

诺贝尔奖获奖者演说文集

经济学奖

· 上 ·

NOBEL LECTURES
ECONOMIC
SCIENCES



1969-1995

罗汉 主译·校

上海人民出版社

诺贝尔奖获奖者演说文集

经济学奖

罗汉 主译·校

上海人民出版社

1969 - 1995

下

责任编辑 顾兆敏
封面装帧 王建纲

诺贝尔奖获奖者演说文集
经济学奖(1969年—1995年)
(上、下)

罗 汉 主译、校

上海人民出版社出版、发行
(上海绍兴路54号 邮政编码200020)

新华书店上海发行所经销

商务印书馆上海印刷股份有限公司印刷

开本 850×1168 1/32 印张 37.75 插页 4 字数 900,000
1999年12月第1版 1999年12月第1次印刷
印数 1—5,100

ISBN7-208-03099-5/F·621

定价 60.00 元

译者的话(代序)

本书是诺贝尔经济学奖得主获奖演说的中文全译本,无任何增删或改动之处。

诺贝尔奖于1901年设立,是世界上最具影响力的奖励。诺贝尔奖是以瑞典化学家阿尔弗雷德·诺贝尔的名字命名的。1896年,诺贝尔在去世前签署的遗嘱中,将遗产作为基金,分别设立物理学、化学、生理学及医学、文学、和平五项奖金。诺贝尔奖每年颁发一次,颁发奖金、一枚金质奖章和一张荣誉奖状;奖金的数额自颁发以来起伏很大,从几万美元到数十万美元不等。

1968年,为了纪念开行300周年,瑞典中央银行决定出资设立一项新奖,“瑞典银行纪念阿尔弗雷德·诺贝尔经济学奖”。该奖由瑞典皇家科学院依照最初评定诺贝尔奖的相同原则和规则颁发。

1969年,首次奖金颁给了在计量经济学方面作出了开拓性贡献的拉格纳·弗里希和扬·丁伯根;1980年,劳伦斯·克莱因也因其构建计量经济学模型方面的成就而荣获此奖。其间,该奖授予了在纯(抽象)理论方面有建树的经济学家:保罗·萨缪尔森(1970),约翰·希克斯和肯尼斯·阿罗(1972);在创新分析方法(在理论和应用领域均可得以利用)方面有作为的经济学家:瓦西里·

里昂惕夫的投入-产出分析(1973)和列昂尼德·康托罗维奇和狄贾林·库普曼斯(1975)在最佳资源配置理论方面的成就。在经济研究具体领域里,伯蒂尔·俄林和詹姆斯·米德(1977)因其对国际贸易和资本流动的分析、赫伯特·西蒙(1978)因其对经济组织内决策过程的研究而获此奖。1974年,该奖授予冈纳·米尔达尔和弗雷德利希·冯·哈耶克,因为他们在宏观经济理论方面和在分析经济、政治和社会现象相互作用方面都作出了贡献。其他年份的授奖与经济史领域更加密切:西蒙·库兹涅茨(1971)对长期经济发展的分析;米尔顿·弗里德曼(1976)对美国货币史的分析和对稳定政策复杂性的阐明;以及西奥多·舒尔茨和阿瑟·刘易斯(1979)对有关欠发达国家长期发展的问题的研究。

这样,在第一个10来年,经济学奖涵盖了很大的一个范围,包括纯理论、方法论(新的分析工具),以及长、短期经济发展的经验分析。

1981年,詹姆斯·托宾因其对金融市场的变化如何影响真实市场的分析而获此奖。随后乔治·斯蒂格勒(1982)获奖,他使我们更好地理解市场、信息和调控。1983年,杰拉德·德布洛获奖,他对竞争性均衡存在的研究运用了高等数学,以表明在何种情况下,基本的微观经济模型具有逻辑上的一致性。

经济分析的基本工具之一是标准国民核算;理查德·斯通由于在这个领域内的重要贡献而获1984年的奖金。弗兰科·莫迪利安尼运用国民收入数据来检验和测算家庭储蓄背后的基本要素,尤其是终身储蓄假说,他因此而得到1985年的奖金。

1986年,詹姆斯·布坎南因其对通过公共部门进行资源配置的研究而荣获此奖;1987年,罗伯特·索洛因其对经济增长的研究而得此大奖。

莫里斯·阿莱获得了1988年的奖金,他使我们明了市场在资

源有效配置中的作用。特里格夫·哈威尔莫得到1989年的奖金,他发展了可以用来经验估计市场行为的统计方法。哈里·马考维茨、默顿·米勒和威廉·夏普分享了1990年的奖金,他们在金融资产市场研究方面作出了贡献。

