

关于“幸福悖论”研究的若干争议^{*}

陈永伟

内容提要:幸福悖论是指收入增长但却不能提升居民幸福的经济现象。这种现象因其所蕴含的丰富福利内涵及政策含义而受到研究者和政策制定者的普遍关注,在学术研究中形成了一系列的争议。主要包括:幸福能否度量效用的争议;幸福悖论是否真实存在的争议;在解释和检验幸福悖论的过程中,对计量方法和实证结果的争议。本文对这些争议进行系统梳理和评析,既为中国居民幸福问题的研究提供理论和方法上的启示,同时也揭示了后续研究可以进一步扩展的方向。

关键词:幸福悖论 收入 幸福 收入比较理论

在经济学中,幸福通常被定义为效用的一个可度量变量。这样,从经济理论上讲,一个基本的逻辑推论就是,收入增长可以通过提高居民消费而改善居民幸福。但是,Easterlin(1974)利用美国的时间序列数据研究发现,自1946年以来,收入增长并没有提高居民的幸福感。随后,Easterlin(1995)将这一结论进一步扩展到日本和9个欧洲发达国家。由于Easterlin首先提出这一问题,因此该问题也被称为Easterlin悖论,为表述方便,本文后续称其为幸福悖论。目前,世界上各主要发达国家和发展中国家先后均经历了幸福悖论现象(Easterlin et al, 2010),因此,对幸福悖论的研究以及解释也就成为国内外学者和政策制定者共同关注的话题。国际上,专门有一本收录在SSCI中的《幸福研究期刊》(*Journal of Happiness Studies*)讨论居民的幸福问题。Easterlin本人也因为对幸福悖论研究的贡献,于2002年当选为美国国家科学院院士,2006年评选为美国经济学会联合会杰出院士。

在研究和解释幸福悖论的过程中,学术界产生了许多有价值的理论观点、研究方法和实证结论,但同时也存在一些较明显的学术争议以及计量方法上的不足,这给我们后续的研究带来了困难。特别地,中国的经济发展和居民幸福也已经表现出显著的悖论现象。利用世界价值观调查数据计算发现,1990—2012年间,中国居民的收入水平快速提高,但是

平均幸福感仅从1.946小幅增加到2.006^①。并且区分居民性别、年龄和婚姻等维度看,在此期间的居民幸福感也没有表现出明显的上升趋势。因此,如何解释中国的幸福悖论现象,对于制定以提高居民幸福为目标的政策将具有重要意义。同时,中国正处在经济和社会快速转型和发展阶段,准确把握这一阶段居民幸福的动态趋势也具有突出的现实意义。本文系统梳理了国内外关于幸福悖论研究的文献,特别是对幸福悖论研究中的若干争议进行了评述,以期为我国居民的幸福问题提供一些理论和方法上的启示。

一、关于幸福能否度量效用的争议

幸福悖论存在的理论基础是,幸福是居民效用的可度量变量,这也是经济学家长期坚持的假设。例如,埃奇沃斯等人认为,幸福是瞬时效用在时间轴上的累积积分(Kahneman & Krueger, 2006)。但是从调查数据来看,幸福毕竟是一种主观心理上的感受和评价,在问卷调查中,我们通常依赖问题“总的来看,你认为自己是否幸福?”及回答“很幸福、比较幸福、不太幸福、很不幸福”等来收集数据^②。那么,这样获得的数据是否具有真实的经济含义?能否作为效用的稳健并可靠的度量变量?现有文献对这一问题进行了深入讨论。

在一项实验中,Bertrand & Mullainathan(2001)

^{*} 陈永伟,中南财经政法大学统计与数学学院,邮政编码:430073,电子邮件:yongwei@zuel.edu.cn。本文受教育部留学回国人员科研启动基金项目资助。作者感谢审稿专家的意见,当然文责自负。

发现,调查中对幸福问题的回答会依赖于问题本身出现的先后顺序。如果在调查幸福之前首先提问“你会隔多久出去约会一次?”,那么,幸福调查的结果与该问题的回答会存在很大的相关性。但是如果在调查幸福之后再提问“你会隔多久出去约会一次?”,那么,幸福调查的结果与该问题的回答则不相关。其次,对幸福问题的调查通常是基于被调查者对过去一段时间(如一年)的回顾和总体评价,但是这种回顾和评价是存在认识偏误的,离调查时间较近的生活经历会对被调查者的回答产生较大的影响。Schwarz & Clore(1983)指出,调查时被调查者的情绪甚至是周围的天气情况都有可能影响被调查者对幸福问题的回答。进一步地,Schwarz(1987)还做了一项随机实验,在调查幸福问题之前,如果首先要求被调查者去帮忙复印一页纸,并在复印机上随机地放置一角钱,那么最后会发现,那些获得额外收入的被调查者会比没有获得收入的被调查者更幸福。

