

金融监测预警系统

邱丕群 杨凤虎 主编



● 陕西人民出版社

前 言

金融体制改革的目标之一,是将国有专业银行转换为商业银行,而商业银行的经营目标,是追求利润最大化。要取得最大化的利润,就要承担最大化的风险,而如何降低风险,保证信贷资金不受损失,就成为理论界必须探讨和解决的问题。

我们知道,工业企业在产品生产中建立了一套全面质量管理体系,对生产过程进行严格控制,把各种不利因素消灭在生产过程中,从而保证生产出高质量的产品,以取得良好的经济效益。那么,在金融业的经营管理过程中,是否也能建立这样一种系统,以保证信贷资金的安全,合理投放货币,取得较好的金融效益和社会效益呢?我们说能。我们编写《金融监测预警系统》的目的,就是想起到这样的作用。它在金融业经营管理中建立了一种科学的、系统的、有效的监测预警系统,利用经济模型、指标体系、预警信号等方式对金融活动进行监测,并提出预警,以保证金融活动的正常、有序进行。

本书由邱丕群、杨凤虎主编,杨长林、梁章运、杜彦辉、郝惠英、王占良、魏明英副主编。参加编写的人员有(按姓氏笔划排列):王孝、王占良、王有朋、李春萍、邱丕群、郝惠英、郝曙辉、杜彦辉、杨长林、杨凤虎、梁红、梁章运、薛淑敏。

另外,与本书配套的计算机软件也正在开发研制中。我们相信,本书的出版定会对我国的金融业管理和金融理论研究起到一定的作用。

作 者

1996年10月

目 录

第一章 金融监测预警总论	(1)
第一节 经济监测预警研究的历史与现状	(1)
第二节 金融监测预警的产生和发展	(14)
第三节 金融监测预警的对象范围和作用	(21)
第四节 金融监测预警的理论和方法	(24)
第二章 金融监测预警系统	(30)
第一节 金融监测预警的基本概念	(30)
第二节 金融监测预警系统的特点、基本特征和功能	(43)
第三节 金融监测预警系统的统计设计	(52)
第三章 我国金融监测预警系统	(67)
第一节 我国金融监测预警系统的基本结构	(67)
第二节 我国金融监测预警系统建立的思路 and 程序	(77)
第三节 我国金融运行监测预警月报、季报的建立与编制	(86)
第四节 我国金融供求状态监测预警	(93)
第五节 我国金融监测预警计算机软件系统	(97)
第四章 金融监测预警指标体系	(105)
第一节 金融监测预警指标的概念和分类	(105)
第二节 金融监测预警指标的选择	(116)
第三节 金融监测预警指标体系的设置	(128)
第五章 金融监测预警模型体系	(139)

第一节	金融监测预警模型的概念及分类	(139)
第二节	金融监测预警模型的建模程序与方法	(144)
第三节	几个重要的金融监测预警模型	(152)
第四节	预警区间的测定方法	(171)
第六章	金融监测预警评价体系	(178)
第一节	金融监测预警评价的内容及任务	(178)
第二节	金融监测预警评价的方法	(183)
第三节	金融监测预警综合效益评价指标	(193)
第四节	金融监测预警系统的投入产出分析	(199)
第五节	监测时滞的处理方法	(205)
第七章	银行信贷监测预警	(212)
第一节	银行信贷监测预警的意义和作用	(212)
第二节	银行存款监测预警指标体系	(214)
第三节	银行贷款监测预警指标体系	(227)
第四节	计量经济模型在银行信贷监测预警中的应用	(240)
第八章	现金收支和货币流通监测预警	(246)
第一节	现金收支监测预警的意义	(246)
第二节	现金收支监测预警	(249)
第三节	货币流通监测预警	(252)
第四节	货币购买力监测预警	(261)
第九章	保险监测预警	(263)
第一节	保险监测预警的意义	(263)
第二节	保险监测预警的指标	(267)
第三节	保险监测预警	(275)
第十章	金融市场监管预警	(278)
第一节	金融市场监管预警概述	(278)
第二节	资金市场监管预警	(281)

