

胡玉立 李东贤等 编著

市场预测

与

管理决策

(修订本)

中国人民大学出版社

图书在版编目 (CIP) 数据

市场预测与管理决策/胡玉立 李东贤等编著—2版 (修订本)
北京:中国人民大学出版社, 1997

ISBN 7-300-02227-8/F·665

I. 市…

II. 胡…

III. 市场预测-高等学校-教材

IV. K 713.54

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (96) 第 16893 号

市场预测与管理决策 (修订本)

胡玉立 李东贤 等 编著

出版:中国人民大学出版社

(北京海淀路 175 号 邮码 100872)

发行:新华书店总店北京发行所

印刷:中国人民大学出版社印刷厂

开本:850×1168 毫米 1/32 印张:13.875

版次:1985 年 6 月第 1 版

1997 年 3 月第 2 版 1997 年 3 月第 1 次印刷

字数:342 000

定价:17.00 元

(图书出现印装问题,本社负责调换)

修 订 说 明

本书第1版(车礼、高广礼编著)于1985年出版以来,被国内许多高等财经院校商业经济和管理专业及相近专业作为教材,已使用十多年。由于我国社会主义市场经济体制的建立和近年来多数部门、企业等的广泛实践经验的积累,本书第1版的内容在原有基础上,应进行必要的补充和修改。

本书修订部分主要包括:增写了社会主义市场体系有序运转的特征与功能、管理决策科学化要求与途径、市场调查资料的处理与分析、市场预测基本原则等内容;同时,注意吸收实际应用经验,充实和调整市场预测与管理决策的分析方法技术方面的内容,使其更接近实际应用需要。

参加本书修订版编写的人员有:胡玉立副教授(导论、第五章至第十一章);李东贤讲师(第一章至第三章);陈欢歌讲师(第四章)。全书由胡玉立负责总纂。

本书编写过程中得到了车礼教授的热情帮助,并提出了许多宝贵意见,谨此表示感谢。

由于编者水平有限,书中难免存在错误和不妥之处,恳请读者批评指正。

编 著 者

1996年1月

第 1 版 前 言

《市场预测和管理决策》是为适应培养现代化管理人才和培训干部的需要而编写的,并于1981年全国商业教育工作会议上纳入了教材编写规划。

我国正处在社会主义现代化建设的新时期。为了顺利地实现现代化建设的宏伟目标,必须实现管理现代化,不断提高经济效益。但是,提高经济效益,实现现代化管理,离不开正确的决策,决策贯穿于管理的全过程,决策正确与否关系着企业经济活动的成败。而正确的决策又必须以在市场调查的基础上,作出的准确的市场预测为依据。市场调查、市场预测和管理决策,三者密切联系不可分割,是现代化管理的重要组成部分。为了不断提高管理水平,逐步实现管理现代化,就需要培养一批能够熟练地应用市场调查、市场预测和管理决策的理论和科学方法的人才,编写本书的目的就在于试图为此略尽绵薄。

本书共有四篇十二章。第一篇导论,主要阐明市场预测、市场调查和管理决策的必要性及其相互关系。第二篇包括第二至五章,中心是阐明市场调查的理论与方法。第三篇着重论述市场预测的理论与方法,其中第六章作为本篇的概论,概述了市场预测的种类、内容和步骤,第七至九章分别阐明判断分析法、时间序列分析法和因果分析法的原理及其应用。第四篇的第十至十二章,集中阐明管理决策的理论,各种决策方法的原理和应用,以及决策的组织实施等。各篇密切联系,又具有相对独立性。我们编写本书的表述方法,既注意阐明原理,也注意适合广大在职干部、职工和社会青年自学,对各种方法均通过案例说明其应用。有的读

者如理解原理有困难，不妨先掌握各种方法的应用。自学的读者一般可以按本书的体系逐章学习，也可以根据工作需要，重点学习其中某一篇章。在学习第八章的第六、第七节有困难时，可以先学习第九章，再返回来学习这两节的内容。

本书内容的遴选，注意了吸取国外的科学方法。但是，资本主义管理既有科学性的一面，也有体现资本主义生产关系的一面，学习国外有用的经验和方法，必须结合我国的实际情况。因此，本书主要是选择那些符合我国实际，在我国商业管理中能够运用和推行的有关方法。各种方法需要在实践中加以检验，并在实践中加以发展。

