

陈湛匀 三好慎一郎 著



财政赤字、通货膨胀 与宏观经济监控研究

CAIZHENG CHIZI TONGHUO PENGZHANG
YU HONGGUAN JINJI JIANKONG
YANJIU

上海社会科学院出版社

财政赤字、通货膨胀 与宏观经济监控研究

陈湛匀 三好慎一郎 著

上海社会科学院出版社

责任编辑 范健平

封面设计 邹越非

财政赤字、通货膨胀与宏观经济监控研究

陈湛匀 三好慎一郎 著

上海社会科学院出版社出版

(上海淮海中路 622 弄 7 号)

新华书店上海发行所发行 上海社科院印刷厂印刷

开本 787×1092 1/32 印张 6.625 插页 1 字数 140000

1991 年 4 月第 1 版 1991 年 4 月第 1 次印刷

印数 1—2000

ISBN7—80515—640—9/F·202

定价: 3.00 元



陈湛匀（中国），88级在职博士生，1986年已获硕士学位。除了进行不少课题研究和教材编写以外，在学术刊物上发表论文和译文数十篇，涉及学科领域较广，尤其对经济领域理论问题和实际问题提出颇有独特的见解，并先后数次获优秀论文奖，最近发表他的学术专著有《财政赤字、通货膨胀和宏观经济监控研究》、《现代决策分析概论》，发表的学术译著有：《统计学应用指南》等，他还译有《资本与时间》一书正在出版中。



三好慎一郎（日本），博士生，已获硕士学位，在学术刊物上发表不少论文，对中国经济问题颇感兴趣，并作了不少研究。

前 言

我国目前正处于体制转轨关键时刻，而巨额财政赤字和严重通货膨胀已经对改革构成了现实的威胁，尤其前几年在政策制订、实施过程中受到“财政赤字无害论”、“通货膨胀有益论”的干扰，各种经济杠杆作用弱化，预警信号得不到足够重视，导致连年出现总需求超过总供给；财政支出超过收入；银行信用贷款超过存款；货币投放超过回笼；物价暴涨，因此宏观经济失衡已经迫在眉睫。毫无疑义，对这方面进行及时研究和探索，具有重要现实意义。本书分三篇共 11 章。第一篇是财政赤字理论与实践；第二篇是通货膨胀统计分析与监控；第三篇为宏观经济监控系统模式与措施。第一篇主要论述研究了财政赤字；第二篇主要阐述探索了通货膨胀；在综合前两篇的基础上，第三篇分析讨论了整个宏观经济正常运行的监控方法和措施。笔者认为在商品经济条件下，宏观经济过程调节，主要依赖于相互配合运用各种经济杠杆，以价值管理的形式从事宏观经济管理，尤要注意的是财政政策和金融政策是最为重要的宏观经济政策调节手段。它对国民经济产生直接影响，而且在调节宏观经济失衡方面、在应用速度、作用效果和灵活性方面具有很大优势；其次，物价、币值稳定是经济发展过程中宏观经济监控的最终归宿，但是要实现物价、币值稳定，必须实行总供给和总需求平衡，完善金融机制，消除财政赤字，这就要我们研究金融和财政政策及控制通货膨胀

和财政赤字问题。也正是鉴于上述原因,我们觉得有必要将本书分为财政赤字、通货膨胀、宏观经济监控三篇内容展述。还要说明的是,在理论研究过程中,我们重视统计数据和运用定量分析方法,目的是提高实际可靠性程度和监控操作有效性。

限于水平,不妥之处,敬请批评指正。

陈湛匀 三好慎一郎

目 录

第一篇 财政赤字理论与实践

第一章 笼罩全球的财政赤字	(1)
第一节 发达资本主义国家的财政赤字.....	(1)
第二节 发展中国家的财政赤字.....	(9)
第三节 社会主义国家的财政赤字.....	(10)
第二章 财政赤字的内容、成因和弥补方法	(12)
第一节 财政赤字的内容.....	(12)
一、明显的财政赤字.....	(12)
二、隐蔽的财政赤字.....	(13)
三、净财政赤字.....	(14)
第二节 财政赤字产生的原因.....	(16)
一、军费开支剧增.....	(17)
二、经济建设费庞大.....	(19)
三、增支减收.....	(22)
第三节 财政赤字的弥补方法.....	(23)
一、发行内债.....	(23)
二、国外借款.....	(24)
三、银行透支.....	(24)

