

城乡分割、就业状况与主观幸福感差异

罗楚亮*

摘 要 本文讨论了不同人群主观幸福感的影响因素,并在对概率模型进行分解分析的基础上,对城乡之间以及城镇失业与就业居民之间的主观幸福感差异进行了比较分析。本文的结论发现,农村居民的主观幸福感高于城镇居民主要是由于预期的满足程度、收入变化预期、对生活状态改善的评价等差异所引起的;城镇失业与就业居民的主观幸福感差异则主要是由收入效应导致的。

关键词 主观幸福感, 预期, 城乡分割, 就业

一、引 言

我国的经济改革与经济转型促进了国民经济以较高的速度持续增长,这也导致了居民收入水平的不断增长与消费水平的不断改善。1979—2004 年期间,我国人均国民生产总值年均增长 8.1%,同期城乡人均收入也分别以 7.1%和 6.8%的年均增长率高速增长(国家统计局,2005,第 23、102 页)。因此,改革以来我国居民物质福利不断获得巨大的改善。

在这一改善过程中至少有两个值得注意的问题:一是城乡之间的分割依然严重存在,城乡居民之间的收入差距总体上表现出扩大的趋势。特别是 20 世纪 90 年代中后期以来,城乡差距的持续扩张趋势长期未能出现逆转的倾向,2002 年城乡居民货币收入比率已经超过了 3 倍,如果考虑到城镇居民所实际享有的各种隐性福利补贴,这一比率将在 4 倍以上。城乡居民收入差距长期存在并持续扩大的趋势表明了我国城乡被严重分割的现实。尽管市场化改革已经推行了二十多年,但农村居民仍然通过户口体制限制在农村地区,从而使城乡实际上处于两个不同的社会系统。二是经济增长的成果、福利改善程度在社会不同人群中的分布是非常不平衡的,这不仅表现为收入差距的持续扩大、收入分配方式的混乱,更表现在 20 世纪 90 年代中后期以来的相关改革措施增大了经济中的不确定性,并使得部分居民成为改革的受损者,部分城镇居民在企业改革中陷入失业状态,从而无法分享经济增长成果,这些改革中的受损者与受益者在社会经济生活中可能也存在诸多显著的差异性。

收入水平或物质福利的总体增长或许并不能够充分地表明居民福利状况

* 中国社会科学院经济所。通信地址:北京阜外月坛北小街 2 号中国社会科学院经济所,100836;电话:(010)68034424;E-mail:luochl@cass.org.cn。感谢匿名审稿人对本文所提出的建设性意见,文中所存在的错误应由作者本人承担。

的改善,福利(welfare或well-being)具有更为丰富的内涵。尽管在现代经济学中,经济增长或收入增长仍是经济研究的核心命题,但它们可能并不是目标本身,而在更大程度上表现为实现人们“幸福”(happiness)的手段,“幸福”才是人们最终所求的。从这一意义出发,本文试图讨论我国不同人群的主观幸福感(subjective well-being或happiness)特征,因为主观幸福感不仅体现了居民对主观福利状况的自我评价,更重要的是这种评价可能来自于经济转轨与经济发展对居民福利水平的综合性影响。

近年来,在我国也出现了一些关于主观幸福感的讨论。但在一些讨论中,我们不难发现仍然大量存在收入与主观幸福感相混淆的情形。如《2005年中国社会形势分析与预测》对中国城乡居民的生活满意度进行了初步的统计分析,得出了“近八成农民感到生活幸福,农村居民幸福感强于城镇居民”的判断(曾慧超、袁岳,2005),引起了比较强烈的社会反响。许多对这一结论表示怀疑乃至否定的看法实际上仍隐含地假定收入与主观幸福感是相同的,认为由于农村居民的收入水平低于城镇居民,因此农村居民的主观幸福感程度也“应当”不高于城镇居民。然而,罗楚亮(2006)利用全国城乡住户调查的数据再次证实,农村居民的主观幸福感程度高于城镇居民这一结论是成立的。这就意味着,更为重要的可能是如何对城乡居民主观幸福感差异进行解释。

90年代中后期以来,我国城镇企业改革采取了更为激进的方式,出现了大量的失业下岗现象,长期构成我国经济中的一个重要社会问题,而根据相关研究文献,这也将对城镇居民的主观幸福感产生不利的影响。城镇居民中所存在的这种就业特征差异可能将城镇居民也划分为两个不同的群体。因此,城乡居民之间的主观幸福感差异同时也应当考虑到城镇居民内部所存在的这一差异性,这就意味着本文将分析三类人群的主观幸福感特征及其差异性:农村居民、城镇中的改革受益者(就业人群)和城镇中的改革受损者(失业人群)。本文将对这三类人群主观幸福感的影响因素等进行经验研究,并讨论不同人群主观幸福感差异的形成原因。本文其余部分的安排如下,第二部分将对主观幸福感研究进行简单地回顾,目的在于得出对我国城乡居民主观幸福感可能具有影响力的潜在因素;第三部分将对本文所使用的数据、计量分析方法和变量定义等问题进行描述;第四部分和第五部分分别是对主观幸福感决定的Logit与排序Logit模型估计结果及在此基础上的分解分析结果;最后是全文的总结。

二、主观幸福感研究的简要回顾

自从Easterlin于1974年对美国跨时期的收入变化与主观幸福感变化之间关系论述的文章发表以来,主观幸福感逐渐吸引了大量经济学家的关注。特

别是20世纪90年代以来，从经济学的角度讨论主观幸福感的文献大量出现。应当说明的是，主观幸福感一直是社会学与心理学研究的重要主题，他们通过对主观幸福感的测量以获得主观幸福感的主要决定因素或影响因素，这一方面的文献描述以及在这一思路主导下对我国居民主观幸福感的研究可参见邢占军（2005）。经济学家在对主观幸福感的研究中，更加强调一些可观测的经济特征与主观幸福感之间的关联，Oswald（1997）、Frey and Stutzer（2002）曾从经济学的角度对主观幸福感的影响因素进行过较为详细的总结。

收入与主观幸福感的关系是经济学家所关注的重要议题。在相当长的一段时期中，经济增长成为一个社会所追求的最终目标，这就隐含地假定收入增长与福利改善二者基本上是相同的，然而这将与两个方面的经验观测不一致：从时间序列上看，一个经济体居民收入水平的跨时期增长并不会导致居民主观幸福感程度的相应提高，Easterlin于1974年指出这一现象后，Easterly（2001）和Frey and Stutzer（2002）再次重申了这一结论，美国1991年的人均实际收入是1946年的2.5倍，但自我评估的主观幸福感程度基本上保持不变，日本的情形也类似；从横截面跨国比较来看，尽管在收入水平较低的阶段，收入水平越高的国家主观幸福感程度相对也较高，但在一定阶段以后，主观幸福感并不会随着收入的增长而继续增长，而是保持比较平稳的状态。

在收入与主观幸福感的联系中，多数研究都并不否认收入水平、甚至绝对收入水平的重要性，如Frijters, Shields and Haisken-DeNew（2004）根据德国的情况给出了绝对收入影响主观幸福感的经验证据。但多数研究似乎认为绝对收入与主观幸福感之间可能只具有微弱的联系，如Easterlin（2001）发现收入与主观幸福感之间的相关系数只有0.2左右，而中国城乡居民的这一相关系数低于0.2（罗楚亮，2006）；因此更为强调相对收入与主观幸福感之间的联系，如Clark and Oswald（1996）、McBride（2001）、Ravallion and Lokshin（2001）、Ferrer-i-Carbinell（2002）。值得指出的是，相对收入效应可能在讨论不同人群的主观幸福感决定中会更有意义，而对于某一特定时点上的同一人群来说，相对收入效应与绝对收入效应可能具有相同的含义，因为在具有相同的参照对象的前提下，只有绝对收入水平较高者才能同时具有较高的相对收入水平。此外，由于相对收入并不是一个直接的观测指标，因此变量的构造方式以及参照人群组的选择也可能会影响到研究的结论。相对收入的另一个含义是，实际的收入水平与欲望（aspiration）之间的联系，显然欲望越强烈则相对收入水平越低，从而主观幸福感程度也相对较低。

影响主观幸福感的另一个与收入相关的因素是对未来收入变动的预期以及过去的收入变动状况。Graham and Pettinato（2001）检验了当前经济状况与过去的比较、对未来经济状况改善的预期以及对所处社会中经济地位的自我评价三个变量对主观幸福感的影响，结果表明它们对主观幸福感都具有显著的正效应。对于正处于转型时期的我国城乡居民来说，不同年份之间的收

