

学校编码: 10384

分类号_____密级_____

学号: 15420071151232

UDC _____

厦 门 大 学

硕 士 学 位 论 文

中国未观测经济测算及其与宏观经济关系的实证研究

The Empirical Study on Estimation and Macro-economy relationship of Non-Observed-Economy in China

石 林 伟

指导教师姓名: 杨 灿 教授

专业名称: 统 计 学

论文提交日期: 2010 年 4 月

论文答辩日期: 2010 年 月

学位授予日期: 2010 年 月

答辩委员会主席: _____

评 阅 人: _____

2010 年 4 月

厦门大学学位论文原创性声明

本人呈交的学位论文是本人在导师指导下,独立完成的研究成果。本人在论文写作中参考其他个人或集体已经发表的研究成果,均在文中以适当方式明确标明,并符合法律规范和《厦门大学研究生学术活动规范(试行)》。

另外,该学位论文为()课题(组)的研究成果,获得()课题(组)经费或实验室的资助,在()实验室完成。(请在以上括号内填写课题或课题组负责人或实验室名称,未有此项声明内容的,可以不作特别声明。)

声明人(签名):

年 月 日

厦门大学学位论文著作权使用声明

本人同意厦门大学根据《中华人民共和国学位条例暂行实施办法》等规定保留和使用此学位论文，并向主管部门或其指定机构送交学位论文（包括纸质版和电子版），允许学位论文进入厦门大学图书馆及其数据库被查阅、借阅。本人同意厦门大学将学位论文加入全国博士、硕士学位论文共建单位数据库进行检索，将学位论文的标题和摘要汇编出版，采用影印、缩印或者其它方式合理复制学位论文。

本学位论文属于：

1. 经厦门大学保密委员会审查核定的保密学位论文，
于 年 月 日解密，解密后适用上述授权。

2. 不保密，适用上述授权。

（请在以上相应括号内打“√”或填上相应内容。保密学位论文应是已经厦门大学保密委员会审定过的学位论文，未经厦门大学保密委员会审定的学位论文均为公开学位论文。此声明栏不填写的，默认为公开学位论文，均适用上述授权。）

声明人（签名）：

年 月 日

摘 要

作为反映国民经济与社会发展的重要指标，GDP 被萨缪尔森称为是“20 世纪最伟大的发明”。但人们在对 GDP 的研究过程中发现，许多国家官方 GDP 统计是不全面的，由此引出了对经济生活中的遗漏生产活动的研究。这部分应该核算而未被核算的经济称为“未观测经济”（Non-Observed-Economy，简称 NOE）。

从各国的统计实践来看，未观测经济作为一种国际现象，已经成为我们经济生活中一个不可忽视的组成部分，它的存在给国民经济体系的各个层面带来了不可忽视的影响。因此，采取科学有效的手段来准确掌握未观测经济的相关信息就显得日益重要和迫切，而其首要工作就是要从宏观上估算出未观测经济的规模，这需要借助科学有效的估算方法。

虽然“未观测经济”的概念 2002 年才由 OECD 提出，但国外对未观测经济的相关研究早就存在，只是由于研究人员的出发点不同，考虑问题的角度和研究目的不同，使用了各种不同的称谓。经过诸多专家和国际机构的努力，相关研究取得了显著的进展，但由于未观测经济的隐蔽性和复杂性，涉及到经济学、博弈论、犯罪学、心理学等多个领域，有关研究受到相当大的阻碍，使得未观测经济的理论体系还不够完善。特别是我国对未观测经济的研究起步较晚，相关研究还比较少，适合我国国情的成果还不多。

本文尝试在前人研究的基础上，对未观测经济的相关问题进行专门探讨。首先是对未观测经济的涵义进行界定；其次，梳理有关未观测经济的理论，对国内外常用的估算方法进行综合比较，并作简要评价；第三，结合我国的实际数据，建立适当的模型对 1989-2008 年的未观测经济进行估算；第四，运用计量经济学和统计学方法探讨未观测经济与货币政策、财政政策、收入分配和经济周期的关系；最后，针对未观测经济产生的根源和影响，提出合理调控未观测经济的对策建议。

关键词：未观测经济；宏观经济；估算；影响

Abstract

As an important indicator to reflect both the domestic economic and social development, GDP was called “the greatest invention in the 20th century” by Paul Samuelson. However, it is found from the GDP study that many countries’ official GDP statistics are not comprehensive. This discovery leads to the study of omission production activities in economic life accordingly. And this part of economic which should be accounted for but not be accounted, is named “Non-Observed-Economy” (short in NOE).