与上述研究相反,也有大量文献从多个角度进行分析,论证了幸福调查数据的合理性及有效性。(1)部分研究文献从被调查者的家属或朋友角度着手,要求他们对被调查者的幸福状态做出评估,结果发现家属或朋友给出的评估结果与被调查者自身报告的幸福状态基本一致,由此说明被调查者自身报告的幸福数据具有可靠性(Pavot & Diener, 1993; Sandvik et al, 1993)。(2)心理学家也从生理的角度进行研究,因为幸福或不幸福的状态可以从生理指标上进行监测,结果他们发现被调查者报告的幸福确实与生理上的“杜氏微笑”(Duchenne smile)及心率和血压存在显著的相关性(Eckman et al, 1990; Shedler et al, 1993; Layard, 2005)。Urry et al(2004)研究指出,从医学上看,大脑左前额皮层通常控制个人愉悦的活动,右前额皮层与厌恶或不快乐的情绪相联系,当要求被调查者观察开心的画面或回顾幸福的事件时,其左前额皮层确实更活跃,反之则右前额皮层活跃。因此,医学监测的结果也与居民的幸福反映相一致。(3)Oswald & Wu(2010)利用美国各州居民的大样本数据进行匹配研究发现,那些报告生活幸福的居民,其生活质量和标准也基本相似。进一步地,Krueger & Schkade(2008)对幸福调查的主观数据进行客观性和有效性检验之后发现,幸福变量的可靠性要低于教育、收入等客观性指标,但却足够用于经济分析的目的。在对幸福数据进行评估之后,Hollander(2001)指出,在经济学上使用幸福数据是有意义的,可以利用这

些数据来分析和识别使居民获得幸福的生活环境和经济条件。

因此,从现有的文献研究看,幸福作为居民效用的可度量变量,目前已经被广泛接受并应用于经济分析。例如,Blanchflower et al(2014)使用幸福数据研究了社会通胀和失业的福利成本。Chuluun & Graham(2016)使用幸福数据分析了地区居民幸福感对企业投资行为的影响。幸福被引入经济学的分析也被认为是对经济学的一次革命(Frey, 2010)。

二、关于幸福悖论是否存在的争议

在检验幸福变量的合理性之后,对幸福悖论提出的第二个质疑是,幸福悖论是否确实存在?因为Easterlin(1995)是利用人均GDP和平均幸福水平对美国、日本和9个发达的欧洲国家进行检验,发现存在幸福悖论现象。但是,宏观总量上的平均数据容易忽视个体(居民)差异,那么,总量上成立的幸福悖论是否在微观个体层面也成立?这也是在幸福悖论的检验中,使用微观个体数据成为主流趋势的原因。并且,发达国家的收入水平相对较高,可以保障居民生活的基本需求,这有可能使得收入在满足居民生活的基本需求之后对居民幸福的影响不显著。但是发展中国家和转型国家的收入水平相对较低,因此,在发达国家成立的幸福悖论是否在经济转型和发展中国家也成立?基于现有文献在检验幸福悖论过程中使用数据的特征,本文从微观和宏观两个角度进行总结和评述。

(一)基于微观个体收入角度检验幸福悖论

从个体角度看,如果幸福悖论成立,那么高收入居民的幸福不会显著高于低收入的居民,或者随着个体收入水平增长,居民幸福感没有显著提高。例如,Brockmann et al(2009)对转型国家中的代表——中国进行研究,基于世界价值观调查的样本数据发现:从个体横向比较看,收入处在四分位数上居民的幸福没有显著高于收入处在二分位数上的居民;同时也低于收入处在三分位数上的居民,从时间序列的角度看,1990—2000年间,中国农村居民的平均收入水平从686元上升到2253元,城镇居民收入从1510元上升到6280元,但是居民幸福感在城镇和农村居民中却都出现下降。Paul & Guilbert(2013)利用澳大利亚家庭收入和劳动动态调查数据的研究发现,澳大利亚存在典型的幸福悖论现象。

但是,也有大量文献认为幸福悖论现象不存在。比较典型的是,Di Tella et al(2003)使用12个欧洲

国家 1975—1992 年间的大型微观调查数据进行研究,发现幸福是收入的单调递增函数,且不同国家之间的结果基本相似,这个结论即使在控制个体特征变量以及国家和时间之间的差异之后也不会发生变化。Lelkes(2006)对匈牙利转型国家的样本数据进行研究,发现收入与幸福正相关,且相关性要显著高于发达国家。Sacks et al(2012)使用盖洛普调查数据对全球 25 个国家(包含发达国家和发展中国家)的样本进行研究也发现,收入增长可以提高居民幸福,他们同时认为,大家广泛接受的收入比较理论难以解释居民幸福的变化。

(二)基于宏观人均 GDP 角度检验幸福悖论

在从宏观角度分析幸福悖论的研究中,Blanchflower & Oswald(2005)使用国际社会调查项目提供的数据对澳大利亚的情况进行分析,发现澳大利亚在英语系国家中的人类发展指数^③排名居首,但是居民幸福水平却排名底部,因此认为澳大利亚存在显著的幸福悖论现象。但是,Leigh & Wolfers(2006)的研究指出,这种排名比较的分析方法是不可靠的,因为人类发展指数在英语系国家的差别都比较小,且幸福水平的度量也存在一定的误差,仅从排名比较的分析上不能断定澳大利亚存在幸福悖论现象。实际上,只要将 Blanchflower & Oswald(2005)提供的人类发展指数和幸福数据画在二维坐标图上就不难发现,人类发展指数和幸福存在正向的拟合关系,且澳大利亚恰好处在正向的样本拟合直线上。进一步地,Leigh & Wolfers(2006)将人类发展指数替换为人均 GDP 或者使用其他调查数据库(世界价值观调查)的研究也同样发现,澳大利亚不存在幸福悖论现象。

最近,Easterlin et al(2010)对幸福悖论的质疑作了一个最新的回复,重新检验了 17 个拉美国家、17 个发达国家、11 个东欧转型国家和 9 个亚非洲欠发达国家 10 年以上的样本数据,最后得出结论:长期来看,收入对幸福的影响是不显著的;那些质疑悖论的研究,其结果在统计上是违反事实的,或者是把收入和幸福的短期正向关系当成了长期关系。