入可能具有更强的不稳定性,从而成为主观幸福感的一个不可缺少的决定因素。

就业状况是另一类解释主观幸福感的重要变量,这不仅仅是因为失业可能具有比较严重的社会影响,还因为就业者的主观幸福感状况也将影响到他们是否会采取“跳槽”等行为,从而影响到雇主的经济收益。多数的研究强调,失业会导致居民主观幸福感程度的显著下降,如 Murphy and Athanasou (1999)、Clark and Oswald (1994)、Korpi (1997)、Gerlach and Stephan (1996)、Winkelmann and Winkelmann (1998)。即使在控制失业所导致的收入损失的情况下,失业对主观幸福感仍具有非常强烈的负效应。Winkelmann and Winkelmann (1998)的研究表明,以主观幸福感度量的失业的非货币性损失要远远高于其货币成本(收入下降)。

在影响主观幸福感的其他个人特征变量中还包括:年龄、婚姻、受教育程度、性别等。Oswald (1997)以发达经济为背景,对影响主观幸福感的人口特征进行了概括,认为幸福程度较高的人群特征包括:已婚、高收入者、白人、受过良好的教育、自我雇佣(self employed)¹、退休及家庭照看者等。Oswald认为,这些结论在不同的时期、不同的国家、甚至对主观幸福感的不同测度形式都应当成立。但事实上,除了多数研究发现年龄与主观幸福感之间表现出非线性关系外²,婚姻、受教育程度、性别等变量对主观幸福感的影响程度在不同的研究者的结论之间存在着某些差异。

由于主观幸福感的研究到目前为止主要仍是经验性的。因此,这些结果既是估计我国居民主观幸福感影响因素的基础,也是检验我国居民主观幸福感影响因素的基准。

三、数据、方法与变量描述

本文所使用的数据来自于中国社会科学院收入分配课题组于2002年针对全国城乡居民所做的住户调查。这次调查专门询问了主观幸福感的情况,根据国际上相关研究的通用询问方式以及我国居民的理解,城镇中这一问题表述为:“总的来说,您现在幸福吗”;农村问卷中,该问题为“现在幸福吗”,要求被调查者在“非常幸福、比较幸福、不好也不坏、不太幸福、很不幸福及不知道”六种选择中做出判断,要求家庭户主或家庭中的一名主要成员回

¹ Frey and Stutzer(2000)发现,在瑞士,这一效应也是正的,但 Graham and Pettinato(2001)发现,在美国,自我雇佣对高收入者主观幸福感没有显著的影响,对中低收入者的影响显著为负。Graham and Pettinato(2002)对此的解释是,发达经济中,“自我雇佣”通常是自愿选择的;而在低收入者中,“自我雇佣”意味着在别无选择的情况下不得不从事的非正规就业。

² 在一定年龄之前,主观幸福感程度随着年龄的增长而下降;但在这一年龄点之后,主观幸福感将随着年龄的增长而上升。这一转折点一般出现在35—40岁左右。

答。尽管将回答对象限定为户主或家庭主要成员将导致个人对这一问题的判断在较大程度上具有家庭层面上的意义，但在本文中，我们除了以家庭收支情况和人口构成特征来度量家庭状况外，在个人特征方面，仍以回答者的个人信息为主。

表1 分城乡与就业特征的主观幸福感分布(单位:数量为户、比重为%)

	城镇无失业住户		城镇有失业住户		全部城镇住户		全部农村住户	
	数量	比重	数量	比重	数量	比重	数量	比重
非常幸福	414	7.55	64	4.86	478	7.03	1340	15.35
比较幸福	2791	50.89	503	38.19	3294	48.43	3966	45.45
不好也不坏	1675	30.54	449	34.09	2124	31.23	2542	29.13
不幸福	456	8.32	233	17.69	689	10.13	705	8.08
很不幸福	96	1.75	55	4.18	151	2.22	90	1.03
说不清	52	0.95	13	0.99	65	0.96	84	0.96
合计	5484	100	1317	100	6801	100	8727	100
主观幸福 感程度 ³	均值	标准差	均值	标准差	均值	标准差	均值	标准差
	3.547	0.821	3.221	0.939	3.484	0.855	3.667	0.871

表1给出了城乡居民主观幸福感分布的基本特征。城乡居民主观幸福感的比较可以从两个方面来进行，一是比较不同人群中，感觉“幸福”的人群比例高低；二是以将不同主观幸福感程度进行赋值，进而比较两类人群的主观幸福感均值水平。

根据第一种比较方式，我们将主观幸福感定义为0—1变量⁴，如果回答者认为自己是“非常幸福”或“比较幸福”的，记 $H_{ap}=1$ ；否则， $H_{ap}=0$ 。在城乡两类样本中选择“说不清”或缺失的样本比例基本相同。农村居民中选择“非常幸福”与“比较幸福”的两类人群要高于城镇住户5.3个百分点。如果设主观幸福感由收入及一系列其他特征所决定，则个人主观幸福感的概率模型可以表示为：

$$\Pr(H_{ap} = 1 | X) = \Phi(X'\beta), \quad (1)$$

其中， $\Phi(\cdot)$ 为一概率分布函数，本文将采用Logit模型进行估计，即设定 $\Phi(\cdot)$ 为逻辑分布的分布函数。在变量 X 中，包括相关的收入变量，如绝对收入水平、相对收入状况及收入变化及其预期等，此外还将对一些个人特征和家庭结构进行控制。

³ “很不幸福”为1、“非常幸福”为5，中间类推。此外，在计算均值时，不包括选择“说不清”的样本。

⁴ Winkelmann and Winkelmann(1998)在讨论失业对主观幸福感的影响时利用的是二元概率模型(binary probability model)。

为了得到不同人群个人主观幸福感差异的形成原因,我们可以在 Even 与 Macpherson (1993)⁵ 的基础上对主观幸福感的平均预测概率按其影响因素进行分解分析。根据 Logit 模型的估计系数,某人群中自我评价为幸福的平均预测概率为:

$$\Pr(\text{Hap} = 1 \mid X, \hat{\beta}) = \frac{1}{N} \sum_{i=1}^N \Phi(X_i' \hat{\beta}), \quad (2)$$

其中, N 为人群组的样本数。对于两组人群 R 与 U 来说,自我评价为幸福的预测概率总体差异可以表示为:

$$\text{总体差异}(T): T = \Pr(\text{Hap} = 1 \mid X_R, \hat{\beta}_R) - \Pr(\text{Hap} = 1 \mid X_U, \hat{\beta}_U). \quad (3)$$

进一步地,由于变量和系数造成的预测概率差异可以分别表示为(假定以人群组 R 的系数、 U 的变量特征为参照):

$$\text{变量差异}(V): V = \Pr(\text{Hap} = 1 \mid X_R, \hat{\beta}_R) - \Pr(\text{Hap} = 1 \mid X_U, \hat{\beta}_R), \quad (4)$$

$$\text{系数差异}(C): C = \Pr(\text{Hap} = 1 \mid X_U, \hat{\beta}_R) - \Pr(\text{Hap} = 1 \mid X_U, \hat{\beta}_U). \quad (5)$$

对于某特定的因素 j 来说,对预测概率所造成的差异也包括变量差异与系数差异,可分别表示为:

第 j 个因素的变量解释程度:

$$V^j = [\Pr(\text{Hap} = 1 \mid X_R, \hat{\beta}_R) - \Pr(\text{Hap} = 1 \mid X_U, \hat{\beta}_R)] \times \left[\frac{(\bar{X}_U^j - \bar{X}_R^j) \hat{\beta}_R^j}{(\bar{X}_U - \bar{X}_R) \hat{\beta}_R} \right]. \quad (6)$$

第 j 个因素的系数解释程度:

$$C^j = [\Pr(\text{Hap} = 1 \mid X_U, \hat{\beta}_R) - \Pr(\text{Hap} = 1 \mid X_U, \hat{\beta}_U)] \times \left[\frac{\bar{X}_U^j (\hat{\beta}_R^j - \hat{\beta}_U^j)}{\bar{X}_U (\hat{\beta}_R - \hat{\beta}_U)} \right]. \quad (7)$$

因此,因素 j 的总体贡献份额则为: $(V^j + C^j)/T$ 。

根据这一分析,我们可以得到农村居民中自我评价为幸福的人群比例高于城镇的原因解释以及每个解释变量对不同人群主观幸福感程度差异的相对贡献率。

⁵ 另一种概率分解方法是 Doiron and Riddell(1994)提出的基于 Probit 模型的一阶泰勒展开式的分解,罗楚亮(2006)采用了这一方法。这一方法的优势在于,分解结果不依赖于参照组的选择,缺陷在于分解的精确度不确定,因为关于使得误差项最小的泰勒级数展开点没有非常简明的计算方法。而 Even and Macpherson(1993)能够得到比较直观的分解结果,并且可以分解全部差异而没有误差项,但各变量的相对贡献大小与参照组(同度量标准)的选择相关。在本文中 choice Even and Macpherson(1993)分解,是因为希望得到比较直观的分解结果,同时增加了绝对收入项后采用 Doiron and Riddell(1994)的泰勒展开式分解会得到比较大的误差项。感谢审稿人推荐了 Even and Macpherson(1993)分解方法。

