



中国商品市场景气 与预警研究

李朝鲜 方 燕 等编著



经济科学出版社

中国商品市场景气与预警研究

李朝鲜 方 燕 等编著

经济科学出版社

图书在版编目 (CIP) 数据

中国商品市场景气与预警研究 / 李朝鲜, 方燕等编著.
北京: 经济科学出版社, 2007. 11
ISBN 978 - 7 - 5058 - 6655 - 3

I. 中… II. ①李…②方… III. 国内市场 - 研究 - 中国
IV. F723

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2007) 第 157506 号

责任编辑：吴 南 陈 静

责任校对：徐领柱

版式设计：代小卫

技术编辑：潘泽新

中国商品市场景气与预警研究

李朝鲜 方 燕 等编著

经济科学出版社出版、发行 新华书店经销

社址：北京市海淀区阜成路甲 28 号 邮编：100036

总编室电话：88191217 发行部电话：88191540

网址：[www. esp. com. cn](http://www.esp.com.cn)

电子邮件：[esp@ esp. com. cn](mailto:esp@esp.com.cn)

汉德鼎印刷厂印装

华丰装订厂装订

880 × 1230 32 开 9.5 印张 250000 字

2007 年 11 月第一版 2007 年 11 月第一次印刷

ISBN 978 - 7 - 5058 - 6655 - 3/F · 5916 定价：18.00 元

(图书出现印装问题，本社负责调换)

(版权所有 翻印必究)

前 言

在市场经济条件下，存在着相互联系、相互制约、相互作用的体系。在这一体系中，包括商品市场，也包括各种要素市场。商品市场是体系发展的基础，同时，商品市场是国民经济发展过程中物质资源交易和配置的基本场所和主要形式，其他市场在一定意义上是为商品市场服务的。要素市场发展的最终目的，也是为了国民物质财富的丰富以及商品交易规模的扩大、交易范围的拓展。从体系发展的历史逻辑来看，在商品市场发展到一定阶段后，就产生了对要素市场发展的客观要求。这是体系发育时序的历史规律。因此，有必要对商品市场进行探讨和分析。

然而，由于市场经济的内在不稳定性，我国商品市场在运行的过程中存在着较大的波动。商品市场的景气波动就是市场经济发展过程中一种常见的经济现象，它既是整个国家经济增长波动的影响结果，也是我国经济周期运行的集中反映，并将对我国经济持续、稳定、协调的发展起着重要的制约作用；科学、系统地研究我国商品市场景气波动分析的理论和方法，并据此对我国商品市场景气状况进行定量考察和实证分析，可为相关部门制定抗波动干扰的应对政策和具体措施提供基本依据。

我国商品市场景气波动监测预警系统是利用一系列监测指标建立起来的宏观经济“晴雨表”或“报警器”。它之所以能像“晴雨表”或“报警器”那样发挥监测和预警作用，一是因为我国商品市场本身存在着的景气波动；二是因为我国商品市场景气波动过程中的一些问题可以通过一些监测指标率先暴露或反映出来。景气监

测就是通过建立监测网络,利用监测指标体系、监测方法体系对我国商品市场运行过程实施有效地监视、检测、监督、检查,及时发现不正常因素和供求失衡的苗头,予以调节与控制。我国商品市场景气预警是以商品市场运行过程的发展趋势为对象的预警活动,它通过科学的方法和技术,对我国商品市场运行状态进行监测,并以监测结果为依据,制定和发布预警信号,提示人们注意商品市场在运行中即将出现的不均衡状态、突变事件和无序结构,以便决策部门采取相关措施,调整和修订市场监管政策,从而保证商品市场的稳定、繁荣和持续发展。

全书分为五个部分,结构如下:

第一部分,主要从我国商品市场发展的历史沿革、商品市场的体系与结构以及商品市场的管理三个方面来对我国商品市场进行大致的叙述。

第二部分,对我国商品市场景气研究的基本理论进行了介绍,如西方经济周期理论、国外景气分析的历史与现状、近年来我国经济周期的研究成果和国内外景气分析的历史与现状等。其中,重点介绍西方经济周期理论,着重分析国内景气分析的历史与现状。

