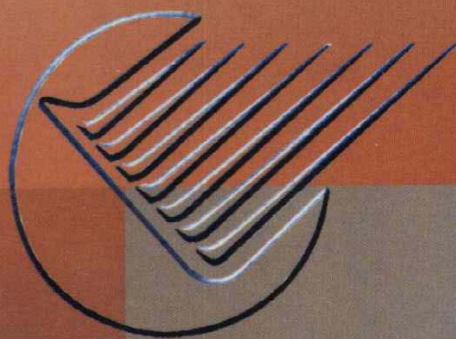




企业调查系列读本

欧盟企业和消费者景气 调查理论与实践



国家统计局企业调查总队 编



中国统计出版社
China Statistics Press

欧盟企业和消费者景气 调查理论与实践

国家统计局企业调查总队 编译



 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

欧盟企业和消费者景气调查理论与实践/国家统计局企业调查总队编译

—北京:中国统计出版社,2002.5

ISBN 7-5037-3705-0

I. 欧…

II. 国…

III. ①欧洲联盟—企业经济—经济统计—统计调查

②欧洲联盟—消费水平—经济统计—统计调查

IV. F150.3

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2002)第 003778 号

欧盟企业和消费者景气调查理论与实践

作 者/国家统计局企业调查总队

责任编辑/姚 立

封面设计/崔宝进

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/科伦克三莱印务(北京)有限公司

经 销/新华书店

开 本/787×1092mm 1/18

字 数/250 千字

印 张/17.5

印 数/1-3000 册

版 别/2002 年 5 月第 1 版

版 次/2002 年 5 月北京第 1 次印刷

书 号/ISBN 7-5037-3705-0/F·1319

定 价/29.00 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。

《企业调查系列读本》
编委会及编辑人员

顾 问：朱之鑫

主 编：邱晓华

副主编：宋跃征

编 委：戚少成 王文颖 王群英 闫路增
李文海 杨玉民 李 黎 雷平静
蔺 涛 叶植材 魏从德

《欧盟企业和消费者景气调查理论与实践》
编 辑 部

编 译：邱 东 蒋 萍 蔺 涛 冯 力
陈梦根 徐 强 张 华 吴 静
杨小英 谢炳芬 陈宝红 张 洋
审 校：王庆石 蔺 涛

前 言

景气调查是观察短期经济运行、监测和预测经济发展趋势重要而又行之有效的工具之一。它通过定期向企业家或消费者发放调查问卷,由其对直接从事的具体活动进行判断和预测,或对一些宏观经济变量发表看法,据以编制景气指数,准确、及时地反映宏观经济运行、企业生产经营和消费者信心状况,预测经济发展的变动趋势。

景气调查方法起源于20世纪40年代末,德国IFO经济研究所于1949年在德国首次进行了该类调查。由于景气调查理论的科学性、方法的先进性和结果的及时可靠性,其调查结果获得了越来越多的政府组织以及经济研究方面专家学者的认同与关注,已经成为许多国家政府管理部门、国际组织、经济研究人员和决策者们分析和判断经济发展趋势的重要依据。

我国多个部门从20世纪90年代初期开始借鉴国外的成功经验,积极探索在中国开展景气调查。国家统计局企业调查队系统建立后,于1998年开始进行大范围、规范的企业景气调查,并正式形成国家统计局调查制度。期间得到了德国IFO经济研究所的大力支持与帮助,并于1999年作为相对独立的和重要的一项内容纳入《中德实证经济研究合作项目》。经过几年努力,这项调查已产生广泛的积极影响,并被国内外专家评价为最具权威的中国企业景气调查。为了进一步完善中国的景气调查方法体系、提高景气调查应用水平,国家统计局企业调查总队、德国IFO经济研究所与东北财经大学统计系联合编译了《欧盟企业和消费者景气调查理论与实践》一书。

本书以德国IFO经济研究所提供的《EUROPEAN ECONOMY》(欧洲经济)1997年第6期暨《The Joint Harmonised EU Programme of Business and Consumer Surveys》和《French Business Surveys》为蓝本,参考国外有关资料编译而成。全书共分三篇:第一篇是欧盟企业和消费者景气协调调查方案;第二篇是欧盟委员会关于实施《欧盟企业和消费者景气协调调查方案》的决定的具体内容;第三篇是欧盟景气协调调查方案在法国的应用,即