在第二种比较方式中,我们可以将主观幸福感由低到高排列,“很不幸福”为1、“非常幸福”为5,中间类推,这样可以得到不同主观幸福感的均值。从表1中可以发现,根据这种度量方式,农村居民的主观幸福感程度也仍要高于城镇居民,城镇中有失业成员家庭的主观幸福感程度是最低的。

在主观幸福感的研究文献中,通常把回答者对主观幸福感程度的选择当作是一个排序的过程,因此在研究方法上多采用排序的概率模型⁶(如 Ordered Logit)来描述这一选择过程。这一选择过程可以描述为:

$$\begin{aligned} \Pr(\text{Hap} = 1 | X) &= \Phi(\alpha_1 - X\beta), \\ \Pr(\text{Hap} = l | X) &= \Phi(\alpha_l - X\beta) - \Phi(\alpha_{l-1} - X\beta), \\ \Pr(\text{Hap} = 5 | X) &= 1 - \Phi(\alpha_4 - X\beta), \\ l &= 2, 3, 4. \end{aligned} \quad (8)$$

其中, $\Phi(\cdot)$ 为逻辑分布的概率分布函数,这里采用排序 Logit 模型进行估计,解释变量的选择与 Logit 模型相同。

在排序概率模型中,主观幸福感程度的预测均值为:

$$\text{Hap}_{\text{pred}} = \sum_{l=1}^5 l \times \Pr(\text{Hap} = l | X, \hat{\beta}). \quad (9)$$

其中, $\Pr(\text{Hap}_l = 1 | X, \hat{\beta})$ 为主观幸福感为等级 l 的概率预测均值。

对于两组人群 R 与 U 来说,主观幸福感程度预测均值的差异可以表示为:

$$\begin{aligned} \text{Hap}_{\text{pred}}^R - \text{Hap}_{\text{pred}}^U &= \sum_{l=1}^5 l \times \Pr(\text{Hap} = l | X_R, \hat{\beta}_R) \\ &\quad - \sum_{l=1}^5 l \times \Pr(\text{Hap} = l | X_U, \hat{\beta}_U) \\ &= \sum_{l=1}^5 l \times [\Pr(\text{Hap} = l | X_R, \hat{\beta}_R) \\ &\quad - \Pr(\text{Hap} = l | X_U, \hat{\beta}_U)]. \end{aligned} \quad (10)$$

在 Even and Macpherson (1993) 的基础上,方括号中的概率预测值差异可以分解为(假定以人群组 R 的系数、 U 的变量特征为参照):

⁶ 多数主观幸福感研究文献以排序概率模型作为基本的估计方法。但 Winkelmann and Winkelmann (1998) 在估计失业的货币收益与非货币损失时采用了二元因变量的概率模型。Ferrer-i-Carbonell and Frijters (2004) 比较了线性模型与排序概率模型的估计结果,发现两者之间的差异不大,但他们据此认为效用的基数假定与序数假定的区分并不重要可能缺乏充分的理由。估计方法得到相似的结果并不意味着关于效用或满足感的基数与序数意义不具有差别性,因为有可能这两种估计结果差异很小仅仅是由于线性概率模型与正态分布、逻辑分布概率模型的估计系数具有相似性造成的。John Knight 与宋丽娜 (2004) 也采用线性模型以 OLS 估计了中国农村居民的主观幸福感决定。

总体差异(T): $T_l = \Pr(\text{Hap} = l | X_R, \hat{\beta}_R) - \Pr(\text{Hap} = l | X_U, \hat{\beta}_U)$, (11)

变量差异(V): $V_l = \Pr(\text{Hap} = l | X_R, \hat{\beta}_R) - \Pr(\text{Hap} = l | X_U, \hat{\beta}_R)$, (12)

系数差异(C): $C_l = \Pr(\text{Hap} = l | X_U, \hat{\beta}_R) - \Pr(\text{Hap} = l | X_U, \hat{\beta}_U)$. (13)

因此, 主观幸福感预测均值的差异可以分解为:

$$\text{Hap}_{\text{pred}}^R - \text{Hap}_{\text{pred}}^U = \sum_{l=1}^5 l \times V_l + \sum_{l=1}^5 l \times C_l. \quad (14)$$

等式右边由两项组成, 分别表示变量差异和系数差异对两人群组中主观幸福感预测均值差异解释的绝对量。更进一步地, 如果考虑第 i 个因素对主观幸福感预测均值差异的贡献, 则可参照 Even and Macpherson (1993) 定义:

第 i 个因素对主观幸福感为等级 l 的概率的变量贡献为:

$$V_l^i = [\Pr(\text{Hap} = l | X_R, \hat{\beta}_R) - \Pr(\text{Hap} = l | X_U, \hat{\beta}_R)] \times \left[\frac{(\bar{X}_R^i - \bar{X}_U^i) \hat{\beta}_R^i}{(\bar{X}_R - \bar{X}_U) \hat{\beta}_R} \right], \quad (15)$$

第 i 个因素对主观幸福感为等级 l 的概率的系数贡献为:

$$C_l^i = [\Pr(\text{Hap} = l | X_U, \hat{\beta}_R) - \Pr(\text{Hap} = l | X_U, \hat{\beta}_U)] \times \left[\frac{X_U^i (\hat{\beta}_R^i - \hat{\beta}_U^i)}{X_U (\hat{\beta}_R - \hat{\beta}_U)} \right], \quad (16)$$

因此, 第 i 个因素对主观幸福感预测均值差异的总体贡献份额可表示为:

$$\omega^i = \frac{\sum_{l=1}^5 l \times (V_l^i + C_l^i)}{\text{Hap}_{\text{pred}}^M - \text{Hap}_{\text{pred}}^N}.$$

本文所选用的解释变量如表 2 所示, 同时也给出了这些解释变量在不同人群中的均值。多数变量的含义如其字面意义所示, 现对其中的两个变量的构造方式略做解释: 相对收入是通过住户人均收入除以当地县/市人均收入⁷得到的, 指的是家庭收入水平超出当地平均水平的幅度; 在本次调查中, 我们询问了住户的最低生活费用支出情况(或称主观贫困线), 本文以家庭的实际消费支出除以主观估计的维持最低生活标准所需要的货币量来描述家庭的预期实现程度。关于主观幸福感的多数研究中, 一般都没有考虑家庭债务的影响, 本文之所以引入了这一变量, 一方面是因为在一些回归结果中, 我们发现这一变量对主观幸福感有显著的影响; 另一方面, 我国居民对于负债可能具有比较强的回避倾向, 而近年来居民收支不确定性的增强以及住房、医

⁷ 农村住户除以县人均收入, 城镇居民除以市人均收入。相应的人均收入水平都是根据抽样调查计算得到。

疗和教育等刚性支出的增长则使人们不得不借债以平滑消费。

从表2中可以看到：(1)农村居民的预期实现程度远远高于城镇居民，结合考虑到农村居民的实际消费支出低于城镇居民的现实，我们不难推断，农村居民预期的最低生活费用标准也要大大低于城镇居民。(2)农村居民对于未来的收入增长也具有更加良好的预期，预期收入大幅度增长或小幅度增长的人群比例都要大大高于城镇居民。农村居民中预期未来收入增长的人群大约占到78%，而城镇中则不到50%；相反城镇居民中预期收入下降的比例大大高于农村居民，前者在20%左右，而后者则只有4%。(3)与过去生活状态比较，农村居民对目前生活具有更为积极的评价，61%的农村居民认为当前的生活状况获得了相对改善，而城镇居民中这一比例则低得多。从表2中还不难发现，有失业成员的城镇住户中，对未来的预期最为悲观，而当前生活状况相对于过去有更为严重的恶化趋向。

造成城乡居民这种预期与评价差异的主要原因可能在于经济改革的不同影响。在我们调查的这一时期中，与城镇改革相联系的就业机会下降、收入与支出不确定性的增强使得城镇居民难以对未来形成良好的预期；但对于农村居民来说，尽管城乡居民收入差距依然存在，但似乎仍不时有一些“利好”的消息，如税费减免、对约束农村外出打工的制度壁垒的逐渐消除等，当然，农村居民所处的相对较低的比较起点可能是更为主要的原因。

表2 不同人群解释变量均值

	全部城镇	城镇无失业	城镇有失业	农村住户
家庭人均收入(元)	8467.15	9054.76	6019.36	2630.89
相对收入	1.050	1.119	0.763	1.026
预期实现程度	1.522	1.557	1.377	2.579
家庭债务(元)	5538.32	5957.78	3790.97	1246.01
预期收入大幅度增长(0—1变量) ⁸	0.023	0.025	0.015	0.096
预期收入小幅度增长(0—1变量)	0.463	0.473	0.419	0.681
预期收入下降(0—1变量)	0.190	0.182	0.223	0.041
比过去改善(0—1变量) ⁹	0.221	0.237	0.156	0.610
比过去恶化(0—1变量)	0.209	0.181	0.327	0.048
户主(0—1变量)	0.660	0.670	0.618	0.749
女性(0—1变量)	0.546	0.549	0.533	0.251

