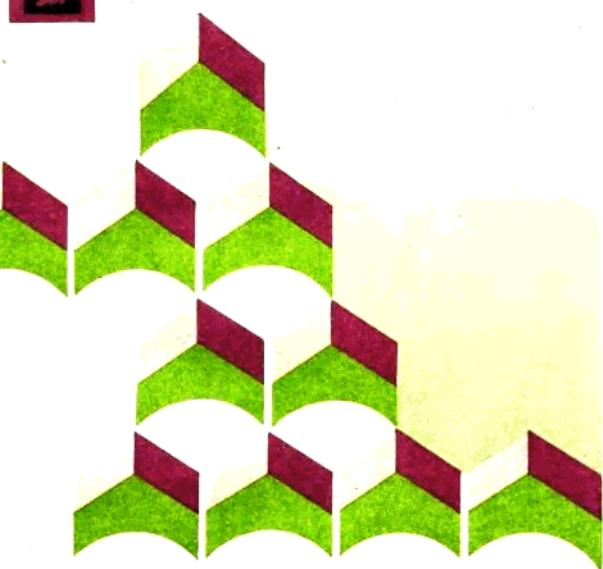


振兴龙江研究丛书



波动与发展

—黑龙江省经济波动研究

许明达 刘幸 主编

黑龙江教育出版社

目 录

导 言	1
第一章 经济波动的一般机理	3
第一节 经济稳定态的涵义	3
第二节 经济稳定态与价格变动	8
第三节 总量失衡和经济波动	12
第四节 经济波动的内生因素和外生变量	23
第二章 黑龙江省经济波动实证考察和比较研究	30
第一节 黑龙江省经济波动与全国经济波动的比较	30
第二节 黑龙江省经济波动与其它省份比较	35
第三章 从产业的视角看黑龙江省的经济波动	48
第一节 黑龙江省经济波动为典型的工业或 重工业主导型波动	48
第二节 工业各行业的波动普遍趋缓的趋势 与黑龙江省经济波动变小的趋势相一致	51
第三节 黑龙江省农业对经济波动的影响力 大于全国	65
第四节 建筑业的波动明显地表现出黑龙江 省经济波动从牵动到被动的过程	70
第五节 商业和运输业的波动越来越明显地 表现出游离于总量波动的倾向	73
第四章 黑龙江省经济波动特殊轨迹的成因分析	81
第一节 摇椅装置失灵,是造成黑龙江省经 济波动大的重要原因	81
第二节 产业结构的大跨度变化是造成大	

	波幅的另一个重要原因·····	84
第三节	资源的强度开发也是造成大波幅 的重要原因·····	85
第四节	黑龙江省的经济波动较多地受到 第二外生因素区的影响·····	88
第五节	近十年来,黑龙江省经济波动趋 势的减弱是由多种因素造成的·····	89
第五章	在积极的、健康的经济波动中发展龙江经济·····	95
第一节	保持经济的适度增长·····	96
第二节	充分利用积极性波动因素,使经济 发展呈台阶式上升·····	106
第三节	充分发挥技术进步在经济波动中的 双重作用·····	109
第六章	黑龙江省经济波动预警系统·····	111
第一节	预警的含义及技术要点·····	111
第二节	模型设计·····	113
第三节	模型检验·····	120
第七章	建立具有中国特色的经济运行机制·····	132
第一节	市场和计划的特点及其结合的必要性·····	133
第二节	市场机制和计划机制的生长轨迹·····	137
第三节	从轨迹中得到的启示·····	146
第八章	黑龙江省经济在波动中上台阶的思路·····	148
第一节	我们对经济上台阶的理解和认识·····	148
第二节	黑龙江省经济所面临的新台阶·····	149
第三节	黑龙江省经济上台阶的有利条件和 制约因素·····	153
第四节	黑龙江省经济上台阶的操作要点·····	158

