

历届 诺贝尔

经济学奖 得主小传

◆ 吴崇信 编著



陕西人民出版社

历届诺贝尔经济学奖 得主小传

吴崇信 编著

陕西人民出版社

(陕)新登字 001 号

历届诺贝尔经济学奖得主小传

LI JIE NUO BEI ER JING JI XUE JIANG

DE ZHU XIAO ZHUAN

吴崇信 编著

陕西人民出版社出版发行

(西安北大街 131 号)

新华书店经销 西安美术学院印刷厂印刷

850×1168 毫米 32 开本 4 插页 10.625 印张 212 千字

1998 年 9 月第 1 版 1998 年 9 月第 1 次印刷

印数:1-5000 册

ISBN 7-224-04595-0/K·753

定价:18.00 元

序

■ 吴崇信

一个偶然的机遇,使我产生了收集整理历届诺贝尔经济学奖得主小传的念头和兴趣。1996年后4个月,我奉命到中共中央党校接受短期轮训,有机会集中精力和时间看点书。11月中旬的一天,偶然在《参考消息》报上看到介绍历届诺贝尔经济学奖获得者的简要资料,总共千把字。正好这个时候,我们的学习进入市场经济这个单元,教员在课堂上不时讲到西方经济学理论,学员们在讨论中也经常议论到这方面的问题。于是,我在小组里提出,希望能比较系统而简要地了解历届诺贝尔经济学奖获得者及其主要学术成就和理论观点,以便对西方经济学的发展轮廓有一点认识。然而,当时周围的同志,谁也说不清这个问题。《参考消息》上刊登的那个小资料又过于简单,说明不了什么,满足不了我们的要求。在这种情况下,我抱着“试试看”的心情,泡在党校的图书馆里查资料,结果就收集整理了这本小册子。

诺贝尔经济学奖是当今世界上最有影响的经济学家,被称为当代经济学的“王冠”。它是1968年瑞典中央银行在建立300周年之际,为纪念阿尔弗雷德·诺贝尔(最早诺贝尔奖基金提供者)而拨出专项基金设立的一

项国际性大奖。这项大奖的全称是“纪念阿尔弗雷德·诺贝尔经济学奖”，基金数额为100万美元。该奖由瑞典皇家科学院委任组成的“经济科学委员会”评定，从1969年起，在每年的10月中旬与其他各项诺贝尔奖同时公布。到1996年止，已经颁发28届，共有40位经济学家获奖。获奖的对象全是当代有突出贡献的经济学家，而且全是男性，绝大多数是欧美学者。其中，美国学者最多，共27名（包括加入美国国籍的欧洲人），占40位获奖者的67.5%；英国人5名，瑞典和挪威各2名；法国、德国、荷兰和前苏联各1名。28届颁奖中，有18届获奖者为1人，8届为2人，2届为3人。他们获奖的理由，或是因为建立了一种新的分析方法，或是提出了一种新的理论，或是开辟了一个新的研究领域，都程度不同、角度各异地为当代经济学的发展做出了独创性或奠基性的贡献。授奖的范围从横的方面覆盖了微观经济学、宏观经济学、国际经济学和发展经济学四大部分；从纵向上包括了经济理论、数理经济学和计量经济学三个层面；从流派上涉及剑桥学派、奥地利学派、瑞典学派、芝加哥学派、新古典综合派等欧美经济学众家之说。因此说，获奖的经济学家们的理论基本上代表了西方经济学的主要成就、最高水平和发展走向，对西方经济学的发展有相当大的影响。