⁸ 对收入变化特征的预期来自于问题：“在未来5年中，您家收入会发生怎样的变化？”参照组为“不变”。

⁹ 对生活状态评价的问题为：“与5年前相比，您现在的生活如何？”参照组为“差不多”。

(续表)

	全部城镇	城镇无失业	城镇有失业	农村住户
有配偶(0—1 变量)	0.936	0.936	0.940	0.952
离异(0—1 变量)	0.016	0.017	0.013	0.003
丧偶(0—1 变量)	0.027	0.028	0.022	0.024
大学及以上(0—1 变量)	0.079	0.091	0.028	0.002
大专(0—1 变量)	0.183	0.203	0.104	0.005
中专(0—1 变量)	0.130	0.136	0.104	0.027
高中(0—1 变量)	0.263	0.258	0.285	0.138
初中(0—1 变量)	0.283	0.252	0.412	0.469
年龄(岁)	46.590	46.616	46.483	45.333
家庭人口数(人)	3.019	2.964	3.247	4.144
0—10 岁儿童比例	0.067	0.071	0.051	0.091
65 岁以上老人比例	0.079	0.089	0.040	0.051
家庭中身体欠佳成员比例	0.059	0.056	0.075	0.051
样本数	6736	5432	1304	8643

在城镇的就业与失业群体之间,相对收入及预期实现程度都存在着比较明显的差异性,并且失业群体明显处于不利地位。失业群体对未来收入变化的预期以及对当前生活状态相对于过去状态比较的评价也都要低于就业群体。因此,失业人群不仅所获得的收入水平相对较低,并且预期状态也更为悲观。而生活状况的相对恶化则可能是这一人群主观幸福感程度相对较低的重要原因。

四、农村居民幸福人群比例高于城镇: Logit 模型

(一) Logit 模型的估计结果

Logit 模型的估计结果可见表 3,该表给出了各解释变量对主观幸福感的边际概率。在针对全部住户的回归分析中,以虚拟变量的形式描述不同类型家庭对主观幸福感的影响,假定不同人群的主观幸福感决定方程具有相同的系数特征,他们之间的主观幸福感差异由虚拟变量所表征。为了便于城乡比较,在所使用的概率模型中,我们采用相同的解释变量。

表 3 不同人群主观幸福感差异的边际效应(Logit 模型)

	全部样本		全部城镇		城镇无失业		城镇有失业		农村	
	dy/dx	z	dy/dx	z	dy/dx	z	dy/dx	z	dy/dx	z
家庭经济状况										
家庭人均收入对数	-0.075	1.03	0.288	1.14	-0.020	0.07	0.820	1.26	-0.173	1.37
人均收入对数平方	0.010	2.28**	-0.014	0.98	0.003	0.16	-0.047	1.21	0.019	2.26**
相对收入	0.004	0.14	0.244	6.16***	0.218	5.37***	0.357	3.17***	-0.119	3.45***
相对收入平方	0.000	0.02	-0.031	3.97***	-0.028	3.84***	-0.042	1.61	0.021	2.31**
预期实现程度	0.044	7.83***	-0.008	0.49	0.001	0.05	-0.062	1.56	0.050	8.14***
预期实现程度平方	-0.003	6.13***	0.000	0.12	-0.001	0.51	0.011	1.98**	-0.003	6.8***
家庭负债	-0.035	4.94***	-0.035	2.52**	-0.044	2.82***	0.014	0.47	-0.038	3.75***
家庭负债平方	0.003	3.57***	0.003	1.89*	0.003	2.3**	-0.003	0.83	0.003	2.77***
预期收入大幅度增长	0.180	11.39***	0.216	6.14***	0.205	5.71***	0.207	1.76*	0.150	7.91***
预期收入小幅度增长	0.084	8.12***	0.108	7.41***	0.112	6.99***	0.091	2.73***	0.057	3.83***
预期收入下降	-0.106	6.62***	-0.119	6.31***	-0.116	5.51***	-0.123	3.19***	-0.044	1.39
生活状态比过去改善	0.156	16.64***	0.032	1.97**	0.036	2.06**	0.006	0.15	0.224	19.24***
生活状态比过去恶化	-0.089	6.15***	-0.107	6.31***	-0.100	5.04***	-0.106	3.27***	-0.073	2.58***
回答者特征										
户主	-0.031	2.52***	-0.039	2.55**	-0.034	2.06**	-0.065	1.83*	-0.017	0.66
女性	0.023	1.89*	0.036	2.41**	0.036	2.19**	0.028	0.81	0.015	0.61
有配偶	0.047	1.41	0.076	1.45	0.065	1.12	0.044	0.4	0.016	0.36
离异	-0.184	3.16***	-0.124	1.61	-0.131	1.56	-0.121	0.72	-0.192	1.87*
丧偶	-0.139	3.14***	-0.057	0.84	-0.063	0.85	-0.092	0.62	-0.188	3.16***
大学及以上	0.071	2.74***	0.057	1.55	0.051	1.29	0.111	1.02	-0.066	0.48
大专	0.034	1.71*	0.009	0.27	0.007	0.18	0.031	0.4	0.105	1.36
中专	0.047	2.49***	0.033	1.00	0.020	0.56	0.104	1.33	0.045	1.28
高中	0.047	3.32***	0.035	1.14	0.044	1.28	0.020	0.29	0.043	2.46**
初中	0.043	3.77***	0.033	1.11	0.020	0.6	0.104	1.59	0.039	3.04***
年龄	-0.006	1.63*	-0.012	2.08**	-0.013	2.15**	-0.001	0.07	-0.002	0.37
年龄平方	0.009	2.53***	0.015	2.53**	0.017	2.66***	0.002	0.12	0.005	0.97
家庭人口特征										
0—10 岁儿童比例	-0.016	0.43	-0.031	0.51	-0.060	-0.91	0.090	0.58	-0.012	-0.26
65 岁以上老人比例	0.068	2.1**	0.073	1.53	0.036	0.71	0.146	0.89	0.047	1
身体欠佳成员比例	-0.297	9.66***	-0.313	7.29***	-0.316	6.7***	-0.261	2.69***	-0.293	6.69***
家庭人口总数	-0.008	1.94**	0.025	2.68***	0.028	2.6***	0.028	1.35	-0.012	-2.7***
有失业的城镇住户	-0.063	3.66***								
农村住户	0.075	3.85***								
样本数	15379		6736		5432		1304		8643	
预测概率	0.600		0.566		0.599		0.424		0.628	
对数似然值(LR)	-9470.31		-4186.613		-3360.637		-808.588		-5191.55	
Wald Chi(2)	1598.71		733.55		540.90		143.88		973.51	

注:本表给出的是各解释变量对主观幸福感的边际效应,其中连续变量在均值处计算、离散变量取 0 到 1 之间的变化;z 统计量绝对值已进行异方差调整;***、**、* 分别表示在 1%、5% 及 10% 水平下显著。

第一列给出的是城乡样本混合时的主观幸福感的概率模型的估计结果。当控制住绝对收入、相对收入、预期、家庭债务及回答者的其他相关特征以后,相对于没有失业成员的城镇住户而言,有失业成员的住户的主观幸福感要更低,但农村住户的主观幸福感程度相对较高。就幸福的边际概率而言,有失业的城镇住户比无失业的城镇住户低 6.3 个百分点,而农村住户则比无失业的城镇住户高 7.5 个百分点。如果将全部城镇住户作为参照组,则农村住户这一虚拟变量的边际概率系数为 0.093,这一系数在 1% 的水平下仍是显著的,也就是说,在控制其他因素的情况下,农村居民中感觉幸福的人群比例比城镇居民要高 9.3 个百分点。因此,在控制住影响城乡居民主观幸福感的一般因素后,农村居民的主观幸福程度仍要显著高于城镇居民,而失业的因素导致城镇居民感到幸福的概率比农村居民要低 13.8 个百分点。

收入对主观幸福感的影响一直是主观幸福感文献关注的重要内容。参照 Clark and Oswald (1996) 的思路,本文的解释变量中同时考虑了绝对收入与相对收入水平,其中绝对收入是以家庭人均收入水平的对数及其平方项衡量,相对收入的定义如前所述。从估计结果中可以发现,同时考虑绝对收入与相对收入效应时,绝对收入的影响一般都不显著,只有全部混合样本及农村住户中人均收入对数的平方项是显著的;在不同人群组内部,相对收入效应对于主观幸福感的决定具有更为重要的作用。在城镇无失业成员的住户中,主观幸福感首先随着相对收入的增加而上升,随后依相对收入的增加而下降;在有失业成员的城镇住户中,相对收入对主观幸福感的影响则基本上表现为线性递增。出现这一现象的原因可能是,当相对收入水平较低时,个人的相对地位改善可能具有比较大的空间,并且在这可能也具有比较强的向上层流动的趋向;当相对收入水平较高时,由于“由俭入奢易、由奢入俭难”导致相对地位具有向下调整的刚性,为了维持既有的相对地位可能需要付出更大的努力,这就是所谓的“守业更难”。但农村居民中,相对收入效应对主观幸福感的影响方式则是完全不同的。当相对收入水平较低时,主观幸福感随着相对收入的增加而降低;但当相对收入水平较高时,主观幸福感随着相对收入的增加而增强。这可能体现了城乡居民的观念意识差异导致的主观幸福感决定方式差异。

