

2001—2010

经济与统计理论新探索

厦门大学计划统计系
新世纪成果集粹

朱建平 高鸿桢 主编



 中国统计出版社
China Statistics Press

2001—2010

经济与统计理论新探索

厦门大学计划统计系
新世纪成果集粹

朱建平 高鸿桢 主编



 **中国统计出版社**
China Statistics Press

(京)新登字 041 号

图书在版编目(CIP)数据

2001—2010 经济与统计理论新探索: 厦门大学计划
统计系新世纪成果集粹/朱建平, 高鸿桢主编. --北京:
中国统计出版社, 2010. 10

ISBN 978 - 7 - 5037 - 6103 - 4

I. ①2… II. ①朱… ②高… III. ①经济统计—文集
IV. ①F222—53

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2010)第 189348 号

2001—2010 经济与统计理论新探索

作 者/朱建平 高鸿桢

责任编辑/梁 超

装帧设计/杨 超

出版发行/中国统计出版社

通信地址/北京市西城区月坛南街 57 号 邮政编码/100826

办公地址/北京市丰台区西三环南路甲 6 号

网 址/www.stats.gov.cn/tjshujia

电 话/邮购(010)63376907 书店(010)68783172

印 刷/河北天普润印刷厂

经 销/新华书店

开 本/787×1092mm 1/18

字 数/500 千字

印 张/27.75

版 别/2010 年 10 月第 1 版

版 次/2010 年 10 月第 1 次印刷

书 号/ISBN 978 - 7 - 5037 - 6103 - 4/F • 2955

定 价/48.00 元

中国统计版图书, 版权所有。侵权必究。

中国统计版图书, 如有印装错误, 本社发行部负责调换。

前 言

厦门大学计划统计系创办于1950年,经过几代人的艰辛创业和不懈努力,现已发展成为国内具有较大影响的统计、信息、投资分析类教学科研和人才培养基地。现拥有统计学、国民经济学、数量经济学和经济信息管理学四个博士点(并同时设有博士后工作站)与四个硕士点,以及统计学(包括经济管理统计和投资决策分析两个方向)、信息管理与信息系统两个本科专业,以及国民经济与核算研究所和国家统计局统计科学研究基地。其统计学科分别于1987年、2001年和2007年连续三次被国家教委和教育部评为国家级重点学科。2008年统计学教学团队被教育部评为国家级教学团队,统计学专业被教育部列入国家级特色专业。

60年来,厦门大学计划统计系全系教师秉承严谨治学的优良传统,通过长期探索和反复实践,已逐步形成自己的学术风格和办学特色,积累了丰富的科研和教学成果。在统计理论方法和国民经济核算这两个具有传统优势和创新能力的研究领域,成果尤为显著。近十年来,为适应新时期学科建设的需要,其教学科研正不断向现代统计方法及其应用等前沿领域拓展。

2010年是厦门大学计划统计系建系60周年。为了更好地连续反映我系教师所取得的教学和科研成果,在《经济与统计理论探索——厦门大学计划统计系50周年代表性成果集粹》的基础上,我们编辑了《经济与统计理论新探索——厦门大学计划统计系新世纪成果集粹》,集中反映21世纪以来教师所取得的科研成果和我系人才培养情况。

据不完全统计,从2000年至今,我系教师先后主持了省部级以上科研项目53项,其中国家社科重点项目2项,国家社会科学和自然科学基金一般项目13项,国家社会科学青年基金项目1项。获得国家级优秀教学成果一等奖1项,国家级精品课程2项,国家级精品教材1项,省部级以上科研成果奖51项。从1988年开始招收博士研究生至今,我系已培养博士179名,是全国同类院系培养博士生最多的单位之一。另外,10年来我系还培养了硕士430名,学士1329名,他们大多已成为

我国现代化建设的中坚力量,为母校和母系赢得了荣誉。

在本书的编辑过程中,我们力求以历史发展为主线,全面、系统和广泛地反映我系教师在 21 世纪取得的代表性成果。收入本书的成果包括:我系教师作为第一作者完成的曾获得省部级以上政府奖励的成果;部分作为第一作者在核心学术刊物上发表,并在学术界有一定影响的成果。由于篇幅有限,根据老师们的投稿,我们精选了其中 67 项成果,并由作者对成果做了删节整理。

