

Outstanding Academic Works on Economics by Nobel Prize Winners
诺贝尔经济学奖获奖者学术精品自选集



ECONOMIC THEORY AND ECONOMETRICS

by

L.R. KLEIN

经济理论与 经济计量学

[美] 劳伦斯·克莱因 著
杰姆·马奎兹 编
沈利生等 译

 首都经济贸易大学出版社

F224.0

k45

461333

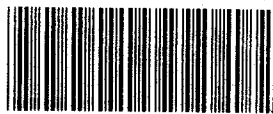
ECONOMIC THEORY AND
ECONOMETRICS

经济理论与经济
计量学

[美] 劳伦斯·克莱因 著

杰姆·马奎兹 编

沈利生 等 译



00461836

首都经济贸易大学出版社

Copyright © 1985 by Lawrence Klein

根据 University of Pennsylvania 出版社 1985 年版翻译

图书在版编目(CIP)数据

经济理论与经济计量学/(美)克莱因(Klein, L.)著;沈利生等译. - 北京:首都经济贸易大学出版社, 2000.3

(诺贝尔经济学奖获得者学术精品自选集)

书名原文:Economic Theory and Econometrics

ISBN 7-5638-0839-6

I. 经… II. ①克…②沈… III. ①经济理论-研究②经济计量学-研究 IV. F224.0

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2000)第 02049 号

首都经济贸易大学出版社出版发行

(北京市朝阳区红庙)

北京宏飞印刷厂印刷

全国新华书店经销

850×1168 米 32 开本 23.75 印张 579 千字

2000 年 3 月第 1 版 2000 年 3 月第 1 版第 1 次印刷

ISBN 7-5638-0839-6/F·457

著作权合同登记号

图字:01-98-2461 号

定价:48.00 元

出版说明

1968年在瑞典中央银行成立300周年之际,为纪念诺贝尔奖奖金提供者,由时任行长艾斯伯林克等人倡议,并经瑞典皇家科学院批准,设立了“纪念阿尔弗雷德·诺贝尔瑞典中央银行经济学奖”。该奖由瑞典皇家科学院委任的5~8名经济学家组成“经济科学委员会”(即奖项委员会),负责在全球范围内对入围的经济学家进行遴选并将评选意见提交科学院社会科学部,最终确定桂冠的得主。由于该奖项与诺贝尔遗嘱所设立的物理学奖、化学奖、生物医学奖、文学奖以及和平奖以同样的时间、同样的奖金额颁发,故被世人习惯地称为“诺贝尔经济学奖”。

1936年,英国经济学家约翰·梅纳德·凯恩斯发表了划时代的名著——《就业利息和货币通论》,标志着现代经济学的诞生。然而,在诺贝尔经济学奖设立以前,人们对能否称经济学为科学尚怀有极大的疑问,即使在艾斯伯林克等人提出设立经济学奖时,也遭到许多名人的反对。他们认为,经济学作为一门社会科学,以它的

价值判断为基础,其成就难以用一定的客观标准来衡量。因此,尽管经济学的研究成果在促进人类文明、推动社会进步方面已显示出极大的作用,但并未得到人们的足够重视。诺贝尔经济学奖的设立,首次使经济学奖与物理学奖、化学奖、生物医学奖、文学奖以及和平奖并驾齐驱,每年颁发给在经济学的研究领域作出杰出贡献的人士。它的设立,对经济学在门类众多的学科中确立自己应有的地位具有极为重要的作用。

今天,诺贝尔经济学奖已被世人极为关注,尤其在经济学界更被奉为至尊。从1969年首次颁奖起,诺贝尔经济学奖至今已颁发了31届,共有44位经济学家获此殊荣。获奖经济学家的研究成果可谓集西方经济理论之大成,几乎囊括了二战后西方经济学的主要研究成果,对西方经济学的发展具有积极、重要的影响。

西方经济学研究了市场经济条件下经济发展的基本规律,对各国在市场经济发展过程中的经验和教训进行了科学的归纳和总结。作为人类经济思想的精华,其成果是全人类共同的宝贵财富。从这个意义上讲,其对中国建立健全市场经济体系,加速经济发展具有无可辩驳的借鉴作用。因此,我们应注意研究和学习西方经济学,并在批判吸收的基础上创立有中国特色的社会主义经济理论。这也是我们出版本丛书的初衷。

