

中国经济 波动与 监测预警

主编 张泽厚

副主编 石良平 方晓林 罗建国



中国统计出版社

中国经济波动与监测预警

主 编 张泽厚
副主编 石良平
方晓林
罗建国

中国统计出版社

(京)新登字 041 号

中国经济波动与监测预警

ZHONG GUO JINGJI BODONG YU JIANCE YUJING

主编：张泽厚

中国统计出版社出版

新华书店北京发行所发行

北京通县永乐印刷厂印刷

*

850×1168毫米 32开本 16印张 40万字

1992年12月第1版 1993年3月北京第1次印刷

印数：1—2500

ISBN 7-5037-1031-4/F·439

定价：14.50元

前 言

(一)

改革开放给我国带来了繁荣与生机,经济建设上了一大台阶;十四个春秋风风雨雨的历程,为谱写我国社会主义建设的新篇章积累了丰富的理论知识与实践经验。目前,我国改革开放和社会主义现代化建设事业进入了一个新的历史阶段,经济体制改革的目标是建立社会主义市场经济机制,进一步解放和发展生产力。在以市场为取向的改革浪潮中,如何转变宏观经济调控手段以适应市场经济机制的需要,是摆在经济管理工作者面前的严峻任务。毋庸置疑,国家经济管理部门综合运用经济杠杆对市场进行宏观调控,通过市场合理配置资源,从而保持经济总量的大体平衡,避免经济大起大落造成的损失,使国民经济健康发展,需要把握市场经济运行的跳动脉搏,需要了解宏观经济运行的信息,需要对经济信息进行深入加工和系统分析,才能使决策有所依据,成为指导市场经济的科学决策。本书做为社会科学基金资助项目的一项科研成果,是正视这一需要而进行的努力探索。

该项目由国家统计局统计科学研究所牵头,部分省市的一些统计研究机构参加,共同组成统一课题组。课题组总负责人为张泽厚,负责整个课题的组织协调和部分研究工作;课题分片负责人分别为罗建国、石良平、方晓林等同志,负责各片的具体研究实施工作。

该项目1988年开始研究以来,从我国经济运行实状—→运作机理—→理论基础—→目标模式—→实理途径—→操作手段—→实证分析以及国际对比等方面进行了全面研究和反复讨论,在理

论、方法和应用领域内取得了一系列研究成果。本书做为该项课题研究的成果之一,是课题组成员几年来辛勤劳动的集体结晶。它在继承前人研究成果的基础上,结合我国经济改革发展的需要和经济运行的特征,就宏观经济运行状况的分析,对经济运行态势的刻划与评价和经济运行中警情的揭示等方面进行了有益的探索,提出了以经济波动为核心的短期经济监测预警系统的框架和实现手段。它具备理论与实践、宏观与微观、部门与区域等相结合的特点。我们深信,它的问世对建立国家和省(市)二级市场经济调控体系具有一定的参考价值。

(二)

本书分四篇,共十八章。

第一篇为经济波动与监测预警导论。改革开放后,尤其是1984年以来,随着经济循环(周期)这一禁区在我国学术研究领域的打破,对经济循环波动问题的研究日益广泛和深入,并对经济循环在我国宏观经济领域的存在有了共识。当然,这种循环不是机械、呆板的,正是因为如此,所以在循环波动的讨论方面存在一些不同的观点和看法。这并不奇怪,它是研究中的正常现象。本篇围绕经济循环波动的宏观性、经济波动的内在机理和对经济循环波动进行监测和预警的设计框架进行了讨论,为下篇方法与模型的选择奠定了基础。

在第一章中首先提出了经济波动造成的负效应这一严峻问题,接着阐述了经济波动存在的宏观必然性,指出在社会主义条件下经济波动的存在是马克思主义的一个基本观点,简要回顾了我国对经济波动的认识过程以及在认识上存在的差异,总结了新时期我国经济波动的基本特征,最后指出经济波动不仅在当前而且在今后我国经济建设中将长期存在。各国经济的运行机理不尽相同,经济波动也是如此,既有相似之处,也有不同之点。我国经济波动有其自身的内在运行机理。第二章对这一问题作了较为深刻的论述,说明了考察中国经济波动的一个基本理论设定——

