

王持位 等编著

HONGGUANJINGJI
YUNXINGFENXI

宏观经济运行 分析

 首都经济贸易大学出版社

宏观经济运行分析

王持位 马立平 王静 编著

首都经济贸易大学出版社

·北京·

图书在版编目(CIP)数据

宏观经济运行分析/王持位等编著. - 北京:首都经济贸易大学出版社, 2001. 2

ISBN 7-5638-0884-1

I. 宏… II. 王… III. 宏观经济学-研究 IV. F015

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2000)第 55927 号

首都经济贸易大学出版社出版发行

(北京市朝阳区红庙)

北京宏飞印刷厂印刷

全国新华书店经销

850×1168 毫米 32 开本 9 印张 230 千字

2001 年 2 月第 1 版 2001 年 2 月第 1 次印刷

印数:1~6 000

ISBN 7-5638-0884-1/F·489

定价:15.00 元

前 言

随着我国社会主义市场经济体制的确立,决策和投资多元化的出现,对宏观经济运行态势的分析已不再仅仅为国家管理国民经济服务,它已成为国家、企业和社会公众共同关心的问题。各级政府为了进行宏观经济调控,需要认真分析研究宏观经济形势;企业和社会公众为了进行投资和决策,也在分析研究宏观经济形势。目前,我国把宏观经济作为一个整体,用定量分析和定性分析相结合,以定量分析为主剖析宏观经济形势的著作很少,难以满足各方面对宏观经济形势分析的需要,而不少高等院校为了适应社会主义市场经济对人才的需要,正在逐渐建立宏观经济分析课程,但也苦于缺少这方面的教材。我们经过多年教学和科研的积累,逐渐形成了宏观经济运行分析的体系,编写成了本书,以解决教学之需求。

宏观经济运行分析学属于认识论的科学体系,它不单是一门实证经济学,也不单纯是一门统计方法论科学,而是把统计方法与实证经济学融于一体,具有双重性质的科学。

宏观经济运行分析要以马克思主义的经济理论为指导,将社会再生产作为一个有机整体,对社会再生产的各个环节——生产、流通、分配和消费进行分析;社会再生产的健康发展要求速度、结构(比例)、效益的统一。本书将这两条宏观经济的主干有机结合起来,形成了总论、社会再生产分析和国民经济总体评价三个板块。

本书编写的目的,一是使之成为大学本科生、专科生学习宏观经济运行分析的教材,并为研究生提供研究宏观经济运行态势的基本参考书,以帮助大学生和研究生掌握分析中国宏观经济运行的基本理论和方法,培养他们提高研究和分析解决实际问题的能力。二是为各级政府部门研究宏观经济形势、进行宏观经济调控提供参考性读物;帮助一些宏观经济管理人员掌握正确认识宏观经济运行态势的理论和方法。三是为企业、为社会公众判断宏观经济形势提供一本指导性读物,以便更好地进行决策和投资。本书的出版如果对上述三方面的读者有所帮助,我们将感到极大的欣慰。

参加本书编写的作者是:王持位(第一章、第二章、第三章、第四章、第九章和第十二章);马立平(第六章、第七章、第十章和第十一章);王静(第五章和第八章)。王持位对本书进行了组织、协调和定稿。

宏观经济运行分析学,是一门新兴的学科,国内外都还没有一本为各方面认可的定型版本,而本书也只是一种尝试,必然存在一些不足之处。我们热忱欢迎广大读者提出批评和帮助,以便在再版时加以改正。让我们共同努力,创造适合我国特色的对宏观经济运行进行分析的理论和方法。

王持位

2001 年于首都经贸大学

目 录

第一章 总论	(1)
第一节 宏观经济运行	(1)
第二节 宏观经济运行分析	(3)
第三节 宏观经济运行分析的任务与方法	(8)
第四节 宏观经济运行分析的体系	(12)
第二章 经济发展阶段的分析	(15)
第一节 经济发展阶段划分的理论	(15)
第二节 我国经济所处的发展阶段分析	(22)
第三节 我国三次产业结构分析	(28)
第三章 经济增长分析	(41)
第一节 经济增长一般理论	(41)
第二节 宏观经济增长分析	(45)
第三节 经济增长因素分析	(52)
第四节 工业经济总量变动分析	(61)
第四章 产业结构分析	(67)
第一节 产业结构分析的一般问题	(67)
第二节 产业结构协调发展分析	(71)
第三节 产业结构水平分析	(75)