《法国企业景气调查》。

本书编译工作是由国家统计局企业调查总队组织与主持,国家统计局企业调查总队、东北财经大学统计系和德国 IFO 经济研究所联合编译,其中前两篇由东北财经大学邱东、蒋萍、冯力、陈梦根、徐强、张华、吴静编译,第三篇由国家统计局企业调查总队蔺涛编译。全书由王庆石、蔺涛进行审校。

本书的编译过程中得到德国 IFO 经济研究所国际研究与项目合作部主任 Siegfried Michael Schoeherr 教授、景气调查与投资分析部主任 Gernot Nerb 博士、德国 Duisburg 大学东亚经济研究所 Markus Taube 教授和经济合作与发展组织统计司 Ronny Nilsson 博士的指导与帮助。值此该书出版之际深致谢意。

编 者

2002 年 1 月

Foreword

Business surveys is an important component of the statistical information for monitoring short-term economic development. Survey questionnaires are periodically addressed to samples of consumers and managers, who are asked to judge and predict developments that directly related to their specific activity, or to express their opinion about the course of variables over which they no control. The results of the surveys are presented in a way that clearly shows the opinions about actual or expected changes or the judgments about the level of a number of variables. In this way the surveys capture the direction of change for a specific activity and macro-economy.

Business surveys date back to the late 1940s and the first surveys were conducted by Ifo Institute for Economic Research, Germany in 1949. Soon afterwards, other countries in Europe start experimenting with the new techniques. Because of its scientific theory, advanced method and rapid result, business surveys had been recognized by more and more government and economic research institutions. Now business surveys have been the important foundation, which is used to analyze and judge the economic development for the economic researchers and policy decision-makers.

Business surveys were launched in China from early 1990s, but most of them were experimental or only limited to industrial sector. Until Enterprise Survey Organization (ESO) was selected by National Bureau of Statistics (NBS) to conduct NBS Business Surveys in 1998, the normative

business surveys were periodically conducted in the most sectors of the economic activities in China. Soon Business Surveys were listed into National Statistics Program of China. Chinese—German Cooperation in the Field of Empirical Economic Research Project was approved by Volkswagen—Foundation in 1999. And business surveys were the most important component of the project. In the past several years, NBS Business Surveys have made rapid progress and been accepted to be the most authoritative business survey in China on the help of Ifo Institute for Economic Research.

In order to improve the application of business survey, it is necessary to publish a book on business survey in Chinese. In collaboration with Ifo Institute for Economic Research and Statistics Department of Dongbei University of Finance and Economics, Enterprise Survey Organization organized to translate a book on business and consumer surveys. The book is based on the The Joint Harmonised EU Programme of Business and Consumer Surveys and French Business Surveys, and the former was supplied by Ifo Institute for Economic Research.

The book consists of three sections. The first section is a users manual to the joint harmonized EU programme of business and consumer surveys. The second section is the Commission decision on the joint harmonized EU programme of business and consumer surveys. The third section is French business surveys, a case of the joint harmonized EU programme of business and consumer surveys. The first two sections are translated by Qiu Dong, Jiang Ping, Feng Li, Chen Menggen, Xu Qiang, Zhang hua and Wu jing, Statistics Department of Dongbei University of Finance and Economics. The third section is translated by Lin Tao, Enterprise Survey Organization. The reviewers of the whole book are Wang Qingshi and Lin Tao.

Thanks should be given to Prof. Dr Siegfried Michael Schoeherr and

Dr Gernot Nerb, Ifo Institute for Economic Research, Prof. Dr Markus Taube, Duisburg University, Germany, Dr Ronny Nilsson, Organization for Economic Co — operation and Development for their help during the translation of the book.

