

1969-2014



诺贝尔经济学大师的 创新视角

邢丽娟 冯丽娜 苏惠芝 编著

*T*he Creative Achievement
from Laureates of
Nobel Prize
in Economic Sciences



◎策划编辑 汪 沁

◎责任编辑 汪 沁

◎封面设计 高联国

— — — — —

1969—2014

75 位获奖者

熠熠生辉的名字

卓越不凡的伟大成就

— — — — —

上架建议：经济学



定价：45.00 元

诺贝尔经济学大师的 创新视角

邢丽娟 冯丽娜 苏惠芝 编著

中国商务出版社

图书在版编目 (CIP) 数据

诺贝尔经济学大师的创新视角 / 邢丽娟, 冯丽娜,
苏惠芝编著. —北京: 中国商务出版社, 2015. 3
ISBN 978-7-5103-1243-4

I. ①诺… II. ①邢…②冯…③苏… III. ①诺贝尔
经济学奖—经济学家—介绍—世界 IV. ①K815. 31

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2015) 第 059220 号

诺贝尔经济学大师的创新视角

The Creative Achievement from Laureates of Nobel Prize in Economic Sciences

邢丽娟 冯丽娜 苏惠芝 编著

出 版: 中国商务出版社
发 行: 北京中商图出版物发行有限责任公司
社 址: 北京市东城区安定门外大街东后巷 28 号
邮 编: 100710
电 话: 010 - 64245686 64515140 (编辑二室)
010 - 64266119 (发行部)
010 - 64263201 (零售、邮购)
网 址: <http://www.cctpress.com>
网 店: <http://cctpress.taobao.com>
邮 箱: cctp@cctpress.com cctpress1980@163.com
照 排: 北京开和文化传播中心
印 刷: 北京中献拓方科技发展有限公司
开 本: 787 毫米 × 980 毫米 1/16
印 张: 20.75 字 数: 336 千字
版 次: 2015 年 4 月第 1 版 2015 年 4 月第 1 次印刷
书 号: ISBN 978-7-5103-1243-4
定 价: 45.00 元

版权专有 侵权必究

盗版侵权举报电话: 010 - 64245984

如所购图书发现有印、装质量问题, 请及时与本社出版部联系。电话: 010 - 64248236

序 言

诺贝尔奖是世界上最著名、学术声望最高的国际大奖。它是以瑞典化学家诺贝尔遗赠的基金设立的，共分物理学奖、化学奖、生理学或医学奖、文学奖、和平奖五项，1901 年首次颁奖。1968 年，瑞典中央银行增设一项经济学奖（1969 年首次颁发）。六项奖都是每年颁发一次，包括一枚金质奖章、一张奖状和一笔数额巨大的奖金（900 万美元基金的利息和投资收入，1990 年起金额约为 65.3 万美元）。每年 12 月 10 日即诺贝尔的逝世纪念日，在瑞典首都斯德哥尔摩的音乐大厅举行庄严隆重的授奖仪式，由瑞典国王授奖。这已成为国际上一种最高荣誉，激励着一代又一代的学者为之奋斗，推动着人类文明的发展。

诺贝尔奖自颁发以来，科学奖的颁发很少有争议，因为它代表了几十年来上述几个科学领域的发展方向。文学奖与和平奖往往存在意见分歧，和平奖经常空缺。

诺贝尔经济学奖，全称是“瑞典国家银行纪念阿尔弗雷德·诺贝尔经济学奖”。这项世界性的经济学大奖是瑞典中央银行于 1968 年在其成立 300 年之际设立的。每年 10 月，由瑞典皇家科学院遴选该年度诺贝尔经济学奖获得者。评选原则是：将奖金授予在经济科学研究领域做出有重大价值的贡献的人；坚持经济研究多元化的方针；优先奖励那些早期做出重大贡献者。此外，让更多的人获奖，瑞典皇家科学院还经常把两人或三人放在一起同时授奖，原则是他们在某一方面的研究成果紧密相关或是合作研究的结果。