第四节	主导产业的分析	(85)
第五章	流通分析	(87)
第一节	商品流通分析	(87)
第二节	对外贸易分析	(98)
第三节	价格与货币流通分析	(103)
第四节	金融市场分析	(110)
第六章	分配分析	(118)
第一节	分配结构分析	(118)
第二节	财政收支分析	(123)
第三节	居民收入分析	(132)
第七章	消费分析	(140)
第一节	居民消费分析	(140)
第二节	城市居民消费模式分析	(146)
第三节	消费需求模型——线性支出系统模型简介	(154)
第八章	宏观经济效益分析	(158)
第一节	宏观经济效益的一般问题	(158)
第二节	宏观经济效益的指标体系	(160)
第三节	宏观经济效益的综合评价	(165)
第九章	总供给与总需求平衡分析	(171)
第一节	总供给与总需求平衡的一般理论	(171)
第二节	狭义总供给与总需求平衡测算	(175)
第三节	广义总供给与总需求平衡测算	(180)
第四节	国民经济运行类型的划分	(184)

第五节	投入—产出表在研究两大部类供需平衡时的作用·····	(187)
第十章	宏观经济运行监测·····	(196)
第一节	经济波动的基本形态及要素分析·····	(196)
第二节	宏观经济运行监测的基本指标·····	(207)
第三节	宏观经济运行监测的主要模型·····	(212)
第十一章	宏观经济评价·····	(222)
第一节	宏观经济评价的基本问题·····	(222)
第二节	国民经济运行质量评价体系·····	(231)
第三节	经济增长方式转换评价指标体系设计·····	(244)
第十二章	综合国力评价·····	(257)
第一节	综合国力评价的基本理论·····	(257)
第二节	外国综合国力评价简介·····	(261)
第三节	我国综合国力评价·····	(265)
第四节	综合国力的国际比较·····	(270)

第一章 总 论

第一节 宏观经济运行

宏观经济是指一个国家或地区经济全局的运行情况。宏观经济运行从理论上概括表现为宏观经济运行主体、宏观经济运行过程和宏观经济调控三者之间的综合运行状况。

宏观经济运行主体,在宏观经济学上一般划分为三类:社会家庭或居民的集合、企业的集合和政府。宏观经济运行主体与微观经济运行主体的主要差别在于个体与总体。微观经济运行主体是指单个企业,或单个居民家庭;宏观经济运行主体则是他们的集合,而且大于集合,因为它还包括政府部门。

社会家庭或居民,又称为家庭或居民部门,它是指一定区域内全部居民和家庭的集合。家庭或居民部门在宏观经济活动中的行为功能,是通过劳动力市场提供劳动力,通过产品和服务市场进行消费,通过资本市场进行储蓄投资和向政府缴纳税金。

企业,又称企业部门,它是指一定区域内所有企业的集合。企业部门在宏观经济活动中的行为功能是进行投资、生产和流通,并向政府缴纳税金。

政府,又称政府部门,它是各级政府的集合。政府部门在宏观经济运行中具有双重功能:一是通过政府的购买、投资、转移支出直接参与经济活动;二是对宏观经济活动进行调节,运用经济、法律,乃至行政手段调节和规范市场,实现国家调控市场,市场引导

