

贸易与国际冲突的因果检验^{*}

邝艳湘 向洪金

内容提要 对于国家间贸易和政治之间的因果关系,学术界始终存在较大分歧,部分学者认为贸易是国家间政治变化的原因,而有的学者则认为国家间政治关系是贸易变化的原因。借鉴计量经济学中的格兰杰(Granger)因果检验和脉冲响应函数,本文利用1980—2001年间东亚国家之间的贸易额和冲突积分的数据,检验了贸易与国际冲突之间的因果关系。研究结果表明:(1)在某些东亚国家之间,国际贸易与双边冲突/合作具有双向因果关系;(2)就整体而言,东亚地区的政治关系对东亚地区的经贸活动的影响,要大于经贸活动对政治关系的影响。

关键词 贸易 国际冲突/合作 格兰杰因果检验 脉冲响应函数

冷战结束以来,随着信息技术的快速发展、经济全球化的加速推进、国际贸

* 感谢《国际政治科学》约请的匿名评审专家对本文提出的宝贵修改意见。正是他们的宝贵意见,本文才得以不断完善。不过,文责皆由作者负责。

《国际政治科学》2009/2(总第18期),第1—26页。

Quarterly Journal of International Politics

易和投资的迅猛增长,国家之间的经济相互依赖不断加深。与此同时,在国际政治领域,尽管地区性局部冲突不断,但是,从整体来看,国际政治不断缓和,冲突的级别和频率都有所下降,呈现出总体稳定的趋势。

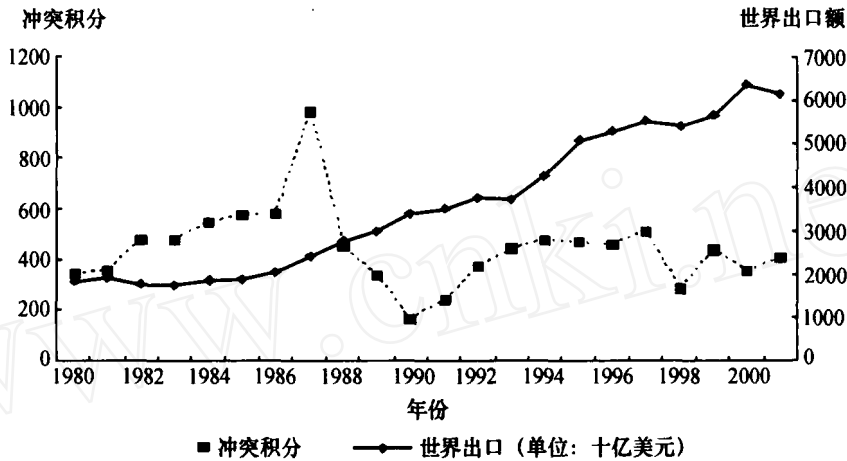


图-1 1980—2001 年全球贸易总额与军事冲突趋势图^①

图-1 左边纵轴是冲突积分的坐标,右边纵轴是世界出口的坐标。图-1 非常直观地表明,在1980—2001年间,全球货物贸易总额持续增加。1980年,全球货物贸易额还不到20万亿美元,而到2001年已增加到60多万亿美元,短短的20年间增加了3倍多。与此同时,虽然在有些年份,国际冲突有所增加,但总体上仍呈下降趋势。那么,国家间贸易的增加与国际政治环境的总体缓和是一种偶然的巧合,还是存在一定的相关关系?如果确实存在相关关系,那么到底是贸易导致和平?还是和平环境更有利于国家开展贸易往来?

长期以来,学者们对上述问题一直存有争议,围绕着这两个变量之间是否具有因果关系这一问题,研究人员分化成了不同阵营。

首先,在国家间冲突是否影响国际贸易问题上,巴比尔蕾(Katherine Barbieri)和列维(Jack S. Levy)的研究发现,敌对国家之间并没有显著地减少

^① 资料来源:世界出口数据来源于世界贸易组织(WTO)网站,冲突数据根据《战争相关性数据库》(Correlates of War, COW)中国家间军事冲突3.10版本整理而得。

互相贸易,也就是说,国家之间的冲突与合作并不影响彼此的贸易往来。^①而以博林斯(Brian Pollins)^②和斯特兰奇^③等认为,国家间的冲突与合作对贸易往来具有重要影响。

其次,在贸易如何影响国家之间冲突与合作的问题上,存在着两种截然对立的看法。波洛契克(Solomon Polachek)^④、鲁塞特(Bruce Russett)和奥尼尔(John R. Oneal)^⑤、罗斯克兰斯(Richard Rosecrance)^⑥认为,贸易会促进国家之间的合作;而巴比尔蕾^⑦认为,贸易会增加国家之间的冲突。不过,两者的共同之处是,他们都认为贸易与国际冲突与合作具有相关性或因果关系。而布赞(Barry Buzan)认为,贸易与国家之间的冲突/合作没有相关性,两者互不影响。^⑧

但是,这些研究的共同缺陷是,仅仅根据国际关系理论或者经济理论提出假设,并未实证检验贸易和国家间冲突/合作之间的因果关系。正如塞耶斯(Lois Sayrs)所言,在关于贸易和冲突/合作的经验性研究中,几乎所有人都主

① Katherine Barbieri and Jack S. Levy, "Sleeping with the Enemy: the Impact of War on Trade," *Journal of Peace Research*, Vol. 36, No. 4, 1999, pp. 463—479.

② Brian M. Pollins, "Conflict, Cooperation, and Commerce: The Effect of International Political Interactions Upon Bilateral Trade Flows," *American Journal of Political Science*, Vol. 33, No. 3, 1989; Brian M. Pollins, "Does Trade Still Follow the Flag: A Model of International Diplomacy and Commerce," *The American Political Science Review*, Vol. 83, No. 2, 1989.

③ 苏珊·斯特兰奇:《国际政治经济学导论:国家与市场》(杨宇光等译),北京,经济科学出版社1990年版。

④ Solomon W. Polachek, "Conflict and Trade," *The Journal of Conflict Resolution*, Vol. 24, No. 1, 1980, pp. 55—78.

⑤ John R. Oneal and Bruce M. Russett, "The Classical Liberals Were Right: Democracy, Interdependence, and Conflict, 1950—1985," *International Studies Quarterly*, Vol. 41, No. 2, 1997, pp. 267—293; John R. Oneal and Bruce Russett, "Assessing the Liberal Peace with Alternative Specifications: Trade Still Reduces Conflict," *Journal of Peace Research*, Vol. 36, No. 4, 1999, pp. 423—442; John R. Oneal and Bruce Russett, "Clear and Clean: The Fixed Effects of the Liberal Peace," *International Organization*, Vol. 55, No. 2, 2001, pp. 469—485.

⑥ Richard Rosecrance, *The Rise of the Trading State: Commerce and Conquest in the Modern World* (New York: Basic Books, 1986).

⑦ Katherine Barbieri, "Economic Interdependence: A Path to Peace or a Source of Interstate Conflict?" *Journal of Peace Research*, Vol. 33, No. 1, 1996, pp. 29—49; Katherine Barbieri, *The Liberal Illusion: Does Trade Promote Peace?* (Ann Arbor: The University of Michigan Press, 2002).

⑧ Barry Buzan, "Economic Structure and International Security: The Limits of the Liberal Case," *International Organization*, Vol. 38, No. 4, 1984, pp. 597—624.