第三节	外汇市场监测预警·····	(293)
第十一章	对外金融监测预警系统·····	(297)
第一节	对外金融监测预警的必要性·····	(297)
第二节	我国对外金融监测预警系统·····	(301)
第三节	国际收支平衡监测预警·····	(309)
第四节	外汇业务监测与预警·····	(330)

第一章 金融监测预警总论

随着我国社会主义市场经济的不断发展和完善,金融体制改革日益深化,我国金融事业的发展日益迅速,金融部门在我国经济的宏观监测、预警和调控中发挥着极其重要的作用。在我国国有专业银行向商业银行的转化中,金融活动本身的特征与变动的规律性,需要我们从数量上去研究分析,用现代手段对金融活动进行监测与预警。

第一节 经济监测预警研究的历史与现状

一、发达国家经济监测预警的历史与现状

西方市场经济国家宏观经济监测预警的内容包括对经济周期波动的监测预警和对社会总供求状态的监测预警。由于经济周期波动的现实存在,出于宏观经济管理和调控的需要,西方经济波动监测预警的研究已走过了半个多世纪的历程,监测预警系统已具有相当的规模和水平。如果从监测预警系统内部的演变和外部环境的变动来观察,可以知道其发展过程大致经历了四个阶段,即早期发展、再度兴起、迅速发展成熟、走向国际化。

(一)早期发展阶段

经济监测预警系统的研究最早可以追溯到19世纪末期。1888年,法国经济学家福里利在其“社会和经济气象研究”的论文中,以黑、灰、淡红、大红几种颜色,测定法国1877—1887年的经济波动。但是,早期的这类研究普遍缺乏定量测度,随意性较大。有组织的、大规模的对建立景气指标系统的研究,实际上是从本世纪初开始的。一方面,频繁发生的经济危机推动了这一研究;另一方面,各国大量信息资料的积累以及统计分析方法的进步,显著地提高了处

理大量统计信息资料的效果。1903年英国出现了描述经济波动的“国家波动图”；1909年美国统计学家巴布森发表了关于美国宏观经济状态的第一个指示器——巴布森经济活动指数，这是巴布森统计公司为投资者和企业家进行商情变动的观察与分析的一部分，1911年，从事景气监测的美国布鲁克迈尔经济研究所编制并发布了关于股票市场、一般商品市场和货币等方面的景气指标；同年，法国建立了常设的经济恐慌委员会机构，以编制各类商情指数和向政府提供关于经济危机的预警报告。

这一时期影响最大的当属美国哈佛大学的珀森斯教授所领导的景气监测研究。1915年，珀森斯编制了“经济晴雨表”，试图对经济波动进行定量刻画。1917年，哈佛大学设立了“经济调查委员会”，由珀森斯主持研究工作。该委员会广泛搜集了美国1875——1913年的统计资料，设计了新的景气指数编制方法，编制了“美国一般商情指数——哈佛指数”，并定期发布。哈佛指数在综合13个经济指标信息的基础上，分别编制投机指数、商情指数和金融指数。其中，投机指数是以股价变动为基础的，是景气变动的超前反映；商情指数是从生产、物价方面综合测度现期景气状态；金融指数则以货币金融指标变动进行滞后反映。哈佛学派认为以上三种指数的循环变动规律为：投机指数的变动先于商情指数，商情指数的变动先于金融指数。从历史上看，哈佛指数对20世纪以来美国的四次经济危机都作出了较好反映，显示出良好的效果。

哈佛指数的出现对景气指标的发展产生了重大影响，其研究方法纷纷为许多国家所效法。1920年，英国创立了“伦敦与剑桥经济研究所”，采用哈佛方法编制“英国商业循环指数”；1922年，瑞典的统计学家编制了哈佛指数；1925年，德国成立景气研究所，从事哈佛指数的编制；随后，法国、意大利、奥地利、比利时、日本等国都相继开展了景气监测研究，以类似哈佛指数的方法编制本国的“经济晴雨计”。