According to the statistic practices in many countries, NOE, as an international phenomenon, has become a neglected part in our economic life. Its existence has brought neglecting influence to all areas of the national economic system. Therefore, it becomes more important and urgent to account the NOE scale with scientific and effective means. For instance, the top urgent task right now is to estimate the scale of NOE in a macro way, and we need scientific and effective estimating methods to work it out.

Although the concept of NOE was put forward by OECD in 2002, the study on NOE has been already existing for a long time. Only because of the different starting point, consideration and research purposes, the researchers used various titles. Under much effort by the experts and international agencies, it had achieved remarkable results. Owing to the hidden and complexity with NOE, it involved Economics, Game theory, Criminology, Psychology and so on. Then the research suffered a lot, and the theory system of NOE is imperfect. Particularly in China, research on NOE starts late, and the relative study is also limited, rather than results under China’s national condition.

Based on the previous studies, this paper attempts to make specialized research on issues of NOE. First of all, it defines the NOE. Secondly, it sorts out the theory of NOE and makes a comprehensive comparison with the commonly estimation methods.

The third is to establish an appropriate model to estimate 1989-2008's NOE scale under the actual date in China. Fourthly, the paper will use economic and statistical methods to discuss the relation between NOE and monetary policy, fiscal policy, income distribution and economic cycle. Finally, it provides several reasonable suggestions targeting the causes and effects of NOE.

Keywords: Non-Observed-Economy; Macroeconomic; Estimation; Effect

厦门大学博硕士论文摘要库

目 录

第一章 绪论	1
1.1 选题背景及意义.....	1
1.2 国内外研究现状.....	2
1.3 研究内容和方法.....	5
第二章 未观测经济的相关理论概述	7
2.1 未观测经济的称谓和涵义.....	7
2.2 未观测经济的类型和特点.....	10
2.3 国内外未观测经济的现状.....	15
2.4 未观测经济的估算方法及评价.....	18
第三章 中国未观测经济规模的实证研究.....	23
3.1 适合中国的通货需求模型.....	23
3.2 模型的建立.....	27
3.3 我国未观测经济规模的评价.....	31
第四章 我国未观测经济与宏观经济的关系研究.....	34
4.1 未观测经济与货币政策的计量检验.....	34
4.2 未观测经济与财政政策的计量检验.....	41
4.3 未观测经济与居民收入分配的计量检验.....	45
4.4 未观测经济与经济周期波动的计量分析.....	50
第五章 未观测经济的影响和治理建议	56
5.1 未观测经济活动的影响.....	56
5.2 对未观测经济的治理建议.....	58
第六章 结语	60
6.1 本文的主要研究结果.....	60
6.2 本文的不足和尚待研究的问题.....	61

附 录	63
参考文献	66
后 记	69

厦门大学博硕士学位论文摘要库

Contents

Chapter 1 Introduction.....	1
1.1 Background and research purpose.....	1
1.2 Research at home and abroad.....	2
1.3 Contents and methods of study.....	5
Chapter 2 Theory related to NOE.....	7
2.1 Definition and title of NOE	7
2.2 Classification and character of NOE.....	10
2.3 Research status at home and abroad	15
2.4 Estimation means and evaluation.....	18
Chapter 3 Empirical analysis on NOE in China.....	23
3.1 Suitable currency Demand Model for China	23
3.2 Model design.....	27
3.3 Evaluation about China's NOE	31
Chapter 4 Study on NOE and Macroeconomic in China.....	34
4.1 Econometric test on NOE and monetary policy.....	34
4.2 Econometric test on NOE and fiscal policy	41
4.3 Econometric test on NOE and resident's income distribution	45
4.4 Econometric test on NOE and Economic cycle fluctuation	50
Chapter 5 Impact and disposing suggestions on NOE in China	56
5.1 Effect of NOE	56
5.2 Disposing suggestions on NOE.....	58
Chapter 6 Conclusion	60
6.1 Major Research work	60
6.2 Limitations and farther study.....	61
Appendix.....	63

References66

Postscript69

厦门大学博硕士学位论文摘要库

第一章 绪论

1.1 选题背景及意义

企业员工在正常工作之余从事第二职业，居民出行乘坐没有营业证的“私家车”，毒品贩子在阴暗的小巷出售毒品，女富豪以高息进行非法集资活动，……所有这些现象，看似没有关联，但都属于典型的未观测经济活动。这其中既有合法活动，更多的是非法活动，每年形成的“账外经济”达到惊人的程度。

