

经济 *jing ji*
guan li xin zhi shi cong shu
管理新知识丛书

● 经济管理新知识丛书

经济监测与经济预警

编著：黎诣远 / 程卫平
湖南科学技术出版社

jing ji

guan li xin zhi shi cong shu

JING JI GUAN LI XIN ZHI SHI CONG SHU

jing ji guan li xin zhi shi cong shu

jing ji guan li xin zhi shi cong shu

这套丛书有明显的特点。它以邓小平同志关于建设有中国特色社会主义理论为指导，以介绍经济管理工作者应当掌握的基本知识为主，侧重于体现实际运用的要求。在内容安排上，以宏观经济管理为主，兼随微观经济内容，并注意满足地方经济管理的需要。在写作方法上，以阐述新知识为主，同时进行必要的比较研究。一本书，一个主题，几万字，三四个晚上就可以读完，很适合于自学使用。

相信《经济管理新知识丛书》的出版会受到广大经济管理工作者们的欢迎！



国 \ 家 \ 计 \ 委 \ 培 \ 训 \ 中 \ 心

98
F123.2
12

2 经济管理新知识丛书

经济监测与经济预警

● 黎诣远 程卫平 编著

● 湖南科学技术出版社

经济管理新知识丛书

经济监测与经济预警

编 著：黎诣远 程卫平

责任编辑：龚绍石

出版发行：湖南科学技术出版社

社 址：长沙市展览馆路 11 号

印 刷：湖南省新华印刷一厂

厂 址：长沙市芙蓉北路 564 号

邮 码：410008

(印装质量问题请直接与本厂联系)

经 销：湖南省新华书店

出版日期：1997 年 11 月第 1 版第 1 次

开 本：787mm×960mm 1/32

印 张：4.125

字 数：66000

印 数：1—3100

书 号：ISBN 7—5357—2302—0/F·268

定 价：6.00 元

(版权所有·翻印必究)

《经济管理新知识丛书》编审小组

组 长：杨世昌

副组长：靳敬敏

成 员：吴 微 宁吉喆

滕四波

序

建立和完善社会主义市场经济体制是一项艰巨而复杂的社会系统工程，是建设有中国特色社会主义进程中的一次伟大实践。在当前国内各领域改革开放不断深入，现代化建设步伐加快，国际政治、经济格局重新组合，各国经济贸易联系日益紧密的新形势下，我国改革和发展的实践不断出现新情况、新问题，要求经济管理工作从理论和实践两个方面给予回答和解决。比如：我国社会主义市场经济的理论基础和目标模式；在市场经济条件下，怎样发挥市场和计划两者的长处和作用，综合运用经济手段和法律手段，辅之以必要的行政手段，对宏观经济进行有效管理；在以市场为基础的经济运行机制下，如何对国民经济发展进行形势分析、预测、监测和调控；如何在经济高速增长的情况下，保持地区经济的协调发展；国际贸易新格局的出现对我国对外贸易和国内经济发展有何影响；我国的国有企业如何增强竞争能力进入国际市场，等等。诸如此类的问题对各级各类经济管理者来说，都是新的课题，许多同志对此并不很了解，有的甚至很陌生。

因此，摆在经济管理工作者面前的迫切任务，就是要重新学习，要解放思想、转变观念、更新和扩充知识。只有掌握了新的知识，才能把新思想、新观念、新方法建立在自觉的、科学的基础之上，才能创造性地做好本职工作。

国家计委培训中心为了推动计委系统培训工作的开展，并满足广大经济管理工作者更新知识的需要，组织有关专家、学者和经济管理部门的领导同志，编写了这套《经济管理新知识丛书》，并且在今后还将不断充实这套丛书的内容，这是一件很有意义的事情。我对这套丛书的出版表示祝贺。

如果从国际范围看，从社会经济发展的历程来看，这套丛书中的某些内容也许不一定称得上是新知识。然而，由于我国原有经济体制的特点，许多经济管理工作者对这些内容很不熟悉，需要重新学习，因此，这些内容也就成为我们所需要的新知识。丛书的作者们对这些知识并不仅限于描述和推荐，而是经过研究、消化，对如何使这些知识适应社会主义市场经济体制和中国国情的基本要求，进行了有益的探索。从这个意义上讲，它们就更具有了新知识的全部涵义。