本书于1981年完成初稿，经过多次教学实践，于1983年又作了较大修改。在编写过程中，重庆市商业局、重庆市交电公司、市化工原料公司、市百货公司、上海市一商局、上海市百货公司、市交电公司、上海交电采购供应站、上海五金采购供应站，以及商业部教育司和计划司给予了很大支持、帮助，蒙定明和迟文渊同志审阅了初稿，提供了许多宝贵的修改意见，在此表示衷心的感谢。

市场预测和管理决策还是一门年轻的科学，尚需通过实践来丰富和发展其内容，逐渐完善其科学体系。本书仅是我们编写的初试，因此书中不妥和错误之处在所难免，诚恳希望广大读者批评指正。

编 著 者

1983年10月

目 录

导 论 市场、市场预测与管理决策	1
第一节 市场与社会主义市场经济	1
第二节 管理决策科学性与市场信息	11
第三节 市场调查与市场预测	24
第四节 市场预测与管理决策	33

第一篇 市场调查

第一章 市场调查的种类、内容与步骤	41
第一节 市场调查的种类	41
第二节 市场调查的内容	46
第三节 市场调查的步骤	59
第四节 市场调查代理	67
第二章 市场调查方法	69
第一节 间接资料调查方法	69
第二节 直接资料调查方法——访问法	71
第三节 直接资料调查方法——观察法	76
第四节 直接资料调查方法——实验法	79
第五节 问卷设计	86
第三章 抽样设计	96
第一节 市场普查与抽样调查	96
第二节 概率抽样技术	99
第三节 非概率抽样技术	108
第四节 样本容量与抽样误差	115
第四章 调查资料的处理与分析	119
第一节 资料处理	119

第二节	资料的简单分析	124
第三节	资料的统计分析	130
第四节	统计分析软件简介	144
第五节	调查问卷与资料处理分析案例	149

第二篇 市场预测

第五章	市场预测的种类和内容	153
第一节	市场预测的种类	153
第二节	市场预测的内容	156
第三节	市场预测的步骤	165
第四节	市场预测的方法	172
第六章	判断分析方法	178
第一节	集合意见法	178
第二节	专家意见法	183
第三节	市场调研预测法	188
第四节	转导法与类比法	193
第五节	预警分析法	196
第七章	时间序列分析法	204
第一节	时间序列分析法的特点	204
第二节	简易平均法	207
第三节	移动平均法	211
第四节	指数平滑法	219
第五节	趋势延伸法	226
第六节	季节指数法	244
第八章	因果分析法	253
第一节	市场变量的因果关系	253
第二节	一元线性回归分析法	256
第三节	多元线性回归分析法	270
第四节	经济计量分析法	279
第五节	投入产出分析法	286

第六节 我国粮食供需中长期预测案例	298
-------------------------	-----

第三篇 管理决策

第九章 管理决策的程序与原则	305
----------------------	-----

第一节 管理决策的结构与分类	305
----------------------	-----

第二节 管理决策的程序	311
-------------------	-----

第三节 管理决策的原则	318
-------------------	-----

第四节 管理决策的软硬技术	321
---------------------	-----

第十章 管理决策分析方法	325
--------------------	-----

第一节 确定型决策分析方法	325
---------------------	-----

第二节 风险型决策分析方法	346
---------------------	-----

第三节 未确定型决策分析方法	367
----------------------	-----

第四节 多阶段决策分析方法	373
---------------------	-----

第五节 效用曲线决策分析法	386
---------------------	-----

第十一章 决策方案的确定与实施	391
-----------------------	-----

第一节 最优方案与满意方案	391
---------------------	-----

第二节 敏感度分析	393
-----------------	-----

第三节 信息的价值	395
-----------------	-----

第四节 多目标决策	400
-----------------	-----

第五节 决策方案的实施	414
-------------------	-----

第六节 管理决策分析案例	418
--------------------	-----

附录:

附录 A t 分布临界值表	425
-----------------------	-----

附录 B 检验相关系数 $\rho=0$ 的临界值 (r_c) 表	426
---	-----

附录 C F 分布表	427
--------------------	-----

参考书目	431
------------	-----

导论 市场、市场预测与管理决策

第一节 市场与社会主义市场经济

市场归属商品经济的范畴。社会主义市场经济体制下，国家为实现其宏观调控职能，让市场体系有序运转；企业为增强活力，更好满足需求，提高经济效益，都必须对市场有个正确的认识。

一、市场与市场功能

（一）市场的含义。市场是商品生产、商品交换的产物。列宁指出：“哪里有社会分工和商品生产，那里就有‘市场’；社会分工和商品生产发展到什么程度，‘市场’就发展到什么程度。市场量和社会劳动专业化的程度有不可分割的联系。”^①可见，市场这一概念，同社会分工和商品生产是完全分不开的。人类社会因社会分工使商品生产者各自生产具有特定使用价值的商品，彼此之间要补偿各自生产的商品价值来交换自己需要的商品使用价值。市场就成为实现不同商品生产者之间、生产者同消费者之间的商品交换的交换关系的总和。

随着商品生产的发展，社会分工趋向专业化，进入现代社会，每个人专门从事着某种商品的生产活动，取得报酬（货币），并用它来购买所需要的商品。此时，整个社会产品的实物形态和价值形态的实现，都离不开市场。市场成为联结社会生产、分配、交换、消费的纽带。通过错综复杂的市场联系，使社会再生产周而

① 《列宁全集》，中文2版，第1卷，79页，北京，人民出版社，1984。

复始地运行，活跃着整个社会的经济生活。市场在社会再生产过程中，作为社会分工和商品生产的表现，既是生产发展的结果，又是生产发展的条件。市场随商品经济的发展而发展，市场地域范围由区域市场发展形成全国的统一市场，乃至扩展到国际市场；市场体系由单一类的物质商品市场发展为既有物质商品类市场又有生产要素类市场的日臻成熟的市场体系。在现代社会中，市场活动范围由小到大的规律性，不仅在外延上不断趋向扩大，在内涵上也发生了深刻的变化。我们认为要研究市场预测与管理决策，应该弄清市场以下含义。

1. 市场是商品交换场所及其实现商品交换关系的统一。就是说，市场是商品交易的地域载体。如集市、商店、商社、超级市场、商品交易会、购物中心等商品买者与卖者进行交易的场所。同时，市场是商品生产者、经营者、消费者所形成的交换关系总和。如社会生产和社会需求关系；市场上国家、集体、个人间的供需关系；商品供求行情、交换方式、讨价还价、交易行为等与市场的运行交织着的众多经济利益关系。显然，没有地域载体，商品交换关系无处实现；没有商品交换实现的经济关系，市场会因没有实际内容，图有虚名而消失，只有两者结合在一起才能形成真正的市场。

2. 市场是商品交换的体系，即市场体系。从商品交换关系来看，市场客观存在市场主体和市场客体。市场主体是指从事商品交换的当事者：企业、政府、家庭个人。企业既是商品供应者，又是商品需求者，它包括生产商、中间商（批发商、零售商、商业中介人）。一般生产商要从市场购买资源，转换为商品和服务后卖给中间商，再经由中间商零售给家庭个人消费。政府是一种特殊的商品交换当事者，既是国家资源供应者，在国家定货情况下也是商品需求者。它一方面要从生产商、中间商、家庭个人消费者征税，依此转换为公共需要的服务；另一方面也会从其他商品交

换当事者处购买商品。家庭个人一般是商品需求者，当然拥有劳动力的家庭个人则要通过自己劳动取得报酬来购买商品和服务。由此可见，从商品交换当事者角度看，市场体系包括生产商市场、中间商市场、政府市场和家庭个人消费者市场。当然，市场主体联结多种市场间的商品交换过程而形成复杂的相互影响，离不开进入交换的市场客体。