这一时期经济监测预警的特点是：①景气监测的研究机构多，监测指示器种类也多；②研究工作多由民间机构甚至以个人方式进行；③学术研究较为活跃，如美国统计学家密契尔在长期研究的基础上出版了两部著作：《经济循环》和《经济循环的问题及调整》，总结了测算经济周期波动的一系列研究成果，对今天广泛应用的监测方法产生了深远的影响。

风行一时的哈佛指数法从 1925 年以后开始出现偏离。当 1929 年西方世界的经济大危机爆发时，哈佛指数却指示经济将继续扩张，从而遭到沉重的失败。后来虽经几次修订补救，终因效果不佳而最后被废止。哈佛指数的失败以及类似景气指标的衰落，标志着景气监测早期阶段的结束。哈佛方法作为一种预警方法虽然失败了，但它的研究却取得了许多有价值的成果。它所提出的关于领先指标、同步指标和滞后指标的理论，为现代宏观经济监测与预警系统的建立奠定了基石。

（二）再度兴起阶段

从 30 年代中期到 50 年代，是监测预警系统发展的第二阶段，即改进、发展并开始进入实际应用的时期。

哈佛晴雨表废止之后，美国全国经济研究所（即 NBER）继续对景气监测的研究。在 1937 年美国的经济衰退中，NBER 首脑密契尔应官方要求，与统计学家伯恩斯进行了利用经济指标判断衰退、结束、转折时间的研究。他们在 500 个经济指标的时间数列中，利用变动的时差关系，选择了 21 个指标构成超前指标器，提出了“循环复苏的统计指标”报告，指出经济转折的可能时间，并合著《测度经济循环》一书。书中提出经济波动是一个在宏观经济系统中各部门间逐步“扩散”的过程，各部门波动存在一定时差。他们的判断为以后的经济变动所证实而取得成功。而这一研究成果使得对景气监测的研究再度兴起，而且其扩散理论也为具有较好信息综合能力的“扩散指数”的开发打下了基础。

由于第二次世界大战的影响,经济监测预警系统的重大进展是在 50 年代取得的。1950 年,NBER 的统计学家穆尔主持了建立新的景气监测系统的工作。他构造了一个由筛选出的指标构成的新监测系统。该系统由先行、同步、滞后三类指数组成,以宏观经济综合状态为测度对象,采用了新的多指标信息综合方法——扩散指数(即 DI),对经济波动中的衰退与复苏均能作出较好反映。1955 年和 1960 年,穆尔又主持了对监测系统的修订工作,替换了部分指标,从而保证了景气监测系统的有效运行。

50 年代,美国的经济学家就扩散指数方法进行了广泛的研究和争论,并在美国各大经济、统计刊物上予以登载。这样扩散指数法从理论到实践效果上都得到肯定,成为构造经济监测预警系统的基本方法之一。这一阶段的主要特点及变化为:(1)构造方法上出现了以 DI 为代表的突破;(2)以整个宏观经济状态为参照系的先行、同步、滞后三类指数构成方式的出现;(3)监测预警系统的信息来源开始广泛化;(4)提出近期修订监测预警系统的问题和方法。以上几项变化,标志着以经济指标构造监测预警系统的方法已基本可行,为系统进入实用阶段及官方应用打下了基础。

(三)迅速发展、成熟阶段

从 60 年代开始,景气监测系统的发展进入了一个崭新的阶段。1961 年美国商务部正式将 NBER 景气监测系统输出信息,以数据和图表两种形式提供动向信号在官方刊物定期发布,预示宏观经济监测预警系统已进入官方的、实际应用的阶段。由于这一时期的研究和应用多在各国政府部门主持下进行,因此,无论在监测预警系统的结构方面,还是测度方法方面,都有了迅速的进展。

60 年代,美国商务部统计学家希斯金提出合成指数(即 CI),用于综合多指标信息。CI 是一种综合加权平均指标。其编制中,进行了一系列技术处理以提高其应用功能。它能反映出经济变动幅度方面的信息,来弥补 DI 的不足。合成指数成为构造监测预警系

