

未来收入预期与进城农民工生活满意度

——对上海等 12 个城市调查数据的实证研究

高文书¹, Russell Smyth²

(1 中国社会科学院 人口与劳动经济研究所, 北京 100732

2 澳大利亚莫纳什大学 经济系, 澳大利亚墨尔本 3800)

摘要: 进城农民工是推动中国经济高速增长的重要引擎, 即便在生活和工作条件很艰苦的条件下, 进城农民工为何还继续留在城市? 利用 2005 年全国 12 个城市的大样本调查数据, 通过研究进城农民工生活满意度的决定因素发现, 对未来收入的预期是进城农民工生活满意度的一个重要决定因素。研究发现, 很多进城农民工对未来的收入甚至生活状况都有良好的乐观预期, 这对他们当前的生活满意度和幸福感产生了积极影响。这一发现对于中国的经济增长以及社会经济的稳定具有重要含义, 因为保持社会经济的稳定对于保持中国高速的经济增长非常重要, 而对未来收入的积极预期对于在经济转型时期保持社会经济稳定具有重要意义。

关键词: 收入预期, 生活满意度, 进城农民工

中图分类号: F014.4 **文献标志码:** A **文章编号:** 1674-4543(2010)06-0021-13

一、导言

在过去的 30 年中, 中国是世界上经济增长最快的国家之一。这一高速增长, 相当一部分是由农村劳动力向城市的转移所推动的。目前, 中国进城农民工的数量已达 1.5 亿, 进城农民工在城市的工作和生活比较艰苦。研究表明, 进城农民工受到明显的职业和工资歧视 (如 Knight & Yueh, 2009; Liu, 2005)。^[1-2] 调查显示, 有近 60% 的农民工每周要工作 7 天 (ILO, 2007)。^[3] 一项对上海市的研究表明, 进城农民工平均每周工作 55.5 小时, 其中 40% 的人每周工作 40~60 小时, 25% 的人每周工作 70 小时, 7% 的人每周工作超过 70 小时 (Feng et al., 2002)。^[4] 对中国 2005 年 1% 人口抽样调查数据的分析发现, 进城农民工参加社会养老、医疗和失业保险的比例非常低, 分别只有 4.87%、5.20% 和 4.76%。Jacka (2005)^[5] 和 Li (2006)^[6] 的研究显示, 进城农民工很少有时间进行休闲娱乐活动。进一步的实证研究表明, 进城农民工的生活满意度水平比农村居民和城市本地居民都要低 (Knight & Gunatilaka, 2008, 2010)。^[7-8] 这就提出了一个问题: 既然进城农民工在城市工作和生活比较艰苦, 生活满意度甚至低于农村居民, 那他们为什么还要继续留在城市? 为什么还会有大量农村劳动力继续向城市迁移? 这是因为农民工对未来生活前景有良好预期。经济学家在传统上并不认为预期会对效用有任何直接影响。然而, 最近经济学家们开始认为预期会对个人福利产生明显影响 (Senk,

收稿日期: 2010-09-01

作者简介: 高文书 (1974-), 男, 安徽颍上人, 中国社会科学院人口与劳动经济研究所副研究员, 经济学博士, 研究方向为就业与社会保障; Russell Smyth (1969-), 男, 澳大利亚墨尔本人, 澳大利亚莫纳什大学 (Monash University) 经济系教授, 经济学博士, 研究方向为劳动经济、中国经济。

2008)。^[9]利用 2005 年中国 12 个城市劳动力调查 (CULS) 所获得的数据, 发现对未来收入增长的预期是中国农村劳动力向城市迁移的重要解释变量。换句话说, 对未来的乐观预期使得中国劳动力不断从农村向城市迁移。这一发现对于中国保持劳动力的稳定供给和经济社会的稳定发展, 具有重要的政策含义。

二、文献综述

在经济学中, 有关生活满意度或幸福感决定因素的研究文献数量众多 (Frey & Stutzer, 2002; Clark et al., 2008; Dolan et al., 2008)。^[10-12]其中, 也有不少文献是关于中国居民生活满意度决定因素的研究。这些研究中的一部分, 重点是针对某一特定人群的生活满意度决定因素的研究。例如, 中国青少年或老年人幸福满意度的决定 (Brown & Tierney, 2009; Chen, 2003; Edwards et al., 2005);^[13-15]另一部分研究, 则关注中国农村居民生活满意度的决定 (如 Knight et al., 2009; Knight & Gunatilaka, 2009a, 2009b)^[16-18] 或中国城市居民的生活满意度决定 (Appleton & Song, 2008; Cheung & Leung, 2004; Smyth & Qian, 2008; Smyth et al., 2008; Smyth et al., 2010)。^[19-23]

有关中国进城农民工生活满意度决定的研究文献还比较有限。Knight & Gunatilaka (2008, 2010)^[7-8] 利用 2002 年中国收入项目调查 (CIPS) 数据, 设法解释为什么进城农民工的生活满意度会低于农村居民和城市本地居民。他们的解释是, 农民工在城市的雄心与抱负增长了, 但他们的实际工作生活状况远未达到他们的预期。Nielsen et al. (2010b)^[24] 使用个人福利指数 (PWI) 来研究福建省进城农民工的幸福感。PWI 是一个关于主观幸福感的多项目指标, 它用于测量被访者在 7 个方面的生活满意度: 生活标准、个人健康、人生成就、人际关系、人身安全、社区联系和未来安全。尽管中国进城农民工生活比较艰难, 但是 Nielsen 等人发现他们的 PWI 处于公认的标准范围之内。他们提出, 一个可能的解释在于中国进城农民工在城乡之间往返流动。当农民工在城里难以生活时, 大多数人可以回到农村的老家去。这种城乡往返流动提供了一个缓冲, 否则进城农民工的生活满意度将会大受影响。