第三章 财政赤字理论	(26)
第一节 古典学派的财政赤字学说	(26)
第二节 凯恩斯学派的财政赤字学说	(28)
第三节 非凯恩斯学派的财政赤字学说	(30)
一、公共选择学派的财政赤字学说	(30)
二、货币学派的财政赤字学说	(31)
三、合理预期学派的财政赤字学说	(32)
四、供给学派的财政赤字学说	(32)
第四章 财政赤字与经济的关系	(38)
第一节 财政赤字与经济增长和发展	(39)
第二节 财政赤字与价格水平	(42)
第三节 财政赤字与失业	(44)
第四节 财政赤字与资本形成	(46)
第五节 财政赤字与货币供给量	(47)
第六节 我国理财观念的几个问题	(49)
一、财政状况的评判问题	(49)
二、支出原则问题	(50)
三、国民收入超分配问题	(52)
四、公债收入问题	(53)
五、虚假收入问题	(54)
六、赤字的去向问题	(55)
第五章 对我国财政赤字的思考	(57)
第一节 “十年改革”前的财政赤字	(57)
一、国民经济恢复时期的财政赤字	(57)
二、第一个五年计划时期的财政赤字	(58)

三、三年“大跃进”时期的财政赤字·····	(60)
四、“十年动乱”时期的财政赤字·····	(61)
第二节 “十年改革”时期的财政赤字·····	(62)
一、十年改革时期财政赤字的成因·····	(62)
二、十年改革时期财政赤字的特点·····	(68)
三、控制和逐步消除财政赤字的根本途径·····	(75)

第二篇 通货膨胀统计分析与监控

第六章 通货膨胀概念、表现及特点·····	(79)
第一节 通货膨胀概念辨析·····	(79)
第二节 通货膨胀的表现、特点及成因·····	(81)
一、通货膨胀的表现和特点·····	(81)
二、通货膨胀产生的原因·····	(85)
第三节 通货膨胀治理·····	(88)
第七章 通货膨胀观察指标探讨·····	(91)
第一节 传统零售物价指数的利弊·····	(91)
第二节 通货膨胀观察指标·····	(92)
一、赤字型通货膨胀统计指标·····	(92)
二、信贷型通货膨胀统计指标·····	(93)
三、结构型通货膨胀统计指标·····	(93)
四、成本推动型通货膨胀统计指标·····	(94)
五、发展型通货膨胀统计指标·····	(95)
六、外贸型通货膨胀统计指标·····	(95)
七、通货膨胀裂口观测统计指标·····	(96)
八、通货膨胀综合统计指标·····	(96)

九、通货膨胀监测统计报表.....	(97)
-------------------	--------

第八章 通货膨胀的统计控制.....(100)

第一节 通货膨胀预警线确定.....	(100)
--------------------	---------

第二节 通货膨胀统计定量控制.....	(101)
---------------------	---------

一、非参数检验控制法.....	(102)
-----------------	---------

二、正态分布图控制法.....	(104)
-----------------	---------

三、质量控制图法.....	(109)
---------------	---------

四、指数型投入产出表控制法.....	(117)
--------------------	---------

五、弹性控制法.....	(118)
--------------	---------

六、蒙特卡罗模拟控制法.....	(120)
------------------	---------

第三篇 宏观经济监控系统模式措施

第九章 宏观统计监督与控制系统.....(125)

第一节 宏观统计监督与控制.....	(125)
--------------------	---------

第二节 宏观统计监控特性、内容、分类、指标	
-----------------------	--

体系.....	(127)
---------	---------

一、宏观统计监控特性.....	(127)
-----------------	---------

二、宏观统计监控主要内容.....	(128)
-------------------	---------

三、宏观统计监控分类.....	(129)
-----------------	---------

四、宏观统计监控指标体系.....	(130)
-------------------	---------

第三节 西方宏观统计监控法——经济周期指	
----------------------	--

标.....	(134)
--------	---------

一、综合指标.....	(135)
-------------	---------

二、按经济活动过程分类的指标.....	(136)
---------------------	---------

三、扩散指数.....	(136)
-------------	---------

四、美、英、法、德、日五国经济景气指标体系	(137)
第四节 宏观统计监控系统模式	(140)
一、供需总量监测模式	(143)
二、宏观系统分析监测模式	(147)
三、结构比例监测模式	(147)
四、计量经济模型监测模式	(148)
五、相关趋势监测模式	(148)
六、联系平衡分析监测模式	(149)
七、宏观经济动态综合指数监测模式	(149)
八、动态分析监测模式	(150)
第十章 财政信贷宏观预警系统的构想	(151)
第一节 财政信贷、经济系统状态行为变量选择	(153)
第二节 财政信贷经济系统状态变量分类	(155)
第三节 由特征变量寻找财政信贷变化规律	(166)
第四节 财政信贷宏观调控	(169)
一、预判模式	(169)
二、最优判别模式建立	(172)
第十一章 宏观经济监控的内容、政策、措施	(175)
第一节 宏观经济监控内容	(175)
一、经济总量控制	(175)
二、重大比例控制	(175)
三、宏观经济监控方式	(176)
第二节 宏观经济监控政策和措施	(177)