这套丛书有明显的特点。它以邓小平同志关于建设有中国特色社会主义理论为指导，以介绍经济管理工作者应当掌握的基本知识为主，侧重于体现实际运用的要求。在内容安排上，以宏观

经济管理为主，兼顾微观经济内容，并注意满足地方经济管理的需要。在写作方法上，以阐述新知识为主，同时进行必要的比较研究。一本书，一个主题，几万字，三四个晚上就可以读完，很适合干部自学使用。

相信《经济管理新知识丛书》的出版会受到广大经济管理工作者的欢迎！

陈锦华

目 录

第一章 绪论	(1)
第一节 经济计划、经济预测、经济监 测与经济预警.....	(1)
第二节 经济预测.....	(5)
第二章 中国宏观经济监测预警系统的建立	(17)
第一节 建立宏观经济监测预警系统的 必要性	(17)
第二节 经济波动的四种基本形态	(25)
第三节 景气循环波动成因分析	(31)
第四节 宏观经济监测预警系统框架 ...	(37)
第三章 监测预警指标的选取和数据的预处理	(43)
第一节 选取监测预警指标的原则	(43)
第二节 数据的预处理	(47)
第三节 指标的分类与筛选	(59)
第四节 预警指标体系比较	(64)
第四章 景气分析系统和预警信号系统	(72)
第一节 扩散指数	(73)

第二节	合成指数	(80)
第三节	预警信号系统	(85)
第五章	区域经济波动和企业景气调查	(91)
第一节	我国区域经济波动的特点和 成因	(91)
第二节	区域经济波动的对策和预警 ...	(99)
第三节	企业景气调查.....	(103)

第一章 绪 论

第一节 经济计划、经济预测、 经济监测与经济预警

政府管理经济的首要职能是统筹规划，合理确定社会经济发展的战略、目标和政策。无论传统社会还是现代社会，无论社会主义还是资本主义，也无论计划经济还是市场经济，莫不如此。

从哲学范畴上讲，由统筹规划形成的计划属于意识形态，计划调控属于管理体制，两者都是上层建筑的重要构成，既取决于经济基础，又反作用于经济基础。在理论上，这种反作用可正可负；在实践上，这种反作用也有正有负。这是上层建筑与经济基础的对立统一，任何社会也莫不如此。

建立社会主义市场经济体制是一场涉及经济基础和上层建筑许多领域的深刻革命，计划体制改革是建立健全宏观调控体系的重要方面。为此，以市场为基础的计划管理职能，要进一步实行以下几个转变：

宏观性——在内容上从个量为主转向总量为主；

战略性——在时间上从短期为主转向中长期为主；

市场性——在手段上从直接的指令性计划为主转向间接的指导性计划为主；

科学性——在方法上从传统的经验方法为主转向现代的科学方法为主。

与任何计划工作一样，经济计划也分为制订、实施、调整、总结四个阶段。但与传统的计划方法不同，现代的计划方法都要辅以相应的经济模型：经济预测、经济监测、经济预警、经济评价。一般说来，它们之间具有图 1-1 所示的关系。

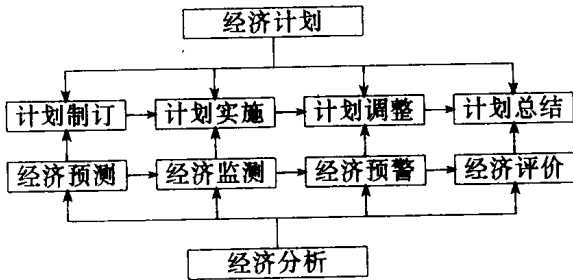


图 1-1 经济监测与经济预警在计划管理中的作用

通过调查研究进行经济分析，是整个计划管理工作的基础。首先，要通过经济模型进行经济预测，即根据各个主要经济因素的内在联系，在一定假设条件之下揭示未来经济发展的可能趋势，然后经过论证、比较、优化，形成经济计划。

