

经济

中国服务贸易竞争力的 理论与实证研究^{*}

夏杰长 姚战琪 齐 飞

【提 要】进入新世纪,中国货物贸易顺差大幅增加,但是服务贸易逆差呈逐年扩大趋势。同时,我国服务贸易总体的贸易竞争力指数为负,且服务业显示性比较优势指数远远小于制造业,因此增强我国服务业竞争力是推动服务贸易良性发展的根本举措。中国服务贸易出口、服务业外商直接投资均与服务业增加值正相关,但服务贸易进口与服务业增加值负相关。误差修正模型估计结果显示,随着时间的延长服务贸易进口对服务贸易出口具有正向作用,并且显著性不断增强。基于VAR模型的格兰杰因果关系检验结果表明,服务贸易出口与服务业外商直接投资存在双向的因果关系,同时服务业外商直接投资与我国服务业增加值也存在双向的因果关系。

【关键词】服务贸易进口 服务贸易出口 服务业增加值

【中图分类号】F752.68 【文献标识码】A 【文章编号】1000-2952(2014)03-0040-10

一、问题提出及文献综述

近百年来的经济全球化进程历经了商品全球化时期、制造全球化时期、服务全球化时期(江小涓,2008;林航,2009),^{①②}在服务全球化时期,跨国公司成为推动全球贸易的主导力量。服务业国际投资和服务贸易作为推动服务全球化的主要力量,也有力地推动了中国深入参与全球产业分工体系。20世纪80年代后,中国对外贸易规模快速增长,服务贸易与货物贸易发展迅猛。2014年1月9日,商务部姚坚在北京透露,未来10~20年是中国货物贸易和服务贸易齐头并进、相互促进的重要战略机遇期,因此,推动中国货物贸易和服务贸易有机结合及互动发展具有重要意义。

当前,中国是世界货物贸易第一出口大国,但是服务贸易逆差很大,逆差居世界第一,旅游、运输、特许权转让和专利等技术交易三项为主要逆差行业。对中国服务贸易出口的行业结构进行分析可以发现,旅游、运输和其他商业服务业是中国服务贸易出口的主体(石占星,2009),^③通讯服务、建筑服务、计算机和信息服

^{*} 本文是国家社会科学基金青年项目(项目号11CJY070)的阶段性成果。

① 江小涓:《服务全球化的发展趋势和理论分析》,《经济研究》2008年第2期。

② 林航:《服务全球化时代:一个贸易理论分析框架及其应用》,《国际服务贸易评论》2009年第3期。

③ 石占星:“中国服务贸易国际竞争力研究”,天津商业大学2009年硕士学位论文。

务以及咨询服务在中国服务贸易出口中的份额次之，而金融、保险、广告及宣传、专有权利使用费和特许费等知识密集型服务业出口所占份额极小，在中国服务贸易出口总额中所占份额最少

和出口额最小的产业是电影和音像业。服务贸易行业进口结构与出口结构基本类似，运输、旅游业仍是中国服务贸易进口的主导产业，电影及音像业在中国服务贸易进口总额中所占比重最小。

表 1 中国服务贸易和制造业贸易竞争力指数（1978~2012 年）单位：亿美元，%

年 份	1978	1979	1980	1981	1982	1983	1984	1985	1986	1987	1988	1989
中国服务贸易竞争力指数	—	—	—	—	0.14	0.16	0.04	0.12	0.29	0.29	0.18	0.11
中国制造业贸易竞争力指数	-0.06	-0.07	-0.05	0	0.07	0.02	-0.02	-0.21	-0.16	-0.05	-0.08	-0.06
年 份	1990	1991	1992	1993	1994	1995	1996	1997	1998	1999	2000	2001
中国服务贸易竞争力指数	0.16	0.28	-0.01	-0.03	0.02	-0.14	-0.04	-0.06	-0.05	-0.08	-0.09	-0.08
中国制造业贸易竞争力指数	0.08	0.06	0.03	-0.06	0.02	0.06	0.04	0.12	0.13	0.08	0.05	0.04
年 份	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010	2011	2012	均值
中国服务贸易竞争力指数	-0.08	-0.08	-0.07	-0.06	-0.05	-0.03	-0.04	-0.1	-0.06	-0.13	-0.19	0.009
中国制造业贸易竞争力指数	0.05	0.03	0.03	0.07	0.1	0.12	0.12	0.09	0.06	0.04	0.06	0.02

资料来源：根据 1980~2012 年《中国统计年鉴》及世界贸易组织网站相关数据计算得出。

通过对中国制造业和服务业贸易竞争力指数进行分析可以发现，从 1992 年开始，我国服务贸易总体的竞争力指数（即 TC 指数 = （出口 - 进口） / （出口 + 进口））为负。1978 年以后，中国货物贸易快速增长，从 1990 年开始中国制造业贸易竞争力指数为正（见表 1）。制造业贸易竞争力指数均值为 0.02 左右，服务贸易竞争力指数平均值（0.009）远远小于制造业，这与我国制造业已深入参与全球分工以及制造业已具有较强的国际竞争优势的事实完全相符（姚战琪，2009）。^① 虽然中国服务贸易增长较快，但服务贸易竞争力指数较低。服务业和服务贸易管理体制不尽科学、服务贸易结构不合理、政府对服务业和服务贸易扶持力度不够、缺乏促进服务企业自主创新的激励措施等原因影响了我国服务贸易竞争力的提高。从纵向上看，中国服务贸易竞争力指数常年为负，说明中国服务贸易竞争力总体上均处于比较劣势；从中国服务贸易竞争力指数的变化情况来看，新世纪以来竞争力指数总体上变化不大，2001 年为 -0.08，2011 年为 -0.13。2008 年后中国服务贸易竞争力指数迅速下降。

