

劳伦斯·克莱因 经典著作导读

张小溪 李芳芳 著

中国社会科学出版社



劳伦斯·克莱因 经典著作导读

张小溪 李芳芳 著

中国社会科学出版社

图书在版编目 (CIP) 数据

劳伦斯·克莱因经典著作导读/张小溪, 李芳芳著. —北京:
中国社会科学出版社, 2018. 2

ISBN 978 - 7 - 5203 - 1948 - 5

I. ①劳… II. ①张…②李… III. ①宏观经济—计量经济
学—研究 IV. ①F224. 0

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2018)第 004771 号

出 版 人 赵剑英
责任编辑 卢小生
责任校对 周晓东
责任印制 王 超

出 版 中国社会科学出版社
社 址 北京鼓楼西大街甲 158 号
邮 编 100720
网 址 <http://www.csspw.cn>
发 行 部 010 - 84083685
门 市 部 010 - 84029450
经 销 新华书店及其他书店

印 刷 北京君升印刷有限公司
装 订 廊坊市广阳区广增装订厂
版 次 2018 年 2 月第 1 版
印 次 2018 年 2 月第 1 次印刷

开 本 880 × 1230 1/16
印 张 2.5
插 页 2
字 数 48 千字
定 价 18.00 元

凡购买中国社会科学出版社图书, 如有质量问题请与本社营销中心联系调换

电话: 010 - 84083683

版权所有 侵权必究

自序一

我喜欢看书，但并不是一个擅长写书评的人，虽然之前和朋友合作写过梯若尔的书评并发表在《经济学动态》上，但那纯粹是偶尔为之，本着认真负责、不要误人子弟的心态，很长一段时间，我都不敢再做类似的工作。

直到一个偶然的机会有，碰到一位前辈正在做关于经济学诺奖得主的经典著作研究，在他的支持和鼓励下，我花了一年多的时间陆陆续续开始拜读克莱因的著作。特别是有三个月的时间在英国访学，终于有机会看到几本在国内始终无法找到的原著，也促使我终于动了提笔写作的念头。当然，最初并没有打算要把克莱因的书评写成一本书，只是想整理出一篇一两万字的文章而已，但是，写起来之后就发现收不住了，于是乎最后就有了这本小册子。

写书和写文章不一样，文章受限于篇幅，要求精练，写书则可以“任性”一点，发挥的余地更大，更适合喜欢无拘无束的我，所以，我其实是很欣喜能有这

本小书的。

克莱因的著作很多，中文译作不多，大部分靠阅读原版，好处之一是自己的英文阅读能力得到了很大程度的提高，仿佛回到在国外上学的时候，每天要阅读厚厚一沓英文书。克莱因的著作中涉及计量的内容很多，好处之二是自己得以恶补了一番相关理论。如此看来，写作这本小书对我而言实在是收获颇丰。

最后，感谢所有在我写作期间给予帮助的人，感谢从阅读到最后写作的那段时光，也感谢阅读本书的你们。

张小溪

2017年11月10日

自序二

劳伦斯·克莱因 (Lawrence R. Klein, 1920—2013), 被称为“计量经济学之父”, 其开创了计量经济模型应用于对经济政策的实际效果进行分析和可行性研究的历史, 并因此成为 1980 年诺贝尔经济学奖的获得者。对克莱因的最初印象来源于他的《凯恩斯革命》一书, 那时我正在攻读宏观经济学专业博士学位。在书中, 克莱因将凯恩斯的经济理论进行了完整的概括并用数学形式对其进行表述, 这本书深深地吸引了我, 并解开了我对宏观计量方面的很多疑惑。虽然后续对克莱因的相关著作也进行了扩展阅读, 但都涉及较浅。

然而, 我和克莱因的缘分并未止步于此。依稀记得一个阳光明媚的下午, 我和张小溪师姐在校园散步, 不经意间聊起了历年诺贝尔经济学奖得主, 我俩都对克莱因的理论十分赞赏, 当小溪师姐提议要对克莱因的著作进行梳理时, 我们一拍即合。其实, 最初的目的是想充实今后进一步学术研究的文献储备, 但当了解到国内并没有对克莱因的理论和成果进行系统梳理及评述的著作

时，我们更加坚定了要好好写下去的信念。在小溪师姐的带领下，我腾出大块的时间开始仔细拜读克莱因的著作，反复琢磨其针对不同国家所构建的经济理论模型。在这个过程中，顶着来自各种英文专业词汇和计量专业知识的压力，我们互相鼓励，尤其是小溪师姐在英国访学期间，经常会发来国内无法获取的克莱因原著和文献资源。我想，在深度阅读研究的这段时间里，我们都是充实并进步着的。

该书写作期间，正值我工作变动时期，之后进入北京林业大学经济管理学院任教，并教授中级和高级《宏观经济学》，教学相长，使我对宏观经济学理论及其数学表述有了更加深刻的理解。回过头来再去研究克莱因的著作，则更加深化了我对其思想的理解与认识，并借此不断推动着我利用经济计量模型来分析各种经济现象的能力的提升。由于写作时间有限，加之克莱因计量经济学思想艰深，本书当作抛砖引玉，以期引起国内更多学者对此学科的关注和研究。书中有理解和阐释不当之处还请学界同人批评指正。