观认定贸易与冲突之间存在因果关系,因而直接利用计量回归模型对二者之间的影响大小进行实证检验。而这些研究经常忽略了最重要的一点,即贸易和冲突/合作之间的因果关系从来没有被证实过。从原则上来说,我们还没有完全理解这些联系。^① 由于因果检验是回归分析的前提条件,也是模型建构的重要步骤,因此这一关键步骤的缺失,严重削弱了既有研究结论的可信性。

本文以东亚国家为例,借鉴计量经济学中的方法和模型,考察贸易与国家间冲突/合作之间的格兰杰因果关系,并利用脉冲响应函数以及方差分解方法,实证检验二者之间的影响情况。

一、文献回顾与评述

贾西奥罗斯基(Mark Gasiorowski)和波洛契克最早提出,需要对贸易与国家间冲突/合作的因果关系进行检验。他们认为,有的研究仅仅凭经验假定贸易是解释变量,冲突/合作是被解释变量,但并未检验和确定两者之间的因果关系,因而建立在这种假定之上的模型是有缺陷的。贾西奥罗斯基和波洛契克考察了1967—1978年间美苏缓和时期美国和华沙集团之间的贸易与冲突/合作关系。他们以1967年至1978年间的双边季度贸易和“净冲突”(net conflict)为变量,以美国—华沙集团以美元计的实际进出口总额衡量贸易,而以《冲突与和平数据库》(Conflict and Peace Data Bank, COPDAB)中的季度“净冲突”加权平均值来衡量冲突/合作。他们的结论是,贸易是促使东西方政治关系缓和的重要原因。为了克服已有研究缺乏因果检验的不足,他们又对两者之间的关系进行格兰杰因果检验,得出的结论是,贸易是冲突/合作的原因。因此,贾西奥罗斯基和波洛契克认为,贸易有利于缓和东西方政治关系的结论是有说服力的。^②

鲁文尼(Rafael Reuveny)和姜熙俊(Heejoon Kang)较为全面地检验了贸易和冲突之间的因果关系。在《国际贸易、政治冲突/合作和格兰杰因果分析》一文中,他们选取1960—1990年间的16对国家国际贸易的季度数据,逐一检验

^① Lois W. Sayers, "Expected Utility and Peace Science: An Assessment of Trade and Conflict," *Conflict Management and Peace Science*, Vol. 11, No. 1, 1990, pp. 17—44.

^② Mark Gasiorowski and Solomon W. Polachek, "Conflict and Interdependence: East-West Trade and Linkages in the Era of Detente," *Journal of Conflict Resolution*, Vol. 26, No. 4, 1982, pp. 709—729.

了各对国家双边贸易与冲突/合作之间的因果关系,其结论是贸易和冲突/合作之间存在双向因果关系。即在有些国家间,贸易是国家间冲突/合作的原因,而对于另外一些国家,国家间冲突/合作是贸易的原因,甚至有些国家间贸易与冲突/合作间不存在因果关系。换言之,在不同国家间,具体何者为因何者为果情形并不一样。^①

但是,上述因果分析存在以下问题:

首先,从选取的样本来看,贾西奥罗斯基和波洛契克只分析了一对行为体(美国—华沙集团)1967—1978年间的样本数据。而鲁文尼和姜熙俊在全世界范围内选取了16对国家1990年以前的数据,前者的研究对象过于狭隘,而后者又过于宽泛。

其次,从他们所选取的变量及指标来看,对贸易的衡量主要是以贸易总额来计算,并没有考虑到贸易对不同国家的重要性,即双边贸易额对一国经济的重要性。比如,英国和阿根廷两个国家之间的贸易在各自GDP中所占的比例相差较大。另一方面,对冲突变量的选择,是以“净冲突”来衡量,数据主要来源于《冲突与和平数据库》和《世界事件互动测量》(World Event Interaction Survey, WEIS)两个对日常事件进行赋值的数据库。可是,对日常事件的赋值具有较大的主观性,容易导致回归结果出现偏差。

再次,通过选取16对国家作为样本,鲁文尼和姜熙俊分别考察了16对国家的政治合作/冲突与贸易间的因果关系,认为这种因果性并不具有普适性,在不同国家具有不同的因果关系。但两位作者并没有解释,为什么不同国家因果检验的结果会不一样,是什么因素导致了不同国家的贸易与政治关系呈现不同的因果性。

为了克服以上缺陷,在已有研究的基础上,本文检验了冷战结束后东亚国家贸易与国际政治关系之间的因果性。本文首先选取东亚地区9对国家,分别对这9对国家间贸易和冲突/合作间的因果性进行格兰杰检验,然后根据检验结果选取3个案例,分析和解释检验结果。

^① Rafael Reuveny and Heejoon Kang, "International Trade, Political Conflict/ Cooperation, and Granger Causality," *American Journal of Political Science*, Vol. 40, No. 3, 1996, pp. 943—970.

二、研究设计及相关概念的界定

在数据处理方面,已有研究基本上采用两种方法:一种是以面板数据为基础,将多对国家的时间序列结合起来。另一种方法则如鲁文尼和姜熙俊所采用的,统计每一对国家间的冲突/合作与贸易,然后再逐一分析。本文采用鲁文尼和姜熙俊的方法,考察东亚地区9对国家在1980—2001年间贸易与冲突/合作之间的因果关系。之所以选择1980—2001年作为考察期限,一是因为大多数国家20世纪80年代以来的贸易数据较容易获取;另外一个原因是,已有研究只考察了20世纪80年代以前的情况,而从20世纪80年代尤其是冷战结束以来,东亚地区的合作加速推进,彼此之间的互动和交流更加频繁。^①

对于样本国家的选择,主要基于以下三个标准:1. 数据的可获得性。正如鲁文尼和姜熙俊所言,“国际贸易和冲突/合作数据的可获得性”是决定选取哪些国家的重要因素,因为并不是所有国家都有全面的贸易、FDI和冲突数据。^② 2. 沿袭国外相关研究的通行做法,即选取样本国家时,要么双边贸易的一方是大国,要么进行贸易的两国接壤。^③ 3. 双边政治关系的好坏。根据COW的统计,在1980—2001年间,国家间关系大致存在三种政治状况:频繁冲突、偶尔冲突以及没有冲突。根据COW中对国家间冲突的统计以及相应的赋值法(参见下文),表-1得出了东亚国家间的冲突积分。根据该积分,首先界定了双边政治关系,将总积分大于100的界定为恶化,积分大于0小于100的界定为普通,没有发生过冲突的界定为良好。考虑到在考察期内有些国家间关系良好,军事冲突积分为0,因而不便进行因果关系检验,所以本文将只选择政治关系一般或恶化的9对国家进行检验。

① 当然,考虑到东亚不仅是世界上人口最多的地区(近30亿),而且近年来东亚也是世界上经济发展速度最快的地区。因此,以东亚作为研究对象具有较大的代表性。

② Rafael Reuveny and Heejoon Kang, “International Trade, Political Conflict/Cooperation, and Granger Causality,” pp. 943—970.

