

ECONOMY

中国经济运行丛书

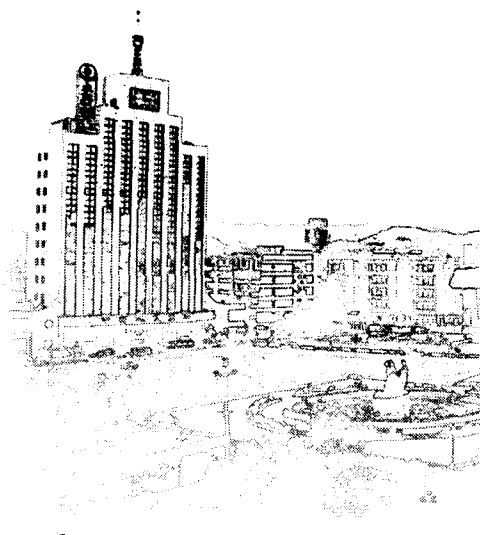
市场经济与 经济预测

张守一

等著

科学文献出版社

中国经济运行丛书



市场经济与 经济预测

张守一
等著

社会科学文献出版社

图书在版编目(CIP)数据

市场经济与经济预测/张守一等著. - 北京:社会科学文献出版社,2000.7

(中国经济运行丛书)

ISBN 7-80149-325-7

I. 市… II. 张… III. 市场经济-经济预测-研究-中国 IV. F123.9

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2000)第 21283 号

·中国经济运行丛书·

市场经济与经济预测



著 者: 张守一 等

责任编辑: 张景曾 屠敏珠

责任校对: 闫晓琦

责任印制: 同 非

出版发行: 社会科学文献出版社

(北京建国门内大街5号 电话 65139963 邮编 100732)

网址: <http://www.ssdph.com.cn>

经 销: 新华书店总店北京发行所

排 版: 北京中文天地文化艺术有限公司

印 刷: 北京春雷印刷厂

开 本: 850×1168 毫米 1/32 开

印 张: 15.5

字 数: 373 千字

版 次: 2000 年 7 月第 1 版 2000 年 7 月第 1 次印刷

ISBN 7-80149-325-7/F·092

定价: 29.00 元

版权所有 翻印必究

《中国经济运行丛书》

编 委 会

总 主 编 李京文

副总主编 郑家亨 汪同三 李富强

编 委 (以姓氏笔画为序)

王稼琼	史忠良	刘迎秋	刘溶沧
许晓峰	李 平	张屹山	张声书
沈利生	吴尚民	罗国勋	周德英
胡乃武	钟学义	顾海兵	蔡 昉
潘新平			

《中国经济运行丛书》总序

李 京 文

20 世纪世界经济发展史上的一大“奇迹”，就是近 50 年来中国经济取得了举世瞩目的成就，由一个殖民地半殖民地的贫穷落后国家发展成为独立的社会主义大国。特别是改革开放 20 年来，中国经济以年均 10% 的速度持续、稳定、高速发展，大大增强了中国的综合国力和国际竞争力，大大提高了人民生活水平和中国的国际地位，也为亚洲和世界经济发展与社会稳定作出了自己的贡献。特别是近期中国经济在东南亚金融风波中表现得最为明显。

对世界经济发展中的这个“奇迹”，对中国经济近 20 年的快速、稳定发展有许多问题值得深入探讨。例如，这个发展进程有些什么特点，它的运行机理是什么？如何保持中国经济持续、稳定、高速运行？中国生产率增长和资本、劳动等生产要素对保证中国经济运行有什么贡献？中国经济运行中的热点和难点何在，如何培育新的经济增长点？数量经济、技术经济、区域经济等经济学科的深入研究和对中国经济运行有什么促进作用？中国经济运行中的政策取向是什么？中国应如何迎接知识经济时代的到来？对 21 世纪的中国经济如何展望？等等一系列问题，都是经济学工作者、企业家、各级领导干部与管理人员，以及全国人民十分关心的大事，也是国际社会关注的焦点。这套《中国经济运行丛书》就是试图将对这些问题做出初步回答而组织编写的。

