

学校编码: 10384

分类号 _____ 密级 _____

学号: 15420091151678

UDC _____

厦 门 大 学

硕 士 学 位 论 文

我国进出口贸易与经济增长关系的经验分析

Empirical Analysis of Relations between Import and Export
Trade to Economic Growth in China

董 博

指导教师姓名: 陈建宝教授

专 业 名 称: 统计学

论文提交日期: 2012 年 4 月

论文答辩时间: 2012 年 5 月

学位授予日期:

答辩委员会主席: _____

评 阅 人: _____

2012 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

厦门大学博硕士学位论文摘要库

摘 要

改革开放以来，中国经济取得了巨大的成就，2010 年国内生产总值达 397983 亿元，成为世界第二大经济实体。大量的研究文献表明，在过去的三十多年里，中国经济之所以能保持较快的发展速度，进出口贸易，特别是出口贸易的贡献功不可没。如何通过计量建模，准确的研究进出口贸易对我国经济发展的贡献，是一项很有价值的研究工作。

论文首先较系统的介绍了研究背景、文献综述、研究方法和理论基础。其次，针对目前国内学者研究的不足，本文尝试选取有代表性的指标，基于全国 31 个省（市、区）1997-2010 年的面板数据，同时利用非参数面板模型和空间自回归模型两种不同的模型，全面地分析了固定资本、人力资本、出口贸易、进口贸易与经济增长之间的关系，并加以比较分析。最后，对主要的结论进行总结，提出了相关的政策建议，并对未来的研究方向进行了展望。

论文的主要结论有：（1）固定资本、人力资本、出口贸易和进口贸易的产出弹性均为正值，其中固定资本和出口贸易的产出弹性较大，显示出我国的经济增长主要是由固定资本投入和出口贸易拉动的，与前些年国家采取的经济发展战略相符合。（2）出口产出弹性关于出口、固定资本、人力资本、进口都具有倒“U”型特征；进口产出弹性关于固定资本、人力资本、出口都具有“U”型特征。（3）相邻省域的 GDP 具有相互促进作用，固定资本、人力资本、出口贸易和进口贸易对本地 GDP 都产生积极的影响，但在不同省份它们影响的力度是不一样的，而且相邻省份的对外贸易对本地区的 GDP 具有削弱倾向。

论文可能的创新点主要有：（1）采用非参数面板模型，克服了参数模型存在的多重共线性问题和模型设定约束，提高了模型的拟合优度和分析结论的可靠性；（2）不仅分析了多个因素与经济增长的关系，还考察了这些因素之间的相互影响作用；（3）采用时空数据空间自回归模型进行实证分析，考虑了变量的空间特征，提高了模型的拟合优度，使计量结果更可靠。

关键词：进出口贸易；经济增长；产出弹性；非参数面板模型；空间自回归模型

厦门大学博硕士学位论文摘要库

Abstract

Since reform and open policy has been taken, China has made great achievements in economy. In 2010, China's GDP reached 39.7983 trillion Yuan and is the second position in the world. In the past 30 years, foreign trade, especially export trade, made great contribution to the rapid development of China's economy. Therefore, how to build models by Econometrics methods and analyze the contribution has become an extremely important issue.

The main conclusions of this paper are summarized as follows: (1) The impacts of physical capital stock, labor capital, export trade and import trade to GDP are positive. The influence order from small to large is import trade, labor capital, physical capital stock and export trade respectively. According to this we know that China's economic growth was mainly driven by physical capital stock and export trade. It is consist with China's development strategy a few years ago. (2) The trends of output elasticity of export trade with respect to physical capital stock, labor capital, export trade and import trade are inverted "U" types. The trends of output elasticity of import trade with respect to physical capital stock, labor capital, export trade and import trade are "U" type, "U" type, "U" type and inverted "U" type respectively. (3) GDPs of adjacent provinces promote each other. The impacts of physical capital stock, labor capital, export trade and import trade to local GDP are positive. The intensity of their affects varies in different provinces. The trade of neighboring provinces has weakened tendency to the local GDP.

