

国家社会科学基金项目 (99CTJ001)
西南财经大学中国金融研究中心资助课题
西南财经大学“十五”“211工程”项目课题

中国国家

聂富强 等著

经济安全预警系统研究

中国统计出版社
China Statistics Press



中国国家 经济安全预警系统研究

聂富强 等著

国家社会科学基金研究项目 (99CTJ001)
西南财经大学中国金融研究中心资助课题
西南财经大学“十五”“211工程”项目课题

 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

中国国家经济安全预警系统研究/聂富强等著.

—北京:中国统计出版社,2005.12

ISBN 7-5037-4839-7

I. 中…

II. 聂…

III. 经济—国家安全—研究—中国

IV. F120.2

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2005)第 148878 号

中国国家经济安全预警系统研究

作 者/聂富强等著

责任编辑/申明九

装帧设计/艺编广告·方 红

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 75 号 邮政编码/100826

办公地址/北京市丰台区西三环南路甲 6 号

电 话/(010)63459084 63266600-22500(发行部)

印 刷/河北天普润印刷厂

经 销/新华书店

开 本/880×1230mm 1/32

字 数/350 千字

印 张/13.625

印 数/1—2000 册

版 别/2005 年 12 月第 1 版

版 次/2005 年 12 月第 1 次印刷

书 号/ISBN 7-5037-4839-7/F·2198

定 价/26.00 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

本研究报告是国家社会科学基金研究课题《中国国家经济安全预警系统研究》(批准号:99CTJ001)的研究成果。同时,也是西南财经大学中国金融研究中心和西南财经大学“十五”“211 工程”项目的研究成果。

本课题于 1999 年 5 月立项,原计划 2001 年 5 月结项。在课题负责人西南财经大学中国金融研究中心聂富强副教授的率领下,经过全体课题组成员的共同努力,几易其稿,于 2001 年 2 月完成初稿。完成本课题的初稿之后,经过进一步的讨论发现:一方面,关于国家经济安全及其预警的理论有新的进展;另一方面,中国国家经济所面临的风险又呈现出扩大化趋势。相对而言,初稿的研究有粗犷之嫌。鉴于此,课题组决定在原分工基础上增加研究力量,在加强方法论研究的同时,细化国内经济安全调研(增加能源安全、信息安全、财政安全等方面内容)。又经过近两年的努力,于 2003 年 1 月完成本课题第二稿。正在讨论和总纂之际,SARS 的爆发及其对国民经济所带来的负面影响,迫使我们不得不进一步思考突发事件对国家经济安全的传递影响和预警问题。考虑到宏观经济运行中新一轮经济景气周期的出现,我们又对各部分内容作了重新审视。国际货币基金组织分别于 2002 年中和 2003 年初又公布了货币与金融统计、金融监管等方面的最新文件和规范,亦使我们重新探讨了金融预警问题。经过对第二稿各章内容的调整、补充和修改,于 2004 年 5 月完成终稿。课题结项后,在进一步学习并听取有关专家意见基础上,我们又在原有的较为庞大的内容基础上作了调整与精炼,特别是基于 2002 年的评价,

对 2003 年的中国国家经济安全状态进行了持续性评价,再一次检验了课题提出的预警评测方法论的适用性质。

研究期间,课题组主要成员有幸参与了由庞皓教授主持的国家社会科学基金课题《中国货币与金融统计体系研究》、由刘锡良教授主持的国家社会科学基金课题《开放条件下的金融安全问题研究》、由李晓松教授主持的联合国儿童基金会委托项目《降低我国孕产妇、婴儿及 5 岁以下儿童死亡率相关因素研究》的主研工作,使我们对中国现实所面临的金融风险和社会风险有了更深刻的认识。此外,课题组成员还曾参加国际货币基金组织举办的“货币与银行统计高级培训班”和“金融规划技术高级培训班”,得到国际货币基金组织有关高级专家的指点。

课题负责人聂富强副教授主持本研究报告的撰写,并提出研究的基本思路及框架。在课题组成员的共同努力下,历经几年曲折和漫长的时间,通过大量的调查研究和反复讨论,最终定稿。参加课题讨论、调研并参与部分初稿和二稿撰写的有:聂富强、谢小燕、毛中明、贾栩、崔兵、赵西、廖常勇、贾彦东、侯玉玲、高显岳、宋国军、万力、朗波等,聂富强对部分内容作了调整修改补充,并对全文作了总撰。