综上所述,有关幸福悖论是否存在的争议,一方面引起研究者对如何准确调查测度幸福的变量以及基于不同的调查方法(即不同的数据库)获得的幸福数据是否具有稳健性的反思,另一方面也引起研究者对研究中所使用的计量方法的广泛讨论。

三、关于解释幸福悖论的争议

现有研究在解释幸福悖论的过程中形成了三种

主要的理论,这三种理论在本质上具有统一性,但在实证检验中,基于这些理论解释的实证结果却产生了相反的结论,由此引起研究者对计量方法的深入讨论和争议。本部分将着重从理论解释和实证研究两个方面梳理文献中的争议。

(一)理论解释的分歧与统一

幸福悖论的第一种理论解释是从收入比较(comparison income)或相对收入差距的角度出发,认为收入增长可以提高居民幸福,但是在收入增长的同时,如果相对收入差距也在扩大,那么,他人收入以更快速度增长会显著降低自己的幸福。这种理论假设社会存在普遍的攀比心理,基于此,Clark et al(2008)将个人效用扩展为自身收入以及社会比较收入的函数,并且效用是社会比较收入(以社会平均收入水平表示)的递减函数,由此他们推导出收入比较对居民幸福产生的负向影响。收入比较理论也是目前解释幸福悖论的主流理论。

对幸福悖论的第二种理论解释是从收入适应性(Income adaptation)的角度出发,认为收入增长可以提高居民幸福,但是这种作用是短暂的,随着人们开始适应新的收入水平后,收入增长对幸福的提升作用会消失(Paul & Guilbert, 2013)。在模型检验上,这种理论将居民的适应能力(即适应性收入)假设为以往收入的函数,其中以往收入通常用上一期的收入值表示。因此,与上一期收入相比,当居民对本期收入增长能够完全适应时,收入增长不会对居民幸福产生促进作用;当居民对本期收入增长出现部分适应时,收入增长可以在一定程度上发挥促进居民幸福的作用;当居民对本期收入增长完全不能适应时,收入增长就会充分发挥促进居民幸福的作用。由上可知,现有收入适应性理论假设居民对收入增长的适应调整是在一期(如一年)内完成的,但是,如果居民在过去一段时间内的收入水平存在波动,那么收入适应的调整过程也应被相应延长。基于此,Paul & Guilbert(2013)将收入适应性函数扩展为过去多期收入值的函数,即收入适应调整的能力可以在过去多期内进行平滑。但是,另一个值得讨论和改进的地方是,现有收入适应性函数通常假设为过去收入值的线性函数形式,而从心理学上看,居民对过去收入的适应调整过程应该更适合非线性函数的形式。那么,应该如何设定和检验收入适应性函数的具体形式?进一步地,如果收入适应存在调整的过程,如何刻画收入对幸福的效应随着这种调整产生的具体动态演变过程?这些问题目前仍不

明确,在这一方向上也需要进一步深入研究。

对幸福悖论的第三种理论解释是从期望收入(aspiration income)的角度出发,认为个人会根据自己收入水平的变化调整自己期望将来获得的收入。当个人收入出现增长时,他们会进一步要求自己将来获得更高的收入,而期望的收入水平越高,居民的幸福感会越低。因此,收入增长对居民幸福产生的正效应就会被期望收入的负效应所抵消,居民幸福感仍在原地踏步,这就是收入增长对幸福影响的“快乐水车”(Hedonic Treadmill)效应。在模型检验中,这种理论假设期望收入是当前收入的线性递增函数,但是,Knight & Gunatilaka(2012)指出,除了当前收入外,居民以往的收入以及周围其他人的收入都有可能作为参考收入,进而影响期望收入。基于此,他们建议将期望收入设定为自身当前收入、以往收入以及周围其他人收入水平的函数,并且随着这三种收入水平的上升,居民会要求将来获得更高的收入。

以上三种理论事实上都可以看成是广义的收入比较理论,不同的是,在收入比较的过程中,传统的收入比较理论选择的参考点是周围其他人的收入,收入适应性理论选择的参考点是自己过去的收入,期望收入理论选择的参考点是自己未来的收入,因此,本质上这三种理论是统一的。

(二) 实证结果的争议

虽然收入比较理论在解释幸福悖论中居于主流地位,但是在实证结果以及基于实证结果的理论再解释上却并没有形成一致结论。

Senik(2008)发现东欧转型国家和美国对收入差距的态度比较乐观,认为个人之间的收入差距对居民幸福会产生正向作用,并将这种作用解释为示范效应,即他人收入水平提高会使自己产生收入同步增长的预期,进而促进居民幸福。关于示范效应,Hirschman(1973)从心理学上给出了支持证据:在一个同向双车道的隧道里发生堵车事故,如果左边车道的交通恢复较快并且开始向前移动,右边车道仍然静止不变,但是右边车道车主的幸福感同样会上升,因为他们会预期到右边车道也会很快通车。因此示范效应有时也被称为隧道效应。Clark et al(2009)按照聚类方法将丹麦划分为9000个小型社区,他们发现邻居收入水平提高会显著增加自己的幸福感。但是,收入差距对居民幸福的促进作用应该以收入流动性为前提,如果收入在不同阶层之间是难以流动的,那么当低收入者看到收入差距扩大