The possible innovative points of this paper are: (1) By using non-parametric panel data model, we overcome the existing problems of multicollinearity and the model set constraints of the parametric model, and improve the goodness of fit of the model. (2) We not only analyzed the relationship between economic growth and physical capital stock, labor capital, export trade and import trade, but also investigated the interactions between these influence factors. (3) By using spatial temporal autoregressive models, we overcome the spatial difference of the data in time series analysis.

Keywords: Import Trade and Export Trade; Economic Growth; Output Elasticity; Non-parametric Panel Data Model; Spatial Temporal Autoregressive Models

厦门大学博硕士学位论文摘要库

目 录

第一章 绪论	1
第一节 选题背景与意义	1
第二节 研究框架与主要内容	5
第三节 可能的创新点	5
第二章 文献综述	7
第一节 进出口贸易与经济增长概述	7
第二节 国内外学者的研究情况	9
第三章 基于非参数面板模型的实证分析	13
第一节 非参数面板模型的构建	13
第二节 实证结果和分析	19
第三节 非参数逐点回归估计及分析	20
第四章 基于空间自回归模型的实证分析	27
第一节 时空数据空间自回归模型的基本类型	27
第二节 实证结果和分析	30
第五章 研究总结、政策建议与展望	36
第一节 研究总结	36
第二节 政策建议	37
第三节 研究展望	38
参考文献	39
致 谢	43

厦门大学博硕士学位论文摘要库

Contents

Chapter 1 Introduction	1
Section 1 Research Background.....	1
Section 2 Research Contents and Structures	5
Section 3 Possible Innovations Points of the Thesis	5
Chapter 2 Literature Review	7
Section 1 Overview of Foreign Trade and Economic Growth.....	7
Section 2 Global Analysis of Current Situation.....	9
Chapter 3 Analysis Based on Non-parametric Panel Data Models ··	13
Section 1 Non-parametric Panel Data Models.....	13
Section 2 Empirical Conclusions and Analysis	19
Section 3 Point by Point Estimates and Analysis.....	20
Chapter 4 Analysis Based on Spatial Temporal Autoregressive	
Models	27
Section 1 Basic Types of Spatial Temporal Autoregressive Models	27
Section 2 Empirical Conclusions and Analysis	30
Chapter 5 Conclusion Summary, Policy Suggestions and Prospects	36
Section 1 Conclusion Summary.....	36
Section 2 Policy Suggestions	37
Section 3 Research Prospects.....	38
Reference	39
Acknowledgements	43

厦门大学博硕士学位论文摘要库

第一章 绪论

第一节 选题背景与意义

改革开放以来，对外贸易在我国经济总量中的份额不断提高，与宏观经济增长的关系十分密切，使得国际贸易理论中的外贸是经济增长引擎的论断得到了较好的验证。虽然我国经济增长的主要拉动力是消费和投资。但是从长远角度来看对外贸易对我国经济增长的促进作用不可忽视，对外贸易对经济增长的影响不仅体现在量上，更体现在质上。在一个较长的时间跨度里，对外贸易在引进新产品、新技术、推动我国产业结构升级、加快工业化和现代化进程、促进国民经济保持持续快速健康发展、加速我国制度的市场化转型和国际经济接轨等方面起着不可替代的作用。

我国长期以来一直实行出口导向型的战略政策，不遗余力地推行以出口创汇为主要目标的对外贸易政策，这在很大程度上促进了经济的发展。然而，随着科技的发展和全球化程度的不断加强，尤其是成功加入 WTO 之后，我国的对外贸易发展进入了一个新的时期，国际贸易环境发生了很大的变化，对中国现行的对外贸易政策提出了严峻的挑战。

随着近几年美国经济下滑，世界经济发展缓慢，贸易保护主义抬头，许多国家尤其是美国与中国的贸易摩擦不断增加，我国已经成为世界上反倾销和贸易保护措施的最大受害国，出口贸易环境严重恶化。