通过对中国服务业和制造业显示性比较优势指数的分析和比较可以看出：即 RCA 指数， $RCA_{ij} = (X_{ij}/X_j) \div (X_{iw}/X_{iw})$ ，其中， X_{ij} 表示中国出口产品 i 的出口值， X_j 表示中国总出口值， X_{iw} 表示世界出口产品 i 的出口值， X_{iw} 表示世界总出口值。1982~2012 年，中国服务业整体的 RCA 指数为 0.52，制造业 RCA 指数为 1.11，也表明我国服务业国际竞争力较弱，制造业国际竞争力较强。中国服务贸易的 RCA 指数在金砖四国中最低。通过对中国、韩国、印度等国家服务贸易显示性比较优势指数进行历时比较（见表 2），可以发现，韩国、印度等国家服务贸易显示性比较优势指数均大于中国的指数。

对中国吸收外商投资进行分析可以发现，从 2011 年开始，中国服务业实际使用外资金额及增幅均超过制造业，但是，服务业外商在华投资过多地集中于房地产，租赁和商务服务业，信息传输、计算机服务和软件业，交通运输、仓

^① 姚战琪：《全球化背景下中国外商直接投资与服务贸易的关系研究》，《财贸经济》2009 年第 7 期。

表2 中国与其他国家服务业 RCA 指数比较

年份	中国	韩国	印度	墨西哥	年份	中国	韩国	印度	墨西哥
1980	—	0.79	1.64	1.29	1996	0.62	0.79	0.94	0.52
1981	—	0.76	1.54	1.07	1997	0.59	0.83	1.07	0.48
1982	0.62	0.83	1.43	0.84	1998	0.6	0.37	1.27	0.46
1983	0.59	0.77	1.52	0.75	1999	0.58	0.38	1.44	0.4
1984	0.61	0.71	1.52	0.85	2000	0.58	0.4	1.47	0.4
1985	0.6	0.64	1.61	0.87	2001	0.57	0.42	1.45	0.38
1986	0.56	0.72	1.44	0.92	2002	0.55	0.38	1.42	0.37
1987	0.52	0.68	1.29	0.87	2003	0.49	0.72	1.47	0.36
1988	0.45	0.67	1.26	0.87	2004	0.49	0.71	1.71	0.37
1989	0.46	0.68	1.17	0.88	2005	0.46	0.7	1.87	0.33
1990	0.46	0.67	1.11	0.82	2006	0.46	0.69	2.05	0.32
1991	0.49	0.63	1.14	0.82	2007	0.48	0.74	2	—
1992	0.54	0.61	1.01	0.81	2008	0.5	0.79	1.95	—
1993	0.62	0.66	0.95	0.69	2009	0.52	0.84	1.9	—
1994	0.6	0.75	1.01	0.74	2010	0.54	0.89	1.85	—
1995	0.45	0.81	0.98	0.58	2011	0.52	0.94	1.8	—

资料来源：笔者根据世界贸易组织网站相关数据计算得出。

储和邮政业等利润较高的服务业。一些研究显示，中国的产业体系仍处于全球产业价值链的低端，当前外商投资对我国服务业增长和结构调整具有一定的负面效应。Haddad and Harrison (1993)^① 对摩洛哥 1985~1989 年制造业的企业和行业面板数据进行实证分析，发现制造业外商直接投资并不存在明显的正向溢出效应。Konings (2001)^② 认为，保加利亚、罗马尼亚、波兰吸收外商投资也不存在溢出效应，但是，来自美国的实证研究支持了在发达国家的外商投资具有明显的正向溢出效应，对技术水平具有显著的促进作用（周洁、刘畅，2011；姚战琪、夏杰长，2013）。^{③④} 当前，学术界关于服务业外商投资溢出效应的研究成果极少。Manuel and Machado (2005)^⑤ 考察了 1970~1996 年亚洲、拉丁美洲及非洲的数据，认为服务业外商投资的溢出效应是不确定的，服务业外商投资

的溢出效应受国内总投资率和各国利用外资政策等因素影响，实证分析结果发现服务业外商投资在拉丁美洲各国具有明显的负向挤出效应（即替代效应），在非洲各国没有显著的关联性。

① Haddad M, Harrison A, Are There Positive Spillovers from Direct Foreign Investment? Evidence from Panel Data for Morocco. *Journal of Development Economics*, vol. 42, no. 1 October 1993, pp. 51—74.

② Konings J, The Effects of Foreign Direct Investment on Domestic Firms: Evidence from Firm-Level Panel Data in Emerging Countries. *Economics of Transition*, vol. 9, no. 3 November 2001, pp. 619—633.