时,就不会产生自身收入向上增长的正向预期,也就不会对居民幸福产生促进作用。因此,对这种作用的解释应该同时检验不同收入阶层居民之间的收入流动性,然而现有研究在这一方面却缺少必要的讨论。

收入比较理论的另一实证结果发现,收入差距对居民幸福产生负向抑制作用。例如,Guven & Sorensen(2012)使用1972—2004年间美国的调查数据研究发现,参考组收入水平提高会降低自己的幸福感;Distante(2013)使用1996—2007年间英国的家庭面板数据研究发现,相对收入对居民幸福的影响具有非对称性,对于高收入群体而言,相对收入差距扩大可以提高居民幸福感;但是对于低收入群体而言,相对收入差距对居民幸福感的影响为负,且作用更显著。他们将这种作用解释为相对剥夺理论,即在收入差距扩大和财富向高收入群体集聚的过程中,低收入群体会发现自己因为处于劣势而产生一种被高收入群体相对剥夺的负面心理,进而影响他们的幸福感。也有研究者将这种负效应解释为低收入群体的嫉妒心理(Senik, 2008)。关于负效应,也可以从前述的隧道案例中进行延伸:在拥堵的隧道中,当左车道的交通已经恢复并且缓慢前行时,右车道车主的幸福感也会上升,因为他们预期到自己所处的右车道也会很快疏通;但是如果右车道的交通在长时期内没有得到恢复,此时右车道车主的幸福感会急剧下降,甚至会比两个车道同时拥堵时的幸福感更低,这也是Hirschman(1973)在论文研究中给出的效应反转现象。由此也进一步说明,收入流动性对形成收入预期以及对幸福感的重要作用。Oshio & Urakawa(2014)认为居民并不知道真实的收入分布形式,他们只能感知到相对的收入差距或主观认为的收入差距,通过使用日本截面数据研究发现,感知到的收入差距对居民幸福感同样会产生负向影响。

(三) 理论解释的新发展

1. 修正的幸福悖论。针对收入比较理论在解释幸福悖论中存在的不足,学术界最近从绝对收入的角度提出了一种修正的幸福悖论思想:收入对幸福的影响存在饱和点(satiation point),在到达一定水平之前(如在个人的基本生活需求被满足之前),收入增长对居民幸福会产生正向促进作用,但在超过这一水平之后,收入再增长对居民幸福的影响不显著。这种理论在思想上因为与马斯洛的需求层次理论相吻合而变得易于接受,但在实证中却缺乏严

格的计量检验和统计证据。Stevenson & Wolfers (2013)以年人均GDP15000美元为界限,在跨国比较中将不同国家划分为贫穷和富裕两种类型,而在分析一国内的居民样本时,同样以家庭年收入15000美元为界限,将居民划分为贫穷和富裕两种状态。在分析国家(居民)收入与幸福之间的关系时,他们基于世界价值观调查和盖洛普调查的样本数据研究发现,收入对幸福的影响不存在上述饱和效应,收入越高的国家(居民),幸福水平也会越高。

但是从研究方法上看,Stevenson & Wolfers (2013)的研究至少在以下两个方面值得讨论:(1)15000美元的划分标准是否适用于所有的国家或者一国内的所有居民,即按照修正的幸福悖论的思想,是否所有国家或国内的所有居民满足基本生活需求的收入水平都是15000美元?从计量方法上而言,他们的缺陷是将区分标准事先假设为外生给定的,但是如果收入对幸福的影响确实存在非线性饱和效应,只是区分标准不在事先设定的15000美元,那么,他们的研究方法就会失效。(2)按照修正的幸福悖论思想,如果收入对幸福的影响存在非线性饱和效应,那么,如何刻画这种非线性变化的过程?并且,在收入到达一定的水平之后,哪些因素会成为新的影响居民幸福的重要因素?这些问题均不明确,也需要进一步的探讨。

2. 幸福的相依性及对悖论的解释。Bolle et al (2009)从幸福相依性的角度对幸福悖论提出了一种新的解释,认为居民幸福不仅依赖于自身收入水平的高低,同时也依赖于周围其他人的幸福水平。由于居民总是会存在厌恶不平等(inequality aversion)的行为和心理,因此当周围人的幸福差距扩大时,这种现象会对居民自身的幸福产生抑制作用,进而抵消由收入增长对幸福产生的促进作用。那么,居民能否准确感知到周围其他人的幸福差距?他们对此进行调查,通过随机采访200位大学生,要求这些大学生报告自己的收入、健康、幸福状态以及这些变量在大学生中的平均值,结果发现每位学生报告的收入、健康、幸福状态值都要高于平均值,显示存在过度自信行为。但是对幸福的过度自信要显著低于收入和健康的感知,因此他们认为居民对幸福差距的感知是可信的。他们还使用幸福水平的平均绝对偏离表示幸福差距,基于Erasmus大学提供的世界幸福调查数据实证研究发现,收入对幸福的影响为正,但是这种效应会被幸福差距对幸福产生的负效应抵消。

Bolle et al(2009)提出的理论在经济学上来源

于相依性效用假设,Becker(1974)指出,个体效用可以看成是自身收入以及周围其他居民效用水平的函数。显然,在信息完全充分可知时,这种假设通过迭代“求解”,最终也可以得到个体效用是自身收入以及周围其他居民收入的函数。这样,居民之间幸福相依性的理论也可以与收入比较理论联系起来,但是在信息不是完全充分可知时,这也是社会的常态,幸福相依性理论就会与收入比较理论存在差别。因此,Bolle et al(2009)所提出的幸福相依性理论是有意义的。但是,该理论在以下两个方面值得进一步分析:(1)如何度量居民之间的幸福差距?该理论用幸福的平均绝对偏离表示,这种度量方法实际上假设幸福是基数型变量,由于该假设在研究中本身就会受到质疑,因此对幸福相依性理论的完善需要进一步研究幸福差距的度量方式。(2)度量多大范围内的居民幸福差距,即与收入比较理论相似,如何限定或明确“周围其他人”的概念?这一问题将对实证结果产生影响,因此也需要进一步明确。