市场客体是指进入交换的商品。现代社会进入交换的商品分为两类：一类是生活消费品和服务，指直接用来满足人们物质文化需要的最终消费的消费品商品；另一类是生产要素，是满足生产经营活动需要的资源商品，如生产资料、技术、资金、信息、劳动力等。从市场客体角度看，市场体系包括消费品市场和生产要素市场（或称资源市场）。消费品市场的核心是家庭个人消费者市场的需求，同时涉及消费品商品从生产商市场经中间商市场向家庭个人消费者市场转移的整个流通过程，它在市场体系运行中具有始发启动意义。生产要素市场，包括生产资料市场、金融市场、技术市场、劳动力市场、信息市场等，它的形成对全社会范围内各项生产要素的合理配置发挥着基础性的作用，显示着市场体系整体构件的完备，使企业能真正成为独立的商品经营者，通过市场把自己生产经营的商品迅速卖出去，并通过市场在更广泛的空间范围内选择各种优质的生产要素，按照市场的信号决定企业生产经营业务的收缩和扩张。

可见，市场体系是由相互联系、相互补充的多种要素市场合成的商品交换关系的统一体。它的完善标志在于市场的组成要素齐全，并充分反映市场主体间的全部交换关系。其中消费品市场是本书研究的重点。

3. 市场是一种经济运行手段，即市场机制。无论是消费品市场还是生产要素市场，在商品交换的实现过程，无不发生买卖双方根据当时市场商品供求状况、竞争状况、讨价还价状况，在双

方认同的价格水平上实现商品交易。因此，商品交换实现的经济关系，内在存在着实现商品交换的基本要素：价格、供求、竞争。我们把价格、供求、竞争称为商品交换的市场基本要素。它们相互联系、相互制约、相互作用的关系及其功能，便是市场机制。如果我们把前面所述市场体系视为市场经济的骨骼构架，那么市场机制就好比市场经济的骨骼构架间联结运作的润滑剂。市场机制必然对市场主体发生调节作用，尤其是对市场主体——企业的微观活动发挥积极的调节作用，要求企业采用先进的科学技术，改进经营管理，促进劳动效率提高；按照市场需要优化生产要素组合，实现供需衔接；善于接收市场信息，发挥竞争和优胜劣汰机制，增强商品生产经营活力。市场机制的调节作用便是市场调节，它是价值规律通过外在表现的市场交换关系发挥调节作用的一种形式。当然市场机制不仅有其作用的积极面，也存在其消极面，如市场机制的自发性，往往也带来资源配置的无序流动，引发社会经济震荡，一定条件下还会带来社会分配收入的不公正，甚至发生两极分化；再者，市场机制调节作用的事后性，使不同市场上的市场主体接受的市场信息，如供求行情、价格信息滞后于实际，且存在某种不确定性，从而影响市场机制调节的有效性。正因为如此，发达的商品经济，在运用市场机制经济运行手段的同时，也利用经济运行的计划调节功能。依据对客观经济规律的认识，根据社会生产和社会需要之间的内在联系，有计划地实现社会总劳动按比例分配的自觉形式及其调节经济运行的功能。这种功能简称计划调节，它表现为人们有意识地依据客观规律的主观见诸于客观的过程。这两种机制，在对经济运行过程微观基础的各个企业的个量资源配置，都可以运用，但只能以其中一种为直接调节方式，另一种为辅助调节方式。以市场机制对微观资源配置起基础性直接调节作用，在此基础上实行宏观计划调节，这就是市场经济；反之，就是计划经济。

(二) 市场功能。市场功能是指社会经济活动中市场体系运行产生的效能。主要表现为市场交换功能、市场调节功能和市场信息反馈功能。尽管由于社会形态和商品经济发达程度的不同，市场体系的发育状况存在着差别，但市场功能作为市场活动所具有的内在属性，是一切市场所共有的。

1. 市场交换功能，即以市场为商品交易场所和中介，促进和实现商品所有权与实体交换活动的效能。它是市场最基本的功能。在市场经济条件下，商品生产者出售商品，消费者购买商品，以及经营者买进卖出商品，都是通过市场进行，为满足消费者需求方便，推动商品所有权在各当事人之间让渡，和商品实体从生产者手中向消费者手中转移。市场交换功能具体表现为销售、采购、运输、储存和挑选分类等功能。

2. 市场调节功能，即以市场机制为价值规律发生作用的实现形式，自动调节社会经济运行过程和基本比例关系的效能，是市场体系的核心功能。通常表现为市场机制以价格调节、供求调节、竞争调节方式，对社会生产、分配、交换、消费的全过程进行自动调节，如对社会资源配置，生产产品总量和种类构成的调节；对生产者、经营者、消费者和各生产要素的所有者或支配占有者之间经济利益分配的调节；对社会商品交换数量、品种与结构的调节；对社会消费水平、消费结构的调节等。最终实现对社会经济基本比例关系，如积累与消费、农轻重等基本比例关系的自动调节，从而促使市场体系快速生成和发育。

