



社科论丛

卢 卫 雷 鸣 主 编

现代经济预测

天津社会科学院出版社

卢 卫 雷 鸣 主编

现代经济预测

天津社会科学出版社

图书在版编目(CIP)数据

现代经济预测/卢卫, 雷鸣主编. —天津: 天津社会科学院出版社, 2004. 9
ISBN 7-80688-157-3

I. 现… I. ①卢…②雷… II. 经济预测-研究
N. F201

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2004) 第 092833 号

出版发行: 天津社会科学院出版社
出版人: 项新
地址: 天津市南开区迎水道 7 号
邮编: 300191
电话/传真: (022) 23366354
(022) 23075303
电子信箱: TSSAP@Public.tpt.tj.cn
印刷: 天津大港华康印刷厂

开本: 850×1168 毫米 1/32
印张: 16.125
字数: 400 千字
版次: 2004 年 9 月第 1 版 2004 年 9 月第 1 次印刷
印数: 1—1000 册
定价: 35.00 元



版权所有 翻印必究

评审意见(一)

对由天津社会科学院经济社会预测研究所所长卢卫研究员、雷鸣副研究员主编《现代经济预测的理论与方法》一书,经审读书稿,提出如下评审意见:

从课题名称来看,全书讨论的重心是现代经济预测理论和方法,从课题的完成情况来看,达到预期研究目标。该课题研究的主要特色具体表现在:

1. 注重经济预测理论体系的建立。目前有关经济预测方面的著作,主要讨论的是预测的方法,预测方法的理论基础一是侧重于规范研究角度,来自传统的西方经济学、数理经济学和计量经济学;二是侧重于应用角度,根据有关数学和统计学原理,采用计算机语言编制经济预测模型和开发软件。但本书的写作,力求避开这些角度,是在实证分析的角度,从现代经济学发展的角度,结合国内外经济预测理论与实践,尝试建立经济预测独立的理论体系。这种尝试不论是否成功,都应予以充分肯定。

2. 较为清晰地界定了经济预测的研究范畴和领域。全书强调以宏观的、长期的和定量的经济预测为理论体系建构的主线,突出经济预测对统计学传统的继承与发展。这样的认识和研究思路,是符合我国经济预测发展现状和实际需要的。随着经济全球化时代到来和中国“入世”,宏观经济运行中的不稳定、不确定因素愈增。本书讨论的经济预测在经济波动、经济结构、经济决策和预警中作用,相对于微观领域,更是亟待研究的课题。

3. 以理论、方法和案例相结合的分析方法富有创新意义。一般的预测研究很注重案例分析,但对本书的研究目标而言,理

论创新更为重要。预测分析由于受到数理专业基础的限制,其设计思路、系统建模与实际预测检验,往往由不同专业背景的人分别承担,这样做的好处是扬长避短,缺陷是互不搭界而影响预测的精度和分析质量。本书的编写力求对理论、方法和案例分析加以综合,是一种覆和分析的创新思路,也坚持了预测学科要交叉、兼容的研究方向。

本课题研究主要的不足是:宏观分析各章对经济预测的定义和概念解释不够一致;有些章节叙述的内容过多,归纳和总结略有欠缺;对预测方法部分建议要有所增补,特别是对宏观经济预测较为适用的预测方法,即使在国内还缺乏推广条件,也要有所介绍和阐述。

天津财经大学管理系首席教授 博士生导师 罗永泰

2004年5月24日

评审意见(二)

非常欣喜地看到由天津社科院卢卫研究员和雷鸣副研究员主编的《现代经济预测的理论与方法》的书稿。通读书稿,感到全书的写作具有这样一些特色:

1. 篇章结构的设计颇具特色。一直以来,经济预测作为经济学和数学、统计学、管理学等诸多学科的交叉学科领域,其应用性是显而易见的,但同时,其自身发展所依托基础理论和体系并不完整。而本书一个最突出的特点,就是研究者在设计篇章结构时,已经较为系统地考虑到建立经济预测相应理论体系的需要,并以多一半的篇幅来阐述和构建这一体系,这在已发表的类似著述中是不多见的。

2. 对经济预测概念和适用范围的阐述较有新意。在知识经济时代,社会科学内部各学科的边缘交叉现象非常普遍。建立经济预测理论体系的困难在于,预测分析不仅是社会科学各个学科交互共进的普遍要求,同时也与工程科学和自然科学的某些综合领域交叉如城市发展、环境保护,如果就事论事,仅就经济分析讨论经济预测,当然不是不可以,但理论创新意义就不够突出。本书在导论中就经济预测三种思维方式、二大传统源流和三大理论支柱的归纳和评述,为准确界定经济预测内涵和外延提供了客观依据。并为全书在后面定位于宏观预测领域顺序展开,设计了研究方法论上的理论支撑点。