考虑到许多获奖者笔翰如流,著作等身,为使收入到丛书中的作品更具权威性,我们采用了由获奖者自己

选择作品的方式确定书目。对那些业已仙逝的获奖者,则邀请其家人、同事、学生或国内专家学者代为确定作品。尽管这样做使得我们的工作变得异常艰辛,但这却是本丛书的特点及价值所在。

在本丛书面世时,我们由衷地感谢那些为本丛书的出版提供过帮助的机构和人士,他们是:瑞典驻华大使馆文化处、美国驻华大使馆文化处及杨更琪先生、法国驻华大使馆文化处、英国驻华大使馆文化处、挪威驻华大使馆文化处、荷兰驻华大使馆文化处、爱立信(中国)有限公司业务开发及礼宾事务经理刘国来先生、瑞典皇家科学院经济科学委员会及托尔斯滕·珀森先生、北京大学图书馆沈正华女士等。没有他们卓有成效的工作,本丛书的顺利出版是不可想像的。我们还要感谢北京市新闻出版局及有关领导,他们对出版本丛书的支持为我们出好丛书提供了保证。我们更要感谢欣然允诺担任本丛书顾问及编委的学者们,他们的亲切指导,特别是为我们推荐能够胜任翻译工作的译者,对保证丛书质量起了关键作用。此外,我们还要感谢许许多多帮助过我们的朋友们。

我们希望本丛书能得到中国广大读者的承认,如果是那样,我们将深感欣慰。

出版者

2000年3月

为《诺贝尔经济学奖获奖者学术精品自选集》所作的序言

1968年,瑞典银行(Sverigs Riksbank)在其300周年志庆活动时宣布设立一个新的奖项,即“纪念阿尔弗雷德·诺贝尔瑞典中央银行经济学奖”,并承诺对该奖项提供永久支持。

同时,瑞典皇家科学院承担了与自1901年起开始运作的诺贝尔奖完全相同的程序来对获奖者进行评选的任务。这样,每年年初科学院都会收到250~300个提名建议,通常涵盖多达百名以上的候选人(未经邀请主动提名的个人没有计算在内)。科学院奖项委员会(成员5~8名)首先对世界各地的候选人进行专业评估,然后,再以报告的形式将奖励意见提交给科学院社会科学部(The Social Science Class of the Academy)。最后,科学院的全体成员要在10月份齐集一堂,以决定奖项的最终归属。

本奖项的评选原则与诺贝尔奖完全一致,完全遵循

阿尔弗雷德·诺贝尔的遗愿——奖励在其所处领域有最为重大发现、发明或发展的科学家。在实践中,这就意味着要考虑到参选者学术成果的独创性、在理论与实践当中的重要性及其对科学工作的影响。科学院及奖项委员会也在一定程度上考虑到了候选对象及其学术成果对社会的影响,包括其对公共政策的影响。

在本奖项设立后的前 30 年里,科学院及奖项委员会对“经济科学”一词采取了相当广泛的理解。因此,奖励对象涉及经济学邻近学科的很多重大科学成就。有几个奖项实际上是授予了“跨学科研究”的成果,处于经济学、政治学、社会学及历史学等学科的交叉点。

本奖项设立后 30 年的运行也反映出本世纪下半叶经济学研究的特点与走向。首先,获奖情况清楚地表明美国在这一领域的优势地位。43 名获奖者中,有 28 人是美国公民,尽管其中 4 人,即里昂惕夫(Leontief)、库普曼斯(Koopmans)、德布鲁(Debreu)和哈萨尼(Harsanyi)的出生地及受教育地均非美国。其他获奖者来自英国(6 人),瑞典、挪威(各 2 人),法国、印度、荷兰、前苏联、德国(各 1 人)。获奖一人次以上的大学有:芝加哥大学(8 人)、哈佛大学(4 人)、剑桥大学(4 人)、麻省理工学院(3 人)、伯克利大学(2 人)、奥斯陆大学(2 人)、普林斯顿大学(2 人)、斯坦福大学(2 人)、耶鲁大学(2 人)。

