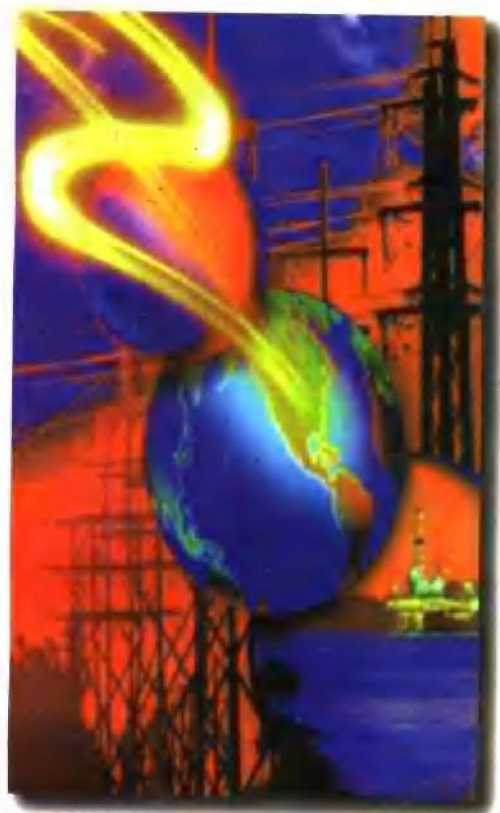


青·年·经·济·学·博·士·研·究·丛·书



SHE HUI ZHU YI JING
JI FENG XIAN LUN

梁广海 著

社会主义经济风险论

○ 陕西人民出版社

青年经济学博士研究丛书

● 社会主义经济 风险论

梁广海 著

■ 陕西人民出版社

(陕)新登字 001 号

社会主义经济风险论

梁广海 著

陕西人民出版社出版发行

(西安北大街 131 号)

新华书店经销 洛南县印刷厂印刷

850×1168 毫米 32 开本 6.25 印张 6 插页 135 千字

1996 年 12 月第 1 版 1996 年 12 月第 1 次印刷

印数:1—3000

ISBN 7-224-04269-2/F·542

定价:8.00 元

“商品价值从商品体跳到金体上，是商品的惊险跳跃。这个跳跃如果不成功，摔坏的不是商品，但一定是商品生产者。”

——马克思

“开放政策给我们带来一些风险……”

——邓小平

答辩委员会关于梁广海博士论文 “社会主义经济风险研究”^①的决 议(代序)

一、关于论文的选题

梁广海的博士论文“社会主义经济风险研究”选题新颖。论文对社会主义经济风险问题进行了系统的理论研究，主要包括：经济风险的概念、性质、特点、分析方法、定量模型和定性对策等方面。

经济风险及其理论问题，是近年来经济学界引人注目的新课题，目前，国内极缺乏系统的研究。梁广海的论文采用理论分析和实证验证相结合的方法，对这一重大的理论和现实问题进行了系统的研究，无疑拓宽了我国经济学界的研究领域，弥补了研究领域的不足。

自改革开放以来，我国学者涉足社会主义经济风险研究领

① 作为图书出版时定名为“社会主义经济风险论”。——编者注

域的人还很少，特别是经济转型期经济风险的研究更少。但在现实中，我国经济却不可避免地要遇到经济风险问题，且经济风险又具有明显的层次差别和程度差别，对经济风险进行系统的经济分析无论对于微观经济决策，还是宏观经济决策均具有重大的理论意义和现实意义。这一课题的研究对解决改革开放过程中出现的一些重大经济难题可以提供新的思路，有助于推动我国经济学界对社会主义市场经济体系进行全面的研究，作者对经济风险与社会主义市场经济和我国开放经济关系的论述，对我国完善和发育市场经济体制具有重要的实际应用价值。

二、论文所取得的创造性成果

第一，对社会主义经济风险的概念界定；提出了包括经济元、经济风险元、险素、风险机制等概念，对分析经济风险和进行深入的分析具有重要意义。

第二，对社会主义经济中经济风险存在的客观必然性进行了较充分的分析。论文对经济风险进行了较全面的历史考察，不仅分析了西方的经济风险研究史，而且对马克思主义的经典作家关于经济风险的论述也作了合理的归纳。作者对于经济风险与经济元行为的关系也进行了令人信服的分析，指出了经济决策事权与经济风险承担责任的结合程度与经济决策所产生的经济风险程度之间的相关关系。