特殊类型的非均衡经济，并对资源与需求的约束、政府行为与经济波动的关系做了剖析。经济波动的形态是多种多样的，但它的基本形态只有四种；推动经济景气循环波动的原因也是复杂多因素的，但它的主要因素是能分析清楚的。第三章在对经济波动基本形态和循环波动成因分析的基础上，提出了宏观经济监测预警体系的框架。

第二篇为经济监测预警方法及其模型。经济监测预警也象其他事物一样，有多种实现的途径和多种可供选择的方法，但其效果是不完全相同的，有的甚至相差很大。因此，选择适当的途径和方法获取最佳效果，是本篇所要解决的重要问题。本篇主要围绕经济波动与监测预警方法、指标体系、监测预警模型以及模型的分析与实用情况展开讨论。第四章在归纳总结波动测定方法种类的基础上，阐明了经济波动预警的常用方法和适用范围。指标体系设计是经济波动分析和经济监测预警的重要内容之一，指标选择是否合理与分析方法一样直接影响到分析结果的准确性。第五章，从指标体系设计的内容、原则到筛选方法进行的全面而详尽的论述，阐明了指标在整个分析中的地位和作用，并据此建立了监测预警指标体系，对国际上几个典型国家的经济景气循环指标体系和国际经济循环指标体系作了介绍，最后指出我国在以市场为取向的改革中，建立监测预警体系在政府统计系列中应增设的指标系列。构造什么样的模型来实现分析亦是经济波动分析和监测预警的关键所在。第六、七、八章分别对三种经济监测预警模型的原理、步骤、基本思想和各自应用的优缺点，做了系统的介绍和评述，并阐明了作者在课题研究中的观点。第九章对三大模型做了全面而细致的比较与综合，使读者对三大模型的特点更加明了，在应用中可以针对不同的目的有选择性的加以运用。三大模型各有其自身的特征和侧重面，三者能相互补充和相互验证、但不能完全替代。当然，如何更好地克服三者的缺陷，利用其优势更好地发挥它们在分析应用中的作用，还有待应用者的进一步

挖掘。第十章就八十年代中国经济波动赖以存在的经济环境的变化进行了有说服力的阐述,描述了八十年代中国经济波动的特征,简要论述了九十年代经济波动可能面临的问题和将表现的特征。近几年我国在经济波动的分析中,从实证角度出发讨论的较多,也较为详细,所以本章侧重从另一角度来分析中国的经济波动。

第三篇为经济要素分析,围绕工业、农业、投资和价格四大要素展开深刻的实证分析。工业居国民经济五大物质部门之首,它的波动对国民经济波动起着举足轻重的影响,在一定程度上反映了国民经济波动的特征。第十一章对中国工业经济波动循环的特征、结构、影响波动的要素进行了分析,并对九十年代工业经济波动进行了展望。我国是一个农业大国,农业生产的好坏直接影响国民经济各个部门,所以农业波动对国民经济波动也有着重大的影响。第十二章介绍了有关农业波动的三种外因学说,并据此提出了作者的观点,分析了我国农业循环波动的成因和九十年代农业生产情况,提出了平抑农业循环波动的对策性建议。投资是引发经济波动的最活跃的因素,纵观建国四十多年的经济建设历程,不难看出投资的扩张和收缩与经济的趋热和趋冷存在着高度相关。第十三章描述了投资波动的形态,阐明了推动中国投资波动成因和投资波动对经济波动的正负影响。改革开放以来,随着社会主义市场经济成分的增大,价格的逐步放开,价格开始伴随市场供需关系波动,对经济波动造成了一定的影响。第十四章在描述八十年代我国价格波动阶段性特征的基础上,对推动价格波动的机理做出了分析,并就如何搞好价格的宏观调控提出了建设性意见。