3. 幸福的收敛性。与相依性比较接近的是,部分文献开始关注幸福本身的收敛性趋势。Apergis & Georgellis(2015)指出,如果经济发展的目的是为了提高居民幸福,且各项财政和需求管理政策的实施也是为了平衡本国居民的幸福水平,那么随着经济增长和政策调控,各国居民的幸福水平最终都会收敛到稳定的均衡状态。他们利用欧洲发达国家较长时间的时间序列数据(1985—2002年)研究发现,幸福具有俱乐部收敛效应,其中法国、德国、意大利等国认为自己生活非常幸福的居民比例会稳定在15%左右,荷兰、丹麦、爱尔兰等国认为自己生活非常幸福的居民比例则会收敛到35%左右。更进一步,Mishra et al(2015)认为幸福的变化在时间上会受到自身过去幸福水平的影响,在空间上也会受到周围其他居民的影响,但这种影响会随着社会距离的疏远而减弱。他们将幸福变化的这种时空特性解释为幸福的惯性,在惯性的作用下,幸福会收敛到稳定的均衡状态。同时,幸福也会受到收入、婚姻状态等其他社会经济变量的作用,因此,幸福收敛的过程是复杂的,会表现出非线性收敛的形式。他们基于欧洲国家的样本数据研究发现,幸福存在非常显著的收敛特征,即使出现幸福水平的冲击或者意外事件的影响,在经过3~5年时间的调整后,幸福也会重新回复到均衡水平。

四、关于计量方法上的争议

在对幸福悖论的理论解释进行检验的过程中,

实证结果产生了较明显的分歧,如上所述,这些分歧不仅没有为理论解释提供更多的经验支持,相反,却引起研究者对幸福以及对计量方法的更多讨论和争议。最近, Brown et al(2015)使用英国家庭调查面板数据,重新复制了现有研究中收入比较理论的正负两种效应,他们发现如何定义收入比较的对象以及如何建立模型及使用参数估计方法会对实证结果产生重要影响。正如 Ferrer-i-Carbonell & Frijters(2004)指出,在幸福悖论的研究中,正确使用计量模型及估计方法是重要的,他们提出使用固定效应面板有序 logit 模型估计幸福问题。但遗憾的是,最新的研究却表明,他们提出的方法本身就存在错误,在参数真实值附近,对数似然函数的期望得分不等于 0,由此说明模型的参数估计值不具有一致性。蒙特卡罗仿真实验也表明,他们提出的方法对于参数估计结果存在较大偏误(Baetschmann et al, 2015)。本部分将系统梳理幸福悖论研究中关于计量方法的各种争议,希望为后续研究提供一些方法论上的启示。

(一)幸福是序数型还是基数型变量?

准确地说,在研究中我们通常用数值 5、4、3、2、1 表示个人非常幸福、比较幸福、一般状况、不太幸福和很不幸福等类型,但是数值之间的大小只是表示幸福程度等级之间的差别,而不具有实际大小的含义。例如,5 和 4 之间的差别(非常幸福和比较幸福之间的差别)并不完全等于 4 和 3 之间的差别(比较幸福和一般状况之间的差别)。因此,从这个意义上来说,幸福应该属于序数型变量,这也是目前研究中大多数文献所采用的方法。基于序数型变量,我们应该使用(面板)有序 probit 或 logit 模型估计参数,但是有序模型的缺陷是不容易解释系数估计值的经济学含义。因此,现有研究中也有部分文献将幸福看成是基数型变量,使用普通的回归方法估计模型参数(如 Jiang et al, 2012)。部分研究者通过对有序模型估计和普通回归估计之间的差别进行分析发现,这种差别只是表现在系数估计值的大小上,并不影响估计值的符号以及模型显著性(Knight et al, 2009)。因此,到目前为止,将幸福看成是序数型和基数型变量在现有研究中仍然同时存在。

(二)如何定义收入比较的对象?

在收入比较中,我们究竟应该与“像你这样的人”做比较还是与“离你附近的人”做比较?这一问题的答案并不明确,而对比较对象的不同定义方法会显著影响实证研究的结果(Brown et al, 2015)。与“像你

这样的人”做比较是指以相似的教育程度、年龄、性别等个体特征变量为基础,定义收入比较的参考对象并计算参考对象的平均收入水平,作为收入比较的代理变量(如 Guven & Sorensen, 2012)。与“离你附近的人”做比较是指以空间地域为界限,定义范围内的人为参考对象并计算参考对象的平均收入水平。例如, Distante(2013)认为每个人的生活范围和认知能力都是有限的,在收入比较中,人们更关心的是与自己生活相邻地区居民的收入水平,而较少受到国家中其他居民的影响,因此,收入比较的对象应以邻居为范围进行界定。最近的研究却否定这一思路, Becchetti et al(2013)认为当公众对媒体披露的信息可及时获得,他国居民的收入水平也可以成为收入比较的对象,利用西欧国家的调查数据研究发现,邻国收入水平提高会显著降低本国居民的幸福感。也有部分研究将个体特征变量与空间概念混合,定义收入比较的对象(如 Senik, 2008 等)。由此可见,如何定义收入比较的对象,现有研究对这一问题的处理仍然只是依赖于个人的价值判断和偏好,缺乏相应的理论基础,也有待于后续研究的进一步深入与规范化。

(三)是否考虑个体异质性?