有很多文献检验了预期在预测宏观经济结果如经济增长和通货膨胀中的作用 (Lorenzoni, 2009)。^[25]然而, 现有文献很少去检验经济预期对生活满意度或幸福感的影响。一个例外是, Senik (2008)^[9] 使用俄罗斯长期跟踪监测调查数据检验了 1994~2004 年间人们未来收入预期与生活满意度之间的关系, 发现预期对幸福感有很强的积极影响。

三、数据描述

文中所使用的数据来自 2005 年 5 月进行的中国城镇劳动力市场调查。这项调查由中国科学院人口与劳动经济研究所和有关城市的统计部门共同完成。调查在 5 个省会城市 (上海、武汉、沈阳、福州和西安) 和 7 个地级城市 (无锡、宜昌、本溪、珠海、深圳、宝鸡和大庆) 进行。使用的抽样方法是规模成比例的概率抽样 (PPS), 在 5 个省会城市各调查 500 户进城农民工家庭和 500 户城市本地居民家庭, 在 7 个地级城市各调查 400 户进城农民工家庭。在每个家庭, 16 岁及以上并从事有收入工作的所有家庭成员都要填写问卷。这样, 共获得 6200 名左右进城农民工的有效信息, 其中男性所占比例高于一半。

上述调查采用四刻度量表来衡量一个人的生活满意程度, 即 1 表示“一点也不满意”, 2 表示“不满意”, 3 表示“满意”, 4 表示“非常满意”。表 1 显示了全部样本中, 每个生活满意度类别被访者所占的比例。总体而言, 接近 2/3 (63%) 的进城农民工表示他们对生活“满意”或“非常满意”。全部样本

的平均生活满意度水平是 2.64 分, 这个水平略高于 2002 年 CIPS 调查 (Knigh t& Gunatilaka 2008)^[7] 所公布的进城农民工 2.37 分的平均生活满意度得分。表 1 同时也列出了按收入分类的被访者的生活满意度水平。生活满意程度和个人收入似乎是正相关关系。在低收入者中 (0~ 600 元 / 月), 约 55% 的被访者认为他们对生活“满意”, 2.43% 的认为“非常满意”; 在中低收入者中 (601~ 1000 元 / 月), 约 60% 的被访者认为他们对生活“满意”, 约 4% 的认为“非常满意”; 在高收入者中 (1000 元以上 / 月), 约 65% 的被访者认为他们对生活“满意”, 约 5% 的人认为“非常满意”。

表 1 进城农民工生活满意度情况

描述性指标	总体	按月工资分组 (元 / 月)		
		0~ 600	601~ 1000	1000 以上
非常满意 (%)	3.81	2.43	3.92	4.81
满意 (%)	59.02	55.12	59.87	65.24
不满意 (%)	34.57	38.92	33.91	28.52
非常不满意 (%)	2.60	3.52	2.30	1.42
平均生活满意度水平	2.64	2.56	2.65	2.73
生活满意度的标准差	0.60	0.60	0.59	0.57
样本数量 (个)	6223	1957	1941	1484

表 2 是全部样本的描述性统计。整体而言, 51.44% 的进城农民工是男性, 88.5% 的人已婚, 87.4% 的人身体状况良好, 64.5% 的人有一个或一个以上孩子在城里上学, 约 5% 的人参加了社会保险或医疗保险, 2% 的人是中共党员。这些被访者在城市的平均居住年限是 7.2 年, 这与 2002 年 CIPS 调查所公布的城市平均居住年限 7.5 年相近。被访者平均每周工作约 69 小时, 月工资是 1033 元。被访者还被问及他们对未来 5 年收入变化的预期。总体而言, 18.4% 的人预期未来 5 年收入有一个大幅增加, 67.4% 的人预期未来 5 年收入有一个小幅增加, 10.9% 的人预期未来 5 年收入没有变化, 3.3% 的人预期未来 5 年收入会下降。中国进城农民工似乎比其他国家的劳动者有更乐观的收入增长预期。例如, Das & Soest (1999)^[26] 发现, 对于荷兰人而言, 大约有 11% 的被访者认为在经济衰退时期收入会在未来 12 个月有所增长, 在经济繁荣时期这个数字上升到约 33%。

表 2 样本的描述性统计

描述性指标	平均值或比例
月工资 (元 / 月)	1033.55
受教育年限 (年)	8.22
工作经验 (年)	19.88
在城市的居住年限 (年)	7.20
男性 (%)	51.44
已婚 (%)	88.50
中共党员 (%)	2.04
工作时间 (小时 / 周)	69.22

(下转第 24 页)

(上接第 23 页)