第三部分,详细论述我国商品市场景气研究的基本方法。如,我国商品市场景气循环的测度方法、我国商品市场景气指数的编制方法等。

第四部分,在前三部分阐述我国商品市场的背景和景气指数相关理论知识的基础之上,从实证的角度出发编制我国商品市场景气指数,并依据景气指数来分析我国商品市场运行情况。

第五部分,从预警的角度来建立我国商品市场景气波动监测、预警及控制系统。该部分主要介绍景气预警方法的相关理论,并对我国商品市场景气进行预警实证研究。

本书是由我和我的同事方燕副教授主持编写的。参加编写的有:商务部市场运行司房爱卿、徐家爱、李习臻,北京工商大学硕士研究生刘清江、白先华、姚志超、杨岳、傅兆翔、李东宁、王

冬、郭华等人。经济科学出版社的编辑和相关工作人员也做了许多耐心细致的工作，在此一并致谢。由于时间和水平有限，书中可能存在许多不完善的地方，甚至错误，恳请广大读者、各位同行、专家提出宝贵意见。

李朝辉

2007 年 8 月于北京工商大学

目 录

第一章 中国商品市场概述	(1)
第一节 中国商品市场发展的历史回顾	(1)
一、传统体制下商品流通体制和政策的形成及演变	(1)
二、改革开放后中国商品市场发展的进程	(4)
三、商品市场发展的现状及成就	(10)
第二节 中国商品市场的体系与结构	(12)
一、中国商品市场体系的构成	(12)
二、中国商品市场在市场体系中的地位与作用	(20)
第三节 中国商品市场的管理	(28)
一、中国商品市场的宏观管理	(28)
二、中国商品市场的微观管理	(33)
第二章 中国商品市场景气研究的基本理论	(48)
第一节 经济周期理论的历史发展	(48)
一、西方经济周期理论	(49)
二、马克思经济周期理论	(67)
三、近年来中国经济周期理论的研究	(74)
第二节 国外景气研究的发展历史和现状	(78)
一、国外景气研究的发展历史	(78)
二、国外景气指数的现状	(82)
第三节 我国景气研究的发展历史与现状	(86)

· 2 · 中国商品市场景气与预警研究

一、我国景气研究的发展历史	(86)
二、我国景气研究的现状	(88)
三、我国主要的景气指数介绍	(90)
第三章 中国商品市场景气研究的基本方法	(112)
第一节 数据处理的基本方法	(112)
一、原始数据处理的基本方法	(112)
二、时间序列处理的基本方法	(119)
第二节 商品市场景气循环的测度方法	(142)
一、周期的计量	(142)
二、季节模型的计量	(171)
三、一些思考	(176)
第三节 商品市场景气指数的编制方法	(178)
一、先行、一致、滞后指标的确定	(178)
二、扩散指数的编制方法	(184)
三、合成指数的编制方法	(196)
四、合成指数编制的几种变通方法	(202)
五、一些思考	(203)
第四章 中国商品市场景气指数研究	(207)
第一节 编制中国商品市场综合景气指数的意义	(208)
第二节 中国商品市场综合景气指数指标的 选取及解释	(210)
一、中国商品市场景气指标的选取	(210)
二、中国商品市场综合景气指数指标的解释	(216)
第三节 中国商品市场综合景气指数指标的 数据预处理	(220)
一、对于异常点的处理	(221)
二、对于表中缺失数据的处理	(222)

三、季节调整	(223)
第四节 中国商品市场综合景气指数指标的划分	(238)
一、先行、同步、滞后指标的划分方法	(238)
二、先行、同步、滞后指标的划分	(240)
第五节 中国商品市场综合景气指数的编制和分析 ...	(241)
一、中国商品市场综合景气扩散指数的编制	(242)
二、中国商品市场综合景气合成指数的编制	(245)
第六节 结束语	(248)
第五章 中国商品市场预警系统的编制	(250)
第一节 预警系统的原理及作用	(251)
一、预警系统介绍	(251)
二、预警系统的基本原理	(252)
三、中国商品市场预警系统的作用	(256)
第二节 经济监测预警研究理论	(256)
一、国内外经济预警研究的起源与发展	(256)
二、经济监测预警的主要方法	(261)
第三节 中国商品市场监测预警系统构建及 实证分析	(271)
一、预警指标的选取	(271)
二、数据的处理	(272)
三、单个指标预警界限的确定	(275)
四、总预警界限的确定	(276)
五、景气预警体系的效果评价	(278)
参考文献	(286)