导 言

我国经济增长过程中广泛存在着周期性的波动现象。这种现象是各种内部和外部的因素互相牵掣、交织作用的结果。它是一个容易感觉到，但难以解释清楚，特别是难以作量化解释的问题。也许是由于这个原因，经济波动的研究仍处于基础理论的探索过程中，进入应用研究或决策咨询的为数甚少。

《波动与发展——黑龙江省经济波动研究》，顾名思义，是一本着眼于区域经济、带有应用性质的专著。我们研究这个题目，并非有“明知山有虎，偏向虎山行”的胆识，而是因为经济运行的现实使我们产生了一种紧迫感。

——经济波动可分成多种类型。有些具有积极意义，有些则属于消极性波动。而要克服经济波动的消极影响，各项经济政策的出台都应在预测的基础上领先一步。如果我们对经济波动的规律和趋势没有相当程度的了解，头痛医头，脚痛医脚，让经济波动牵着鼻子走，就谈不上管理和决策的科学化，经济波动的消极影响也不可能得到有效的控制。

——改革开放以来，各省区的经济波动与全国的波动出现了明显的差异，这表明地方政府控制经济波动的责任正在加大。为了胜任这项工作，需要认真地总结一下区域性经济波动的历史经验。

——经济波动反映着经济运行中的种种问题。通过对我省经济波动的研究，可以揭示其中的矛盾，以便有的放矢地进行工作，促进经济发展。

总之，研究经济波动是宏观调控的迫切需要，是一个具有长远、战略意义的课题，也是一个迟早要搞，晚搞不如早搞的课题。抱着这样的心态，我们开始着手黑龙江省经济波动的研究。

这项研究开始是分两条战线进行的，一方面对已有的经济波动理论加以概括、提炼，并由此形成我们独特的理论假说。另一方面，对黑龙江省四十年来的经济波动进行了一次系统的描述。在此基础上，我们把理论和实践结合起来，对黑龙江省经济波动特殊轨迹的成因作了分析，最后我们对如何正确处理和调节经济波动提出了一系列观点。其中有些观点曾长期被理论界和经济管理者所忽视。

在探索和研究的过程中，我们更加深切地感觉到，要想真正打开经济波动这个“黑匣子”，需要作长期的努力。我们这个研究只是一个起步，而且可能是笨拙的起步。但我们相信，科学研究的成功之路需要有不成熟的甚至是失败的思维作为铺路石。

第一章 经济波动的一般机理

一百多年来，经济波动像一个捉摸不定的幽灵，以始料不及的力量控制着经济的运行。众多的经济学家对此进行了长期艰苦的探索，形成了繁杂混乱的种种解释。其中西方经济学的解释偏重于在总量平衡中找原因，缺乏对结构均衡的分析，并明显地表现出唯心主义的成份。马克思虽然对资本主义的经济危机作过深入的分析，但没有预料到初级阶段的社会主义还存在着商品经济，因而也想象不到经济波动会超越资本主义制度而存在。我们还找不到一个现成的成熟的经济波动理论来指导黑龙江省经济波动的研究。这里，我们站在前人的肩上，吸纳古典的和当代的各种波动理论，分析经济波动的成因和机理，作为本书研究的始端。

第一节 经济稳定态的涵义

经济波动的相反形态是经济稳定，研究经济波动，首先要了解经济稳定的涵义。而要解释这个问题，又得从供给和需求的平衡谈起。

供给和需求，是国民经济运行中的两个基本方面，供给是指“处在市场上的产品，或者能够提供给市场的产品。”^①需求则是市场产品有支付能力的购买要求。供给和需求，构成了国民经济

^① 《资本论》第三卷 第208页。

济连续不断的运动。国民经济的稳定态，就是指供给与需求相平衡的状态。

按通常的统计方法，总供给和总需求的平衡，可分别从狭义和广义两个角度来考察：

狭义的社会总供给是指社会净产值，即国民收入，在价值上等于劳动者的原始收入和社会纯收入，在实物上等于本期新生产的全部消费资料和扩大再生产用的生产资料。狭义的社会总需求是指在一定的支付能力条件下社会消费需求和净投资需求。从国民收入来考察的总供给和总需求的平衡关系如下：

$$\begin{array}{l} \text{全部消费} \quad \text{扩大再生产的} \\ \text{资料的供给} \quad + \quad \text{生产资料的供给} \end{array} = \text{社会消费需求} + \text{净投资需求}$$

