



天
才
永
远
是
我
们
学
习
的
榜
样

诺贝尔

获奖人物全传

(1980~1987)



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、拖宾、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。

——获奖人物全传

经济学卷

〈二〉

(1980 ~ 1987)

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： 芈宇飞 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

劳伦斯·罗伯特·克莱因	(1)
托宾	(31)
斯蒂格勒	(53)
杰拉德·德布鲁	(64)
弗兰科·莫迪利阿尼	(82)
布坎南	(100)
索罗	(112)



劳伦斯·罗伯特·克莱因

(*Lawrence Robert Klein*)



1980 年诺贝尔经济学奖获得者



◆◆◆ 诺贝尔获奖人物全传 ◆◆◆

生平简介

1920 年 9 月 14 日生于美国内布拉斯加州的奥马哈城
(Omaha)

学 历

- 1942 年 毕业于加利福尼亚大学伯克利分校
1944 年 获麻省理工学院哲学博士学位
1957 年 又获英国牛津大学林肯学院硕士学位

经 历

- 1944—1947 年 在芝加哥大学任教
1948—1950 年 在国家经济研究局(NBER)任研究员
1949—1954 年 在密执安大学调查研究中心任研究员,
同时在该校任教
1954—1958 年 任牛津大学统计研究所研究员
1958 年 在宾夕法尼亚大学任教授,与此同时在日本大
阪大学以及斯坦福大学、普林斯顿大学等七所
著名大学任客座教授

获 奖

- 1959 年 获 Clark 奖章
1975 年 获纽约商业经济学会 F. Butler 奖



- 1977 年 获金靴俱乐部奖
1980 年 获宾夕法尼亚大学总统奖章
1980 年 获诺贝尔经济学奖

主要著作

- 《凯恩斯革命》
《1921—1941 年的美国经济波动》
《经济计量学教程》
《美国的一个经济计量模型, 1929—1952》
《经济计量学入门》
《美国布鲁金斯季度经济计量模型》
《沃顿经济计量预测模型》
《经济计量模型的成就》
《数量经济学及其发展》
《作为决策指导的经济计量模型》
《经济理论和经济计量学》



经济计量模型建立者

当我们以研究的眼光、总结的思绪来看伟大经济学家的成长历程,或是探索经济思潮何以会有特定走向时,我们如果能深入了解当时的经济情况与经济思想趋向之间的互动关系,必然会有丰硕的收获。这在宏观经济学的范畴内最为明显,在整个经济学上亦不例外。

克莱因之所以进入经济学的世界,因为身为经济大恐慌时代的年轻人,他渴望了解周围究竟发生了什么事。在那个年代成长,心里的确充满了苦闷,人们很容易因经济生活的问题而丧失斗志,就算是18岁或20岁的年轻人,也感觉不到有无穷的机会等待着他们。相比之下,在过去的二三十年,年轻人固然担心核战争的威胁,但也同时感受到,如果和平能维持下去,那么各式各样的机会对年轻人来说,是足够多的。

经济学的结合体——数学

大自然一直遵循着此增彼减这个规律。新兴事物,却给克莱因带来了幸运。在他的脑海里原本一直浮着一个想法,



就是数学可以应用到经济问题的分析上。在大学所修的课程,他大部分不是数学就是经济学。况且他并不是富有原创力的数学家,也不是所谓的数学天才,这点克莱因早由自己曾经参与的数学竞赛就知道了。不过他深深被大学的数学课程所吸引,同时产生了数学可以应用到经济学上的念头。例如,用数学公式来表达需求曲线或收益的估算。当他泡在加利福尼亚大学柏克莱分校的图书馆里时,十分惊讶地看到,各种新兴学科的相关期刊内容已达到相当高的水平,探讨问题的复杂程度更是远远超过他的想像。