收入比较理论对幸福悖论的解释在实证结果上产生分歧的原因,也有可能来自于忽视了幸福变量的个体异质性。每个人对幸福都会产生不同的理解和评价,即使对于相同水平的收入增长,不同的人也会报告不同的幸福感。因此,在幸福悖论的研究中,应该控制个体异质性,否则实证结果会产生有偏的结论。解决异质性最有效的方法是观察同一个体在其收入增长时幸福水平的变化。这意味着我们需要使用面板数据从个体截面和时间序列两个维度分析居民幸福感,如果居民报告的幸福感具有时间连续一致性,如 Diener & Suh(1997)的研究所证实,那么面板数据是控制异质性的有效方法。但是截至目前,限于数据的可得性,对幸福悖论的研究,仍然有大量文献使用截面数据或者混合截面数据和模型(如 Latif, 2015),这有可能是实证结果产生不一致的原因。进一步地,对于使用面板数据的研究,个体异质性应该看成是随机效应或者是固定效应形式,现有研究也没有形成一致意见(如 Brown et al, 2015)。事实上,我们可以借鉴 Greene(2014)的方法,在面板有序模型中检验固定效应或者随机效应形式,但是这种方法在幸福悖论研究中却没有被广泛使用。固定效应面板有序模型需要使用最近提出的条件极大似然估计方法(Baetschmann et al, 2015),随机效应面板有序模型可

以使用极大仿真似然估计方法,显然,估计方法的差别也会导致实证结果的不一致性。

(四)是否控制收入变量的内生性?

收入比较理论对幸福悖论的解释在实证结果上的分歧,还有可能来自于忽视了收入变量的内生性。通常来看,幸福的人可能由于他拥有更加积极乐观的心态和外向的性格特征,具有这些特征的人在工作中通常也会更加积极努力,容易获得更高的收入(Paul & Guilbert, 2013)。这说明,在幸福悖论的研究中,收入变量具有内生性。如果忽视这种内生性,将会产生有偏的实证结论。计量方法上,解决内生性的常用办法是寻找工具变量,但是在实际应用中争议最大和最困难的地方也是寻找合格的工具变量。如果我们可以获得关于幸福的面板数据,那么就可以借鉴 Mundlak(1978)关于内生性的常用假设方法,即内生性主要来自于不可观察的个体特征与收入等相关解释变量,进而在面板模型中除了引入原有的解释变量外,再额外增加收入等内生变量的均值项来控制内生性。这也是面板离散选择模型中处理内生性的常用方法(Greene, 2014)。因此,近年来,使用面板数据及其相应的参数估计方法已经成为幸福悖论研究的新兴发展趋势。

(五)幸福感不同的人对收入差距的反应一样吗?

以往研究幸福悖论的文献通常假设,当收入发生变化时,不同幸福水平的人对相对收入差距的变化会做出相同的反应。但是心理学上的研究指出,幸福和不幸福的人对信息(包括收入比较信息)的处理、使用以及反应是不同的。例如,认为自己生活不幸福的人对不利于自己的信息会感到悲观,对有利于自己的信息却不会出现积极的反应,但是认为自己生活幸福的人,即使对不利于自己的信息也不会感到悲观失望(Lyubomirsky et al, 2001)。基于此,Budria(2013)将心理学上的研究结果扩展到幸福悖论分析,提出幸福和不幸福的人对相对收入变化的反应是不同的。在这一假设下,将收入和相对收入对幸福的影响系数设定为随着幸福水平的不同而变化,在参数估计中,建议使用广义的有序 probit 方法估计扩展后的模型系数。通过使用德国社会经济面板数据研究发现,生活不幸福的人会对收入比较更敏感,当相对收入下降时,他们会认为自己受到更大的伤害,因此也会更不幸福。

五、中国的幸福悖论研究及展望

国内学者对我国的幸福悖论问题也进行了深入

分析,并且在上述具有争议的各个领域也积累了大量的研究成果,做出了重要贡献。比较典型的有,在对幸福和效用的关系研究中,贺京同等(2014)从效用论历史演变的角度对居民幸福和效用的关系进行了梳理,他们认为幸福是效用的题中之意,并且是可度量的,可以看成是个体从既往事件中获得的满足感。在对幸福悖论是否存在的研究中,刘军强等(2012)通过使用中国综合社会调查数据,从宏观角度进行研究发现,经济增长是国民幸福提升的主要动力,在经济收缩时期,居民幸福感会显著下降。在对幸福悖论进行解释的研究中,田国强和杨立岩(2006)认为社会存在一个与非物质初始禀赋正相关的临界收入水平,在达到这个水平之前,收入增长可以促进居民幸福,但是在超过这个水平之后,增加收入反而会降低居民幸福。在对收入比较理论进行实证检验的研究中,陈钊等(2012)认为中国收入差距对居民幸福会产生正向促进作用,并且这种作用在人与人之间存在显著差异。具体来看,在城市外来居民中,低教育程度者的正向促进作用会更显著,而在城市本地居民中,高教育程度者的正向促进作用会更显著,他们将这种差异解释为劳动力市场上城市户籍制度对外来高教育程度者的进入限制。也有部分研究认为,我国收入差距对居民幸福产生了负向抑制作用,公共支出可以通过缩小收入差距进而提高中低收入阶层的幸福感,但是这种作用对高收入群体不显著(汤凤林和雷鹏飞,2014)。