广义的总供给包括本期全社会所生产的全部消费资料、用于扩大再生产和旧设备更新的生产资料，以及来自国外的对消费品供给、投资品供给和进口。广义的社会总需求包括本期全社会为了满足生产、生活的，有支付能力的投资需求、消费需求，以及出口需求。因此总供给和总需求的平衡关系如下：

$$\begin{array}{l} \text{消费品} \quad \text{投资品} \\ \text{供给} \quad + \quad \text{供给} \end{array} + \text{进口} = \text{消费需求} + \text{投资需求} + \text{出口}$$

移项：

$$\begin{array}{l} \text{消费品} \quad \text{投资品} \\ \text{供给} \quad + \quad \text{供给} \end{array} = \text{消费需求} + \text{投资需求} + (\text{出口} - \text{进口})$$

总量平衡的实质就是总支出（E）等于总收入（y）。实现这个等式，意味着全体人民有计划地支出了一个等于收入的量，也意味着生产的商品数量完全等于所需要的商品数量。在西方经济学中，这一现象被称为均衡收入，均衡收入可以用一个简单的图式表达。图1—1中画了一条线，在这条线上可以找到支出（以

纵轴表示) 等于收入 (以横轴表示) 的所有可能点。它是一条始于原点的 45° 直线。从线上的任何一点, 如A点出发, 就可以在支出轴和收入轴上, 得到支出和收入的相等量——在A点时, 各为15000亿元。在实际经济运行中, A点不是任意确定的, 而是由支出决定的, 我们假定, 支出(E)由总消费(C)和总投资(I)两部分组成:

$$E = C + I$$

我们还假定消费完全受收入水平本身决定, 如果收入低, 各家庭所消费的就少; 如果收入很高, 则消费就很多。为了进一步简便起见, 又假定工商业愿意投资的数量不受当时的收入水平和先前投资造成的资本总量的影响。所以, 在任何收入水平上, 投资水平都是一样的。

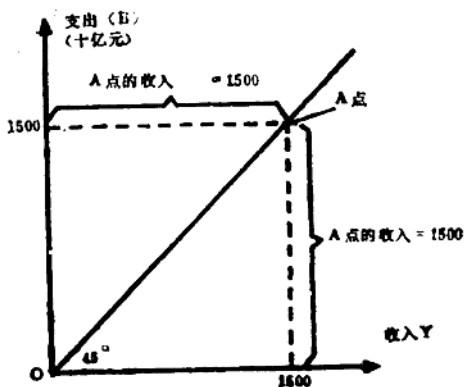


图1-1 45° 线

这些假定在图1-2中得到了表达, 它的纵轴表示总支出(E), 横轴表示总收入(Y)。消费线(C)表示经济中总收入增加时消费支出的水平上升。应当说明, C线与支出轴(E)的交点是正值。这说明即使收入暂时降到零, 人们仍要消费某些东西——

也许是靠动用他们的储蓄。消费线上方与消费线保持等距离的另一条线，是代表投资加消费 ($C+I$) 的直线，两条线之间的差额就是固定水平的投资 (I)。所以， $E=C+I$ 线表明了经济中总支出和总收入各种可能的结合点。

