# 深圳市对外贸易与经济增长的实证研究(1)论文

来源：网络 作者：雾花翩跹 更新时间：2024-05-31

*【论文摘要】 本文利用深圳市1983-2011年的数据，对深圳市出口、进口与经济增长之间的关系进行了协整分析，格兰杰因果检验，并根据格兰杰定理建立了三者之间的误差修正模型。协整分析结果表明，出口、进口与GDP存在长期均衡关系；格兰杰因果检验...*

【论文摘要】 本文利用深圳市1983-2011年的数据，对深圳市出口、进口与经济增长之间的关系进行了协整分析，格兰杰因果检验，并根据格兰杰定理建立了三者之间的误差修正模型。协整分析结果表明，出口、进口与GDP存在长期均衡关系；格兰杰因果检验表明GDP是进出口增加的原因，进出口增长不是GDP增长的原因；从增长率的角度来看，出口对GDP的增长具有更强的促进作用，而进口对GDP的增长的促进作用并不明显。

【论文关键词】 对外贸易 经济增长 协整分析 格兰杰因果检验 误差修正模型 自1980年5月，中共中央和国务院正式将深圳定为“经济特区”以来，深圳经济特区的进出口贸易大幅度增长。1980年深圳的进出口总额仅为1751万美元，2001年深圳进出口贸易总额上升为685.97亿美元，其中，出口贸易总额为374.76亿美元 ，进口贸易总额为311.21亿美元。

2002年深圳进出口贸易总额上升为872.16亿美元；其中，出口贸易总额为465.42亿美元，进口贸易总额为406.74亿美元；2003年深圳进出口贸易总额上升为1174亿美元，其中，出口贸易总额上升为629.71亿美元，进口贸易总额上升为544.29亿美元，2011年深圳进出口贸易总额上升为1472.7亿美元，其中，出口贸易总额为778.43亿美元，进口贸易总额为694.33亿美元。由统计数据我们可以得出：.2011年进出口贸易总额是1980年的8411倍，是2000年的2.3倍。

其中进口贸易总额是2000年的2.36倍，出口贸易总额是2000年2.25倍。进出口贸易的快速增长大大促进了深圳的经济增长，并且已经成为深圳经济增长的重要渠道。

在此情况下，研究深圳进出口贸易对深圳经济增长具有很重要的现实意义。 郝雁（2006）选取1981年～2011年度的数据对广东省对外贸易与经济增长实证分析时指出由于广东省的特殊情况，进口拉动经济的增长且对经济增长的贡献较大，而出口增长对广东省GDP增长的相关性较弱。

本文在前人研究的基础上，以深圳市作为研究对象，根据格兰杰定理，通过对深圳市GDP、进口，以及出口三个变量的协整分析，格兰杰因果检验以及误差修正模型，以分析进出口对深圳市经济增长的贡献问题。比较对外贸易的两个方面，出口和进口究竟哪一个对经济增长的贡献比更大并分析主要原因，以求对深圳市进出口对经济增长的初步分析。

一、出口、进口与GDP的协整分析 1.数据的选取和处理 我选取1983年～2011年度数据作为样本空间，数据均来自《广东省统计年鉴》（1995年～2005年）：在变量的选取上，进、出口总额均用当年的平均汇率换算成以人民币为单位的进、出口总额，同时，考虑物价水平的波动，因此采用剔除物价因素。取（1983=100）的实际GDP、实际出口总额和实际进口总额。

另外，分别对实际GDP、实际出口总额和实际进口总额取对数以消除数据中存在的异方差，分别用：Lny=Ln（GDP/P）、LnX=Ln（EX/P）、LnM=Ln（IM/P）表示自然对数的实际GDP、实际出口总额和实际进口总额。 2.单位根检验 由于对非平稳变量建立回归模型会产生虚假回归的问题，所以首先对各变量进行平稳性检验，滞后期的选择采用AIC准则。

检验结果如下表所示： 如上表所示，检验结果表明LNY、LNX、LNM的ADF值均大于5%的临界值，它是属于不平稳的。经过一次差分，经检验，其ADF值均小于5%的临界值，则表明他们是平稳的。

所以LNY、LNX、LNM是～I

（1），即3个变量是一阶单整变量。 3.协整检验 协整检验是用来检验非平稳变量之间的是否存在长期均衡的关系。

如果若非平稳变量之间存在协整关系，则它们之间的差即非均衡误差是平稳的。根据Johnson的最大似然方法来检验LNY、LNX、LNM之间的协整关系，其中滞后期的选择根据非约束的VAR模型的残差分析结合似然比检验而得到。

本文将模型的滞后阶数取1，然后可得相应的检验结果。 由所得检验结果知：LNY、LNX、LNM3变量之间存在协整关系。

估计出的协整关系如下： Ut=LNYt-0.36LNMt-0.40LNXt-2.5(1） （3.33）（4.40）（8.17） 对Ut进行单位根检验的结果结果中ADF值（-3.77）小于5%下ADF的临界值（-3.0294），序列是一个平稳序列。综上，我们可以得出：LNY、LNX、LNM3个变量之间存在长期均衡关系。