社会科学文献出版社在世纪之交推出的这套《中国经济运行

丛书》，经过了有关专家的精心策划、精心选题、精心安排，并邀请国内外知名学者为丛书作者，力求在内容上和形式上都使人耳目一新，争取成为中国经济类图书的样本。这套丛书的出版，对中国经济运行的研究具有重要的理论意义和现实意义，必将产生深远影响。

这套丛书之所以值得一读，我以为其原因就在于它将具有三大特点：科学性和先进性、系统性和全面性、应用性和启示性。

首先，这套丛书是中国著名经济学家和优秀中青年学者的创作或合作产物，代表了当今中国经济学研究的主流方向。他们吸收了国内外最新的研究成果，采用定量分析与定性分析相结合的方法，继承性与开拓性相结合，理论与实证研究相结合，如实地评价过去，科学地展示未来，提出新观念和新思想，构造新模型和运用新方法，使各有关课题研究处于国内或国际的领先地位，具有较深刻的理论探索意义和较高的学术价值。如《知识经济的兴起》、《中国生产率分析前沿》等。

其次，这套丛书反映了中国经济运行的方方面面，对经济增长趋势、科学技术进步、产业结构升级和支柱产业选择、人力资源和就业结构、消费和需求结构、发展战略和政策建议等，都有全面、深入、精辟的论述，既有系统的、权威的数学模型，又有详尽的统计资料和典型数据，在总量层次、部门（产业）层次、地区层次等各个层面都可为进一步跟踪研究和拓宽研究范围提供帮助。如《中国经济增长的理论与政策》、《中国经济增长与可持续发展》等。

最后，这套丛书的目的在于为中国实现“两个根本性转变”和实现 2010 年远景目标贡献力量，因此必然要紧密结合中国经济运行的实际，有针对性地对中国经济运行中出现的问题，提出切实可行的政策思路和政策建议，特别是始终强调科教兴国的基本国策，强调科学技术进步在中国未来经济发展中的重要作用。

这套丛书对中国经济运行中的现实问题和应用问题，给了我们一些很好的帮助和启示。

我希望，这套丛书的出版，既是对我国改革开放 20 年和中华人民共和国成立 50 周年的丰厚献礼，也是对我国继续坚持改革开放，实现我国经济的持续、快速、健康发展的有效促进，同时也是对不断变革与蓬勃发展的中国经济科学宝库的一个补充与丰富。

由于时间紧迫，水平有限，而且这套丛书涉及的范围非常广泛，研究对象十分复杂，其中很多因素带有极大的不确定性，因此尽管作者和出版者们作出了最大的努力，也仍然不可避免地会存在这样那样的不足之处，在此真诚期望各界读者批评指正，以便使这套丛书不断修正、补充、完善。

1998 年 6 月

市场经济与经济预测是一对“双胞胎”

(代 序)

张守一

在这个代序中，我们要论证市场经济与经济预测是一对“双胞胎”，要讨论的主要问题是：中国建立社会主义市场经济体制是正确的选择，市场经济是经济预测产生与发展的沃土，市场经济一刻离不开经济预测。

一、中国建立社会主义市场经济体制是正确的选择

经济学已经证明，完全竞争和完全计划都可以实现帕累托最优，但这是抽象的理论，由于缺少一序列条件，实际上做不到这一点。中国从 1953~1978 年实行了 25 年的计划经济，实践证明，这种经济体制在实际运行中遇到了三大障碍：一是组织结构问题，经济系统与行政系统是本质不同的两大系统，但在计划经济条件下，经济系统从属于行政系统，是后者的附属物，经济系统不是按照客观规律运行，而是按照长官的主观意志行事，“大跃进”、“洋冒进”是典型的事例；二是信息问题，计划经济是由计划层层安排的，如果中央计划者能够全面、系统、及时地掌握一切信息，就能作出符合实际的计划。信息学已经证明，信息是不完全的，是滞后的，收集、处理信息需要成本，这就使计划经济体制遇到了不可克服的困难；三是利益问题，计划经济在理论上强调中央利益，忽视地方（部门）利益；强调集体利益，忽视个人利益，在实践上出现了职工吃企业的“大锅饭”、企业吃政

