

绪 论

一、研究背景

根据海峡两岸关系协会（简称“海协会”）与台湾海峡交流基金会（简称“海基会”）台北会谈达成的协议，两岸海运直航、空运直航、直接通邮于 2008 年 12 月 15 日全面启动，宣告两岸“三通”时代来临。经过 30 年的努力，海峡两岸双向的直接通航、通邮和通商终于基本实现，这是两岸关系发展史上具有里程碑意义的大事。同时，经过两岸高层的共同努力，2010 年 8 月 17 日，台湾方面通过《海峡两岸经济合作框架协议》（ECFA），在经济全球化和区域经济一体化的趋势下，潜力巨大、经济繁荣、政局稳定的祖国大陆市场一直是台商投资的首选地，因此 ECFA 的签署标志着两岸经济共同繁荣与发展的合作机制的建立，这对于促进两岸贸易与投资往来，进一步创造公平与宽松的贸易环境，以及两岸共同防范国际经济危机的冲击，有着重要意义。

所以，这一切都将进一步推动大陆与台湾经贸合作层次，加快海峡两岸经济一体化的步伐。再者，两岸经济交往的深入发展也必将会对两岸经济增长方式、经济波动的形态等产生重要影响。故在此背景之下，研究两岸经济周期的同步性及如何防范对方经济波动的冲击，对于促进两岸宏观经济的稳定发展具有重要意义。

二、研究意义

（一）理论意义

1. 为统筹协调区域经济发展提供基础理论支撑

在我国，区域经济学是一门年轻的、正在蓬勃发展的朝阳学科，而两岸的发展问题将是较长时期内我国区域经济学研究的重大主题之一。大陆与台湾研究的目的之一是使两岸经济协调发展，这也是区域经济学研究的目的之所在。因此，我国的区域经济学研究必将随着两岸宏观经济的稳定和协调发展而走向辉煌。自从改革开放以来，随着世界经济一体化进程的加快，以及 20 世纪八九十年代我国经济体制改革的不断深化，两岸经济发展的不确定、不规则和突发性因素增多，经济运行越来越复杂。同时，随

着人们生活质量的不断提高，对经济运行的稳定性提出了越来越高的要求，这一切都离不开对经济周期的研究。因此，研究我国两岸的经济周期对于完善区域经济学和宏观经济学理论，促进区域经济学理论和宏观经济学理论的交叉研究意义重大。

2. 为区域性反周期调控提供现实依据

针对一个国家的经济周期研究的文献较多，但针对一个区域的经济周期研究的文献较少，尤其是关于大陆和台湾的经济周期研究更是屈指可数。随着中国改革开放的深入，由于大陆与台湾在制度、市场化程度、产业结构等方面的差异越来越大，各自的特殊性越来越明显，它们之间的经济波动的同步性越来越复杂。一般化的反周期调控政策由于没能充分考虑大陆与台湾的特殊性，因而越来越不适应区域经济的发展。加强两岸经济周期的研究，有助于区域性反周期调控体系的建立并为其提供现实依据。

3. 为协调地区发展提供理论指导

从区域层次来分析总结各地区经济周期波动的规律和特点，同时揭示各地区经济周期波动的特征，对于研究各地区经济运行规律、揭示各地区

经济发展差距的原因具有重要的参考意义。同时，有利于因地制宜地实行有针对性的区域经济政策，促进各地区经济快速发展。此外，揭示各地区经济周期波动的特征，还可以促进区际贸易、加大各地区的交流和合作、打破地区分割、促进各地区的协调发展。

（二）实际意义

第一，从区域层次来分析总结大陆与台湾经济周期波动的规律和特点，对于揭示两岸经济运行规律具有重要的参考意义，同时还可以促进区际贸易、促进两岸的交流和合作、促进两岸的协调发展。

第二，本研究可应用到政府部门，可加深政府部门对两岸经济交往的认识，大力促进大陆与台湾之间的贸易往来，积极推动海峡两岸经济一体化。

第三，本研究还可应用到商家，有利于商家判断和预测台湾经济形势，在对台经济交往中减少盲目性。

第四，本项目可为全国乃至各地区的经济周期的同步性分析提供一种实用的定性和定量分析工具，有利于提高宏观经济政策的针对性，促进各地区经济的协调发展。

三、研究内容

该研究共分为以下五个部分：

第一个部分是两岸经济周期同步性实证研究。首先，通过收集大陆与台湾 1990 年以来的年度数据，分析了中国与中国台湾地区 GDP 同步的特征和趋势，得知两者经济周期的同步性呈现出不断增强的走势，波动频率高度一致。其次，通过对大陆与台湾 2000 年以来的季度数据的分析，以美国为参照，对两岸双向的直接通邮、通航和通商前后中国与中国台湾地区经济周期的同步性进行了偏相关分析，得知在海峡两岸双向的直接通邮、通航和通商前后，中国与中国台湾地区经济周期的同步性发生了结构突变。再次，对海西与台湾经济周期的同步性进行了实证分析，得知 1990 年以来海西与台湾不仅在长期内存在共同趋势，在短期内两地区的产出也存在共同周期。