二、格兰杰（Granger）因果检验 协整检验结果告诉我们变量之间是否存在长期的均衡关系，但这种关系是否构成因果关系还需进一步检验。作Granger因果检验，检验结果如下： \' 检验结果表明：在5%临界水平上经济增长是进口增加的原因和出口增加的原因，出口增加和进口增加不是经济增长的原因。

进、出口增长在很大程度上是由对外经济政策决定的，同时隐含了深圳目前的进、出口水平还没有达到显著拉动经济增长的能力。

三、误差修正模型 根据格兰杰定理，一组具有协整关系的变量一定有误差修正模型的表达式存在。我们用et表示模型

（1）中的残差项Ut 作为非均衡误差项建立误差修正模型： △LNYt=0.16-0.06△LNMt+0.29△LNXt-0.07et-1

（2） （5.37）（-0.89） （5.07）（0.67） R2=0.619s.e=0.09 DW=1.57T=22（1983-2004） 由于模型中的变量△LNMt的系数值没有统计特征，所以把该变量从模型中剔除，最后确定误差修正模型如下： △LNYt=0.16 +0.27△LNXt-0.10et-1

（3） （5.4）（5.19） （1.06） R2 =0.60 s.e=0.09 DW=1.59 T=22（1983-2004） LM1=0.36 LM2=0.16 ARCH=0.02 模型

（3）的回归系数都通过了显著性检验。误差修正项系数为负，符合反向修正机制。式中LM1和LM2分别是检验随机项一阶和二阶自相关的统计量，因为对于模型

（3）有LM1Πx20.05

(1)=3.84， LM2Πx20.05

(2)=5.99，所以该模型不存在自相关。式中的ARCH是检验随机项是否存在异方差的统计量，因为对于该模型有ARCHΠx20.05

(1)=3.84，所以该模型不存在异方差。对于模型

（3）中的残差序列的正态性检验结果为JB=1.29，这表明回归残差序列满足正态性，不存在自相关和异方差。验证了ECM模型的有效性。

完整的ECM模型如下所示： △LNYt=0.16 +0.27△LNXt-0.10（LNYt-0.36LNMt-0.40LNXt-2.5） ECM模型显示（对数）深圳GDP与出口年增长量序列存在紧密关系，尤其存在稳定密切关系。也即是说从增长率的角度来看，出口对GDP增长率增长更具有促进作用，而进口对GDP增长的促进作用并不明显。

平均来说（对数），出口年增长量以0.27的比率影响GDP的年增长量变化。即出口增长率每增加1%，GDP增长0.27%。

上一年度的GDP、 进口、出口的非均衡误差以0.10的比率对本年度的（对数）GDP做修正。

四、结论 通过对深圳市GDP和进出口的协整检验，并在此基础上进行的Granger因果检验和误差修正模型来分析经济增长同进出口之间的关系，得出以下结论： 1.从短期来看，进口贸易的效益（进口设备的利用等）没有发挥出来，经济增长存在巨大潜力。 2.从长期来看，GDP与进出口之间存在惟一的协整关系，即它们之间存在长期的稳定的均衡关系；但是进出口与GDP之间存在单向的因果关系，GDP增长是进出口增加的原因，而进出口增加不是GDP增长的原因。

3.进出口对经济增长的作用。从分析中可以看出，进口对经济增长的影响不显著，即进口增长对深圳GDP增长的相关性较弱。

而出口对经济增长的作用比较显著。究其原因，深圳的发展有目共睹，深圳属于技术密集型的企业比较多，有大量的人才优势和国际地区优势，故出口对经济增长的贡献大于进口对经济增长的贡献。

针对以上分析结论，本文从以下几个方面提出深圳实现经济可持续发展的政策建议: 1.深化外贸体制和外贸企业改革。在现在有基础上，经积极推动外贸企业的发展，以确保其对经济增长的贡献。

同时大力扶持和引导生产企业和地区外贸企业的发展，培育外贸经济增长点; 2.大力发展对外加工贸易; 3.大力引导深圳技术密集型企业的发展，鼓励引进先进技术，机器设备，积极发挥进口对经济增长的促进作用。 参考文献: 易丹辉:数据分析与应用[M].北京:中国统计出版社，2002 李子奈潘文卿:计量经济学[M].北京：高等教育出版社，2000 刘家悦:武汉市出口贸易与经济增长关系得实证分析[J].时代经济，2007

（1） 郝雁:广东省对外贸易与经济增长的实证研究[J].特区经济，2006

（2） 魏巍贤:中国出口对经济增长贡献的实证分析[J].商业研究1999

（1） 朱廷珺于宾:对外贸易与经济增长:文献述评[J].兰州商学院学报 2006

(10)

本文档由028GTXX.CN范文网提供，海量范文请访问 https://www.028gtxx.cn