商品贸易统计数据库的统计口径,SITC5至SITC9为工业制成品,其中,SITC5为化学成品及有关产品,SITC6是按原材料分类的制成品,SITC7为机械及运输设备,SITC8是杂项制品,SITC9为未分类的(其他)商品(本文未将其列入讨论)。SITC5至SITC8的产业内贸易水平就是采用GL指标刻画的,通过四类制成品的产业内贸易指数加权便可以求得工业制成品的产业内贸易指数,计算公式如下:

$$GL_j = \frac{\sum GL_i(X_i + M_i)}{\sum (X_i + M_i)} = 1 - \frac{\sum |X_i - M_i|}{\sum (X_i + M_i)}$$

其中, $i=5,6,7,8$, GL_j 代表工业制成品的产业内贸易指数。各类制成品的进出口数据来源于《新中国五十年统计资料汇编》和《中国统计摘要2010》。

3. 控制变量。本文还引入了两个控制变量:FDI和规模经济。

(1)FDI对产业内贸易的影响方向取决于投资的类型。若FDI属于成本寻求型,即外资的进入主要是为了利用我国的廉价劳动力,降低生产成本,把从国外进口的原材料或零部件在我国加工组装成产品,然后再销往母国或其他国家,这种加工贸易模式将会大大提高我国的产业内贸易水平。若FDI属于市场寻求型,即外资的进入主要是为了扩大在我国的市场份额,降低贸易成本。外资企业生产的产品直接在中国市场销售,返销回母国或其他国家的产品比例较小,这将会降低我国的产业内贸易水平。FDI用我国每年实际使用的外资金额来衡量,以亿美元为单位,数据来源于《中国统计年鉴》(1982—1985)和《中国统计年鉴2010》,并采用每年的汇率(年均价)对外资金额进行单位换算,汇率数据来源于《中国统计年鉴1996》和《中国统计年鉴2010》。

(2)规模经济也是产业内贸易的重要影响因素。一方面,规模经济的存在大大降低了生产成本,企业可以充分扩大差异化产品的生产规模,从而推动产业内贸易的发展;另一方面,规模经济的存在意味着在一国范围内只能生产有限种类的产品,从而削弱产品的差异性,在一定程度上抑制了产业内贸易的发展。借鉴邵玲、谢建国(2008)的测量方法,规模经济以中国大中型工业企业的数量来测量,数据来源于《中国统计年鉴》(1982—1991)、《中国工业经济统计年鉴2009》和《中国统计年鉴2010》。

(二)单位根检验

在检验上述四个时间序列变量是否存在协整关系或长期均衡关系之前,本文首先采用ADF单位根检验法考察每个变量的平稳性。由于取自然对数可在不影响变量特征和趋势的情况上消除可能存在的异方差问题,我们对各时间序列变量先取自然对数,再对其进行单位根检验。其中检验滞后期的确定采用AIC最小准则,以保证残差值的非自相关性。由检验结果(见表1)不难发现,产业内贸易 $\ln gl$ 、城镇基尼系数 $\ln gini$ 、外商直接投资 $\ln fdi$ 和规模经

济 lnes 这四个变量都存在单位根,而它们的一阶差分序列在 10% 的显著性水平上均是平稳的。因此,这四个变量均为一阶单整的,满足协整检验的条件。

表 1 单位根检验

变量	检验形式	ADF 统计值	1%临界值	5%临界值	10%临界值	平稳性
lngl	(c,0,0)	-1.598	-3.689	-2.972	-2.625	不平稳
D(lngl)	(c,0,0)	-4.728	-3.700	-2.976	-2.627	平稳
lngini	(c,0,0)	-0.537	-3.689	-2.972	-2.625	不平稳
D(lngini)	(0,0,0)	-7.366	-2.653	-1.954	-1.610	平稳
lnfdi	(c,t,1)	-1.292	-4.339	-3.588	-3.229	不平稳
D(lnfdi)	(0,0,0)	-1.986	-2.653	-1.954	-1.610	平稳
lnes	(c,t,5)	-1.280	-4.416	-3.622	-3.249	不平稳
D(lnes)	(c,0,4)	-2.892	-3.753	-2.998	-2.639	平稳

注:在检验形式(c,t,n)中,c 和 t 表示单位根检验方程中包含常数项和趋势项,n 表示滞后阶数。

(三)协整分析

协整分析的意义在于检验变量之间是否存在长期稳定的关系。下面采用 Johansen 协整检验法对上述四个变量进行协整关系检验,检验结果见表 2 和表 3。迹检验和最大特征值检验的结果均表明,在 1% 的显著性水平上 lngl、lngini、lnfdi 和 lnes 存在唯一的协整关系,即各变量之间存在长期均衡关系。