第四篇为经济波动区域实证分析。分别选择了辽宁、上海、河北、江苏和山西五省市进行了实证分析。通过对五省市的分析,可以看出,监测预警的几种方法对区域经济分析是适用的;分析形式不拘一格,各有千秋,为经济监测预警分析提供了多种参照模式。第十九章是通过建立景气调查制度的方法来进行景气分析的,

这一方法有别于第二篇中提出的方法。它是立足于企业对经营前景的判断，通过所确定监测样本点的问卷式调查，对调查结果进行综合处理而做出的经济运行状况的景气判断。本章对企业监测样本点的确定方法、问卷调查表和调查内容等进行了科学的设计，为这一方法的发展提供了有益的前期探索。它的进一步开发、应用和完善还有待我们的继续努力。

此外，我们还编制了《中国经济监测预警分析系统》软件——SEMWA2.0，以供社会各经济管理部门应用。

(三)

本书是集体研究和共同创作的成果，各章执笔分工如下：

张泽厚	前言		
方晓林	第一章	第九章	
陈玉光	第二章	第十章	
石良平	第三章	第四章	第八章
罗建国	第五章	第六章	
李献唐	第七章	第十五章	
蔡旭初	第十一章	第十六章	
朱震葆	第十二章	第十八章	
刘向耘	第十三章		
杨景祥	第十四章	第十七章	
上官炜星 } 赵季明 }	第十九章		

本书思想的形成到付梓成书，前后历时三年有余，编者仍觉多有不尽人意之处，因此对书中的缺点、错误，欢迎专家学者批评指正。

1992年10月

目 录

第一篇 经济波动与监测预警导论

第一章 经济波动：中国经济建设所面临的一个严峻问题

- 一、我们所面临严峻问题的一般内涵 (3)
- 二、对我国经济波动过程的简要回顾 (5)
- 三、社会主义条件下存在经济波动是马克思主义的一个基本观点
..... (10)
- 四、对社会主义经济波动在认识上存在的偏差 (16)
- 五、新时期我国经济波动的基本特征 (21)
- 六、深入研究中国经济波动是我们所面临的一项跨世纪任务 (27)

第二章 中国经济波动的内在机理

- 一、考察中国经济波动的一个基本理论设定：特殊类型的非均衡
经济 (31)
- 二、过度需求、资源约束与经济波动 (38)
- 三、资源与需求双重约束与经济波动 (49)
- 四、政府行为与经济波动 (60)

第三章 中国经济监测预警的理论分析框架

- 一、经济波动基本形态 (63)
- 二、景气循环波动成因分析 (71)
- 三、宏观经济监测预警体系框架 (77)

第二篇 经济监测预警方法及其模型

第四章 中国经济波动与监测预警方法界定

一、季节波动测定方法·····	(85)
二、长期趋势分离方法·····	(91)
三、景气循环波动测定方法·····	(99)
四、经济波动预警方法界定·····	(107)
第五章 指标体系设计	
一、指标体系：建立监测预警模型的基石·····	(118)
二、指标体系设计·····	(119)
三、指标的分类与筛选方法·····	(124)
四、我们所选择的指标体系·····	(135)
五、国内外经济监测预警指标体系比较·····	(136)
六、国际经济循环指标系统 (IEI)·····	(152)
七、政府统计系列中应增设的指标·····	(153)
第六章 中国经济监测预警模型 (I) —— 景气循环法	
一、景气判断·····	(157)
二、循环测定·····	(161)
三、景气循环法·····	(165)
第七章 中国经济监测预警模型 (II) —— 综合模拟法	
一、基本概念与思路·····	(173)
二、经济发展状态的划分·····	(175)
三、经济运行轨迹的描述·····	(177)
第八章 中国经济监测预警模型 (III) —— 状态空间法	
一、多指标综合方法优劣评价·····	(184)
二、监测预警特征指标选择·····	(189)
三、从点监测走向状态监测·····	(191)
四、以状态判别预警替代曲线波动预警·····	(199)
第九章 三大模型的综合与比较	
一、对三大模型体系的基本分析·····	(204)
二、三大模型体系的同异辨析·····	(212)
三、三大模型体系的选择使用·····	(217)
第十章 八十年代中国经济波动与九十年代预期	
一、经济波动赖以存在的经济环境的变化·····	(219)
二、八十年代中国的经济波动·····	(230)

