

# 政府支出与贸易自由化分析

Sohrab Abizadeh 著 费 菲 译

原载: Applied Economics, Vol.37, No. 16, Sept., 2005

人们研究了贸易自由化对政府在经济中作用的影响。研究显示,与被普遍接受的预测相反,当小型开放经济实行贸易自由化时,其政府的管理范围缩小了。

## 一、引言

贸易自由化问题(以及关于这个问题的争论)可以追溯到亚当·斯密。根据 Edwards (1993)的分析,对贸易限制的放宽和贸易保护的减少为 20 世纪 60 和 70 年代的发展周期提供了动力。政客和经济顾问们又花了十年时间才减弱了他们对贸易保护主义的偏见。“自由贸易区的激增、贸易自由化的倡议 (initiatives) 以及《关税与贸易总协议》(GATT) 乌拉圭回合谈判的圆满完成,均证实了贸易是经济增长动力这一不断增强的观念。然而,也有较具影响力的少数人坚持声称贸易自由化对经济增长产生负面影响”(Rivera-Batiz, 1997, p.36)。Volcker (2002, p.13)认为“全球化”(指“globalization”一词——译者注)是“一个讨人嫌的五音节词”。但是,不管它是否讨人嫌,它可是呆在这儿不走了。

近期实践表明,在全球化和扩大自由贸易欲望的驱使下,世界经济已经历了空前的技术创新,并采用了前所未有的新方法去推行消费主义,随后对在政策和管理手段方面进行了调整。有关文献的回顾显示,大多数争论和随后的研究都是围绕贸易自由化对于经济增长与发展的影响进行的。<sup>①</sup>特别要指出的是,绝大多数针对全球化对宏观经济变量作用效果的研究是围绕着就业、生产力和经济总体发展而展开的。<sup>②</sup>

人们认为,贸易自由化有望影响若干宏观经济变量,进而对经济增长产生影响,但是,Agenor 和 Aizerman (1995)却推测说方兴未艾的贸易自由化可能导致新的经济活动,并因此在很长的时期内改变生产部门的布局。这些变化会以不同形式出现,包括生产组合的变动、以及随之而来的政府支出占总产出相对份额的变化。全球化和贸易的更加自由化似乎已经理所当然地影响了政府管理的范围并限制了政府的管理权限。然而,这种变化的确切方向尚未可知。Rodrik 1998 年进行的研究和 Alesina 与 Wacziarg 在同一年进行的研究,为贸易自由化和政府管理范围方面的进一步研究提供了背景。Alesina 和 Wacziarg (1998: pp.304-305)在强调国家的大小对政府消费影响的同时,提出了两个“事实”:一是由于规模经济的存在,所以国家越大,人均政府支出就越低;二是由于生产力的影响,国家规模越大,其经济就越接近于一种封闭经济。Rodrik (1998)认为,越开放的经济所需要的政府管理范围就越大,以便能够抵御“外部冲击”并稳定经济。相反, Alesina 和 Wacziarg (1998: p.306)对于开放程度和政府消费份额的直接联系提出了某些质疑。他们过后又提出,如果我们把政

府功能的转变视作政府支出及其与开放程度的关系的一个组成部分，那么外部风险依然存在。

这个研究试图确定在以新定义的开放程度来衡量的贸易自由化与政府管理范围之间是否存在一种关联。结果表明，开放程度较小的经济体（如加拿大、新加坡、乌拉圭）便不再受制于那个“外部冲击”理论；同时，这项研究还推测说这可能是由于近几十年来得到加强了国际贸易自由化所致。然而，外部冲击定理仍然适用于小型但并不开放的、且有着（贸易）保护主义传统的国家（如韩国和埃及），而大国（如美国）之所以仍然实行贸易保护主义，正如 Alesina 和 Wacziarg(1998)所指出的，是由于规模经济和生产力作用的结果。

之所以选这些国家为例，是为了显示经济发展范围的广泛。这一点很重要，因为研究已经显示：一个国家的政府管理范围对于该国经济所达到的发展阶段是非常敏感的（Abizadeh 和 Gary,1985）。所选的例子中包括加拿大（它高度发达、开放、但经济总量小的）、美国（它高度发达、经济总量大、但多少有些封闭）、韩国（它是新兴工业化国家、经济总量小、但多少有些封闭）、新加坡（它是新兴工业化国家、开放、但经济总量小）、埃及（它欠发达、经济总量小、多少有些封闭）和乌拉圭（它欠发达、经济总量小、但开放）。<sup>③</sup>这次的实证分析所采用的是覆盖了从 1960 年至 2000 年间的时间序列数据。<sup>④</sup>

