

分类号

密级

UDC

学号 200401103

延边大学硕士学位论文

延吉市城镇居民消费问题研究

——消费函数与结构计量分析

研 究 生 姓 名	朴基石
培 养 单 位	延边大学经济管理学院
指导教师姓名、职称	王国臣 副教授
学 科 专 业	中国少数民族经济
研 究 方 向	区域经济
论 文 提 交 日 期	2007年5月18日

郑重声明

本人郑重声明：所呈交的学位论文，是本人在导师的指导下，独立进行研究工作所取得的成果。除文中已经注明引用的内容外，本论文不含任何其他个人或集体已经发表或撰写过的作品成果。对本文的研究做出重要贡献的个人和集体，均已在文中以明确方式标明。因本学位论文引起的法律结果完全由本人承担。特此郑重声明。

学位论文作者（签名）：

2007年4月26日

摘 要

当前中国宏观经济正由投资拉动向消费拉动经济增长转变，正确认识与评价区域消费状况、合理引导消费、建立与消费结构变化相匹配的产业结构对区域经济增长具有重要意义，延吉更是如此。延吉市不论从消费水平现状还是从消费者行为来讲，都有着鲜明的个性与特点。就消费水平而言，延吉市是本地区公认的高消费城市；就消费者行为而言，延吉市不仅受宏观因素的影响，也受边疆地理因素、少数民族文化及人缘关系等因素的影响，所以不可以简单借鉴其他地区的消费政策或措施，应对延吉居民消费问题进行系统全面的分析和研究。目前对于延吉消费问题，仍缺乏定量的研究工作，因此本文采用历年数据对延吉消费者中的核心群体——城镇居民的消费函数及结构进行计量分析，对延吉市城镇居民消费行为、消费水平、消费模式、消费适当程度，以及收入与消费、价格等因素的关系进行了讨论研究，对存有争议或认识模糊的问题进行了定量评价，并提出相应的对策与建议。

全文分6章，第一章，阐述了本文的研究背景与意义，并简单回顾了消费问题（动态和趋势），本文的研究方法、创新与不足；第二章概述了消费理论的起源与发展，包括消费函数的绝对收入、相对收入、生命周期、持久收入、预防性储蓄及几种新的消费假说，消费结构研究中的主要分析方法——线性支出系统及扩展线性支出系统；第三章，定性分析了延吉市城镇居民的消费水平、平均消费倾向、消费模式的变化，分析结果说明延吉市城镇居民具有较高的消费意愿，消费水平与平均消费倾向都较高，长期以来基本属于同步消费模式；第四章，对消费函数的研究中，摆脱了传统的几种消费假说，采用了现在常用且已经相对成熟了的向量自回归理论（VAR），建立了延吉市城镇居民消费函数的误差修正模型，数据的协整检验结果说明延吉市城镇居民的可支配收入与消费性支出具有长期稳定关系，具有很高的边际消费倾向，同时误差修正模型显示，收入与消费之间在短期波动偏离长期均衡时，有很强的修正能力，结果也说明延吉市城镇居民的消费近似于绝对收入假定，并具有里兰德预防储蓄假定的部分性质。第五章，采用扩展线性支出系统对延吉市城镇居民的消费结构做了静态和动态定量分析，确定各消费项与收入、价格对各项消费的影响及居民的基本消费，分析表明延吉市城镇居民的最低收入层还不能实现基本消费，居民整体的消费结构变化很快，对文教娱乐的消费明显增加，对提高性的消费品需求较高。第六章对延吉市城镇居民的消费情况做了全面的总结，并提出了相应的对策，分析证明现阶段延吉市城镇居民消费的主要特征不是消费过低，而是居民消费心理不成熟、居民消费的

不稳定和不均衡。平滑居民消费并调整消费在各项目上的分配，建立与消费结构相匹配的产业结构使消费能真正促进本地区的经济，使产业结构与消费结构形成互动是当前经济调节和制定经济措施的关键。