描述性指标	平均值或比例
工作满意程度 (非常不满意 = 1 不满意 = 2 满意 = 3 非常满意 = 4)	2.65
人均居住面积 (平方米)	13.72
本市老乡数量 (人)	12.98
本市亲戚数量 (人)	2.98
身体健康状况良好 (%)	87.38
预期未来 5 年收入有大幅增加 (%)	18.39
预期未来 5 年收入有小幅增加 (%)	67.40
预期未来 5 年收入没有变化 (%)	10.88
预期未来 5 年收入下降 (%)	3.33
参加基本医疗保险 (%)	5.23
参加社会养老社会保险 (%)	5.45
至少有一个孩子在本市上学 (%)	64.53
流出地省份的农民人均纯收入 (元 / 月)	295.27
当前所在城市居民人均可支配收入 (元 / 月)	1758.23
职业分布 (%)	
专业及技术人员	6.61
生产运输及相关工作	2.86
商业服务人员	72.79
设备操作人员及相关工作者	17.74
单位类型分布 (%)	
政府 / 事业单位	3.33
国有 / 集体企业	5.25
私营企业	13.70
外商投资企业	2.05
个体工商户或自我雇用	73.13
其他	2.53
行业分布 (%)	
制造业	8.21
建筑业	5.50
交通运输 / 通信业	3.20
批发 / 零售 / 餐饮业	44.70
社会服务业	24.20
政府 / 社会团体	0.49
其他	13.71

四、实证分析

将进城农民工的生活满意度视为他们对未来收入的预期、个人特征和人力资本等函数。因此,以进城农民工生活满意度为因变量,以他们对未来收入的预期、个人特征和人力资本等为自变量,进行回归分析。

为了测量生活满意度程度,让被访者回答“你对目前的生活满意吗?”回答 1 表示满意度最低即“一点也不满意”,4 则表示满意度最高即“非常满意”。为了衡量对未来收入的预期,对被访者关于“你认为你五年后的经济状况与现在相比会如何?”问题作了提问,回答结果是从 1 (“预期未来 5 年收入下降”)到 4 (“预期未来 5 年收入有大幅增加”)。被访者的个人特征变量包括:性别、婚姻状况、在城市的居住年限、是否是中共党员、所在城市、在城市的亲戚数量、在城市的老乡数量、至少有一个孩子在城里上学以及健康状况变量。被访者的人力资本特征变量包括受教育年限和工作年限。其他变量还包括被访者本人的收入、参照群体的收入(流出地省份农民人均纯收入、目前所在城市居民人均可支配收入)、周工作时间、工作满意度、人均住房面积、是否参加了社会养老和医疗保险、被访者的职业、单位类型、行业以及所在城市。

在一篇有关方法论的论文中, Ferrer- i- Carbonnel & Fritjers (2004)^[27]研究了把满意度或幸福水平视为基数(正如心理学家通常做的)或序数(正如经济学家通常做的)时,是否会对实证研究结果产生影响的问题。他们的结论是,将满意度视为基数或序数对于研究结果没有大的影响,亦即选择普通最小二乘法(OLS)估计或者极大似然估计得到的结论基本相同。在下文中,汇总了有序 Probit 模型和 OLS 回归的估计结果。结果表明,OLS 估计和有序 Probit 模型估计的结果非常相似。由于 OLS 结果更直观、更容易理解,这里着重讨论 OLS 的估计结果。

Ferrer- i- Carbonnel & Fritjers (2004)^[27]同时发现,在满意度或幸福度决定的研究中,如果用于实证分析的数据集中,缺乏被访者的个性变量,则会对研究结果产生影响。通常,这会低估收入、健康和婚姻状况等的正效应,因为具有有助于幸福的个性往往与获得更高的收入,更好的健康或者结婚正相关。由于使用的是横截面数据,因此就意味着应该控制被访者的个性变量。但是,在本文的研究中没能控制个性变量。这并非因为控制个性变量不重要,而是数据中没有任何对个性进行测度的有效变量。经济学家通常通过人们对社会问题的看法(Smyth et al., 2008)^[22]、情绪(Knight et al., 2009)^[16]或精神健康指标(Ferrer- i- Carbonnel & Gowdy, 2007)^[28]来控制被访者的个性特征。然而,并没有哪一个变量准确描述了个性特征。在我们看来,利用诸如此类的代理变量来控制个性并不比不控制个性增加什么价值。如果要充分控制个性问题并认真考虑 Ferrer- i- Carbonnel & Fritjers (2004)^[27]所指出的问题,则需要在调查中引入对个性进行心理测量的相关问题,但我们现有的数据做不到这一点。

利用 CULS 调查数据对前述模型进行回归分析。表 3 显示的是有序 Probit 模型的回归结果,表 4 则显示的是 OLS 回归结果。在这两个表中,模型 1 都是不控制参照群体收入的情况。在模型 2 中,把农民工流出地省份农村居民人均纯收入作为参照群体的收入。在模型 3 中,把农民工目前所居住城市的城镇居民人均可支配收入作为参照群体的收入,在模型 4 中同时引入上述两个参照群体的收入。有序 Probit 模型的结果和 OLS 回归的结果从各系数的符号和统计显著性上看是相同的。因此,主要解释 OLS 回归结果,因为这些结果更直观,并相对容易理解。

表 3 进城农民工的生活满意度决定 (有序 Probit 模型)