从这40位获奖经济学家的主要理论观点看，当代西方经济学的发展有以下特点和趋势：

一 数学在经济学中得到广泛而深入的应用

经济学要反映经济中的数量关系,因此,经济学与数学早就结下了不解之缘。从17世纪起,经济学家就用数学公式来表述经济理论。20世纪以来,经济学家在把数学方法引入经济分析,用于解决实际问题方面取得了新的重要的发展。从某种意义上说,经济学的数学化是其精密化、实用化的标志。在获奖的经济学家中,有 $\frac{1}{3}$ 以上在这方面做出了开创性的贡献,正是因为提出和运用一种数学方法于经济分析而得奖,其他人则部分地运用了数学方法来表述和证明自己的理论,纯粹只用文字分析的极少。舒尔茨是惟一对数学不感兴趣的经济学家。在他的著作中,除了统计数字外,几乎找不到任何数学公式。他是根据丰富的经验,运用观察的逻辑推理的方法直接了解事情的本质,找出问题的症结和解决问题的对策。

数学在经济学中的应用,主要体现在三个领域:

(一)将经济理论和数学相结合形成数理经济学。这主要是运用微积分、线性代数、集合论、拓扑学等数学工具来表述经济理论并进行推理、证明。萨缪尔森1970年获奖就是因为“发展了静态和动态经济理论,提高了经济科学的分析水平”。他的《经济分析的基础》一书被认为是现代数理经济学的奠基之作。该书研究了静态、比较静态和动态均衡之间的联系和区别,并作了精辟的阐述,运用联立方程及其求解来进行静态均衡分析,用微分进行比较静态均衡(均衡的移动)分析,用积分来进行

动态均衡(均衡在时间上的稳定性)分析。萨缪尔森的贡献使经济分析方法发生了一次飞跃。

一般均衡分析是数理经济学的一个重要运用,因此而获奖的有:1972年因“对一般均衡理论和福利理论的开创性贡献”而同时获奖的希克斯和阿罗;1983年因“对一般均衡理论严格阐述”而获奖的德布鲁;1988年因“在市场理论和最大效率理论方面的贡献”而获奖的阿莱。他们运用不同的数学方法来证明一般均衡条件的存在,一般均衡状态的稳定性以及一般均衡状态和最大效率状态的一致性这三个方面。希克斯用效用序数论代替传统的效用基数论作理论基础,为以后的一般均衡分析制订了精确的联立方程;他运用传统的微积分将静态均衡模型分析扩展到比较静态和动态研究;他还在凯恩斯理论上发展了一个总量的产品市场、信贷和货币市场的一般均衡的宏观经济模型。阿罗使用了更为现代的数学手段,使证明更加一般化和简化。他集中于论证一般均衡体系的存在、稳定和一致性问题,还通过研究不确定性和保险活动的重要性扩大了一般均衡分析的领域,并且特别用数学方法证明了从个人价值判断中得到社会福利函数的不可能性。德布鲁用集合论代替微积分,系统证明了一般均衡的三个方面。德布鲁的老师阿莱则批评上述三人的理论关于消费者偏好函数和生产函数的连续、可微和一般凸状假定以及关于市场价格对所有市场参加者都是共同且给定的假定是不现实的,他们将他们的理论统称为“一市场经济模型”;他抛弃这些假定,以可分配剩余、偏好指数的超空间包络边界等概念

构建了自己的“多市场动态模型”，另辟蹊径重新系统地阐述了一般均衡理论。总之，一般均衡的证明在经济分析中所用到的数学知识最深奥，这四位经济学家都是数学家。

1975年，康托罗维奇和库普曼斯因为“对资源最优利用理论及建立线性规划方法的开创性研究”而同时获奖。线性规划也是数理经济学的一个方面，它是在一定的目标函数和资源约束条件下寻求资源配置的最有效状态。为证明这种生产效率状态与“影子价格”（或“计算价格”）体系之间的一致性，康托罗维奇创立了求解线性规划的“解乘数法”，库普曼斯提出了“活动分析法”。他们两人的研究表明了计划经济中分散决策在理论上的可能性是如何与有效的价格体系的存在密切相关。