③ 周洁、刘畅：《服务业外商直接投资的溢出效应研究综述》，《商业时代》2011年第2期。

④ 姚战琪、夏杰长：《服务业全球化趋势及中国选择》，《全球化》2013年第3期。

⑤ Agosin M, Machado R, Foreign Investment in Developing Countries: Does it Crowd in Domestic Investment? *Oxford Development Studies*, vol. 33, no. 2 2005, pp. 149—162.

对于中国而言,我们认为,服务业外商投资的大规模进入可能不会促进服务业技术水平的改善,甚至服务业外商投资不利于我国服务业的结构升级。对1983~2011年中国服务业外商投资、国内生产总值与服务业增加值之间进行协整分析的统计结果表明,服务业外商直接投资与服务业增加值的相关系数小于国内生产总值与服务业增加值的相关系数,即服务业外商投资对服务业增加值的促进和推动作用远远小于国内生产总值对服务业增加值的影响。^①当前,我国服务业开放面临的困境主要表现为:第一,当前我国内资生产性服务业竞争力较低导致内资生产性服务业处于产业链低端,不利于本土企业技术升级。第二,由于服务业外商直接投资过多地集中于房地产等利润较高的非传统服务业,以及中国服务业与外商投资存在较大的技术差异,因此外商投资并未给中国服务业带来明显的技术优势。第三,外商投资可能对我国服务贸易总额及服务业国内市场需求产生不利影响,不利于中国服务业国际竞争力提高。目前,学术界仍缺乏对服务贸易及其竞争力与我国经济增长的长期关系进行系统分析和实证检验的研究成果,本文从服务贸易促进经济增长以及服务业总产出和经济增长推动服务贸易两个角度,研究20世纪80年代以来,中国服务贸易进口、服务贸易出口、服务业外商直接投资与服务业增加值之间的互动关系和内在影响机制,对我国服务贸易竞争力进行理论与实证研究。根据1983~2012年的经济数据,在各变量之间建立向量自回归模型并进行相应的协整检验、格兰杰因果检验及建立向量误差修正模型,研究服务贸易与我国经济增长是否存在长期的稳定关系,得出较可靠的研究结果,并提出相应的政策建议。

二、模型构建

(一) 分析模型和研究方法

现有的理论研究表明,关于服务贸易进口、服务贸易出口、服务业外商直接投资对我国经

济增长的影响,除了服务贸易进口、服务贸易出口和服务业外商直接投资分别对经济增长的直接影响之外,还通过服务贸易进口、服务贸易出口及服务业外商直接投资之间的交互影响对我国经济增长产生间接影响,因此三变量之间存在极为密切的联系。向量自回归模型(VAR)依托经济理论分析框架,以系统中每一个内生变量作为系统中所有内生变量的滞后值的函数来构造模型,更多的是依据数据自身的内在特征探讨经济变量之间的关系,克服了传统经济计量方法不足等问题。基于此,本文采用向量自回归模型的分析方法。本文设定基本模型为:

$$\begin{pmatrix} EXPO \\ IMP \\ SGDP \\ FDI \end{pmatrix}_t = \alpha_1 \begin{pmatrix} EXPO_{t-1} \\ IMP_{t-1} \\ SGDP_{t-1} \\ FDI_{t-1} \end{pmatrix} + \alpha_2 \begin{pmatrix} EXPO_{t-2} \\ IMP_{t-2} \\ SGDP_{t-2} \\ FDI_{t-2} \end{pmatrix} + \alpha_3 \begin{pmatrix} EXPO_{t-3} \\ IMP_{t-3} \\ SGDP_{t-3} \\ FDI_{t-3} \end{pmatrix} + \alpha_4 \begin{pmatrix} EXPO_{t-4} \\ IMP_{t-4} \\ SGDP_{t-4} \\ FDI_{t-4} \end{pmatrix} + \dots + \begin{pmatrix} e_{1t} \\ e_{2t} \\ e_{3t} \\ e_{4t} \end{pmatrix},$$

$t=1, 2, \dots, T$

其中,EXPO、IMP、SGDP、FDI分别表示服务贸易出口、服务贸易进口、服务业增加值、服务业外商直接投资, e 为扰动向量。本文采用向量自回归模型的分析方法,具体包括时间序列平稳性检验、协整检验、格兰杰因果检验、向量误差修正模型等多种方法。

(二) 数据来源及其处理

服务贸易出口、服务贸易进口、服务业增加值等数据来自《中国统计年鉴》、《中国对外经济贸易年鉴》、《中国商务年鉴》等,时间跨度为1983~2012年。所有数据按当年平均汇率换算为人民币,由于各变量都是名义变量,使用以1983年为基期的国内生产总值缩减指数进行序列调整,得到各变量的实际值。为了消除

^① 夏杰长、姚战琪:《服务业外商投资与经济结构调整:基于中国的实证研究》,《南京大学学报》(人文哲学社会科学版)2013年第3期。

时间变量数据存在的异方差性,并考虑到对各时间序列数据取对数形式之后不会改变它们之间的计量关系,因此,对所有变量采取对数形式。各变量具体表示如下:LEXPO表示服务贸易出口,LIMP表示服务贸易进口,LSGDP表示服务业增加值,LFDI表示服务业外商直接投资。DLEXPO、DLIMP、DLSGDP、DLFDI分别表示服务贸易出口、服务贸易进口、服务业增加值、服务业外商直接投资的一阶差分变量。