## 二、模型

已得到清楚表述的假设是这样的：当一国的贸易自由化程度增强时，以人均政府支出来衡量的政府在经济中的作用便减弱了（即政府在资源配置方面对市场的依赖程度增强了）。

使用人均政府支出(G) 而不是政府消费作为应变量，原因是全球政府支出的数字反映了在转移支出和政府官僚程度（包括管理和行政的领域）方面的变化。

最主要的表示自由贸易的自变量是一种度量开放程度(OP)的新方法，即把开放程度定义为进出口总额与 GDP 减去进出口总额之差的比值，即

$$OP=(X+M) / [GDP-(X-M)] \quad (1)$$

其中，X 和 M 分别表示进口和出口。在检查政府功能时被广泛认可的另一种变量是国民经济总产出量替代变量。这种观点认为，高收入（尤其更高的人均收入）会引起对公共产品需求的增加，而对公共产品需求的增加则会导致政府支出的提高。之前的大多数实证研究多以人均 GDP 作为替代变量。然而，政府支出本身就是 GDP 的一个组成部分，而政府支出相对于人均 GDP 的回归则会导致计量经济学方面的问题。通过把私人人均 GDP 定义为人均 GDP 减去人均政府支出之差，这类问题就可以避免了。这样，Y 作为自变量便被用来检验收入对于政府支出所产生的作用。

实证模型如下：

$$\ln G_t = \ln A + \alpha \ln OP_{t-i} + \beta \ln Y_{t-i} + \epsilon_t \quad (2)$$

其中， $i \geq 1$ ， $t$ ， $G$ ， $OP$ ， $Y$  分别表示时间、人均政府支出、作为贸易自由化替代变量的开放程度、私人人均 GDP。 $A$ 、 $\alpha$ 、 $\beta$  是待估计的参数， $\epsilon$  为残差项。

## 三、实证分析

由于所使用的数据是真实的时间序列数据，而且所使用的变量是以对数的形式表示，因此有必要确保这些变量 G、OP、Y 是平稳的，以及残差项 $\epsilon$ 是无序列相关的。ADF 单位根检验(扩展的迪克·富勒单位根检验)证实了这里时间序列是平稳的，因此没有必要对数据进行协整检验，也没有必要应用误差修正模型 (ECM)。<sup>⑤</sup>

使用时间序列数据应关注的另一问题是应变量 G 与自变量的因果关系方向。利用 Armah 因果关系检验 (1997) [结合了 Akaike 最终预测误差(FPE)准则和格兰杰因果关系检验]对变量 G 和 OP 的检验表明，对于加拿大、新加坡和埃及，OP 变化引起 G 变化；对于美国和乌拉圭，二者双向影响；对于韩国，二者无因果关系。对于 G 和 Y 之间的关系，结果表明，除对于乌拉圭来说 G 变化引起 Y 变化外，其他国家二者均相互影响。<sup>⑥</sup>

表 1: 用两阶段最小二乘法进行的回归结果汇总

国家	常量 A	$\alpha$	$\beta$	修正的 R <sup>2</sup>	杜宾-沃森值	工具变量和滞后期数
加拿大	-0.09	-0.41(-2.16*)	0.75(2.12*)	0.97	1.66	OP <sub>-1</sub> , IR <sub>-4</sub>
美国	5.49	0.12(1.97*)	-0.26(1.85*)	0.97	1.87	IR <sub>-2</sub> , SDR <sub>-3</sub>
韩国	-1.61	0.3(1.81*)	1.07(16.52*)	0.98	1.65	Y <sub>-1</sub> , IR <sub>-4</sub> , SDR <sub>-3</sub>
新加坡	1.44	-0.48(1.22)	0.56(1.93*)	0.93	2.3	IR <sub>-1</sub> , SDR <sub>-3</sub> , OP <sub>-1</sub>
埃及	2.39	0.61(3.53*)	0.14(0.81)	0.82	1.79	IR <sub>-1</sub> , OP <sub>-1</sub>
乌拉圭	14.84	-1.02(1.32+)	-4.73(1.73*)	0.86	1.75	IR <sub>-3</sub> , SDR <sub>-1</sub>

注释：括号中数据为估计系数的 t 统计值

\*表示在 5%的置信区间上显著

+表示在 10%的置信区间上显著

使用普通最小二乘法估计式 2 中的系数会引起联立方程偏倚。因此引进两个工具变量 (IV)，利用两阶段最小二乘法 (TSLS) 来对模型进行估计。分别以特别提款权(SDR)和利率 (IR)作为 OP 和 Y 的工具变量，以确保模型的恰好识别<sup>⑦</sup>。除乌拉圭外，所有估计模型的杜宾-沃森统计值都拒绝接受零假设，即不存在自相关。采用科克兰内——澳克特过程 (Cochrane-Orcutt procedure) 来修正这个问题。表 1 列出了式 2 的实证估计结果。