收入水平为多少时，国家经济处于均衡呢？当我们把这两个

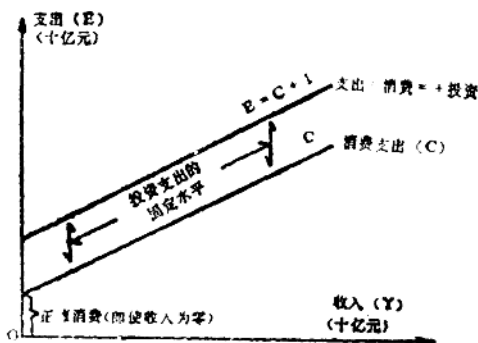


图1—2 不同收入水平上的消费支出和投资

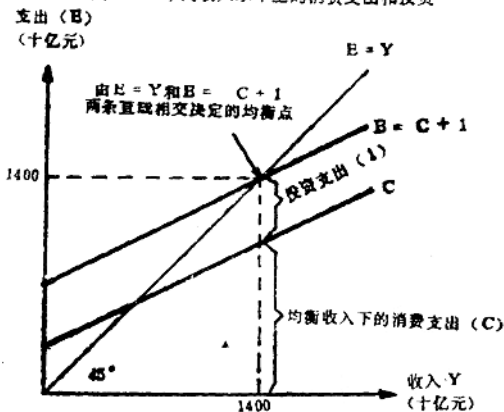


图1—3 支出等于收入时的均衡收入

图结合在一起时（如图1—3），就可以找到这个问题的答案。图中 $E = C + I$ 线与 $E = Y$ 线（45°直线）的相交点就是经济的均衡点。这是各种不同收入水平产生的总支出（如 $E = C + I$ 线给定的）与收入水平（如 $E = Y$ 线给定的）相等的唯一的交点。从这个交点向两轴引两条直线，我们可以得出：均衡收入水平为14000亿元，均衡支出水平（投资加消费）也是14000亿元。总需求没有变化，因为收入14000亿元会引起同等数量的支出。

如果收入没有达到均衡水平，会出现何种情况呢？图1—4有助于回答这个问题。

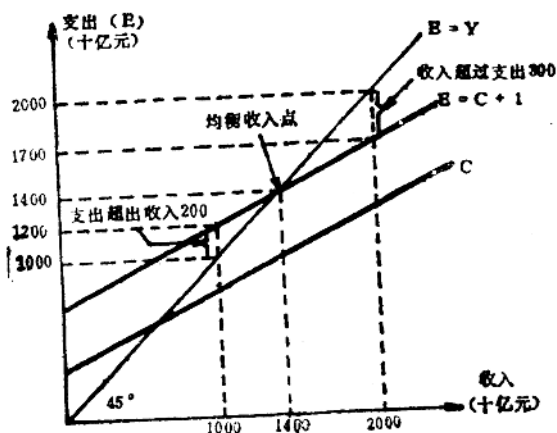


图1—4 偏离均衡收入

首先分析一下实际收入高于均衡水平的情况。比如，实际收入是20000亿元，而均衡收入是14000亿元，如果我们把收入轴的垂直线向上移到20000亿元，我们就可以看到，表示实际总支出的 $E = C + I$ 线仅仅达到17000亿元的水平，而 $E = Y$ 线则处于20000亿元的全部收入水平。所以，就产生了一个3000亿元的差额（如括号所示），这是因为收入为20000亿元时所引起的消

费和投资总支出没有达到与收入水平相等的数量。这种收入水平不可能保持住，因为收入产生出较低水平的支出，反过来会导致收入水平的下降。总需求也将持续下降，并且引起总供给和总需求的波动，直到收入趋近到 14000 亿元为止。在这个水平上，收入就会产生同等数量的支出。

其次，我们来看看收入水平低于均衡水平时的情形，比如，在收入为 10000 亿元时，从收入轴引出的直线表明，实际的支出水平为 12000 亿元。（图中括号说明， $E = C + I$ 线超过 $E = Y$ 线 2000 亿元）。10000 亿元的收入将会产生出 12000 亿元的支出，导致了需求循环流量的增加，进而引起收入的增加。这种趋势将一直持续下去，直到收入达到 14000 亿元的均衡水平为止。

所以，不管我们是从收入大于均衡水平，还是从小于均衡水平开始，经济总会有向均衡靠拢的趋势。在图中，只有均衡收入为 14000 亿元时，由收入产生的总支出才与收入水平相等，进而才能使收入水平趋于稳定。