描述性指标	模型 1	模型 2	模型 3	模型 4
月工资自然对数	0.1529 ^{**} (0.0573)	0.1568 ^{**} (0.0576)	0.1529 ^{**} (0.0573)	0.1568 ^{**} (0.0576)
受教育年限 (年)	-0.0085 (0.0137)	-0.0088 (0.0137)	-0.0085 (0.0137)	-0.0088 (0.0137)
工作经验 (年)	-0.0037 (0.0060)	-0.0038 (0.0060)	-0.0037 (0.0060)	-0.0038 (0.0060)
在城市的居住年限 (年)	0.0479 ^{**} (0.0184)	0.0470 ^{**} (0.0184)	0.0479 ^{**} (0.0184)	0.0470 ^{**} (0.0184)
在城市居住年限的平方	-0.0020 [*] (0.0009)	-0.0019 [*] (0.0009)	-0.0020 [*] (0.0009)	-0.0019 [*] (0.0009)
男性	-0.0428 (0.0633)	-0.0442 (0.0634)	-0.0428 (0.0633)	-0.0442 (0.0634)
已婚	0.6098 (0.8947)	0.6088 (0.8957)	0.6098 (0.8947)	0.6088 (0.8957)
中共党员	0.3837 (0.2776)	0.3829 (0.2775)	0.3837 (0.2776)	0.3829 (0.2775)
工作时间 (时/周)	-0.0002 (0.0016)	-0.0002 (0.0016)	-0.0002 (0.0016)	-0.0002 (0.0016)
工作满意程度 (1~4)	1.6048 ^{**} (0.0604)	1.6072 ^{**} (0.0605)	1.6048 ^{**} (0.0604)	1.6072 ^{**} (0.0605)
人均居住面积 (平方米)	0.0038 (0.0028)	0.0038 (0.0028)	0.0038 (0.0028)	0.0038 (0.0028)
本市老乡数量 (人)	-0.0015 (0.0010)	-0.0015 (0.0010)	-0.0015 (0.0010)	-0.0015 (0.0010)
本市亲戚数量 (人)	0.0134 [*] (0.0060)	0.0134 [*] (0.0060)	0.0134 [*] (0.0060)	0.0134 [*] (0.0060)
身体健康状况良好	0.2583 ^{**} (0.0924)	0.2592 ^{**} (0.0925)	0.2583 ^{**} (0.0924)	0.2592 ^{**} (0.0925)
预期未来 5 年收入有大幅增加	0.6524 ^{**} (0.1210)	0.6530 ^{**} (0.1212)	0.6524 ^{**} (0.1210)	0.6530 ^{**} (0.1212)
预期未来 5 年收入有小幅增加	0.2800 ^{**} (0.0899)	0.2783 ^{**} (0.0899)	0.2800 ^{**} (0.0899)	0.2783 ^{**} (0.0899)
预期未来 5 年收入下降	0.1332 (0.1611)	0.1315 (0.1612)	0.1332 (0.1611)	0.1315 (0.1612)
参加基本医疗保险	0.4845 [*] (0.1982)	0.4850 [*] (0.1997)	0.4845 [*] (0.1982)	0.4850 [*] (0.1997)
参加社会养老保险	-0.3796 [*] (0.1717)	-0.3802 [*] (0.1724)	-0.3796 [*] (0.1717)	-0.3802 [*] (0.1724)
至少有一个孩子在本市上学	-0.3435 ^{**} (0.0657)	-0.3442 ^{**} (0.0660)	-0.3435 ^{**} (0.0657)	-0.3442 ^{**} (0.0660)

(下转第 27 页)

(上接第 26 页)

描述性指标	模型 1	模型 2	模型 3	模型 4
流出省农民平均月人均纯收入自然对数	--	0.0256 (0.1150)	-	-0.0256 (0.1150)
本市城镇居民平均月可支配收入自然对数	-	-	-0.3880 ^{***} (0.1473)	-0.3948 ^{***} (0.1496)
职业	已控制	已控制	已控制	已控制
单位类型	已控制	已控制	已控制	已控制
行业	已控制	已控制	已控制	已控制
城市	已控制	已控制	已控制	已控制
样本数	2133	2128	2133	2128
Pseudo R ²	0.3307	0.3305	0.3307	0.3305

注: 括号内的数字为标准误差。“***”、“**”、“*”分别表示在 1%、5%、10% 水平上显著。

表 4 进城农民工的生活满意度决定 (OLS 回归)

描述性指标	模型 1	模型 2	模型 3	模型 4
月工资自然对数	0.0511 ^{***} (0.0185)	0.0523 ^{***} (0.0187)	0.0511 ^{***} (0.0185)	0.0523 ^{***} (0.0187)
受教育年限(年)	-0.0022 (0.0044)	-0.0024 (0.0045)	-0.0022 (0.0044)	-0.0024 (0.0045)
工作经验(年)	-0.0010 (0.0019)	-0.0011 (0.0020)	-0.0010 (0.0019)	-0.0011 (0.0020)
在城市的居住年限(年)	0.0146 [*] (0.0060)	0.0142 [*] (0.0060)	0.0146 [*] (0.0060)	0.0142 [*] (0.0060)
在城市居住年限的平方	-0.0006 [*] (0.0003)	-0.0006 [*] (0.0003)	-0.0006 [*] (0.0003)	-0.0006 [*] (0.0003)
男性	-0.0135 (0.0206)	-0.0142 (0.0207)	-0.0135 (0.0206)	-0.0142 (0.0207)
已婚	0.2223 (0.3146)	0.2255 (0.3150)	0.2223 (0.3146)	0.2255 (0.3150)
中共党员	0.1107 (0.0869)	0.1106 (0.0870)	0.1107 (0.0869)	0.1106 (0.0870)
工作时间(时/周)	-0.0001 (0.0005)	-0.0001 (0.0005)	-0.0001 (0.0005)	-0.0001 (0.0005)
工作满意程度(1~4)	0.6093 ^{***} (0.0182)	0.6106 ^{***} (0.0183)	0.6093 ^{***} (0.0182)	0.6106 ^{***} (0.0183)
人均居住面积(平方米)	0.0010 (0.0009)	0.0010 (0.0009)	0.0010 (0.0009)	0.0010 (0.0009)
本市老乡数量(人)	-0.0005 (0.0003)	-0.0005 (0.0003)	-0.0005 (0.0003)	-0.0005 (0.0003)