③ 在英文里,他们称这些国家对为“politically relevant directed-dyad”,由于没有相应合适的中文加以表述,这里仅把其大意表示出来。

表-1 东亚国家双边政治关系的界定

政治现状	冲突双方	冲突总积分	政治关系定性	样本国家
没有军事冲突	菲律宾—印尼	0	良好	
	印尼—马来西亚	0	良好	
	新加坡—马来西亚	0	良好	
	中国—新加坡	0	良好	
偶尔发生军事冲突	中国—印尼	14	普通	1. 日本—韩国 2. 中国—日本 3. 韩国—中国 4. 中国—菲律宾 5. 菲律宾—中国 6. 菲律宾—马来西亚 7. 日本—菲律宾
	菲律宾—日本	16	普通	
	菲律宾—马来西亚	22	普通	
	菲律宾—越南	23	普通	
	柬埔寨—越南	25	普通	
	中国—日本	28	普通	
	中国—韩国	38	普通	
	日本—韩国	44	普通	
	柬埔寨—泰国	64	普通	
中国—菲律宾	82	普通		
军事冲突频繁	泰国—老挝	114	恶化	1. 泰国—缅甸 2. 越南—中国
	韩国—朝鲜	190	恶化	
	中国—越南	269	恶化	
	泰国—缅甸	329	恶化	

(一) 国家间政治关系的度量

如何定义和度量国家间政治关系,是本研究进行实证分析的关键与前提。从本质上来说,国家间的政治关系是一种社会现象,要实证分析这种社会现象,就需要对它进行量化。就国家间政治关系的量化问题而言,目前主要有以下两种不同的方法:一种认为国家间的冲突/合作是一个连续体,在国家间的日常交往中,既有冲突,也有合作,因此对这些日常事件进行赋值、然后加总,通常以“净冲突”来表示;另外一种则以国家间冲突(或者战争)为衡量指标,把国家间的冲突看作是独立事件。前者有《冲突与和平数据库》、《世界事件互动测量》等,而《战争相关性数据库》(Correlates of War, COW)则主要采用了第二种方法。

前述两篇因果检验的文章都采用“净冲突”来度量国家间冲突。由于该方法较为主观,因此本文将根据 COW 数据库有关冲突行为的分类和界定,对冲

突进行赋值。COW 将冲突划分为两个级别：一是以冲突双方的具体行为进行划分，共分为 21 级，称为最高敌视行为 (highest hostility action)，即冲突中双方所采取的针对对方的最高级别的敌视行为。二是以双方的敌视程度进行划分，共分为 5 级，被称为最高敌视级别 (highest hostility level)。这两种划分标准之间有一定的联系，即把 21 级冲突行为划分为 5 个不同的敌视级别 (见表-2)。

本文以最高敌视行为为标准，对冲突中的双方进行赋值。如果没有军事冲突，取值为 0。如果冲突行为为威胁使用武力，则取值为 1；如果威胁进行封锁，则取值为 2，以此类推。假设 A 国与 B 国发生冲突，A 国为挑起国，A 国在整个冲突中的最高级别的敌视行为为威胁使用化学、生物和放射武器 (5)，则取值 5；B 国在整个冲突过程中最高行为为威胁宣布战争 (4)，则取值 4。如果在同一年内 A 国与 B 国还发生了另一次冲突，A 国采取的最高行为是展示武力 (7)，B 国的最高行为是动员 (10)，则 A 国对 B 国的总体敌视积分为 12 (= 5 + 7)，B 国对 A 国的敌视积分为 14 (= 4 + 10)。^① 因此，发生在两个国家之间的冲突事件使两国的冲突积分不相同，或者说，两个国家之间的冲突积分变量具有方向性。

表-2 COW 的冲突级别划分法^②

最高敌视级别	最高敌视行为
1 没有军事行动	0 没有军事行动
2 威胁使用武力	1 威胁使用武力
	2 威胁要进行封锁
	3 威胁要占领领土
	4 威胁宣战
	5 威胁使用生物、化学和放射性武器
	6 威胁要参战

① 本文开头对 1980—2001 年全球国家间军事冲突的统计也是以这种方法测量出来的。

② Faten Ghosn and Scott Bennett, "Codebook for the Dyadic Militarized Interstate Dispute Data, Version 3.10," www.correlatesofwar.org.

(续表)

最高敌视级别	最高敌视行为
3 展示武力	7 军事演习 8 警戒 9 核戒备 10 动员 11 屯兵边界 12 侵犯边界
4 使用武力	13 封锁 14 占领领土 15 抢占资源 16 进攻 17 交火 18 宣战 19 使用化学、生物和放射性武器
5 战争	20 国家间战争开始 21 加入国家间战争

(二) 贸易依赖度变量

相对而言,对国家之间的贸易进行量化比较容易。但是,对于如何具体定义和衡量贸易变量,学术界也存在较大的争议,而且不同的定义与衡量标准往往可能得出不同甚至相反的结论。如巴比尔蕾使用贸易份额(trade share, TRS)作为贸易变量指标,即两国的贸易额与某国的对外贸易总额之比。其实证检验后的结论是,贸易增加冲突,甚至是冲突的源泉。而奥尼尔和拉塞特则从某个国家对另一国双边贸易的依赖度(trade dependency, TRD),即两国的贸易额除以某国的GDP总额入手,得出了贸易减少冲突的结论。^①

本文认为,贸易是否对国家间的政治关系产生影响以及大小如何,主要是

^① Katherine Barbieri, "Economic Interdependence: A Path to Peace or a Source of Interstate Conflict," pp. 29—49; John R. Oneal and Bruce Russett, "Assessing the Liberal Peace with Alternative Specifications: Trade Still Reduces Conflict," pp. 423—442. 对这两篇文章的讨论参见 Erik Gartzke and Quan Li, "Measure for Measure: Concept Operationalization and the Trade Interdependence-Conflict Debate," *Journal of Peace Research*, Vol. 40, No. 5, 2003, pp. 553—571.

由两国间的贸易在两国经济活动中的地位与重要性决定的。因此,奥尼尔和拉塞特所采用的贸易依赖度指标,比巴比尔蕾使用的贸易份额指标更加可取。本文借鉴奥尼尔和拉塞特的方法,以双边贸易额在 GDP 中所占比例即贸易依赖度作为度量贸易的指标。根据奥尼尔和拉塞特的界定,贸易依赖度 $TRO_{i,t}$ (Trade Openness) 指标的计算公式如下:

$$TRO_{i,t} = \frac{TRD_{j,t}}{GDP_{i,t}} \quad (1)$$

其中, $TRD_{j,t}$ 表示第 t 年 i 国与 j 国之间的进口和出口总额, GDP_i 表示第 t 年 i 国的国民生产总值。^① 由于一国的进口等于另一国的出口,两国之间的进出口总量对两国来说是相等的。但根据上面的计算公式,对贸易双方来说,同样贸易额的重要性是不同的,即一国对另一国的贸易依赖度不同。而且一般情况下,小国(GDP 较小的国家)的贸易依赖度要大于大国(GDP 较大的国家)。因此,贸易依赖度变量同样具有方向性。

三、贸易与冲突之间的因果关系检验及脉冲响应分析

(一) 贸易与冲突之间的格兰杰因果检验

1. 因果检验的基本原理。^② 格兰杰因果检验是检验两个变量之间是否为因果关系的常用方法之一,由 J. 格兰杰(J. Granger)于 1969 年提出。它的简单定义是:给定一个信息集 A_t ,它至少包含 (X_t, Y_t) ,如果利用 X 的过去比不利用它时可以更好地预测 Y_t ,称 X_t 为 Y_t 的格兰杰原因。

格兰杰因果关系检验法的基本原理是:如果 X 的变化引起 Y 的变化,则 X 的变化应当发生在 Y 的变化之前。如果说“ X 是引起 Y 变化的原因”,则必须满足两个条件,第一, X 应该有助于预测 Y ,即在 Y 关于 Y 的过去值的回归中,添加 X 的过去值作为独立变量应当显著地增加回归的解释能力;第二, Y 不应当有助于预测 X ,其原因是如果 X 有助于预测 Y , Y 也有助于预测 X ,则很可能

① 国际贸易数据主要来源于国际货币基金组织,GDP 数据来源于世界银行。

② 关于格兰杰因果检验以及 F 检验的详细介绍可以参见罗伯特·S. 平狄克、丹尼尔·L. 鲁宾费尔德:《计量经济模型与经济预测》(钱小军等译),北京,机械工业出版社 1999 年版,第 150—151 页。