第二节 经济稳定态与价格变动

在商品经济中，总量的平衡和失衡必然要鲜明地表现在价格和价格水平的变动上，因此，考察价格和价格水平的变化可以使我们进一步理解什么叫经济稳定态或总量平衡。

由于总供给和总需求是由各种物质产品和生产性劳务组成的，因此要考察总物价水平还必须从个别商品的供给价格和需求价格谈起。按照西方经济学的理论，在假定其它因素不变的前提下，供给量将随着价格的涨落而增减，数量与价格是正方向变化。即价格较高（或较前上升），相应的供给量就较多（或较前增加），价格较低（或较前下降），相应的供给量就较少（或较

前减少)。同时,按照边际效用论,在假定消费者的货币收入、爱好等不变的条件,当该种商品价格较低或较前下落时,消费者相应的需求量则较大或较前增加,价格越低,需求量越大;价格较高或较前上涨时,消费者相应的需求量则较小或较前减少,价格越高,需求量越小。这样,供给和需求互相影响,互相冲击、互相制约,形成了均衡价格和均衡数量。

所谓均衡价格,是指一种商品的需求和供给处于均衡状态所形成的,在没有外部力量影响时不会自行变动的价格。亦即一种商品的需求价格和供给价格相一致时的价格。它是买主和卖主都

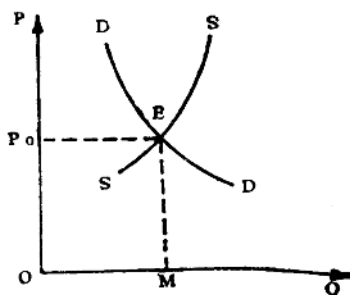


图1—5 均衡价格

愿接受的价格。在图形上,均衡价格水平与需求曲线和供给曲线的交点相对应,即图1—5中的 OP_0 。均衡数量是指供给和需求达到均衡状态时的供、求量,即供给量和需求量相一致时的数量。同样,均衡数量水平也与需求曲线和供给曲线

相交之点相对应,即图1—5的 OM 。需要指出的是:当E点成为供给和需求的均衡点时,市场并非停止交换活动。相反,卖者连续不断地向市场输进商品,买者也连续不断地从市场购进商品。但是,商品的价格和数量这两个变量没有发生变动,用西方经济学的话来说,市场处于均衡状态。

不同的理论体系对均衡价格有不同的解释。西方经济学用人的欲望或物品的效用来解释这一现象,这就使科学变成了臆想。如果我们把小轿车的价格均衡点和一斤大米的价格均衡点放在一个座标中,则可以发现,两者均衡点的高度要相差千万倍。正如马克思指出的“市场上现有商品的数量和它们的市场价值之间,

没有必然的联系。例如，有些商品的价值特别高，另一些商品的价值特别低，因而一定的价值额可以表现为一种商品很大的量，也可以表现为另一种商品的很小的量。”^① 我们显然无法用欲望的强弱、稀缺的程度和边际效用的高低来解释轿车和大米的价格差异。

马克思的劳动价值论才能说明这一现象，马克思主义认为，商品价格是劳动价值决定的。在社会化大生产中，这种劳动价值又表现为生产成本加平均利润率。这样，我们可以很容易地理解，E点之所以达到 P_0 的高度，是因为 $E = P_0 = K + P$ 其中K表示生产成本，P表示平均利润率。E点是供给者所承认的最低价格。低于E点，生产者就会因为得不到平均利润而停产、转产。E点也是消费者心甘情愿支付的价格。高于这个价格，消费者就会在交换中失去一部分本来属于他的劳动。如果市场价格高于均衡价格而处于 OP' 的位置上，则供给者愿意供给 OM' 的商品，而消费者只能购买 OM'' 的商品。其时将出现剩余供给 $M'M''$ 。