第三，对社会主义市场经济条件下的经济风险的分类、性质和特征，进行了较充分的分析。其中，特别突出的是，作者对社会主义经济运行中的风险机制进行了较深入的分析，区分了经济运行中的行为主体与风险承担主体；对经济运行中的经

济元的权利结构进行了深入分析；讨论了经济运行中的风险运动效应；并比较成体系地分析了投资行为对经济风险的特殊影响，讨论了投资乘数和投资风险乘数的关系。

第四，作者对社会主义经济风险的定量分析方法与模型进行了开创性的研究。论文深入细致地讨论了经济风险分析的定量方法体系，构建了对经济风险进行经济判断分析、盈亏平衡分析、敏感度分析等的方法体系，以及社会主义市场经济条件下可用于实际分析的定量分析模型。论文中用于进行经济风险分析的几种常用的概率分布均可成立。论文以海洋石油开发为例所做的实证分析表明，作者建立的经济风险分析模型具有较强的适用性。

三、论文的不足之处

论文中所涉及的一些经济学概念尚需认真推敲。

总之，梁广海同志的博士论文“社会主义经济风险研究”具有重要的理论意义和现实意义，尤其是对展开社会主义经济风险研究和完善我国经济学界关于社会主义市场经济的研究也具有重要的科学价值。在国内尚缺乏系统的研究的时候，梁广海的论文对此问题进行了如此深入的探讨，具有理论开创性，已经达到了博士论文水平。特别值得提出的是，梁广海的博士论文在数理经济学的方法运用方面达到国内的较高水平。

答辩委员会对答辩人进行了若干提问，答辩人对答辩委员提出的问题进行了答辩，答辩委员会表示满意。答辩委员会由五人组成，经无记名投票表决，一致通过梁广海同志的博士学

位论文答辩，并建议校学术委员会授予梁广海同志经济学博士学位。^①

答辩委员会主席

张 卓 元

1994 年 6 月 14 日

① 南开大学已于 1994 年 6 月 14 日授予梁广海同志经济学博士学位。——编者注

内容提要

社会主义经济风险及其理论问题是近年来经济学界引人注目的新课题之一,至今尚未形成全面、系统的理论体系。这一课题的研究对解决改革开放过程中出现的一些重大经济难题可以提供新的思路,有助于推动我国社会主义市场经济的发展进程。本书对社会主义经济风险的概念、性质、特点、分析方法、定量模型和定性对策等,进行了较为系统的研究。

导论中,首先对“风险”一词的释义进行了探究,认为它是蕴含着损失性、量化性、预期性、或然性、关联性等方面的含义,与特定的经济学范畴相结合便形成一系列特定的风险概念。对经济风险的概念,经济学界的阐述不尽一致。本书对经济风险的定义是:在市场经济中经济行为主体的预期经济目标与实际结果之间的偏差及其影响。为研究需要,书中提出了经济元、经济风险元、险素、风险机制等概念。其中,经济元是对处于经济行为过程的一切行为主体的统称。静止地看,经济元可以是国家、部门、企业、其他经济实体或个人,但事实上,在市场经济中它们均以具有自身利益的独立单元而出现于经济行为的过程之中,具有相同的经济属性。因此,在研究经济风险的一般性问题时可同一视之。

第二章探讨社会主义经济风险存在的背景及其客观必然性。我国正在改革开放中发展社会主义市场经济,这是本书所研究的经济风险存在的大背景。在这样的背景下,经济风险有其存在的客观必然性。书中对此从社会主义经济的市场经济特性和开放经济特性两个方面展开分析。

社会主义市场经济的特性决定其经济风险性。我国社会主义经济是处在改革开放过程中的经济,对原有计划经济体制进行改革,培育和发展市场经济体制是我国社会主义经济的一个基本特性,这种特定经济状态决定着我国经济风险的特征。首先,社会主义与市场经济的融合本身就是一项风险性的经济实践,在经典社会主义理论中二者是不相容的;其次,只有对传统经济体制进行不断改革才能建立起市场经济体制,而改革本身是有风险的;再次,实事求是地对社会主义重新加以认识和理解,敢于并善于冒风险来改进和发展传统社会主义的理论和实践原则,才能真正搞好社会主义市场经济;最后,中国特色的社会主义亦具有中国特色的经济风险,集中表现为经济风险的最终体现是危及中国共产党生死存亡的风险。