本书包括十个方面的内容:经济学理论、统计基本理论与方法、国民经济核算、专业统计问题、计量经济模型与实验经济学、数据分析与数据挖掘、投资经济研究、现实经济问题、计算机科学与信息管理、统计人才培养与教育思想。另外,书后附有我系招收博士研究生的基本信息一览表、承担省部级以上科研项目一览表、获得省部级以上奖励的教学和科研成果一览表。

本书的编辑,得到了全系在职和离退休老师们的热情支持,在此致以诚挚的谢意!同时感谢黄良文、曾五一教授,他们自始至终的关心和指导确保了本书的顺利完成和出版;感谢中国统计出版社的编辑同志和我系袁加军博士,他们为本书的组稿、编辑做了大量的工作。本书的编辑和出版还得到了国家教育部“统计学教学团队”经费的资助。在此,我们谨向所有为本书的问世做出贡献的同志表示深切感谢!

我们想通过本书的出版,让读者全面了解厦门大学计划统计系发展的历史脉络,以及近年来教学和科研的概况。由于时间仓促,水平有限,难免有疏漏或错误之处,恳请读者多提宝贵意见。

朱建平 高鸿桢

2010 年 9 月

目 录

第一部分 经济学理论探索

关于深化劳动价值认识的几点思考 3

投资估价的若干理论问题 8

论商品二因素的两种内涵 15

风险经济学引论 22

一夫当关 万夫莫开 30

对投资乘数的质疑 39

第二部分 统计基本理论与方法

论社会主义市场经济的统计体系 51

关于进一步促进我国统计学发展的几点思考 57

关于我国统计体制改革的思考与建议 63

中国现代化进程的统计考察 68

要建立科学的统计数据质量评估体系 74

统计学的思路 78

《统计学》简介 85

《统计学导论》简介 88

《统计学概论》简介 90

第三部分 国民经济核算

- 关于无偿服务核算的研究 95
- 住户无付酬服务核算若干问题研究 100
- 我国对外直接投资产业结构调整效应的实证分析 107
- 潜在产出、产出缺口与通货膨胀率关系研究 114
- EDP 核算中几个问题的思考 120

第四部分 专业统计问题

- 中国房地产价格指数的模拟和预测 125
- 我国城市用地扩展影响因素的实证研究 132
- 随机截尾试验下三类癌症的发病率估计 139
- 统计人员在调查中的责任分析 147
- 《统计调查体系与调查方法问题研究》简介 152
- 《应用多元统计分析》简介 155
- 《国家金融安全的统计分析》简介 157
- 《科研中常用的统计方法——自由分布统计检验》简介 161

第五部分 计量经济模型与实验经济学

- 信息不对称资本市场的实验研究 165
- 我国财政支出对经济增长的乘数效应分析 171
- 我国各地区教育与 GDP 的空间特征实证分析 180
- 面板数据的聚类分析及其应用 190
- 实验经济学的理论与方法 197
- SAR 模型在省域和县域农民收入中的应用研究 204
- 空间关联分析及其应用 212
- 《实验经济学导论》简介 219

第六部分 数据分析与数据挖掘

- 数据挖掘中数据排序及其应用 225
- 数据挖掘中关联规则的提升及其应用 231
- 数据挖掘中基于可辨识矩阵的连续属性离散化方法 236
- 属性重要程度的测量方法及比较 242
- 基于面板数据的数据仓库模型设计 248
- 《数据挖掘的统计方法及实践》简介 252

第七部分 投资经济研究

- 我国资本市场的热点问题 259
- 筹资决策问题探讨 264
- 我国上市公司融资行为实际问题研究 270
- 企业的风险收益和预期收益的测度与估算 280
- 中国与世界金融市场从分割走向整合 288
- 风险中性组合在风险套利中的应用研究 294
- 我国国有商行不良资产处置的制约因素及对策探析 301