存在一个或几个其他的变量,它们既是引起 X 变化的原因,也是引起 Y 变化的原因。

要检验以上两个条件是否成立,我们需要检验一个变量对预测另一个变量没有帮助的原假设。例如,要想检验“ X 不是引起 Y 变化的原因”的原假设,我们把 Y 对 Y 的滞后值以及 X 的滞后值进行回归,再将 Y 只对 Y 的滞后值进行回归。然后就能用简单的 F 检验来确定 X 的滞后值是否对第一个回归的解释能力有显著的贡献。如果贡献显著,我们就能拒绝原假设,认为“ X 是 Y 的原因”。“ Y 不是引起 X 的变化的原因”的原假设也用同样的方法加以检验。下面是检验 X 与 Y 的因果关系的模型:

$$\begin{cases} X_t = c_1 + \sum_{i=1}^n \alpha_i X_{t-i} + \sum_{i=1}^n \beta_i Y_{t-i} + \mu_{1t} \\ Y_t = c_2 + \sum_{j=1}^p \lambda_j Y_{t-j} + \sum_{j=1}^q \delta_j X_{t-j} + \mu_{2t} \end{cases} \quad (2)$$

其中的变量 X_t 和 Y_t 必须是平稳的时间序列,否则将导致回归结果出现偏差。 μ_{1t} 和 μ_{2t} 是随机干扰项。当存在下列情况时:

- (1) 如果 $\beta_i = \delta_j = 0$, 则 X_t 和 Y_t 相互独立;
- (2) 如果 $\beta_i = 0, \delta_j \neq 0$, 则 X_t 是 Y_t 的原因;
- (3) 如果 $\beta_i \neq 0, \delta_j = 0$, 则 Y_t 是 X_t 的原因;
- (4) 如果 $\beta_i \neq 0, \delta_j \neq 0$, 则 X_t 和 Y_t 互为因果。

格兰杰因果分析结果的显著性常常采用 F 检验, F 检验的基本原理与主要步骤是,在进行因果检验之前往往先做原假设 H_0 : X_t 不是 Y_t 的原因;然后由回归估计得到 F 检验值,在给定的置信水平 α 下,查出临界值 F_α ,如果 $F > F_\alpha$,即回归得到的 F 检验值大于相应的临界值,则拒绝“ X_t 不是 Y_t 的原因”的原假设 H_0 ,从而得到 X_t 是 Y_t 的原因,否则,不能拒绝原假设 H_0 。

2. 相关变量的平稳性检验。在对变量进行格兰杰因果分析之前,首先要对相关变量进行平稳性检验,因为利用非平稳时间序列会导致回归估计出现偏差,即所谓的“虚假回归”现象。由于贸易等宏观经济变量常常具有长期的增长趋势,尤其是在经济全球化浪潮的推动下,世界各国之间的贸易呈快速增加趋势,绝大多数国家之间的贸易变量是非平稳的,因此事前进行平稳性检验就显得尤为重要。本文利用迪克-富勒(DF)方法来进行平稳性检验。下面以

1980—2001 年间日本对中日贸易的依赖度时间序列变量为例,来说明如何检验有关变量的平稳性。

日本对中日贸易依赖度

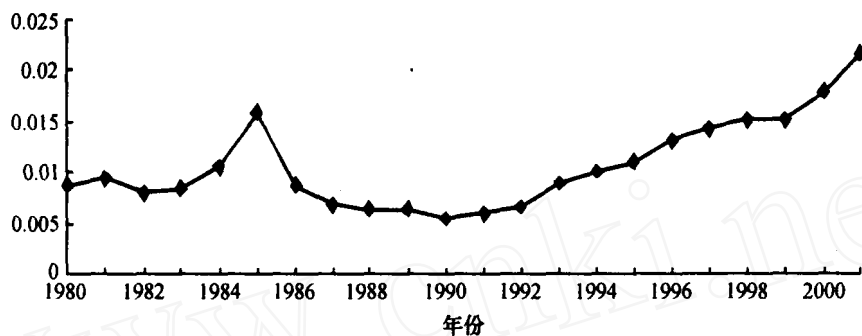


图-2 1980—2001 年间日本对中日贸易依赖度变化情况

图-2 是 1980—2001 年间日本对中日贸易的依赖度的变化情况。图中曲线表明,日本对中日贸易的依赖度呈上升的趋势。根据图形可以初步判断,贸易变量时间序列是非平稳的,下面利用 Eviews5.0 计量软件来进行正式的平稳性检验。表-3 是软件输出的迪克—富勒检验结果。

表-3 迪克—富勒检验结果

		t-统计值	概率
调整后的迪克—富勒统计值		0.039788	0.9524
临界值	1% 置信水平	-3.788030	
	5% 置信水平	-3.012363	
	10% 置信水平	-2.646119	

显然原序列的迪克—富勒检验值大约为 0.04,其绝对值小于三种不同置信水平下的临界值的绝对值,因此不能拒绝“序列存在单位根”的原假设,从而说明贸易时间序列确实是非平稳的。但是,由于非平稳的时间序列进行差分后往往可以转化为平稳序列,因此需要对原时间序列进行一阶差分,然后再次进行平稳性检验。检验结果如下:

表-4 差分后的检验结果

		t-统计值	概率
调整后的迪克—富勒统计值		-3.948402	0.0074
临界值	1% 置信水平	-3.808546	
	5% 置信水平	-3.02068	
	10% 置信水平	-2.650413	

表-4 中的检验结果表明,差分后的时间序列的迪克—富勒检验值为-3.95左右,其绝对值大于3种置信水平下临界值的绝对值。因此在这3种置信水平下,贸易变量的一阶差分都是平稳的时间序列。利用同样的方法发现,在1980—2001年间东亚不同国家之间的贸易依赖度时间序列变量往往也是非平稳的,但一阶差分序列都是平稳的。

在进行因果关系检验之前,同样还需要检验冲突积分时间序列的平稳性。但同贸易依赖度变量相比,对多数国家来说,冲突积分时间序列往往没有明显增加或减少的趋势,因此,有些国家与另一国的冲突积分时间序列有可能是平稳的(比如泰国与缅甸之间就是这样)。但是,笔者也发现,有些国家冲突积分,比如中国对越南的冲突积分时间序列是非平稳的。这主要是由于从20世纪80年代中期以后,中越之间的关系改善,导致冲突积分时间序列具有明显的下降趋势。但是,检验结果表明,所有国家对冲突积分时间序列都是一阶平稳的。

通过平稳性检验,笔者发现,尽管国家间的贸易依赖度变量和冲突积分变量往往是非平稳的,但都是一阶平稳的,因此在二者之间可以进行回归分析。

3. 格兰杰因果检验结果。依据国家的政治关系以及是否相邻,本文共选择9对国家来进行因果关系检验。贸易与冲突之间的因果检验包括两个方面,即贸易是否是冲突/合作的原因以及冲突/合作是否是贸易的原因。需要指出的是,由于冲突积分与贸易依赖度变量都具有方向性,因此中国—菲律宾与菲律宾—中国属于不同的国家组合(country dyad)。^①例如,为了检验日本—韩国组合中“贸易是否是冲突的原因”,我们使用的贸易变量是日本对韩国的贸易

^① 考虑到中国与菲律宾之间的贸易在两国经济活动中的地位与重要性不同,因此贸易对两国的政治关系取向的影响大小也是不同的。

依赖度变量与日本在日韩冲突中的冲突积分变量。利用 Eviews5.0 计量软件, 本文分别对所选的 9 对国家间的冲突和贸易进行回归分析。表-5 是贸易与冲突之间的格兰杰因果检验结果。