第一章 中国商品市场概述

我国商业的发展、商品市场的繁荣稳定，与我国经济和社会的发展、整个国家的长期繁荣和稳定密切相关。加快我国商品市场建设，建立科学的市场景气监测预警系统，对于促进中国经济和城市建设的发展具有举足轻重的作用。本章将在回顾中国商品市场发展历史进程的基础上，总结我国商品市场发展的现状及成就，分析我国商品市场的体系与结构，并从宏观和微观两方面论述如何有效管理中国商品市场，进一步促进和完善我国商品市场的建设。

第一节 中国商品市场发展的历史回顾

马克思指出：“交换有它自己的历史，它经过各个不同的阶段。”^① 商品市场是一个不断发展、不断完善的发育过程，经历过各个不同的发展阶段。因此，中国商品市场发展的历史是十分悠久的。

一、传统体制下商品流通体制和政策的形成及演变

从新中国建立开始，一直到 1978 年党的十一届三中全会之前的这一时期，在理论研究中一般称之为传统体制时期。在这一较长的时期内，我国实行的是高度集权的计划经济体制，并形成了与这一经济体制相适应的商品流通体制。这种体制的形成不是偶然的，

^① 参见《马克思恩格斯全集》第 4 卷，人民出版社 1974 年版，第 79 页。

而是有其特定的背景。

首先，受苏联经济体制模式的影响。新中国建立伊始，对于力图建立一个新民主主义国家进而建设社会主义的中国而言，当时的社会主义苏联，为中国提供了现成的“软件”和“硬件”的“样板”，即高度集权的计划经济理论、指导思想和直接的、具体的计划经济体制模式，以及与这种体制相适应的经济政策框架。

其次，特定的经济与政治背景。新中国成立后，百废待兴，国民经济处于恢复时期，国家的经济能力相当薄弱，物质资源极其匮乏。在这种条件下，国家必须集中有限的财力和物质资源恢复经济，加快建设。这在客观上决定了传统体制下的经济政策以及流通体制和流通政策的形成。特别是 20 世纪 50 年代初的朝鲜战争，使新中国承受着战火的考验，政府必须首先维持社会的生存与安全，稳定经济，支持保家卫国的战争，这也促使了中国传统计划经济体制的形成。

在上述背景下，中国逐步形成了高度集中的计划经济体制形式。其基本特征：一是中央政府权利高度集中，通过集中统一的国民经济指令性计划来组织国家的经济活动；二是企业的微观生产经营活动也由政府来决定，企业只是从事生产或经营的具体单位而没有自主权利，形成了“政企不分”的关系格局；三是形成了财政上“统收统支”的分配体制和投资体制。这种计划经济体制决定了流通体制的基础，进而决定了传统体制下流通政策的构架和基本走势。加上新中国在建立之后的相当长时期内受物质资源短缺的制约和西方帝国主义国家的经济封锁，更强化了传统体制下流通体制和流通政策的计划经济体系。在这样的流通体制和流通政策条件下，中国商品市场的发育本身被蒙上了厚厚的计划经济的色彩，具有下述基本特征。

（一）单一商品流通所有制形式

新中国建立后的 1950 年 3 月，中央人民政府颁布了《关于统一全国国营贸易实施办法的决定》，规定中央贸易部是全国国营商

业、合作社商业和私营商业的统一领导机关。各大行政区也设立了贸易部，形成了全国性的商业行政系统。同时，中央贸易部相继建立了15个专业总公司，各总公司根据业务发展的需要，由总公司和当地人民政府双重领导，以总公司领导为主，对所属公司的全部业务实行统一管理、统一经营，形成了全国性的商业企业管理系统。国营流通企业经营机构迅速增加，从而形成了包括商业行政部门、企业管理机构和经营机构的一套国营商业系统。随后，经过第一个五年计划中实行的对私营工商业改造的基本完成，原来五种经济成分并存的国内流通市场格局发生了根本变化。“资本主义”商业被挤出流通领域，形成了以国营流通企业为主体和领导力量的基本企业格局。这一格局在后来又进一步得以巩固和强化，如：1959年将供销社转为全民所有制，1962年恢复为集体所有制，1977年又转为全民所有制，形成了单一国营的流通企业的所有制形式。