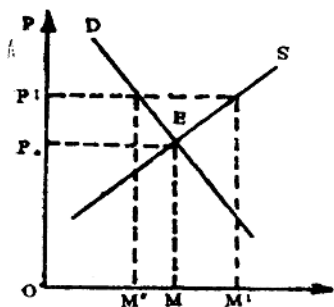


图1—6 偏离均衡价格的一种情况

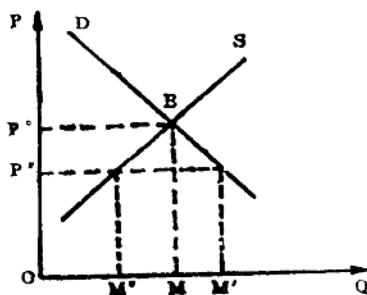


图1—7 偏离价格的另一种情况

反之，如果市场价格在 P'' 的位置上，则消费者愿意购买 M' 数量的商品，而生产者又愿提供 M'' 的商品。则需求量大于供给量

^① 《资本论》第三卷 第208页。

为M' M''，这将导致供给价格上升，而消费量减缩，最后相交于E。

现在我们可以看出，均衡价格是价值规律发生作用，价格等于生产成本加平均利润率的价格。所谓供求平衡，实际上就是指，“某个生产部门的商品总量能够按照它们的市场价值出售，既不高，也不低”，^①或者反过来说，“当商品能够按照它们的市场价格出售，供求就是一致的。”^②

上面介绍的只是个别商品的均衡。现在我们再讨论一下总供给和总需求的平衡。总供给和总需求的平衡只是各种商品和劳务供求一致的集合。在图1—8中，横轴表示各种不同物品和劳务的

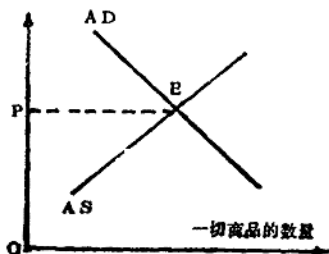


图1—8 总量平衡

总量。由于这个总量中每一种物品和劳务都有它自己的价格，所以纵轴表示的是总物价水平，或者说是横轴所示的全部物品和劳动的集合量的价格加权平均数。

图1—8中的曲线分别表示总供给量（AS）和总需求量（AD）。这两条曲线在形式上与个别商品的均衡价格相似，但内容要广泛得多。两条曲线相交的E点显示总供给量和总需求量相等时的物价水平或平均价格。象单个商品的情况那样，任何高于或低于交叉点所示的物价水平，都意味着失衡。物价水平高时，总供给量就要超过总需求量，物价水平就趋向下降，以达到均衡；物价水平低时，情况相反，总供给量低于总需求量，物价水平就趋向上升，以达到均衡。

①② 《资本论》第三卷 第211页。

图中交叉点E的含义是，当总物价水平处于P的位置时，全部收入正好等于支出。当经济运行实现这一点时，各种商品都能在价值上得到实现，在实物上得到补偿，从而处于良好的运行状态。

第三节 总量失衡和经济波动

在商品经济中，价格与价值相等是一种极为罕见的现象，同样的，供给和需求的平衡也是一种少见的现象。马克思说过：“供求实际上从来不会一致；如果它们达到一致，那也只是偶然现象，所以在科学上等于零，可以看作没有发生过的事情。”^①可见，供求平衡和价值规律中价格与价值的相等一样，只能作为一种抽象的趋向而存在，它不是现实的存在。

那末，经济失衡与经济波动有什么联系呢？这里，我们来分析一下商品经济运行中的摇椅现象。

所谓摇椅现象，是指当摇椅受到外力作用后，会出现来回摆动，摆幅变小，最后恢复静态。

经济运动也是这样，当供给和需求失衡后，经济并非一下子就回到均衡点上，相反，它是经济反复摆动后再回到均衡点上的。

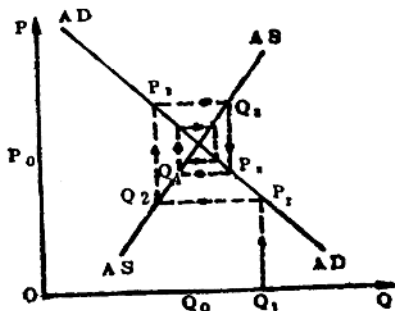


图1—9

所谓摇椅现象，是指当摇椅受到外力作用后，会出现来回摆动，摆幅变小，最后恢复静态。经济运动也是这样，当供给和需求失衡后，经济并非一下子就回到均衡点上，相反，它是经济反复摆动后再回到均衡点上的。