表-5 贸易与冲突之间的格兰杰因果检验

国家	显著性 (最优的 F 值)	滞后期数	显著性 (次优的 F 值)	滞后期数	零假设
日本—韩国	4.05** (0.0395)	2	3.09* (0.0674)	3	贸易不是冲突的原因
	2.810* (0.0843)	3	1.797 (0.3411)	2	冲突不是贸易的原因
中国—日本	10.661** (0.0132)	2	5.438** (0.0135)	3	贸易不是冲突的原因
	0.307 (0.8658)	4	0.231 (0.8729)	3	冲突不是贸易的原因
中国—菲律宾	5.429** (0.0136)	3	1.974 (0.1823)	4	贸易不是冲突的原因
	0.8372 (0.4914)	5	0.321 (0.8067)	4	冲突不是贸易的原因
菲律宾—中国	4.788** (0.0203)	3	3.481* (0.0555)	4	贸易不是冲突的原因
	0.853 (0.4954)	3	0.705 (0.5043)	4	冲突不是贸易的原因
泰国—缅甸	2.354* (0.0653)	3	2.146 (0.1602)	4	贸易不是冲突的原因
	1.406* (0.9012)	4	0.975 (0.1408)	5	冲突不是贸易的原因
日本—菲律宾	2.944* (0.0834)	2	0.393 (0.5381)	1	贸易不是冲突的原因
	2.862* (0.0811)	3	1.41 (0.2730)	2	冲突不是贸易的原因
越南—中国	2.719* (0.0637)	2	1.539 (0.1394)	4	贸易不是冲突的原因
	3.749** (0.0463)	4	1.137 (0.1104)	3	冲突不是贸易的原因

(续表)

国家	显著性 (最优的 F 值)	滞后期数	显著性 (次优的 F 值)	滞后期数	零假设
韩国—中国	4.943** (0.0386)	5	4.901* (0.5807)	6	贸易不是冲突的原因
	2.497* (0.7329)	4	1.864 (0.1337)	3	冲突不是贸易的原因
菲律宾—马来西亚	4.558** (0.0275)	4	5.510** (0.0302)	5	贸易不是冲突的原因
	0.291 (0.907)	6	0.218 (0.9422)	5	冲突不是贸易的原因

注:***、**、*分别代表在1%、5%、10%的显著性水平上通过F检验。表中各个F值下面括号里的数值是对应的概率,即P值。

表-5中的第一列是所选的国家组合,第二列和第四列分别是在不同滞后期时所得到的F检验值,最后一列是零假设。首先来看对原假设为“贸易不是冲突的原因”的检验结果。从表-5中的因果检验结果可以发现,在10%的显著性水平下,所选的9对国家间的回归结果都通过了迪克—富勒检验,或者说都拒绝了“贸易不是冲突的原因”的原假设。这从而表明,至少对所选的9对国家来说,国际贸易与国家间政治关系具有格兰杰因果性。

再来看对原假设为“冲突不是贸易的原因”的检验结果。在所选的9个国家中,日本和韩国、越南与中国等5对国家对应的检验结果,至少在10%的显著性水平下通过了迪克—富勒检验。这表明,对这些国家来说,冲突在一定程度上是国际贸易的原因。但是,中日以及中国与菲律宾等4对国家之间的检验结果却没有通过显著性检验。这表明,在考察期内,这些国家之间的政治关系对这些国家之间的贸易往来并没有产生显著的影响。^①

进一步来看,比较表-5中不同国家组合对应的两种零假设的检验结果,可以明显地看出,总体而言,对零假设为“贸易不是冲突的原因”检验结果的显著性,要远大于零假设为“冲突不是贸易的原因”检验结果。这表明,在东亚国家之间,虽然相互间的贸易与冲突/合作具有双向格兰杰因果关系,或者说互为格

① 这也在一定程度上解释了为什么这些经济体之间在一定时期内会出现“政冷经热”的现象。

兰杰因果关系,但就整个东亚地区而言,贸易是政治的原因要比政治是贸易的原因更为显著。

(二) 脉冲响应函数分析与方差分解

以上通过格兰杰因果检验验证了国际贸易与冲突之间的因果关系,证明贸易与冲突之间互为因果关系。以此为基础,我们可以利用克里斯托弗·西姆斯(Christopher Sims)^①提出的向量自回归(vector auto-regression, VAR)技术进行脉冲响应函数(impulse response function)分析。脉冲响应函数是用来衡量随机扰动项的一个标准差冲击对其他变量当前和未来取值的影响轨迹,它能够比较直观地刻画出变量之间的动态交互作用及效应。通过脉冲响应函数,我们可以进一步探索二者之间的动态关系。

为了简单起见,我们将前面所选的8对国家之间在不同年份的贸易量加总并将其作为国际贸易变量指标,^②用 tr 表示;将这些国家之间在不同年份的冲突积分加总并将其作为冲突变量,用 ci 表示。根据 AIC 和 SC 取最小的准则,我们建立国际贸易与冲突之间如下形式的 VAR(2) 模型:

$$\begin{aligned}ltr_t &= \alpha_{11}ltr_{t-1} + \alpha_{12}ltr_{t-2} + \beta_{11}ci_{t-1} + \beta_{12}ci_{t-2} + \varepsilon_{1t} \\ci_t &= \alpha_{21}ltr_{t-1} + \alpha_{22}ltr_{t-2} + \beta_{21}ci_{t-1} + \beta_{22}ci_{t-2} + \varepsilon_{2t}\end{aligned}\quad (3)$$

其中 ltr_t 是贸易变量 tr 的对数形式。在上面的 VAR 模型的基础上,可以利用脉冲响应函数来分析国际贸易变量与冲突积分变量在短期内如何相互影响。对于上述 VAR 模型的估计方程,我们通过 Eviews5.0 计量软件绘制了如下的脉冲响应图。

图-3 中横轴表示追踪期数,这里为 10;纵轴表示被解释变量对解释变量的响应程度,两条虚线代表两倍标准差的置信带。图-3 中左边的图形反映了贸易对冲突的一个标准差的冲击产生的脉冲响应函数图。从该图可以看出,当冲突变量在本期存在一个标准差的冲击后,国际贸易变量在前三期都存在一个负

^① Christopher A. Sims, "Macroeconomics and Reality," *Econometrica*, Vol. 48, No. 1, 1980, pp. 1-48.

^② 前面进行格兰杰因果检验时由于考虑了方向性,因而中国—菲律宾与菲律宾—中国是不同的组合。但这里并不需要考虑方向性,因此最初是 9 对国家,而进行脉冲响应函数分析时是 8 对国家。

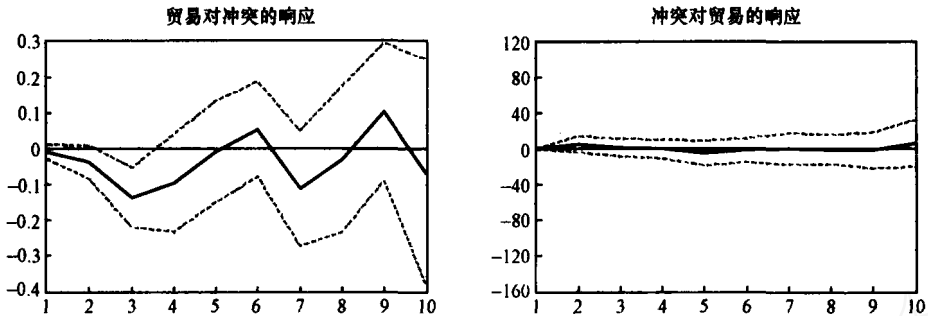


图-3 贸易与冲突之间对一个标准差冲击的脉冲响应

响应,且在第三期达到一个最大负响应点,然后逐渐回升,第六期回升到一个最大正响应点,然后上下波动。这表明武力冲突在短期内会使相互冲突的国家之间的贸易减少,但随着时间推移,武力冲突对贸易的这种抑制效应会有所减弱。图-3 中右边的图形反映了冲突变量对贸易变量的一个标准差的冲击产生的脉冲响应函数图。从该图可以看出,贸易对冲突的影响并不明显。这表明,在短期内国际贸易的和平效应并不显著。