企业,纠正市场调节中的盲目性。市场经济体制下,宏观经济的运行过程,可以用图 1-1 进行概括。

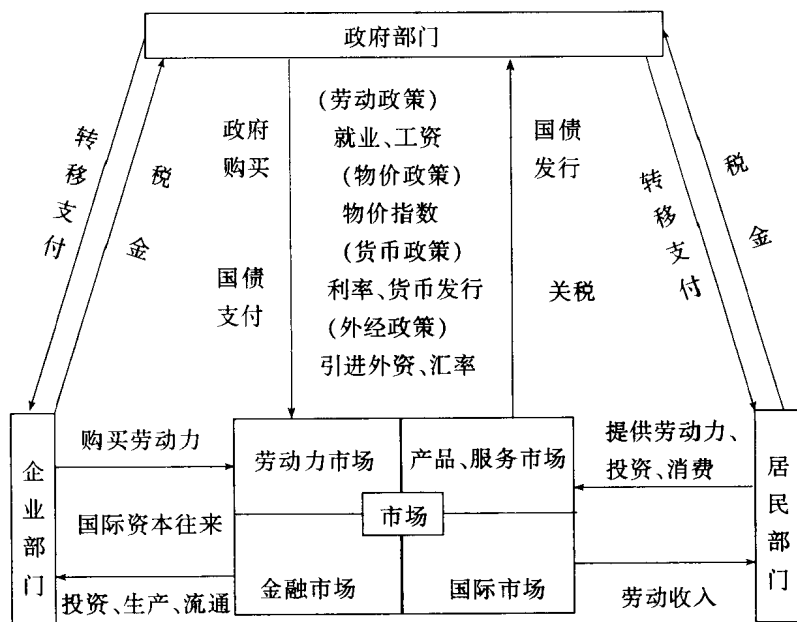


图 1-1

宏观经济运行,除了转移支付和税金外,都是通过市场进行的。市场可以有不同的划分方法,这里将市场划分为四种:①产品、服务市场,是指各类不同商品、服务市场,包括所有有形商品、无形商品和服务;②劳动力市场,是指所有人力资源就业状况;③金融市场,又称资本市场,包括各类资本市场的一切货币流通、政府债券、企业债券和其他所有有价证券的买卖、融资活动;④国际市场,是指国际间经济活动的整体,包括一切进出口交易和国际资本往来。

居民部门通过提供劳动力获得劳动收入,通过接受转移支付

得到转移收入;用于购买商品、服务进行个人消费,用于向政府纳税,剩余部分进行储蓄,进入资本市场。企业部门进行生产、流通和投资,并向政府纳税。政府部门通过居民和企业的纳税,通过债券发行获得财政收入,用于进行政府购买和投资,用于向居民和企业进行转移支付,用于国债还本付息和国际资本往来。

宏观经济活动过程,形成了宏观经济中五大供求关系:①劳动力市场供求关系。国家通过劳动力政策和工资率进行劳动力的供给和需求调节。②商品市场供求关系。国家通过产业政策、物价政策和物价指数,调整商品、服务的供给与需求。③金融市场供求关系。国家通过货币政策、利率,调节投资,调整货币的供给与需求。④国际市场供求关系。国家通过对外经济政策、汇率、关税,调节外汇、国际收支平衡,促进经济的发展。⑤政府收支平衡关系。国家通过财政政策和税率调整财政收入与支出。

总之,国家通过多种手段调节宏观经济中的五大关系,促进国民经济健康发展。

在市场经济体制下,市场发挥资源配置的基础作用,通过价值规律调节社会生产,实现社会资源的有效配置。但是,市场调节的进程较为缓慢,且具有一定的盲目性。为了弥补市场调节的不足,必须辅以国家的宏观调控。国家对国民经济运行进行宏观调控,是一种间接调控,它是充分利用市场机制,通过市场中中介间接地进行调控。国家调控市场,市场引导企业,这就是市场经济体制下国民经济运行的模式。

第二节 宏观经济运行分析

一、宏观经济分析

宏观经济分析,是观察、研究宏观经济运行中各种总量及其相互关系;掌握宏观经济运行的特点、影响因素,找出运行中存在的问题,揭示其发展变化的规律性,以便更好地把握国民经济运行的