社会主义经济的开放特性决定经济风险性。开放为我国经济发展带来了活力,同时也为经济风险的产生和传递创造了条件。我国对外开放的政策、内涵、性质、格局和现状,决定了经济风险的一些特点。随着法制建设的完善,国内开放环境风险减弱;对外经济技术合作机会与风险并存;利用外资规模的扩大加重了外债风险。从宏观上看,开放带来的经济风险主要表现为:在国内经济总量方面,因出口结构不当而可能导致的“贫困增长”问题;在国内经济结构方面,开放政策的地区差别产生的国内区域经济发展不平衡的风险;在经济结构与总量平衡关系方

面,主要是对外开放可能导致的国际收支失衡的风险。

第三章研究社会主义经济风险的一般属性,包括经济风险的分类、性质、作用,经济运行中的经济风险运动效应,投资行为对经济风险的特殊影响等几个方面。

经济风险的具体表现形式从不同的角度可以有不同的分类。经济风险对经济活动起着约束和激励的双重作用。经济风险的性质可以从时间和空间两个方面来考察。任何经济行为都是发生在一定时间和空间中的,使经济元面临时间和空间两方面的风险。经济行为在空间和时间上的风险性,可用经济行为过程中的资金流动和历经时间来表示。有四种典型情形:无时空风险性;只具空间风险性;只具时间风险性;具有时空综合风险性。

现行体制下的经济风险承担结构与权力利益享有结构相背离,形成两个相反的金字塔结构。这种结构是导致我国经济运行效率低下、投资膨胀、宏观失控、大起大落等重大经济现象的原因之一。

投资行为对经济风险具有特殊影响,存在着“投资风险乘数”效应。

第四章探讨对社会主义经济风险进行分析的定量方法体系,并建立了定量分析模式。

关于经济风险分析的系统的理论和方法,目前国内尚处于探讨阶段,国外也未见权威著述。本书将经济风险分析方法体系概括为常规分析法和概率分析法。常规分析法旨在通过定性或常规数量测算等手段对经济风险进行研究分析,包括判断分析、盈亏平衡分析和敏感分析等方法。概率分析法指应用概率统计理论进行经济风险分析的一类数量方法,包括期望值分析和模拟模型等方法。书中所构建的分析模型是用于研究分析有限多

个险素共同影响和决定经济风险的一套数学方程。其基本原理是：

设有随机变量函数

$$Y=g(X_1,X_2,X_3,\cdots X_n)$$

其中 $X_1, X_2, X_3 \cdots X_n$ 是 n 个 (n 是有限正整数) 相互独立的随机变量, 并且各自具有一定的概率分布。通过对各个自变量按其概率分布进行 N 次随机抽样, 并且对每一次抽样结果都按上述关系式进行一次运算, 得到一个 Y 值; 这样, 抽样运算 N 次, 当 $N \rightarrow \infty$ 时, 这 N 次运算的结果便构成了 Y 的概率分布。从而通过实际测算 (而不是理论推导) 实现了对目标变量的求解。根据所研究问题的需要, 目标变量可以是增长率、通货膨胀率等宏观指标, 也可以是净现值、盈利率等微观指标。书中结合经济活动实例对所构建的模型进行了实证检验, 获得了预期的结果。

第五章探讨社会主义经济风险的定性战略对策。社会主义经济是市场经济。市场经济是以竞争为中枢环节的。市场竞争犹如沙场战争, 经济元酷似军队。本章在对竞争与战争、经济元与军队的相似性做出比较分析的基础上, 试借鉴军事原则与战略战术, 通过对世界上市场竞争胜败的大量实例进行总结概括, 提炼出经济元在市场经济中的风险战略与对策。在市场经济中, 经济元的风险战略可概括为: 总体战略、经济战略、操作战略三个层次, 并可采取慑抑、克制、化解三种对策, 处理所面临的经济风险问题。

目 录

答辩委员会关于梁广海博士论文“社会主义经济风险研究”
的决议(代序)..... 张卓元(1)

内容提要..... (1)

1 导论 (1)

1.1 风险释义..... (1)

1.2 经济风险的概念..... (2)

1.3 经济元及经济风险元的概念..... (5)

1.4 险素的概念..... (6)

1.5 风险机制的概念..... (6)

1.6 研究经济风险问题的意义..... (9)

1.7 经济风险研究的内容和方法 (13)

2 社会主义经济风险存在的背景及其客观必然性..... (14)