府的“大锅饭”的情况，在收入分配上大搞平均主义，对企业、个人失去了激励作用。

以上三大障碍使计划经济体制不能充分调动职工的主动性、积极性、创造性，生产效率不高，经济效益下滑，消耗高、质量差、浪费严重、科技进步慢、管理落后等等，就成了计划经济的代名词，“短缺经济”就成为这种经济的真实写照，充分说明计划经济体制这种生产关系不适应生产力发展的要求，1978年中国走上改革开放之路，以建立社会主义市场经济体制作为改革的目标模式，是必然的、也是正确的选择。

与计划经济体制相比，市场经济基本上不存在上述三大障碍。在市场经济条件下，经济系统与行政系统是分开的，政府不直接干预企业的经营活动；市场主体的决策是自主的，所需要的信息量少于中央计划者所需要的信息量，即使由于信息不完全造成决策失误，损失是局部的，不像中央计划者的决策失误造成全局性的、有时是灾难性的损失；市场主体追求利益最大化，激励是充分的。

二、市场经济是经济预测产生与发展的沃土

市场经济是经济预测产生与发展的沃土，以美国为代表的发达国家，预测咨询业的发展已经有力地证明了这个道理。

第一，在计划经济条件下，个人（家庭）收入由政府规定，企业计划由上级安排，没有开展经济预测的必要，前苏联的经济预测局限于宏观范围，就是这个道理。在市场经济条件下，经营主体自主决策，自主经营，自担风险，自负盈亏。而发达国家只有局部计划，没有全局计划，市场主体（个人、家庭、企业）在作微观经济计划时，必须了解市场信息，了解政府政策，经济预测也就应运而生了。

中国通过21年的改革，指令性计划已经基本上退出了历史

舞台，但个人、家庭、企业都要制定计划，需要了解市场信息和政府政策，因此中国经济预测与改革开放同呼吸，共命运，是一种必然现象。

第二，在市场经济条件下，市场机制在资源配置中发挥基础性作用。市场机制分为供求机制、竞争机制、价格机制、风险机制等等，无论微观经济还是宏观经济，都需要研究这些机制作用的方向和力度，也就是要认识客观经济规律，并自觉地运用这些规律指导自己的行动，这为经济预测的发展提供了用武之地。

第三，市场经济是一个总称，它分为商品（含技术）市场、劳动力（含人才）市场、金融市场和国际市场。当某个市场出现非均衡现象时，就会对其他市场产生“溢出效应”，例如如果劳动力市场供过于求，工资下降，就会使消费品市场的销售额减少，反之亦然。为了使市场经济持续、快速、协调地发展，需要开展经济预测，把握这些市场及其相互关系的发展变化。

第四，现代市场经济是开放的经济，由物流、人流、资金流、信息流、知识流形成的经济全球化，发展迅速，势不可挡。经济全球化为经济预测开辟了又一个发展空间。我们在巴黎看到，随着美国跨国公司在法国落户，美国预测咨询机构也打入了法国。改革开放以来，中国出现了类似的情况，随着外国跨国公司在华登陆，它们的咨询公司就接踵而来。

第五，现代市场经济体制是市场机制与宏观调控相结合的体制，国家既参与经济活动，又干预经济运行。何时干预，如何干预（干预手段），何处干预（干预领域），干预多少（干预力度），都是中央政府需要决策的问题，决策应以预测为基础。

三、市场经济时刻离不开经济预测

对经济管理来说，预测具有普遍性，它与计划经济并不矛盾，也就是说，经济预测对制定经济计划是必要的，但不充分。

前苏联在经济预测方面作了不少工作，说明经济预测对制定计划是必要的。所谓不充分，是指经济预测对计划者没有切身的利害关系，当他们认识到这种必要性时，经济预测就能开展起来；当他们没有认识到这种必要性时，经济预测就不能开展起来。在我国计划经济时期，计划者错误地认为它是资本主义社会的产物，社会主义社会不需要开展经济预测，使它没有发展起来。

对市场经济来说，经济预测不仅是必要的，而且是充分的。换言之，经济预测对市场主体有着密切而巨大的利害关系。

对个人、家庭来说，劳动就业，工资水平，资产组合（证券、股票、存款），消费品价格，农产品市场与价格，都是他们关心的焦点。未来是随机的，在没有预测的情况下，个人、家庭的经济活动存在很大的盲目性。对上述问题开展预测，可以降低随机性，提高确定性，使个人、家庭获得巨大的经济效益。