预期的实现程度对于无失业成员的城镇住户没有显著的影响,但正向地影响有失业成员的城镇住户的主观幸福感程度。预期实现程度越高,或者说预期的最低生活标准越低,则越容易获得满足。这一变量对于农村居民的主观幸福感程度的作用是显著的,并且也具有非线性特征。这一变量对于城乡居民主观幸福感的作用方式具有明显的差异,这也暗示城乡居民的主观幸福感差异可以在一定程度上由预期及预期实现程度的差异所解释。

相对收入强调的是居民收入水平的横向比较,而预期的实现程度强调实

际生活状态与期望达到的状态或欲望 (aspiration) 之间的比较。在城镇居民中,前一变量具有显著作用,但后一变量的作用是不显著的;在农村居民中,这两个变量都具有显著的效应。这可能表明,城镇居民的主观幸福感在更大程度上取决于本人在当地的相对状况,因此“炫耀性”或“示范性”特征更为明显;而农村居民的相对满足感尽管同时取决于这两方面的因素,但预期的满足则似乎更加表现为提高主观幸福感的积极因素。这两个变量在城乡之间所表现出的这一差异性可能是由两类人群的经济发展程度差异造成的。当经济发展程度处于较低的水平时,对基本生存条件的满足能带来较强的幸福感;而当经济发展达到一定阶段后,幸福感则更主要的是来自于与他人比较所具有的相对优势地位。

家庭债务对于主观幸福感通常具有显著的影响。无论城乡,我国传统的社会意识都不支持家庭的负债行为。因此,家庭债务一般都会被认为是一种应当尽快偿还的负担,为偿还债务可能会对居民的主观幸福感造成消极影响。但负债同时也与居民对未来的预期相关,对未来具有悲观预期的家庭,可能会更为谨慎地对待是否举债的选择。因此,较高负债的家庭也可能是对未来具有较好预期的家庭,从而具有较高的主观幸福感。一个有意思的现象是,在有失业的城镇住户中,债务对主观幸福感没有显著的影响。对于这一现象有两种可能的解释,一是没有考虑到债务的来源,如果有失业成员的家庭债务主要是由于亲友接济形成的,则对主观幸福感可能没有显著的影响;二是债务对主观幸福感的负效应被其他因素,如失业所掩盖。

对未来收入变化趋势的预期与主观幸福感之间存在显著的关联性。以预期未来收入没有变化为参照组,如果未来的收入变化具有增长的趋势,则主观幸福感程度相对较高;相反,如果预期未来收入是下降的,则主观幸福感程度相对较低。并且,如果预期收入有大幅度增长趋势,则其主观幸福感程度也要高于预期收入有小幅度增长的住户。应当注意的是,预期收入下降对农村居民造成的主观幸福感损失是不显著的,这可能也在一定程度上表明城乡居民心态上的差异性。当前相对于过去的生活改善状况与主观幸福感之间的联系通常也是显著的。在农村居民中,不仅有更多的人认为生活状态获得了改善,而且这种改善对于主观幸福感的影响程度也要大大高于城镇居民。对收入变化的预期及对生活状态改善状况的评价表明,主观幸福感具有纵向意义上的相对性,并且具有向下调整的刚性。良好的预期能导致主观幸福感的增强,但一旦生活状态变差,则可能会对人们的主观幸福感构成严重的打击。

在主观幸福感决定方程中,除了包括以上具有明确经济含义的解释变量外,还根据多数研究文献的变量选取方式,对回答者的个人特征和家庭构成进行控制。选取的变量包括回答者是否为户主、性别特征、婚姻状况、教育程度及年龄等;家庭构成主要考虑的是家庭人口规模、儿童与老人比例以及

家庭成员的健康状况。

表3的估计结果显示,户主的幸福感程度相对较低¹⁰,但农村样本中这一变量的作用不显著。性别的影响则不确定,在无失业成员的城镇住户中,女性具有更高的幸福感程度,但在有失业成员的城镇住户及农村住户中,这种性别差异则是不显著的。在城镇居民的主观幸福感决定因素中,婚姻状况似乎并不具有显著的影响,但“离异”或“丧偶”的农村回答者的幸福感程度则显著较低。在业已控制收入的情形下,教育程度对城镇居民的主观幸福感没有显著的影响,但农村居民中的“高中”与“初中”人群¹¹相对于小学及以下(参照组)人群具有更强的主观幸福感,因此农村居民对教育的偏好似乎超出了单纯的获取收入的动机。在家庭无失业成员的城镇回答者中,回答者的年龄与主观幸福感之间表现出U型关系,即在一定年龄之前,主观幸福感随着年龄的增长而降低,而此后则随之增高,这也是与多数的研究的结论基本一致的。但这一效应在有失业成员的城镇家庭及农村住户中却不存在。即使只考虑年龄的一次项,家庭中有失业成员的城镇回答者的年龄与主观幸福感之间没有显著的联系,但农村回答者中则存在着主观幸福感随着年龄的增长而增强的线性关系。

在家庭人口构成中,儿童与老人比例对主观幸福感通常没有显著的影响,但家庭成员的健康状况则对主观幸福感具有显著的作用,不健康成员越多的家庭主观幸福感程度也越低。值得注意的是,家庭人口数对主观幸福感的影响具有明显的城乡差异性,家庭人口数量对无失业成员城镇居民的主观幸福感具有正向的影响,人口数量越多的家庭幸福感程度相对较高;但对农村住户的影响则是相反的;而对有失业成员城镇居民的主观幸福感则没有显著的影响。这其中的联系机制不难理解,如果家庭具有较强的经济能力,并且家庭规模相对较低时,则家庭人口数量较多能带来相对较高的主观幸福感;相反,如果家庭的经济能力较差,并且家庭规模相对较大,则家庭人口数量对主观幸福感的影响可能为负面的。

(二) 总体回归系数差异显著性检验

在本文中,我们将全部样本划分成了几个不同的人群组。这也就隐含地假定不同人群组中,主观幸福感方程具有不同的决定形式,在决定因素(即解释变量)相同的情况下,不同人群组主观幸福感决定形式的差异将主要表现为总体估计系数之间的显著差异。

为了检验这种模型设定差异的显著性,我们采用了 Hausman 检验:记两

¹⁰ 不难理解,户主通常承担更多的社会及家庭责任。

¹¹ 从表2的描述性统计中也可以发现,农村居民中“高中”以上文化程度是极为罕见的。

人群组 R 与 U 的估计系数向量分别为 $\hat{\beta}_R$ 和 $\hat{\beta}_U$, 估计系数向量对应的方差—协方差矩阵分别为 $\text{var}(\hat{\beta}_R)$ 和 $\text{var}(\hat{\beta}_U)$, 则统计量 $(\hat{\beta}_R - \hat{\beta}_U)' (\text{var}(\hat{\beta}_R) - \text{var}(\hat{\beta}_U))^{-1} (\hat{\beta}_R - \hat{\beta}_U)$ 服从自由度为两个方程中相同解释变量的数量的 χ^2 分布。

表4 不同人群组主观幸福感 Logit 模型估计系数总体性差异检验

	全部样本	全部城镇	城镇无失业	城镇有失业
全部城镇	70.30***	—	…	…
城镇无失业	1336.12***	30.23	—	…
城镇有失业	51.37**	23.53	41.89*	—
农村住户	201.81***	1396.25***	773.12***	114.73***

注: 本表给出的是根据各人群组主观幸福感 Logit 方程中各解释变量估计系数 Hausman 检验的 χ^2 统计量; ***、**、* 分别表示在 1%、5% 及 10% 水平下显著。

表4的检验结果表明, 农村住户与城镇住户之间的主观幸福感决定方式中存在着显著的差异性, 因此主观幸福感的决定方式中存在着比较明显的城乡差异性, 并且这种差异是一种结构性的差异。城镇内部失业与非失业住户中的总体系数差异也是显著的, 因此城镇有失业成员的住户的主观幸福感相对较低也在一定程度上可以归结为主观幸福感决定方程的结构性差异。总体上说, 这种不同人群的分割特征是显著的, 为了简化, 我们也将不同人群之间的这种分割属性看成是外生给定的。