在获奖成果的内容方面,经济分析中的演绎法与数

学公式化表述成为其显著特征。例如,萨缪尔森(Samuelson)、希克斯(Hicks)、阿罗(Arrow)、库普曼斯、康托罗维奇(Kamtorovich)、德布鲁、阿莱斯(Allais)等人的获奖,还有金融经济学方面的获奖者马克威茨(Markowitz)、米勒(Miller)、夏普(Sharpe)、默顿(Merton)和斯科尔斯(Scholes),以及博弈论研究方面的获奖者哈萨尼、纳什(Nash)、泽尔滕(Selten)等。

20 世纪下半叶,经济学研究的趋势和特点之二是包括系统统计测试或评估等在内的定量研究法变得越来越重要。这主要反映在授予弗里希(Frisch)、丁伯根(Tinbergen)、里昂惕夫、克莱因(Klein)、斯通(Stone)、哈维尔莫(Haavelmo)等人的奖项上。实际上,在过去 10 年间,定量研究领域的硕果涉及了大量的数据,如果没有分析技术手段的发展(如计量经济学、投入—产出分析、程序编制、高能计算机等的发展和应用),要想取得这样的成就几乎是不可能的。

本奖项还反映出二战后宏观经济学的重要作用。在此,我们应特别注意弗里德曼(Friedman)、克莱因、托宾(Tobin)、莫迪里安尼(Modigliani)、索洛(Solow)和卢卡斯(Lucas)等人的成就。一些研究经济体系的新方法得到了认同,这反映在奖项授予信息经济学[米尔利斯(Mirrlees)、威克里(Vickery)]、人力资源[贝克尔(Becker)]和博弈论等研究课题上。定量研究法在经济史学研究中的不断上升的重要作用表现在库兹涅茨

(Kuznets)和福格尔(Fogel)的获奖上。同样,发达国家和发展中国家经济中的制度的重要作用则体现在授予冯·哈耶克(Von Hayek)、布坎南(Buchanan)、科斯(Coase)和诺斯(North)等人的几个奖项上。对经济发展不同方面的研究成果的奖励则授予了缪尔达尔(Myrdal)、刘易斯(Lewis)、舒尔茨(Scholtz)和森(Sen)等人。

据我所知,此套丛书是首次尝试系统地出版所有获奖者的重要著作。丛书的出版本身就具有重大的意义,在中国面世其意义更加深远。我希望它的出版不仅有助于经济学的发展,而且能直接推动中国经济的发展。

奖项委员会秘书

托尔斯滕·珀森

1999年7月,于斯德哥尔摩

鸣 谢

编者和出版者对下列杂志和出版社的大力帮助和合作致以诚挚的谢意：

American Economic Review

Cambridge University Press

Econometrica

Economie Appliquee

Federal Reserve Bank of Minneapolis

International Economic Review

International Journal of Mathematical Education in Science and Technology

Journal of the American Statistical Association

Journal of Money, Credit, and Banking

Journal of Political Economy

Metroeconomica

North-Holland Publishing Company

Review of Economics and Statistics

Review of Economic Studies

Quarterly Journal of Economics

Festschrift für Nationalökonomie

中文版序

劳伦斯·克莱因

本文集中的论文几乎都是我在本世纪 40 年代到 70 年代末的学术研究成果，只有几篇文章发表在本世纪 80 年代早期。这些论文概括了我第一次访问中国以前的研究活动。1979 年在中国的第一次访问，特别是与发展中经济有关的问题，给我的经济学思想留下了经久不灭的印象。1980 年，我和斯坦福大学的刘遵义 (Lawrence J. Lau) 教授，以及另外几个亲密同事一起，在北京组织了一个经济计量学讲习班，从那以后，我就经常与中国的经济学家们——他们或是作为宾夕法尼亚大学的访问学者，或是作为攻读学位的候选人，或是在中国的研究单位里——一起研究中国的经济问题。