3. 市场信息反馈功能，即以市场体系运行中形成的市场信息，经传递、接收影响商品交换当事人交换活动的效能。市场信息是对反映市场经济活动的消息、情报、数据、资料、指令的总称。它既是市场上商品供需能力的客观描述，同时借助市场活动参数如价格、利率、工资率、股息等相互变动、相互作用信息，预示市场供求变动趋势，对生产者、经营者、消费者经营活动产生

连续引导和反馈协调作用。它是市场体系运行派生功能，随着社会信息化程度提高，市场信息反馈功能日益加强，为国家宏观经济管理决策和企业生产经营管理决策提供重要依据，使市场体系在运行动态过程中表现出自组织特征。

二、社会主义市场经济与科学决策

(一) 社会主义市场经济的特征。党的第十四次代表大会明确提出，建立社会主义市场经济体制是我国经济体制改革的目标。掌握社会主义市场经济基本特征，有益于加强和推动政府宏观经济管理、企业微观经济管理科学化，以及市场调查与预测理论的研究及实践的发展。

市场经济是以市场机制为配置社会资源的经济运行形式和方法的一种经济体制。当人类社会经济活动都通过市场，以市场为资源配置的经济运行形式和方法时，商品经济即进入高度发达阶段，即市场经济。它是商品经济发展的必然产物。从历史发展进程来看，商品经济由来已久，存在于诸多社会形态。虽然有商品经济就有市场，但并非商品经济发展的任何阶段都形成市场经济。市场经济要有一定条件，即完善的市场体系使商品和各种生产要素能在全社会范围内自由地配置到效益最优化的项目和组合中。可见，市场经济与商品经济既有联系，又有区别。二者的联系，都以商品交换和市场为基础，经济活动按照价值规律运行。二者的区别，商品经济是比较抽象、比较本质地表现社会生产方式的内容，根据产品通过交换进入消费这一基本特征来界定的；而市场经济是比较具体、现实地反映社会生产方式中的形式，根据社会资源配置的具体方式来界定的。在范畴划分上，商品经济是相对于自然经济和产品经济而言的，在于人类社会经济活动中交换行为是否具有商品性或等价补偿关系；而市场经济是与计划经济相对应的，主要根据社会资源配置方式进行区分。当社会资源配置主要由政府按照预定计划通过行政命令配置时，为计划经济；当

社会资源配置按照市场机制在不同部门和企业之间有效配置时，为市场经济。显然，只有商品经济赖以存在的市场发育较完善，既有消费品市场，又有生产要素市场，而且以市场机制运作将它们结合成一个完整的市场体系时，商品经济才进入高级阶段，构成市场经济。

市场经济作为经济运行的一种体制，在不同社会制度的社会均可采用。我国社会主义市场经济体制，是同社会主义基本制度结合在一起的，界定了市场在社会主义国家宏观调控下对资源配置起基础作用的社会属性。它与资本主义制度的市场经济的本质区别在于这种政治领导体制下，以公有制（包括国有制和集体所有制）为主体，个体、私营、外资等经济成分为补充的多种所有制组合；在分配制度上以按劳分配为主体，其他分配形式为补充，关注效率与公平，运用市场机制合理拉开差距，同时运用多种调节手段防止贫富两极分化，实现共同富裕。简而言之，我国实行的社会主义市场经济，是社会主义国家宏观调控下的市场经济体制。它具有市场经济的一般特征。

1. 经济关系市场化。社会的一切经济活动都直接或间接地处于市场关系之中，体现供求关系规律、价格规律、竞争规律的内在市场机制是推动社会资源要素流动和促进资源优化配置的基本运行机制。

2. 企业行为自主化。企业是市场经济的重要主体，参加市场经济活动的每一个企业具有法人地位，都必须具有生产经营自主决策、自主经营的权利，必须自负盈亏。

3. 宏观控制间接化。政府部门不直接干预企业生产和经营的具体事务，一方面借助计划导向市场经济运行总目标，合理规划国民经济和社会发展战略，矫正市场调节出现社会资源配置失衡，对社会供求总量和重大结构进行宏观计划调控；另一方面，通过财政、税收、价格、金融等政策调节，规范企业经营活动，保障