第二个10年的获奖者的研究领域涵盖了经济学的绝大多数传统分支:基础理论研究(2次),方法论(2次),宏观经济学研究(3次),微观经济学研究(2次),以及公共部门经济学研究(1次)。

1991年的获奖者是罗纳德·科斯,他在分析交易成本和产权如何影响经济活动方面作出了开拓性的贡献。1992年的奖金为加里·贝克所得,他向我们示范了如何将微观经济学的方法运用于一系列社会问题(包括教育,职业培训,罪与罚,歧视,家庭的作用等)的研究。1993年,罗伯特·福格尔和道格拉斯·诺斯合获此奖,他们的研究工作表明了经济学理论和统计方法的运用可以如何揭示经济和制度变化的许多方面,他们使经济史领域的面貌焕然一新。1994年的奖金由约翰·纳什、约翰·哈萨尼和雷恩哈德·塞尔顿分享;通过引入基础均衡概念,他们为现代非合作博弈理论打下了坚实的基础。1995年,罗伯特·卢卡斯荣获此奖,因为他发展和运用了理性预期假说,极大地改变了宏观经济思路和研究。

简而言之,第三个10年的头5年,获该奖学者的贡献从根本上改变了不仅是经济学方面的,而且还有几个相关领域方面的研究。

当然,即使诺贝尔经济学奖比较公允,它也不可能面面俱到或不受到某些因素的影响。在1969年至1995年这一时段内,我们这个星球上不乏在理论上有重大贡献、然而又与诺贝尔经济学奖无缘的经济学家或相关学者。唯有时间才能提炼出理论和学说中蕴藏的纯金。

1997年年中,复旦大学经济学院博士张军教授(博导)热情地将我推荐给上海人民出版社编辑何元龙先生和顾兆敏先生,商量本书翻译事宜。承蒙后者信任,我们第一次见面就把一切谈妥了,厚厚的英文原版书就到了我的手上。现在译文即将刊行,我谨代表译者对本书责任编辑顾兆敏先生和我见过面的或我未曾见过面的其他编辑表示诚挚的谢意:这80万字的译文字字句句都要经过他们辛勤而又忘我的编辑和审订。

在本书的翻译过程中,我也得到了许多专家、同事、同学的慷慨支持;我尤其感谢复旦大学经济学院前院长洪文达教授(博导)、现院长黄亚钧教授、博士(博导)、世界经济系系主任华民教授、博士(博导)、殷醒民教授、博士(硕导)、谢识予教授(硕导)等同仁的热情鼓励和具体帮助。

作为出版社的初衷,任何译著自然最好由一人完成;但面对厚厚的三本书(原版书分三卷),如果要在一个比较理想的时间长度内完成,我颇感困难。因此,在得到编辑的同意后,我约请了与我共事多年的好友孟俭女士、我的研究生滕泰、陆从珍、马苏芹、伍仁隄、顾隽等参与本书的部分翻译和校对。我们合作得很愉快,工作也很有成效。毫无疑问,我作为本书的主译和主校,一要衷心感谢这几位译者和校者不可或缺的鼎力相助;二要对译文中(可能)出现的种种讹舛或失当之处承担全部责任。

罗 汉

谨识于复旦嘉陵村

1998年4月至6月间

目 录

上

1969 年

拉格纳·弗里希和扬·丁伯根.....	(1)
艾立克·伦德伯格的演说	(1)
拉格纳·安东·吉蒂尔·弗里希的自传	(4)
从乌托邦理论到实际应用:计量经济学实例	(6)
扬·丁伯根的简历.....	(44)
模型的用途:经验和前景.....	(45)

1970 年

保罗·萨缪尔森.....	(57)
阿萨·林德贝克的演说.....	(57)
保罗·萨缪尔森的传记.....	(60)
分析经济学中的最大化原则	(65)

1971 年

西蒙·库兹涅茨.....	(86)
伯蒂尔·俄林的演说.....	(86)
西蒙·库兹涅茨的自传.....	(88)