一、宏观财政政策及其控制·····	(177)
二、宏观金融政策及其控制·····	(180)
三、价格政策及其控制·····	(183)
四、收入分配政策和消费基金宏观控制·····	(184)
五、宏观经济政策的有效配合·····	(189)
六、固定资产投资规模控制·····	(189)
七、产业结构调整·····	(196)
八、外债的宏观监控·····	(199)

第一篇 财政赤字理论与实践

第一章 笼罩全球的财政赤字

财政赤字困扰着地球上的每一个角落，经济发达国家有赤字，发展中国家有赤字；资本主义国家有赤字，社会主义国家也有赤字，财政赤字成为每个国家经济生活中的一个重要组成部分。

第一节 发达资本主义国家的财政赤字

几十年来，财政赤字是发达资本主义国家的普遍现象，除挪威因居特殊的环境外，其他主要资本主义国家无一不赤字累累，如表1所示。

表1从横向显示出了发达资本主义国家的财政状况。若按公债依存度即财政赤字占财政支出的比例的高低排列次序的话，意大利为27.4%，希腊为25.7%，比利时为25.5%，加拿大为25.2%，西班牙为24.5%，葡萄牙为23.9%，奥地利为21.1%，日本为20.2%，瑞典为19.8%，美国为14.8%，法国为14.1%，芬兰为11.2%，荷兰为10.6%，丹麦为10.3%，联邦德国为9.1%，英国为4.1%，瑞士为3.3%。从这种排列次序中我们可以看出，在公债依存度在20%以上的

表 1-1 发达资本主义国家的财政收支状况

(单位: 亿美元)①

	收入	支出	余 额	余额占支 出的%	余额占 GNP的%
美国(1986)	8312	9751	-1439	-14.8	-5.5
英国(1985)	1325	1380	-56	-4.1	-1.1
联邦德国(1986)	1653	1159	-106	-9.1	-1.2(1985年)
法国(1986)	1245	1443	-203	-14.1	-3.4(占GDP)
意大利(1985)	1742	2399	-657	-27.4	-14.3
加拿大(1986)	583	780	-197	-25.2	-5.3
瑞士(1984)	95	98	-3	-3.3	-0.3
澳大利亚(1986)	609	318	-67	-21.1	-7.4(1984年)
荷兰(1986)	609	681	-72	-10.6	-7.3(1985年)
比利时(1985)	230	306	-78	-25.5	-10.2
西班牙(1985)	284	376	-92	-24.5	-5.8(1983年)
芬兰(1984)	131	148	-16	-11.2	-3.1
瑞典(1986)	360	448	-89	-19.8	-8.6
挪威(1984)	253	230	23	9.9	4.2
丹麦(1985)	203	213	-10	-10.3	-9.5(1983年)
希腊(1986)	119	161	-41	-25.7	-10.6
葡萄牙(1985)	64	84	-20	-23.9	-7.6

① 青木信治(日):《财政赤字国际比较》,《经济评论》,1986年第11期。

国家中,经济大国占比重较小。换言之,一般来说,经济小国的公债依存度较高。

此外,在表 1 中,唯一的财政盈余是挪威,但这种财政盈余的存在,说它是依赖天时地利也不过分,因此,近年来,挪威因迅速开发北海油田,使其财政收入剧增。但是,在原油的国际价格不断波动的情况下,这种财政盈余存在到底能维持多久,我们不得而知。

如果我们把表 1-1 中的有关数字和表 1-2 《纵向给出的

一些数字资料用从标图表示出来的话,我们不难发现,主要资本主义国家的财政赤字,以第一次石油危机和随之而来的世界性不景气为契机,不断恶化。尤其日本,以财政赤字占年度财政支出规模来看,它是英、美、德、日四国中最严重的国家(见图 1-1)。

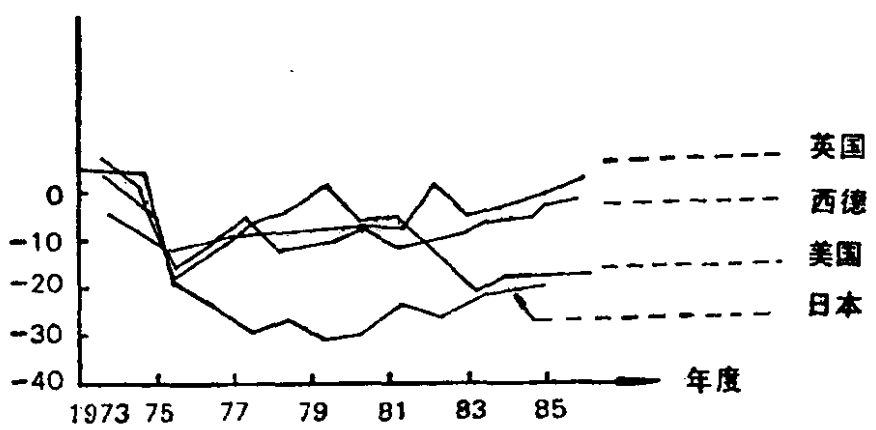


图 1-1 财政赤字占年度支出的比率(%)