(下转第 28 页)

(上接第 27页)

描述性指标	模型 1	模型 2	模型 3	模型 4
本市亲戚数量(人)	0.0040 [*] (0.0019)	0.0040 [*] (0.0019)	0.0040 [*] (0.0019)	0.0040 [*] (0.0019)
身体健康状况良好	0.0899 ^{***} (0.0308)	0.0901 ^{***} (0.0309)	0.0899 ^{***} (0.0308)	0.0901 ^{***} (0.0309)
预期未来 5 年收入有大幅增加	0.1851 ^{***} (0.0389)	0.1865 ^{***} (0.0390)	0.1851 ^{***} (0.0389)	0.1865 ^{***} (0.0390)
预期未来 5 年收入有小幅增加	0.0990 ^{***} (0.0301)	0.0985 ^{***} (0.0301)	0.0990 ^{***} (0.0301)	0.0985 ^{***} (0.0301)
预期未来 5 年收入下降	0.0393 (0.0559)	0.0392 (0.0560)	0.0393 (0.0559)	0.0392 (0.0560)
参加基本医疗保险	0.1474 [*] (0.0634)	0.1475 [*] (0.0642)	0.1474 [*] (0.0634)	0.1475 [*] (0.0642)
参加社会养老保险	-0.1123 [*] (0.0554)	-0.1131 [*] (0.0558)	-0.1123 [*] (0.0554)	-0.1131 [*] (0.0558)
至少有一个孩子在本市上学	-0.1081 ^{***} (0.0210)	-0.1090 ^{***} (0.0211)	-0.1081 ^{***} (0.0210)	-0.1090 ^{***} (0.0211)
流出省农民平均月人均纯收入自然对数	-	0.0004 (0.0375)	-	0.0004 (0.0375)
本市城镇居民平均月可支配收入自然对数	-	-	-0.1270 ^{***} (0.0470)	-0.1324 ^{***} (0.0479)
职业	已控制	已控制	已控制	已控制
单位类型	已控制	已控制	已控制	已控制
行业	已控制	已控制	已控制	已控制
城市	已控制	已控制	已控制	已控制
常数	0.3482 (0.3570)	0.3317 (0.4134)	1.3593 ^{***} (0.4816)	1.3852 ^{***} (0.5032)
样本数	2133	2128	2133	2128
F(β = 0)	39.44 ^{***}	38.50 ^{***}	39.44 ^{***}	38.50 ^{***}
Adj-R ²	0.4480	0.4478	0.4480	0.4478

注: 括号内的数字为标准误差。“***”、“**”、“*”表示在 1%、5%、10% 水平上显著。

为了克服回归模型中的收入变量可能存在的内生性问题, 尝试使用工具变量法 (IV) 回归。表 5 显示的是工具变量有效性的检验结果。具体来说, 把母亲的受教育程度、父亲的受教育程度以及配偶的受教育程度作为个人收入变量的工具。父母或配偶的教育常被用来控制非观测的能力 (Card 1995; Ashenfelter & Zimmerman, 1997; Chen & Hamori, 2009),^[29-31] 而且在研究生活满意度决定因素中被用作收入的工具变量 (Knight et al., 2009)。^[16] 工具变量有效性的第一个要求是相关性, 即工具变量要与收入显著相关。第二个要求则是工具变量的外生性。由于工具变量回归模型是过度识别的, 即工具的数目超过内生变量的数目, 通过 Sargan 检验来检测工具的外生性。表 5 的结果表明, 工具是内生的, 因此不是有效的工具。这里不仅检验了同时利用所有三个工具的检验结果 (如表 5 所

示),还检验了分别使用这三个变量的各种组合作为工具的情况。在每种情况下, Sagan 检验都是显著的,也就是这些工具都不是有效的。正如 Bound et al (1993, 1995)^[32-33]所指出的那样,当工具变量不是有效的时候,“治疗可能比疾病本身更糟糕”。Hahn & Hausman (2003)^[34]详细讨论了无效工具问题。他们指出,当工具变量与误差项相关时,工具变量估计可能比 OLS 估计更有偏。因此,在数据缺乏有效工具变量的情况下,坚持采用 OLS 估计,尽管这样估计出的收入变量的系数可能会出现上偏。需要指出, Knight et al (2009)^[16]发现,在分析中国农村人口的生活满意度决定因素时, OLS 估计与 IV 估计没有显著的差异,而且, Knight & Gunatilaka (2010)^[8]发现,除了收入变量的系数之外, OLS 估计和 IV 估计在分析进城农民工的生活满意度决定因素时几乎是相同的。