关键词：延吉市城镇居民；消费函数；消费结构；误差修正模型；扩展线性支出系统

Abstract

The current Chinese macroscopic economy promotion is drawing from investment to consumption, it is very important to regional economy promotion that correctly understanding and evaluation of regional consumption, reasonably guide consumption, and establish the industrial structure matching the consumption structure changes, especially in Yanji. Yanji city has distinctive personality and character both in the level of consumption and consumer behavior. On the level of consumption, Yanji is recognized high consume city; on consumer behavior, Yanji is not only influenced by macroeconomic factors, but also influenced by geographical borders, ethnic culture and personal relationship, Therefore, we should not simply get the consumer policies or measures from other parts, but analysis and research to Yanji consumer system. Now, for Yanji consumption, there is a lack of quantitative research, the article used historical data to measurement analysis the consumer function and structure of Yanji core consumer groups -city urban resident; discussed and researched to its expense behavior, the consumption level, the expense pattern, the expense suitable degree, as well as the relations between income and expense, price; Carried on the quantitative evaluation to the dispute question, and proposed the corresponding countermeasure and the suggestion.

This article qualitative analysis Yanji city urban resident 's consumption level, the average propensity to consume, the expense pattern change, the analysis result showed Yanji city urban resident has the higher expense wish, the consumption level and the average propensity to consume is all higher, since long ago basically belongs to the synchronized expense pattern.

In the research to the expends function, got rid of the traditional several kind of expenses hypothesis, used spatial vector from the return theory (VAR) which is the present commonly used also already the relatively mature, established the error correction model of Yanji city urban resident's expense function, the data association entire examination result explained the Yanji city urban resident's controlling income and the expense disbursement has the long-term stable relations, had the very high boundary expense tendency.

Simultaneously, the error correction model demonstrated: when short-term undulate and deviate long-term equilibrium between income and expense, it has a very strong revision ability, the result also explained that the Yanji city urban resident's expense is approximate to absolutely receives hypothesis, and has partial nature of Leland prevention deposit

hypothesis.

Regarding the consumption pattern, this article used the expansion linear disbursement system to make the static state and the dynamic quantitative analysis to the Yanji city urban resident's consumption pattern, determined the influence of respectively expense part, income, and the price to each expense, also urban resident's basic expense, the analysis indicated the Yanji city urban resident's lowest income level could not realize the basic expense, the urban resident whole consumption pattern change very quick, expense in the culture and education entertainment obvious increase, demand was higher to the enhancement consumable.

After the full text analysis, the main characteristic that the present Yanji city urban resident expends is not lowly, but is the urban resident expense psychology not mature, the urban resident expends is unstable and imbalanced. The key which current economical adjustment and the formulation economical measure is that Smooth urban resident expense and adjust the expense in various projects, establish the industrial structure matching the consumption structure, enables the expense truly to promote local economy, causes the industrial structure and the consumption pattern forms the interaction.

Key word: Yanji city urban resident, Consumption Function, Consumption structure, Error correction model, ELES

目 录

摘 要.....	II
Abstract.....	IV
第一章 绪论	1
1.1 延吉市城镇居民消费状况研究的背景与意义.....	1
1.2 本文的研究思路.....	1
1.3 本文的研究方法.....	2
1.3.1 消费函数研究.....	2
1.3.2 消费结构研究.....	3
1.3.3 本文的研究方法.....	3
1.4 本文的不足与创新.....	4
1.4.1 本文的不足.....	4
1.4.2 本文的创新.....	5
第二章 消费理论回顾	6
2.1 消费函数理论.....	7
2.1.1 凯恩斯的绝对收入假说.....	7
2.1.2 杜森贝里的相对收入假说.....	8
2.1.3 弗里德曼的持久收入假说.....	8
2.1.4 迪莫利安尼的生命周期假说.....	9
2.1.5 其他消费函数理论.....	9
2.1.6 传统消费函数的缺点及修正.....	10
2.2 消费结构理论.....	11

2.2.1 恩格斯的理论	11
2.2.2 罗斯托的理论	11
第三章 延吉市城镇居民消费状况定性分析.....	13
3.1 消费水平的变化	13
3.2 平均消费倾向的变化	14
3.3 消费水平评价	16
3.3.1 消费模式的判定标准	16
3.3.2 延吉市城镇居民消费模式的评价	17
第四章 延吉市城镇居民消费函数研究.....	19
4.1 协整理论及误差修正模型	19
4.1.1 协整理论	19
4.1.2 单整检验的方法	19
4.1.3 协整检验	20
4.1.4 建立误差修正模型的方法	21
4.2 消费函数的实证分析	21
4.2.1 单整检验	22
4.2.2 协整检验	23
4.2.3 误差修正模型的建立	25
4.3 模型的经济含义（结论分析及经济含义）	25
第五章 延吉市城镇居民消费结构研究.....	27
5.1 扩展线性支出系统法的选择	27
5.2 数据的调整	29