在本课题的研究中,得到西南财经大学中国金融研究中心的大力支持,并得到北京大学、财政部、国家统计局、中国人民银行统计司、国务院妇女儿童工作委员会、四川省委政策研究室、四川省国家安全厅、四川省旅游局、河南省巩义市政府、内蒙古自治区喀喇沁旗政府、吉林市政府、甘肃省康乐县政府、青海省西宁西区和互助县政府、四川省汶川县政府、人民银行成都分行国库处、人民银行乌鲁木齐中心支行国库处、乌鲁木齐市财政局、国税局、地税局、海关、人民银行博乐市中心支行、人民银行温泉县支行、温泉县财政局、新疆建行阿拉山口支行、代理国库、人民银行重庆市营业管理部国库处、重庆市财政局、国税局、地税局、海关、人民银行梁平县支行国库股、国税局、地税局、财政局和西南财经大学的许多

专家和同志的帮助和指导。在此一并表示感谢！

本书的完成在很大程度上离不开庞皓教授在最后修改过程中给予的极大鼓励和具体指导,感激之情无法言表。

聂富强

2005 年 7 月

内容摘要

国家经济安全预警体系是国家经济安全管理体系的有机组成部分,也是政府危机管理的重要决策支持系统。当代国家安全的重点已从传统意义上的军事安全转变为经济安全,在此背景下,各国普遍开始重视对经济不安全因素的预警。我国自 1996 年以来也对国家经济安全进行了一些卓有成效的研究,并引起高层的重视,十五大报告中明确提出要“维护国家经济安全”。十六大报告在总结过去 13 年的经验时指出:“始终把国家的主权和安全放在第一位”,还强调:在扩大对外开放中,要“十分注意维护国家经济安全”。我国对经济安全预警问题的重视始于 20 世纪 90 年代中后期。国家统计局曾经研究过广义和狭义的经济安全指数,有关大学和研究机构还建立了国家经济安全研究小组。许多学者也讨论了中国国家经济安全的评测和预警问题,这些研究尽管只是一些思路的比较简单的应用,但对推进中国国家经济安全预警体系的研究仍起到了很大的作用。遗憾的是,随着东南亚金融危机影响的消失和中国宏观经济进入新的上升时期,有关中国国家经济安全预警的研究急剧减少。与目前印度等国的高度重视相比,潜在着一丝隐忧。

中国正在经历极其深刻的两个转变:一是社会转型,二是经济、政治转型。通常这种转变要经历极其艰难、痛苦的过程,不仅充满未知结果,也会遇到许多重大挑战。从不同的视角进行横向比较,中国经济安全所面临的困境具有三个显著特点:

首先,渐进式的对内改革制约了社会经济系统运行的稳定性。在从传统经济迈向现代经济的历史进程中,由于制度的不健全、不完善,出现了产业结构不合理,宏观经济波动大,失业率高,中央财政能力下降,银行不良资产上升,地区间经济发展水平差距拉大等问题。这些都是经济系统运行不稳定的主要特征。此外,还出现了收入差距大,腐败猖獗,犯罪率高,人口多,人口素质不高等问题。这些是社会、政治系统运行不稳定的表现。

其次,在中国对外开放,日益走向世界的时代,在分享国际分工所带来的比较利益时,也产生了信息安全、输入性金融风险、贸易纠纷、民族产业受冲击、引进外资安全等外生性隐患,以及新的国家政治利益与军事利益博弈等问题。

最后,随着中国经济规模的迅速扩大,一方面,以粮食、能源与水资源为主的资源供应和保障日趋紧张;另一方面,在片面追求GDP高速增长背景下,又出现了生态环境被严重破坏,生态赤字进一步扩大的问题。对人口大国而言,这是中国国家经济所面临的特殊风险。在全球化和市场化背景下,上述问题将在很长一段时间里存在,如果处理不当还可能出现局部性危机,一些行之有效的传统经济安全维护手段也会受到影响。把中国经济安全预警研究放在综合性安全观视角下研究,实际上就是要回答:导致我国国家经济不安全的警情何在;如何建立中国独立的国家经济安全预警系统;以及如何通过预警系统的建立和完善来支持决策系统,以维护中国国家经济安全。