李芳芳

2017年11月20日

前 言

劳伦斯·克莱因 (Lawrence R. Klein) 1920 年 9 月 14 日出生于美国内布拉斯加州奥马哈，大学就读于洛杉矶城市大学，获得数学学士学位，研究生就读于加州大学伯克利分校，1942 年获得经济学硕士学位，并开始研究计算机模拟，博士师从萨缪尔森，就读于麻省理工学院，1944 年获得经济学博士。随后，克莱因先后在芝加哥大学、国家经济局、密歇根大学、牛津大学和宾夕法尼亚大学沃顿商学院等知名高校和研究机构从事经济研究工作。

众所周知，克莱因成功地把计量经济学方法和凯恩斯主义宏观经济学分析结合起来，创立了宏观经济计量学。并且通过构建大规模的计量模型，克莱因建立起估算系统，对经济周期、乘数效应、政策冲击进行模拟和预测，其研究涉及经济、贸易和金融等诸多领域。1980 年，瑞典皇家科学院宣布授予克莱因诺贝尔经济学奖，以表彰他将计量经济学模型应用于经济波动分析和经济政策方面的贡献。

在阅读劳伦斯·罗伯特·克莱因的经典著作时，人们普遍会期望了解其在经济学各个领域的贡献，包括聚合理论、宏观和微观计量经济学模型、计量经济学理论、多国建模、经济政策分析和经济预测等。毫不夸张地说，这些期望很容易得到满足，因为克莱因的著作不仅包括上述内容，还涉及20世纪90年代以来热门的经济全球化问题。通过全球建模，克莱因在书中比较了不同国家之间政策模式的差别，进行了短期的国际预测，并研究了全球服务业在经济中的地位和在各国的份额差别。因此我们认为，克莱因将计量经济学的研究范畴国际化，在某种意义上说，可以称为开创了“全球计量经济学”。

本书按照时间顺序，对克莱因的主要著作进行逐一评介，主要目的在于帮助读者了解其在经济理论、计量经济学、应用微观经济学、应用宏观经济学和应用国际经济学五大方面的贡献。他的著作可以说是科学理论、统计学方法、制度知识和数据分析的最佳组合。

目 录

第一章	凯恩斯革命	1
第二章	美国 1921—1941 年的经济波动	4
第三章	计量经济学教科书	6
第四章	问卷调查法对经济学的贡献	8
第五章	美国 1929—1952 年的经济计量模型	10
第六章	联合王国计量经济学模式	12
第七章	计量经济学导论	14
第八章	商业周期文献选读 (第五卷)	16
第九章	沃顿经济计量预测模型	18
第十章	沃顿产能利用指数	20

第十一章	经济增长：明治维新时代以来的日本 经验·····	22
第十二章	布鲁金斯模型：一些最新成果·····	24
第十三章	经济预测理论随笔·····	26
第十四章	财政和货币政策问题：折中经济学家的 争论·····	28
第十五章	布鲁金斯模型：观点和最近进展·····	30
第十六章	计量模型的表现：美国经济的比较模拟 研究·····	32
第十七章	经济计量预测和预测模型入门·····	34
第十八章	计量经济模型：决策的指南·····	36
第十九章	经济学的供给和需求·····	38
第二十章	促进增长和竞争的产业政策：一个 经济学视角·····	40
第二十一章	计量经济学讲义·····	43
第二十二章	经济理论与计量经济学·····	45
第二十三章	美国计量经济学模型比较·····	48

第二十四章	宏观计量建模的历史	50
第二十五章	寻求更稳定的世界经济体系： 一次重组	53
第二十六章	新俄罗斯：转型的失败	55
第二十七章	加速日本的经济增长：解决日本的 增长困境	58
参考文献	61

第一章 凯恩斯革命

《凯恩斯革命》（*The Keynesian Revolution*）一书是劳伦斯·克莱因在其博士学位论文基础上修改完成的，于1947年由麦克米伦出版公司出版。这是劳伦斯·克莱因出版的第一本书，时任加拿大政府经济顾问的克莱因将凯恩斯的经济理论进行了完整的概括，并用数学形式进行表述，该书也成为使凯恩斯思想实现数学模型化的奠基之作，《凯恩斯革命》一书的出版在当时引起了西方经济学界的高度重视，被认为是西方经济学初学者的入门读物。

第二次世界大战之前，大多数经济学家信奉以马歇尔为首的“新古典”市场运行理论，该理论主要强调市场经济的自动调节作用，认为市场运行始终会自动保持供求均衡。而第二次世界大战之后，面临经济复苏任务的西欧各国和日本，需要一种新理论作指导，以实现资本主义经济的稳定和增长。《凯恩斯革命》一书在这一背景下应运而生，它对于推广凯恩斯的“新”经济理论起到了巨大的作用。在本书中，作者否定了以英国