5.2.1 数据调整的原因	29
5.2.2 数据调整的方法	29
5.3 消费结构的实证分析	31
5.3.1 消费结构的静态（横截面数据）分析	31
5.3.2 消费结构的动态（时间序列数据）分析	37
第六章 结论与对策	40
6.1 结论	40
6.2 对策和建议	41
致 谢	43
参考文献	44
附录 A1981—2005 年延吉城镇居民人均消费及可支配收入	46
附录 B 攻读学位期间发表论文目录	46

第一章 绪论

1.1 延吉市城镇居民消费状况研究的背景与意义

当前宏观经济正由投资拉动向消费拉动经济增长转变，正确认识影响地区消费的因素及其作用，合理引导有效需求对经济的增长具有重要意义。

延吉市居民不论从消费水平现状还是从消费者行为来讲，都有着鲜明的个性与特点。就消费水平而言，延吉是本地区公认的高消费城市；就消费者行为而言，延吉市居民不仅受宏观因素的影响，也受边疆地理因素、少数民族文化及人缘关系等因素的影响，所以不可以简单借鉴其他地区的消费政策或措施，应对延吉居民消费问题进行系统全面的分析和研究。[1]

目前，对于延吉消费问题，仍缺乏定量、深入、全面的研究，因此本文拟对延吉消费者中的核心群体——城镇居民的消费问题进行分析，即从消费水平、消费函数和消费结构三个方面，运用西方经济学中消费经济学的理论和方法，从定量分析的角度，分析延吉市城镇居民消费水平状况、消费行为变化的特点及其影响因素，探讨延吉居民收入与消费支出之间、消费结构之间的关系，目的在于正确、全面、深刻地认识延吉市城镇居民消费行为，为合理、有效地调节居民的消费行为，引导延吉市城镇居民适当消费，保障和促进延吉市经济的持续、稳定与协调发展提供参考依据，也为定量研究整个延边朝鲜族自治州的消费问题做一尝试。

1.2 本文的研究思路

本文主要从定量的角度分析延吉居民消费行为特点及收入和价格对消费的影响程度。总体而言，本文按照先定性分析延吉市城镇居民的消费状况，后分析消费与收入的关系，最后分析消费结构并总结全文提出对策和建议的研究思路展

开分析和论述

在研究延吉市城镇居民消费状况中，通过描述对消费水平绝对值的变化、平均消费倾向的变化、消费模式评价，勾勒出延吉市城镇居民消费状况的外廓，定性地掌握延吉市城镇居民消费状况，确定和评价居民的消费模式。

在消费函数分析中，根据延吉市城镇居民 1981—2005 年的统计数据，运用计量经济的协整理论，建立误差修正模型，建立延吉市城镇居民消费函数，确定收入和消费间的定量关系，定量地评价延吉市城镇居民消费水平。

在消费结构分析中，本文采用扩展线性支出系统对 2005 年延吉市城镇居民消费结构（人均食品、衣着、居住、家庭设备用品及服务、医疗保健、交通通讯、文教娱乐用品及服务、其他商品及服务消费支出）进行分析，研究可支配收入与消费结构的关系，分析各项消费支出的变化趋势以及未来的消费热点，为调节消费、调整产业结构提供依据。

1.3 本文的研究方法

关于居民消费的研究主要集中于两个方向：一是消费函数理论，从消费与收入关系、消费水平的角度研究消费；二是消费结构理论，从消费总支出在各消费项上的分配、收入与各消费项的变动关系、各消费项间的关系研究消费。

1.3.1 消费函数研究

对居民消费函数的研究，主要分为如下三种：

一、定性分析居民消费特点，依据西方绝对收入、相对收入、持久收入等假说，确定居民的消费函数模型，然后利用相关数据进行回归分析估计参数，再利用参数对先期的定性分析进行检验，在确定了定性分析与模型分析一致后，用计算得出的居民消费函数对居民消费问题进行分析。如蒙肖莲对广西城镇居民消费函数进行研究时，将广西城镇居民的消费函数定性地确定为持久收入、相对收入、生命周期消费函数，分别对函数进行估计。[2]

二、将西方消费理论中的几种假说融为一个一般形式，[3] 一个综合了的模型，然后利用相关数据对模型进行回归分析。如刘佳在对我国消费函数进行研

究时，将绝对收入、相对收入、持久收入、生命周期四种假说改良成一种线性组合（一般形式），然后对其进行估计。[4]