三、简论——九十年代经济波动预期	(248)
------------------------	-------

第三篇 经济波动要素分析

第十一章 中国工业经济波动

一、我国工业经济中期循环	(253)
二、我国工业经济短期循环	(258)
三、工业波动的结构分析	(262)
四、工业循环波动的因素分析	(265)
五、九十年代我国工业经济波动展望	(267)

第十二章 中国农业经济波动

一、农业生产的循环波动性	(270)
二、三种外因学说	(274)
三、价值规律理论	(280)
四、中国农业循环波动的成因机制	(283)
五、我国九十年代农业生产预期	(290)
六、平抑农业循环波动的对策建议	(291)

第十三章 中国投资波动

一、中国投资波动的形态	(294)
二、推动中国投资波动的因素分析	(317)
三、投资波动对经济的影响	(335)

第十四章 中国价格波动

一、八十年代中国价格波动的阶段性特征	(342)
二、推动价格波动的机理分析	(350)
三、价格波动的宏观调控	(358)

第四篇 经济波动区域实证

第十五章 辽宁省经济波动分析

一、对辽宁省经济波动的历史回顾	(367)
二、八十年代辽宁省经济波动的特征分析	(370)
三、对1991年经济波动的分析及对1992年经济形势展望	(375)

第十六章 上海市经济波动分析

一、上海经济波动透视	(383)
------------------	-------

二、上海经济波动形态	(387)
三、八十年代上海经济波动的实证分析	(392)
第十七章 河北省经济波动分析	
一、八十年代河北省经济运行轨迹与波动特征	(401)
二、经济波动生成因素分析	(405)
三、促进经济持续稳定协调发展	(416)
第十八章 江苏省经济波动分析	
一、江苏经济波动的形态	(420)
二、江苏经济循环波动的特征 (I) —— 中波特征	(425)
三、江苏经济循环波动的特征 (II) —— 短波特征	(430)
四、江苏经济波动的传导	(431)
五、江苏经济循环波动的机制	(437)
六、平抑江苏经济波动的对策建议	(441)
第十九章 企业监测点景气调查制度及景气分析	
一、企业监测点景气调查制度与经济管理	(444)
二、企业监测点景气调查的基本内容及景气分析	(452)
三、企业样本点的确定原则	(472)
四、企业景气动向与景气判断	(477)
附表	(482)

第一篇

经济波动与监测预警导论

第一章 经济波动：中国经济建设所面临的一个严峻问题

在我国四十多年社会主义经济建设发展的过程中，经济增长始终是时快时慢，有时发展十分顺利，有时则出现始料不及的滑坡。实践证明，经济波动和景气循环在我国经济发展的整个过程中，无处不在，无时不在。在理论上给我们带来诸多困扰，在实践上给我们带来重大损失。不彻底研究、认识我国经济波动规律和解决对策问题，中国社会主义经济将难以健康地发展。这确是我国经济工作者所面临的一个严峻问题。就研究和解决这一问题作探索性的工作，是本书的基本任务。

一、我们所面临严峻问题的一般内涵

(一)经济增长过程中的频繁波动与高速稳定发展的良好初衷存在着较大差距

自本世纪五十年代以来，以“超英赶美”为目标的我国社会主义工业化浪潮奔腾而来，给经济建设带来了高速度、高增长。但是，在高速增长过程中，经济发展也十分不稳定。尤其是从五十年代末进入六十年代，经济动荡和阶段性的经济困难日益明显，隔几年就有一次经济滑坡。尽管我国的社会主义经济建设一直在发展，但对经济波动处置不当而造成的损失是巨大的。我们不能不承认，我们原来对经济发展的历程估计得过于顺利，对经济工作