贸易顺差和资本流入的增大，使得外汇存款造成的货币增长大幅度提高，外汇储备过多，人民币面临升值的压力。美国财长诺斯、鲍尔森，前联储主席格林斯潘在不同场合多次提及人民币汇率偏低的问题，要求随着中国经济实力的增加提高人民币汇率。

中国贸易依存度不断加大。据统计，2005 年中国对外贸易依存度高达 63.9%。在如此高的贸易依存度下，增强产品在国际上的竞争力是经济发展的必要手段，而一味追求产品出口创汇则对我国经济发展构成威胁。过去，我国外贸政策主要放在规模与速度的增长上，追求贸易顺差与外汇储备，使企业片面

强调多出口，多创汇，少进口，节约使用外汇，从而导致出口商品供给的急剧增加，价格迅速下降，贸易条件恶化。

进口在很大程度上可以促进国民经济的增长，当前出口导向的政策不仅对我国对外贸易带来了很多问题，而且大量的出口导致我国资源外流，降低了社会福利和人民生活水平，而适当增加原产设备，尤其是高科技产品的进口，这不仅有利于解决当前我国对外贸易存在的问题，而且有助于提高我国技术水平及资源使用率，实现产业结构的升级，改变经济增长方式。因此，我国应该积极发展增加进口的策略，实现进出口贸易平衡发展，从而促进我国经济次序健康发展。

在这种情况下，仍然保持以往的出口策略将会阻碍我国对外贸易的发展，影响我国的国际形象，破坏良好的国际环境，从而影响我国经济发展。所以在开放经济中，一国应该实行进口、出口并重的积极贸易政策。绝大多数的发展中国家都认识到出口对加快本国经济发展和增加外汇储备的作用，所以各国都实行了许多鼓励本国出口的措施，但是对进口却采取了种种限制政策，忽视了进口对经济增长的重要作用。发展中国家应该采取比较中性的贸易政策，在积极扩大出口的同时，要充分利用出口的外汇来进口本国所需的各种紧缺资源和技术，不应该拥有太高的外汇储备，以免延缓本国的经济发展。出口不仅是拉动经济增长的动力和增加外汇储备的源泉，也应该是扩大进口的外汇基础，因此我们应立足国情正确看待进出口对我国经济增长的作用。

因此，研究如何保持中国经济高速增长，中国经济增长的动因及其之间的相互关系就成为一个极为重要的课题。我们可以基于公开的数据，利用各种统计方法发现其中的规律，探究其间的联系，以便于制定合理的发展政策。

中国经济这几十年来取得了巨大的成就，同时也是非常好的研究课题，自1978年改革开放以来，中国实行社会主义市场经济，每年以9.4%的增长率令世界震惊。同时，中国在贸易方面也取得了巨大的成长。从1980年到2010年，中国的贸易水平从380亿美元增长到7460亿，30年间几乎增长了20倍，远高于同期的世界增长水平。在2001年中国加入世界贸易组织后，中国经济更是飞速发展。近些年，中国经济增长对世界GDP增长的平均贡献仅次于美国，排名世界第二，与此同时，中国对外贸易扩大给世界各国带来了诸多益处，年平均

出口增速达到 31.4%。中国物美价廉的商品输往世界各地，提高了进口国居民实际收入水平，促进了消费的增长。

对于经济开放度与经济增长的关系，国外经济理论界有较为一致的观点，即经济开发能够促进经济增长。英国古典经济学家亚当斯密是西方经济学家中最早涉及国际贸易与经济增长相互关系问题的。他提出的动态生产率理论和“剩余产品出口”模型，对以后的理论发展有重要影响。斯密关于分工的论述包含了国际贸易具有带动经济增长作用的最初思想。其“剩余产品出口”理论更是着眼于贸易对经济增长的带动作用。他首先假定一国在开展国际贸易之前，存在着闲置的土地和劳动力，这些多余的资源可以用来生产剩余产品以供出口，这样对外贸易为一国提供了利用过去未能充分利用的土地和劳动力的机会，为本国的剩余产品提供了“出路”。而且，这种剩余产品的生产不需要从其他部门转移资源，也不必减少其他国内经济活动，因而出口所带来的收益以及换回的本国需要的产品，也没有机会成本，因而必然促进该国的经济增长。他说：“我们完全有把握相信，自由贸易无需政府的注意，也会给我们提供我们需要的葡萄酒，我们也可以有把握的相信，自由贸易总会按照我们所能购买的或所能使用的程度，给我们提供用以流通商品或用于其他用途的全部金银。”