未观测经济作为一种国际现象，它的存在给国民经济体系的各个层面带来了不可忽视的影响。从统计角度看，它造成了 GDP 的失真，导致劳动力统计的偏差，致使相关官方统计信息间出现矛盾；从社会角度讲，未观测经济加速了劳动力流动，使得大量工人缺乏社会保障；着眼于国家，未观测经济造成了国家财政税收的大量流失，大大增加了政府部门官员的寻租机会，导致腐败行为发生；立足经济角度，未观测经济造成社会资源的巨大浪费，导致市场资源配置的失效，阻碍了经济的正常运行……

无论我们对未观测经济进行怎样的道德评价，它已经渗入我们经济生活，成为其中一个不可忽视的组成部分，这是人人皆知的事实。由于未观测经济活动的隐蔽性，具有广泛的负面影响，近年来受到国际社会和各国政府的高度重视。早在 2004 年国务院内部经济工作会议上，温家宝总理就发出警告：“游离于政府监控之外的中国“地下经济”正以超乎人们想象的势头增长。庞大的“地下经济”犹如中国经济大厦的“火山口”，随时可能对国家的经济金融安全造成严重威胁，对此必须密切关注。”

诚如诺贝尔奖获得者保罗·萨缪尔森所说，“虽然 GDP 和其他国民收入账户是显得有点神秘的概念，但它们确实属于 20 世纪最伟大的发明之列。”遗憾的是，就是这个最伟大的发明——GDP 核算，最初却忽视了未观测经济这部分事实上存在的经济活动。

进行未观测经济核算最关键的问题是怎样统计未观测经济活动，以确定其活

动影响。由于未观测经济的隐蔽性、复杂性等特征，未观测经济资料的零散和不完整。长期以来，现有的方法常常难以准确估算，出于不同的研究初衷，借助不同方法得到的估算结果往往出现较大分歧。

鉴于此，采取科学有效的手段来准确掌握未观测经济活动的相关信息就显得尤为重要，它需要借助科学有效的估算方法。

中国未观测经济规模核算始于 20 世纪末。此后，尽管采用各种方法进行核算实践，但与国外研究相比，国内所运用的方法还比较落后，并缺乏中国特色。因此，系统、深入地总结和归纳国外有关未观测经济规模的估算方法，选择可行的方法应用到中国未观测经济规模的估算实践中，对我国国民经济核算研究具有重大的现实意义，是全面掌握我国国民经济现状，实现经济又好又快发展的充要条件。

本文尝试着在考察未观测经济内涵、估测方法和国内外经典应用的基础上，结合所学的宏观经济学、国民经济统计学、计量经济学等知识，对我国未观测经济规模及其与宏观经济的关系进行实证研究。

1.2 国内外研究现状

一、国外研究现状

尽管“未观测经济”的概念到 2002 年才由经济与合作组织正式提出，但学界对它的研究早就存在，尤其是对地下经济的研究，在第二次世界大战后就曾经出现过一次高潮。到了 20 世纪 70 年代，困扰西方资本主义世界的“滞胀”现象，动摇了凯恩斯主义在西方经济理论界的统治地位，西方学者开始从其他角度思考经济现状，促使各国再度掀起对地下经济的研究热潮。研究的内容涉及多个方面，包括未观测经济的定义与类型，未观测经济的核算范围，各种未观测经济活动的表现及特点，未观测经济对公开经济的影响和未观测经济的估算方法等。这里我们简要介绍一下在未观测经济发展过程中比较重要的研究成果。

在理论上，艾德加·法伊格编著了《地下经济学》^①，书中对艾德加·法伊格、罗伯特·T·阿尔福德和里查德·D·庞特等人有关地下经济的研究进行系统的整理，较完整地提出了地下经济的定义、类型、影响与估算方法等，是有关

^① [美] 艾德加·L·法伊格. 地下经济学[M]. 上海: 上海三联书店出版社, 1993

地下经济研究领域的经典著作。大卫·C·柯兰德所编著的《新古典政治经济学：寻租与 DUP 活动分析》^①第一个把新古典政治经济学的主要文献集成一体，分析了一些个体企图避开亚当·斯密“看不见的手”，使政策朝着有利于他们自身利益的方向改变，作者把地下经济活动与寻租理论上升到新古典政治经济学的高度来评价。秘鲁学者费尔南多·德·莱多在他的《另一条道路》^②一书所研究的非正规经济活动，或者说“非法”经济活动，不是指诸如走私、贩毒、卖淫嫖娼、偷窃或绑架等暴力违法犯罪活动，而是指通过非主流的方式和渠道，去实现某些合法权利。他从制度方面分析了非正规经济产生和发展的原因，认为政府对经济生活进行的不适当干预和法律制度的不健全，是非正规经济得以发展的主要原因，被学术界认为是探讨发展中国家“地下经济”的经典著作。此外还有印度国家公共财政及政策研究所的《黑色经济活动分析》等著作。