(三) 影响因素的分解分析

鉴于前一部分的讨论, 由于不同人群的主观幸福感决定方式之间存在差异性 (主观幸福感的 Logit 模型的估计系数整体上具有显著的差异性), 为了进一步确认导致不同人群主观幸福感差异的各因素的相对贡献大小, 我们对各人群主观幸福感决定的 Logit 模型的估计结果进行分解分析, 主要考虑两类主观幸福感差异: 城乡差异以及就业状态差异。表5给出了具体的分解结果, 包括变量和系数差异对主观幸福感差异的总体解释程度, 以及各类变量对不同人群主观幸福感差异的总体解释份额¹²。由于在 Even-Macpherson 分解中, 参照组的选择将影响到单个因素对总体差异贡献大小的解释, 因此我们分别给出了两种参照组的分解结果。

表5 各因素对城乡居民主观幸福感差异的解释效应(基于 Logit 分解)

	城乡分割						就业分割	
	农村—全部城镇 数量 百分比	农村—全部城镇 数量 百分比	农村—城镇无失业 数量 百分比	农村—城镇有失业 数量 百分比	农村—城镇有失业 数量 百分比	农村—城镇有失业 数量 百分比	无失业—有失业 数量 百分比	
平均预测概率总差异	0.054	100.00	0.024	100.00	0.179	100.00	0.155	100
			以农村系数、 城镇变量为参照				以有失业系数、 无失业变量为参照	
变量总差异	-0.071	-131.48	-0.088	-366.67	-0.002	-1.12	0.105	67.74
系数总差异	0.125	231.48	0.112	466.67	0.181	101.12	0.050	32.26

¹² 在考虑具体变量对主观幸福感差异的解释时, 没有对系数差异与变量再进行进一步的区分。

(续表)

	城乡分割						就业分割	
	农村—全部城镇		农村—城镇无失业		农村—城镇有失业		无失业—有失业	
	数量	百分比	数量	百分比	数量	百分比	数量	百分比
绝对收入	-1.342	-2484.58	-0.191	-794.07	-3.309	-1848.84	2.473	1595.45
相对收入	-0.254	-471.23	-0.242	-1007.84	-0.294	-164.52	0.159	102.40
预期实现程度	0.074	136.67	0.066	273.67	0.119	66.60	-0.045	-29.04
家庭债务	-0.005	-9.63	-0.006	-24.65	-0.003	-1.49	-0.002	-1.16
收入变化预期	0.017	31.43	0.013	53.33	0.033	18.41	-0.007	-4.34
与过去状态的比较	0.125	231.91	0.120	500.83	0.139	77.57	-0.001	-0.84
其他变量	0.040	74.47	0.060	248.22	-0.144	-80.34	0.287	184.98
常数项	1.399	2590.95	0.204	850.51	3.638	2032.62	-2.709	-1747.44
	以城镇系数、 农村变量为参照						以无失业系数、 有失业变量为参照	
变量总差异	0.005	9.26	0.014	58.33	0.136	75.98	0.096	61.94
系数总差异	0.049	90.74	0.010	41.67	0.043	24.02	0.059	38.06
绝对收入	-1.370	-2536.71	-0.156	-650.78	-6.489	-5191.06	4.467	2882.00
相对收入	-0.258	-477.75	-0.189	-789.15	-0.670	-536.14	0.162	104.52
预期实现程度	0.074	136.88	0.045	186.90	0.161	128.80	-0.072	-46.45
家庭债务	-0.007	-13.37	-0.010	-41.64	-0.013	-10.43	0.006	3.74
收入变化预期	0.027	50.60	0.031	130.52	-0.009	-6.96	-0.012	-7.63
与过去状态的比较	0.133	246.38	0.101	420.88	0.258	206.39	-0.015	-9.46
其他变量	0.041	75.54	0.048	197.98	-0.304	-243.01	0.490	315.90
常数项	1.414	2618.43	0.155	645.29	7.190	5752.40	-4.871	-3142.63

1. 城乡分割

首先我们考虑主观幸福感差异的城乡分割特征,以农村居民自我评价为幸福的平均预测概率减去城镇居民的这一平均预测概率为分解对象。

从变量和系数对城乡主观幸福感差异的总体解释效果来看,在两种参照组的选择方式下,系数的总体差异对主观幸福感总体差异的解释程度通常要大于变量的解释作用;在以农村系数、城镇变量为参照组的分解结果中,变量总差异的解释作用总是为负的,而系数的总体解释作用总是为正的。导致变量总差异的解释作用为负的主要原因在于,城镇居民的绝对收入水平高于农村居民,即绝对收入水平对于城乡居民主观幸福感差异没有起到正向的解释作用。从表3中的估计结果可以看出,相对收入效应对于不同人群内部的主观幸福感决定具有较强的解释作用,但对于不同人群之间的主观幸福感差异也没有正向的解释作用。无论是绝对收入效应还是相对收入效应都无法解释城乡居民之间的主观幸福感差异。

对城乡居民主观幸福感差异具有重要解释作用的变量预期实现程度、对收入变化预期和对生活状态相对于过去状况的比较。预期实现程度对于农村与有失业城镇住户之间的主观幸福感差异具有较强的解释效应。事实上,以

实际消费支出与主观估计的最低生活标准的比值所度量的预期实现程度在有失业成员的城镇住户中要更低于农村居民。在有失业的城镇住户中，这一较低值主要是由于实际消费支出较低造成的；而农村居民中，这一指标值较高是由于主观估计的最低生活标准较低造成的¹³。应该指出的是，由于主观估计的最低生活支出中包含的是一个家庭中最为必要的生活开支，因此主观估计的最低生活支出差异在一定程度上可能反映了生活费用的差异，这在城镇有无失业成员的家庭中差异较小而城乡之间的差异较大的现象中也可以体现出来。这就意味着，城镇居民较低的主观幸福感与城镇相对较高的生活费用不无关联。在通常情况下，对“收入变化的预期”及“与过去状态的比较”在城乡居民主观幸福感差异中具有非常重要的解释作用，对于农村居民与全部城镇样本及无失业成员的城镇样本中尤其如此。这可能与这一段时期中相关改革措施的推行是相关的。对生活状态改善状态的评价差异可能是与90年代后期以来在城市推行的相关改革措施相关的。直接影响到城镇居民福利水平的住房、医疗、教育支出预期的增长，由于失业率上升导致的收入及预期收入水平的下降，使得城镇居民对当前生活状态改善状况的悲观评价及对未来收入增长的悲观预期，从而使得城镇居民的主观幸福感低于农村居民，而相关的改革措施可能对农村居民未能造成直接的影响或影响程度相对较轻。

此外，常数项差异也具有较强的解释作用，而这一变量可能在更大程度上度量的是主观幸福感在城乡之间不可解释的差异部分，体现了城乡分割对于主观幸福感决定的影响。

2. 就业分割

在就业分割中，我们以没有失业成员的城镇家庭自我评价为幸福的平均预测概率减去有失业成员的城镇住户的这一平均预测概率为分解对象。从表5的分解结果可以看出，失业状态差异造成的主观幸福感差距则主要地来自于收入效应，绝对收入效应与相对收入效应对这一差异都具有非常强的解释作用。相反，那些在主观幸福感的城乡差异中具有重要解释作用的因素，如预期实现程度、收入变化预期以及与过去状态比较，对于城镇居民就业状态差异而造成的主观幸福感差异的解释作用却是微不足道的。常数项对不同就业状态城镇居民的主观幸福感差异具有非常强的负解释效应，这一项度量的是这两类人群主观幸福感差异中不可解释的部分，体现的是一些未能观测到的因素的影响。

¹³ 城镇中有失业与没有失业成员的家庭的人均实际消费水平分别为4839和6847元，前者比后者要低2000元，农村居民中这一数值为1832；但从主观估计的每月最低生活支出来看，城镇中有失业与没有失业成员的家庭中分别为970和1122元，前者比后者低152元，农村居民中的主观估计月最低生活支出只有461元，不到有失业的城镇住户的一半。

五、农村居民的主观幸福感高于城镇：排序 Logit 分析

表 6 和表 7 分别给出了排序 Logit 模型的估计结果及不同人群概率模型系数总体差异的显著性检验结果。表 6 给出的是排序 Logit 模型的估计系数。根据这些估计系数,我们可以确定解释变量对不同人群主观幸福感的影响形式,包括影响的显著性及影响的方向,但不能据此断定某特定变量对主观幸福感程度的边际贡献。表 7 的结果表明不同人群的主观幸福感决定方式存在显著的结构性差异。

具有显著影响的大多数解释变量在排序 Logit 模型与 Logit 模型中具有相同的系数符号,采用 Logit 与排序 Logit 模型并不改变这些变量对主观幸福感的总体作用形式,因此不再赘述。但关于家庭绝对收入水平的变量有非常大的改变。在 Logit 模型中,除了其平方项在城镇总样本及农村样本中显著以外,家庭人均收入对数及人均收入对数平方对主观幸福感的影响从总体上说都是不显著的。但在排序 Logit 模型中,绝对收入水平对城镇居民的主观幸福感程度有非常显著的影响,无论家庭成员中有无失业都是如此¹⁴。这就意味着,主观幸福感决定中,绝对收入效应仍可能具有显著的作用,即使控制了相对收入的影响。