3. 就宏观经济预测展开的问题,具有一定理论深度。全书以宏观、长期和定量经济预测作为分析主线,从现代经济预测的统计学和经济学理论分析入手、选择经济周期、经济结构、经济决策

和经济预警,以独立一章展开系统和较为深入的讨论,并提出研究者自己的分析结论。全书最后五章,转入对经济预测方法的讨论,这从思维逻辑上是可行的,也符合课题立项的要求。

当然,瑕不掩玉,全书写作也存在一些不足。如各个章节的衔接不够连贯,特别是对预测方法的阐述如何与前面的理论分析衔接,最好是通过实例分析说明,又如,有些章节所参考和引证的文献可能是作者早期的观点;而全书还未能充分反映出经济预测研究近年来一些最新和微观领域的发展,如信息经济学的博弈分析等。建议作者在书稿的修改过程中加以调整和补充。

据介绍,本书是由天津社科院经济预测研究所集体撰写,这是对经济预测基础理论研究的一个理论贡献。总体来看,这部书稿的写作完全达到了预期目的,也反映了该所在基础理论方面较高的研究水平。预祝这部书稿能够早日面世。

天津大学管理学院教授 博士生导师 赵黎明

2004年5月24日

前 言

自新世纪以来,中国经济始终处于加速发展的上升区间。中国持续二十多年的改革开放,已初步建立市场经济制度,也使经济发展面临着更加复杂的外部环境。因此,对经济目标和行为进行周密的预测,成为经济决策者、管理者和执行者的共识。预测或经济预测,不是简单的工具加技术。自20世纪30年代计量经济学创立以来,经济预测已逐步演变成为应用经济科学的一个重要分支,具有丰富的理论内涵和系统的预测方法,但经济预测在中国的发展和应用,却只有很短的历史。

为适应经济发展的需要和服务于社会,天津社会科学院于1999年10月正式组建了经济社会预测研究所,在承担大量应用性研究课题的同时,经济社会预测研究所为加强本学科的基础理论建设,向院学术委员会申请了“经济预测的理论与方法”专项课题,这部《现代经济预测》,就是这一课题研究的结项成果。

一、关于研究目的

——是发展市场经济的需要

西方国家的经济预测理论研究和应用实践之所以早于中国半个多世纪,主要是因为市场经济在经过一个多世纪的自由发展之后,其有效的组织和运行,更多的不是依靠计划和行政管理,而是充分发挥市场规律和间接机制的作用。故此,超前、客观和及时的预测,在经济分析和决策时就显得十分重要。中国历经多年的改革开放,一个具有中国特色的市场经济体系已初步建立,政府管理经济的计划职能愈趋于指导意义;市场规律的内在调控机

制受到高度重视;在多重因素的作用之下,中国市场经济运行和发展,从没有像今天这样高度重视经济预测工作。换言之,中国的市场经济欲要做大做强,必须建立在科学预测的基础之上。

——是把握复杂经济形势的需要

随着经济全球化、区域经济一体化进程的不断加速,中国业已加入世贸组织,中国的市场经济活动已充分与世界接轨并日益受到全球经济大气候变化的影响。尽管中国作为市场经济国家的地位还不被一些国家所认同,但必须承认,大到国家五年计划和中长期发展规划的制订;税率、利率和汇率的调整;小到企业经营和产品定位;个人储蓄、投资和消费,无不置于变化的经济环境之中,几乎任一决策都需要预测。而现实经济发展的不确定和不连续性,不仅是只凭经验和定性分析预测方法失灵,就是依靠一般的预测理论和方法,也往往难以对现实作出合乎逻辑判断和解释。为适应经济预测专业化程度的提高,我们不仅需要把握预测的一般方法和技术,还需要根据经济发展的时代特点和国情特色,加强现代经济预测的理论研究。

——是完善经济科学体系的需要

经济预测理论具有学科的边缘性和交叉性。相关课程在经济学本科和研究生教育中虽均有涉及,但只有少数大学才设有相关专业或硕、博士点,教材的使用也不统一。由地方社会科学院的专业研究所来组织经济预测的系统研究,主要目的不是编写教材,而是通过对国内外经济预测文献的广泛收集和系统比较,一要全面了解和经济预测的理论渊源、发展进程、思维方法、流派体系与前沿观点;二要澄清和解答我们对经济预测在认识上一些误区和盲点;三要全面梳理、阐述现代经济预测方法、建模思想、适用对象、运用步骤和特点,剔除那些不成熟或缺乏操作基础的预测方法;力求从体系建设和应用研究两方面,创建适合中国国情的经济预测理论和方法体系。