事实上,我们还可以利用 VAR 模型中的方差分解方法,进一步考察国际贸易与冲突之间的动态特征。方差分解方法的基本思想是,把系统中每个内生变量的变动按其成因分解为与各方程随机扰动项(信息)相关联的各组成部分,以了解有关变量的变动对模型内生变量的影响大小或相对重要性。

本文利用方差分解技术分析了国际贸易(冲突)变量的变动对冲突(国际贸易)变量变动的贡献率,具体结果如下表-6 所示。

表-6 包括两个不同的部分,左边的是 lir 的方差分解表,右边的是 ci 的方差分解表。从表-6 中的方差分解结果可以看出,国际贸易变量的波动在第一期只受自身波动冲击的影响。但从第二期开始,自身的扰动逐渐下降,而冲突扰动的影响开始显现。到第三期时,冲突扰动的影响有显著增加,这种增加趋势一直延续到第五期,达到最高的 52% 左右。这表明,在第五期国际贸易变量的变动中有 52% 的变动是源于冲突的扰动。不过从第六期开始,冲突的扰动对贸易的影响又逐渐减弱并趋于稳定。从表-6 中的方差分解结果可以看出,尽管从第一期开始国际贸易的变化对冲突积分的变量变化就有一定影响,但这种影响相对较小,而且从第二期开始,这种影响趋于稳定。

表-6 方差分解分析的结果

追踪期数	ltr 的方差分解表			ci 的方差分解表		
	S. E.	ltr	ci	S. E.	ci	ltr
1	30.30320	100.0000	0.000000	0.040971	96.73458	4.265421
2	33.58713	88.02054	11.97946	0.075486	93.65645	6.34355
3	36.43141	64.33104	35.66896	0.159989	89.51098	10.48902
4	37.17269	58.21529	41.78471	0.187320	89.69271	10.30729
5	41.30724	48.32377	51.67623	0.187698	87.38049	12.61951
6	43.49868	59.41705	40.58295	0.196871	88.46143	11.53857
7	43.77069	62.74942	37.25058	0.226816	88.51099	11.48901
8	48.31572	63.77261	36.22739	0.230174	89.49046	10.50954
9	49.05304	79.66009	20.33991	0.253258	89.32591	10.67409
10	62.49229	79.54850	20.45150	0.262655	87.20745	12.79255

因此,方差分析结果表明,对于东亚国家整体而言,国际贸易与国际政治二者之间互为因果关系。不过,国家间政治关系对国家间的经贸活动的影响要大于经贸活动对国家间的政治关系的影响。

四、个案分析

根据以上检验结果,我们可以得出两个结论:(1) 在所有检验的 9 对国家中,贸易构成国家间政治的原因,且具有显著性,^①而对“冲突是贸易的原因”的检验结果却并不一致:在有些国家之间,冲突是贸易的原因,而在另外一些国家之间,冲突并不构成贸易的原因;(2) 基于东亚国家的整体贸易与冲突数据,我们发现,东亚地区的政治关系对经贸活动的影响,要大于经贸活动对其政治关系的影响,经贸活动(或者说经济相互依赖)对政治关系的影响非常微弱。需要指出的是,这个结论是针对东亚国家的整体贸易与冲突数据而得出的,考虑到不同国家之间现实情况的差异,这个结论与个别国家之间的情形不一定完全吻

^① 虽然限于篇幅,还暂时无法确定是正相关还是负相关。但通过世界范围内冲突下降、世界出口上升的趋势来看,可以确定基本的发展趋势是,贸易的增加将有利于减少军事冲突的发生。

合。下面我们根据因果分析的结果,选取几个典型的案例,对以上检验结果进行分析和解释。

(一) 贸易对政治关系有显著影响:中国与日本

表-5 中的检验结果表明,中国—日本对应的检验结果非常显著。考察中日两国间的政治、经济发展的轨迹可以发现,经贸合作在两国关系中发挥着基础性作用,成为两国政治关系发展的重要推动力。在考察期内,中日两国间的经贸合作至少在两个方面推动了中日政治关系的发展。

首先,中日之间的贸易和经济交往,成为冷战结束后日本率先打破美国对中国经济封锁的重要原因之一。1989 年政治风波之后,以美国为首的西方国家纷纷采取了中止对华合作、互访交流、经贸往来等制裁措施,日本也做出了大致相同的反应:无限期延长了日中投资促进大会的召开,把对华投资的保险费从“优惠国待遇”提高到“注意国待遇”;实际冻结了第三批日元政府贷款和日中友好环境保护中心等经济协作项目;并向经济团体发出劝告,希望各企业在华机构暂时停止对华业务。两国的经济关系虽受到影响,但在 1989 年到 1993 年间,仅 1990 年双边贸易出现负增长,而在 1991 年之后,双边经济贸易保持了高速增长,这为稳定两国关系打下了坚实的基础。正是由于这种坚实的经济基础,日本海部俊树首相才能冲破各种阻力率先实现访华。海部访华后,西方国家逐步恢复了与中国的往来,西方对中国的制裁被打破。1992 年江泽民总书记访日,随后日本明仁天皇访华,这两次访问将中日友好关系推向了一个新的高潮。

其次,20 世纪 90 年代以来,在政治安全、历史问题、领土问题等诸多方面,两国之间频繁出现分歧和摩擦。^① 即便如此,双方之间的经贸往来并未受到明显影响,成为推动中日关系发展的“助推器”(参见图-4)。这一方面是由于中日两国经济具有很强的互补性,中国的经济发展需要日本的资金和技术。日本以贸易和技术立国,资源匮乏,市场相对狭小,需要中国的资源和市场,这种互补性为两国经贸关系的发展提供了较大的发展空间;另一方面,两国经济界的

^① 参见黄大慧:《中日关系发展 30 年》,《教学与研究》2008 年第 11 期。

友好团体和人士,也为推动困难时期的两国经贸关系发展做出了很大贡献。中日两国经济界通过“中日民间人士会议”、“中日友好二十一世纪委员会”、中日能源合作论坛等民间渠道,加强双方之间的联系与沟通。与此同时,日本经济界许多知名人士多次率团访华,就中日贸易问题,积极与中国政府及企业界展开协商,努力加强两国在经贸领域的沟通与合作。

因此,中日双边贸易对于促进两国间的交流、稳定和平衡双边关系发展、避免冲突升级发挥了非常重要的作用。有人认为,中日间的贸易和经济相互依赖构成了中日间冲突的源泉。^①但是,在很大程度上,中日两国间的军事冲突并非由贸易等经贸活动引发。因此设想一下,假如没有中日间密切的经济交往,那么双边关系将远非现在这样乐观。

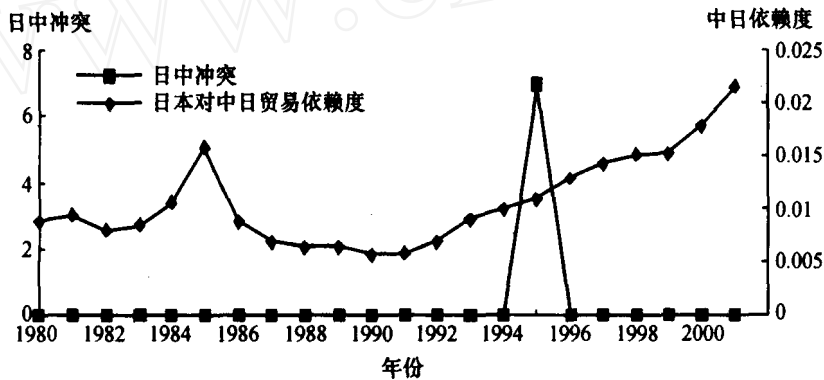


图-4 1980—2001年间日中冲突与日本对中日贸易依赖度

(二) 政治冲突对贸易有显著影响:中国与越南

1949年以来,中国与越南的关系非常具有戏剧性。20世纪50—60年代两国关系是“同志加兄弟式”的密切友好关系。但在20世纪70年代后期到80年代,甚至两国关系恶化,爆发了边界战争。1990年9月,两党、两国领导人在成都秘密会晤。1991年11月越南党政高级代表团访华,一度处于抗衡对峙状态的中越关系开始实现重大突破,最终实现了正常化。此后,两国开始逐步建立起战略层次的合作关系,虽然偶有冲突,但是政治关系始终正常发展。在考察