（二）高度集中统一的商品流通管理体制及政策

20世纪50年代，高度集中的流通管理体制已基本形成，主要是通过建立贸易金库和商品统一调拨制度来实现的。各级流通企业的资金由专业总公司统一调度，一切现金收入均须缴入贸易金库，一切现金支出都要列出计划经专业公司审核后，通知金库支付。企业间资金往来则通过上一级公司实行内部转账。商品由专业总公司统一调拨。这一高度集中的体制在当时对于统一调拨商品和资金，集中恢复经济、控制市场、稳定物价起到了重要作用，但也存在过于集中、缺乏灵活性的问题。因此，1957年11月，全国人大常委会批准了国务院关于改进工业、商业、财政管理体制的三个规定，即《关于改进工业管理体制的规定》、《关于改进商业管理体制的规定》、《关于改进财政管理体制的规定》，这些规定从1958年开始实施。自此，流通管理体制开始了根据“统一领导、分级管理”的原则进行的改革。国务院颁布的《关于改进商业管理体制的规定》，主要内容是扩大地方在管理体制方面的权限，原同一部门管

理的流通企业，除一级批发站外，其余全部由各省、市、自治区领导。加工企业全部下放到地方，并且精简、合并了商业行政部门。同时，国务院还发布了《关于物价管理权限和有关商业管理体制的几项规定》，商业部发出《关于若干规章制度下放、废止或修改的通知》，商业部等四部门发出《关于国内商业企业、事业单位的财务工作问题的规定》，从而保证了地方的流通管理权限扩大。20世纪70年代初，中央又收回了部分下放的权限，如中央收回工商业一级站，省市收回了二级批发站。到改革开放前，我国经历了几收几放的流通管理体制格局。

（三）与计划分配体制相适应的流通方式和流通渠道

从1953年开始，与当时的计划分配体制相适应的流通方式和流通渠道逐步形成。根据管理与经营分开、采购供应与市场销售分开的原则，商业中的日用工业品的流通主体主要是国营商业企业和供销社，流通渠道主要是批发商业和零售网点，形成了三级专营批发组织：即一级、二级和三级批发站。

在这样的流通方式、流通渠道条件下，中国商品市场不是按照经济规律和市场竞争的原则发育和发展，而是按照计划给出的轨道和方向发展。这固然有经济发展水平较低、商品供求矛盾较大等原因，但从根本上来看，则是受当时的理论认识的局限，没有认识到中国应该发展商品经济和市场经济，认为市场经济体制是与资本主义制度相联系的。尽管当时承认消费资料是商品，但商品流通仍要在高度集中的计划控制之下，从而极大地制约了商品市场的发展。虽然随着经济发展，物质商品的数量在增加，居民消费也有所增加，但是中国的商品市场却在长时期中始终未能真正发育起来。

二、改革开放后中国商品市场发展的进程

从新中国建立初期到20世纪70年代末，我国商品市场总体上讲，商品货源不够充裕，商业部门对一些重要的消费品采取了计划

供应、票证控制供应、节日和重要性商品供应等多种不同的供应方式，以保证人民生活基本需要。党的十一届三中全会以来，随着我国经济体制改革和对外开放的不断推进，为我国国民经济和社会发展注入了巨大的生机和活力，同时我国流通领域也发生了历史性的变化。我国商业机构及网点得到空前发展，市场供求关系得到了根本改善，大市场、大流通的经营格局已经形成，城乡市场空前活跃，形成了多种经济成分、多种流通渠道、多种经营方式并存的开放式和少环节的新型流通体制，消费品市场货源充裕，市场上商品的种类日益丰富，人民生活水平和消费水平出现了划时代的变化。改革开放以来，中国市场特别是商品市场发展较快，对促进生产、搞活流通、繁荣经济、解决就业问题起到了重要的促进作用。

1978年12月召开的党的十一届三中全会，标志着我国经济体制改革的序幕正式拉开。全会决定把全党工作的重点转移到经济建设上来，实行改革开放的方针。自此，我国商品市场也迈开了快速发展的步伐。迄今为止，我国商品市场大体经历了五个大的阶段。

