



诺贝尔

天
才
永
远
是
我
们
学
习
的
榜
样

获奖人物全传

(1988~2004)



Nobelprize

经济学卷

主编 岑宇飞

诺贝尔经济学奖是设立最晚的诺贝尔奖项，它却是对人类社会经济发展最具影响力的奖项。自1969年设立至今，已经有几十位专家学者获奖。萨缪尔逊、刘易斯、托宾、布坎南、诺斯、默顿、芬恩·基得兰德……诺贝尔经济学奖获得者将他们的毕生献给了经济现象的研究、经济理论的总结、经济活动的分析等等，了解他们的人生道路，借鉴他们的研究成果，研究发现他们在取得举世瞩目成就背后的拼搏与奋斗，对我们青少年来说具有十分重要的意义。

诺 贝 尔

——获奖人物全传

主编 岑宇飞 刘利生

经济学卷

〈三〉

(1988 ~ 2004)

吉林摄影出版社

责任编辑：李相状
封面设计：原创在线

书 名： 诺贝尔获奖人物全传

主 编： 岑宇飞 刘利生
出版发行： 吉林摄影出版社
经 销： 新华书店
印 刷： 北京铁建印刷厂
开 本： 850 × 1168 1/32
印 张： 248
字 数： 3500 千字
版 次： 2005 年 6 月第 2 版第 1 次
印 数： 1 - 3000
书 号： ISBN 7 - 80606 - 522 - 9/Z · 55

总 定 价： 668.00(全 34 册 本册 19.60 元)

版权所有 翻版必究



目 录

莫利斯·菲立克斯·查理·阿莱	(1)
威廉·夏普	(16)
默顿·米勒	(30)
科斯	(42)
诺斯	(57)
阿马蒂亚·森	(70)
约瑟夫·斯蒂格利茨	(84)
丹尼尔·卡尼曼和弗农·史密斯	(95)
罗伯特·尼格尔和克莱夫·格兰杰	(102)
芬尼·基德兰德和爱德华·普雷斯科特	(110)
诺贝尔经济学奖获得者总览表	(116)

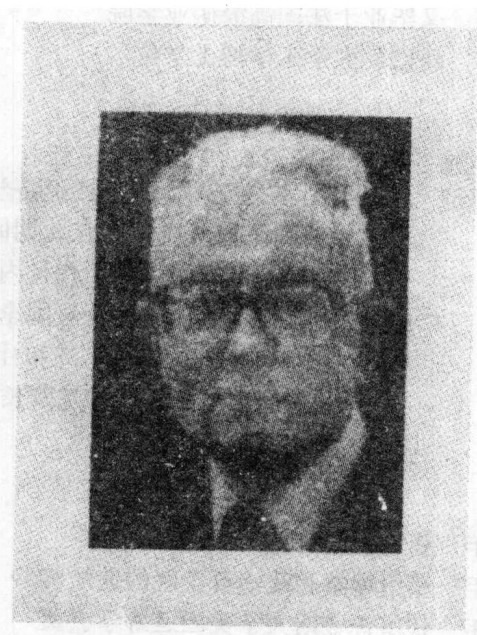
◆◆◆诺贝尔获奖人物全传◆◆◆



NOBEL 获奖人物全传 • 经济学卷

1

莫利斯·菲立克斯·查理·阿莱
(*Maurice Filix Charles Allais*)



1988 年诺贝尔经济学奖获得者



◆◆◆诺贝尔获奖人物全传◆◆◆

生平简介

1911年5月13日生于法国巴黎

学 历

- 1931年 毕业于法国工艺学院
1936年 又毕业于法国高级矿业学院
1949年 获巴黎大学工学博士学位

经 历

1944年起 在巴黎国家高级矿业学院任经济学教授,并任该校经济研究所所长。在此期间,还兼任过巴黎大学、弗吉尼亚大学和日内瓦国际高级研究所经济学教授,以及法国全国科学研究中心研究室主任、法国经济和社会研究室主任、巴黎国家高级矿业学院院长等职。

获 奖

- 1933年 获 *Laplace* 奖
1954年 获伦理学和政治科学院的迪潘奖
1958年 获霍普金斯大学美国运筹学会奖
1959年 获 J. 迪唐斯奖和法国宇航学会加尔贝尔奖
1968年 获 A. 阿尔努大奖
1970年 获鼓励工业国有化协会金质奖章