^① 于铁军:《国际政治理论与中日历史问题》,《太平洋学报》2003年第3期。

期内,两国间发生的军事冲突可参见图-5。^①

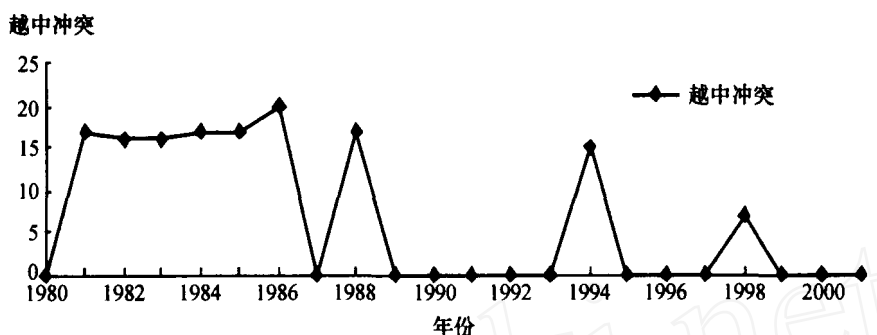


图-5 1980—2001年越中冲突

相应地,在1980—1991年间,两国间的贸易水平一直较低,而在1991年实现关系正常化后,两国之间的经济交往日益密切。国际货币基金组织的数据显示,除了1980年的数据不可获取外,1981—1989年间中越双边的贸易数据几乎都为零;而从1990年开始,双边贸易额则以加速度增长,如图-6所示。

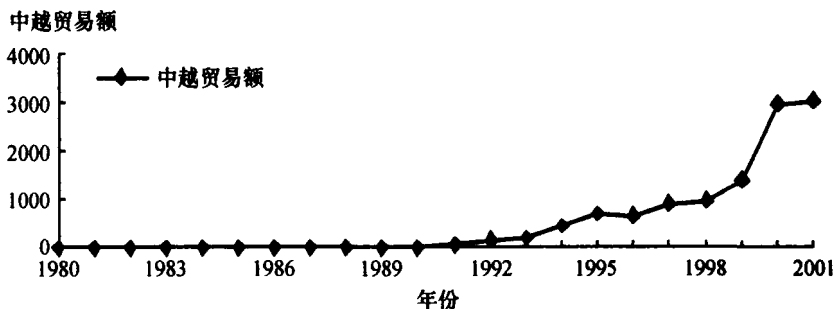


图-6 1980—2001年间中越之间的贸易额(单位:百万美元)

因此,在考察期内,中越改善政治关系几乎与经济关系飞速发展同步,政治关系始终影响着考察期内的中越经济关系,这主要有以下几个原因:(1)在经历了两国关系的极度恶化后,两国间的传统经济联系被切断,开展经济交往的基础设施和条件皆不具备,这需要两国政府创造条件,鼓励和刺激双边的经济交往。以铁路为例,1978年,由于双边政治关系的恶化,从1955年开始的两国

^① 关于中越关系的发展,参见项东:《中越关系新发展与经贸合作新机遇》,《南洋问题研究》2005年第3期;郭明:《正常化后的中越关系》,《东南亚纵横》2002年第1期。

铁路客货联运中断,直到 1996 年才恢复运行。铁路中断极大地影响了双边的交往和经贸交流。^① (2) 两国都是发展中国家,发展阶段相似,经济互补性不强,双边经贸往来的动力不是很强。此外,中越皆为社会主义国家,政府对经济活动的干预较多,尤其是在 20 世纪 90 年代以前,两国都还处于改革开放的摸索阶段,政府力量对经济活动的介入较多,社会力量对经贸活动的介入必须考虑政府的偏好和政策,因此很容易受到政治关系的影响。如果两国双边政治关系恶化,则可能完全切断经济往来。例如 1980—1991 年间中越之间完全没有贸易交往;但如果政治关系改善,双边的经贸交流会迅速增加(如 1992—2001 年之间)。

(三) 政治关系对贸易没有显著影响:中国与日本

在考察期内,中日之间的政治关系对双边贸易并没有显著影响。两国分别于 1995 年、1996 年和 1999 年发生过冲突,但是双边贸易继续保持增长的势头,如图-2 和图-7 所示,中日贸易额以及日本对中日贸易的依赖度始终保持增长的势头。

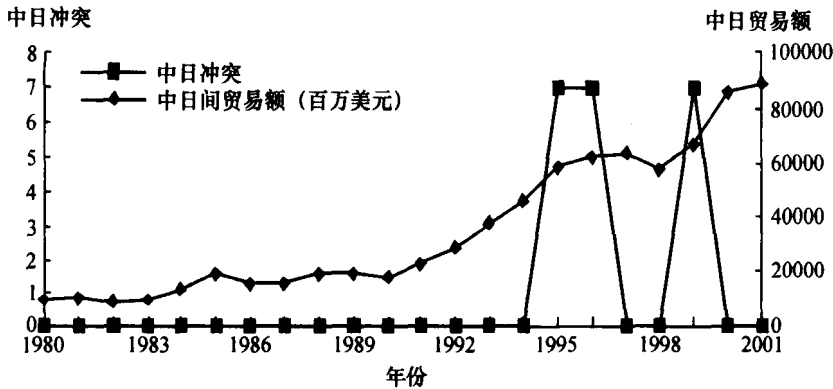


图-7 1980—2001 年间中日冲突与中日间贸易额

我们可以从国际大背景以及中日双边经贸交流的特点来考察这个问题：首先,在全球化的背景下,和平与发展已然成为大趋势。每个国家都希望

^① 孙兰芝:《中越关系的回顾与展望》,《当代世界与社会主义》2001 年第 3 期。

能够在世界经济中获得一部分利益,合作成为各国的必然选择,东亚国家内部经济一体化和区域化趋势因而日益加强。在这种大趋势的推动下,每个国家都希望参与这一进程,获取经济利益。即便由于各种原因出现了冲突,双方也尽量避免冲突升级,以免影响经济决策和经济福利。尤其是作为东亚区域内的两个大国,中国和日本更是难以承受冲突所带来的损失。每当双方遇到各种问题如教科书问题、参拜靖国神社问题、光华寮事件等,“两国往往能以大局为重,尽量不使事态扩大,妥善加以解决或予以排除。”^①

其次,从中日贸易的性质和特点来看,在考察期内,社会力量逐渐发展成为中日贸易的主导性力量。二战结束后,中日双方由于经济上的互补性,迫切需要恢复两国间的经济联系。到1980年,双边的经贸活动就已经达到较高的水平,具有了一定的基础。随着两国经济相互依赖水平的提高,民间贸易和资本日益壮大。民间资本的动力在于追求利润,他们更多地是出于经济考虑,只要有利可图,他们与国家并不必然采取一致的立场。国家并不是如“弹子球”似的行为体,其决策是各种社会力量不断介入和博弈的过程。随着双边社会力量更多的介入,以及社会基础设施的完善,经济交往开始具有了自身独立的轨迹。^② 即便是在1989年至1993年间,中日之间的贸易也并没有被完全切断。

总而言之,比较考察期内的中越关系与中日关系,我们可以发现以下不同点:中越间的贸易较易受到政治关系的影响,而中日之间的经贸关系却不易被政治关系影响。不仅如此,中日间贸易对政治关系的推动作用,要远远大于中越间贸易对政治关系的推动,通过以上案例分析,本文认为,这主要是由于以下三个原因:

(1) 中越作为两个发展中国家,经济互补性不强,而中国和日本分别是发展中国家和发达国家,双边的经济互补性很强,经济合作的动力很强,这有利于社会力量介入双边经贸活动。

(2) 从经济相互依赖(贸易)的程度来看,中越由于历史上的传统贸易联系被切断,1992年建交时双边贸易还处于初步发展阶段,开展经贸往来的基础

^① 黄大慧:《中日关系发展30年》。

^② 刘江水:《中国与日本:变化中的“政冷经热”关系》,北京,人民出版社2007年版。

设施和条件都还不具备,因此必须要求双方政府加以鼓励和引导。虽然中日之间建交时间也不长,但自二战后就一直保持了经济联系,双边交往的基础设施和条件基本具备,到1980年双边的相互依赖已经具备一定的规模,社会力量介入较多,而不再仅仅依靠双边政府的推动。换言之,在经济相互依赖发展的初期,贸易容易受到政治关系的影响,但当两国关系发展到比较高的依赖程度,基础设施已然具备时,政府的推动作用下降,而经济、市场因素本身的影响力上升。此时,双边经济关系受政治关系的影响相对下降,易出现“政冷经热”的局面。

(3) 出于维护自身利益最大化的考虑,参与对外贸易活动的企业和个体极力参与政治,稳定双边关系,以免给自己的投资带来政治风险。因此随着双边经贸关系的发展,参与贸易活动的个体和企业也越来越多。参与双边经济交往的社会力量,不仅有强烈的愿望来影响国家决策,而且其参与能力也逐步扩大。两国经济交往的日益密切和整合需要较长时间,从而贸易对政治关系的影响也是一个逐步扩大的持久过程。

通过分析和比较中越与中日两个案例,本文认为,贸易与国家间政治的相互作用取决于经济相互依赖程度以及政府力量与社会力量的博弈,具体而言:

(1) 当两国间的经济交往水平较低时,贸易容易受到双边政治关系的影响:当政治关系恶化时,双边的经贸发展受到抑制,但政治关系改善后,又将推动双边经贸关系迅速发展,这一点恰如中越之间、泰国与缅甸之间的关系发展所示;当贸易水平较高时,政治关系的波动虽在短期内影响双边贸易,但是并不会出现大的波动,此时极易出现“政冷经热”的局面,例如中日之间。

(2) 当社会力量更多地介入双边经济活动时,双边的经贸活动不容易受到政治关系和政治冲突的影响;当政府更多地干预和指导双边经贸活动时,双边的经贸交往更容易受到双边政治关系的影响。而这两个变量往往又是结合在一起,国家间的相互依赖程度高,社会力量则会更多地介入双边交往,而国家间的相互依赖程度较低时,社会力量会更多地考虑政府的偏好和政策。

通过这两个结论再反观察察期内整个东亚地区的经济合作状况可以发现:在1980—2001年间,东亚地区主要国家间的冲突对贸易的影响非常之大,而贸易对政治关系的影响虽稳定但却微弱。这意味着,在1980—2001年之间,整个

东亚地区的经济合作还处于起步阶段,基础设施匮乏,民间和社会资本对地区合作的参与度不高,力量也较弱小,合作的深度和广度都还处于初级水平,整个地区的合作动力不够。

五、结 语

通常我们在分析国家间的政治经济关系时,或者认为政治决定经济,如重商主义者;或者认为经济决定政治,如自由主义者;或者认为政治与经济之间存在着互动,如马克思主义者。但往往局限于定性分析和主观推断,对于政治与经济之间的因果关系,绝大部分研究并未做出更为明确的回答。本文基于1980—2001年间东亚国家之间贸易与政治关系(冲突)的数据,利用格兰杰因果检验模型,实证检验了贸易与国家间政治二者之间的格兰杰因果关系,并利用脉冲响应函数以及方差分解方法,考察了二者之间的影响情况。本研究的主要结论是:第一,在某些东亚国家之间,国际贸易与国际政治之间具有双向因果关系;第二,就整体而言,东亚地区政治关系对其地区经贸活动的影响,要大于地区经贸活动对其政治关系的影响。

虽然格兰杰因果检验表明在一段时期内如何通过考察国家之间的经贸活动(政治关系)来预测国家之间的政治关系(经贸活动),但当我们采取动态视角看待这一问题时会发现,贸易与国际冲突/合作间的关系会随着时间的变化而改变。国家间政治经济关系很可能遵循着如下的发展轨迹:起初,两国政治关系友好,推动两国贸易达到一定的水平。达到一定的水平后,双边的经济交往发展成为独立于政治关系的力量,不再轻易受到政治关系的影响,此时一旦由于某些外在原因致使政治关系波动,贸易不易受影响,很可能出现一种“政冷经热”的情况。不仅如此,从自身利益出发,参与对外经济合作的企业和个体不仅有意愿而且有能力影响政府决策,稳定双边关系,以避免损失。

由此观之,从整体来看,东亚地区的经济活动更容易受到政治关系的影响,而地区经济活动对国家间冲突的影响非常微弱。因此这在一定程度上表明,东亚地区经济合作进程在1980—2001年间一直处于起步阶段,政府力量在推动经济合作的过程中居于主导地位。

最后,需要指出的是,因果检验只是表明两个变量之间是否存在格兰杰因果关系,这只是确定了两者之间一种比较粗略的关系,至于如何评估两者之间的影响大小与方向,需要做出进一步的研究。^①另外,上述实证检验的样本选自东亚地区的一些主要国家,考虑到国家的发展程度、文明传承以及人文地理等因素的差异,本文的结论是否具有普世性尚需进一步考证。

^① 可参见邝艳湘:《国际贸易和平效应的演化:理论与实证研究》,《数量经济技术经济研究》2009年第5期;庄宗明、蔡洁:《国际贸易消减国际冲突的理论与经验分析:以亚洲国家为例》,《世界经济》2008年第9期。

作者简介

邝艳湘 中南大学政治学与行政管理学院讲师。2002年、2005年在湘潭大学分别获经济学士学位和法学硕士学位,2008年在外交学院获博士学位。研究方向为国际政治经济学、相互依赖理论。

Email:kyx0713@163.com

向洪金 西安交通大学金禾经济研究中心博士候选人。2005年在湘潭大学获经济学硕士学位。研究方向为国际贸易理论和政策。

Email:xhjin2006@163.com

李莉 合肥工业大学人文经济学院讲师。2009年在复旦大学国际关系与公共事务学院获法学博士学位。研究方向为美国国会与中美关系。

Email:grass1118@126.com

李彬 清华大学国际问题研究所教授。1985和1988年在北京大学分别获技术物理专业学士和硕士学位,1993年在中国工程物理研究院获理学博士学位。1993—1999年在北京应用物理与计算数学研究所军控室工作,1999年8月在中国青年政治学院工作。最新著作为《军备控制理论与分析》(2006年)

Email:libin@mail.tsinghua.edu.cn

齐皓 清华大学国际关系学系博士候选人。2004年在黑龙江大学获英语语言文学学士学位。2006年在哈尔滨工业大学获应用语言学专业硕士学位。研究兴趣为国际环境机制理论。

Email:qi-h06@mails.tsinghua.edu.cn

孙学峰 清华大学国际关系学系副教授。1997和2000年在国际关系学院国际政治系分别获法学学士、硕士学位,2006年在清华大学获法学博士学位。著有:《国际关系研究实用方法》(合著,2007年)、《中国崛起及其战略》(合著,2005年)。

Email:sunxuefeng@mail.tsinghua.edu.cn

杨原 清华大学国际关系学系2008级硕士研究生。

Email:yyir@163.com