大卫李嘉图创立的比较成本理论，论证了贸易静态利益的基础。他认为，对外贸易是实现英国工业化和资本积累的重要手段。并指出，经济增长的基本动力是资本积累。随人口的增加，食品等生活必需品的价格会因土地收益递减规律的作用而逐渐昂贵，工资（劳动力价格）也会随之上涨。在商品价格不变的情况下，工资上涨将使利润下降，从而妨碍资本积累。通过对外贸易，如果转移从外国获得较便宜的食品等生活必需品以及原料，就会阻止在本国发生作用的土地收益递减化倾向，促使经济增长。

而按照马克思主义的观点，对外贸易与经济增长的关系，归根到底是交换与生产的关系。从本质的意义上讲，生产决定交换，在一定条件下，交换也能对生产发生反作用，有时会对生产产生巨大的推动作用或阻碍作用。

较为系统的论述贸易的发展利益的古典经济学家，是英国的约翰穆勒。他第一次明确区分了贸易利益和发展利益。他指出：国际贸易通过下列途径推动不发达国家的发展：“外国工艺技术的引进，提高了资本的收益率；外国资本的

引进使生产的增长不仅又依赖于本国居民的节约和精打细算，并且为本国居民提供了激励性的示范，向人们传输了新的观念。”，它启发人们从新的角度来认识贸易利益问题。

受古典经济学家上述观点和理论的启发，后来的经济学家进一步探讨了贸易对经济的带动问题。其中较为著名的是 D.H.罗伯特逊在 20 世纪 30 年代首次提出来的对外贸易是“经济增长的发动机”命题。20 世纪 50 年代，R.纳克斯对这一学说又进行了进一步的充实和发展。纳克斯在分析 19 世纪国际贸易的性质时指出，19 世纪的贸易不仅是简单的把一定数量的资源加以最适当配置的手段，它实际上是通过对外贸易把中心国家的经济成长传递到其他国家，即中心国家经济迅速增长引起的对发展中国家初级产品的大量需求引发了发展中国家的经济增长，因此，对外贸易是经济发展的发动机。这一理论认为，较高的出口增长可以带动经济的增长。

澳大利亚国际经济学家马克思科登提出了贸易对经济增长率的影响效应理论。其理论要点是将对外贸易与宏观经济变量联系起来进行分析，并且特别强调外贸对生产要素供给量的影响和对劳动生产率的作用。科登认为，贸易对经济增长的贡献作用随着经济的发展逐渐得到强化。

70 年代，克拉维斯提出了对外贸易不是增长的“发动机”，而只是增长的“侍女”的著名见解。他明确指出，一国的经济增长主要是由国内其他因素决定，外部需求只构成了对经济增长的额外刺激，这种刺激在不同国家的不同时期有不同的重要性；外贸既不是增长的充分条件也不是必要条件，而且还不一定必然对经济增长有益。但自 70 年代末期以来，越来越多的人注意到，那些对外贸易发展较快，实行外向型战略的国家和地区，同时实现了较高的经济增长率。于是许多经济学家倡导“出口导向”。而后，巴拉萨等人利用跨国家的横截面数据或单个国家的时间序列数据，对出口和经济增长的关系做了许多回归分析，并得出了“外贸有利于促进经济增长”的结论。

80 年代中期以来，以罗默，卢卡斯和斯文森等人为代表的新经济增长理论，把技术变动作为推动生产率增长的核心因素。国际贸易与技术变动的相互促进关系将保证一国经济的长期增长。

新贸易理论经济学家克鲁格曼和海尔波曼则认为，国际贸易促进经济增长

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