表 2 无约束的协整秩检验——迹检验

原假设	特征根	迹统计	5%临界值	p 值
没有协整关系	0.796	63.74	47.86	0.001
至多 1 个协整关系	0.355	20.88	29.80	0.365
至多 2 个协整关系	0.283	9.047	15.49	0.361
至多 3 个协整关系	0.003	0.070	3.841	0.791

表 3 无约束的协整秩检验——最大特征值检验

原假设	特征根	最大特征值统计	5%临界值	p 值
没有协整关系	0.796	42.86	27.58	0.000
至多 1 个协整关系	0.355	11.83	21.13	0.564
至多 2 个协整关系	0.283	8.977	14.26	0.288
至多 3 个协整关系	0.003	0.070	3.841	0.791

采用标准化协整向量表示方法,估计出的协整方程如下(括号内为 t 值):

$$\text{lngl} = 0.413\text{lngini} + 0.101\text{lnfdi} - 0.314\text{lnes} + \text{ecm}$$

$$(5.107) \quad (3.458) \quad (-2.955)$$

由协整方程可以看出:

1. 城镇收入差距对工业制成品产业内贸易的影响系数为正,且是显著的。当城镇基尼系数增加 1% 时,工业制成品的产业内贸易指数将提高 0.413%。按照上述理论分析,随着收入差距的扩大,即类似于把低收入者的

收入转移到高收入者手中,高收入者对工业制成品的需求增加,低收入者对工业制成品的需求下降,但高收入者的需求增加幅度大于低收入者的需求下降幅度。因此,我国对工业制成品的总需求将会增加,进口规模扩大。鉴于我国近 20 年来一直都是工业制成品的净出口国,在这种情况下,随着进口量的增加,工业制成品的产业内贸易指数自然会上升。

2. $\ln gl$ 与 $\ln fdi$ 显著正相关,外商直接投资对工业制成品产业内贸易有显著的促进作用。这表明从长期看,我国接受的外资主要是成本寻求型的。为了充分利用我国低廉的劳动力,近些年外企纷纷在我国投资设厂,把中低端制造环节转移到我国,而附加值高、利润最大的研发、营销环节却留在海外。这种“两头在外”的加工贸易模式大大提高了我国制成品的出口量及其原材料和零部件的进口量,推动了产业内贸易的发展。

3. 规模经济对产业内贸易指数的影响系数为负,大规模企业数量的增加反而降低了产业内贸易水平,与邵玲、谢建国(2008)的研究结论一致。这一方面归因于我国大规模企业在从事专业化生产的同时忽视了产品的差异化;另一方面,大规模企业数量的增加是我国制造业外部规模经济的一个重要体现。一国一旦建立起大于别国的生产规模,该国就会获得由外部经济带来的成本优势,从而成为该产品的净出口国。近些年来我国工业制成品一直都是以出口贸易为主,在此基础上出口的大规模扩张无疑会使贸易结构失衡加剧,从而抑制产业内贸易的发展。

(四)误差修正模型

通过 Johansen 协整检验发现,产业内贸易与城镇基尼系数、外商直接投资和规模经济存在一个长期稳定的均衡关系。当然除此之外,城镇基尼系数、外商直接投资和规模经济的短期波动对产业内贸易水平的影响同样令人关注,下面我们通过建立向量误差修正模型(VECM)来研究各变量间的短期动态关系。由于本文重点考察的是以 $\Delta \ln gl$ 为被解释变量的误差修正模型,所以只列出该方程的估计结果(括号内为 t 值):

$$\begin{aligned} \Delta \ln gl_t = & -0.821ecm_{t-1} + 0.33\Delta \ln gl_{t-1} - 0.259\Delta \ln gini_{t-1} \\ & (-5.222) \quad (2.153) \quad (-1.720) \\ & -0.144\Delta \ln fdi_{t-1} + 0.033\Delta \ln es_{t-1} + 0.039 \\ & (-2.44) \quad (0.117) \quad (1.505) \end{aligned}$$

不难发现,误差修正项 ecm_{t-1} 的系数为负,这表明当系统偏离长期均衡时,系统会自动向长期均衡点收敛,符合反向修正机制。短期内城镇基尼系数对工业制成品产业内贸易指数的影响系数为负但不显著。一般而言,当收入水平发生改变时,消费者对商品的需求量短期内不会立刻做出调整,影响效应更多地是在长期体现出来的,从而导致产业内贸易水平在短期内对基尼系数变动的反应不敏感。此外,外商直接投资对产业内贸易的短期影响系数显著

为负,说明外资在短期内主要用于扩大其在我国的市场份额,在一定程度上抑制了产业内贸易的发展。规模经济对产业内贸易的短期影响系数非常不显著,其影响效应主要是在长期体现出来的。