从这个意义上讲，经济预测是计划制订的基础。其次，要通过经济模型进行经济监测，即选择若干主要经济指标，监测原订计划的实施情况。由于“人们原定的思想、理论、计划、方案毫无改变地实现出来的事是很少的”，^①通过经济监测就能发现经济发展偏离经济计划的程度。从这个意义上讲，经济计划是进行经济监测的前提。再次，通过经济监测结果的分析，对经济发展中的问题发出警报，并提出相应的对策：如果原定经济计划是正确的，便采取以经济手段为主的各种方法，将经济发展纳入原定经济计划的轨道；如果原定经济计划存在问题，或者出现意外事件，就要根据实际情况及时调整原定的经济计划。从这个意义上讲，经济监测是经济预警的依据。最后，通过经济评价对整个经济计划的实现情况做出全面总结。一方面，要对经济计划实现后的现状（如增长速度、全面发展、经济结构、经济效益、技术进步、收入分配等）通过一定的指标体系进行各方面的评价和综合性的评价；另一方面，要对经济计划工作中的经验和教训做出总结。因此，它既是本期计划管理的终点，也是下期计划管理的起点。

对于本书来说，经济监测和经济预警则是研

^① 《毛泽东选集》第一卷，第294页，人民出版社，1991年第二版。

究经济波动、特别是景气循环这一特定经济现象而建立的一整套方法体系。改革开放以来，我们逐步形成共识：我国不仅存在经济波动，而且不可避免地存在景气循环。因此，中共中央关于建立社会主义市场经济体制若干问题的决定中，将“建立新的国民经济核算体系，完善宏观经济监测预警系统”作为加快体制改革、进一步转变计划管理职能的重要内容，目的就是尽可能“熨平”经济波动。经济监测的主要任务是：通过一套指标体系表明经济运行的状态，判断所处景气循环的阶段或经济发展的冷热程度，有如“监视器”。经济预警的主要任务则是：根据经济监测的结果和景气循环的特点，对经济发展的前景做出超前判断，预先发出警告，以便及时采取对策，有如“报警器”。古语云：“月晕而风，础润而雨”，意即月亮周围出现光环就要刮风，柱子底下的础石湿润了就要下雨。这里，月亮、础石就是监视器；光环、湿润就是报警器。1962年，美国曾经规定：当失业率连续3个月增加，且增加的总幅度超过1%时，政府必须增加20亿美元的公共投资。1972年，罗马俱乐部的成员利用系统动力学模型预测，如果世界经济增长继续下去，到2100年将达到“增长的极限”：由于环境污染，人口过多，粮食不够，资源耗尽，将出现“世界末日”。为此，他们主张实行“零增长”。现在看来，这种监测未必准确，但确实向全世界发出了预警：忽视生态平

衡，人类将面临毁灭，从而提出：“21 世纪是生态平衡的世纪。”

由此可见，经济监测和经济预警也是一种经济预测，或者是经济预测的分支。从历史发展来看，也是先有经济预测，后有经济监测和经济预警，而且后者所用的模型方法，也是经济预测中不断发展起来的模型方法。因此，本章作为基础知识将首先介绍经济预测的 ABC，以下各章再详细介绍经济监测预警系统。

第二节 经济预测

一、经济预测是计划制订的基础

在管理科学中，计划属于决策。正确的决策必须依靠科学的预测。尽管计划和预测都面向未来，都要对经济发展的历史和现状进行科学分析，也采用某些相同的方法，但两者所要解决的问题是不同的：计划是对未来的部署，包括未来经济发展的任务和目标，实现目标的途径、手段、步骤等；预测则是对未来的描述，根据经济因素之间固有的规律性，在一定的假设条件下揭示未来经济发展的可能趋势。简单说来，计划要回答的问题是：应当怎样，必须怎样；预测要回答的问题是：如果这样，将会怎样。众所周知，社会科学不可能像自然科学那样在实验室进行重复实

验，但通过不同的假设条件，预测可以大致描绘社会经济的可能前景。因此，人们通常将经济预测称作“社会实验室”，它可以为计划提供必要的科学依据。

制订计划不仅要从小经济预测入手，而且在制订计划的各个重要阶段，都要不断运用经济预测提供依据，寓经济预测于计划制订的全过程。例如：根据经济发展未来趋势的预测，确定计划期的任务和目标；根据各种不同可能前景的预测，提出多种计划方案；根据经济发展中的专项预测，对计划方案进行论证；根据各种预测参数的比较、优化，做出计划决策；等等。如图 1-2 所示。所以，经济预测是计划制订的基础，它直接影响着经济计划的准确性和可靠性。