◆◆◆诺贝尔获奖人物全传◆◆◆

1978年 获法国全国科研中心金质奖章

1988年 获诺贝尔经济学奖

主要著作

《个体经济学说研究》

《经济与利息》

《欧洲的联合——通向富裕的道路》

《一般经济均衡理论与最大效率——当前的绝境与新的远景》

《健忘与兴趣》

《关于资本税和货币改革》

《预期效用假设与阿莱悖论：当代关于不确定性情况下合理决策的讨论，以及阿莱的答辩》





法国经济学的才子

在巴黎一个工人家庭里,有一个男孩出生了,那天是1911年5月13日。他的父母经营着一家奶酪店,外祖父是一位木匠。他们日子过得很舒适。有时,他的外祖父带着他去旅行,感受大自然的阳光,享受生活的美好,这也极大地激起了小男孩对生活的热爱和对自然的向往。

1914年,世界人民灾难性的一年,人类第一次世界大战爆发了。特别是在欧洲,人民流离失所,妻离子散,家破人亡。小男孩的父亲也无法避免,在小男孩3岁时,也就是同年的八月,小男孩的父亲入伍,在对德国的战争中被俘虏,次年3月27日在德国的监狱中去世。他成了没有父亲的孩子了。他的名字叫莫利斯·菲立克斯·查理·阿莱。对于父亲的去世,在阿莱的青少年时代,甚至他的一生,都直接间接地深受此事的影响。自从父亲去世后,阿莱从心里对战争深恶痛绝,这也更加增强了对和平的向往和热爱。有时,他一个人独自在想:长大后,我一定要从事和平事业。为人类营造一个美好而安静的环境。然而,又一想到父亲的死,那颗心豪情壮志的心在苦苦地呻吟,痛痛地挣扎。他开始消沉了,不再像以前那



样开朗、活泼，总是保持着沉默的样了。一个人开始独来独往，不愿与母亲和外祖父交流了……

此时，他母亲看在眼里，痛在心里。她自己何尝不是：自己最爱的最信任的患难与共的人离去，对她来说无疑是要她的命。可她母亲并没有表现出来，把这种痛深深埋在心底，因为她知道还有儿子，儿子还要成长、学习。所以，母亲总是不厌其烦地细心地照料着阿莱，帮助他尽快走出阴影。也许只上苍的仁慈，也许是九泉之下的父亲的保佑，阿莱很快摆脱了阴影。那时，尽管家庭经济拮据，但母亲和外祖父仍支持阿莱学习。阿莱的勤奋努力终于有了回报，1928年，阿莱得到拉丁文和科学的高中学士证书。在1929年又得到数学和哲学两个学士证书。不仅如此，阿莱对历史也感兴趣，并一直热爱它，从未间断过对历史的研究。这种热爱曾使阿莱想在中学毕业后申请进入文学院，但由于数学老师的坚持，阿莱进入了数学班，为进入工学院作准备。阿莱在中学同年级的全部学业科目中，包括法文、拉丁文和数学在内的成绩都是第一名。母亲看到儿子取得如此骄人的成绩，心里说不出的高兴，为儿子默默地流泪，这种泪应是高兴之泪吧！

辉煌的学习生涯

1931年，阿莱以优异成绩考入了巴黎工学院，当时工学院以及巴黎高等师范学院被认为是法国科学教育的顶峰。



◆◆◆ 诺贝尔获奖人物全传 ◆◆◆

1933年,阿莱以全班第一名的成绩毕业,在法国这通常被认为是一个“最高峰”。1934年,阿莱又进入巴黎国立高等矿业学院,两年后毕业。大学毕业时,阿莱选择的工作单位是一个政府机关,即国家矿务局,要知道,进入国家级部门,在法国有一个规定,那就是每年工学院毕业的优秀毕业生(毕业班的前三名),正因如此,它创造了在法国大工业企业中就业的可能性。

涉入经济学领域

1937年,阿莱在南茨矿业机关做负责人。他管辖法国89个省中的5个省,并在一些地方铁路系统中兼职。

1939年9月,第二次世界大战爆发,为了响应国家的号召,阿莱参加了战时部队服务。他到意大利前线的阿尔卑斯军,指挥白里安松地区的一个重炮连(中尉)。但真正的战争只持续了两个星期,从1940年6月10日意大利对法国宣战,到同年6月25日停战。历时10个月的短期部队服役之后,阿莱被任命到南茨地区国营企业管理局。

阿莱经历了战争后,对战前关心的事已完全改变。“对我而言,我能做的事情显然是准备战后时期为国家作出贡献。”他除了干行政工作外,开始认真学习经济理论,目的在于利用这些理论提高经济效率。曾在1933年,刚进入大学的阿莱参观了正处于大萧条的美国,对这一惊人的现象却没有

◆◆◆诺贝尔获奖人物全传◆◆◆



NOBEL
获奖人物全传
· 经济学卷

7

找到能被普遍接受的解释。阿莱认为任何经济的根本问题是如何促进最大可能的经济效率,同时找到能被所有参与者接受的收入分配方案,“有什么比这个更好的准备战后为国家作贡献的方式?”因而,“作为一位经济学家的职业,不决定于教育而决定于环境。职业经济学家的目的是努力打下基础,以便在上面有效地建筑一项经济和社会政策。”