从我这一方来说，以收集在《经济理论与经济计量学》中的论文内容为基础，将是一个很好的研究联系。自 1979~1980 年以来的岁月里，我一直在对本书中所概括的研究内容进行扩展。我的许多注意力放在国际经济学、国际金融、以经济计量模拟为依据的经济政策、经济学中的高频预测、冷战以后的军转民等方面。

当中国开始经济改革时，我和中国经济学家们的主要合作

就建立在本书各章中的各类研究基础之上了。在经历了十年动乱以后，中国的经济分析必须达到世界级的水平。现在，中国的经济学家们已经在 1979~1980 年还存在的差距上架起了桥梁，正在以他们自己的方式发展此学科。当然，这并不是说中国的信息基础就像许多先进国家一样雄厚了，处理信息的硬件设施还没有达到她想要的或应有的那么丰富，但是，中国的经济学现在已经准备好以中国的方式发展了。

我相信，本书会在西方经济学和中国经济学之间建立起学术联系，我希望我从 1980 年以来一直从事的研究会对此有所帮助，特别是在数量经济学 (Quantitative Economics) 领域。

我的研究成果的第二集《劳伦斯·克莱因论文选 (Selected Papers of Lawrence R. Klein)》是由前宾夕法尼亚大学博士指导组成员、现加拿大卡尔顿 (Carleton) 大学教授肯塔·玛瓦 (Kanta Marwah) 编辑的。该书已于 1997 年由新加坡世界科学出版公司出版。该书中各章重印的内容以及编者说明，主要是我在 80 年代以来到 90 年代早期的论文。

我的论文集的主题是数学和统计学方法，似乎对中国研究人员颇有吸引力。在即将到来的岁月里，我期望中国的经济学家们会在这个领域里作出有力的、丰富的贡献。

译者前言

劳伦斯·克莱因是美国宾夕法尼亚大学经济系教授，国际上著名的经济学家，1980年诺贝尔经济学奖获得者。《经济理论与经济计量学》一书是克莱因教授的学生杰姆·马奎兹从克莱因发表于1980年以前的论文中精选出来汇编而成的。本书既反映了克莱因教授在各个历史阶段的学术成就，也大致描述了他的治学道路。

我们知道，克莱因教授获得诺贝尔经济学奖是由于他对经济计量模型和经济预测作出杰出的贡献。他把经济理论与经济计量方法结合起来，建立起可用于实际预测的经济模型，为经济问题和经济政策的定量分析提供了有力的工具。他在50年代建立的两次世界大战之间的美国模型已经成为各国经济计量学教科书的经典范例。经济计量模型和经济预测能够风靡全世界，既得益于克莱因教授的开创性贡献，也与他言传身教，培养了大批经济计量模型专家有着密切的关系。当然，作为一代大师，克莱因教授的学术贡献并不仅仅局限于这个范围，他在经济理论和经济计量方法上也有诸多成就。

本书的原编者杰姆·马奎兹在其《40年“严格观察的实证理论方法”》一文中对本书的内容有一介绍，克莱因本人也在

他的《自传性研究评论》中对选入本书各论文的背景作了较为详细的说明，这里不再赘述。下面仅引述一位台湾学者关于克莱因教授贡献的一段话^①，或许对读者有所帮助。

克莱因教授的第一篇金石之作是《有效需求与就业理论》。这篇文章在凯恩斯经济学的经典级论文中，可与希克斯（Hicks, 1937）和莫迪里亚尼（Modigliani, 1944）两人的宏文媲美，甚至还有过之。希克斯的文章虽然成功地推出了IS-LM分析法的架构（框架），画定了日后研究总体经济的基本路线，但由于省略了对工资与物价的处理，并不能算是完整的模型。莫迪里亚尼的模型虽然兼顾了工资与物价，但其结论却倡言凯恩斯的理论，不过是新古典理论在工资与物价皆出现僵固性时的化身；凯恩斯理论并无其本身创始性的特色。此结论很难被经济学家普遍接受，惟有克莱因教授能作持平之论。克莱因认为，要了解凯恩斯体系有关工资、物价与利率方面的特性，必须从“流动性偏好理论”与“边际生产力学说”来加以追溯。到后来，我们不难发现，货币数量的作用在于决定利率而非物价，因而与古典的理论大异其趣。因此，克莱因的理论并不单纯是前人理论的翻新，简直就是一种突破与革命。