二、关于写作的基本框架

从上述研究目的出发,本书定名为《现代经济预测》,全书的写作框架建构遵循如下原则:

——强调预测理论与方法的系统性和一致性

全书分成理论与方法两部分。以导论加上第一章至第七章,主要讨论经济预测的理论及其相关应用领域。第八章《经济预测的一般准备》作为一个承上启下的章节来安排,自第九章至第十三章,主要讨论经济预测的方法。进行这样的划分,目的还是要二者相互呼应。力图从经济预测的理论到方法之间,建立可贯通一气的系统路径或桥梁,期望纠正一些已发表文献中出现的、单一讨论预测方法和只谈理论不顾及应用的种种偏向。

——强调以宏观、中长期和定量预测作为建构理论体系的主线

这既是对经济预测统计学传统的继承与发展,也更加适合分析我国开展经济预测的主要实践领域如周期预测、结构预测和经济预警等。就一般意义而言,短期经济预测更具有重要性和精确度,因而在经济数学和统计学课程中多有介绍,因而不是本书的讨论重点。当然,这样的划分不是绝对的,对同样适用于宏观和微观预测领域的、中长期和短期的和定性的经济预测理论与方法,我们也择其重点的加以介绍,如专家预测法等。

——强调以现代经济活动预测作为分析对象

经济预测的产生是以市场经济的充分发展为前提,总体是以二战之后世界范围计量经济学的形成为起点。需要强调的是,本书所讨论的重点,是与中国当代市场经济发展水平相适应、有数据环境支撑、实践可行的预测理论与方法,其理论分析的实际起点已远远超过20世纪40年代。定义于现代经济预测的另一重意义在于,所谓“现代经济”是一个与时俱进的概念,中国的改革开放和经济转轨,在较长时期仍处会处于加速转变之中,许多领

域的发展要求同步于甚至赶超世界水平,如信息产业、环境产业的发展、绿色 GDP 统计制度的建立等。因此,对预测理论和方法的讨论不能完全拘泥于现实,还要顾及全球及未来发展需要,更要了解现代经济预测理论研究的前沿动向。

——强调经济预测的应用性和操作性

由于现代经济活动日趋复杂和不确定,预测的对象和标准实际在不断变化,指导预测实践的理论和方法论范式也在不断创新。事实上,与西方主流经济学的形成相衔接,已有一些成熟的预测理论和方法得到学术界的公认。但究竟是哪些预测方法被广泛推崇,需求者一般并不了解,在通用教材和理论性研究文献中也介绍的不多。作为从事经济预测的专业机构,尽管我们开展预测研究的历史只有短短五年,但还是具有一定的发言权。故此,坚持学以致用,深入浅出,面向从事应用研究和初步接触预测分析的经济工作者,将预测的理论、方法和案例有机结合,兼收并蓄,达到普及和提高的双重目的,这是写作本书的一个主要动机。

三、对研究难点的基本认识

建立经济预测的基础理论框架,需要从思维方式到内容的创新研究。因而,就无可避免地要面对和解答一系列难点与问题。归纳起来,贯穿全书的主要难点集中于以下四个方面。

——什么是经济预测的理论传统

从预测科学发展的历史源流来看,早期的经济预测具有统计学与未来学的两大传统,经济预测又具有经济学、数学、统计学三大理论支柱,至 20 世纪 60 年代以后,由于系统科学的“老三论”和“新三论”的建立和发展,虽然主要应用于自然科学领域,实际上却形成经济预测的第三大传统。从经济预测实践和发展角度上看,我们认为,在一个大国经济中,政府统计数据系统尽管不够完善,但却是目前惟一具有连续性和可比较的数据库系统。

我们认为,经济预测坚持统计学的传统更为必要,但决不是

要忽略其它几大传统。如何从理论、思维逻辑和方法论角度加以客观区分,由于以往的文献著作均较少涉及,需要更为深入的论证。故此,我们在导论和第一章,以较大的篇幅进行介绍和分析。由于其中必然涉及自然科学的相关内容,必须承认,我们的一些分析并不十分专业。或许在一些学者看来,这种讨论与经济预测主题似乎相距甚远。但我们依然认为,这正是经济预测的边缘性、交叉性特色所在,不能绕过也无须回避。

