

城乡统筹、城镇化与农村居民消费关系研究*

夏永祥, 盛培宏

(苏州大学 东吴商学院, 江苏 苏州 215021)

摘要:城乡统筹是全面建设小康社会的重要任务,城镇化是改革开放后我国经济增长的一大引擎,而农村是近年启动内需的重要市场。采用 9 个城乡经济社会统筹的基本指标,运用主成分分析法构建反映城乡统筹水平的综合指标,再利用 VAR 模型研究城乡统筹、城镇化与农村居民消费的关系,分析表明:城乡统筹和城镇化均是农村居民消费的格兰杰原因,城乡统筹和农村居民消费也是城镇化的格兰杰原因;从长期来看,城乡统筹和城镇化的正向冲击均会对农村消费产生正的影响,且两者对农村消费变化的贡献率超过 50%。应以城乡统筹、城镇化开启和促进农村内需市场发展,并在城乡统筹的背景下以农村居民消费推进内生性新型城镇化进程。

关键词:城乡统筹;新型城镇化;农村居民消费;农村消费市场;城乡一体化;城乡关系;扩大内需

中图分类号:F291.3;F120.3

文献标志码:A

文章编号:1674-8131(2014)06-0001-06

一、引言

我国城乡分割的二元结构阻碍了城乡要素自由流动,固化并加剧了城乡隔阂。上世纪末本世纪初,城乡矛盾在经济、社会、文化、生态等各个维度开始凸显,因此,从“十六大”以来,统筹城乡经济社会发展成为全面建设小康社会的重大任务。城乡统筹的实质是实现城乡之间要素自由流动,通过农民增收减小日益扩大的城乡居民生活水平差距,并通过支农政策扶持加快农业和农村发展。城镇化水平反映了国家经济社会发展的阶段,我国城镇化率从 1978 年的 17.9% 以年均近 1 个百分点的速度增长到 2012 年 52.6%。但是从城镇化的主体——“农村流动劳动力”来看,我国的城镇化还是低水平、不完全的,并且城镇化滞后于工业化,与发达国

家平均 75% 的高质量城镇化水平差距尚远。同时,虽然我国的城镇化与城乡一体化在很大程度上促进了消费,但是从已有众多研究来看,三者之间的关系并非很明朗。在目前推进新型城镇化和优化城乡关系的阶段,厘清城乡统筹、城镇化和农村居民消费三者之间的关系,对于转变我国经济发展方式、激活经济增长内生动力都具有重大意义。

城镇化、城乡统筹与我国经济发展的特定阶段相关,因此有关研究主要以国内文献为主。在城镇化与消费(内需)关系方面,学者们做了相对广泛和深入的研究。曾令华(2001)从定性角度分析城镇化与内需的关系,认为城镇化速度越快,创造的需求越多,农村人口转变为城镇人口以后,消费实现商品化,同时增加了城市基础设施的需求;吕景春和胡钧浪(2011)从理论上分析认为,城镇化有利于

* 收稿日期:2014-09-22

基金项目:国家社会科学基金资助项目(11BJL032)“苏州市城乡一体化发展道路研究”

作者简介:夏永祥,男,教授,博士生导师,在苏州大学东吴商学院任教,主要从事区域经济、农村经济、经济理论研究。

扩大社会生产性需求和居民消费性需求, 并通过数据走势预测农村消费潜力巨大, 居民消费将会拉动未来经济。在实证研究方面, 姜凌和高文玲(2013)构建了动态面板回归模型, 得出通过加快城镇化、引导农民改变消费方式可以促进消费的结论; 胡日东和苏桂芳(2007)实证研究表明, 城镇化对居民消费增长, 尤其对农村居民消费增长有促进作用, 因此认为城镇化战略应具有长期眼光, 要克服短期行为; 廖进中和韩峰(2009)、张书云和周玲瑶(2010)等均构建了向量自回归模型, 研究表明, 城镇化长期内有利于农村居民消费率的提高, 启动农村消费比启动城镇居民消费对城镇化的影响更大, 并且城镇化和农村居民消费呈双向作用关系, 两者是相互促进的。