第八部分 现实经济问题

- 中国区域资本配置效率及影响因素的实证分析 309
- 论全球化思维下的中国自力主导型经济发展 316
- 构建社会主义和谐社会的思维框架探析 321
- 浅析中国能源安全 328
- 我国制造业技术创新效率差异的实证分析 335
- 教育产出结构、资源配置与中国经济增长 342
- 价格对质量的显示功能分析 349
- 基于生活污染物的环境库兹涅茨曲线研究 355

第九部分 计算机科学与信息管理

- 关于发展我国电子商务的对策研究 363
- 客户体验概念的三个层次 369
- 市场信息效率的提高会改善资源配置效率吗 376
- 一种知识管理与决策支持系统的整合模型 380
- 《客户体验管理》内容简介 386

第十部分 统计人才培养与教育思想

- 缅怀导师王亚南 391
- 经济管理类统计学专业教学体系的改革与创新 394
- 研究型大学本科生评优方案的微观思考 399
- 再论王亚南的中国官僚政治研究 406
- “李约瑟难题”与王亚南的中国官僚政治研究 413

- 附录 1 获省、部级以上政府科研成果奖一览表 419**
- 附录 2 承担省、部级以上科研项目一览表 424**
- 附录 3 历年来统计系博士毕业基本情况一览表 427**



第一部分

经济学理论探索

关于深化劳动价值认识的几点思考

钱伯海

本文原发表在《理论前沿》2001年第11期,全文约4900字。

党的十五届五中全会,提出了一个重大的理论问题,即“在新的形势下,深化对劳动和劳动价值理论的认识”。从报刊发表的材料看,深化主要表现在两个方面:一是随着社会生产力的发展,特别是高新技术的发展,科学技术工作和经营管理作为劳动的重要形式,在推动经济发展中起着越来越重要的作用,其创造价值应该得到社会的承认;二是要求正确理解实行按劳分配为主体,多种分配方式相结合的制度,鼓励资本、技术等要素参与收益分配。这两个理所当然、毋庸置疑的现实问题,为什么现在还要提出来深化认识,这表明中间存在障碍并且是根本性障碍。

一、劳动创造价值和如何创造价值

劳动与价值是劳动价值理论不可分割的两个基本范畴,劳动创造价值,价值是劳动时间的物化,统一于商品生产之中。商品二因素——价值与使用价值,劳动二重性——抽象劳动与具体劳动。具体劳动创造使用价值,抽象劳动创造价值,从而形成马克思的劳动价值论体系。可见,劳动创造价值,只有生产性劳动创造价值,非生产性劳动不能创造价值。所以考察劳动价值,首先得明确什么是生产性劳动,只有生产性劳动,才有价值可言,才创造价值。

根据商品二因素与劳动二重性,劳动价值有两种表现,一是指实际价值(商品实物量、使用价值),指生产成果的实物量。但我国现有的政治经济学教材,都不承认这种价值。二是指理论价值,指生产商品所费的社会必要劳动时间,又称抽象劳动时间。至于创造价值则是指劳动总量不变的情况下,由于提高劳动生产率,增加了商品的实物量。或在实物量不变的情况下,由于提高劳动生产率,压缩了必要劳动时间,延长了剩余劳动时间,即创造剩余价值,简称为创造价值。所以一般讲的创造价值都是指创造剩余价值,它的关键在于提高劳动生产率。劳动生产率不提

高,必要劳动时间不压缩,就谈不上创造剩余价值,即创造价值。至于劳动价值的增加,如增加劳动人数、延长劳动时间,称增加价值,不能叫创造价值。通俗地说,创造价值就是节约劳动消耗,降低生产经营成本,取得较好的成果或较多的盈利。

提高劳动生产率有多种途径,但最根本的途径在于“利其器”——不断改进物化劳动,采用先进的设备、材料和工艺。可以大幅度地提高劳动生产率,压缩必要劳动时间,延长剩余劳动时间,创造剩余产品和剩余价值。因此,物化劳动——先进的设备、材料和工艺是剩余产品、剩余价值的主要源泉。进而可以作这样推论,凡是对利其器——不断改进物化劳动,以及促使物化劳动形成现实生产力的各个要素,都对生产直接或间接作出了贡献,可以从物化劳动创造的剩余产品、剩余价值中,“分取”一部分,对其进行分配。这主要有两个方面。