本课题在归纳总结有关研究成果的基础上,紧密联系中国改革开放的实际,并根据有限目标原则,从政治、经济、军事等三个层面10余个领域深入分析了影响中国经济不安全的主要因素和总

体经济安全度。指导了局部和总体经济安全预警系统的建立,进行了关于建立和完善国家经济安全预警系统的基本思考并提出了若干的政策建议。在研究的思路与方法上,还力图构建一个全面系统研究中国国家经济安全预警问题的理论框架。

本研究成果对完善中国国家经济安全理论体系,促进国家经济安全预警理论、方法的研究都有重要理论意义。中国国家经济安全预警系统的构建正处于萌芽阶段,本课题的研究对我国国家经济安全预警系统的建立、完善,以及国家经济安全政策的制定也有较大的参考价值。

本研究报告共分为三个部分:

第一部分是基础理论篇(包括第一、二章)。首先,从理论上界定国家经济安全的内涵和外延,国家经济安全与国家利益、国家安全等相关概念的区别和联系,国家经济安全的演化、量化,监测与预警的区别与联系;其次,综述和评价了有关国家经济安全预警研究的方法和历史;第三,讨论了国家经济安全预警的系统和框架;第四,现实分析了中国国家经济不安全的警源并构筑了预警的指标体系;最后对国家经济安全警度测定的方法论进行了详细的讨论和研究。

第二部分是分析篇,包括第三章至第十三章。该篇主要从能源、粮食、金融、财政、对外开放、地区发展、产业结构、信息、宏观经济运行、突发事件冲击等十个对国家经济安全产生直接影响的方面进行分析。分别讨论了他们与国家经济安全的关系,现实分析了各自存在的问题及其对国家经济安全系统的影响,讨论了各部分预警系统的建立;最后针对性的提出了未来几年治理隐患、维护安全的主要措施。

第三部分是总体篇,包括第十四、十五章。依托前两部分深入分析的结果,首先提出了中国经济安全建设总体评测的系统化视角、指标体系,并运用主要数据和多样化统计方法得出了中国经济安全状态的量化结论;其次,针对中国经济在改革开放过程中存在

的国家经济风险,提出了建立和完善中国独立的经济安全预警系统的设想和相应对策。

本课题的主要特点是:(1)高度重视研究思路、内容及研究报告的系统性,力求全面反映有关研究的已有成果,力图全面分析中国国家经济安全的现实状态,力求全面探讨国家经济安全预警的方法论;(2)注重以基础理论为指导,从理论上阐明经济安全与国家安全,宏观经济预警与国际经济安全预警、监测与预警、警义与警源、警素、警度、警限、警级等基本概念及相互关系;(3)密切联系中国改革开放的实际,从有限目标视角深入讨论经济安全直接系统的安全及预警问题;(4)借鉴其他国家建立预警系统,维护国家经济安全的经验,在充分考虑科学性、可行性前提下,提出了建立我国国家经济安全预警系统及维护国家经济安全的对策思路。

本课题的主要结论或创新点是:

1. 系统而明确地界定了国家利益、国家安全、国家经济安全、监测、预警、宏观经济预警、国家经济安全预警等概念,深入分析了这些相关概念之间的区别与联系。

2. 系统而明确地界定了警义、警源、警素、警度、警限、警级等概念,并以此为基础,首次构建了国家经济安全预警系统的概念性框架。

3. 首次明确提出了国家经济安全波动与预警的结果是否有效,依赖于国家经济安全指标体系中指标的观测值,因此必须对指标的观测值进行有效性检验。

4. 首次提出了国家经济安全预警分析也要寻求稳健的统计分析方法。并讨论了稳健的统计分析 with 异常值分析对经济安全预警的信号意义。

5. 深入讨论了多元统计分析中的有序聚类方法在认识国家经济安全波动规律性中的特殊作用,为国家经济安全预警提供了新的方法论视角。

6. 在对诸多的统计分析方法进行系统归纳的基础上,根据国

家经济安全预警各阶段的特点提出了可供参考的定量分析方法。

7. 系统地对金融危机的种类、金融危机理论和金融危机模型进行总结和述评,反映了金融危机理论研究的新方向,探讨了金融危机预警模型构建的方法论。

8. 讨论了中国的金融安全状态定量分析的理论基础和方法,对目前的金融安全状况做出总体的量化评价,提出了一套中国金融安全状况测定的指标体系。

9. 运用多元统计方法深入分析中国对外经济变化对国家经济安全状况的影响,深入讨论了外生性经济风险预警的度量。

10. 在深入分析中国国家财政能力变化对国家经济安全状态影响的基础上,讨论了反映财政能力的预警指标构建。

11. 现实分析了我国区域经济发展的表现特征和演变规律,以及区域发展不平衡对国家经济安全的影响;尝试使用多元统计分析方法来确定区域经济发展不平衡对我国经济安全影响的预警线;通过构建和计算“三率”相关综合发展指数深刻揭示了中国各地区社会发展极不平衡的现实。

12. 现实分析了我国产业结构变化对国家经济安全的影响,深入讨论了产业结构量化的方法论。

13. 系统分析了宏观经济运行对国家经济安全带来的影响,专门讨论了宏观经济运行预警系统以及预警系统中 VAR 方法的应用。

14. 现实分析了我国粮食安全问题,深入讨论了我国粮食安全预警的警限。

15. 现实分析了我国能源和战略资源情况,讨论了我国石油安全的评价以及预警问题。

16. 系统而明确的界定了硬信息和软信息概念,分析了他们对国家经济安全所带来的不同影响。

17. 实证分析了 SARS 对国民经济的负面影响,深入讨论了突发事件对国家经济安全的冲击。

18.明确提出了在国家综合安全观下测度国家经济安全状态的具体方法论,专门讨论了多方法综合评价问题。

19.明确提出了在国家综合安全观下构建中国国家经济安全预警体系的设想。

由于中国国家经济安全预警体系涉及的范围十分广泛,我们自感研究水平有限,本报告提出的研究成果还只是初步的,肯定会有存在不足和缺陷,还望今后与关注国家经济安全预警的同志们共同努力去完善。

目 录

前言 / 1

内容摘要 / 1

第一章 国家经济安全预警的理论界定 / 1

第一节 国家经济安全及其预警的内涵 / 2

一、国家利益、国家安全与国家经济安全 / 2

二、国家经济安全的演化和量化 / 5

三、监测与预警 / 7

第二节 国家经济安全预警研究的方法与动态 / 9

一、国家经济安全预警研究的方法 / 9

二、国家经济安全预警的特点 / 10

三、国家经济安全预警研究的动态 / 11

第三节 国家经济安全预警系统的基本框架 / 13

一、明确警义 / 13

二、寻找警源 / 14

三、分析警素 / 15

四、研究警度 / 16

五、发现警限 / 16

六、探讨警级 / 20

参考文献 / 22

第二章 国家经济安全预警系统的方法论研究 / 23

第一节 警源——中国国家经济安全面临的主要风险 / 23

一、来自直接影响体系的风险 / 24

二、来自间接影响体系的风险 / 30

三、来自政治环境的风险 / 31

四、来自军事的风险 / 31

第二节 警素——衡量国家经济安全的指标体系 / 32

一、指标体系构建应遵循的原则 / 32

二、指标体系的基本框架 / 33

三、预警指标的类型 / 39

第三节 指标预处理方法研究 / 40

一、指标无量纲化 / 41

二、时序数据处理 / 44

三、数据的稳健性讨论 / 46

四、指标有效性检验 / 49

第四节 综合指数方法 / 52

一、扩散指数 / 52

二、合成指数 / 54

第五节 综合评价方法——多元统计分析方法 / 56

一、主成分分析法 / 56

二、因子分析 / 59

三、聚类分析法 / 63

四、层次分析法 / 66

第六节 经济安全预警方法讨论 / 68

一、方法的分类 / 68

二、各分析阶段的定量分析方法 / 71

参考文献 / 71

第三章 金融安全预警理论 / 73

第一节 对金融安全相关概念的界定 / 74

- 一、如何界定金融安全 / 74
- 二、金融风险与金融危机 / 75
- 三、金融危机与金融安全 / 77
- 四、金融风险、金融危机与金融安全 / 78
- 五、经济安全与金融安全 / 84