研究城乡统筹与农村居民消费的文献相对较少。刘根荣和种璟(2012)先通过主成分分析法对城乡流通一体化综合指数进行量化, 再利用格兰杰因果检验证明我国城乡流通二元结构抑制了居民消费需求; 程世勇和王勇(2009)以 22 年的时间序列为基础, 构建协整和误差修正模型, 发现农村居民长期消费倾向显著高于城市居民, 因此认为解决城乡居民消费结构差异问题的根本在于构建城乡统筹的市场化制度。

在城乡统筹与城镇化之间的关系方面, 学者们大多探讨了两者的定性关系。如陈成和李标(2012)从理论角度探讨城乡统筹与两化之间的关系, 认为城乡统筹是两化的目标, 而两化是城乡统筹的路径。朱宝树(2006)认为统筹城乡发展必须关注城镇化的城乡差别效应, 实现以城镇化为主线推进城乡统筹改革与以城乡统筹改革为主线推进城镇化的双向促进。在实证研究方面, 杨振宁(2008)建立 VAR 模型分析表明城镇化与城乡统筹发展之间存在长期均衡关系, 并且城镇化是城乡统筹的格兰杰原因。

由于城镇化加速了人口集聚, 改变了部分农民的生产生活方式, 并且目前“三农问题”又成为全党工作的重中之重, 因此城镇化有利于改善农村居民的生活水平; 而城乡统筹则更是把实现城市和农村居民均等的生活水平作为目标。基于此, 笔者提出以下猜想: 城镇化和城乡统筹均有利于开启和促进农村居民消费市场, 而作为三驾马车之一的消费的

提升必将带动经济的增长, 从而继续推动城乡统筹改革和推进城镇化进程。鉴于目前较少综合研究城乡统筹、城镇化、农村居民消费之间关系的现状, 以及三者相互作用机理尚未清晰的困惑, 笔者基于全国 1995—2011 年的数据, 先通过主成分分析量化我国城乡统筹的综合水平, 继而通过构建向量自回归模型(VAR)探讨三者之间相互作用的关系。

二、城乡统筹、城镇化和农村居民消费水平的评价

1. 城乡统筹水平的评价

城乡统筹不只是单纯的经济统筹, 其包含经济、文化、人民生活、要素流动等多方面。本文基于概念的全面性和数据的可得性, 构建了 9 个指标以综合反映城乡统筹状况: 城乡居民收入比(X1)= 城镇居民可支配收入/农村居民纯收入, 反映城乡收入差距; 城乡居民家庭恩格尔系数比(X2), 反映城乡生活水平的差异; 城乡居民每百户彩电比(X3), 反映城乡居民生活物质的差异; 城乡消费支出比(X4)= 城镇居民人均消费支出/农村居民人均生活消费支出, 反映城乡生活品质的差异; 信息覆盖率(X5)= $0.4 \times$ 广播覆盖率 + $0.6 \times$ 电视覆盖率, 反映城乡间信息传播情况; 城乡就业人口比(X6)= 城镇就业人口/农村就业人口, 反映劳动力要素的城乡流动状况及就业结构; 城乡劳动效率比(X7)= 非农产业单位劳动力产值/农业单位劳动力产值, 反映非农产业产出效率与农业产出效率的差异; 城乡固定资产投资比(X8)= 城镇固定资产投资/农村固定资产投资, 反映基础建设的城乡差异; 财政支农比(X9)= 财政支农支出/财政总支出, 反映国家的政策导向。以上 9 个变量的数据均来源于 1996—2012 年《中国统计年鉴》。

为了获得城乡统筹的综合指数, 本文采用主成分分析法对上述 9 维变量进行降维处理, 保留解释力较强的成分。运用 SPSS19.0 对 9 个变量 17 年时间序列进行主成分分析, 计算结果见表 1。