其实,他大学时代的指导教授并不赞同克莱因在攻读经济学时兼修数学,但他有自己的想法,充分利用了40年代初期柏克莱的最佳资源——一流的经济系、数学系以及数理统计系。有些人的成就可以追溯到高中时期,但他的学术专业则是发源自第二次世界大战前的柏克莱,以及其后获得的麻省理工学院奖学金。在麻省理工学院,克莱因遇到了耀眼的经济学天才萨缪尔逊。当年,在柏克莱的图书馆浏览时,克莱因曾经看过好几本早期的《计量经济期刊》(*Econometrics*),其中萨缪尔逊的文章特别吸引他的目光。当他有机会前往麻省理工学院就读时,能和萨缪尔逊共同研究的念头,或许更坚定了克莱因的决心。一开始在他手下担任研究生助理,他除了极力找机会与他接触,也努力捕捉萨缪尔逊在每次碰面时所传达的见解和看法。



◆◆◆诺贝尔获奖人物全传◆◆◆

NOBEL

获奖人物全传

● 经济学卷

6

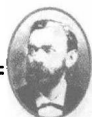
现在,透过数学与政策应用,萨缪尔逊成为阐释凯恩斯理论的先锋。

就在萨缪尔逊的《经济学》(*Economics*)成为经济学普遍使用的入门教科书时,凯恩斯经济学自此根深蒂固,形成无法扭转的趋势。在后来的一批批学生中,经济研究所的课程逐渐转向了数理的研究方法,因此学生学成后的教学或研究,也都是按此而行。用数理方法进行研究经济学,首先是在美国,继之则是欧洲、日本、印度以及世界各地,不过其中许多基础内容仍在欧洲建立,而且许多美国数理经济学大师都是外来移民。然而,萨缪尔逊与弗里德曼等本土学者使数理经济研究具有美国本土特性,并在美国广受欢迎。

而那时克莱因在麻省理工学院,进入经济学专业学习,他离开研究所后的第一份工作,是在芝加哥大学的考列斯员会(*Cowles Commission*)任职。当年他24岁,这份工作好像是又进入另外一个研究所。

起步的计量经济模型

40年代末期的芝加哥大学经济学系,真可谓英才云集,在他们这群亲密的工作伙伴里头,先后产生了四位诺贝尔经济学奖得主,而在下一代的考列斯研究人员——部分在芝加哥大学,部分在耶鲁大学——之中,又产生了两位得主。他们合力专注研究单一的课题——为美国经济建构整体的计量经



济模型(继30年代丁柏根模型的第二度尝试),并且运用了当时最先进的统计学理论、经济学理论以及各种现有的资料。经过四五年集中的研究之后,这个工作团体的成员陆续散开,展开了新的学术生命。然而,克莱因并没有放弃,仍在做研究,仍延续了这项建立总体模型的努力,而许多曾经与他共事的才俊,则分别在不同的经济学分支中一展才华——如库普曼(Tjalling Koopmans)在活动分析(activity analysis)上、阿罗在一般均衡理论上、西蒙(Simon)在决策分析(decision analysis)上、安德生(Anderson)在统计学上、马尔夏克(Jacob Marschak)在组织理论上等等。

整合计量经济学的方法论与凯恩斯总体经济分析。让克莱因一直信心十足的去面对战后的规划工作,克莱因等人觉得整个经济的福祉正掌握在自己手中。在往后的10年,他们透过模型的建构与运用所获得的成果,远远超过当初他们预估战后美国情况时最大胆的梦想。他们所建构的从考列斯委员会的成果演化而来的系统,已成为经济学者标准研究工具组合的一环。这些系统扮演了非常重要的角色,但并没有完全主导政策的形成,它们在经济预测上位居领导角色,但也并非经济预测领域中举世无双的方法。

在芝加哥大学里的科学家,秘密地以编组方式进行比考列斯委员会更重要的研究计划。而这群科学家的领导人季拉德(Leo Szilard)是克莱因的老友,因此,克莱因等与那些科学



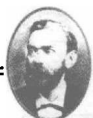
◆◆◆ 诺贝尔获奖人物全传 ◆◆◆

家交往相当频繁。季拉德这位堪称本世界最绝顶聪明的人物之一,偶尔也会客串业余经济学家的角色。季拉德曾建部体经济的室内赛局(*parlor games*),来说明如何透过一项货币管制方案以消除景气循环,也教导他们许多研究的策略,以及如何融合政治与科学。值得一提的是,还有一位他们常接触的科学家,是传奇人物的冯纽曼(*John von Neumann*)他在前往洛斯阿拉莫斯(*Los Alamos*)的途中,常会造访芝加哥,因为当时横贯美国东西部的火车行程,必须在芝加哥换车。