的难度估计得过低，对社会主义经济规律认识得过于肤浅。总企图用超越实际可能的雄心壮志和大规模群众运动的方式搞经济建设，而忽视对经济规律的认识。但经济波动规律本来是一个冷峻的客观存在，它一再惩罚不去认识这一规律并且不按这一规律办事的人。因此，问题的严峻不仅在于本来就存在客观的、不以人的意志为转移的、必然会给经济发展带来损失的社会主义经济波动，而且更在于我们对社会主义经济波动规律至今没有一个系统的、深刻的、量化的认识，而对其限制和利用的对策就更不用谈了。这样的结果是，本来经济已经震荡不已，我们还在推波助澜；本来结构已经严重失衡，我们还在单一发展；本来经济已在低谷徘徊，我们还在进行强紧缩控制。简而言之，社会主义存在经济波动，这一波动必然带来困挠和损失，而我们对经济波动规律缺乏应有的研究态度加剧了这种困挠和损失。

(二)社会主义传统经济理论的静态平衡观与经济活动客观本身动态地、连续不断地发展有较大不适应

事实证明，国民经济持续的线性增长和长时间的结构稳定不过是一种不可能实现的主观设想。从辩证唯物主义的立场和观点出发，经济发展的时高时低、时快时慢的波浪式运动，是事物的对立统一规律在经济活动中的基本表现形式。所以我們必须在经济的动态发展中，把握波浪式运动的幅度，既能在发生巨涨巨落的危险时，使波动幅度限制在一个允许的范围内；又能在限制大起大落时，积极地驾驭波动。而我们以往的目标，总是试图平息波浪，寻求一个风平浪静的经济发展过程。这对于前者来说有极大的难度，对于后者来说是纯粹的空想。我们面临的问题是，必须重新审视我们的立场，认识事物的本来面目，寻求规律性的东西，并在此基础上调整社会主义经济管理的思维、观念、模式和方法。

我国社会主义经济建设的发展过程，是一个始终伴随着经济波动的过程。但是对经济波动规律性的认识，却大大滞后于经济

波动实际。长久以来，对经济波动是否是社会主义经济固有规律一直是一个讳莫如深的问题。其中牵涉到的一个最敏感的问题是，有波动就意味着存在经济周期，有周期就包含着经济危机概念，而经济危机是资本主义的固有规律，这样社会主义岂不等同于资本主义了。因此，社会主义传统经济理论的基础是综合平衡理论，它更注重状态描述而较少注重过程分析，它更注意静态平衡而较少研究变动机制，它更注重经济格局和经济行为的规范性与前定性，而较少注意经济过程乃至经济政策的随机性和应变性。所谓“较少”还包含着这样一种意思，那较少研究的东西一般都具有波动性，只有当问题发生而不得不认真面对的时候，才仓促应付。这就是一个时期以来被经济工作者常常戏称的“计划不如变化，变化不如电话”。这里提出一个问题，究竟我们的失误在于原来综合平衡不够，经济计划不周呢？还是本来就不可能存在一个典型静态的周密计划，而我们真正存在的问题，是没有一个科学的动态经济理论，没能从运动的、矛盾的、对立统一的观点去考察和研究社会主义经济运动过程，并在此基础上制订对策和政策，实施管理。总而言之，在社会主义经济建设的宏观管理和调控方面，真正的失误到底是什么？我们在经济波动面前到底需要做什么？我们面临怎样一个严峻的问题？上述这些问题，将是我们在社会主义经济发展的历史长河中必须反复研究，并力求给予科学回答从而正确指导实践的重大理论问题。

二、对我国经济波动过程的简要回顾

对我国四十年来经济发展的统计分析表明，大约每隔5—6年就经历一次高涨与低落的循环，我们可以称之为经济景气循环。这可以从图1.1清晰地体现出来。

建国初期，面对国民党政府留下的千疮百孔的旧中国经济，我们用三年时间进行了国民经济恢复工作。由于采取了统一财经管