尽管学术界对幸福悖论的研究仍然存在较多的争议,但是对这些问题研究至少已经让我们在思想上认识到提升居民幸福的重要性。中国在过去近30年的改革和经济建设中,GDP增速成为考核政府官员绩效的主要指标之一。但是如果经济增长主要由投资快速拉动,而消费增长缓慢,那么国民的幸福水平未必会显著提高,中国过去的经济发展似乎也印证了这一点。因此,转变政府执政理念,关注民生、以提升居民幸福为目标正在成为当前政府调控经济的政策方向。例如,广东省和江苏江阴等地区已经将居民幸福感作为考核当地官员绩效的主要指标之一。中共十八大也提出共创中国人民和中华民族更加幸福美好未来的目标。因此,在这一背景下,深入研究和解释我国居民的幸福悖论问题就具有重要的现实意义。本文对现有研究中关于幸福悖论的争议进行梳理,也是希望为研究我国居民的幸福悖论问题提供一些理论和方法上的启示,同时这些争议本身也是后续研究值得进一步深入分析的方向。

与国外研究相比,中国特有的社会结构特征,如制度因素、城乡及地域差异、社会分层现象等,都会为我们研究我国居民的幸福问题提出新的挑战及方向。例如,张峰和贾岚暄(2016)最近讨论了体制内关系对居民幸福感的影响。另一方面,从政策实践的角度看,现有文献已经从收入比较和绝对收入两个主要角度对幸福悖论提出了不同的理论解释。显然,不同的理论解释将对应于不同的政策着力点和政策重点,那么究竟哪种理论还是两种理论都可以解释我国居民的幸福悖论?辨析这一问题对于制定以提高居民幸福为目标的政策具有重要意义。

注:

- ①世界价值观调查中,幸福水平用1—4度量,1表示非常不幸福,4表示非常幸福。数据经过作者处理和计算。
- ②现有多数研究中,幸福(happiness)、主观幸福(subjective well-being)和生活满意度(satisfaction with life)被视为同一变量,可替换使用。
- ③人类发展指数由三部分构成,包含预期寿命指数、教育指数和GDP指数。

参考文献:

Apergis, N. & Y. Georgellis(2015), “Dose happiness converge?”, *Journal of Happiness Studies* 16(1):67—76.

Baetschmann, G. et al(2015), “Consistent estimation of the fixed effects ordered logit model”, *Journal of the Royal Statistical Society (Series A)* 178(3):685—703.

Becchetti, L. et al(2013), “Beyond the Joneses: Inter-country income comparisons and happiness”, *Journal of Socio-Economics* 45:187—195.

Becker, G. (1974), “A theory of social interaction”, *Journal of Political Economy* 82(6):1064—1093.

Bertrand, M. & S. Mullainathan(2001), “Do people mean what they say? Implications for subjective survey data”, *American Economic Review* 91(2):67—72.

Blanchflower, D. G. & A. J. Oswald(2005), “Happiness and the human development index: The paradox of Australia”, *Australian Economic Review* 38(3):307—318.

Blanchflower, D. G. et al(2014), “The happiness trade-off between unemployment and inflation”, *Journal of Money, Credit and Banking* 46(S2):117—141.

Bolle, F. et al(2009), “A note on interdependent happiness”, *Journal of Socio-Economics* 38(5):713—721.

Brockmann, H. et al(2009), “The China puzzle: Falling happiness in a rising economy”, *Journal of Happiness Studies* 10(4):387—405.

Brown, S. et al(2015), “The relative income hypothesis: A comparison of methods”, *Economics Letters* 130:47—50.

Budria, S. (2013), “Are relative-income effects constant

across the well-being distribution?”, *Journal of Happiness Studies* 14(4):1379—1408.

Chuluun, T. & C. Graham(2016), “Local happiness and firm behavior: Do firms in happy places invest more?”, *Journal of Economic Behavior and Organization* 125:41—56.

Clark, A. E. et al(2008), “Relative income, happiness, and utility: An explanation for the Easterlin and other puzzles”, *Journal of Economic Literature* 46(1):95—144.

Clark, A. E. et al(2009), “Economic satisfaction and income rank in small neighbourhoods”, *Journal of the European Economic Association* 7(2—3):519—527.

Diener, E. & E. M. Suh(1997), “Measuring quality of life: Economic, social and subjective indicators”, *Social Indicators Research* 40(1):189—216.

Distante, R. (2013), “Subjective well-being, income and relative concerns in the UK”, *Social Indicators Research* 113(1):81—105.

Di Tella, R. et al(2003), “The macroeconomics of happiness”, *Review of Economics and Statistics* 85(4):809—827.

Easterlin, R. A. (1974), “Does economic growth improve the human lot? Some empirical evidence”, in: P. A. David & M. W. Reder(eds.), *Nations and Households in Economic Growth: Essays in Honor of Moses Abramovitz*, Academic Press.

Easterlin, R. A. (1995), “Will raising the incomes of all increase the happiness of all?”, *Journal of Economic Behavior and Organization* 27(1):35—47.

Easterlin, R. A. et al(2010), “The happiness-income paradox revisited”, *Proceedings of the National Academy of Science, USA* 107(52):22463—22468.