三、中国服务贸易国际竞争力影响因素的实证分析

(一) 多变量描述性分析

从图1可以看出,在1983~2012年期间,服务业外商直接投资、服务贸易出口、服务贸易进口、服务业增加值四个时间序列都处于上升趋势,服务贸易进口与出口两个变量基本保持同步变动的趋势,相关性很强。服务业外商投资变动幅度非常大,经历了1985年、1994年和2007年三次高峰与1989年、1997年和2009年三次低谷。服务业三次外商投资增长的高峰期与全国外商投资的高涨期基本一致,1989年的政治风波、1997年的东亚金融危机和2008年国际金融危机不但降低了中国工业行业的外商投资,也使中国服务业外商投资处于低谷期。外商投资规模在1993年出现最高值,1993年前指标值增长较快,之后增长率缓慢下降。1999年之后,随着中国宏观经济环境的改善,服务业外商投资开始稳步增长。

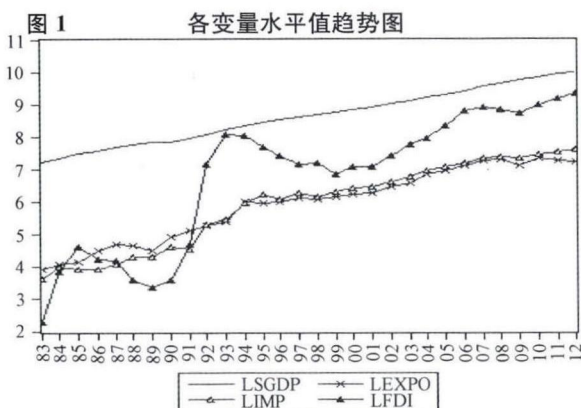
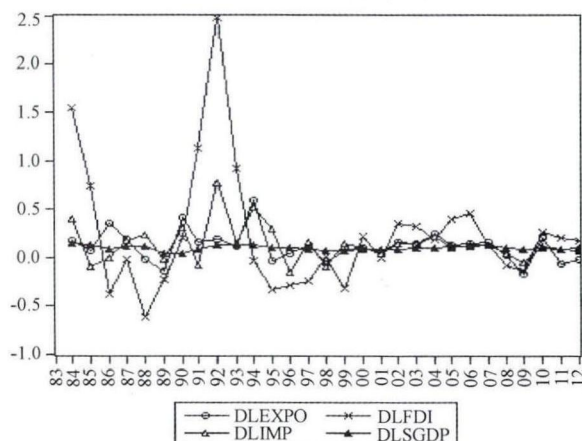


图2 各变量的一阶差分趋势图



(二) 平稳性检验

采用时间序列数据进行分析,使用带有随机趋势的非平稳数据进行估计时会引起伪回归问题。因此,在协整检验之前,必须通过单位根检验以确定服务业外商直接投资、服务贸易出口、服务贸易进口、服务业增加值各变量的单整阶数。为确保结果的正确性,对每个变量序列都使用ADF和PP两种检验方法确定其稳定性和单整阶数,在滞后期数的选择上,参照赤池信息准则AIC(Akaike Information Criterion)和施瓦茨准则SC(Schwarz Criterion)。

表3 服务业外商直接投资与GDP的单位根检验结果

变量	ADF 统计量	检验方 程形式	临界值			AIC值	SC值
			1%	5%	10%		
LEXPO	-1.6056	(C, T, 1)	-4.3098	-3.5742	-3.2217	-0.81038	-0.66894
dLEXPO	-5.6943	(C, 0, 1)	-3.6892	-2.9719	-2.6251	-0.69138	-0.59622
LSGDP	-4.2330	(C, T, 1)	-4.3240	-3.5806	-3.2253	-5.28205	-5.09174
dLSGDP	-4.2061	(C, 0, 1)	-3.6999	-2.9763	-2.6274	-5.02572	-4.88174
LFDI	-3.4449	(C, T, 1)	-4.3240	-3.5806	-3.2253	1.310494	1.500809
DLFDI	-3.7845	(C, 0, 1)	-3.6999	-2.9763	-2.6274	1.500425	1.644407
LIMP	-1.5368	(C, T, 1)	-4.3743	-3.6032	-3.2381	-0.52571	-0.18442
dLIMP	-6.5364	(C, 0, 2)	-3.6892	-2.9719	-2.6251	-0.45319	-0.35803

注:检验方程形式(C, T, d)中,C表明检验方程带有常数项,T表明带有趋势项;d为滞后期数,选择标准是AIC和SC准则。

从检验结果可知(表3),服务业外商直接投资、服务业增加值、服务贸易出口及服务贸易进口这四个数据序列的水平值在1%的显著性水平上都不是平稳的,但其一阶差分序列平稳,说明它们都是I(1)序列。由图2可看出,所