Editors
Jan. 2002

原 序

开展协调的企业与消费者景气调查的原因是很清楚的：消费者和经理人员对他们所处环境的认识的信息对政策制定者来说是非常重要的。为了以一种有意义的方式对调查结果进行解释，需要采用可比较的方式开展调查并将调查结果提供出来——因而需要开展协调调查。此外，协调景气调查结果能够很快地得到，并且这些调查所传达的信息在别处是无法取得的。欧洲经济共同体内的企业与消费者景气协调调查由欧洲委员会于 1961 年发起，第一次景气协调调查是 1962 年在工业行业进行的企业景气协调调查。从此之后，景气协调调查所涵盖的范围和行业得到了很大的扩展。

欧盟委员会上次在《欧洲经济》上发表《企业景气调查的一般原则》是在 1991 年。本手册在几个方面得到了扩展，对相关信息（正像调查结果所提供）的一些其它要求，在欧盟内部和外部都得到了认同。欧盟委员会因此引入新的景气调查，调查结果的提供方式应使人容易接受。为此，使用了信心指标这样一种单一测度指标。由于这一原因，一些新的指标已经构造了出来，用以综合调查的有关信息。调查结果用于经济计量建模已被做得有条有理，并且已使用多年。欧盟各成员国内部经济结构和成员国间经济结构方面的演变以及建模方法的进步，促使欧盟委员会重新审视了将调查结果用于预测经济总体和各部门发展的方法。

欧盟各国经济随时间变化发生的结构性调整表明，需要在调查中包含一些新的行业部门。的确，人们已经认识到服务业越来越重要，并且欧盟在目前的消费者与企业景气协调调查方案中已将服务业包括进来。

有些成员国在零售贸易业开展该类调查已进行了很长时间，足以能够构造出零售业的信心指标。欧盟委员会于 1997 年 5 月计算了这一信心指标，该指标是对零售贸易业企业景气调查结果的一种综合。

企业与消费者景气调查的结果能够很快地得到，并且该调查结果包含了经济代理人所做的预期方面的信息，这一事实使得它们在预测中具有较

大的价值。的确,1982年以来欧盟委员会一直使用一种利用调查结果建立经济计量模型,即 BUSY 模型的方法。1996年,构建了一种预测 GDP 及其主要构成部分的新模型——BUSY II 模型,该模型包括了经济计量建模方法的最新进展。

企业与消费者景气调查提供了经济代理人对他们所处环境认识的详细信息。本手册全面介绍了各种景气调查,提供给读者各种不同景气调查的范围及所覆盖的领域。

一些中欧和东欧国家已经从中央计划经济向市场经济转型,这使得人们对这些国家经济发展的演化过程越来越感兴趣,特别是自从这些国家申请加入欧盟以来更是如此。经济合作与发展组织(OECD)与欧盟委员会(EU)于1991年开始的一项联合项目,其目的就是贯彻实施欧盟企业与消费者景气调查协调方案。目前,该调查结果定期公布在《欧洲经济》上。

欧盟的企业与消费者景气协调调查结果对所有关心经济趋势的部门与人员——政府部门、管理人员、研究人员以及所有的决策者——都非常有用。本指南的目的就是向他们提供全面的介绍:欧盟委员会公布的调查结果是如何得到的以及如何最大程度地利用这些调查结果。

《欧洲经济》编委会主任

Heinrich Matthes

目 录

原序

第一篇 欧盟企业和消费者景气协调调查方案

第 1 章 企业和消费者景气调查的一般原理·····	(2)
1.1 企业和消费者景气调查的性质·····	(2)
1.2 企业和消费者景气调查的实施·····	(5)
1.3 调查结果的计算·····	(11)
1.4 调查结果的表达方式·····	(13)
1.5 调查结果的季节因素调整·····	(15)
第 2 章 企业和消费者景气调查结果的使用·····	(16)
2.1 引言·····	(16)
2.2 对企业和消费者景气调查结果的解释·····	(17)
2.3 根据调查结果计算的综合指标·····	(20)
2.4 调查结果在经济计量模型中的使用·····	(30)
2.4.1 调查结果与经济计量模型介绍·····	(30)
2.4.2 BUSY II 模型简介·····	(31)
2.4.3 BUSY II 模型:经济计量方法·····	(32)
2.4.4 BUSY II 模型:估计和模拟结果·····	(37)
第 3 章 欧盟企业和消费者景气协调调查·····	(41)
3.1 企业和消费者景气协调调查的一般特点·····	(41)
3.2 工业企业景气协调调查·····	(43)
3.3 建筑业企业景气协调调查·····	(56)

3.4	零售贸易业企业景气协调调查	(66)
3.5	投资景气协调调查	(66)
3.6	服务业企业景气协调调查	(72)
3.7	消费者景气协调调查	(76)
3.8	国际经济景气调查	(77)
3.9	专项调查	(89)
3.10	向中欧和东欧国家扩展的景气协调调查	(91)