走势,使人们对宏观经济运行有一个科学的认识,为进行宏观经济调控提供科学的依据。

宏观经济分析,既可以是定性分析,也可以是定量分析,或者是定性与定量相结合的分析。马克思在《资本论》中对资本主义经济分析,采用的是定性分析。《资本论》用高度抽象的方法,从资本主义生产关系的矛盾出发,分析了资本主义的本质及其发展的规律性。西方经济学对宏观经济运行的分析主要是实证性分析。从威廉·配第的政治算术开始采用定量方法对宏观经济现象进行分析。西方经济学的宏观经济分析直到 20 世纪 30 年代才逐步形成。从 30 年代开始,凯恩斯经济学提出了宏观经济总量的概念及其经济变量,例如:货币数量、总供给、总需求、消费、投资、收入、利息率等,开创了宏观经济静态分析和比较分析的方法。英国经济学家斯通和米德以及美国经济学家库兹涅茨等建立和发展了国民经济核算体系,为宏观经济过程的统计描述提供了科学的手段,构造了宏观经济分析的框架体系。里昂惕夫开创了投入-产出分析方法,对生产中复杂的宏观经济结构和部门间的技术经济联系进行了定量分析。20 世纪初,特别是 1929~1933 年的世界经济危机,使经济周期的定量分析日趋发展和成熟。以后,西方经济学家从不同的方面和不同的角度进一步丰富和完善宏观经济运行分析,特别是美国经济学家丹尼森、索洛等人创建的经济增长理论,柯布-道格拉斯的生产函数,钱纳里的工业化和经济增长的比较研究等,对西方经济学的宏观经济分析作出了巨大的贡献。西方经济学的宏观经济分析,其主要特点是用定量分析方法进行实证研究,这些研究极大地丰富和发展了西方经济学。但是直到目前,西方国家还没有形成完整的、系统的宏观经济运行分析学。

我国的经济学进行宏观经济运行分析主要是定性分析,在经济学中基本上没有定量分析。国家统计局虽然利用大量统计资料分析宏观经济活动,但是这种分析基本上是为国家行政管理服务,对宏观经济运行的规律缺乏全面、系统的研究。因此,我国宏

观经济定量分析,有待进一步开发。

二、宏观经济统计分析

宏观经济统计分析,是以宏观经济理论为指导,以宏观经济统计资料为基础,采用以定量分析为主、定量分析与定性分析相结合的方法,对国民经济系统进行实证分析,对国民经济运行态势作出基本判断,阐明宏观经济发展的主要特征及其各组成部分之间的内部联系,揭示国民经济发展所取得的主要成就和存在的主要问题及其成因,提出相应的对策和建议。因此,宏观经济统计分析具有以下基本特征:

第一,宏观经济统计分析是以宏观统计资料为基础,对宏观经济统计资料进行分析研究,揭示宏观经济发展的主要特征及内部联系。宏观经济统计分析的各种观点和结论是从统计资料研究中形成的,它既不是统计数字的罗列,也不是用统计资料去证明某种观点和理论。由统计资料研究中形成观点和结论,是统计分析包括宏观经济统计分析的一个主要特征。

第二,宏观经济统计分析必须以相应的宏观经济理论为指导。进行宏观经济统计分析,研究宏观经济统计资料,包括统计指标的选择、统计指标计算口径的确定,以及从统计资料的变化揭示宏观经济的变化和内在联系等,都是以一定的宏观经济理论为指导。马克思主义的认识论指出,人们的认识是由感性认识到理性认识再到感性认识,循环往复,一次比一次深化。对统计资料的分析乃是以原来的理性认识为基础,对反映客观现实的统计资料进行认识,从中得出必要的结论,形成新的理性认识,使人们的认识得到升华。所以,如果没有一定的理论为指导,我们就无法从宏观经济统计资料中发现宏观经济运行的特征、联系及问题,就无法进一步分析、判断宏观经济的成就与不足、偶然因素与系统因素、外部联系与内部联系,一句话,就无法取得规律性的认识。