首先讨论除未来预期之外的其他变量的系数。在表 4 中的每一个模型中,月工资自然对数的系数总是为正且是显著的,这表明个人收入和生活满意度是正相关的,与现有文献一致 (Clark et al, 2008)^[11]但是,个人收入对生活满意度的影响程度并不是很大,月收入增加一倍,生活满意度指数约增加 0.05。模型 2 和模型 3 遵循了 Luttmer (2005)^[35]以及 Graham & Felton (2006)^[36]所采用的方法,即引入了参照群体收入的影响。参照群体的收入与生活满意度之间的关系尚不清楚。大多数研究发现,当参照群体的收入上升时,生活满意度会下降(“嫉妒效应”) (如 Graham & Felton, 2006)^[36]然而,一些研究发现,当参照群体的收入增加时,生活满意度会增加(“信号效应”) (如 Senk, 2004)^[37]后者与 Hirschman (1973)^[38]的隧道效应一致,即当别人过得更好时自己会感到更高兴,因为你在不久的将来可能会变得像别人一样。流入地居民收入的系数为负且显著,但是流出地收入的系数在统计上不显著。这一发现表明,随着劳动力的迁移,进城农民工的参照群体已从农村留守居民转变为城市本地居民,并且在与城市本地居民的比较中产生了嫉妒效应或相对剥夺感。城市本地居民收入的系数是负的,其绝对值是个人收入变量系数的 2 倍多。Appleton & Song (2008)^[19]以及 Smyth & Qian (2008)^[21]发现,对于中国城市居民而言,当参照群体收入增加时,他们的生活满意度会下降。Knight et al (2009)^[16]以及 Knight & Gunatilaka (2010)^[8]对中国农村居民以及农村向城市的迁移人口的分析中也分别得出了同样的结论。如果进城农民工把他们的收入与城市亲戚相比较,例如那些拥有城市户口的亲戚,进城农民工看到他们在不久的将来会与这些亲戚生活得一样,信号效应可能会占优势,亲戚们收入的增加可能会提高农民工的生活满意度。但由于城市对农民工还存在广泛的职业和工资歧视,信号效应占优势的可能性并不大,而嫉妒效应可能会更占主导地位。

再来看其他变量的系数。在城市居住的时间及其平方项在统计上都是显著的,前者的系数为正,后者系数为负。这些系数意味着,在城市 12~13 年之后,生活满意度达到高峰,然后下降。这个结果比 Knight & Gunatilaka (2010)^[8]发现的进城农民工生活满意度在进城 14 年后达到高峰稍微早一点。这个结果表明,在其他条件相同的情况下,移民在城市生活时间越长,生活满意度会越高。在城里有可以寻求帮助的亲戚会对生活满意度产生显著的积极影响,但本市同乡的数量对生活满意度没有显著的积极影响。至少有一个孩子在本市上学,会对生活满意度产生显著的负面影响。他们也发现,有孩子生活在城里会对进城农民工的生活满意度产生显著的负面影响。有一些证据表明,有孩子会提高生活满意度 (Dolan et al, 2008)^[12]而且 Appleton & Song (2008)^[19]发现,有孩子的中国城市居民生活会更满意。但是,如果孩子所处的环境不好,例如孩子生病或需要更多的照顾,孩子会对生活满意度产生负面影响 (Dolan et al, 2008)^[12]对此的一个解释是,由于进城农民工的收入普遍较低,对于他们来说,要供孩子在城里上学是一个很大的经济负担。此外,进城农民工还要负担孩子在城市的其他费用开支,这也会对他们们的生活满意度产生不利影响。

回归结果还表明,参加社会医疗保险会使生活满意度指数提高 0.15 但是参加社会养老保险会

使生活满意度指数降低 0.11。参加社会医疗保险对生活满意度的影响与 Appleton & Song (2008)^[19] 对城市居民的研究发现是一致的,而且这很可能反映了人们对疾病风险的担忧。养老保险对进城农民工生活满意度有负面影响,可能反映了中国的养老保险项目设计并不适应进城农民工的要求 (Yang & Guo 2006; Li 2008)。^[39-40] 首先,农民工的流动性特别强,但养老保险的可转移性还比较差。其次,相当一部分农民工和雇主都不愿意参加社会养老保险。根据 2005 年对 7 个省会城市和一个大城市的调查,80% 的企业和 83.2% 的农民工都不愿意参加社会养老保险 (Xiao & Liu 2005)。^[41] 再次,进城农民工往往有这样一个看法,即他们自身都还年轻,养老还是很遥远的事情,等到了退休年龄的时候他们可以依靠子女或回老家养老。Li (2008)^[1] 对天津进城农民工养老保险的访谈调查表明,农民工往往认为退休与他们没有任何关系。

有良好的身体健康状况,可以使生活满意度指数提高 0.08~0.09。在对工作满意度的研究方面我们支持外溢假说,这一假说指出工作满意度与一个人的生活满意度有正相关关系,因为在工作上的满意(或不满意)会渗透到生活中的方方面面 (Spector, 1997)。^[42] 工作满意度指数每增加 1 分,会使幸福感增加 0.61 分。其他变量(教育、工作经验、性别、婚姻状况、政治面貌和工作时间)在统计上不显著,说明他们对生活满意度没有显著影响。

现在来看未来收入预期对生活满意度的影响。相对于那些预期未来收入没有变化的进城农民工来说,那些预期未来 5 年收入有大幅增加的人,生活满意度指数会提高 0.19 分,而那些预期未来 5 年收入有小幅增加的人,生活满意度指数会提高 0.10 分。这就意味着对于那些预期未来 5 年收入有大幅增加的人来说,相当于他们月平均工资增加 380% 所带来的生活满意度提升效果,对于那些预期未来 5 年收入有小幅增加的人来说,这相当于月收平均工资增加 200% 所带来的效果。这表明预期对幸福的影响大大超过实际收入对生活满意度所带来的影响。

表 5 工具变量的有效性检验

	模型 1	模型 2	模型 3	模型 4
工具变量	Edu_mother Edu_father Edu_spouse	Edu_mother Edu_father Edu_spouse	Edu_mother Edu_father Edu_spouse	Edu_mother Edu_father Edu_spouse
第一阶段回归 IV 的显著性				
Edu_mother	*	*	*	*
Edu_father				
Edu_spouse				
不包括工具的 F-检验 (P-值)	0.0664	0.1000	0.0664	0.1000
Sargan 检验 (P-值)	0.0252	0.0223	0.0252	0.0223