Eckman, P. et al(1990), “The Duchenne smile: Emotional expression and brain physiology II”, *Journal of Personality and Social Psychology* 58(2):342—353.

Ferrer-i-Carbonell, A. & P. Frijters(2004), “How important is methodology for the estimates of the determinants of happiness?”, *Economic Journal* 114(497):641—659.

Frey, B. S. (2010), *Happiness: A Revolution in Economics*, The MIT Press.

Greene, W. (2014), “Panel data models for discrete choice”, in: B. H. Baltagi(ed.), *The Oxford Handbook of Panel Data*, Oxford University Press.

Guvan, C. & B. E. Sorensen(2012), “Subjective well-being: Keeping up with the perception of the Joneses”, *Social Indicators Research* 109(3):439—469.

Hirschman, A. (1973), “The changing tolerance for income inequality in the course of economic development”, *Quarterly Journal of Economics* 87(4):544—566.

Hollander, H. (2001), “On the validity of utility statements:

- Standard theory versus Duesenberry's", *Journal of Economic Behavior and Organization* 45(3):227-249.
- Jiang, S., M. Lu & H. Sato(2012), "Identity, inequality and happiness: Evidence from urban China", *World Development* 40(6):1190-1200.
- Kahneman, D. & A. B. Krueger(2006), "Developments in the measurement of subjective well-being", *Journal of Economic Perspectives* 20(1):3-24.
- Knight, J. & R. Gunatilaka(2012), "Income, aspirations and the hedonic treadmill in a poor society", *Journal of Economic Behavior and Organization* 82(1):67-81.
- Knight, J., L. Song & R. Gunatilaka(2009), "Subjective well-being and its determinants in rural China", *China Economic Review* 20(4):635-649.
- Krueger, A. B. & D. A. Schkade(2008), "The reliability of subjective well-being measures", *Journal of Public Economics* 92(8-9):1833-1845.
- Latif, E. (2015), "Happiness and comparison income: Evidence from Canada", *Social Indicators Research*, doi: 10.1007/s11205-015-1024-4.
- Layard, R. (2005), *Happiness: Lessons from a New Science*, London: Penguin.
- Leigh, A. & J. Wolfers(2006), "Happiness and the human development index: Australia is not a paradox", IZA Discussion Paper No. 1916.
- Lelkes, O. (2006), "Tasting freedom: Happiness, religion and economic transition", *Journal of Economic Behavior and Organization* 59(2):173-194.
- Lyubomirsky, S. et al(2001), "Responses to hedonically conflicting social comparisons: Comparing happy and unhappy people", *European Journal of Social Psychology* 31(5):511-535.
- Mishra, T. et al(2015), "How interdependent are cross-country happiness dynamics?", *Social Indicators Research* 122(2):491-518.
- Mundlak, Y. (1978), "On the pooling of time series and cross section data", *Econometrica* 46(1):69-85.
- Oshio, T. & K. Urakawa(2014), "The association between perceived income inequality and subjective well-being: Evidence from a social survey in Japan", *Social Indicators Research* 116(3):755-770.
- Oswald, A. J. & S. Wu(2010), "Objective confirmation of subjective measures of human well-being: Evidence from the U. S. A.", *Science* 327(5965):576-579.
- Paul, S. & D. Guilbert(2013), "Income-happiness paradox in Australia: Testing the theories of adaptation and social comparison", *Economic Modelling* 30:900-910.
- Pavot, W. & E. Diener(1993), "Review of the satisfaction with life scale", *Psychological Assessment* 5(2):164-172.
- Sacks, D. W. et al(2012), "The new stylized facts about income and subjective well-being", *Emotion* 12(6):1181-1187.
- Sandvitz, E. et al(1993), "Subjective well-being: The convergence and stability of self and non-self report measures", *Journal of Personality* 61(3):317-342.
- Schwarz, N. (1987), *Stimmung als Information*, Heidelberg: Springer Verlag.
- Schwarz, N. & G. L. Clore(1983), "Mood, misattribution and judgments of well-being: Informative and directive functions of affective states", *Journal of Personality and Social Psychology* 45(3):513-523.
- Senik, C. (2008), "Ambition and jealousy: Income interactions in the 'old' Europe versus the 'new' Europe and the United States", *Economica* 75(299):495-513.
- Shedler, J. et al(1993), "The illusion of mental health", *American Psychologist* 48(11):1117-1131.
- Stevenson, B. & J. Wolfers(2013), "Subjective well-being and income: Is there any evidence of satiation?", *American Economic Review* 103(3):598-604.
- Urry, H. L. et al(2004), "Making a life worth living: Neural correlates of well-being", *Psychological Science* 15(6):367-372.
- 陈钊 徐彤 刘晓峰, 2012:《户籍身份、示范效应与居民幸福感:来自上海和深圳社区的证据》,《世界经济》第4期。
- 贺京同 那艺 郝身永, 2014:《决策效用、体验效用与幸福》,《经济研究》第7期。
- 刘军强 熊谋林 苏阳, 2012:《经济增长时期的国民幸福感——基于CGSS数据的追踪研究》,《中国社会科学》第12期。
- 汤凤林 雷鹏飞, 2014:《收入差距、居民幸福感与公共支出政策——来自中国综合调查的经验分析》,《经济学动态》第4期。
- 田国强 杨立岩, 2006:《对“幸福—收入之谜”的一个解答》,《经济研究》第11期。
- 张峰 贾岚暄, 2016:《体制内关系与居民幸福感》,《经济学动态》第3期。

(责任编辑:李仁贵)