统的另一基本方法,对系统的构成产生了重大的影响。

60年代中期,西方国家经济“过热”问题引起人们普遍关注,不少国家在其监测预警系统中引进了评价指标,试图对经济波动的不同状态予以相应评价。1965年,法国政府制定了“景气政策信号制度”,借助不同的信号灯颜色,对宏观经济状态作出简明、直观的评价;1968年,日本经济企划厅发布了“日本景气警告指数”,对正处于高速增长的日本经济分别以红、黄、蓝等颜色予以评价。1970年,前西德国会专家委员会也编制了类似的警告指数。这样,经济监测预警系统能以简明、直观的方式进行经济状态的评价,特别有利于广大厂商的经营决策。

这一阶段,在系统的有关基本制作方法,如季节调整、指标选择等方法,也取得重要进展。从50年代到60年代中期,美国、日本、联邦德国政府有关部门提出了一系列剔除季节因素的方法。特别是1965年,希斯金主持开发的X-11法,很快为各国景气监测所采用,提高了监测预警系统信息的质量。1966年,美国商务部研究出一种定性与定量相结合,选择指标的方法,即“评分系统”。该方法首先确定若干选择准则,如经济的重要性、充分性、一致性等,赋予不同的分数,根据每个指标的分值进行定量选择。该方法于1975年、1982年进行了修订完善。

这一阶段引入了预期调查方法,从而拓宽了监测预警系统的信息来源。预期调查是第二次世界大战后由联邦德国IFO经济研究所开发的一种新的信息搜集方法。该方法以厂商和消费者为调查对象,采用问卷方式调查收集关于景气变动的判断信息,然后以扩散指数法进行综合计算。这种方法搜集的信息具有较高的超前性和时效性,尤其是60年代引进扩散指数法进行信息综合以后,取得了优良效果。美国从70年代将预期调查信息纳入监测预警系统,日本及西欧一些国家也设立了基于预期调查的景气指数,作为其监测预警的一部分。

此外,关于监测预警系统输出信息的识别与评价方法,以及测定增长循环,从而建立新的基准循环的方法等,都是这一阶段经济监测预警研究与应用中,具有突破性的进展。

自 1973 年以来,随着战后第二次世界性经济危机的冲击,美国的监测预警系统出现指示失误,难以正常运行。为此,由商务部主持对其进行了长达两年之久的大规模修订工作。1975 年,美国政府有关部门正式公布了新的监测预警系统。经过修订的新系统不仅包括构成指标的替换、构造方法的更改,还增加了国民经济中某些重要方面的景气变动指示,如金融景气指数。这样,监测预警才成为社会各方普遍关注的指示器。这标志着经济监测预警系统相对完善并进入成熟阶段,同时也预示着金融监测预警问题的提出。

(四)走向国际化

自 70 年代后期起,经济监测预警系统在信息识别、领先指标特征,以及基础理论的研究方面仍在不断发展。这一时期最为显著的趋势是走向国际化。1979 年,美国建立了“国际经济指标系统”(即 IEI),用以监测西方主要发达国家的景气变动。该系统具有如下功能:①迅速检测世界性衰退和复苏,测度正在进行的周期性衰退的范围与程度;②评价对外贸易前景;③对通货膨胀提供预警信号。1978 年,西方发达国家经济合作与发展组织(OECD)建立了先行指标系统,监测成员国经济动向;欧洲共同体于 80 年代初开始将其成员国景气状况监测系统投入运行;1984 年日本也出现了研究区域景气变动的 SEPIA 项目。到了 80 年代中期,监测预警系统已由发达国家向发展中国家扩展,其主要功能表现在为宏观调控提供预警信号。

社会总供给与社会总需求均衡和非均衡的监测预警也是宏观经济监测预警的主要内容。西方市场经济国家对社会总供给、总需求的监测预警,通常是借助失业率、通货膨胀率等指标间接测定