1979年得奖的刘易斯和1987年得奖的索洛的经济增长模型也运用了数学方程加以表述和数学方法进行推论。这也属于数理经济学的内容。1990年获奖的三位美国经济学家马科威茨、夏普、米勒都是借用高等数学的分析方法，建立并发展了所谓证券选择理论、金融资产价格形成理论和公司理财理论。1994年的三位获奖者：美国的伯克利加利福尼亚大学的豪尔绍尼、普林斯顿大学的纳什和德国波恩大学的泽尔滕，都是数理经济学家。纳什长期以来主要在纯数学领域从事学术研究，成绩斐然。他运用数学方法对非合作对策进行分析研究，提出了著名的“纳什均衡”概念。泽尔滕对“纳什均衡”进一步精心研究，于1965年和1975年先后提出“子对策完全性纳什均衡”和“颤抖手完美纳什均衡”的概

念。豪尔绍尼与泽尔滕合作,在对“纳什均衡”的研究中,建立了不完全信息对策理论。1996年获奖的维克里和米尔利斯,也是以高等数学为武器,研究“不对称信息下的刺激理论”而出名。

(二)将经济理论、数学和统计学相结合形成计量经济学。计量经济学是根据经济理论关于经济变量间的相互关系,用联立方程构建数学模型,再根据实际经济统计资料,对模型的参数进行估计,最后反过来检验理论的正确与否以及进行经济预测。在计量经济学领域里获奖的有弗里希、丁伯根、克莱因、哈韦尔莫、列昂惕夫、福格尔和诺思等人。弗里希(挪威人)和丁伯根(荷兰人)是1969年首届诺贝尔经济学奖的获得者。他们“在发展和应用动态模式于经济过程分析和建立计量经济模型方面进行了开创性研究”。被誉为“计量经济学之父”的弗里希率先把数学方法和统计方法应用于经济研究并命名为计量经济学,最先提出分析资本主义经济周期的数理模式,创立“统计合流分析法”,为计量经济学的方法论打下了基础。丁伯根则在此基础上发展了检验各种经济周期理论方法,他的贡献更多地侧重在应用上。他们二人还创立了强调政策手段和目标之间关系的经济政策的定性和定量理论。1973年获奖的列昂惕夫开创的“投入产出分析”方法是计量经济学最富有成果的一个应用,他根据一般均衡原理建造了各部门间投入和产出相互联系的投入产出表,并根据经验统计资料对投入产出系数进行估计,最后依此进行经济预测和经济计划。克莱因则因“建立计量经济模型并运用于经济波动

和经济政策分析”于1980年获奖。他将计量经济学方法和凯恩斯主义宏观经济学结合起来,创立了宏观经济计量学。他的贡献偏重在经济预测和经济政策分析上。1989年得奖的哈韦尔莫则是因为从随机变量入手,阐明了计量经济学的概率方法,为评估和检验经济理论及进行经济预测提供了理论基础,从而对计量经济学的发展做出了开拓性贡献。1993年获奖的两位美国经济学家福格尔和诺思,“通过使用经济理论和定量方法来解释经济与机构的变化而更新了经济历史的研究。”他们都力图把经济计量学的方法应用于历史研究,在定量分析的基础上进行了理论分析。

(三)在纯经验分析中,也是通过对大量统计资料的分析而归纳出某些经济规律。库兹涅茨1971年获奖就是因为“对国民生产总值和经济增长的经验研究”。他通过经济分析得出了著名的有关经济增长的六个基本的长期趋势,及平均为20年的各国经济增长的长周期。他对美国和其他国家的国民生产总值和国民收入的核算及统计的系统研究,为当代资本主义国家经济核算体系奠定了基础。1976年得奖者弗里德曼关于美国货币史的研究也是一种典型的统计经验分析。1984年斯通获奖也是因为“对建立国民收入核算体系及完善经验经济分析的基础做出了重大贡献”。该体系由国民收入和生
产账户、投入产出表、资产流量账户、国民资产负债表、国际收支平衡表五个部分组成,完整反映了整个国民经济的运动过程和结构状况,为制订一国的经济发展计划提供了有效的统计数据,是各类经济决策的重要依据,