2. 城镇化与农村居民消费水平的评价

使用通常意义上城镇化的衡量方法, 用“城镇常住人口/总人口”来衡量我国城镇化水平; 农村居民消费水平则用农村居民生活消费支出占农村居

民纯收入(消费率)来衡量;数据来源于历年《中国统计年鉴》。

表 1 城乡统筹指数、城镇化率与农村居民消费率

| | 城乡统筹指数 | 城镇化率 | 农村居民消费率 |
|------|--------|-------|---------|
| 1995 | 0.897 | 0.290 | 0.831 |
| 1996 | 0.937 | 0.305 | 0.816 |
| 1997 | 0.963 | 0.319 | 0.774 |
| 1998 | 1.017 | 0.334 | 0.736 |
| 1999 | 1.051 | 0.348 | 0.714 |
| 2000 | 1.111 | 0.362 | 0.741 |
| 2001 | 1.154 | 0.377 | 0.736 |
| 2002 | 1.212 | 0.391 | 0.741 |
| 2003 | 1.257 | 0.405 | 0.741 |
| 2004 | 1.300 | 0.418 | 0.744 |
| 2005 | 1.347 | 0.430 | 0.785 |
| 2006 | 1.402 | 0.443 | 0.789 |
| 2007 | 1.466 | 0.459 | 0.779 |
| 2008 | 1.529 | 0.470 | 0.769 |
| 2009 | 1.599 | 0.483 | 0.775 |
| 2010 | 1.635 | 0.500 | 0.740 |
| 2011 | 1.685 | 0.513 | 0.748 |

三、城乡统筹、城镇化与农村居民消费的关系

本文基于 VAR 模型对我国城乡统筹、城镇化与农村居民消费的关系进行实证分析。为了防止出现自回归系数的估计值向左偏向于 0、传统 t 检验失效以及伪回归等现象,VAR 模型要求时间序列是平稳的。本文使用 ADF 单位根检验方法对时间序列进行平稳性检验,为了增加平稳性,本文对农村居民消费率取对数后再进行检验。从结果来看(见表 2),原始序列均不平稳,而一阶差分以后均平稳,同阶单整,可以进行协整分析。

虽然时间序列数据经过了一阶差分以后平稳,但是差分以后的经济含义与原序列不同,为了考察城乡统筹、城镇化与农村居民消费之间是否有长期关系,进一步进行 Johansen 协整检验。首先,确定 VAR 模型的滞后阶数,综合权衡自由度和 LR、AIC 等测度,选择滞后阶数为 2;然后,确定协整秩,在

5%的显著水平下拒绝没有协整关系的假设,而在 5%的显著水平上接受有一个协整关系,即认为城乡统筹、城镇化、农村居民消费之间有一个长期协整关系(表 3)。

表 2 单位根检验

| 变量 | ADF 检验值 | 检验形式 (c,t,k) | 5%临界值 | 结论 |
|-----------------|---------|-----------------|-------|-----|
| <i>integ</i> | -2.353 | (1,1,0) | -3.6 | 不平稳 |
| <i>urban</i> | -2.5 | (0,1,0) | -3.6 | 不平稳 |
| <i>lnrucs</i> | -2.561 | (0,0,0) | -3 | 不平稳 |
| <i>d integ</i> | -3.64 | (1,0,0) | -3 | 平稳 |
| <i>d urban</i> | -3.64 | (0,0,0) | -3 | 平稳 |
| <i>d lnrucs</i> | -2.288 | (0,0,0) | -3 | 平稳 |

注:*integ*、*urban*、*lnrucs* 分别表示城乡统筹指数、城镇化水平和农村居民消费率的对数,*d integ*、*d urban*、*d lnrucs* 分别表示城乡统筹指数、城镇化水平和农村居民消费率对数的一阶差分,运用 Stata11.0 进行平稳性检验。