在欧洲研究的历程

克莱因学术生涯的另一个阶段,就是培养更丰富的国际观。在那一段时光,有些经济学者每个月都要到世界各地实地考察,到欧洲更是家常便饭。他也在1947年离开考列斯委员会后,开始了一趟横渡大西洋的欧洲之旅。当时克莱因刚在渥太华(*Ottawa*)结束了第一个月加拿大经济模型的整合工作。此项目后来在加拿大持续了很长时间,造就一个在加拿大学术界相当活跃的团体,至今仍在不断扩大规模。

到欧洲各地的经济与计量经济研究中心访问考察,也算是克莱因教育的一部分。他从中对世界形势有了更深刻的了解,但是更吸引他的仍是这些课题在美国的蓬勃发展。至于亲眼目睹欧洲从战后的瓦砾中重建,也是相当值得重视和借鉴的经验,并开启了许多迄今仍活跃的专业交流。这些对克



莱因的学术生涯的发展,都产生了重大的影响。

第二次世界大战之前,英国的剑桥及伦敦可以说是影响世界经济思潮的重镇,来自全球各地的人士齐聚那里进行研究。美国则是急起直追,但直到1946年以后,才取而代之,而各国学者也就纷纷来到美国。事实上,这种现象40年来一直没有太大的改变。不用说许多其他研究领域了。

克莱因在海外历练的那一年,有机会接触到正宗凯恩斯学派的学者,也就是曾与凯恩斯共事的剑桥学者。他和凯恩斯素未谋面,但是透过卡恩(Kahn)、罗宾逊夫人以及斯拉法(Piero Sraffa),使他对剑桥学者的思想有了深入的认识。同时克莱因也见到了卡尔多与史东(Stone)等重要学者。有趣的是,当年克莱因的教师萨缪尔逊尚未到过剑桥,但对这些学者却如数家珍。剑桥的人也曾向他提过此事。

克莱因第一次造访欧洲,刚好是萨缪尔逊初访欧洲之前的几个月,不久他们在萨缪尔逊行程的第一站挪威会面。在海外的第一年,克莱因大部分时间都在挪威,跟着奥斯陆大学的教授弗里希(Frisch——译注:1969年第一届诺贝尔经济学奖得主之一)学习。当时萨缪尔逊刚出版《经济学》一书,受到极佳的好评。当时克莱因也刚好在欧洲研究了一年。

财富对储蓄的影响是凯恩斯体系中涉及问题之一。这在宏观经济学的文献里,就是所谓的庇古效应(Pigou effect),但实质上庇古对这个问题的探讨,主要是从流动资产(liquid as-



◆◆◆诺贝尔获奖人物全传◆◆◆

sets)而非整体财富的观点来考察。那时战争刚结束,民众手上都握有为数不少的流动资产(特别是储蓄公债),所以这是一个相当普遍也极为重要的课题,值得深入探讨和研究。

与调查研究方法秘密接触

从欧洲返回美国之后,克莱因加入由伯恩斯(Arthur Burns)所领导的国家经济研究局(National Bureau of Economic Research)。在那里,他先是从事铁路部门生产函数的预算工作,一年后,参加了局里与密西根大学调查研究中心(Survey Research Center of the University of Michigan)合作的一项项目计划,利用消费者财务调查的资料,以进一步了解储蓄行为,尤其是庇古效应。

二战后,出现了经济研究新趋势,其中之一就是克莱因所从事的计量经济学,特别是宏观计量经济学俨然成为主流。至于调查研究方法,则在战时蓬勃发展,用来协助政府筹划民间活动而提升战斗力。其中一个主要的团体设于农业部之内,除了和学术界建立联系,并在安娜堡(Ann Arbor)密西根大学成立了社会研究所(Institute for Social Research)在这段时期,克莱因和这些统计学的工作团队共事愉快,而他们跨学科的研究态度,也令克莱因耳目一新。

在调查研究中心,克莱因学到了许多家政行为(household behavior)的知识,以及相关的测量技巧。该项工作是利用人



口抽样的方法,每一项研究的人有数千个。这些研究让克莱因进入了处理大规模资料的领域,借助打孔卡片及电子处理机械来完成工作。虽然电脑在当时已问世,但几乎还未用到经济及社会问题的处理上。这也许需要一个过程吧。