图1—9中AS和AD分别代表总供给曲线和需求曲线，二者的交点代表总供给量与总需求量相等时的物价水平。倘

① 《资本论》第三卷 第212页。

若由于某种原因，总供给为 Q_1 ，同期产品的成交价格或购买 Q_1 所形成的价格水平 P_1 小于均衡价格水平，这个价格水平导致生产者在第二生产周期减少商品生产，如图示生产者愿为此价格提供的数量减少到 Q_2 。由于供给减少，在第二生产周期，产品 Q_2 所形成的价格水平为 P_2 ，大于均衡价格水平，因而导致生产者决定在第三生产周期增加生产，以致第三生产周期供应量达到 Q_3 ，而产品 Q_3 所形成的价格水平为 P_3 ，再次小于均衡价格水平。这样，又导致生产者决定在第四生产周期把产量减少到 Q_4 ，如此继续下去，最后实现均衡价格。在这个过程中，市场实际成交价格不是高于就是低于均衡价格水平。高于均衡价格水平时，将导致下一生产周期的供给超过需求，并导致下一生产周期的实际成交价格低于均衡价格；低于均衡价格时，就要导致下一生产周期需求超过供给，从而又导致实际成交价格上升，高于均衡价格水平。如此变动而达于均衡。

这里顺便说明一下，为叙述方便，图中虚线的变动均为直角。实际上，当商品生产者对经济运行规律比较了解时，特别是当国家对经济实行干预时，它很可能是一个锐角，从而可以加快向均衡点 E 靠拢的趋势。

在单位商品的均衡中，商品产量之所以会发生波动是由商品生产者根据价格变化而决策的结果。那末在经济总量的均衡中，为什么摇椅不能一下子回到均衡点上呢？总量的波动并不是各个商品生产者共同协商的结果，而是因为经济运行存在着一个相互牵制的关系，一个小小的力会通过一连串因果关系而以夸张的形式表现出来，而使经济在向均衡方向变化时，会不由自主地越过均衡点然后再向回摆动。能够证明摇椅装置的最典型的理论是乘数加速原理。它可以从供给和需求投入和产出的一连串的变化中显示这种摇椅运动的必然性。

在阐明乘数加速原理之前，先解释下列概念：

(一) 自发投资和引致投资

1. 自发投资。指一种外在的投资。不受国民收入或消费变动的制约。例如，由于心理方面的原因，政治方面的原因或生产技术进步引起的投资。自发投资是使摇椅进入摇摆状况的原始力。

2. 引致投资。指由于国民收入或消费变动引起的投资。例如，收入增加了，投资也会增加，这样的投资就叫做引致投资。

(二) 消费倾向、积累倾向

1. 消费倾向

消费倾向是指消费在收入中所占的比例。它可分为平均消费倾向和边际消费倾向。二者从不同角度描述消费与收入的关系。

(1) 平均消费倾向

平均消费倾向就是国内常说的消费率。它是某一时期的消费额在收入中所占的份额。记消费率为APC，则

$$APC = \frac{C}{Y}$$

(2) 边际消费倾向

边际消费倾向反映收入水平发生变化的情况下，消费在其变动部分中所占的份额。记边际消费倾向为MPC。则

$$MPC = \frac{\Delta C}{\Delta Y}$$

其中， ΔC 、 ΔY 分别表示C与Y的增量

(3) 平均消费倾向与边际消费倾向的几何图示

用横坐标轴表示收入Y，用纵坐标轴表示消费C，曲线 $C = f(y)$ 是消费函数。曲线上任一点 (Y_0, C_0) 的纵坐标 C_0 与横坐标 Y_0 之比，即为平均消费倾向。

$$APC = \frac{C_0}{Y_0}$$