也是建立一切宏观经济模型和进行计量分析的基础。可以说没有任何经济方法的创新比这种经验分析更为重要。如果没有斯通和库兹涅茨的工作,一切计量分析都是空的。

二 经济学的研究逐渐拓展到政治学、社会学、法学、心理学等领域,反映了其人文社会化的趋势

一些获得诺贝尔经济学奖的经济学家从政治学、法学、社会学和心理学等不同角度来分析经济问题,大大开阔了经济学的视野。缪达尔和哈耶克 1974 年共同获奖的原因之一就是“对经济、社会和政治制度相互依存关系的开创性研究”。他们强调经济和社会过程中制度、法律、政治和意识形态结构的重要性。缪达尔主张采用制度分析方法,对一国的经济、政治和社会问题进行综合研究,找出它们之间的相互关系。他把经济分析和社会学的观点结合起来,表明了社会、经济和政治力量如何相互作用,如何经常出现恶性的或良性的循环以及如何决定个人和社会集团的命运,这充分体现在他对美国黑人问题的权威研究和对南亚地区贫困和经济发展的研究。他主张“通过一种使计划与自由相结合、分散做出决定的制度来最大限度地增加社会财富,使最大多数人获得好处”,提出“福利国家”和“福利世界”的观点;赞同国家干预经济生活,通过国家计划来指导和调整人力资源和自然资源的分配,以增进公共福利,克服资本主义的“缺陷”;还强调发展中国家的特殊性。这些都是由他的分析方法自然演化出的结论。哈耶克则站在另一极

端,“对道德意义上的个人行为 and 包括政治体制、契约以及所有权的法律规范在内的制度结构的重要性给予了特别关注”。他强调价格体系传递信息和刺激的作用,认为经济决策所依据的信息和知识都分散在千万人的头脑中,集中计划的决策人根本无法掌握。因此他极力鼓吹自由主义,强烈反对凯恩斯为代表的国家干预主义和社会主义的计划经济。社会学家西蒙因“对经济组织内部的决策程序的开拓性研究”于1978年获奖,最出人意料之外,是经济学与社会学嫁接的一个典范。他从研究人的行为出发,认为由于信息不完全和风险不确定,传统经济学关于具有全知理性和追求最大利润的“经济人”假定是不现实的。他提出“有限理性”的“行政管理人”代替之,认为后者追求的只是适度的“令人满意”的利润而非最大利润。布坎南则恢复古典经济学的传统,将经济和政治挂钩,在经济学中引进了社会伦理、法律制度、财政制度和政治体制范畴,开创了公共选择理论,剖析了政府决策的形成及弊端,提出要消除“预算赤字永久化的政体”之弊病就须从根本上改变政治活动的规则的主张,这就使得人们考虑从政治角度来解决经济问题,从而填补了正统经济学的缺口。布坎南于1988年因此获奖。1991年获奖的科斯,一生所从事的大多是经济学与法学相交叉的边缘学科的研究。而他获得诺贝尔经济学奖的主要原因是“对于理解经济的制度结构取得了突破性进展”;“他发现和澄清了交易费用和财产权对经济的制度结构和运行的意见”。美国另一位经济学家贝克尔,则由于“把微观经济分析扩大到包括非市场行为