的。西方的社会总供求状态的监测预警与西方经济波动的监测预警相交融,其理论系统与方法体系也经历了一个产生、发展和成熟的历史过程。这里不再赘述。

二、发展中国家经济监测预警的历史与现状

70年代末,发达国家的监测预警研究向发展中国家扩展。80年代中期,亚洲的印度尼西亚、马来西亚、菲律宾、新加坡、泰国、南朝鲜、印度七国参加了日本经济研究所的 SEPIA 科研项目。该项目以亚洲各国和地区景气循环的研究和预警为研究课题,编制各国和地区的景气循环指数。其研究的内容包括:景气循环机制研究、商情调查特征分析、景气国际影响分析、景气指数编制方法开发以及计算机软件库的设计等。十年来,这一项目已获得诸多成果,亚洲七国均已建立了经济监测预警系统,较好地配合了宏观经济管理与调控。

(1)经济高速增长下的波动问题。发展中国家在进行景气分析时,必须处理经济高速增长下的波动问题。它们采用了增长循环概念,编制去掉趋势变动的景气指数予以解决。如泰国的扩散指数中,8个同步指标变量中的7个、5个先行指标变量中的3个,采取了增长循环概念;新加坡全部采取增长循环概念;印度在7个先行指标变量中有3个、9个同步指标变量中有8个、4个滞后指标变量中有2个采用增长循环概念;而南朝鲜也有部分变量采用增长循环概念。

(2)GDP 增长率与景气指数变动。由于国民生产总值(GNP)或国内生产总值(GDP)与景气有一定对应性,发展中国家在监测预警中往往把景气指数的变化与 GNP、GDP 的变动联系起来,把景气转折点与 GNP、GDP 增长率的转折点对应起来。如泰国修订扩散指数时,把实际 GDP 增长率与农业增加值增长率的峰谷信息适当加入景气年表中,来选取指标;新加坡利用测算 GDP 转折点来确定其景气转折点;菲律宾考虑以 GNP 为核心的七个经济指

标增长率,用以确定景气转折点,从而选择变量。

(3)指标的分类。发展中国家根据本国经济特点来划分先行指标、同步指标和滞后指标。如泰国将其农产品产地综合价格指数作为先行指标;将第一产业——农业产量的变量作为同步指标;将商品销售额、储蓄存款作为滞后指标。亚洲七国在指标的划分及分类方法上都不尽相同。

(4)经济波动的国际扩散。在国际贸易十分发达的当今世界,必须考虑经济波动的国际扩散问题。特别是亚洲一些发展中国家,与美国、日本的联系和依赖日益深化,来自美、日的景气循环扩散对于这些国家和地区是一种外来冲击。世界市场上的价格和需求都影响这些国家和地区的出口,而这些国家和地区的出口变动又对本国的景气变动产生影响。如东盟四国,出口在总需求中所占比例:印度尼西亚 20%,马来西亚 35%,菲律宾 20%,泰国 25%。以上比例都大于各国的总资本形成或政府支出比例。所以,各国的出口变动对国内景气的影响很强。

自本世纪 50 年代以来,国家工业化运动席卷了前苏联及东欧各国,带来了高增长、高速度。但在高速增长的同时,发展很不稳定。尤其进入 60 年代以来,各国经济动荡和阶段性经济困难日益明显。70 年代末,苏联和大部分东欧国家陷入经济危机。东欧学者从 50 年代就开始了社会主义经济周期的研究。如波兰经济学家卡宾斯基、切林斯基、兰格,苏联学者诺特金、哈维尼,捷克学者戈德曼、库巴、夫莱克,南斯拉夫学者霍尔瓦特等。他们的见解尽管有所不同,但都贯穿一个基本思想:传统的集中计划体制和发展战略是造成周期性失衡、阶段性增长“瓶颈”以及隐蔽性通货膨胀和失业的根源。东欧学者的研究中,以下一些见解对我们具有现实的启迪作用。