现代经济增长:发现和思考.....	(90)
-------------------	------

———— 1972 年 ————

肯尼斯·阿罗和约翰·希克斯爵士.....	(107)
拉格纳·本茨尔的演说	(107)
肯尼斯·阿罗的自传	(109)
一般经济均衡:目的、分析技巧、集体选择	(111)
约翰·希克斯的自传	(140)
经济增长的源泉.....	(142)

———— 1973 年 ————

瓦西里·里昂惕夫	(157)
阿萨·林德贝克的演说	(157)
瓦西里·里昂惕夫的自传	(159)
世界经济结构——一个简单投入-产出模型的概要.....	(161)

———— 1974 年 ————

弗里德利希·奥古斯特·冯·哈耶克和冈纳·米尔达尔.....	(181)
艾立克·伦德伯格的演说	(181)
弗里德利希·奥古斯特·冯·哈耶克的简历	(184)
像似有知识.....	(187)
冈纳·米尔达尔的传记	(197)
世界发展中的平等问题.....	(199)

———— 1975 年 ————

列昂尼德·康托罗维奇和狄贾林·库普曼斯.....	(221)
拉格纳·本策尔的演说	(221)

列昂尼德·康托罗维奇的自传	(223)
经济学中的数学:成果、困难、前景	(228)
狄贾林·库普曼斯的自传	(237)
最优化概念及其应用	(244)

1976 年

米尔顿·弗里德曼	(268)
艾立克·伦德伯格的演说	(268)
米尔顿·弗里德曼的自传	(271)
通货膨胀和失业	(275)

1977 年

詹姆斯·米德和伯蒂尔·俄林	(300)
阿萨·林德贝克的演说	(300)
詹姆斯·米德的自传	(303)
“内部平衡”的含义	(307)
伯蒂尔·俄林的自传	(322)
1933 年和 1977 年——不平衡的国内与国际经济关系下的 一些扩张政策问题	(332)

1978 年

赫伯特·西蒙	(350)
苏恩·卡尔森的演说	(350)
赫伯特·西蒙的自传	(352)
企业组织中的合理决策	(358)

1979 年

西奥多·舒尔茨和阿瑟·刘易斯爵士	(396)
艾立克·伦德伯格的演说	(396)
西奥多·舒尔茨的自传	(400)
穷人的经济学	(405)
阿瑟·刘易斯爵士的自传	(422)
减缓中的增长速度	(427)

1980 年

劳伦斯·克莱因	(443)
赫尔曼·沃德的演说	(443)
劳伦斯·克莱因的自传	(446)
为 20 世纪 80 年代制定的一些经济方案	(450)

1981 年

詹姆斯·托宾	(482)
阿萨·林德贝克的演说	(482)
詹姆斯·托宾的自传	(485)
宏观经济过程中的货币与金融	(491)

1982 年

乔治·斯蒂格勒	(538)
拉斯·魏林的演说	(538)
乔治·斯蒂格勒的自传	(541)
经济学的过程和进展	(544)

下

1983 年

杰拉德·德布洛	(579)
卡尔-格兰·马勒的演说	(579)
杰拉德·德布洛的自传	(582)
数学形式的经济理论	(587)

1984 年

理查德·斯通	(611)
艾立克·伦德伯格的演说	(611)
理查德·斯通的自传	(613)
社会会计	(621)

1985 年

弗兰科·莫迪利安尼	(655)
拉格纳·本策尔的演说	(655)
弗兰科·莫迪利安尼的自传	(658)
生命周期、个人节俭和国民财富	(662)

1986 年

詹姆斯·布坎南	(693)
英格玛·斯泰尔的演说	(693)
詹姆斯·布坎南的简历	(695)
经济政策的宪法	(697)

1987 年

罗伯特·索洛	(710)
卡尔·格兰·马勒的演说	(710)
罗伯特·索洛的自传	(712)
增长理论及其发展	(715)

1988 年

莫里斯·阿莱	(735)
英格玛·斯泰尔的演说	(735)
莫里斯·阿莱的自传	(738)
简述我对经济科学的主要贡献	(760)

1989 年

特里格夫·哈威尔莫	(790)
本各特·克里斯特·桑德的演说	(790)
特里格夫·哈威尔莫的简历	(792)
计量经济学与福利国家	(794)

1990 年

哈里·马考维茨, 默顿·米勒和威廉·夏普	(803)
阿萨·林德贝克的演说	(803)
哈里·马考维茨的自传	(805)
证券组合理论基础	(810)
默顿·米勒的自传	(822)
杠杆收购	(823)
威廉·夏普的自传	(836)