的人类行为和相互作用的广阔领域”而获得 1992 年度的诺贝尔经济学奖。

三 经济学在内容上也得到拓宽和深化

将经济分析的视野从一国扩展到世界,就产生了现在的国际经济学。1977 年同时获奖的瑞典经济学家奥林和英国经济学家米德就是因为“对国际贸易理论和国际资本流动理论做出了贡献”。奥林将微观经济理论拓展到国际领域,创立了现代国际贸易理论。他的代表作《区际和国际贸易》阐述了区际或国际分工和贸易的原因在于各国的生产要素资源禀赋及其相对价格上的差异,并分析了贸易对资源分配、收入分配和价格关系的影响,这大大发展了李嘉图的比较成本说。米德则是国际经济宏观理论与国际经济政策领域里的开拓者。他把凯恩斯的理论同传统的理论特别是一般均衡理论结合起来,对开放宏观经济理论进行了开创性的系统研究,特别分析了一国内部和外部经济之间的平衡关系以及相应的经济政策的目标和手段(财政政策、货币政策、价格调整)之间的关系。

发展经济学则是将微、宏观经济理论运用到分析发展中国家的经济问题。其创始人之一的刘易斯因为“对经济增长理论特别是第三世界国家经济发展理论的创造性研究”于 1977 年获奖。他提出了著名的“无限劳动供给下的经济增长”的“二元模式”,强调发展中国家的工业化应根据自己的国情,注重经济制度变革,积极发展农业、教育和国际贸易等。舒尔茨同年获奖也是因为

“对第三世界国家经济发展特别是农业发展所需要的人力资本投资作用的分析”。他从分析传统农业的技术停滞入手,确认技术进步是农业发展的关键,进而提出人力资本理论,强调教育和人力资源开发的重要性。这对传统微观经济学的资本观是一个突破。前边提到的北欧的经济学家弗里希、丁伯根、缪达尔、奥林对发展中国家的经济计划、财富和收入再分配、消灭贫穷等经济发展问题的研究,都有很大的贡献。

传统宏观经济学内部的深化,在上面曾提到的有希克斯将凯恩斯体系中分离的产品市场和货币或资产市场相结合,奠定了现代宏观经济学和宏观经济政策运用的基础。萨缪尔森将凯恩斯理论化,库兹涅茨和斯通奠定了宏观分析的经验统计基础,克莱因创立宏观经济计量学并运用于经济预测。此外,还有缪达尔和哈耶克的货币均衡和经济周期理论,从货币方面解释经济波动。弗里德曼关于消费决定的“永久性收入”理论和1985年获奖者莫迪利亚尼提出的“生命周期”储蓄理论,发展了凯恩斯建立在“绝对收入”假定之上的消费理论。库兹涅茨的经验论证,将凯恩斯的递减的消费倾向修正为宏观上和长期中的稳定的消费倾向。索洛在“哈罗德—多马模型”把凯恩斯的短期分析长期动态化的基础上,提出“新古典增长模型”,对资本、劳动和技术这些生产要素在经济增长中的作用加以区分,并论证由于劳动和资本之间的可替代性,充分就业的均衡增长长期中能得到保证。1981年获奖的托宾论证了货币需求对利率的敏感性,强调货币重要但不惟一重要,发展了凯恩斯的货币

理论及对货币政策的看法；他还创立了多种资产选择模型，将凯恩斯的债券和货币的两种资产选择扩展到货币与多种非货币资产间的选择；并强调资产的风险和不确定性，将凯恩斯的单一利率扩展到多种资产收益率；把自己的金融理论引入到凯恩斯的收入支出理论，分析和探讨了金融市场对消费、投资、价格、生产和就业的影响；另外他还把货币和通货膨胀纳入经济增长理论。弗里德曼则站在与凯恩斯主义对立的立场，创建了现代货币数量论，并加以大量的经验验证；他确认货币在短期中主要影响价格，次要影响产量和就业，在长期中则惟一影响价格；稳定经济惟一所需要的就是稳定的货币增长率政策，财政政策是无效的，政府的需求管理只会导致通货膨胀。弗里德曼的学说提高了人们对货币政策的认识。布坎南的“公共选择理论”从研究公共决策人所具有的“经济人”非理性行为入手，揭示了政府干预和“福利国家”的局限和缺陷，破除了人们对“理性”“公正”的政府的迷信，他还提出通过法制变革来约束政府的作为。布坎南开辟了宏观经济学的一个新领域。