未观测经济的估算方法一直是国内外学者研究的重点。就目前看来，研究成果主要集中在直接法和间接法两个方面。直接调查法是使用一定的方法和技术通过调查或观察来直接获取有关未观测经济活动信息的方法，主要有税收审查和抽样调查两种形式。如 Kevin F. McCrohan 和 James D. Smith (1986) 曾经通过电话访问和入户调查的方法，在对居民消费支出调查的基础上，对美国地下经济规模作出大体的估算，结果显示：居民申报的收入比同期支出少了近 500 亿。间接估算法是采用间接方式，通过观察官方统计信息中与未观测经济相关的宏观指标，结合一定的方法和模型来估算未观测经济的规模。比较常用的有：①国民账户分析法，1980 年英国学者麦考菲 (Macafee) 从收支平衡的角度对未观测经济进行估算，他认为人们一般会隐瞒收入但不会隐瞒支出，可以通过把官方统计的总支出减去总收入的差额作为地下经济的估算数。②劳动力差异分析法，这种方法是通过观察一段时间内总人口数 N 、官方注册的劳动人口数 L 、劳动力供给数 G 的变化情况来估算未观测经济。它的基本思想是：假定 G/N 一定的条件下， L/N 这个比率数值的减少就意味着从事未观测经济劳动人数的增加，同时也就意味着未观测经济本身规模的扩大。③物量投入分析法，此法有点类似货币分析法，它也是试图通过寻找某个和“正常标准”相联系的物量（例如电力消耗），并观察官方计算的国民生产总值的增长是否能说明该投入物量的增长，如果不能，那就认

^① 大卫·C·柯兰德. 新古典政治经济学：寻租与 DUP 活动分析[M]. 长春：长春出版社，2005

^② 费尔南多·德·莱多. 另一条道路[M]. 沈阳：辽宁人民出版社，1992

为存在未观测经济。④潜在变量法，它根据一组解释变量的变化来估算未观测经济的规模。这些变量一方面影响未观测活动的规模和增长，另一方面则是未观测经济留在经济中的“踪迹”，即反映未观测活动的指标。因此利用不同国家的横截面数据或同一国家不同时期的时间序列数据，对未观测到的因变量与一个或多个观测到的解释变量之间的关系进行典型性分析，可估算出不同国家或一国不同时期未观测变量的相对规模。⑤货币分析法，它是目前使用最多的方法，又可以细分为简单现金比率法（Gutmann,1977）、通货需求法（Tanzi,1980,1982）和货币交易法（Feige,1979）等。这种方法的主要特点是，假定不同的货币存量总和之间的关系是固定不变的，它们同经济中的收入和交易问题等宏观经济指标也是相对固定的，因此可以把不同年份与“基准年”的偏差归因于未观测经济的发展。这些方法都是在一定的假设条件和特定的经济背景下提出来的，有一定的合理性。关于未观测经济规模的估算方法我们会在第二章进行讨论。

二、国内研究现状

由于我国在上世纪 70 年代末改革开放以前几乎不存在未观测经济，因此国内对此研究相对国外起步较晚，基本是从改革开放以后才开始的。1992 年黄苇町编著的《中国隐形经济》是我国研究未观测经济的首部著作，书中对我国各种类型的未观测经济活动及其相互关系做了全方位的考察，对藏匿在公开统计数字背后的黑色和灰色经济活动规模进行宏观分析和总量测算。比较系统研究该问题的是夏兴园教授主编的《中国地下经济问题研究》，他分析了地下经济的涵义、在我国的表现形式，以及产生的条件和原因等，同时对旧中国的地下经济进行了纵向考察，为我国治理地下经济提出了建议。夏南新出版的《地下经济估测》是在作者的博士论文基础上完成的，系统讨论了地下经济理论和估算方法，紧密联系实际，对我国地下经济的估算结果令人置信。中央党校讲师梁朋的《税收流失经济分析》一书，从税收流失现象出发探讨了地下经济与我国税收流失的关系。他们是我国未观测经济研究的先行者。

在未观测经济的估测方法方面，我国学者对直接法的研究比较少，吴润生在《未被观察到的经济——范围、定义、类别和方法》一文中将直接法分为地区抽样调查、时间利用调查、使用调查者介入的技术调查、财政审计和其他相关控制数的运用四种类型，同时简要介绍了混合法的概念和分类，主要有敏感性分析和