剑桥学派为主要代表的传统新古典经济学中关于资本主义市场经济可以自动维持经济，达到充分就业的和谐均衡状况的理论主张及信条，提出了一整套新颖的有效需求理论，主张通过国家对经济生活进行积极干预的办法，来消除大规模失业，摆脱经济萧条。

该书前六章论述凯恩斯理论的发展和内涵。一方面克莱因追溯了凯恩斯革命的起源，指出 20 世纪 30 年代初经济大萧条时期，凯恩斯出版的《通向繁荣的手段》一书阐述了货币创造乘数理论，是凯恩斯思想的起源。而凯恩斯于 1936 年发表的《就业、利息和货币通论》一书则是凯恩斯“革命”的集中体现。另一方面作者试图揭示凯恩斯革命的本质，他将凯恩斯理论同“新古典”学派理论进行了对比，说明两者在经济理论的表达方式上存在的异同。从投资和储蓄的关系入手，克莱因指出，凯恩斯革命实现了从“新古典”学派通常认为的储蓄和投资的平衡由利率决定到两者的平衡由国民收入水平决定的观点转变，并阐明了凯恩斯关于现代资本主义国家有必要干预经济生活的理论。此外，该书论述了凯恩斯理论支持者的一些言论，如马尔萨斯、西斯蒙第、霍布森、福斯特、卡钦斯等，并回应了由凯恩斯革命所产生的一些重要争议，指出凯恩斯经济学并非萧条经济学，凯恩斯理论在“近代”经济学体系中代表着一种思想“革命”。最后一章就凯恩斯理论对经济和社会改革的力量所发生的影响进行评价。

从书中可以看出，克莱因本人是凯恩斯主义的坚定支持者。他后期的研究也受到凯恩斯的深刻影响，我们常常可以发现克莱因将凯恩斯的观点通过计量经济模型展现出来。曾经有人说，克莱因是借《凯恩斯革命》这本书推翻凯恩斯的所有观点，其实仔细阅读书后就会发现，他所提到的革命是指针对当时社会发展的现状提出与凯恩斯所写的不同的理论和结论。他认为，不同的历史时期的经济思想是完全不同的，并非反驳凯恩斯的观点。我们认为，如果想了解凯恩斯主义的精髓，又没有时间去阅读原著，那么阅读《凯恩斯革命》这本书的确是一个不错的选择。

第二章 美国 1921—1941 年的经济波动

《美国 1921—1941 年的经济波动》（*Economic Fluctuations in the United States, 1921 - 1941*）于 1950 年由威利出版公司出版。在出版《凯恩斯革命》之后，克莱因就致力于宏观计量经济学模型的研究，试图整合经济理论和计量方法论。该书以克莱因 1944—1947 年在考尔斯委员会时的研究成果为基础，是他在宏观计量经济学研究方面的首次成功，并一度成为模型引证的典范，使宏观计量经济学一跃成为欧洲、美国、日本等国家广受推崇的经济学科之一。

该书以丁伯根的商业循环理论为基础，并试图对其进行改进和拓展。全书共有四章，内容涉及模型构建的基本原则、经济理论、统计模型和可用数据的充分性，前两章为理论框架构建，后两章则为应用分析。

第一章，克莱因探讨了计量模型构建的一般规律和程序，并假定经济系统可以用一系列表示各种经济关系的方程式来描述，将方程式中的变量分为内生和外生两种，利用最小二乘法来进行参数的估计。第二章，阐述

了宏观计量模型所依据的经济理论。作者假定经济系统由两部分组成：企业和家庭。该部分引入了凯恩斯有效需求总调整政策的理论，并考虑到企业和家庭在经济生活中的表现及两者的互动，假设企业行为满足利润最大化，因此企业会在利润和所持有的资产之间进行权衡；而家庭行为满足效用最大化，因此家庭的效用与消费量和所持有的资产有关。企业和家庭的互动决定着市场的价格、工资和租金等变量的大小。虽然该书以丁伯根理论为基础，但囊括了丁伯根没有考虑的加总问题，全书用了一整章篇幅来描述其变量的选取和如何将相似的个体行为进行加总。第三章，克莱因依据理论框架，构建了三个简单的美国模型，并利用美国两次世界大战期间（1921—1941年）的年度数据进行参数估计，这些模型很好地拟合了包括世界经济危机在内的二十年间的经济变动，说明了美国这一时期经济波动的原因和现代资产阶级国家干预经济生活的必要性。第四章，论述了其所使用数据的合理性。在建模中，理论固然重要，数据的合理性也是大家普遍关注的问题之一。书中，克莱因详细介绍了其数据的来源和计算过程。

《美国 1921—1941 年的经济波动》被视为研究美国经济的经典书籍之一，该书论述的模型规模虽小，但在宏观计量经济模型的发展史上占有重要地位，美国很多宏观计量模型都是在此基础之上发展起来的。