2.1 社会主义市场经济特性决定其经济风险性 (14)

2.1.1 发展社会主义市场经济是一项风险性经济
实践..... (14)

2.1.2 在改革的风险中发展市场经济..... (16)

2.1.3 深刻理解社会主义内涵及其内在风险性
..... (18)

2.1.4	中国特色的社会主义及其特色经济风险	(19)
2.1.5	社会主义市场经济特性决定其经济风险性	(23)
2.2	社会主义经济的开放特性决定其经济风险性	(28)
2.2.1	社会主义对外开放政策引发经济风险	(28)
2.2.2	社会主义对外开放的全面内涵及其风险意义	(30)
2.2.3	社会主义对外开放的性质决定其经济风险性	(33)
2.2.4	中国特色的社会主义开放格局及其潜在经济风险	(39)
2.2.5	我国开放现状的宏观经济风险分析	(42)
3	社会主义经济风险的一般属性研究	(46)
3.1	社会主义经济风险的分类、性质和作用	(46)
3.1.1	经济风险的分类	(46)
3.1.2	经济风险的性质	(48)
3.1.3	经济风险的作用	(50)
3.2	社会主义经济运行中的风险机制问题	(51)
3.2.1	经济运行中的行为主体与风险承担主体	(51)
3.2.2	经济运行中经济元的权利结构分析	(54)
3.2.3	经济运行中的经济风险承担体系及其运动过程	(56)
3.2.4	现行经济运行中的风险运动效应	(58)

3.3	投资行为对经济风险的特殊影响	(60)
3.3.1	投资乘数原理与“投资风险乘数”	(60)
3.3.2	投资风险的含义	(61)
3.3.3	投资行为导致经济风险的一般原因	(62)
3.3.4	投资行为导致的经济风险程度分析	(64)
3.3.5	投资行为导致的经济风险的表现形式	(67)
4	社会主义经济风险的定量分析方法与模型	(70)
4.1	经济风险分析的定量方法体系	(70)
4.1.1	经济风险分析方法体系的构建	(70)
4.1.2	经济风险的常规分析方法	(71)
4.1.3	概率分析法	(78)
4.2	经济风险定量分析的模拟模型	(85)
4.2.1	经济风险定量分析模型的基本原理	(86)
4.2.2	经济风险定量分析模型中的险素变量描述	(87)
4.2.3	经济风险定量分析模拟模型实证检验	(89)
4.2.4	经济风险定量分析模型的特点	(99)
4.3	经济风险定量分析模型的应用指引	(100)
4.3.1	经济风险分析模型中的变量相关性问	(100)
4.3.2	应用定量模型进行经济风险分析的意义	(111)
4.3.3	经济风险定量分析模型应用的基本过程	(113)
5	社会主义经济风险的定性战略对策	(117)
5.1	经济元现代市场竞争风险战略的考察	(117)

5.1.1	市场与战场及经济元与军队之比较	(117)
5.1.2	经济元市场争战实例考察	(120)
5.1.3	经济元的风险战略体系	(122)
5.2	经济元对经济风险的慑抑对策	(124)
5.2.1	威慑抑险的要素及效应	(125)
5.2.2	通过市场手段慑抑经济风险	(128)
5.2.3	通过生产手段慑抑经济风险	(130)
5.2.4	通过财务手段慑抑经济风险	(130)
5.2.5	通过技术手段慑抑经济风险	(131)
5.2.6	通过管理手段慑抑经济风险	(132)
5.3	经济元对经济风险的克制对策	(134)
5.3.1	通过正面市场竞争克制经济风险	(134)
5.3.2	通过侧翼市场突破克制经济风险	(138)
5.3.3	通过全面市场攻势克制经济风险	(142)
5.3.4	通过强占特定市场克制经济风险	(144)
5.4	经济元对经济风险的化解对策	(145)
5.4.1	通过授权许可交易转嫁经济风险	(146)
5.4.2	通过市场妥协分摊经济风险	(147)
5.4.3	通过合资经营共担经济风险	(148)
5.4.4	通过集团联盟共同对抗经济风险	(148)
5.4.5	灵活机动,化险为夷	(149)
附 录		(152)
(一)经济风险分析模型实证检验计算机程序软件		(152)
Appendix A		(152)
Appendix B		(157)

(二)主要参考文献.....	(165)
1. 中文论著.....	(165)
2. 英文论著.....	(177)
后 记.....	(181)