1940年7月,从部队归来后阿莱开始购买经济学著作,凡是法国作者写的,或者外国作者的法译本经济学,都不经考虑地购买。在10个月的时间里,阿莱阅读了列昂·瓦尔拉,阿尔弗雷德·帕累托和欧文·费雪的基本著作,每星期至少工作80小时,这一切对他的思想影响甚深。

在复员后一年内,即1941年7月,阿莱就完成了《经济学研究》的导论,在战争的最黑暗年代和法国被德国占领的特别困难条件下,他用了30个月的时间就收集了五卷的材料,并写出一本约900页的《经济学研究:第一篇,纯经济学》。如果你现在静下心来想一想,阿莱是多么不易呀,在德国法西斯地统治下,他们所到之处无不恐怖一片,然而,阿莱并没有被他们所吓倒,他仍坚定不移地从事经济研究。这需要多么大的勇气和胆量啊!这也许是对事业的巨大的热爱吧!

1954年,阿莱因这一著作获道德和政治科学院查理·杜平奖。



◆◆◆诺贝尔获奖人物全传◆◆◆

1943年—1948年,阿莱在巴黎任矿业文献和统计局局长。在此期间兼任国立高等矿业学院经济学教授,经济分析中心主任(隶属于国家科研中心)和国家矿务局荣誉总工程师。

1948年,阿莱辞去了所有行政职务,以使用全部时间致力于教学、研究和写作。

阿莱除了在国立高等矿业学院任经济分析教授外,还在其他单位担任一些教学任务。1949年阿莱在巴黎大学获科学学院博士工程师,1964年获格龙宁根大学荣誉博士。

阿莱还参加了很多学术团体,如国际经济计量学会(1949年),国际统计学会(1951年),政治经济评论编辑委员会(1952~1984年),美国运筹学会(1956年),《计量经济学》编辑委员会(1959~1969年)等。

1980年5月31日,阿莱决定退休,但仍得到国立高等矿业学院和国家科研中心的经费资助,使他能继续从事教学、研究和写作。

由于阿莱的工作成绩,从1933年至1987年他共获14个科学奖。最重要的是1978年国家科研中心金奖(一般每年只有一个),这是第一位而且至今为止也是惟一的获此奖的经济学家。

不仅如此,阿莱在应用经济学方面的工作成就也很突出。一是参加欧洲联邦主义者同盟,欧洲运动,大西洋联盟运动,

◆◆◆诺贝尔获奖人物全传◆◆◆



NOBEL 获奖人物全传 · 经济学卷

9

欧洲经济共同体等组织研究经济发展的国际因素,国际贸易自由化,国际经济关系及经济同盟等问题。二是与政府及工业界的接触,引导阿莱在能源、运输及矿业三个系列问题上进行研究,其结果在工程界引发许多辩论,使许多工程师研究经济理论并且应用到他们各自的领域中,并得到工程界的认可。

莫利斯·菲立克斯·查理·阿莱的兴趣不仅在经济领域,而且也在历史和物理学。阿莱一直没有间断过对文明史的研究,并从1961年至1968年写了一本通史:《文明的兴衰——经济因素》(第一版),并在过去30年中不断改进和发展它。工学院时对物理学、力学及天文学课程的反思,使阿莱在过去的60年中作为一个经济学家活动时,从未停止过反思和研究建立引力、电磁和量子的统一理论所涉及的问题。物理学实验提供的经验极大地丰富了阿莱的思维方法,即物理学和经济学中关于构思模型和经验数据解释问题的相似性。

阿莱一生著作极丰,其中阿莱出版了他的第一批著作,两本基础理论著作:《经济学科研究》(1943年),《经济和利息》(1947年);三本通俗著作:《纯经济学和社会效率》(1945年),《世界经济重建理论》(1945年),《富裕或贫困》(1946年);以及在各种报纸上发表的论文。

阿莱无疑是他那一代经济学家中最杰出的一位,正如1983年萨缪尔逊对阿莱丰硕的贡献评价:“阿莱教授在法国巴黎的职业生涯中对经济学基础理论和前沿做出了极大的贡



◆◆◆诺贝尔获奖人物全传◆◆◆

献。”“阿莱是早期独立发现的源泉，要不是阿莱早期的著作译成英文，一代经济理论或许要采取不同的形式。”

精彩片断

一般经济均衡和效率最大化理论

经济分析中一般均衡和效率最大化理论的基本问题

在《经济学科研究：纯粹经济学》一书中，阿莱集中证明两个基本命题：一个市场经济的任何均衡状态是一个最大效率状态；反之，任何最大效率状态是一个市场经济的一般均衡状态（等价定理）。为此，需要具体地阐明关于人类需求和可行技术的经济结构条件，经济运行条件，这种经济运行的优越性，以及均衡状态和效率最大化状态的等价条件。