表 3 Johansen 协整检验

| 协整关系 | 特征值 | 迹统计量 | 5% 临界值 |
|------|----------|-----------|--------|
| 0 | 0.000 00 | 35.687 4 | 29.68 |
| 1 | 0.797 68 | 11.719 1* | 15.41 |
| 2 | 0.535 85 | 0.205 9 | 3.76 |
| 3 | 0.013 63 | 0.013 63 | |

根据上述确定的滞后阶数,进行回归,再进行 VAR 系统的稳定性检验,如图 1,所有单位根均在单位圆内,说明此 VAR 系统是稳定的。继续进行格兰杰因果检验,格兰杰因果反映的是动态统计意义上的关系,表明的是一个变量是否对另外一个变量具有预测能力(表 4)。分析结果表明:城镇化、农村居民消费均是城乡统筹的格兰杰原因,城乡统筹和城镇化均是农村居民消费的格兰杰原因,而城乡统筹和农村居民消费均不是城镇化的格兰杰原因。说明城镇化水平的提高和农村居民消费率的增长会促进城乡经济社会的和谐发展,而城乡统筹、城镇化在统计意义上也能促进农村居民消费的增长,这与笔者提出的城乡统筹和城镇化可开启和促进农村消费市场的猜想是一致的。

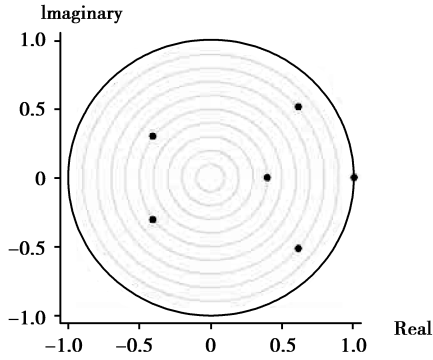


图1 平稳性检验图

表4 格兰杰因果检验

| Equation | Excluded | chi2 | df | Prob > chi2 |
|---------------|---------------|----------|----|-------------|
| <i>integ</i> | <i>urban</i> | 15.660 0 | 2 | 0.000 |
| <i>integ</i> | <i>lnrucs</i> | 5.999 9 | 2 | 0.050 |
| <i>urban</i> | <i>integ</i> | 5.687 1 | 2 | 0.058 |
| <i>urban</i> | <i>lnrucs</i> | 1.200 4 | 2 | 0.549 |
| <i>lnrucs</i> | <i>integ</i> | 13.594 0 | 2 | 0.001 |
| <i>lnrucs</i> | <i>urban</i> | 7.567 5 | 2 | 0.023 |

下面进行脉冲响应分析,以进一步明晰城乡统筹、城镇化和农村居民消费三者之间相互影响的关系。脉冲响应冲击函数反映了一个内生变量对误差冲击的反应,即在随机误差项上施加一个标准差大小的冲击后,对内生变量的当期值和未来值的影响。图2中,横轴代表时间,设定10期,纵轴代表变量对冲击的响应幅度。对城镇化施加一个标准差的正向冲击,消费在第一年有一个负向的反应,而从第二年以后,反映为正向且幅度最大,从第六年以后反应逐渐减弱,说明城镇化对农村居民消费有2~5年的激励作用;对城乡统筹施加一个标准差的正向冲击,消费在前三年的反应都是负向的,说明政策具有滞后效应,而从第四年以后反应转正,并且持续三年左右,但是反应幅度不如城镇化对消费的冲击大;对城乡统筹施加正向冲击,会促进城镇化的进程,并且具有长期性,说明城乡统筹改革利于城镇化发展;对城镇化施加正向冲击,对城乡统筹的影响更大,并且长期效应更明显,更验证了城镇化是城乡统筹的实现途径;农村居民消费的冲击对城乡统筹和城镇化也都具有一定短期效应,但幅度不大,且长期效应不明显。