非观察变量法。他认为混合法是通过直接信息和间接信息将直接法和间接法的特征结合在一起。

朱小斌、杨缅昆（2000）在国民账户分析法和简单现金比率法基础上提出了 GDP 分割模型，并估算了我国 1979 年至 1997 年的“地下经济”规模，即将地下 GDP 分为浮现地下 GDP 和流通地下 GDP，两者分别进行测算。刘洪、夏帆（2003）在《我国非正规经济规模的定量估测——现金比率法的修正及实证分析》中对简单的现金比率法进行了修改，提出修正的现金比率法：即放宽现金作为唯一交换媒介的假设，采用狭义货币 M1 和广义货币 M2 的口径来推算非正规经济规模，并基于修正的简单现金比率法对我国地下经济规模作了估测。夏南新根据中国的实际情况，提出基于社会货运量变动的物量投入法，并给出了我国地下经济规模估计。张迎春（2003）讨论通货需求模型的形式，找出比较适合我国国情的以税率、人们的收入、利率和通货膨胀率为解释变量的模型。李金昌、徐霭婷（2005）以我国居民的消费储蓄及与国民总收入之间为基础，提出居民消费储蓄边际倾向——弹性系数估算法和预期与分布滞后模型估算法、并对我国未观测经济规模作估算等。徐霭婷、李金昌（2007）从未被观测经济在整个经济系统中的逻辑地位入手，根据结构方程原理构建了中国的 MIMIC 模型，以经济普查的实际数据为依据估算了历年未被观测经济规模及其占国内生产总值的比重。总之，这些研究有的是基于国外模型的简单应用，有的是对国外模型的改进，还有一些是对新方法的尝试。

1.3 研究内容和方法

一、研究内容

本文将从理论和实证两方面对我们未观测经济规模进行估算，并对未观测经济与我们宏观经济的关系进行探讨。在研究方法上，本文将遵循提出问题→理论分析→建立模型→实证检验的思路来展开；在内容上，本文共分为 6 章：

第一章为导论，这一部分主要介绍本文的研究背景及意义；回顾国内外学者在未观测经济领域的研究现状与动态；简要介绍本文所采用的研究方法和研究的主要内容等。

第二章是有关未观测经济的相关理论概述，该章将分为四部分，第一部分主

要将对未观测经济的称谓和定义等概念进行界定；第二部分介绍未观测经济的分类标准和特点；第三部分将全面考察国际和国内未观测经济的现状；第四部分对目前未观测经济的估算方法进行综合比较。

第三章对我国未观测经济的规模进行估算，结合我国未观测经济的特点，寻找适合我国国情的解释变量，建立合理的估算模型。本章分为三个部分，第一部分对模型进行简要回顾；然后从经济意义上对具体变量进行筛选；第二部分是进行模型的计量经济学和统计学检验，最终建立模型；第三部分运用建立的模型对我国未观测经济进行估算，并做出分析。

第四章对我国未观测经济与宏观经济的关系进行探讨，结合我国宏观方面的相关数据，应用计量经济分析工具，探讨未观测经济与若干宏观经济政策的关系。综合运用 ADF 检验、误差修正模型、格兰杰因果关系检验等分别对未观测经济与货币政策、未观测经济与财政收入和支出、未观测经济与居民收入分配、以及未观测经济对宏观经济周期波动的影响四个方面进行分析。

第五章为政策建议，在前文理论与实证分析的基础上，结合未观测经济产生的影响，对控制和减少未观测经济提出政策建议。

第六章对全文进行总结，分别介绍本文所得到的主要研究成果和本文存在的不足，并简要说明尚待研究的问题。

二、研究方法

好的研究离不开科学的研究方法。本文将以唯物辩证法为指导，以文献研究法、比较分析法、调查研究法、归纳演绎法为工具，采用图表说明等方式，将规范分析与实证分析相结合，综合运用国民经济统计学、抽样调查方法、宏观经济学和计量经济学知识，以定量研究方法为主，并借助 Eviews 等相关统计软件。此外，基于本选题的内容性质，由于未观测经济涉及到经济学、管理学、社会学、法学、犯罪学、行为科学等学科，本文还会使用到博弈论、公共社会学与心理学等理论思想。

Degree papers are in the "[Xiamen University Electronic Theses and Dissertations Database](#)". Full texts are available in the following ways:

1. If your library is a CALIS member libraries, please log on <http://etd.calis.edu.cn/> and submit requests online, or consult the interlibrary loan department in your library.
2. For users of non-CALIS member libraries, please mail to etd@xmu.edu.cn for delivery details.

厦门大学博硕士学位论文摘要库