到密西根大学之后,克莱因教了一点计量经济学,而关心的重点仍在调查研究方面。后来,他接到福特基金会(*Ford Foundation*)赞助的经费,因为他们当时基于税负的考虑,有大笔款项可捐给一些大学。经济系的人对如何运用突然收到的经费,还真有点不知所措。于是,克莱因创办了数量经济研究小组,把一些研究所的学生组织起来,重回建立计量经济模型的本行——再度展开原先在考列斯委员会的工作。

美国经济模型的建立

克莱因和戈德伯格(*Arthur Goldberger*)两人合作完成了一套新的美国经济模型,称为克莱因—戈德伯格模型(*Klein-Goldberger model*)。他们将在考列斯委员会建构的模型加以补充及修正,并导入一些调查研究的发现,用以定期从事经济预测。

后来,这位来自澳大利亚大胆的计量经济学家克拉克(*Colin Clark*),把他们的研究成果推向高峰。他在极有影响力的《曼彻斯特卫报》(*Manchester Guardian*)全球版周刊上撰文指出,朝鲜战争期间逐渐下滑的经济,可能会导致大规模的



◆◆◆诺贝尔获奖人物全传◆◆◆

衰退。他甚至吓唬大家，全球经济会遭遇最可怕的经济事件——由于经济形势持续盘旋衰退，1929 年的历史即将重演。

在重新检视我们的模型对 1953 年—1954 年经济的预测后，克莱因得到的结论是，情况不致再像 1929 年一样。于是，他和戈德伯格合写了一篇文章寄给该报，很高兴除了文章大幅刊登出来，还配上了一幅劳氏卡通画（*Low cartoon*）。

克莱因—戈德伯格模型相关估计的运算，当年只有片段零碎地利用到电脑。为了模型求解的问题，他们可能要花上一两天，借助桌上型计算机以人工计算。密西根装设了一组大型的数位电脑，他们也开始进行模型自动求解——也可称之为模拟。但是直到克莱因离开密西根大学之前，也还没有什么具体的成就。

在麦卡锡（*McCarthy*）主义高涨的年代，克莱因离开了密西根来到平静而崇尚学术自由的牛津，在统计研究所（*Institute of Statistics*）任职，仿效密西根的调查形式进行英国的储蓄调查。在牛津期间，克莱因又回到模型建构的本行，对象是整个英国。在这里，他认识了日后相交达 25 年的好友博尔（*James Ball*）爵士。

宾夕法尼亚大学的工作者

1958 年克莱因回到美国，在宾夕法尼亚大学（*University*



of Pennsylvania)担任教授一职。这里的校长、行政主管及各学院院长,均对学术自由这项严肃课题持尊重的态度,令他深感敬佩。从在宾夕法尼亚大学及华顿学院(Wharton School)展开教职开始,克莱因又再度投身建构美国经济模型的工作,这次采用的是季度资料。因为有了英国及密西根的经验,他开始导入一些预期(expectations)的概念。这就是一系列华顿模型的滥觞。

现在大家知道,华顿模型改以季度为时间单位,重视短期景气循环的变运,运用了更多预期调查的资料,同时所有会计科目都以当期价格来表示。特别是最后一项的改变,修正了克莱因——戈德伯格旧模型的缺点。新模型的第一版是用来预估美国的经济,预估的结果送交肯尼迪政府中的经济学者参考。几年后,克莱因的注意力又移转到更新的方法,也不再对第一版的模型作任何的修正。但是他把完整的档案,包括资料列表及方程式,还有一位受过训练的助理人员,全都移交给商务部(Department of Commerce),因为他们之前曾要求协助模型建构的工作。这些资料再加上其他宾夕法尼亚大学一些相关的博士论文,终于形成了今天所谓的商务部企业经济研究室(Office of Business Economics)模型,简称 OBE 模型。此一模型形成了自己的独特之处,也是众多美国经济模型中相当杰出的一个,而第一版的华顿模型是根源之本。

在这个阶段,克莱因从事着两个方面研究,两者都对他个