注:“*”表示显著性水平为 10%。Edu_mother Edu_father Edu_spouse 分别表示母亲的受教育程度、父亲的受教育程度和配偶的受教育程度。

五、结论

中国农村劳动力向城市的转移,已经成为驱动中国高经济增长的引擎。大多数研究都认为,进城农民工没有能够从经济增长中分得与其贡献相应的份额。以往的研究已经发现,进城农民工的生活满意度水平比纯农村人口和城市本地居民都要低 (Knight & Gunatilaka 2008, 2010)。^[7-8] 因此,我们会很自然地问这样的问题:既然进城农民工生活满意度水平比纯农村人口还要低,为什么他们还要继

续迁移到城市中去?文中设法通过考察进城农民工的生活满意度的决定因素来回答这一问题,结果发现,对未来收入的预期是生活满意度的一个重要决定因素,这一影响远远超过个人收入增长所带来的作用。

本文的发现意味着,要想让进城农民工保持较高的生活满意度,就要确保他们对未来收入增长的积极预期。在选用的样本中,进城农民工对未来收入增长普遍有较为积极的预期,这是因为调查是在2005年收集的,当时沿海地区劳动力短缺的现象已经比较明显,农民工工资增长趋势比较明显。当前中国面临的挑战是,如何确保进城农民工在金融危机后中国经济前景不太明朗的情况下仍然保持积极的预期。

本文的研究存在一些局限性。一是没能控制被访者的个性特征。虽然认为现有的经济学文献为控制个性使用的代理变量并不理想,但是未来的研究可以使用心理测量技术措施来控制个性特征。二是没能找到收入的有效工具变量。因此收入的回归系数的 OLS 估计可能会上偏。三是与现有的对中国居民生活满意度决定因素的研究相类似,缺乏面板数据。利用面板数据将可以较好解决不可观测的个性特征因素的影响。

参考文献:

- [1] Knight J and Yueh L. Segmentation or Competition in China's urban labour market? [J]. Cambridge Journal of Economics 2009, 33: 79–94
- [2] Liu Z. Institution and Inequality: The Hukou System in China [J]. Journal of Comparative Economics 2005, 33: 133–157.
- [3] International Labour Organization (ILO). Internal Labor Migration in China: Features and Responses [R]. Geneva: International Labour Organization, 2007.
- [4] Feng W., Zuo X. and Ruan D. Rural Migrants in Shanghai: Living under the Shadow of Socialism [J]. International Migration Review, 2002, 36: 520–545
- [5] Jacka T. Finding a Place: Negotiations of Modernization and Globalization among Rural Women in Beijing [J]. Critical Asian Studies, 2005, 37(1): 51–74
- [6] Li B. Floating Population or Urban Citizen? Status, Social Provision and Circumstances of Rural-Urban Migrants in China [J]. Social Policy & Administration, 2006, 40(2): 174–195
- [7] Knight J and Gunatilaka R. Aspirations, Adaption and Subjective Well-being of Rural-Urban Migrants in China [R]. Department of Economics, University of Oxford, Discussion Paper, 2008: 381.
- [8] Knight J and Gunatilaka R. Great Expectation? The Subjective Well-being of Rural-Urban Migrants in China [J]. World Development (in press), 2010
- [9] Senk C. Is man Doomed to Progress? [J]. Journal of Economic Behavior and Organization, 2008, 68: 140–152
- [10] Frey B. and Stutzer A. What Can Economists Learn from Happiness Research? [J]. Journal of Economic Literature, 2002, 40: 402–435
- [11] Clark A. E., Frijters P. and Shields M. A. Relative Income, Happiness and Utility: An Explanation for the Easterlin Paradox and Other Puzzles [J]. Journal of Economic Literature, 2008, 46: 95–144
- [12] Dolan P., Peasegood T. and White, M. Do We Really Know What Makes Us Happy? A Review of the Economic Literature on the Factors Associated with Subjective Well-being [J]. Journal of Economic Psychology, 2008, 29: 94–122
- [13] Brown P. H. and Tiemey B. Religion and Subjective Well-being among the Elderly in China [J].

Journal of Socio- economics, 2009, 38: 310- 319.