三、摆脱传统消费理论中的各种假说，利用收入与消费序列的数据间关系，采用向量自回归理论建立误差修正模型。[5] 近来也有很多学者将系统工程方面的方法引入到消费函数的计算之中，运用蒙特卡罗模拟、人工神经网络、滤波分析、灰色系统理论等方法，结合误差修正模型，建立可变参数模型。[6]

1.3.2 消费结构研究

消费结构的研究中，采用的方法有恩格尔系数法、指标体系法、平衡表法、指数体系法、线性支出系统（LES）及扩展线性支出系统（ELES）模型。当前采用最多的是扩展线性支出系统（ELES），兼用恩格尔系数法作为支持性方法。利用横截面数据（panel data）和时间序列数据对消费结构作静态和动态的分析。[7][8]

在扩展线性支出系统（ELES）的实际应用中常存在数据约束（也可称为计算约束）。扩展线性支出系统常用普通最小二乘法估计参数，但普通最小二乘法的潜在假定为数列是平稳的，但是在一些地方，特别是统计工作不发达，区域经济受外界影响、冲击较大的城市，如边疆城市，各种经济数据的波动很大，如果直接使用样本数据，拟合度差且难以通过统计检验，所以需要原始数据进行合理调整。

1.3.3 本文的研究方法

本文主要采用规范与实证、定量与定性相结合的方法，具体如下：

理论分析结合实际分析。在运用西方消费经济学理论及政府统计数据进行分析的同时，还与延吉当地的企业家、老居住户对消费的某些方面，以及特定时期延吉消费统计数据突变的原因进行探讨，全面了解问题发生的背景或原因。如在 1991 年，延吉市居民消费水平出现了一个飞跃，而之前和之后都比较平稳，对于这样一个疑问，民间人士回忆，当年边境走私猖獗，以汽车走私为例，一个普通司机受雇开车过境收入达到 1000 元，当年消费场所极其繁荣。这样，从民

间层面上了解消费者心理和消费者行为，拓宽认识和分析问题的视角。

实证分析结合规范分析。整篇文章采取实证与规范相结合的方法，但以实证分析法为主。如在对延吉市城镇居民消费函数和消费结构分析时，先采用实证分析对模型结果做了客观的分析，但是在对延吉消费水平及最后的对策部分则采用了规范分析的方法，以便客观地描述消费问题的全貌，挖掘消费问题产生的客观根源，使本文的逻辑更清晰、明了。

定性分析结合定量分析。消费理论的研究，从 20 世纪中期起就与定量分析密不可分。本文在研究中采用了统计、计量及灰色系统理论的分析工具。如在估算延吉市城镇居民消费函数时采用了计量的协整理论，分析消费结构时采用了扩展线性支出系统模型，在数据的一些预处理上采用了灰色系统理论的原理与方法。全文采用定性与定量结合的方法，以求在对问题做出定性判断的基础上，建立变量间的数量关系，同时用两种方法的分析结果相互印证，以证明结论的真伪（可靠性）。

静态分析结合动态分析。就消费结构而言，既有静态的现有消费结构，又有动态的长期发展趋势，所以本文在研究过程中，分别采用时间横截面数据和时间序列数据对延吉市城镇居民的消费结构进行分析，力图揭示当前消费结构状况及长期以来消费结构的变化趋势。

1.4 本文的不足与创新

1.4.1 本文的不足

本研究存在两个不足之处：其一，因为数据不足，未能对延吉农村居民的消费结构进行定量分析，对比分析城乡之间的差异，定量地分析及预测城镇化对消费的影响，也没能将延吉和宏观消费环境及经济发展水平与延吉相似的民族地区进行定量的对比分析，以致对延吉市城镇居民消费状况描述缺乏直观立体感；其二，因缺乏关于最优消费率方面的建模理论，未能确定延吉市城镇居民的最优消费率，只能对延吉市城镇居民消费的适当程度做规范性的评价。[9]

1.4.2 本文的创新

本研究的创新也体现在两点：其一，首次对延吉市消费问题进行了全面的定量分析，为更深入的研究及政策制定提供了依据；其二，在运用扩展线性支出法的过程中，结合灰色系统理论的思想和方法，根据模型分析的实际需要，对波动很大的数据进行适当的预先处理，使扩展线性支出法在大波动经济数据中的应用成为可能，为调整原始数据做出了新的尝试。