有数据序列经过一阶差分变化以后变为平稳序列，已不存在时间趋势和序列自相关。

(三) 协整检验

本文使用基于 VAR 模型的 Johanson 的协整方法对各数据序列进行实证分析 (Johansen 和 Juselius, 1990)。^① 确定 VAR 协整检验的滞后阶数是进行协整检验的前提，我们进行了滞后长度判别检验，同时考虑到有效估计的残差应具有的正态分布特征，选择 VAR 模型的滞后期为 2。协整检验分为两个具体程序，首先，对每两个变量的对数值进行协整关系检验，发现服务贸易出口、服务贸易进口、服务业外商直接投资与服务业增加值之间均存在协整关系。其次，在服务业外商直接投资、服务业增加值、服务贸易出口及服务贸易进口四变量的对数值之间进行协整关系检验，结合迹检验和最大特征值等统计值，得到的协整检验结果见表 4。结果表明，服务贸易出口、服务贸易进口、服务业外商直接投资与服务业增加值之间在 5% 的显著水平上存在一个协整方程，最终正规化后的协整方程见表 5 (括号中数字为标准误)。

表 4 服务贸易出口、服务贸易进口、服务业外商直接投资与服务业增加值四变量协整检验结果

原假设	迹统计量	迹统计临界值		最大特征值统计		
		0.05	P 值	最大特征值	0.05	P 值
None *	62.76466	47.85613	0.0011	43.52941	27.58434	0.0002
At most 1	19.23525	29.79707	0.4761	10.6341	21.13162	0.6837
At most 2	8.601144	15.49471	0.4035	7.343277	14.2646	0.4494
t most 2	1.257867	3.841466	0.2621	1.257867	3.841466	0.2621

从服务贸易出口、服务贸易进口、服务业外商直接投资与服务业增加值四变量的协整检验估计系数的结果可以看出 (见表 5)，服务业外商直接投资、服务贸易出口均与服务业增加值正相关，但服务贸易进口与服务业增加值负相关。服务贸易出口增加 1%，服务业增加值增长近 2.3%；服务业外商直接投资增长 1%，服务业增加值增长近 0.08%。服务贸易出口与服务业增加值的相关系数远远大于服务业外商直

接投资与服务业增加值的相关系数，即服务贸易出口对服务业增加值的促进和推动作用远远大于服务业外商投资对服务业增加值的影响。同时，服务贸易出口与服务业增加值之间的系数估计值的 t 值较显著，表明两变量之间具有明显的统计上的显著性。服务业外商直接投资虽与服务业增加值保持正相关性，但相关系数较小，且系数估计值的 t 值不显著，表明二者之间的显著性水平较低。服务贸易进口与服务业增加值负相关，服务贸易进口每增加 1%，服务业 GDP 约减少 1.34%，服务贸易出口对服务业经济增长的影响远远大于服务贸易进口对服务业经济增长的影响。服务贸易进口在一定程度上抑制服务业增加值的增长，但服务贸易进口能缓解服务供给能力不足的缺口，满足我国居民的多样化需求，同时服务贸易进口尤其是生产性服务进口对中国制造业生产率的促进效应要更为明显，因此加大生产性服务进口对充分发挥进口的竞争效应和技术外溢效应进而提升整个生产性服务业的国际竞争力具有重要意义。

表 5 服务贸易出口、服务贸易进口、服务业外商直接投资与服务业增加值四变量的回归估计

变 量		LEXPO	LIMP	LFDI	LSGDP
协整关系	LSGDP	2.2870 (-0.3204)	-1.3442 (-0.3184)	0.0769 (-0.0818)	—
	LEXPO	—	0.8412 (-0.0921)	-0.1820 (-0.0372)	0.3317 (-0.0910)

注：括号中的数字为标准误。

通过表 5 可以看出，服务贸易进口对我国服务业增加值具有负向作用，同时，服务贸易进口对服务贸易出口具有正向作用，并具有统计上的显著性，因此改革开放后服务贸易进口通过提高技术水平、满足多样化需求、缓解供给能力缺口等渠道提高了我国服务贸易竞争力。尤其是国际服务外包发展迅猛，中国承接国际

① Johansen S, Juselius K, Maximum Likelihood Estimation and Inference on Cointegration with Applications to the Demand for Money. *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, vol. 52, no. 2 May 1990, pp. 169—210.

服务外包迅速增长,在很大程度上提升了中国服务贸易国际竞争力。20 世纪 90 年代后,中国不断扩大对外开放,积极参与国际合作,国际服务外包成为推动中国服务贸易竞争力提升的重要因素,2010 年,中国承接国际服务外包业务达到 145 亿美元,同比增长 43%,2011 年,中国承接国际离岸服务外包合同执行金额 238.3 亿美元,同比增长 65%。

从表 5 还可看出,服务业外商投资与中国服务贸易出口总额负相关,外商投资不利于中国服务贸易国际竞争力的提高。从改革开放以来一直到 2010 年,外商直接投资仍集中在以制造业为主的第二产业,因此在改革开放后的绝大多数年份,服务业没有受到外资的青睐,此种情况导致我国二元经济结构更加严重,同时进入我国服务业的外商投资的市场战略是为了扩大我国市场,而不是推动我国出口贸易,因此外商投资所起作用仅限于进口替代而非出口导向,因此外商投资对我国服务贸易竞争力的提升作用极不明显。因此,为了提高中国服务贸易国际竞争力,必须制定政策促使外商投资提高我国服务产品供给水平和出口能力。