克莱因教授的这种观点，不但持续于他本人日后的研究作品中，同时亦影响了许多同时代的经济学家，如托宾（Tobin）、帕廷金（Patinkin）等。甚至连萨缪尔森（Samuelson）亦坦然承认早年自克莱因处获得不少对凯恩

^① 李继祥。克莱因——把经济学带出象牙塔的先锋。诺贝尔经济学奖论文集。台湾：台湾中央日报出版社，1983年8月。

斯经济学的了解。

选入本书的论文都发表于1980年以前，虽然离现在远了些，但其中的许多内容在今天仍然对我们有很好的参考价值。目前，我国的经济体制还处于由计划经济体制向社会主义市场经济体制的转变时期，我们现在遇到的许多问题是市场经济国家遇到过的问题，因此，国外的经验会给我们提供很好的借鉴。例如，中国在短缺经济情况下的主要问题是供不应求，瓶颈部门的供给能力是制约经济增长的主要因素。而在告别了短缺，进入若干商品相对过剩的历史时期，需求就成为制约经济增长的主要因素。现在，由于需求不足而使许多生产部门和行业的生产能力得不到充分发挥，有相当一部分生产能力处于闲置状态。因此，如何对生产能力的利用情况或设备利用率进行估计，就是一个很有意义的课题。再如，失业率的估计问题，现有的统计数据中只有城镇登记失业率，这是一个很不完整的统计。中国过去长期在计划经济体制下，国家对城镇劳动力实行全部包下来的就业政策，每年新增的城镇劳动力都由国家的指令性计划安排到（国有）企事业单位中去，而不考虑企事业单位中是否真正需要，需要多少。这种指令性的强行分配从表面上看实现了城镇劳动力的充分就业，但实际上却出现了人浮于事和冗员充斥等不合理的现象。现在，有些国有企业希望通过部分职工下岗来提高生产效率，以增强企业在市场上的竞争力，但由于社会保障体系的不健全，不能做到根据实际生产需要确定所需要的劳动力数。现有的统计数据没有提供各生产部门中的劳动力利用率。而估计劳动力利用率的实质，也就是估计失业率。目前，不仅在城镇存在一定的失业率，而且在农村也存在一定的失业率，因而，如何估计失业率也是一个很有意义的课题。

克莱因教授多次指出,发展中国家建立经济模型时不能完全照抄照搬发达国家的模型,而应当根据本国的实际情况和数据的可获得情况,构建适合自己国情的模型。这是非常中肯的。中国是一个发展中的大国,目前仍然是一个穷国,国情与外国不同,再加上经济体制的转变,所以,中国的经济计量模型一定会有中国的特色。

克莱因教授把他的许多精力用于世界联接模型(Project LINK)上,并取得了大量研究成果,这些成果在本书中反映得较少,只有一篇写于1976年的总结性论文。事实上,世界联接模型在80年代得到了很大的发展,把几乎世界上所有的国家和地区都包括进来了^①。联接模型与其他国际组织[如国际货币基金组织(IMF)、经济合作与发展组织(OECD)等]的世界模型有一个最大的区别,那就是参加联接模型中的各模型大多由参与国或地区的学者自行建造并自行维护,最能反映参与国或地区的实际情况,因而具备最为坚实的基础。随着经济的全球化,各国和地区的经济联系越来越密切,联接模型中心每年春季和秋季两次提供的预测报告不仅得到学术界的重视,也得到了各参与国或地区政府的关注。

最后,我们要特别介绍经济计量学在中国的发展以及克莱因教授所起的关键作用。经济计量学和经济模型在中国起步较晚,严格地说,是从1980年以后才开始发展起来的。改革开放以前,由于众所周知的原因,中国与西方基本上处于完全隔绝的状态,尽管经济计量理论和经济计量模型在五六十年代就

^① 在克莱因等著的另一本书上有对LINK模型的更详细介绍。参见罗纳德·博德金,劳伦斯·克莱因著,王慧炯,李善同等译,宏观经济计量模型史,北京:中国财政经济出版社,1993年7月。