第二节 金融危机预警体系的构建 / 85

- 一、金融危机预警系统研究——一个综述 / 85
- 二、金融危机预警指标体系的构建 / 91
- 三、金融危机预警风险程度的度量 / 97
- 四、确定金融危机的预警级别，评估金融危机的爆发程度 / 100

第三节 金融危机预警系统的基础——金融监管统计 / 102

- 一、金融监管统计的基本数据构架——宏观审慎监管指标体系 (MPIs) / 102
- 二、MPIs 与有关核算方法和监管标准的关系及展望 / 105
- 三、对中国金融监管统计体系构建的思考 / 110

参考文献 / 114

第四章 中国金融安全状态测定研究 / 130

第一节 评价中国金融安全状况的视角 / 131

- 一、经济与金融的系统性 / 132
- 二、“虚拟经济”理论对金融安全的诠释 / 134
- 三、对中国金融安全状况测定的理论模型 / 136

第二节 中国金融安全测评指标体系的构建 / 137

- 一、构建金融安全指标体系的原则 / 137
- 二、金融风险指标体系的构建 / 139

三、对于虚拟经济与实体经济的偏差衡量体系的构建 / 144	
四、小结 / 158	
第三节 中国金融安全测定的实证分析 / 159	
一、指标、数据及其来源 / 160	
二、实证的具体步骤与方法 / 161	
三、实证的过程 / 161	
第四节 结论与政策含义 / 166	
一、主要结论 / 166	
二、若干政策建议 / 168	
参考文献 / 169	
第五章 对外经济安全及其预警 / 172	
第一节 对外经济安全的相关内涵 / 173	
一、对外开放与对外经济 / 173	
二、对外经济安全 / 175	
第二节 对外经济安全影响机制分析 / 178	
一、全球化与对外经济不稳定性 / 178	
二、我国对外经济安全影响机制分析 / 180	
第三节 中国对外经济安全状况分析 / 187	
一、我国对外经济安全影响因素实证分析 / 187	
二、对外经济安全警限的划分 / 190	
三、对外经济安全状况的简要分析 / 191	
参考文献 / 192	
第六章 国家财政能力与国家经济安全 / 193	
第一节 国家财政能力等相关概念的内涵 / 194	
一、国家财政能力 / 194	
二、国家财政能力与财政风险、财政安全 / 195	
三、财政能力与国家经济安全 / 196	

- 第二节 我国国家财政能力与国家经济安全关系的演变分析 / 198
- 一、计划经济体制下我国的国家财政能力与经济安全 / 198
 - 二、改革开放前期我国的国家财政能力与经济安全 / 199
 - 三、分税制改革后我国的国家财政能力与经济安全 / 202
 - 四、我国财政风险对经济安全的现实威胁 / 203
 - 五、当前我国经济隐忧对国家财政能力的要求 / 208
- 第三节 以财政能力为核心, 构建财政风险预警指标体系 / 210
- 一、财政风险预警指标体系构建的基本思想 / 210
 - 二、财政风险预警指标体系的架构 / 211
 - 三、主要指标解释 / 214
- 参考文献 / 220

第七章 区域经济发展不平衡与国家经济安全 / 221

- 第一节 区域经济发展不平衡对国家经济安全的影响分析 / 222
- 一、积极方面 / 222
 - 二、消极方面 / 223
- 第二节 我国区域经济发展不平衡状况的评测 / 226
- 一、综合评价指标体系的确立 / 227
 - 二、实证分析 / 227
- 第三节 解决我国区域经济发展不平衡的体制路径 / 236
- 一、探寻地区差异解决路径必须首先理顺若干重要关系 / 236
 - 二、市场化取向改革: 解决地区差异问题的体制路径 / 239
- 附录: 我国区域发展不平衡的新证据 —— 基于“三率”相关综合发展指数的一个分析 / 242
- 一、“三率”相关综合发展指数的建立 / 242