从表 5 亦可看出,服务业外商投资对服务业增加值的影响虽为正,但影响较弱,因此必须加强国内服务供应商与外资企业的联系,扩大外商投资企业对国内服务业的需求范围,从而使跨国公司在华投资能显著地促进我国服务业技术进步,从而促进中国服务业国际竞争力的提升。

(四) 向量误差修正模型

在我国服务贸易出口、服务贸易进口、服务业外商直接投资与服务业增加值四个变量之间存在协整关系的基础上,确定差分形式的向量误差修正模型方程如下:

$$\begin{aligned} dLEXPO_t &= \beta_1 + \sum_{i=1}^k \alpha_{1i} dLFDI_{t-i} + \sum_{i=1}^k \alpha_{2i} d \\ LIMP_{t-i} &+ \sum_{i=1}^k \alpha_{2i} dLSGDP_{t-i} + \delta VECM_{t-1} + \epsilon_t \\ dLSGDP_t &= \beta_2 + \sum_{i=1}^k \eta_{1i} dLEXPO_{t-i} + \sum_{i=1}^k \eta_{2i} d \end{aligned}$$

$$\begin{aligned} LIMP_{t-i} &+ \sum_{i=1}^k \alpha_{1i} dLFDI_{t-i} + \gamma VECM_{t-1} + \lambda_t \\ dLFDI_t &= \beta_3 + \sum_{i=1}^k \chi_{1i} dLSGDP_{t-i} + \sum_{i=1}^k \chi_{2i} d \\ LEXPO_{t-i} &+ \sum_{i=1}^k \eta_{2i} dLIMP_{t-i} + \phi VECM_{t-1} + \zeta_t \\ dLIMP_t &= \beta_1 + \sum_{i=1}^k \chi_{2i} dLEXPO_{t-i} + \sum_{i=1}^k \alpha_{1i} d \\ LFDI_{t-i} &+ \sum_{i=1}^k \alpha_{2i} dLSGDP_{t-i} + \theta VECM_{t-1} + \delta_t \end{aligned}$$

参考调整后的可决系数、AIC、SC 等标准,确定本文向量误差修正模型的最优滞后阶数并指定存在一个协整关系,所得结果详见表 6。VECM 是误差修正项,反映变量之间的长期均衡关系,所有作为解释变量的差分项的系数,反映该变量的短期波动对作为被解释变量的短期变化的影响。

从服务贸易出口、服务贸易进口、服务业外商直接投资与服务业增加值四变量之间的误差修正模型可以看出,在短期内,服务业外商直接投资促进我国 GDP 增长,这表明在短期内服务业外商直接投资对我国服务业增加值具有促进作用,但是在短期内该变量系数的 t 值不显著,这与前面所述服务业外商投资对我国服务业增加值的促进作用较弱的事实相一致。

本文发现,我国服务贸易进口及出口与服务业增加值之间的协整关系不同,服务贸易出口促进我国服务业经济增长,并且随着时间的延长,服务贸易出口对服务业增加值的促进作用更为明显。同时可以看出,中国服务贸易进口对服务业增加值有短期负向作用,但是变量系数的 t 值均不显著。

从四变量间的误差修正模型可以看出,在协整关系上服务贸易出口、服务贸易进口变量对服务业外商直接投资产生了反向修正作用。短期内服务业外商投资同时促进了我国服务贸易出口和服务贸易进口,即对二者的影响方向相同,但短期内服务业外商投资对服务出口的影响作用稍大一些,同时显著程度更高。同时本文发现,随着滞后期的延长,服务业外商投

资对我国服务贸易的影响作用逐渐增强。另外，从系数估计结果可以看出，前期出口的变化对随后的服务业外商投资变化产生正向影响，因此，至少短期内服务贸易出口对服务业外商投资是存在促进作用的。

表 6 服务贸易出口、服务贸易进口、服务业外商直接投资与服务贸易增加值误差修正模型估计结果

误差修正	D (LEXPO)	D (LFDI)	D (LIMP)	D (LSGDP)
D (LEXPO (-1))	0.045130 [0.19749]	0.071611 [0.09488]	-0.026405 [-0.08394]	0.012724 [0.48350]
D (LEXPO (-2))	-0.137839 [-0.72029]	0.662559 [1.04825]	0.056459 [0.21433]	0.029545 [1.34061]
D (LFDI (-1))	0.084466 [1.24513]	0.406021 [1.81211]	0.051007 [0.54623]	0.010617 [1.35899]
D (LFDI (-2))	0.144201 [1.99202]	0.218144 [0.91238]	0.102620 [1.02986]	0.009376 [1.12469]
D (LIMP (-1))	-0.233745 [-1.34242]	-0.270234 [-0.46989]	-0.240500 [-1.00342]	-0.013266 [-0.66155]
D (LIMP (-2))	0.321558 [1.83588]	-0.034642 [-0.05988]	0.253592 [1.05182]	-0.008533 [-0.42304]
D (LSGDP (-1))	-2.550758 [-1.33839]	-11.991860 [-1.90505]	-2.847914 [-1.08557]	-0.105830 [-0.48218]
D (LSGDP (-2))	-0.147132 [-0.09229]	-13.521990 [-2.56793]	-3.183366 [-1.45058]	-0.275803 [-1.50218]
C	0.317785 [1.61185]	2.457294 [3.77360]	0.676858 [2.49407]	0.124072 [5.46451]
R-squared	0.697879	0.743461	0.538765	0.800413
Sum sq. resid	0.217527	2.373024	0.412169	0.002885
F-statistic	4.363212	5.474072	2.206398	7.575103
Log likelihood	26.775770	-5.483774	18.147790	85.133580
Akaike AIC	-1.242650	1.146946	-0.603540	-5.565451
Schwarz SC	-0.762710	1.626886	-0.123600	-5.085511
S.D. dependent	0.166410	0.596468	0.185392	0.023579