- [14] Chen C. Revisiting the Disengagement Theory with Differentials in the Determinants of Life Satisfaction[J]. Social Indicators Research, 2003, 64: 209- 224
- [15] Edwards G., Bangert A., Couch G., Shinfuku N., Chen, T., Bi Y and Rappe, T. The Impact of Sibling Status on Chinese College Students' Quality of Life[J]. Social Behavior and Personality, 2005, 33: 227- 242
- [16] Knight J., Song L. and Gunatilaka R. Subjective Well- being and Its Determinants in Rural China[J]. China Economic Review, 2009, 20(4): 635- 649
- [17] Knight J. and Gunatilaka R. Income Aspirations and the Hedonic Treadmill in a Poor Society [R]. Department of Economics, University of Oxford, Discussion Paper, 2009a: 468
- [18] Knight J. and Gunatilaka R. Is Happiness Infectious? [R]. Department of Economics, University of Oxford, Discussion Paper, 2009b: 446
- [19] Appleton S. and Song L. Life Satisfaction in Urban China: Components and Determinants[J]. World Development, 2008, 36(11): 2325- 2340
- [20] Cheung C. K. and Leung K. K. Forming Life Satisfaction among Different Social Groups during the Modernization of China[J]. Journal of Happiness Studies, 2004, 5: 23- 56
- [21] Smyth R. and Qian X. Inequality and Happiness in Urban China[J]. Economics Bulletin, 2008, 4(23): 1- 10
- [22] Smyth R., Mishra V. and Qian X. The Environment and Well- being in Urban China[J]. Ecological Economics, 2008, 68: 547- 555
- [23] Smyth R., Nielsen I. and Zhai Q. Personal Well- being in Urban China[J]. Social Indicators Research, 2010, 95(2): 231- 251
- [24] Nielsen I., Smyth R. and Zhai Q. Subjective Well- being of China's off- farm Migrants[J]. Journal of Happiness Studies(in press), 2010b
- [25] Lorenzoni G. A Theory of Demand Shocks[J]. American Economic Review, 2009, 99(5): 2050- 2084.
- [26] Das M. and Van Soest A. A Panel Data Model for Subjective Information on Household Income Growth[J]. Journal of Economic Behavior and Organization, 1999, 40(4): 409- 426
- [27] Ferrer- i- Carbonell A. and Frijters P. How Important Is Methodology for the Estimates of the Determinants of Happiness? [J]. Economic Journal, 2004, 114: 641- 659.
- [28] Ferrer- i- Carbonell A. and Gowdy J. M. Environmental Degradation and Happiness[J]. Ecological Economics, 2007, 60: 509- 516.
- [29] Card D. Using Geographic Variation in College Proximity to Estimate the Returns to Schooling[M] // In Christofides L. N., Grant E. K. and Swilinsky R. (Eds). Aspects of Labor Market Behavior: Essays in Honor of John Vanderkamp. Toronto: University of Toronto, 1995: 201- 222
- [30] Ashenfelter O. and Zimmerman D. Estimating Returns to Schooling from Sibling Data: Fathers, Sons and Brothers[J]. Review of Economics and Statistics, 1997, 79: 1- 9.
- [31] Chen G. and Hamori S. Economic Returns to Schooling in Urban China: OLS and Instrumental Variables Approach[J]. China Economic Review, 2009, 20: 143- 152
- [32] Bound J., Jaeger D. A. and Baker R. The Cure Can Be Worse than The Disease: A Cautionary Tale Regarding Instrumental Variables [R]. NBER Technical Working Paper, 1993: 137.
- [33] Bound J., Jaeger D. A. and Baker R. Problems with Instrumental Variables Estimation When the Correlations Between the Instruments and the Endogenous Variable Is Weak[J]. Journal of the American Statistical Association, 1995, 90: 443- 450

- [34] Hahn, J. and Hausman, J. W. Estimation with Valid and Invalid Instruments [R]. Mimeo Department of Economics, MIT, 2003
- [35] Luttmer, E. Neighbors As Negatives: Relative Earnings and Well-being [J]. Quarterly Journal of Economics, 2005, 120: 963– 1002.
- [36] Graham, C. and Felton, A. Inequality and Happiness: Insights from Latin America [J]. Journal of Economic Inequality, 2006, 4: 107– 122
- [37] Senik, C. When Information Dominates Comparison: Learning from Russian Subjective Panel Data [J]. Journal of Public Economics, 2004, 88: 2099– 2123
- [38] Hirschman, A. O. The Changing Tolerance for Income Inequality in the Course of Economic Development [J]. Quarterly Journal of Economics, 1973, 87: 544– 566.
- [39] Yang, C. and Guo, J. The Social Insurance Scheme for Peasant Workers: Dilemma and Theoretical Analysis [J]. Zhengjiang University Journal: Social Science Edition, 2006, 36(3): 108– 116
- [40] Li, B. Why Do Migrant Workers not Participate in Urban Social Insurance Schemes? The Case of the Construction and Service Sectors in Tianjin [C] // In I. Nielsen and R. Smyth (Eds.) Migration and Social Protection in China. Singapore: World Scientific, 2008.
- [41] Xia, S. and Liu, J. Labour Subcontractors: It Is Not Easy to Keep You [N]. Workers' Daily, 2005 – 04– 27.
- [42] Spector, P. Job Satisfaction: Application, Assessment, Causes and Consequences [M]. California: Sage Publications, 1997.

责任编辑、校对: 李品秀

Future Income Expectations and Life Satisfaction of China's Rural Urban Migrant Workers

——An Empirical Study on the Migrant Workers in Shanghai and Other 11 Cities

GAO Wen-shu¹, Russell Smyth²

(1. Institute of Population and Labor Economics, Chinese Academy of Social Sciences, Beijing 100732, China; 2. Faculty of Economics, Monash University, Melbourne 3800, Australia)

Abstract China's rural urban migrant workers have always been an important engine which drives China's fast growing economy. Although the living and working conditions of them are poor, why do they still choose to stay in the cities? By using data of large-scale survey administered across 12 cities in 2005, and examining the determinants of the life satisfaction of the workers, we find out that future income expectation is an important determinant of their life satisfaction. This means that many migrant workers are optimistic about their future income and even their living conditions, which exerts positive influence on their life satisfaction and happiness at present. This finding has important implications for the economic growth and the social economic stability in China given that maintaining the social economic stability is important to maintain China's high rate of economic growth, and positive future income expectation is has great significance in maintaining the social economic stability during times of economic transition.

Key words Income Expectation, Life Satisfaction, Rural Urban Migrant Workers