传统微观经济学内部的深化除了前面曾论及的希克斯、阿罗、德布鲁、阿莱对一般均衡及福利理论的发展以及西蒙对追求最大利润的“全知理性人”的修正外，1982年获奖的施蒂格勒所创立的信息理论是一个重要发展。他认为信息是联系生产、交换、分配、消费的纽带，认为正统微观经济学假定经济当事人具有完备的市场知识、同一产品只有惟一的市场价格或由产品差异而引起的价格差别是不现实的。实际上信息是不完全的，正

是了解信息的成本太大才造成了同一种商品存在着不同的价格。莫迪利亚尼提出的不确定条件下公司资本成本理论也是对微观经济学关于投资决策的理论的一个发展。他认为对风险相同的企业来说,企业的成本与借入资本和股权资本二者的相对构成比例无关,因为股权资本的成本随着借入资本在总资本中所占比例的增加而增加(因不确定性和风险增加),为了股东的最大利益,企业投资与否决定于投资的收益是否大于或等于其加权的资本成本而非利率水平。前面提到的马科威茨建立并发展的证券选择理论、夏普对金融资产价格形成理论的贡献、米勒对公司理财理论以及公司在市场上的演化理论的贡献、贝克尔对劳动市场的差别待遇的分析等,都进一步丰富和发展了微观经济学。

综观 40 位获奖者的贡献,绝大多数都是在宏观经济领域取得的,所以宏观经济学相对于微观经济学是当代西方经济学家们的主战场,这从根本上来说是由西方国家的经济基础决定的(宏观经济问题更为突出,微观问题则由企业和个人有效地加以解决)。

四 围绕国家干预问题,既有斗争,又有妥协

第二次世界大战以后,以凯恩斯主义为代表的国家干预主义思潮占据西方经济学的统治地位,而那些信奉自由市场机制的效率、反对国家干预的学派的批评声音也一直没有停止过,而且有愈来愈大的趋势。这种情况也反映在诺贝尔经济学奖中。从 40 位获奖经济学家来看,有的是当代凯恩斯主义的代表人物,如:希克斯、萨

缪尔森、托宾、莫迪利亚尼、索洛、克莱因、米德等。他们发展了凯恩斯理论,确信政府必须而且能够运用财政、货币政策来稳定经济和再分配收入,以修正市场机制的缺陷。也有的对凯恩斯主义持激烈批判和反对的态度,如:哈耶克、弗里德曼、施蒂格勒、布坎南、阿莱、卢卡斯等。他们反对国家干预,从不同的侧面批判揭露政府干预的弊端,宣扬自由市场的有效性。介乎这两个对立学派之间的也都有一定倾向性。或是赞同用国家计划管理经济,主张财富再分配,以防止贫富悬殊,关心并致力于发展中国的经济发展研究;或是通过自己的研究为宏观管理提供依据和方法;或是附和对国家干预主义的批评。两派既有斗争,又有妥协。维护凯恩斯主义的新古典综合派,将凯恩斯的理论和新古典学派的理论综合起来,甚至吸收现代货币主义、理性预期学派、供给学派这些新老对手的理论,并将其纳入自己的理论体系,建立总供给总需求模型,以解释各种经济问题并提供对策。这种妥协折衷从根本上说是为了适应当代资本主义经济发展的需要。

五 理论研究贴近现实,为解决实际问题做出贡献

经济学是一门实用性很强的科学。因此,获奖者中有一大批对解决各种实际问题做出卓越贡献的经济学家。不少人都先后在政府部门担任要职,主持实际工作,或为政府在经济方面出谋划策。如美国的库兹涅茨和英国的斯通对国民收入统计做出开创性的贡献。他们在第二次世界大战时期,都曾在政府的经济统计部门工作