表 6 不同人群组主观幸福感的影响因素(Ordered Logit 模型)

	全部样本		全部城镇住户		无失业的城镇住户		有失业的城镇住户		农村住户	
	系数	z 值	系数	z 值	系数	z 值	系数	z 值	系数	z 值
家庭经济状况										
家庭人均收入对数	0.138	0.46	3.997	4.33***	2.926	2.64***	5.591	2.61***	-0.475	0.84
人均收入对数平方	0.02	1.08	-0.21	4.02***	-0.151	2.43**	-0.318	2.53**	0.064	1.73*
相对收入	-0.06	0.77	0.878	6.97***	0.797	6.06***	1.447	3.50***	-0.397	4.21***
相对收入平方	0.005	0.38	-0.097	5.15***	-0.089	5.05***	-0.181	2.30**	0.054	3.00***
预期实现程度	0.175	8.50***	-0.045	0.65	0.006	0.09	-0.269	2.03**	0.193	8.82***
预期实现程度平方	-0.013	7.13***	0.001	0.07	-0.007	0.68	0.038	2.62***	-0.014	7.75***
家庭负债	-0.157	5.99***	-0.158	3.15***	-0.18	3.13***	-0.035	0.32	-0.186	4.74***
家庭负债平方	0.012	4.40***	0.011	2.33**	0.014	2.48**	-0.002	0.18	0.017	3.66***

¹⁴ 对于城镇居民中,绝对收入变量在 Probit 模型与排序 Probit 模型中的影响为什么不一样,我们还没有很好的解释。我们的猜测是,在排序概率模型中,被解释变量取值的变动性更强,因此对解释变量的变化可能会更为敏感。

(续表)

	全部样本		全部城镇住户		无失业的城镇住户		有失业的城镇住户		农村住户	
	系数	z 值	系数	z 值	系数	z 值	系数	z 值	系数	z 值
预期收入大幅度增长	0.913	11.82***	1.352	6.54***	1.395	6.33***	0.931	1.65*	0.759	8.86***
预期收入小幅度增长	0.338	8.94***	0.377	6.91***	0.391	6.36***	0.353	2.90***	0.294	5.36***
预期收入下降	-0.574	9.75***	-0.669	9.61***	-0.679	8.53***	-0.657	4.43***	-0.292	2.40**
生活状态比过去改善	0.678	18.99***	0.145	2.43**	0.162	2.49**	0.046	0.29	0.954	21.22***
生活状态比过去恶化	-0.466	8.29***	-0.514	7.91***	-0.445	5.80***	-0.612	4.92***	-0.554	4.43***
回答者特征										
户主	-0.109	2.44**	-0.138	2.41**	-0.14	2.20**	-0.149	1.09	-0.076	0.80
女性	0.097	2.21**	0.128	2.29**	0.127	2.02**	0.127	0.99	0.064	0.68
有配偶	0.267	1.92*	0.35	1.88*	0.334	1.54	0.093	0.23	0.221	1.07
离异	-0.784	3.34***	-0.525	1.86*	-0.582	1.83*	-0.56	0.85	-1.019	2.07**
丧偶	-0.553	3.11***	-0.184	0.76	-0.242	0.87	-0.209	0.36	-0.728	2.79***
大学及以上	0.209	2.37**	0.119	0.88	0.101	0.67	0.29	0.81	-0.201	0.42
大专	0.177	2.42**	0.006	0.05	-0.003	0.02	0.08	0.29	0.412	1.20
中专	0.156	2.22**	0.037	0.30	0.005	0.03	0.232	0.87	0.143	1.09
高中	0.187	3.38***	0.079	0.67	0.112	0.84	0.049	0.20	0.183	2.71***
初中	0.182	4.09***	0.094	0.84	0.051	0.40	0.325	1.39	0.174	3.60***
年龄	-0.038	2.80***	-0.059	2.80***	-0.064	2.75***	-0.017	0.32	-0.028	1.51
年龄平方	0.052	3.66***	0.069	3.17***	0.076	3.21***	0.018	0.33	0.041	2.10**
家庭人口特征										
0—10岁儿童比例	-0.139	1.02	-0.186	0.83	-0.289	1.18	0.115	0.19	-0.107	0.62
65岁以上老人比例	0.206	1.83	0.273	1.65*	0.147	0.82	0.605	1.03	0.18	1.07
身体欠佳成员比例	-1.41	12.21***	-1.469	9.36***	-1.455	8.03***	-1.408	4.19***	-1.433	8.30***
家庭人口总数	-0.027	1.74*	0.11	3.30***	0.125	3.19***	0.096	1.37	-0.047	2.68***
有失业的城镇住户	-0.285	4.59***								
农村住户	0.509	7.18***								
阈值1	-1.645		14.754		9.826		21.449		-4.481	
阈值2	0.500		16.749		11.792		23.545		-2.096	
阈值3	2.484		18.710		13.829		25.324		-0.045	
阈值4	5.119		21.804		16.956		28.256		2.369	
样本数	15379		6736		5432		1304		8643	
拟对数似然值	-17908.256		-7586.716		-5970.920		-1589.448		-10121.918	
Wald chi2(25)	2372.38		1116.39		775.90		276.11		1345.60	

注:本表给出的是各解释变量对主观幸福感的排序 Logit 模型的估计系数,而非边际效应;方括号中为 z 统计量的绝对值;***、**、* 分别表示在 1%、5%及 10%水平下显著。

其他系数特征变化明显的变量包括,在城乡混合及城镇总样本中,“有配偶”能显著地提高主观幸福感程度,而农村样本中“离异”则会导致主观幸福感的显著下降。在农村住户中,“预期收入下降”这一变量在排序 Logit 模型中的影响显著为负,而这一变量在 Logit 模型中则是不显著的;主观幸福感的年龄效应也变得明显,在无失业的城镇住户中,系数符号仍符合 U 型特征;农村居民的主观幸福感程度则随着年龄的增长而提升。

表 7 不同人群组主观幸福感排序 Logit 模型估计系数差异检验

	全部样本	全部城镇	城镇无失业	城镇有失业
全部城镇	362.47 ***	—
城镇无失业	12690.76 ***	15.51	—	...
城镇有失业	65.16 ***	107.88 ***	472.60 ***	—
农村住户	301.75 ***	376.61 ***	205.81 ***	199.60 ***

注:本表给出的是根据各人群组主观幸福感排序 Logit 方程中各解释变量估计系数 Hausman 检验的 χ^2 统计量;***、**、* 分别表示在 1%、5%及 10%水平下显著。

表 8 给出了根据排序 Logit 模型,各因素对主观幸福感程度的城乡差异进行分解的结果。这里是对农村居民主观幸福感程度的预测均值减去城镇居民主观幸福感程度预测均值的差额为分解对象。

表 8 各因素对城乡居民主观幸福感差异的解释效应(基于排序 Logit)

	城乡分割						就业分割	
	农村—全部城镇 数量 百分比	农村—全部城镇 数量 百分比	农村—城镇无失业 数量 百分比	农村—城镇无失业 数量 百分比	农村—城镇有失业 数量 百分比	农村—城镇有失业 数量 百分比	无失业—有失业 数量 百分比	无失业—有失业 数量 百分比
预测均值总差异	0.184	100.00	0.120	100.00	0.448	100.00	0.328	100
	以农村系数、 城镇变量为参照						以有失业系数、 无失业变量为参照	
变量总差异	-0.097	-52.72	-0.134	-111.67	0.057	12.72	0.231	70.43
系数总差异	0.281	152.72	0.254	211.67	0.391	87.28	0.097	29.57
绝对收入	-0.012	-6.63	-0.062	-51.74	0.170	38.03	0.097	29.72
相对收入	0.021	11.27	0.032	26.69	-0.010	-2.13	0.163	49.81
预期实现程度	0.008	4.11	0.005	4.50	0.013	2.97	-0.012	-3.77
家庭债务	-0.024	-13.07	-0.026	-21.29	-0.019	-4.28	0.004	1.21
收入变化预期	0.066	36.10	0.064	53.29	0.080	17.84	0.024	7.36
与过去状态的比较	0.186	100.97	0.173	144.34	0.245	54.79	0.040	12.29
其他变量	-0.060	-32.75	-0.067	-55.80	-0.032	-7.24	0.011	3.39
	以城镇系数、 农村变量为参照						以无失业系数、 有失业变量为参照	
变量总差异	-0.117	-63.59	-0.122	-101.67	0.214	47.77	0.199	60.67
系数总差异	0.301	163.59	0.242	201.67	0.234	52.23	0.129	39.33

(续表)