1. 科技因素。科学技术包括经营管理劳动,凝聚在物化劳动上,形成先进的设备、材料和工艺,借以大幅度地提高劳动生产率,创造巨额的剩余产品和剩余价值。科技因素作为知识产品,与一般物质产品不同,它具有特定的积累扩散效能,不断积累、不断扩散,无止境地拓展。好像发明蒸汽机与制造蒸汽机,其效应,其价值,简直是无法比拟。科技因素始终依附于劳动者,形成各种人才——科学家、工程师、设计师等。为了激励劳动热情,有条件从物化劳动创造的剩余产品与剩余价值中,抽取一部分作为高科技人员,包括经营管理人员,采取一些特殊的分配政策。使他们与企业在经济上同甘苦,共得失,一心扑在生产经营上,促使企业经营的迅速发展。

2. 资本要素。物化劳动——先进设备材料和工艺,必须有相应的资本,才能够购买,形成现实生产力。如果缺乏资本,没有资金购买力,那设备材料就只能闲在生产者的仓库里。久而久之,铁会生锈,木会腐烂,永远不能发挥其应有的作用。但是要集资,不论是私人投资,或大众集资,都必须有回报,即实行按资分配。否则,资本就集不来,无法形成现实购买力。资本很重要,但资本不等于物化劳动,物化劳动来自活劳动,而且是本期的活劳动,归根结底还是活劳动创造价值。可见,同样的活劳动,采取大分工,利其器,就可以大幅度地提高劳动生产率,创造比不分工要多出几倍、几十倍甚至更多的劳动成果,从而形成新的剩余价值理论——既按资分配,又认定资本不创造价值,与资产阶级生产三要素理论存在根本的不同,这正是我国改革开放对马克思剩余价值理论的巨大创新。

过去人们经常提出:“企业家能不能创造价值?”回答十分肯定。这正是劳动价值需要深化认识的重要内容。企业家作为有见地、有本领的企业领导人,善于观察市场,开拓创新,重视“利其器”,善于组织力量,不断革新设备、材料和工艺,大幅度地提高劳动生产率,也就是节约劳动消耗,降低生产成本,为企业创造巨额的盈利。



既然创造巨额价值,巨额盈利,很有建树,就应该给以特殊的分配政策,以充分体现他们的劳动价值。当然,特殊分配政策,一定要和严格的约束监督机制相配套,对不称职或渎职者,应有相应的制裁措施。

二、只有克服扭曲,才能深化认识

前面所谈的几个基本理论问题,都在情理之中。然而由于种种原因,长期存在认识上的扭曲,认为物化劳动是凝固了的活劳动,它只能转移价值,不能创造价值,只有活劳动创造价值,并且把物化劳动创造价值与三要素论联系起来,给以种种的责难。只有克服这些扭曲,才能深化认识。下面为深化认识需要,准备从理论上作一些剖析。

(一)对生产劳动范围的认识存在着偏颇。长期以来,我国政治经济学教材都坚持物质生产观点,认为物质生产才是生产,实际部门也推行以物质生产为内容的国民经济核算制度 MPS 体系,并且对西方各国报告的包括第三产业核算 SNA 体系持强烈的批评。改革开放以来,为了与国际接轨,1992 年 8 月,国务院正式批准我国以 SNA 为主体的新国民经济核算体系。对第一二三产业都作为生产,计算产值,并列入我国国内生产总值 GDP 中。从而使科学技术、文化教育等长期列作非生产,不创造价值的理论扭曲在实践中被解开了。但理论界有的仍持批评态度,政治经济学教材不少还存在保留看法。这表明从理论上继续宣传一二三产业创造价值,即社会劳动创造价值,克服理论扭曲,还有大量工作要做,这是深化对劳动和劳动价值论认识的基础性工作。

(二)对物化劳动的认识存在着偏颇,包括以下两个方面:

1. 对“物化劳动”的功能作用认识不足,使按资分配失去必要的理论依据。物化劳动是科学技术劳动成果凝聚在物化劳动上,体现为先进的设备材料和工艺,它作用巨大,可以几倍、几十倍地提高劳动生产率。创造巨额的剩余产品剩余价值,可以对物化劳动相配套的资金或资本,提供按资分配的财力资源。然而由于长期存在的理论扭曲,认为物化劳动只能转移价值,不能创造价值,那按资分配就失去了财力资源。只能从活劳动创造的剩余价值中榨取一部分,即进行剥削。从而使按资分配,就失去了必要的理论支持。

2. 对“劳动物化”的物化内容认识不足,使特殊分配政策失去客观的科学依据。物化是活劳动的物化,问题是什么活劳动的物化。从经济发展来看,它不是一般劳动的物化,而是科技劳动、包括管理劳动的物化。为了激励劳动热情,必须适当提高科技人员的劳动报酬,特别是对企业的高层管理人员和科技人员,采取一些

特殊的分配政策,例如年薪制、期权制等,以充分体现他们的劳动价值。而传统的价值理论认为物化劳动都是过去劳动的成果,只能转移价值,不能创造价值、提供更多的剩余产品和利润。从而要对他们采取特殊的分配政策,就缺乏理论依据了。

最近,许多学者撰文,从多方面论证高科技劳动对生产如何作用重大,对企业的兴亡盛衰起了如何巨大的作用。但疏于提出物化劳动只能转移价值的理论扭曲,并设法克服这个扭曲,从而使论证永远陷于可望而不可及的空想。因为不要谈一个企业、一个地区,就是全中国,甚至把全世界的科学家、工程师、设计师、诺贝尔奖金获得者,都集中到中国来,但如不把他们高水平和世界顶尖的科研成果,凝聚在物化劳动上,体现为先进的设备材料和工艺,那只是纸上谈兵,想入非非,无法体现科学技术能提高劳动生产率,进而创造剩余产品、剩余价值的巨大作用。或者基于理论扭曲,人为地否定作为科技劳动物化的先进设备、材料和工艺,能够提高劳动生产率,创造剩余产品、剩余价值,坚持说物化劳动只能转移价值,不能创造价值,那科学技术是生产力、第一生产力这个大命题就不能成立,更谈不上要深化对劳动和劳动价值的理论认识了。

三、必须明确的几个基本理论问题

在国民经济中,无以计数各色各样的企业,实行社会大分工、大协作,制造各种产品(含劳务),以直接或间接满足人们生产和生活的需要。企业间通过商品买卖,进行等价交换,还有一部分公共产品部门,如文化教育、科学研究、国防治安、城乡交通管理等,也为人们的生产生活提供各种服务。而企业和个人也通过税收缴纳支付相应的报酬,从而使社会再生产源源不断地进行。为此,必须明确对几个基本理论问题的认识。

(一)劳动价值有两种表现——理论价值与实际价值。拙著《经济学新论》已经从理论上作了阐明。如果仅承认理论价值,以劳动时间计量,那再先进的科技劳动和再高超的经营管理劳动,都只和一般劳动一样,以劳动时间计量,不增加劳动时间,就不能“创造”价值。但如果认定以实物量计量的实际价值那就大不相同了,依靠科技力量,可以使同样的人数在同样的劳动时间内,创造出比过去多几倍、几十倍的产品,增加几倍、几十倍的产值,即几倍、几十倍的实际价值。那就充分说明,科学技术和经营管理劳动作为劳动的重要形式,它不仅创造价值,而且创造巨额价值。巨额价值就是指包括剩余产品为内涵的实际价值。采取相应的分配政策,以充分体现他们劳动价值的“价值”。马克思所讲复杂劳动是简单劳动的倍加价值的“价值”,都是指以实物为内涵的实际价值,而不是以时间为内涵的理论价值。理论



价值与实际价值存在内在的逻辑联系,在劳动报酬与劳动生产率同步增长的情况下,理论价值等同于实际价值。从长期看问题,同步增长是肯定的,因此可以认为理论价值长期会等于实际价值。