注：括号中的数字为 t 检验值。

通过表 6 还可以看出，短期内服务贸易进口对服务贸易出口具有负向作用，但不具有统计上的显著性，随着时间的延长服务贸易进口对服务贸易出口具有正向作用，并且显著性不断增强。这表明，服务贸易进口在入世后对我

国服务行业的发展起到了正向的、较为稳定的促进作用。同时，服务贸易出口对服务贸易进口具有短期的正向促进作用，但显著性不强，这反映了决定当前影响服务贸易自由化因素的复杂性和服务贸易协定谈判中各国利益博弈的不均衡性。

此外，本文发现，服务业外商投资流量与滞后各期的服务贸易进口之间存在负相关性，表明服务贸易进口变化会对外商直接投资流量产生一定的替代效应，即短期内服务贸易进口会替代服务业外商投资的流入。随着我国经济快速增长，对服务的需求可以部分地通过服务业外商投资和服务进口两种渠道获得。由于我国人力资本匮乏，服务业发展需要的高级生产要素难以满足产业发展的需要。短期内满足服务需求的主要方式仍为服务贸易进口，这与我国第三产业外商投资所占比重较小的事实相符。

虽然短期内国内生产总值与服务贸易出口负相关，但系数 t 值并不显著，表明二者呈现较弱的负相关，同时，二者呈现正相关的发展趋势。20 世纪 80 年代后，中国对外贸易规模快速增长，服务贸易与货物贸易发展迅猛。但是自 1992 年后中国服务贸易处于逆差状态，并且服务贸易逆差绝对额不断扩大，在 2012 年出现改革开放以来的逆差最大值 896 亿美元，因此我国经济增长对服务贸易出口的推进作用是有限的。

(五) 格兰杰因果检验

确定了服务贸易出口、服务贸易进口、服务业外商投资与服务贸易增加值之间的长期和短期关系并不能说明各变量之间的因果方向，本文采用格兰杰因果检验法进行分析。格兰杰因果检验一般有两种形式：对于非协整序列间的因果检验适合用 VAR 模型进行检验；对于协整序列间的因果检验适合用 VEC 模型进行检验。本文的服务贸易出口、服务贸易进口、服务业外商投资与服务贸易增加值之间存在着协整关系，因此选用第二种检验方法，其计量结果见表 7。

表7 中国服务贸易与GDP的格兰杰因果关系检验结果

被解释变量	原假设	Chi-sq 统计量	自由度	P 值
中国服务业增加值	LEXPO 不能引起 LSGDP	14.21563	2	0.0008
	LIMP 不能引起 LSGDP	6.084026	2	0.0477
	LFDI 不能引起 LSGDP	20.25780	2	0.0000
	All 不能引起 LSGDP	30.48546	6	0.0000
服务贸易出口	LSGDP 不能引起 LEXPO	3.285867	2	0.1934
	LIMP 不能引起 LEXPO	5.275993	2	0.0715
	LFDI 不能引起 LEXPO	8.965007	2	0.0113
	All 不能引起 LEXPO	15.56141	6	0.0163
服务贸易进口	LSGDP 不能引起 LIMP	4.679147	2	0.0964
	LEXPO 不能引起 LIMP	6.001695	2	0.0497
	LFDI 不能引起 LIMP	13.20698	2	0.0014
	All 不能引起 LIMP	17.94567	6	0.0064
服务业外商直接投资	LSGDP 不能引起 LFDI	6.665205	2	0.0357
	LEXPO 不能引起 LFDI	7.592672	2	0.0225
	LIMP 不能引起 LFDI	1.911252	2	0.3846
	All 不能引起 LFDI	26.39915	6	0.0002

可以看出,中国服务贸易进口与服务贸易出口都是中国服务业增加值格兰杰原因,表明中国服务业进出口贸易对经济增长具有显著地促进作用。同时,我国服务业经济增长不是服务贸易出口和服务贸易进口的格兰杰原因,这表明中国服务贸易并没有随着经济的高速增长而较快发展。

另外,中国服务贸易出口是引起进口的格兰杰原因,服务贸易进口也是引起服务贸易出口的格兰杰原因,同时服务贸易出口对服务贸易进口的带动作用强于服务贸易进口对出口的带动作用,这表明服务贸易出口比进口对我国经济增长具有更大的导向作用。服务贸易出口、服务业增加值是服务贸易进口的格兰杰原因,这表明从长期来看经济增长是促进服务贸易进口的根本性因素。