第三,宏观经济统计分析具有整体综合性。宏观经济统计分析是把宏观经济作为一个整体,从总量上和构成上研究宏观经济

各个环节及主要方面运行的态势,然后加以概括描述和推断宏观经济运行总的状态、内部联系及其发展变化的趋势,发现和证实宏观经济运行的一些新规律性。马克思关于绝对地租是否存在,一定要有统计来证实的论断,就是一个极好的例证。恩格斯的恩格尔定律,基尼的基尼系数,霍夫曼的霍夫曼定律,无一不是通过对统计资料的研究而取得的认识。可以说,没有统计的证实研究,就难以发现社会经济事物量变的质量界限,就难以丰富和发展社会科学理论,包括宏观经济理论。宏观经济统计分析,既不能空口说话,完全依赖于逻辑推理,也不能只搞统计数字的罗列,只见树木,不见森林,必须通过统计数字认真观察、研究它们所代表的宏观经济现象的实质,取得规律性的认识。

第四,宏观经济统计分析,是定量分析与定性分析相结合,以定量分析为主;理论分析与实证分析相结合,以实证分析为主。定性认识是定量认识的前提和基础,实证分析必须以科学的理论分析为指导;定量分析可以丰富和提高人们对客观事物的认识,可以发现客观事物的特点和规律性。宏观经济运行是一个复杂的系统,其发展变化,既受社会生产力水平的制约,又受生产关系和上层建筑的影响;既受内部因素的制约,又受外部条件变化的影响。为了更准确揭示宏观经济变化的态势及其规律性,更准确地把握宏观经济量变的数量界限,必须把宏观经济统计数字和现实情况有机地结合起来。社会经济现象的变化,有些因素可以通过统计数字直接予以揭示,有些则不能,例如:经济发展中人们的积极性和创造性,经济体制和各级领导驾驭经济的能力高低等,是无法用统计数字来反映的。这些活的因素又往往是社会经济发展的重要因素,乃至决定性因素。在进行宏观经济统计分析时,必须重视和充分考虑这些因素的影响,把对宏观统计数字的分析和对活情况的研究有机结合起来。为了取得和估计活因素影响,往往要通过问卷调查取得资料,并将问卷调查的资料进行量化处理,作为统计分析的依据。

第五,宏观经济统计分析与微观经济统计分析的区别在于,它是从宏观经济的总量和结构的角度研究宏观经济的总体态势和规律性。宏观经济统计分析为了更深刻地认识和把握总体,除了对总体进行研究外,还必须抓住对总体有典型意义的局部、个体进行深入的研究。通过对典型单位的解剖,弄清客观事物内部错综复杂的联系,发现那些具有典型意义的新事物,以丰富和深化对总体的认识。对总体的数量分析与典型解剖相结合是宏观经济分析的另一特点。

三、宏观经济运行态势与微观经济运行态势的反差分析

在规范的市场经济条件下,宏观经济环境中的各种信息信号传递十分灵敏,企业经营状况会很快地传递到政府;宏观经济调控的措施和力度,在微观经济上也会迅速产生影响。当比较多的企业出现困难,发生亏损时,宏观经济形势也会很快反应出来。宏观经济形势和微观经济形势之间具有较高的一致性。但是,在市场经济体制不规范,或正如我国目前处于市场经济体制转换过程中,在所出现的无序状态和原有经济体制固有的问题,必然导致一些市场信号失灵,信息渠道不畅;企业没有摆脱对政府的依赖,不注重对市场的研究,对市场信号不重视,不善于依据市场变化调整自己的经营决策和经营管理,以致企业的生产不适应社会需要,造成大量的积压和浪费,微观经济出现大量困难和问题,再加上企业在短期内不可能卸下压在身上的社会职能担子,这就很容易造成企业亏损。如果大量企业亏损和微利,甚至职工工资不能正常发放,这是判断微观形势不好的主要标志。但微观经济形势不好,不一定会造成宏观经济形势不好。我国情况就是如此。从我国的宏观经济形势看,经济持续快速增长,物价又趋于稳定和人民币汇率坚挺,外汇储备增加,说明宏观经济形势持续好转和健康运行。宏观经济运行状况,主要反映在四个方面:经济增长、物价稳定、充分就业和国际收支平衡。每个方面分别对应一个综合性经济指标,即可比的GDP增长率、国民经济综合物价指数、就业率(失业率)和