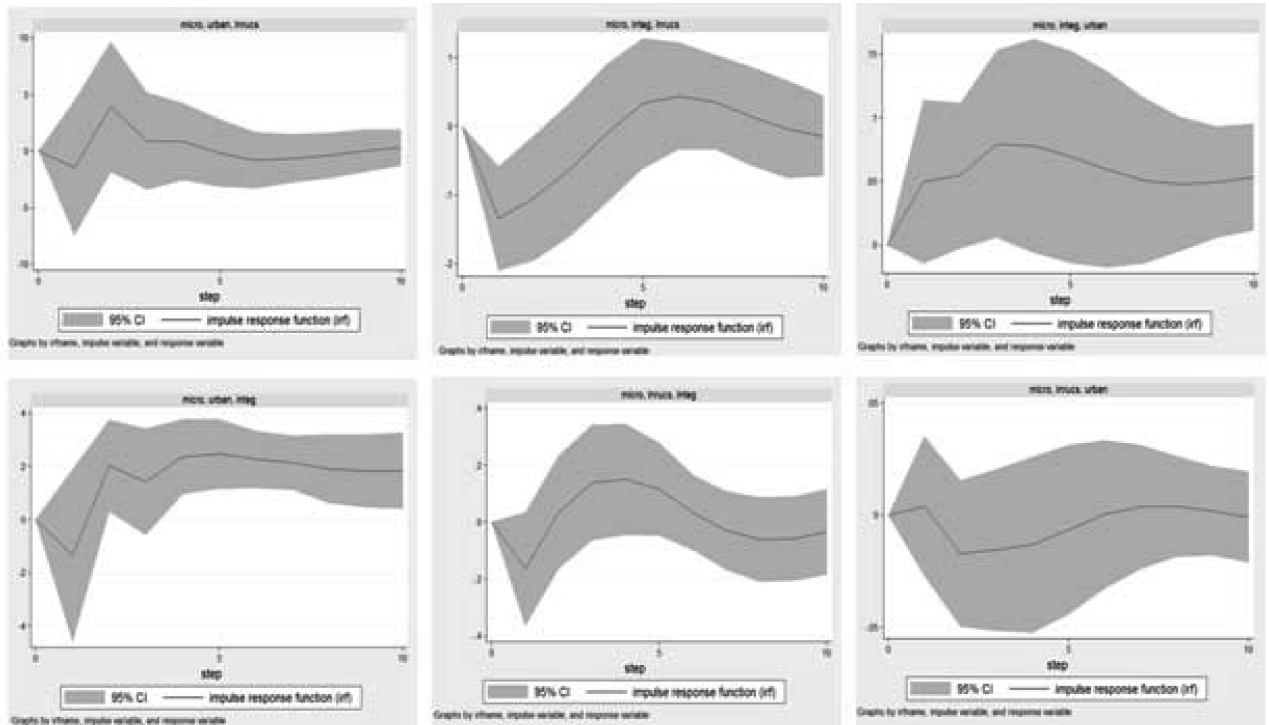


图2 脉冲响应图

脉冲响应函数反映了变量之间的冲击反映, 而方差分解通过分析每一个结构冲击对内生变量变化(通常用方差度量)的贡献度, 进一步评价不同结构冲击的重要性。从方差分解的结果(表 5)可见, 城乡统筹和城镇化的变动主要受自身冲击影响, 尤其以城乡统筹更为明显(在第 1 期贡献几乎全部来自自身, 而到第 10 期时城乡统筹对自身影响也占总影响的 66%, 城镇化对其贡献率占 26%, 农村居民

消费对其贡献不足 10%); 城乡统筹对城镇化的贡献度占 30%, 城镇化的自身贡献占 60%, 消费对其贡献度只有 1.3%; 但是三者对农村居民消费的冲击响应的贡献度从长期来看比较平均, 第 10 期时, 城乡统筹和城镇化合计对农村居民消费的贡献超过 50%, 这与脉冲响应分析中城乡统筹和城镇化对农村居民消费具有正向影响的结论相一致。