——经济预测与现代经济学当是怎样的关系

经济预测作为一门独立学科的历史很短,但经济学发展的历史却源远流长,已形成规范的科学体系。此外,经济预测由于是建立在数学、经济学、统计学、系统科学等多学科发展的理论基础之上,会随着几大学科的理论推进而发展,随着预测精度标准的提高而发展。但正是由于经济预测是“多方嫁接”的成果,使得它作为一门独立学科总有“门派不清”的嫌疑。因而,能否建立自有的理论体系,这一体系又该如何发展,都需要有新的突破。

我们认为,经济预测是一门不断发展、创新的学科,本书在导论、第一章均有所涉及,第三章则专门讨论了经济预测和现代经济学的关系。需要说明的是,虽然经济学具有硬科学的“内核”,是与自然科学分享诺贝尔奖美誉的社会科学之一,但伴随的数学至上倾向、新古典主义对主流地位的垄断、对社会科学话语权的独霸等问题,导致西方主流经济学面临范式单一发展的危机,也波及到经济预测的科学发展。因此,讨论西方现代经济学主流学派发展的危机,可使我们更加充分地认识经济预测的局限性,在建立有中国特色的经济预测体系过程中,必须善于倾听来自各方面建设性意见甚至是批判,以避免多走弯路。

——经济预测是否能够达到足够的精确度

必须承认,经济预测具有运用复杂、精致数学工具的充分手段,但经济预测的“测不准”似乎司空见惯。某些从事预测研究的

资深学者甚至断言,经济预测是要不是把预测方向搞错,就算是基本成功,过高和过低只是技术层面的问题。这显然是对经济预测的一种误解。在预测理论体系中,对方向或“拐点”的预测属于定性预测,其它则主要是定量预测,这是两个不能混淆的前题。多数情况下,即使方向预测准确,预测结果若过分偏离目标,也会造成决策的失误。譬如,导致近年来全国电力空前短缺的主要原因,就是“十五”计划对全国电力市场发展的速度严重低估,这是预测失准导致决策重大失误的典型案列。^①

我们认为,包括经济预测活动在内一切预测活动,都有预测精度的相对尺度。绝对的预测精度是不存在的。即使在论证严谨的物理学中,也存在所谓“测不准”原理:某些物理现象不能凭借实验设备和计算手段来预测其发生和发展,这不是仪器本身的缺陷,而是因为这些现象的出现具有一定概率,用宏观手段无法精确测量^②。经济现象的周期性已经被证明是广泛存在,但是否能精确预测,与预测对象的选择、预测区间的确定和预测工具的选择均密切相关。为提高预测精度,经济学者也设计了诸如“组合预测法”等技术手段,以多种预测技术来检验和综合预测精度。预测不准只是相对而言,不应成为我们质疑经济预测科学性的借口。著名经济学家吴敬琏认为:“经济活动是一种复杂的人类社会行为、是主观和客观交互作用的结果。当经济学家预测出某种不利的前景时,人们可以有意识地根据经济学家的建议,采取措施来加以避免。在这种情况下,原来预测的灾害性前景没有出现,不但不是经济学家的无能和过失,相反恰恰证明了经济学家对社会的特殊贡献”^③。

① 徐任重《19省电荒热钱滚滚涌向电力》《财经时报》2003年8月9日。

② 《“测不准原理”与新经济奇迹》,《互联网周刊》2003年9月25日。

③ 《经济学家有没有价值》搜狐网站“财经聚焦”专栏154期,2004年7月12日。

——数学对于经济预测是工具还是目的

经济预测的理论基础,主要是数理经济学和计量经济学,偏重于运用数学公理和模型来解释社会经济现象和人的经济行为,选择参照系和构思研究框架。在西方各国经济学教学中,数学都是必修的基础和应试课程,国外的学者认为,在经济理论研究中借助数学模型至少有三个优势。一是对理论研究的前提假定,用数学语言可更清晰地描述;二是运用数理逻辑的推理分析严格缜密,可以防止非数学语言的谬误;三是可以应用已有的数学模型或数学定理推导新的结果。但是,对于不具备专业数学知识的经济学者,这些优势恰恰都是劣势。应当看到,我国许多颇有建树的老一代经济学家,普遍缺乏现代经济学的知识结构,并不擅长对数学模型的运用,这是计划经济时代的历史烙印,但这并不妨害他们观察和分析经济的敏锐和才智。西方近年爆发的“经济学改革国际运动”则是对经济学过分美国化、新古典化、数学化的强烈反应。