对企业来说，通过经济改革，人、财、物、供、产、销的决策权基本上都交给了企业，在这些权力中，企业领导者能够自己做主的只有“产”，其他权力都与外部有关，而“产”又不是孤立的，它与人、财、物、供、销有着密切的关系。不开展经济预测，企业领导者的行为是盲目的，决策失误会造成巨大的损失。开展经济预测，可以使他们减少盲目性，提高自觉性，减少决策失误。这一点对国有企业更加重要，改革开放已有 21 年的历史，仍然有不少国有企业的领导者不了解市场，盲目生产，造成了很大的损失。他们要在转变观念的基础上开展经济预测，及时掌握国内外市场的动态，改变被动局面，取得主动权。

如上所述，现代市场经济，国家既参与经济活动，又干预经济运行。国家为什么要参与经济活动？1875 年马克思在论述新社会产品分配时指出：社会总产品在扣除用来补偿消费掉的生产资料的部分，用来扩大生产的追加部分，用来应付不幸事故、自然灾害等的后备基金或保险基金后，还要扣除：“第一，和生产

没有关系的一般管理费用。和现代社会比起来,这一部分将会立即极为显著地缩减,并随着新社会发展而日益减少。第二,用来满足共同需要的部分,如学校、保健设施等。和现代社会比起来,这一部分将会立即显著增加,并将随着新社会的发展而日益增加。第三,为丧失劳动能力的人等等设立的基金,总之,就是现在属于所谓官办济贫事业的部分”。^①

在中国,马克思设想的第一项费用不仅没有缩减,而是在不断地扩大。1952年有行政管理人员259万人,每万人口平均45人,1997年行政管理人员达到了1093万人,每万人口平均88人,后者比1952年增长了95.6%;行政管理费用1952年为14.5亿元,每个行政管理人员平均575元,1997年这笔费用高达1358.85亿元,每个行政人员平均12432元,按现行价格计算,后者增长了20倍以上。这就是说,政府不仅规模越来越大,而且日益昂贵。1998年开始的机构改革,初步抑制了这个势头。

第二项是公共产品,现在这些产品比马克思当时设想的内容要多得多,除学校、保健设施外,还有国防、外交、公安、检查、法院、高科技、基础设施、供电、供水、供气、卫生、环境保护、公园等等。这说明随着居民人均收入的增加,他们不断地追求生活质量的提高,对公共产品需求的品种和数量日益增加。这些公共产品的一部分可以民营化,政府有关部门负责检查监督,必要时给予一定的补贴,但国防、外交、公安、检查、法院、高科技等需要政府主办。

国家为什么要干预经济运行?回答是市场决非十全十美。虽然现代福利经济学已经证明,完全竞争可以使公共利益与个人利益保持完全一致。这个定理是亚当·斯密首先提出来的。斯蒂格利茨指出:“在某些部门(如铁路、运输),如果为了取得满意结

^① 《马克思恩格斯选集》,第3卷,第9~10页,人民出版社,1972。

果而任其完全竞争，那么这个前提是值得推敲的”。^① 其实，对这个定理值得推敲的不限于某些部门，而是适用于整个市场失灵，其中包括公共产品、外部性、垄断。我们在这本专著中指出，除市场失灵外，还有市场缺陷，如市场不能处理好效率与平等的关系，市场具有滞后性，讲求经济效益、忽视社会效益，等等。

这个问题涉及到信息不完全、个人理性、社会理性之间的关系。信息与个人理性之间存在两种情况：一是个人理性希望与社会理性保持完全一致，但由于信息不完全，使它们之间发生了冲突，即“好心办坏事”；二是在市场经济条件下，容易暴露“性本恶”，即使信息是完全的，一些人也是“恶性难改”，如贩毒吸毒、制黄贩黄、杀人放火、拐卖妇女儿童等等。

这充分说明，即使在完全竞争的条件下，个人理性与社会理性的完全一致只适用于部分情况，更多情况是它们之间的不一致。在当今世界，完全竞争的市场经济只是一种理论抽象，实际上是不存在的，这就使个人理性与社会理性之间经常发生冲突，这种冲突是市场失灵和市场缺陷的根源。