(1)纯循环。纯循环分析是一种抽象出技术因素和体制影响的自然循环分析。它仅就生产力因素引起的涨落来分析其循环规律,

研究经济周期的一般动因。这一研究的代表人物是波兰的卡莱茨基。他指出,人们在分析内涵方式的增长时,往往忽视效率的递减,看不到内涵的极限,夸大了内涵效率的作用。70年代以来,前苏联、东欧国家为了扭转投资效率下降的趋势,力图以内涵的发展方式取代粗放的发展方式,在投资与其它要素恰当组合时,可以短期见效,但这不过是在长期下降曲线中的阶段性高峰而已。

(2)短缺均衡波动。所谓短缺均衡波动,是指经济变量对短缺均衡体系的不断偏离、回归的周期运动,是计划经济中的“正常状态”。提出这一论点的学者是匈牙利的科尔内。他的研究表明,计划经济中的周期波动,可以概括为短缺均衡波动。这是由于传统集中计划体制下供给与需求的长期关系决定的。这一长期关系的特征为:总需求总是过大;供给曲线弹性不足;主要靠指令实施调节等。

(3)滞胀螺旋。在社会主义计划经济的周期运动中,也可以发现滞胀。在传统体制下的计划经济中,经常是资源短缺与隐蔽性通货膨胀并存、在职失业与隐性膨胀的互相推进,酿成特种滞胀局面。在引入市场机制之后,滞胀将化为公开性的。如果缺少必须的约束机制,如货币投放过多、投资失控,加之不合理的微观行为,就会出现一个奔腾的螺旋式的膨胀。这将预示着危机的到来。南斯拉夫的滞胀就是一个实证。

(4)超振危机。危机是指经济比例严重失衡,或产生超常剧烈振荡。当经济波动超出一定界限时便酿成危机,就是超振危机。东欧学者认为,有三个增长“瓶颈”:资源“瓶颈”、消费“瓶颈”、外债“瓶颈”。一旦突破颈口,必定爆发危机。这三条界限具体地表明了社会主义国家经济危机的边界。严重的失衡危机在计划经济中可分为两类:其一为显性危机;其二为隐性危机。80年代初东欧六国的周期性经济危机,统计表明兼有两类危机的特点。

从以上东欧学者的研究中我们可以得出如下结论:适度增长、

适度短缺、适度待业、适度膨胀、适度波动，应成为社会主义国家计划部门宏观决策的准则；在经济正常运转时期不要过热，当超常振荡来临时刹车勿猛。

通过对前苏联、前东德、匈牙利、波兰四国 1966—1985 年国民收入波动周期和幅度的测算结果表明：经济波动与经济机制状态的关系甚密，经济机制状态影响到经济波动的周期和幅度。例如，前苏联、前东德的经济波动周期和幅度类似，匈牙利、波兰的经济波动周期和幅度类似。前者表现为：经济波动的周期较短，振动幅度较小，没有古典循环存在；后者则相反，表现为：经济波动的周期相对较长，振动幅度较大，并出现过经济大滑坡的现象。以上四国在 1966—1985 年期间，同为计划经济国家，但它们的经济机制又有较大差异，市场成份对经济的调节作用深度各不相同。前两国的经济发展严格受经济计划的控制，是强计划机制国家，经济波动的原因主要是来自投资的变化；后两国在经济机制上表现为市场机制和计划机制的混合存在，是弱计划机制国家，经济波动的直接原因已从投资变化转向消费变化。这一结论对那些进行了经济改革的计划经济国家尚有借鉴意义。

三、我国经济监测预警的历史与现状

我国经济监测预警的理论和方法体系，经历了一个较长的孕育过程，提出较晚，发展较快，当前已成为经济研究和金融研究中的一个十分引人注目的重要课题。随着宏观经济管理和决策需要的不断提高，经济监测预警系统的研究和应用将不断发展。

我国的社会主义计划经济管理体制，是 50 年代从前苏联引入的。当时人们认为社会主义经济发展只有一个规律，即有计划、按比例和高速度发展。国民经济综合平衡是当时经济研究的基本方法。1958 年的“大跃进”及 60 年代初的三年自然灾害，使我国国民经济的发展出现严重比例失调和“低潮”。这与东欧国家此阶段的经济波动相一致。严酷的现实迫使理论界不得不有保留地对原有