附录 A

附录 A.1	Dainties 季节因素调整法介绍	(94)
附录 A.2	BUSY II 模型详解	(97)
附录 A.3	BUSY II 模型——单一方程估计结果	(100)
附录 A.4	BUSY II 模型——同步估计结果	(106)
附录 A.5	BUSY II 模型——备选模型估计结果	(109)
附录 A.6	零售贸易业信心指标的构建	(111)
附录 A.7	投资景气调查——新的行业分类,企业规模分类 及调查时间	(128)
附录 A.8	消费者景气调查——按收入与职业进行的分类	(130)
附录 A.9	消费者景气调查——相关分析	(133)
附录 A.10	国际经济景气调查——调查问卷	(173)
附录 A.11	国际经济景气调查——国家名录表	(175)
附录 A.12	专项调查——全部调查问卷	(177)
附录 A.13	中、东部欧洲国家——可提供的调查结果	(221)
附录 A.14	企业与消费者景气调查的文献目录	(223)

第二篇 欧盟委员会关于实施《欧盟企业与消费者景气 协调调查方案》的决定

1	导言	(226)
2	企业与消费者景气调查的特点	(227)
3	欧盟制定联合的协调调查方案的必要性	(229)

4	调查方案的内容	(230)
5	调查结果的使用	(231)
6	调查经费	(232)
7	结论	(233)
8	欧盟委员会的决定	(234)

附录 B

附录 B.1	欧盟工业企业景气协调调查	(235)
附录 B.2	欧盟建筑业企业景气协调调查	(238)
附录 B.3	欧盟零售贸易业企业景气协调调查	(240)
附录 B.4	欧盟投资景气协调调查	(242)
附录 B.5	欧盟服务业企业景气协调调查	(246)
附录 B.6	欧盟消费者景气协调调查	(247)
附录 B.7	欧盟景气协调调查的时间安排和条件要求	(252)
附录 B.8	调查机构清单	(253)

第三篇 法国企业景气调查

第 1 章	调查的描述	(259)
1.1	调查项目	(259)
1.2	调查的主要特点	(261)
1.3	实施过程	(261)
1.4	行业范围	(262)
1.5	抽样	(263)
1.6	调查问卷	(267)
第 2 章	调查数据的处理与汇总	(270)
2.1	调查问卷的回收与录入	(270)
2.2	数据质量控制	(270)
2.3	数据处理	(271)

2.4	数据汇总	(271)
2.5	季节因素调整	(273)
2.6	两个案例	(274)
2.6.1	工业企业月度和季度景气调查	(274)
2.6.2	工业投资景气调查	(274)
第3章	调查结果的解释与应用.....	(276)
3.1	调查结果的表达方式	(276)
3.2	定量先行指标的构建	(277)
3.3	预测消费	(279)
3.4	预测制造业产出	(283)
3.5	批发贸易业调查结果的开发	(283)
3.6	小结	(284)
3.7	调查结果的应用	(284)
3.7.1	短期经济趋势报告	(284)
3.7.2	季度国民经济核算	(285)
第4章	调查的组织、费用与调查成果	(286)
4.1	组织实施	(286)
4.2	经费预算	(286)
4.3	调查活动	(287)
4.4	调查成果	(287)

Contents

Foreword

Part A

A users' manual to the joint harmonised EU programme of business and consumer surveys

1. General principles underlying the business and consumer surveys	
.....	(2)
1. 1. The nature of business and consumer surveys	(2)
1. 2. Carrying out a survey	(5)
1. 3. Calculation of the results	(11)
1. 4. Presentation of the results	(13)
1. 5. Seasonal adjustment of survey results	(15)
2. The use made of business and consumer survey results	(16)
2. 1. Introduction	(16)
2. 2. Interpretation of business and consumer survey results	(17)
2. 3. Composite indicators based on survey results	(20)
2. 4. Using survey results in econometric models	(30)
2. 4. 1. Survey results and econometric models; an introduction	(30)
2. 4. 2. The BUSY II model; introduction	(31)
2. 4. 3. The BUSY II model; the econometric methodology	(32)
2. 4. 4. The BUSY II model; estimation and simulation results	(37)