	城乡分割						就业分割	
	农村—全部	城镇	农村—城镇	无失业	农村—城镇	有失业	无失业—有失业	
	数量	百分比	数量	百分比	数量	百分比	数量	百分比
绝对收入	0.021	11.18	0.009	7.63	0.052	11.59	0.169	51.56
相对收入	0.010	5.40	-0.005	-4.18	0.119	26.56	0.087	26.63
预期实现程度	-0.023	-12.37	-0.040	-33.41	0.060	13.34	-0.005	-1.39
家庭债务	-0.021	-11.45	-0.025	-20.55	-0.001	-0.30	0.008	2.34
收入变化预期	0.120	65.19	0.114	94.69	0.116	25.84	0.025	7.56
与过去状态的比较	0.051	27.48	0.040	33.16	0.072	16.00	0.030	9.20
其他变量	0.027	14.58	0.027	22.67	0.031	6.98	0.013	4.10

尽管排序 Logit 模型中，绝对收入的影响是显著的，但如果以农村系数、城镇变量均值为参照，不难发现绝对收入对主观幸福感城乡差异的解释程度总体上仍是比较低的；在以城镇系数、农村变量为参照的分解中，绝对收入对城乡主观幸福感差距具有正的解释效应，这种正的解释效应来源于这一变量的系数效应，因此绝对收入对主观幸福感的影响程度取决于对不同人群组对绝对收入的评价的差异性。与 Logit 分解结果相同的是，收入变化预期及“与过去状态比较”对于城乡居民主观幸福感程度差异仍具有非常强的解释作用。

从城镇内部的就业分割特征来看，绝对收入效应与相对收入效应仍是造成城镇居民不同就业状态之间主观幸福感差异的主要原因。从表 8 中，我们还发现，“收入变化预期”及“与过去状态的比较”对于不同就业特征人群之间的主观幸福感差异也具有一定的解释作用，显然，失业人群对未来有更为悲观的预期，生活状态也更加趋向于恶化而非改善。

六、总 结

城乡分割以及城镇失业是我国当前比较突出的两大社会问题。本文在住户调查数据的基础上，讨论了城乡分割与就业状态差异对不同人群主观幸福感差异的影响，并进一步分解分析了不同人群之间主观幸福感差异的形成原因。

从主观幸福感的决定因素来看，收入、对收入变化的预期以及生活改善状况对不同人群的主观幸福感程度都具有重要的影响。预期实现程度对于农村居民的主观幸福感具有重要的作用，这一变量也是导致主观幸福感的城乡差异的重要原因。对农村居民的主观幸福感程度高于城镇居民这一现象具有解释作用的其他变量包括，对收入变化的预期和对当前生活状态相对于过去的变化特征的评价。

总体上说,农村居民具有较高的主观幸福感程度在较大程度上是与较低的预期或欲望相联系的。而这一特征又可能在很大程度上与城乡被严重分割成两个不同的社会系统相关。城乡之间的藩篱最终将被打破,这是进一步市场化改革的基本要求和必然结果。在这种情况下,农村居民的主观幸福感将会发生怎样的变化?可能是不能令人乐观的。如果我们将农村中有无外出打工成员住户的主观幸福感进行比较,则会发现有外出打工成员住户的主观幸福感程度远远低于没有外出打工成员的家庭¹⁵。因此,当前农村居民主观幸福感程度高于城镇居民这一现象是农村仍具有严重的封闭性的结果,在逐步打破城乡分割的市场化改革过程中可能不具有稳定性。

本文的另一组对比分析对象是城镇居民中的就业人群与失业人群。与城乡分割的主观幸福感差异的解释因素不同的是,城镇居民中不同就业状态人群的主观幸福感差异主要是由收入效应所引起的。这是否意味着失业的非货币性的心理损失不重要?可能有待于进一步的研究。但既然收入效应是导致城镇失业人群主观幸福感较低的重要原因,那么不难预期,针对失业人群的收入补偿等社会保障措施应当能够收到良好的效应。

参考文献

- [1] Alesina, A., R Di Tella. and R MacCulloch, "Inequality and Happiness: Are Europeans and Americans different?" *Journal of Public Economics*, 2004, 88 (9—10), 2009—2042.
- [2] Clark, A. E. and A. J. Oswald, "Unhappiness and Unemployment", *Economic Journal*, 1994, 104 (424), 648—659.
- [3] Clark, A. E. and A. J. Oswald, "Satisfaction and Comparison Income", *Journal of Public Economics*, 1996, 61(3), 359—381.
- [4] D'Ambrosio, C. and J. R. Frick, "Subjective Well-Being and Relative Deprivation: An Empirical Link", IZA DP No. 1351, 2004.
- [5] Doiron, D. and W. C. Riddell, "The Impact of Unionization on Male-Female Earnings Differences in Canada", *Journal of Human Resources*, 1994, 29(2), 504—534.
- [6] Easterlin, R. A., "Income and Happiness: Towards a Unified Theory", *Economic Journal*, 2001, 111 (473), 465—484.
- [7] Even, W. E. and D. A. Macpherson, "The Decline of Private-Sector Unionism and the Gender Wage Gap", *Journal of Human Resources*, 1993, 28 (2), 279—296.
- [8] Ferrer-i-Carbonell, A., "Income and Well-being: An Empirical Analysis of the Comparison Income Effects", Tinbergen Institute Discussion Paper TI 2002-019/3, 2002.
- [9] Ferrer-i-Carbonell, A., and P. Frijters, "How Important Is Methodology for the Estimates of the Determinants of Happiness", *Economic Journal*, 2004, 114 (497), 641—659.

¹⁵ 我们在另一项关于农村外出打工与主观幸福感关系的研究中发现,有外出打工成员家庭认为幸福的比例比没有外出打工成员的家庭要低 15 个百分点。

- [10] Frey, B., and A. Stutzer, "What Can Economist Learn from Happiness Research?", *Journal of Economic Literature*, 2002, XL (2), 402—435.
- [11] Frijters, P. M. Shields, and J. Haisken-DeNew, "Money Does Matter! Evidence from Increasing Real Incomes in East Germany Following Reunification", *American Economic Review*, 2004, 94(3), 730—741.
- [12] Gerlach, K., and G. Stephan, "A Paper on Unhappiness and Unemployment in Germany", *Economics Letter*, 1996, 52(3), 325—330.
- [13] Graham, C., and S. Pettinato, "Happiness, Markets, and Democracy: Latin America in Comparative Perspective", *Journal of Happiness Studies*, 2001, 2(3), 237—268.
- [14] Graham, C., and S. Pettinato, "Frustrated Achievers: Winners, Losers and Subjective Well-Being in New Market Economies", *Journal of Development Studies*, 2002, 38 (4), 100—140.
- [15] 国家统计局,《中国统计摘要 2005》。北京:中国统计出版社,2005年。
- [16] Knight, J. and L. Song, "Subjective Well-being and its Determinants in Rural China", Conference Discussion paper in "Income Inequality and Public Policy in China", 2004.
- [17] Korpi T., "Is Utility Related to Employment Status? Employment, Unemployment, Labor Market Policies and Subjective Well-Being among Swedish Youth", *Labour Economics*, 1997, 4 (2), 125—147.
- [18] 罗楚亮,“预期、相对收入与城乡主观幸福感差异”,《中国社会科学评论》,2006年,即将发表。
- [19] McBride, M., "Relative Income Effects on Subjective Well-Being in the Cross-Section", *Journal of Economic Behavior and Organization*, 2001, 45 (3), 251—278.
- [20] Murphy G., and J. Athanason, "The Effect of Unemployment on Mental Health", *Journal of Occupational and Organizational Psychology*, 1999, 72 (1), 83—99.
- [21] Oswald, A. J., "Happiness and Economic Performance", *Economic Journal*, 1997, 107(445), 1815—1831.
- [22] Ravallion, M. and M. Lokshin, "Identifying welfare Effects from Subjective Questions", *Economica*, 2001, 68(271), 335—357.
- [23] Winkelmann, L. and R. Winkelmann, "Why Are the Unemployed So Unhappy? Evidence from Panel Data", *Economica*, 1998, 65(257), 1—15.
- [24] Woodridge, J., *Econometric Analysis of Cross Section and Panel Data*. The MIT Press, 2002.
- [25] 邢占军,《测量幸福——主观幸福感测量研究》。北京:人民出版社,2005年。
- [26] 曾慧超、袁岳,“2004年中国居民生活质量报告”,载汝信等主编《2005年:中国社会形势分析与预测》。北京:社会科学文献出版社,2005年。

Urban-Rural Divide, Employment, and Subjective Well-Being

CHULIANG LUO

(Chinese Academy of Social Sciences)

Abstract Using decomposition analysis based on several probability models, this paper

conducts a comparative analysis on the subjective well-being of rural and urban residents, and employed and unemployed persons in urban China. The findings show that rural residents have higher subjective well-being than their urban counterparts and the differences mainly come from their differences in their aspiration for a better life, expectation of income growth in the coming years, and evaluation of improvements of their living standards in the past recent years. Unemployment reduces the subjective well-being of urban residents and the income effect is the main cause for the result.

JEL Classification I31, D31, C25