国际收支平衡综合差额。从这四个综合经济指标的数值来看,我国宏观经济运行的态势,国内和国际一般均认为是好的。但微观经济运行态势不好,大量企业亏损或微利,产品积压,职工工资和各种社会福利费用不能按时足额发放,国有大中型企业困难重重。但企业亏损,生产并未收缩,失业并未增加,物价并未上涨,微观经济形势和宏观经济形势出现了巨大反差。这种反差最终必然会对宏观经济形势产生影响,或者是采用若干政策和措施逐渐消除微观经济形势不好的态势,使微观经济形势与宏观经济形势基本保持一致。但是在相当一段时期内这种反常会继续存在,所以在观察和分析宏观经济形势时,就不能无视宏观经济形势和微观经济形势的反差,必须把对企业经营整体状况的考察作为判断宏观经济形势的一个有机组成部分,把它和经济增长、物价变化、就业变化和
国际收支状况这些通用的宏观经济管理的目标模式同等对待,而不是把它仅仅作为宏观经济大好形势下存在的问题和不足予以点缀。

这是当前分析我国宏观经济形势,乃至研究所有在进行经济体制转轨的国家的宏观经济形势时必须充分注意的一个问题,也可以说是一个特殊问题。

第三节 宏观经济运行分析的任务与方法

一、宏观经济运行分析学的性质

将宏观经济运行分析的实践进行理论概括就形成了宏观经济运行分析学。它是通过数量从整体上认识宏观经济运行特点、联系和发展趋势的认识论科学。认识论科学既要解决对客观事物的认识,又要解决如何认识客观事物的问题。宏观经济运行分析学既要正确地对宏观经济现象进行正确的定量描述和推断,又要研究对宏观经济现象描述和推断的方法问题。任何一门科学都有自己的方法论问题,而认识论科学的方法论问题就更为突出和重要。

宏观经济运行分析学的方法论,是在对大量宏观经济现象描述和推断的不断总结、提炼以及归纳的基础上形成的,不能离开对宏观经济现象定量描述和推断来研究宏观经济运行分析的方法论问题。两者的紧密结合,就使宏观经济分析学具有实证经济学和方法论科学双重性质。

第一,宏观经济学是一门实证经济学。实证经济学是经济学的一个分支,它是以现实经济活动为研究对象,以经济活动的实际资料为基础,对经济发展现状及其变化的历程进行研究,揭示经济活动的各种变量之间的相互联系,发现各种影响因素的正面或负面效应,对现实经济活动作出正确的判断和说明;同时探索客观经济发展中新的特征和新的规律性,并不是单纯做客观经济事物因果关系的描述。宏观经济运行分析学只是把这种研究局限于宏观经济事物,它是以反映宏观经济现实的资料,特别是统计资料为基础,寻找现实宏观经济活动中的特点、联系、影响因素及其发展变化的趋势,探索宏观经济变化中的各种数量界限,对宏观经济运行作出科学而系统的说明,使人们得到规律性认识。因此,宏观经济运行分析学属于实证经济学的范畴。

第二,宏观经济运行分析学是一种方法论的科学。宏观经济运行分析学,是以宏观经济运行作为客体,从定量的角度阐明宏观经济运行的特点、联系和规律。从量的角度认识客体,虽然它离不开统计指标和统计方法,但是,统计指标和统计方法必须服从并服务于对客观经济现象性质和特点的研究。客观经济现象的性质和特点不同,统计指标和统计方法也就不同。任何科学都有自己特定的研究方法。宏观经济运行分析属于认识论体系的科学,因而统计方法对其具有突出重要的地位。要从数量上正确认识客观实际,必须解决如何才能有正确的认识,即认识的方法论问题。认识的方法论是否科学,只能由是否正确认识客观实际来检验。同时,正确认识客观实际可以丰富和发展认识的方法论,脱离对客观实际的定量认识,统计认识的方法论就成为无源之水、无本之木。必