私人人均 GDP 变量 Y 的系数 $\beta$ 解释为对政府支出需求的短期收入弹性 (私人收入)，正如预期的那样，除美国和乌拉圭除外，该系数为正。

开放程度的系数 $\alpha$ 正负也不一致。对于加拿大、新加坡、乌拉圭这三个国家， $\alpha$ 为负。这些国家尽管处于不同经济发展阶段，但均为小型、开放、出口导向型经济，劳动力教育程度高、收入分配相对平衡、社会支出水平较高，且三国均具有非管制、削减了的工业补贴和自由化的贸易。也就是说，与预期相反，对于这几个小型开放国家，随着贸易自由化加强，政府管理范围缩小。可以推测，随着世界范围内贸易自由化的加强，尤其是像美国这样的大国加入自由贸易协定，小型开放国家不必再为严重的“外部冲击”担忧，因此更加倾向于撤销贸易限制。

对于美国、韩国和埃及，开放系数 $\alpha$ 为正，且是统计显著的。这个结果表明，大国 (如美国) 尚未放开其传统的贸易限制、贸易部门管制和对出口导向型行业的补贴<sup>⑧</sup>。对于美国，这个结果可归因于两点 (1) 美国贸易占 GDP 的份额在 G7 国家中处于最低的行列；(2) 由于其高生产力水平和规模经济，美国可以成为贸易保护的国家 (Alesina 和 Wacziarg, 1998)。

我对韩国的研究结果也许反映了中央政府直接参与贸易部门的传统做法。历史上，20 世纪 80 年代韩国经济的成功发展是基于政府与商业部门的紧密联系。政府对某些行业的直

接资助政策、进口限制政策、为促进经济增长的定向贷款、同时支付消费品以鼓励原材料和技术进口的政策，在当时普遍存在。

对于埃及，有两种可能的解释。第一，埃及在模型所选择的国家中发展水平最低，尚未能实行任何贸易政策的转变；第二，由于不同政治派别集团之间的持续紧张状态，埃及的政治环境动荡，反对贸易之风盛行。对韩国和埃及的分析结果表明，小型的、不开放经济体仍然担心“外部冲击”的影响，因而他们要维持政府对经济的介入。

## 四、结论

结果表明，由于那些小型的、传统上开放的经济体（如加拿大、新加坡、乌拉圭）已经扩大了其贸易开放的程度，所以政府功能在国内经济中减弱了。有人认为，这种趋势可以解释为是世界范围内贸易自由化程度不断得到提高的结果，贸易自由化的提高使得较小的国家能够在不必担心外部冲击的情况下取消其对贸易的限制，而这反过来又使得它们能够解除国内管制从而减少政府对市场的参与。美国却抵制这种发展趋势，这可以在现有的理论框架内很容易地得到解释，因为美国是经济大国。有人进一步推测说，韩国对于这种趋势的抵制可能是由于其结构惯性造成的滞后，这个惯性来自于在此之前该国政府与企业之间紧密联系的强大传统。研究人员将设计出一项持续不断的研究来检验这种假设的可行性，并同时准确地检验这么一种推测，即本文所阐明的令人惊讶的结果（即一个国家在其贸易自由化的过程中，其政府的管理范围便缩小了）是可以通过不断增强的全球经济结构自由化而很好地对其做出解释的。

### 注释：

- ① 有关贸易与经济发展文献的全面回顾，参见 Edwards(1993)；关于此问题的更多近期讨论，参见 Crafts(2000)。
- ② *Canadian Journal of Development Studies* 的近期专刊专门分析了这些宏观经济变量和全球化在经济发展中的作用。
- ③ 此选择基于 Abizadeh 和 Basilevsky (1986) 应用多元技术（因子分析）来对许多国家根据其经济增长水平进行的分类。
- ④ 数据来自于国际货币基金组织的多期《国际金融统计》(*International Financial Statistics*)
- ⑤ 确切地了解这些检验及其对于相似计量分析的应用见 Islam(2001,pp.511-12)
- ⑥ 检验结果可向本文作者索取。
- ⑦ 假设 SDR 和利率 IR 与残差项不相关，而分别与自变量 OP 和 Y 高度相关。
- ⑧ 参见近期对于钢铁与加拿大软木材的征税

译者单位：厦门大学经济学院国际经济与贸易系

邮政编码：361005