第二个部分以大陆与台湾以及海西与台湾为例，从锁模的角度对两岸经济周期同步的传导机制进行了实证分析。首先对两岸经济交往的背景作了回顾，然后以两岸贸易和投资增长率为例检验了两岸经济周期的传导渠道，并通过对两岸 GDP 总值的回归分析得知，大陆与台湾、海西与台湾的

经济联系都存在显著的非线性关系，因此两岸共同周期的生成及传导可以用锁模这种内部机制来解释。

第三个部分在前面锁模的基础上，运用二阶段最小二乘法建立了连接两岸的宏观经济模型。在该模型的基础上，首先对照两岸的经济实际对模型进行了分析和检验，并对照中国与台湾地区宏观经济政策的实施方式进行了情景模拟。

第四个部分以两岸的年度数据为基础，对 2015—2020 年的两岸经济周期同步性进行了预测，发现两岸经济增长的相关系数基本上保持在 0.82~0.83，所以今后几年两岸经济周期的同步性仍然属于高度同步。

第五个部分分别从推进两岸服务贸易、增强祖国大陆对台湾进出口的主动性及推动两岸宏观经济政策协调机制的建立等方面提出了相应的对策和建议。

四、研究方法

(1) 定量分析与定性分析相结合的方法。如运用锁模来对大陆与台湾经济周期同步性的原因进行分析时，采用的都是定量分析法；又如分析和

解释锁模的原理时，采用定性分析方法。

(2) 动态模拟分析方法。我们将模拟正弦函数和物理学中的锁模原理来对大陆与台湾经济周期的同步性进行动态分析。

(3) 历史分析方法。在对大陆与台湾经济周期波动的历次同步和传导进行回顾时将采用历史分析方法。

第一章 区域经济周期研究综述

国内外对国际区域经济波动问题的研究历史较长，到目前为止已经形成了相对成熟的理论，但对一国国内区域经济周期波动的研究文献相对较少。对一国国内区域经济周期的研究是一个特殊的领域，它既不同于国际经济周期又不同于国家经济周期。本书将主要综述区域经济周期波动的研究文献，看能否为中国的区域经济周期波动研究提供借鉴。

研究区域经济波动的文献基本上运用三种研究方法：一是研究区域经济周期的特征；二是研究区域经济周期与区域经济周期、国家经济周期和国际经济周期的同步性；三是研究各个区域经济对国家经济周期的不同反应。下面我们分别进行讨论。

一、区域经济周期特征研究

随着各区域渐渐成为相对独立的经济实体，其经济周期波动的特征也越来越不同，因此已经有越来越多的学者开始研究各区域的经济周期

特征。

Michael A. Kouparitsas 和 Daisuke J. Nakajima (2006) 分析了美国第七联邦储备区五个州的经济波动特征，认为这五个州的波动特征相差较大，伊利诺伊州和威斯康新州波动较平缓，密歇根州、艾奥瓦州和印第安纳州波动较剧烈，并认为产业结构的差异是导致它们波动特征差异的主要原因。

陈维云、夏绍模 (2005) 采用 ARCH 模型研究了重庆市中观经济波动特征，并与全国宏观经济波动特征进行了比较。与全国情况相同的是，重庆市中观经济波动是对称的，具有较高持续性。与全国情况不同的是，重庆市中观经济波动具备自我稳定机制，外部冲击会加剧重庆经济系统的波动。

钱宁 (2001) 对改革开放以来的江苏经济周期波动及特征进行了分析，认为江苏经济波动进入了一个新的阶段，由过去的古典波动转入现在的增长波动，稳定性大大增强。作者认为江苏经济波动在扩张阶段跳跃很大，而在收缩阶段呈长时期的平衡下滑，并从消费、投资和产业结构等方面对

江苏经济波动变化的原因进行了分析。

陈乐一(2006)承担并主持了关于“湖南经济周期波动”的系列课题。近年来,课题组对湖南经济波动从理论到实践进行了专门的研究,发现改革开放前后湖南经济波动特征悬殊:改革开放前湖南经济“大起大落”,改革开放后由于政府管制力量和市场力量的变化,湖南经济增长的稳定性大幅度提高。

二、区域与国家、区域与国际经济周期同步性研究

经济周期的同步性研究主要是从两方面展开的,一方面是论述不同层次的区域之间的经济周期是否同步,如区域与区域之间、区域与国家之间、区域与国际之间的经济周期的同步性研究;另一方面是论述它们各自之间经济周期同步与否的原因或机制。

1. 区域与国家经济周期同步性研究

比较区域与区域之间以及区域与全国之间经济周期是否同步,是区域经济周期研究涉及最多的领域。Owyang ,Piger ,Howard(2004)以 Stock 和 Watson (1989)的方法为基础,使用 Crone (2002)建立的美国 50 个州的