第二章 消费理论回顾

英国古典政治经济学鼻祖威廉·配第是最早对消费问题进行理论分析的学者，配第对消费的基本观点是主张约束不必要的消费，以达到积累资本、增加财富的目的。配第同时认为，赋税是实现上述目的的有效手段，主张对不利于生产的消费及过剩产品征税，以减少消费^①。配第的主张代表了资本主义初期资产阶级的利益。[10]

古典经济学创始人亚当·斯密和大卫·李嘉图继承了威廉·配第的观点，认为人有两种欲望，一种是“现在享乐的欲望”，另一种是“改良自身状况的欲望”，^②当后一种欲望战胜了前一种欲望，即发展的欲望战胜了消费的欲望，财富得以积累，社会得以进步。[11]

具有相似的抑制消费观点的还有法国古典经济学家魁奈，但是他对消费及消费品的认识有了一定的发展。他认为消费品可以分为必需品和奢侈品，必需品的消费有利于财富的积累和社会的发展，而奢侈品的消费则相反。而法国的西斯蒙地则对消费有了更深入的认识，他已经意识到资本主义生产和消费间的矛盾，并认为消费不足是资本主义经济危机发生的重要原因，并提出促进消费可以减缓经济危机的主张。[12]

19世纪中期以后，庸俗经济学者对消费进行了大量深入的研究，新古典经济学创始人马歇尔在继承前人的基础上提出了需求理论，认为就长期而言，消费水平会随着技术水平的进步而提高，同时提出了效用递减规律、需求规律、需求的价格弹性，第一次对消费理论进行了系统的阐述，奠定了消费理论的基础。[13]

20世纪30年代，凯恩斯经济学在资本主义经济大危机的背景下产生，其学说的基本理论是有效需求理论，他看到了消费在社会经济运行过程中所起到的重要作用，主张政策干预刺激消费，以缓解资本主义经济危机。凯恩斯不但最早建立了消费函数理论，对消费函数中的主、客观因素及长期消费趋势进行了分析，而且对研究方法也有创新与发展，采用了静态与动态、规范与实证相结合的研究方法。[14]

^①威廉·配第. 政治算术[M]. 北京:商务印书馆, 1979. 42.

^②亚当·斯密. 国家财富的性质和原因研究(上卷)[M].北京:商务印书馆,1979.314.

二战以后，随着西方国家普遍出现的经济衰退，凯恩斯经济理论受到质疑，继而出现了很多新的理论，其中最具有代表性的是米尔顿·弗里德曼、弗朗哥·莫迪利亚尼、加里·贝克尔的消费理论

消费理论一般地理解为包括消费需要与消费需求理论、消费环境理论、消费水平理论、消费结构理论、消费方式理论、劳务消费理论、消费市场理论、消费信贷理论、消费者心理与消费者行为的理论、消费调控和引导理论，[15]其中消费函数与消费结构理论是应用最广也是最为基础的理论，本文主要从这两个方面作一下理论回顾。

2.1 消费函数理论

消费函数理论主要揭示收入与消费两者间的相互关系，是基于消费者行为分析基础上的对消费状况的描述。[16]对消费函数的系统研究，始于20世纪上叶的马歇尔时代，但是完整的消费理论则是在20世纪30年代由凯恩斯首先提出，此后到了70年代，随着西方国家经济的波动与发展，以理性预期学派为代表的一大批经济学家开始关注消费函数理论，这些学者对凯恩斯的消费函数理论进行了补充和修正。从凯恩斯绝对收入假定，发展为绝对收入、相对收入、持久收入、生命周期、消费品存量假定及消费者效用的代际连接模型等。[17]

2.1.1 凯恩斯的绝对收入假说

凯恩斯绝对收入假定的基本思想包括三方面的内容，一是在短期内消费倾向是基本稳定的，即影响消费的因素是稳定的，消费主要取决于收入，实际消费支出是实际收入的稳定函数；二是边际消费倾向是小于1的正数，即消费随收入的变化而绝对地变化，但收入的增长不会全部用于消费，消费的增长幅度小于收入的增加；三是在长期过程中，边际消费倾向是递减的，平均消费倾向也随收入的增加而逐渐下降。[18]

绝对收入假定的公式表达为： $C_t = b_0 + b_1 Y_t$