为评价经济分析的现状，需要确定选择区间、生产区间，并要考虑三个严格的假设：连续性假设，函数的可微性假设和凸性假设。从经济学的观点来看，普遍凸性假设意味着边际收益是不会递增的。然后考察两种完全不同的经济运行模型。第一种模型是一元主义的单个市场经济模型：假设所有的经济活动者，在任意给定的时刻，都面对着惟一的一组价格，只要能使每种商品的供给都等于其需求，这组价格就能保证交换及蕴含的生产发生。每个消费单位都在它的预算约束



下,使其偏好指标极大化,而每一个生产单位都通过选择可行的生产计划使它的净收入极大化,由此作出生产决策。在这两种情况下市场价格被认为是给定的,供给和需求作为市场价格的一个函数由这些行为规则来决定。第二种模型是多元主义多市场经济模型:假定所考虑的经济活动在特有的价格之下,交换以及相应的生产在任意给定的时刻都会发生。如果交易的双方都发现通过交换能够改善他们的处境,那么互換交易(伴随着生产活动)就会发生。

在这里,阿莱定义了四个很基个的新概念:消费单位偏好指数超空间中的最大可能性面;对应经济从一个给定情况的一次可行修改的可分配剩余;为保留偏好指数不变的经济的可行修改的最大可分配剩余的损失;以及偏好指数超空间中相等损失面等相关概念。当交换发生时(伴随着隐含的生产活动),经济主体之间(消费单位和生产单位)的边际效用不同时,就可能实现剩余(保证所有的偏好指标不变的前提下,通过经济的调整可能得到的商品数量)。在偏好指标的超空间中,能够定义出一个对应于所有可行情况的区域和一个对应于不可行情况的区域。最大效率点的集合就是两区域之间的边界,因而,对于任意一种最大效率状态。任何商品的可行分配剩余都是零。同样,在这种状态下,对经济的所有可能调整所得到的剩余都是零。因而阿莱提出一般经济均衡定义:如果在所考虑的状态下,对任意一种商品都没有潜在的剩



◆◆◆诺贝尔获奖人物全传◆◆◆

余,则存在着均衡。

给出了上面这些定义,就产生了两个问题,经济均衡状态是不是效率最大化状态?效率最大化状态是否能作为经济均衡状态?在给出一些限制性条件后,等价定理得到了肯定的回答。

市场经济的新理论

阿莱的新理论集中讨论两个问题:一是解释商品价格怎样在私有制经济下,由经济行为者的相互作用,通过市场而形成;二是解释价格在最优状态下的作用。与建立在微积分基础上的早期理论相比,新理论建立在集合论基础上,它更富于建设性,更一般、更现实、也更严格;而且根据它们所得出的结果来看,在研究均衡条件和效率极大化情形时,无需再用微积分理论。

新理论有四个优点,一个形式上的,其他则是实质性的。首先,表述形式的简洁。以同样的方式表达所有商品(物品或劳务、耐用品或替代品),在简化符号上具有无可争辩的优点;第二,考虑到非切线的均衡。新理论完全避开了建立在微积分基础之上的理论,即要求切线均衡的假设;第三,均衡价格体系存在性的证明。新理论在一定假设下能够证明至少存在一组价格保证均衡存在,这个定理用建立在微积分基础上的理论也能证明,但要求作出更严格的假设。最后,该理论能



够证明,市场经济的均衡状态对应于一个绝对的经济效率最大化状态,即不仅仅是局部最优化状态。

然而,从经济分析的观点来看,新理论仍然有一些重要的内在缺陷:它包含某些逻辑上的不和谐,它还要求选择区间和生产区间的普遍凸性假设,这些假设是无法证明的;并且形式上一方面与选择区间的内省资料相冲突,另一方面与生产区间的观察数据相背离。

从一元主义的单市场经济模型到多元主义的多市场经济模型

从现实中观察到的现象表明单个市场经济模型是不现实的:(1)在非均衡状态下,从来都不存在对所有经济行为者都相同的单一价格。(2)也不存在一个集中的市场,使所有消费者和生产者针对一组总的公开价格,以有效的方式同时对所有的物品显示出他们的需求和供给。(3)只存在局部市场,使任何供给或需求部可以通过货币和另外一种商品的交换来实现,并不要求经济作为一个整体必须达到普遍均衡状态。(4)大宗贸易发生在特定的交易人之间,价格对购买者来说是明确的,但并不是预先给定的。(5)一种商品通常会有数个市场。

多市场经济模型与单市场经济模型的本质区别在于,前者通向均衡的交换是在不同价格下持续发生的,而且在任意