与前文所述在协整关系上服务贸易出口与GDP具有长期正相关关系的结论相符,中国服务贸易出口对服务业经济增长的推动作用大于服务贸易进口对经济增长的推动作用,改革后我国服务贸易规模增长迅速,服务贸易出口逐

年增长,在短期内服务贸易出口有利于增加国内生产总值。服务贸易进口对经济增长具有抑制作用,但并不显著。

在四变量的因果检验中,服务业外商投资与我国服务业增加值存在双向的因果关系,同时服务贸易出口与服务业外商投资也存在双向的因果关系。这与笔者前期研究结果相似(姚战琪,2009),服务业外商投资与服务贸易进口存在一个单向的因果关系,即服务业外商投资是进口的格兰杰原因,但服务贸易进口不是服务业外商投资的格兰杰原因。服务贸易进口不是格兰杰原因引起外商投资变动的P值为0.38,因此可以视为外生变量。这是因为服务进口对外商投资存在一定程度的替代作用,虽然服务业外商投资会促进服务贸易进口,但进口不是促进外商投资变化的格兰杰原因。

四、结论及政策建议

本文研究结果表明,服务贸易出口对服务业增加值的促进和推动作用远远大于服务业外商投资对服务业增加值的影响,同时,服务贸易进口对我国服务业增加值具有负向作用,服务贸易进口对服务贸易出口具有正向作用,并具有统计上的显著性,因此改革开放后服务贸易进口增强了我国服务贸易竞争力。同时,服务业外商投资对服务业增加值的影响虽为正,但是服务业外商投资与我国服务贸易出口总额负相关,这表明外商投资不利于中国服务贸易国际竞争力的提高。同时,从各变量之间的误差修正模型可以看出,服务贸易进口变化会对外商直接投资流量产生一定的替代效应,即短期内服务贸易进口会替代服务业外商投资的流入。

因此,要切实提升中国服务贸易国际竞争力,须从以下五个方面着手:

第一,加强国内服务供应商与外资企业的联系,加快外资企业对本土企业进行技术转移的步伐,要通过一系列政策措施,培育和扶持本土企业的成长,不断增强本土企业竞争力。首先,要鼓励外资企业与国内购买方和服务供

应商之间建立广泛的联系，间接地扩大制造业整体对国内生产性服务业的需求范围，要不断提高本土生产性服务业为外商制造业企业提供生产性服务的能力，从而使跨国公司在华投资能显著地促进我国服务业技术进步。其次，提高服务业内资企业的技术水平，缩小内资企业与外资企业的技术差距，尤其是对那些在竞争能力上与外商投资企业差距较大的行业，要尽快出台激励与支持措施，帮助企业缩小差距。

第二，打破行业壁垒，降低进入门槛。要努力扶植新兴服务行业与科技服务业快速成长，积极拓宽中国服务贸易领域，更好地促进金融、保险、咨询等科技含量较高的服务行业的快速发展和对外开放，推动中国服务业由传统的劳动密集型向资本密集型、技术密集型转变，实现中国服务产业结构优化升级。

第三，要优先发展旅游服务业、建筑服务业等我国具有较强比较优势以及计算机和信息服务业、专利与特许服务、通讯等比较劣势逐渐减弱的服务行业，努力提高传统服务业的科技含量，积极发掘其他服务产业的发展潜力，促进我国服务业整体实力的提升，不断提升服务业国际竞争力。

第四，注重人才培养，发挥人力资本在提升

服务业对外开放进程中的积极作用。要加强对人力资本的投入，大力发展知识技术密集性的服务贸易，推动运输业等服务业尽快向知识技术密集型产业转变；要加强对人力资本投入，加大对高等教育的投资力度，培养适应现代服务业发展要求、精通国际商法、国际运输的复合型专业人才；要拓宽人才培养途径，形成科学的人力资源开发利用体系和多层次人才培养体系。

第五，加强服务贸易相关产业的协调与支持，完善基础设施和发展基础产业，推动相关产业的协调配合。我国政府要制定相应的融资、税收等优惠政策和产业倾斜政策，鼓励知识技术密集型服务业的发展，并引导人们对旅游、信息、房地产、金融、保险等行业的需求，刺激服务业总体竞争力的提高。

本文作者：夏杰长是中国社会科学院财经战略研究院院长助理、服务经济研究室主任、研究员、博士生导师；姚战琪是中国社会科学院财经战略研究院服务经济研究室副主任、研究员、硕士生导师；齐飞是中国社会科学院研究生院2013级博士研究生

责任编辑：何 辉

Theory and Empirical Study of China's Service Trade Competiveness

Xia Jiechang Yao Zhanqi Qi Fei

Abstract: Surplus in commodity trade and deficits in service trade have both increased since we entered the new century. For the whole service trade, NTB is negative and RCA is much lower than that of manufacturing industry. This indicates that China's service industry is comparatively less competitive, and enhancing competitiveness is essential to its benign development. Service trade export and service FDI both have a positive relationship with service industry value (SIV), while service trade import demonstrates a negative relationship with SIV. Estimation results of Error Correction Model indicate that, as time extends on, service trade import implements a positive role on service trade export, and significance becomes more obvious. Granger Causality Test based on VAR model shows that there exists bidirectional causality between service export and service FDI, similarly between service FDI and service trade value.

Keywords: service trade import; service trade export; service industry value