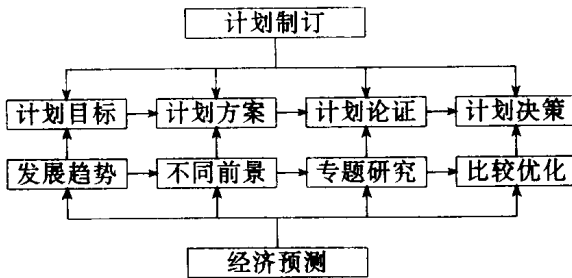


图 1-2 经济预测寓于计划制订的全过程

然而，经济预测并不等于计划方案，更不能代替计划决策。这是由于：经济模型只能选择主要的易于量化的经济因素，而舍弃其他次要的、但并非不重要的因素；经济模型只是包括经济因素，

而难以反映政治体制、思想文化、伦理道德等对社会经济发展具有重大影响的各种非经济因素；经济模型总是根据一定假设条件而构成的，这些假设条件未必完全符合实际。因此，最好的经济预测也只能为计划提供依据，而不能直接成为计划。也就是说，充其量，预测只能当参谋，而不能当司令。制订计划必须在经济预测的基础上，综合地全面分析一切重要因素，最后形成计划决策。

我国古代很早就认识到预测的重要性。“凡事预则立，不预则废”，“人无远虑，必有近忧”，这些脍炙人口的格言，都是明证。而“借东风”、“空城计”、“水则资车，旱则资舟”，则是根据预测作出的决策。改革开放以来，我国借鉴西方的现代预测方法，大部分综合部门、产业部门和省、市、自治区都建立了预测机构，预测日益成为制订计划的重要环节。1990年3月，国家统计局通过模型预测，指出若按当时确定的基本建设规模，当年的经济增长率将为0；如果基本建设投资增加10%，大体上可以保持5%的增长速度。国务院总理办公会议很快采纳这一建议，立即增加400亿元固定资产投资，使当年的经济增长率达到4.2%。

二、经济预测的方法论

在我国的学科分类中，经济预测属于经济学科下数量经济学的应用，是经济学与统计学、数

学、计算机技术相结合的交叉学科。如图 1-3 所示。

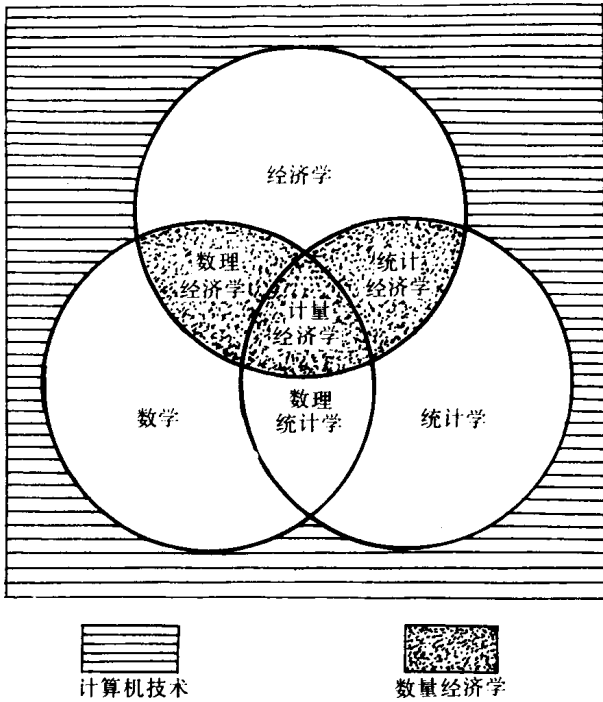


图 1-3 经济预测的方法论

现代经济学是在一定社会条件下，研究如何优化配置可供选择的有限资源，以求得人民无限需要的最大满足。它从错综复杂的经济现象中抽象出一些内在的规律，是搞好经济预测的理论基础。

经济学与数学的结合，形成数理经济学。数理经济学是用数学方法研究经济学，而不是研究