市场经济健康地运行和发展。

4. 管理法规化。竞争是市场经济的突出特点，由于市场结构本身难以达到完全竞争和提供完全的信息，而且市场竞争优胜劣汰、适者生存的客观规律容易引起两极分化。为实现经济长期稳定发展，需要政府制定一套科学而严谨的法规体系，让所有企业经营活动按照法规来进行，以弥补市场机制的缺陷，使整个经济运行有序。从此意义上讲，市场经济运行是一种法制经济。

(二) 市场经济需要科学的管理决策。在我国，由计划经济体制到市场经济体制的建立，是一项艰巨而复杂的任务。必须充分认识市场经济体制的企业、市场、政府“三位一体”的构成环节，切实抓好以下三方面改革。

1. 构筑市场经济的微观基础，抓住企业这个基础环节，深化国有制企业体制改革，建立现代企业制度，使之成为依赖市场而生存和发展的市场主体。具体讲，要求企业能够自主经营、自负盈亏；建立适应市场机制的企业经营机制；企业内部引入竞争机制，改革劳动、人事、分配制度；卸掉企业“办社会”的负担，发展社会化的服务产业和建立社会保障制度等，使企业成为具有经营管理决策自主性、经济活动效益性、企业市场行为应变性和企业系统自组织性等特征的市场主体，能够对市场各种变化作出能动反应，满足需求，引导需求，促进市场的开拓，提高竞争优势。否则，企业不能进入市场竞争，市场经济体制便没有微观基础。

2. 构建市场经济的客观条件，着力市场体系培育与发展及制度建设。市场是市场主体——企业活动的舞台。完整的市场体系是社会主义市场经济走向统一性的保证条件。我国经济改革实践表明，没有健康发育的市场体系，社会主义市场经济就很难真正建立。因为企业不能从市场中组织生产要素资源，又不能通过市场自主销售商品，企业则难以成为市场主体；同时，缺少等价交换、公平交易、平等竞争的市场运行规则、法规和管理制度，就

很难保证市场信号不扭曲，也就形成不了准确反映市场关系变化的调节机制，所以，积极创造条件，充分发展商品经济，使商品范围扩大，不仅有消费品市场，而且还有发育和发展的生产资料、金融、技术、劳务、信息和房地产等要素市场，形成全国统一性、开放式、竞争型的市场体系，是生成市场机制，建立市场经济的关键性的系统工程。

3. 转变政府职能，健全宏观调控管理体制。社会主义国家的宏观调控主体地位，要求在新旧体制转轨中不能放松宏观调控，而且要强化政府的调控职能。政府作为宏观调控主体，体现其地位的具体途径，在传统体制下是整个国民经济的发展，在国家政府的直接控制下进行，即直接调控。社会主义市场经济沿用直接调控是不利于微观搞活的。为了满足微观搞活，保证宏观经济的协调发展，国家只有建立新的宏观调控模式——间接调控。即国家是通过经济杠杆的运用，通过市场机制实现间接控制企业经济活动，市场处于国家的计划调节之中。这种调控市场经济运行的模式，关键在于通过国家宏观调控和管理，导向和规范市场经济运行。要加强和改进计划手段，要求社会主义国家政府所有者职能、行政管理职能与宏观调控职能的分离；通过撤并主管企业经营部门，并适应市场经济要求重新界定原综合部门职权和职能，实行宏观统筹规划，信息引导、组织协调、提供服务和检查监督；依法建立行政责任制，更新计划观念，改革计划形式，如计划工作重点从年度计划转向中长期发展计划，把合理确定国民经济和社会发展的战略目标，搞好经济发展预测，总量调控，重大结构与生产力布局规划，集中必要的财力、物力进行重点建设作为基本着眼点，强调计划本身的科学性。具体地讲，是通过经济杠杆综合运用与国家发布指导性计划，实施宏观经济管理。国家调节企业行为是通过市场，将计划调节变量输入市场，再通过市场中介传递，间接迂回地调节企业行为。实际上建立和健全国家宏观调