理论进行修补,即承认社会经济发展有不平衡现象,提出了波浪式高速度的概念。1961年刘国光等同志关于社会主义经济波浪式发展的分析,就是经济波动问题研究的一次率先尝试。“文化大革命”时期,我国国民经济出现大滑坡,到了崩溃的边沿。党的十一届三中全会奠定了在我国进行经济体制改革的基础。在解放思想、自我反思的条件下,经济理论界打破了许多禁区,提出了一系列新学术思想,为经济体制改革寻求理论上的支持。在这种环境中,才有可能认识并承认社会主义经济发展存在着周期性。1982年,当国民经济进入扩张时,轻工业反而转为收缩;1984年,我国的经济生活中出现了投资失控、消费膨胀;1985年,经济膨胀,景气转折。对于这一系列始料不及的变化,理论界众说纷纭,莫衷一是。80年代后几年的经济波动促使人们在理论研究上大胆突破。一系列实证分析表明,我国经济增长过程中广泛存在着周期性波动现象。前苏联、东欧学者的研究也证明了这一点。可以说,经济增长中的周期性波动,在任何社会经济制度下,在经济发展的各个阶段都可能出现。

在我国,关于社会总供求的概念以及对其监测预警和调控的方法,还在研究探索之中。研究的结果表明:社会总供给与社会总需求的失衡状态,无论在发达的资本主义国家,还是在发展中的社会主义国家都会出现。承认这些超越体制的模式和现象,是我们进行宏观经济监测预警研究的前提。

出于宏观经济管理的需要,必须对经济未来状态的不确定性因素进行预测和预报,从而提出对宏观经济进行监测预警的思想。然而,经济监测预警并不仅仅是一组理论概念,而且包括具体的、科学的方法体系。与经济理论的发展同步,从80年代开始,我国统计理论与方法的研究也开始进入一个新时期。传统的统计方法吸收了新三论、旧三论的营养,吸收了现代应用数学和计算机技术的新成就,理论经济学、数理统计学、经济计量学、投入产出技术的紧

密结合,突变论、耗散结构理论、协同学、系统动力学思想方法的交融运用,为宏观经济监测预警系统的建立解决了一系列方法、技术难题,使这一研究有了可能性。

1985年以来,我国加快了对国民经济运行进行监测预警的研究。我国学者,特别是一批中、青年学者,大胆闯入禁区,使这一研究在理论上取得重大突破,在应用上取得可喜进展。1987年3月,吉林大学系统工程研究所的报告“我国经济循环的测定和预测”通过鉴定;1987年9月,由国家统计局等单位召开了全国统计科学研讨会,中心议题是建立宏观经济监测和预警体系;1988年4月,由中国科学院等单位发起召开了第一次全国性“中国经济周期波动研讨会”,同年10月又召开了第二次会议,在此基础上1990年出版了有关专著《经济周期与预警系统》;1991年8月,北京大学提交了“社会总供给与总需求非均衡警戒线问题研究报告”,对此报告进行扩大和延伸,于1993年出版了有关专著《社会总供求状态的监测、预警和调控》;近年来,一些经济类重要刊物上也发表了诸多从不同角度探讨有关经济监测预警研究的论文。

当前我国的经济监测与预警研究,对于经济监测和预警的对象是国民经济运行系统已取得共识,而在如何确定监测和预警的目标、内容,仍有不同认识。归纳起来,在这个问题上主要有以下几种观点:

(1)以监测社会总供给和总需求的总量与结构平衡为中心,对社会总供求的失衡进行预警,也有人提出以监测社会总供求的增量平衡为重点更好。

(2)以监测经济增长和波动为中心,预报未来经济运行的短期轨迹。因为经济增长和波动是国民经济运行的综合反映和直接结果。经济增长的态势和波动情况可以说明经济运行是否正常。

(3)监测和预警系统首先是对状态的描述,并在经济运行失常之前进行预警。经济运行中的总供求平衡、经济增长和经济波动是