五、结 论

本文从理论和实证两个层面探讨了国内收入差距对产业内贸易的影响,主要得出以下结论:

1. 通过理论推导发现,国内收入差距通过影响该国对制成品的总需求进而影响制成品的产业内贸易水平。当一国是制成品的净出口国时,制成品的产业内贸易水平与该国的收入差距正相关。国内收入差距的扩大将会提升制成品产业内贸易水平,国内收入差距的缩小将会降低制成品产业内贸易水平。反之,当一国是制成品的净进口国时,制成品的产业内贸易水平与该国的收入差距负相关。国内收入差距的扩大将会降低制成品产业内贸易水平,国内收入差距的缩小将会提高制成品产业内贸易水平。

2. 在引入外商直接投资和规模经济两个控制变量的情况下,产业内贸易与城镇收入差距、外商直接投资和规模经济存在一个长期稳定的均衡关系。而且在长期均衡条件下,外商直接投资对工业制成品的产业内贸易有一定的促进作用,而规模经济却有一定的抑制作用。规模经济的负向作用在某种程度上与其测量指标有关,因为本文只采取了外部规模经济的测量指标,而没有考虑内部规模经济,从而没有全面反映出规模经济对产业内贸易的作用情况,这一点是在下一步研究中需要注意的。

3. 通过实证分析发现,产业内贸易水平在短期内对城镇收入差距变动的反应并不敏感,收入分配状况对产业内贸易的影响更多地是在长期体现出来的。在长期,城镇收入差距对产业内贸易有非常显著的正向影响,与理论模型推导结果一致。城镇收入差距的扩大在长期推动了我国制造业产业内贸易的发展,出现了收入分配状况恶化与产业内贸易快速发展并存的局面。

参考文献:

- [1]程大中.中美服务部门的产业内贸易及其影响因素分析[J].管理世界,2008,(9):57—66.
- [2]李实.城镇内部差距拉大:当前中国收入分配差距新动向[J].党政干部参考,2011,(5):30—31.
- [3]鲁晓东.收入分配、有效要素禀赋与贸易开放度——基于中国省际面板数据的研究[J].数量经济技术经济研究,2008,(4):53—64.
- [4]马剑飞,朱红磊,许罗丹.对中国产业内贸易决定因素的经验研究[J].世界经济,2002,(9):22—26.
- [5]潘沁,韩剑.基于引力模型的产业内贸易与区域经济一体化研究[J].国际贸易问题,

2006,(9):22—26.

- [6]邵玲,谢建国. 中欧制成品产业内贸易影响因素实证分析[J]. 国际贸易问题,2008,(4): 43—48.
- [7]周茂荣,吕婕. 中美产业内贸易的影响因素研究——以资本和技术密集型产品贸易为例[J]. 国际贸易问题,2010,(2):32—37.
- [8]Balassa B, Bauwens L. Intra-industry specialization in a multi-country and multi-industry framework[J]. *Economic Journal*,1987,97:923—939.
- [9]Dalgin M, Trindade V, Mitra D. Inequality, nonhomothetic preferences and trade: A gravity approach[J]. *Southern Economic Journal*,2008,74:747—774.
- [10]Mitra D, Trindade V. Inequality and trade[J]. *Canadian Journal of Economics*,2005, 38(4):1253—1271.
- [11]Francois J F, Kaplan S. Aggregate demand shifts, income distribution, and the Linder hypothesis[J]. *Review of Economics and Statistics*,1996,78:244—250.
- [12]Linder B. An essay on trade and transformation[M]. Stockholm: Almqvist and Wiksell,1961.
- [13]Dalgin M. Intra-vs. inter-industry trade:Do country differences matter? [J]. *International Research Journal of Finance and Economics*,2010,56:29—42.

On the Impact of Domestic Income Gap on Intra-industry Trade

LIU Cui-cui¹, XIA Lei²

(1. *School of Economics, Huazhong University of Science and Technology, Wuhan 430074, China*; 2. *School of Economics and Management, Jiangxi Science & Technology Normal University, Nanchang 330031, China*)

Abstract: This paper theoretically and empirically examines the impact of domestic income gap on intra-industry trade. The theoretical model shows that, in a country as a net exporter of manufactured goods, the level of intra-industry trade in manufactured goods is positively related to domestic income gap; otherwise, in a country as a net importer of manufactured goods, the level of intra-industry trade in manufactured goods is negatively related to domestic income gap. In addition, this paper employs Johansen co-integration test to empirically study the effect of income gap among urban residents on the level of intra-industry trade in industrial manufactured goods, and concludes that the income gap among urban residents has a positive effect on the level of intra-industry trade in industrial manufactured goods in China in the long term.

Key words: income gap; intra-industry trade; manufactured goods

(责任编辑 周一叶)