表 5 方差分解列表

| step | integ 的方差分解 | | | urban 的方差分解 | | | lnrucs 的方差分解 | | |
|------|-------------|--------|--------|-------------|--------|--------|--------------|--------|--------|
| | integ | urban | lnrucs | integ | urban | lnrucs | integ | urban | lnrucs |
| 1 | 100.00% | 0.00% | 0.00% | 0.49% | 99.51% | 0.10% | 0.11% | 39.15% | 60.74% |
| 2 | 95.75% | 0.03% | 4.22% | 9.34% | 90.57% | 1.32% | 23.92% | 33.40% | 42.68% |
| 3 | 91.54% | 4.76% | 3.70% | 14.00% | 84.68% | 1.71% | 29.78% | 27.21% | 43.01% |
| 4 | 89.22% | 4.80% | 5.98% | 20.98% | 77.31% | 1.86% | 32.10% | 25.98% | 41.92% |
| 5 | 84.83% | 6.79% | 8.38% | 25.64% | 72.50% | 1.70% | 31.82% | 26.44% | 41.73% |
| 6 | 80.60% | 9.93% | 9.47% | 28.14% | 70.16% | 1.53% | 31.86% | 26.35% | 41.79% |
| 7 | 76.48% | 14.48% | 9.03% | 29.47% | 69.00% | 1.43% | 32.49% | 25.76% | 41.75% |
| 8 | 72.12% | 19.57% | 8.32% | 29.94% | 68.63% | 1.43% | 33.07% | 25.41% | 41.52% |
| 9 | 68.83% | 23.35% | 7.81% | 30.10% | 68.55% | 1.35% | 33.19% | 25.38% | 41.44% |
| 10 | 66.63% | 26.00% | 7.37% | 30.24% | 68.50% | 1.26% | 33.14% | 25.39% | 41.47% |

四、结论与建议

通过对城乡统筹进行量化, 继而对城乡统筹指数、城镇化水平和农村居民消费率进行向量自回归、协整检验、格兰杰因果检验、脉冲响应和方差分解, 分析发现: 城乡统筹、城镇化和农村居民消费之间存在长期稳定的关系, 城乡统筹和城镇化都是农村居民消费增长的格兰杰原因, 并且城乡统筹、城镇化的变化对农村居民消费的冲击较大。但是农村居民消费对城镇化的促进机理尚不明显, 冲击变动的长期影响效果也不明显。这与通常认为的农村居民消费水平的提升会提高城镇化水平的观点不一致。基于我国的现实, 笔者认为主要原因在于下面两个问题: 第一, 我国长期以投资推动、大拆大建、农民被进城为特点的城镇化模式不能实现内需型、内生性的城镇化, 在长期的投资冲动中和政绩效益的不当激励机制下, 农民实际收入增长较慢, 农村消费市场难以开启, 消费率难以提升, 对高速

的人口城镇化进程不能产生有效的推进作用; 第二, 由于收入预期较低、农村社会保障的低水平以及传统养老观念的根深蒂固, 农民不敢消费的心理严重影响了内需的扩大。因此, 我国的农村居民消费对城镇化在统计意义上构不成格兰杰原因是成立的。基于上述分析结论, 笔者提出以下建议:

第一, 城乡统筹和城镇化的最终目标是人本身的发展, 根据格兰杰因果分析和脉冲响应与方差分解的结论, 笔者认为进一步优化城乡关系以及提升城镇化水平将有助于农村居民内需市场的开启和发展。从理论意义上而言, 城乡关系的优化即实现城乡要素的合理流动、缩小城乡居民生活水平差异、提升农村基本保障水平、创造更多就业机会、提升增加收入的可能性并增加农民的乐观预期, 这将会扩大有效需求, 减少农村居民消费的后顾之忧, 进而实现传统经济发展方式的改变。而城镇化水平的进一步提高将改变农民的生产生活方式, 激发“新市民”的潜在消费需求。因此城乡统筹和城镇