(二)物化劳动有两种属性——物质属性与劳动属性。对此,前面已有所阐述。作为设备材料和工艺的物质属性,必须有它的所有制归宿,为一定所有者所有,也就是一定要有资本,才能购买取得它,形成现实生产力。但筹集资金必须有回报,即实行按资分配。而物化劳动因创造巨额剩余产品、剩余价值,可以从中“抽取”或“分取”一部分作回报,使按资分配可以从物化劳动的作用功能中找到依据和归宿。从劳动属性看,物化劳动是社会活劳动的成果,而且是本期活劳动成果(因为过去的物化劳动作为“存量”,还要留到下一期去,表示没有本期耗用),从而使按资分配依然建立在劳动价值论的基础上,坚持活劳动是价值的唯一源泉。既然价值包括必要劳动价值和剩余劳动价值,都来源于活劳动,归根结底,一切商品都是活劳动的成果。在确认按资分配的同时,必须确认其所“分取”的数量,应该有一个界限。过了量就要另当别论,称之为剥削并要加以控制了。

(三)价值生产和价值分配的关系和形式。在早期,价值生产与价值分配的关系和形式都比较单纯。很多手工业生产,自己生产,成果归己,最多少量纳税而已,使价值生产与价值分配取得基本的统一。随着经济技术的发展,价值生产与价值分配关系和形式发生了巨大变化——分配关系复杂化,分配形式多样化,这里不加讨论。仅仅就分配形式来说,工资奖金作为劳动报酬的主要手段,就有计时制、计件制、承包制以及现在正在议论的年薪制、股份制和期权制等等,都是劳动成果按劳动数量、质量分配的具体形式。问题是分配的数量是否与价值生产、劳动贡献相对应,与投入的劳动质量数量相对应。前已说明,高科技劳动、经营管理劳动,特别是企业主要负责人,主要科技骨干,他们总揽企业全局对企业盛衰影响极大,发挥主观能动性可以大幅度提高劳动生产率,创造巨额的剩余产品、剩余价值。需要相应地采取一些特殊分配政策,引进风险机制,增强激励力度。从而使价值生产与价值分配的关系和形式,在实际中不断丰富和发展。至于不同企业,不能强求统一,应该是具体情况具体分析,具体情况具体应用。

投资估价的若干理论问题

黄良文

原文发表在《厦门大学学报(哲学社会科学版)》2002年第4期(总第152期),
全文约6500字。

摘要:商品的价值和使用价值同是商品的属性,它们相互依存、相互制约。对商品估价,要综合考虑商品的劳动耗费和使用价值。知识产品的使用价值表现为技术创新、管理创新的能力,其价值不是决定于产品的劳动耗费,而是决定于产品价值的增值。金融产品本身没有价值,但代表一定的权利,应该有交换价值。金融资产的价值决定于其未来收益的资本化。

关键词:价值内涵;知识产品;金融产品;投资估价

在市场经济条件下,投资估价是寻找商机、规范市场、引导经济的一项基础工作,逐步受到人们的重视。而随着市场经济的发展,特别是资本市场、技术市场、人才市场、劳动力市场等纷纷出现,投资估价的对象不断扩大,既有实物资产的估价,又有无形资产的估价;既有传统产品的估价,又有金融产品的估价;既有劳动产品的估价,又有知识产品的估价;既有经济产品的估价,又有资源、环境的估价等等。投资估价又使人们感到困惑。在纷繁的估价中有没有共同的理论依据?有没有自己的方法论?在我国历史相当长的经济体制过渡时期,确实存在两种极端的认识。一种思想总认为土地、资金、人才本身没有价值,不计成本,可以无偿使用,不付代价,甚至把它作为廉价资源优势,可以任意加以践踏。另一种极端思想则认为价格市场自然形成客观存在的,不是投资者所能左右的,价值不可认识,也无需认识,估价是徒劳无功的事。这些思想无疑阻碍着投资估价科学的发展。

我们认为,市场价格是客观存在,人们参与市场固然是价格的接受者,但需要怎样的投资组合,人们参与市场却是积极的主导者。正如海上航行,人们无法改变风向,却可以调整风帆。投资价值评估正是在市场的风险中找机遇,因势利导争主动的有力手段。在纷繁的估价中有它应遵循的原则和基本的理论依据,也有相适