（一）起步阶段（1979～1984年）

中国商品市场发展的起步阶段。随着农村体制改革的迅速展开，我国农产品产量迅速增加，在解决全国人民温饱的基础上，农副产品商品率迅速提高，从而使城乡集市贸易快速地恢复和发展起来。同时，随着城市经济改革的进展，逐步放开了小商品价格，并对机电产品等部分工业产品实行了浮动价格，一部分生产资料价格实行了“双轨制”。这些改革措施促进了消费资料商品市场的发展，生产资料市场建设也开始起步。此外，城镇商业流通业发展较快，商业网点迅速增加。

（二）全面展开阶段（1985～1991年）

中国商品市场建设全面展开阶段。1984年，以中共中央《关于经济体制改革的决定》的颁布为标志，城市经济体制改革迅速

展开。在扩大企业自主权、塑造商品经济主体的同时，价格改革全面展开，在逐步缩小指令性计划范围的同时，重点是改革长期扭曲的价格体系和过度集中的计划价格形成机制。改革提高了政府指导价和市场调节价格的比重，为商品市场的发展奠定了基础。在这一阶段，商品市场的发育和发展步伐明显加快。农副产品批发市场、浙江专业批发市场纷纷建立，各地政府也重视培育市场，如山东寿光蔬菜批发市场、浙江义乌小商品批发市场和一些生产资料市场等都是在这时期建立起来的。城镇商品流通市场在这时期也出现快速发展，商业网点数量较大幅度增加。居民消费革命带来的消费结构升级促进了商品市场的建设和发展，特别是千元级的耐用消费品为主导的消费结构变化，使城市商品市场发展步伐进一步加快，以满足人民日益增长的消费需求。

（三）快速发展阶段（1992～1996 年）

中国商品市场快速发展阶段。1992 年，在邓小平“南巡”讲话精神的指引下，中国迎来了新一轮改革发展的热潮，商品市场发展出现了快速发展势头。特别是在 1992 年 10 月，党的十四大确立了我国改革目标是建立社会主义市场经济体制以后，商品市场更加迅速地发展。到 1995 年底，我国在“八五”时期建设的市场数量，已经比新中国建立四十多年的总和还要多。这一时期，一方面，城市商品市场和商业网点建设空前加快，特别是非国有资金大量投入到商业流通领域建设中来。仅以北京市为例，“八五”期间投资建设的万平方米以上的大型百货商场就达几十家，促进了这一时期商品零售总额的快速增长（见表 1-1）；另一方面，城乡批发市场建设如火如荼，出现了大量产地型、销地型和集散地型的消费资料、生产资料和农产品批发市场（见表 1-2），辐射范围不断扩大。多种成分的市场经营主体出现。在许多地方，确实是建一个市场，兴一个产业，富一方百姓。如浙江绍兴的“中国轻纺城”、天津的“北洋钢材市场”等都是在这时期兴建的。同时，这一时期中国商品市场的对

外开放迈出了更实质的步伐。1992 年以后, 我国的几个沿海开放城市开始进行中外合资商业零售业试点, 国外先进的经营技术和理念进入我国, 带动了我国商品市场的发展。商业新兴业态迅速发展。但是不可否认, 在这一时期, 盲目、重复建设市场的问题也比较严重, 一些地方, 不顾客观现实, 盲目建有形市场, 导致出现了许多有场无市的“空壳市场”。城市中大型商场过度发展, 盲目求全、求大, 导致了社会资源的浪费, 经济效益低下。

表 1-1 北京城乡零售总额情况

年份	零售总额 (亿元)	城市 (亿元)	增长 (%)	农村 (亿元)	增长 (%)	城/乡 (倍)
1993	12 237	7 176	31.2	5 061	19.5	1.42
1994	16 053	9 555	33.2	6 498	28.4	1.47
1995	20 598	12 389	28.2	8 209	24.3	1.49
1996	24 614	14 921	20.1	9 693	18.3	1.54
1997	27 200	16 395	10.9	10 499	9.2	1.18

表 1-2 全国各类农副产品批发市场情况 (1996 年)

类 型	市场数 (个)	成交额 (亿元)
蔬菜市场	1 254	605
干鲜果市场	827	294
水产品市场	278	189
肉禽蛋市场	231	98
粮食市场	461	178
食用植物油市场	30	18
仔猪市场	231	14
中药材市场	41	112
其他市场	491	398

资料来源:《中国国内贸易年鉴 (1997)》。