我们认为,经济学不是数学。对经济学研究者而言,研究的思维和方法最为重要,数学计量方法只是体现、映证和执行经济学思维的工具。诚如数学家李大潜院士所言:“如果将数学教学仅仅看成是一般数学知识的传授,那么即使包罗了再多的定理和公式,可能仍免不了沦为一堆僵死的教条,难以发挥作用;而掌握了数学的思想方法和精神实质,就可以由不多的几个公式演绎出千变万化的生动结论,显示出无穷无尽的威力”。^①

必须看到,中国市场经济的不断加速,宏观经济的稳定运行,政府职能的转变,迫切需要加强经济预测理论和方法研究和创新,这是一个不可逆转的历史趋势。随着计算机和各种计量预测

① 李大潜《学数学的目的不在于定理和公式》,《光明日报》2003年6月4日。

软件的发展,有关预测的技术原理和运算程序已充分工具化、软件化和商业化。因此,一项预测的成功,主要不是取决于预测者的数学水平,而取决于预测者对预测经济学原理的把握程度、对预测目标的认知深度和对预测工具驾驭能力。而设计和开发预测工具,则是软件工程师的任务。

四、结语

总之,呈现在读者面前的这部专著,力求在构建现代经济预测的基础理论框架方面有所创新、有所突破。抱着这样的目的,我们对本书的构思,力求跳出实证研究一般性分析思路,充分结合我们的实际研究工作,并增加了较多的理论分析内容。此外,考虑经济预测初学者的需要,我们对有关理论、学派、事件和方法的介绍,尽可能做到规范、简洁和通俗。至于能否达到这个目的,仍有待于方方面面的检验。

本书由天津社会科学院经济社会预测研究所集体完成。鉴于这一机构的组建只有短短四年,我们坦言,多数作者在接受研究任务之前,对于经济预测的理论和方法的熟悉程度并不比他人更多。在长达一年半的写作过程中,学习、再学习,实际是每一位作者的首要任务。在这里,我要由衷地感谢全所同事为此付出的辛劳和努力。这部专著的问世,不仅展示了我们这个学术集体的凝聚力和创造力,也见证了我们由初创走向成熟的艰辛进程。

卢 卫

2004年7月于天津社会科学院

目 录

评审意见(一)	(1)
评审意见(二)	(3)
前 言	(1)
导 论	(1)
第一节 预测的三种思维方式	(2)
一、汉语语境中的“预测”及其外延	(2)
二、英语语境中的“预测”及其外延	(4)
三、预测的三种思维方式	(7)
第二节 经济预测的“两大传统”源流	(10)
一、统计学传统	(10)
二、未来学传统	(14)
第三节 经济预测两大传统的比较	(18)
一、经济预测涵义比较	(18)
二、研究内容的范围比较	(20)
三、构成要素比较	(22)
四、一般过程比较	(26)
第四节 经济预测的“三大理论支柱”与关系	(29)
一、经济学、统计学和数学的关系	(29)
二、统计学、统计经济学与经济统计学的关系	(31)
三、数理经济学与计量经济学	(32)
四、概率论与数理统计学	(37)
第五节 现代预测方法论的演进	(40)

一、现代预测方法论产生的背景	(40)
二、20 世纪之前科学方法论的发展	(42)
三、经典数理统计和波普尔方法论	(42)
四、20 世纪 50 ~ 80 年代的贝耶斯运动	(43)
第一章 预测的哲学和系统科学基础	(47)
第一节 人的思维系统	(47)
一、神经细胞的构造与功能	(47)
二、人体神经系统概述	(48)
第二节 预测的唯物主义哲学基础	(50)
一、唯物论三大规律与预测	(50)
二、唯物论的基本范畴与预测	(52)
三、预测的哲学原理	(55)
第三节 预测的系统科学基础之一：“老三论”	(57)
一、系统论与预测	(58)
二、信息论与预测	(60)
三、控制论与预测	(66)
第四节 预测的系统科学基础之二：“新三论”	(68)
一、耗散结构论与预测	(68)
二、协同学与预测	(71)
三、突变论与预测	(77)
第二章 经济预测的发展及其评价	(81)
第一节 经济预测的概念、起源和发展	(81)
一、经济预测的概念与起源	(81)
二、经济预测的原则、程序与步骤	(85)
第二节 世界各国经济预测的发展	(86)
一、美国经济预测及其政策分析特点	(87)
二、日本对经济预测的应用与发展	(90)
三、经济预测在法国的应用与发展	(92)