为了克服市场失灵和市场缺陷，政府既要制定固定规则政策，为市场经济的顺利运行奠定坚实的基础；又要制定反馈规则政策，即宏观调控政策，其中主要是财政政策和货币政策。政府无论制定什么政策，都要以经济预测为基础。“凡事预则立，不预则废”，对各级政府及其所有部门都是适用的。

总之，经济市场化程度越高，经济预测水平就越高，影响范围也就越大；反之，经济预测水平和影响范围是检验经济市场化程度的重要指标之一。目前中国经济预测处于起步阶段，与经济市场化程度是基本对应的。今后经济预测的发展，仍然依赖于以市场为导向改革的深入。

^① 斯蒂格利茨：《政府为什么干预经济》，第61页，物资出版社，1998。

目 录

市场经济与经济预测是一对“双胞胎”(代序)	1
-----------------------	---

第一篇 经济预测的理论基础

第一章 人的预测能力	3
第一节 人脑与思维	3
第二节 逻辑推理	5
第三节 规律与预测	7
第四节 两个“三论”对预测学发展的意义	10
第五节 预测的哲学原理	12
第二章 信息、知识与经济预测	15
第一节 信息与知识的关系	15
第二节 信息、知识与经济预测的关系	21
第三节 经济预测对象的变化	25
第三章 经济类型与经济预测	30
第一节 计划经济	30
第二节 从计划向市场过渡的经济	37

第三节 市场经济	39
第四章 经济理论与经济预测	44
第一节 马克思主义经济学与经济预测的关系	44
第二节 西方经济理论与经济预测	47
第五章 经济周期与经济预测	63
第一节 改革开放以来的经济周期	63
第二节 经济周期产生的原因	68
第三节 经济对策是经济周期产生的根本原因	73
第六章 经济政策与经济预测	76
第一节 国家的经济职能	76
第二节 市场的局限性	80
第三节 经济政策及其分析	82

第二篇 经济预测的内容

第七章 人口与劳动力预测	91
第一节 人口与劳动力现状	91
第二节 人口的时间序列模型	94
第三节 人口的 ARMA 模型	103
第四节 劳动力的门限自回归模型	105
第八章 固定资产投资与固定资产预测	109
第一节 固定资产和固定资产投资	109
第二节 投资的主成分分析法	113
第三节 固定资产和固定资产投资的 VAR 模型	120

第九章 科技进步预测	129
第一节 科技进步问题	129
第二节 科技进步的内容	134
第三节 科技进步对经济增长贡献率的测算	137
第十章 经济增长与产业结构预测	147
第一节 生产函数	147
第二节 符合可持续发展的产业结构模型	158
第十一章 物价预测	164
第一节 价格系统的因果关系	164
第二节 价格系统动力学模型	165
第三节 模型运行结果	173
第十二章 金融预测	176
第一节 金融系统结构	176
第二节 人工神经网络理论与模型	178
第三节 神经网络与回归分析相结合的模型	189
第十三章 中国宏观经济季度协整模型	196
第一节 变 量	196
第二节 模 型	206

第三篇 经济预测研究的前沿

第十四章 对策论及其在经济预测中的应用	231
第一节 对策论与经济预测	231
第二节 经济对策论的基本内容与常用模型	235
第三节 初步应用	241

第四节	基本特点和发展趋势·····	251
第十五章	非均衡经济计量模型·····	253
第一节	不变替代弹性 (CES) 交易方程的确定 ·····	253
第二节	商品市场有效供求模型的确定·····	256
第三节	劳动力市场供求模型的确定·····	261
第四节	货币市场供求模型的确定·····	265
第五节	三市场非均衡计量模型·····	272
第六节	估计结果·····	280
第十六章	非线性经济计量模型·····	288
第一节	模型结构·····	288
第二节	模型估计·····	298
第三节	模型运行·····	300
第十七章	新经济增长模型·····	306
第一节	经济增长模型的演变·····	307
第二节	新经济增长模型·····	316
第三节	经济增长的长周期模型·····	332
第十八章	非参数估计及其应用·····	341
第一节	非参数估计·····	341
第二节	拟合度检验·····	343
第三节	非参数回归·····	346
第四节	城镇居民消费的核回归·····	349
第五节	经济预测和预测精度比较·····	353
第十九章	金融衍生商品及其预测·····	355
第一节	金融衍生商品及其发展·····	355