进入 80 年代后,美国在“里根经济学”的推动下,其财政赤字占 GNP 的比率超过了日本。在联邦德国和英国顺利地走向经济恢复的过程中,日本和美国的财政赤字却依然如故,甚至更加恶化(如图 1-2 所示)。特别是美国,其财政赤字占私人

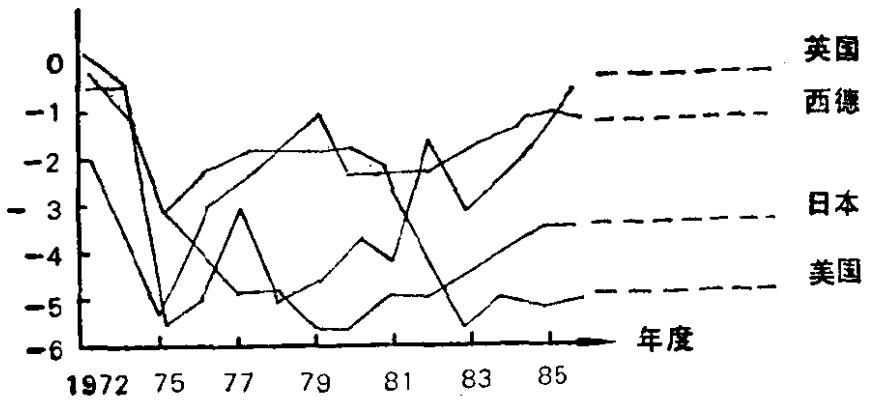


图 1-2 财政赤字占 GNP 的比率(%)

表 1-2 第三世界诸

	岁 出	岁				
		对 内 依 存				
		实际岁入	对 内 债 务			合 计
			内 债	借 款	计	
韩国(1985)	185亿	179亿	4 亿	4482万	4.4亿	183.6亿
台湾(1986)	172亿	157亿			10亿	167亿
菲律宾(1984)	33亿	29亿			3 亿	32亿
泰国(1985)	71亿	59亿				
马来西亚(1985)	97亿	74亿				
新加坡(1985)	75亿	57亿				
印度尼西亚(1985)	207亿	118亿				
印度(1983)	611亿	412亿			156亿	568亿
新西兰(1983)	93亿	73亿			17亿	99亿
澳大利亚(1983)	428亿	389亿			34亿	424亿
伊朗(1984)	464亿	423亿		41亿	41亿	464亿
沙特阿拉伯(1984)	606亿	606亿				606亿
土耳其(1985)	119亿	100亿	11亿	10亿	21亿	122亿
埃及(1985)	247亿	174亿	36亿	16亿	52亿	227亿
阿尔及利亚(1985)	329亿	234亿				
埃塞俄比亚(1983)	16亿	10亿			2 亿	12亿
肯尼亚(1986)	19亿	13亿				
津巴布韦(1986)	21亿	14亿			4 亿	18亿
南非洲(1982)	157亿	157亿			1 亿	159亿

国财政收支状况

(单位: 美元)

入						收 支 结 余		
对 外 依 存					总 计	实 际	实际收入 结余 岁出	(公债依 存度) 实 际债权 债务(一) 余/岁出
对 外 债 务			海外无偿 援助	合 计				
外 债	借 款	计						
		1.3亿		1.3亿	185亿	-5.8亿	-3.1	-3.1
					167亿	-15亿	-8.8	-8.8
				7.595亿	33亿	-3.9亿	-11.9	
					71亿	-12亿	-16.4	
						-23亿	-23.5	
						-18亿	-23.7	
		38亿	6393万	39亿	207亿	-39亿	-19.0	-18.6
		37亿	12亿	49亿	618亿	-198亿	-325	-30.5
		7 亿		3 亿	23亿	-20亿	-21.6	-21.6
		13亿		13亿	437亿	-39亿	-9.1	-9.1
					464亿	-41亿	-8.9	-8.9
					606亿	0	0	0
					122亿	-18亿	-15.7	-15.7
		20亿		20亿	247亿	-73亿	-29.5	-29.5
				94亿	329亿	-94亿	-23.8	
	2 亿		1 亿	3 亿	16亿	- 5 亿	-36.8	-29.4
			6200万		19亿	- 6 亿	-30.6	-27.4
		2 亿	7808万	3 亿	21亿	- 7 亿	-34.0	-30.5
				2 亿	161亿	-3.79万	-0.2	