负持有和正持有的资本资产价格.....	(848)
---------------------	-------

1991 年

罗纳尔德·科斯	(876)
拉斯·魏林的演说	(876)
罗纳尔德·科斯的自传	(879)
生产的体制结构.....	(884)

1992 年

加利·贝克	(897)
阿萨·林德贝克的演说	(897)
加利·贝克的自传	(899)
观察生活的经济方式.....	(914)

1993 年

罗伯特·福格尔和道格拉斯·诺斯.....	(944)
雷纳特·约尔伯格的演说	(944)
罗伯特·威廉·福格尔的自传.....	(947)
经济增长、人口理论和生理学：长期过程对经济政策制订的 影响.....	(955)
道格拉斯·诺斯的自传.....	(1001)
经济运行的历史进程	(1008)

1994 年

约翰·哈萨尼, 约翰·纳什和雷恩哈德·塞尔顿	(1024)
卡尔－格兰·马勒的演说.....	(1024)
约翰·哈萨尼的自传.....	(1027)

不完全信息博弈	(1032)
(小)约翰·纳什的自传	(1055)
(小)约翰·纳什在博弈论上的工作	(1060)
雷恩哈德·塞尔顿的自传	(1100)
多阶段博弈模型和延迟超级博弈	(1108)

1995 年

(小)罗伯特·卢卡斯	(1146)
拉斯·E.O. 斯文森的演说	(1146)
(小)罗伯特·E. 卢卡斯的自传	(1148)
货币中性	(1162)

1969 年

拉格纳·弗里希 (Ragnar Frisch) 和
扬·丁伯根 (Jan Tinbergen)

“为他们在经济过程分析中创立和应用动态模型”

瑞典皇家科学院艾立克·伦德伯格教授的演说

国王陛下，殿下们，女士们，先生们：

过去四十年中，经济科学在经济生活的数学表述和统计定量方向上日益发展。沿着这些路线的科学分析被用来解释经济增长、周期波动以及重新分配经济资源以用于不同目的之类的复杂的经济过程。在经济生活中，比较系统的各类关系相互交错混合，形成多少有些规则的重复模式；但也存在一些历史的特殊事件和破坏。对于常人来说，没有实验的支持，要在这些极其复杂的经济变化过程中找出发展规律，并为此目的应用数学和统计分析技术，似乎有些不自量力。尽管如此，经济学家们构建与策略经济关系

1
2
4
5
甲
乙
甲
乙

相关的数学模型,并借助对不同时期进行统计分析,从而对这些模型进行定量表述的努力,事实证明是成功的。正是这条经济研究路线,即数理经济学和计量经济学,代表了近几十年来这个学科的发展。因此,当瑞典中央银行为了纪念阿尔弗雷德·诺贝尔,第一次把经济学奖授予这个研究领域的两位先驱者——挪威的拉格纳·弗里希和荷兰的扬·丁伯根——就是自然而然的了。

20年代后期以来,弗里希教授和丁伯根教授一直沿着基本相同的路线进行研究。他们的目标是在经济理论中引入数学的严谨性,并使人们能对经济假设进行定量分析和统计检验。一个主要的目标是改变那种模糊的、更为“文字”型的经济学。例如,任意“列举”周期波动的原因,以及过分关注某些简单的因果关系链,在弗里希和丁伯根两人的工作中都已让位给陈述经济变量相互关系的数学体系。

让我们以30年代早期弗里希教授涉及周期理论的动态形式的先驱工作为例。他解释了一个有投资和消费支出的差分和微分方程的动态系统,有某些货币限制时,如何产生波长为四年和八年的衰减波浪运动。引入随机突发情况,他还能解释这些波动如何变得永久、不匀,从而更为真实。弗里希走在时代前面,首创了数学模型,他后面有许多追随者。他对假设的统计检验方法的贡献,情况也是如此。

丁伯根教授主要致力于用统计方法分析动态经济理论。他在这个领域的伟大先驱工作是对美国周期波动的经济计量研究。这一调查给人们留下了深刻印象,其重要目的是试图定量确定各个因素的重要性,以检验现有的许多商业周期理论的解释价值。丁伯根建立了一个包括50个方程的计量经济系统,并利用统计分析确定反应系数及“前导和滞后”。他的一些理论引起了剧烈的反响,至今仍是争论的焦点。丁伯根教授在计量经济学方面的先驱