化是开启和扩大农村内需市场的两大有效路径。

第二, 改变过去投资驱动型城镇化模式, 改变消费增长与城镇化水平提高脱轨的现状, 提升消费对城镇化的促进作用, 以实现经济发展方式的转型和内生性新型城镇化的推进。最终在城乡协调发展的背景下, 以城乡统筹和城镇化激发农村居民消费需求, 并以提振内需助推可持续的城镇化进程, 实现城乡统筹、城镇化和农村居民消费的相互促进和良性循环。

参考文献:

陈成, 李标. 2012. 四川省城乡统筹与两化互动的关系与路径 [J]. 软科学 (11): 123-129.
程世勇, 王勇. 2009. 当前扩大内需的制度选择: 实证的视角 [J]. 经济问题 (5): 28-30.
胡日东, 苏桔芳. 2007. 中国城镇化发展与居民消费增长关系的动态分析——基于 VAR 模型的实证研究 [J]. 上海经济研究 (5): 58-65.
姜凌, 高文玲. 2013. 城镇化与农村居民消费——基于我国 31

个省动态面板数据模型的实证研究 [J]. 投资研究 (1): 141-149.
廖进中, 韩峰, 唐宇凌. 2009. 湖南农村消费启动与城镇化关系的实证研究 [J]. 消费经济 (2): 39-42.
刘根荣, 种琛. 2012. 促进消费视角下城乡流通协调发展研究 [J]. 经济学家 (9): 29-36.
吕景春, 胡钧浪. 2011. 城镇化与扩大内需的作用机理——兼谈我国农村城镇化的基本路径 [J]. 中国流通经济 (8): 73-78.
邱皓政. 2011. 量化研究与统计分析——SPSS 中文视窗版数据分析范例解析 [M]. 重庆: 重庆大学出版社: 305.
杨振宁. 2008. 城乡统筹发展与城镇化关系的实证研究——基于安徽的数据 [J]. 农业经济问题 (5): 49-54.
张书云, 周玲瑶. 2010. 我国城镇化发展与农村居民消费关系的实证研究 [J]. 农业技术经济 (11): 30-37.
曾令华. 2001. 我国现阶段扩大内需的根本途径——城镇化 [J]. 经济学动态 (3): 26-29.
朱宝树. 2006. 人口城镇化与城乡统筹发展 [J]. 华东师范大学学报 (哲学社会科学版) (4): 28-34.

On the Relation between Overall Urban and Rural Development and Urbanization and Rural Inhabitant Consumption

XIA Yong-xiang, SHENG Pei-hong

(Business School of Soochow, Suzhou University, Jiangsu Suzhou 215021, China)

Abstract: Overall urban and rural development is an important task for China to realize all-round well-off society, and urbanization is a big engine of China's economic growth after reform and opening-up, as a result, rural areas are an important market to initiate domestic demand. By using 9 basic indexes of overall urban and rural economic development, the comprehensive index for embodying overall urban and rural development level is constructed by principal component analysis method. And the relation between overall urban and rural development, urbanization and rural inhabitant consumption is studied by VAR Model. Analysis shows that both overall urban and rural development and urbanization are the Granger Cause of rural inhabitant consumption, that overall urban and rural development and rural inhabitant consumption are Granger Cause of the urbanization, that from long-term point, the shock on both overall urban and rural development and urbanization has positive influence on rural consumption. Furthermore, the contribution rate of the two to rural consumption change is more than 50 percent. China should initiate and boost rural domestic demand market development by overall urban and rural development and urbanization and use rural inhabitant consumption to promote endogenously new-style urbanization progress under the background of overall urban and rural development.

Key words: overall urban and rural development; new-style urbanization; rural inhabitant consumption; rural consumption market; urban and rural integration; urban and rural relation; domestic demand enlargement

CLC number: F291.3; F120.3

Document code: A

Article ID: 1674-8131 (2014)06-0001-06

(编辑: 夏 冬)