多年来，许多诺贝尔经济学奖获得者在国际联盟和联合国及其专门的经济机构中任职，在外国，特别是在发展中国家担任专家和经济顾问，在本国总统府或政府顾问小组担任要员。他们在实践中运用和检验自己的经济理论及系统研究方法。他们不仅扮演经济咨询顾问的角色，而且起着政治家的重



要作用。研究和借鉴诺贝尔经济学奖获得者的创新理论与方法，对世界经济的繁荣与发展必将产生巨大影响。

本书介绍了诺贝尔经济学奖自颁发以来各年度获奖者的理论创新及学术研究成果，他们每个人无不成功付出了艰苦的努力，每个人的创新成果也在现实经济活动中不断得到实践，并推动了社会经济制度的日益完善和社会经济运行的良性循环与发展，改变了人们对各种传统经济问题的认识，增强了人们对各种新生经济事物的探讨和研究，促进了经济社会的不断进步和发展。因此，每位获奖者的创新理论和研究成果必将不断指导人们探索新问题，解决新难题，为世界经济的日益繁荣和人类社会的持续进步做出巨大贡献。

本书在写作过程中，得到了姚燕和尉捷两位同志的大力帮助，在此表示深切的感谢！

作 者

2014 年 12 月 28 日

目 录

1969 年

经济计量学奠基人——拉格纳·弗里希 / 1

经济计量学模式建造者——简·丁伯根 / 5

1970 年

凯恩斯主义的集大成者——保罗·安·萨缪尔森 / 12

1971 年

美国 GNP 之父——西蒙·史密斯·库兹涅茨 / 19

1972 年

一般均衡理论模式的创建者——约翰·理查·希克斯 / 24

一般均衡理论的贡献者——肯尼斯·约瑟夫·阿罗 / 31

1973 年

投入产出分析方法的创始人——华西里·里昂惕夫 / 38

1974 年

奥地利经济学派的主要代表——弗里德里希·奥古斯特·冯·哈耶克 / 41

货币和经济波动理论的先驱——纳纳·缪达尔 / 46

1975 年

苏联诺贝尔经济学奖第一人——列奥尼德·康托罗维奇 / 52

线性规划经济分析法的创立者——佳林·库普曼斯 / 58



1976 年

货币主义大师——米尔顿·弗里德曼 / 62

1977 年

现代国际贸易理论创始人——戈特哈德·贝蒂·俄林 / 65

国际经济宏观理论与政策开拓者——詹姆斯·爱德华·米德 / 69

1978 年

经济组织决策管理大师——赫伯特·亚历山大·西蒙 / 74

1979 年

发展经济学的成就者——威廉·阿瑟·刘易斯 / 80

人力资本概念之父——西奥多·舒尔茨 / 86

1980 年

经济计量学之父——劳伦斯·罗伯特·克莱因 / 91

1981 年

资产组合选择的开创者——詹姆士·托宾 / 96

1982 年

信息经济学创始人——乔治·约瑟夫·斯蒂格勒 / 99

1983 年

经济社会均衡存在定理的创立者——罗拉尔·德布鲁 / 102

1984 年

国民经济统计之父——约翰·理查德·尼古拉斯·斯通 / 105

1985 年

家庭储蓄的生命周期假说的提出者——弗兰克·莫迪利安尼 / 108

1986 年

公共选择理论奠基人——詹姆斯·麦基尔·布坎南 / 113

1987 年

新古典经济增长理论的贡献者——罗伯特·默顿·索洛 / 119

1988 年

市场理论和最大效率理论的杰出贡献者——莫里斯·阿莱斯 / 122

1989 年

经济计量学的杰出贡献者——特里夫·哈维默 / 127

1990 年

莫迪利安尼-米勒定理的发现者——默顿·米勒 / 130

金融经济学理论先驱——哈里·马科维茨 / 133

资本资产定价模型的奠基者——威廉·夏普 / 136

1991 年

交易成本理论及科斯定理的提出者——罗纳德·哈里·科斯 / 138

1992 年

开拓经济新视野的先驱者——加里·贝克尔 / 142

1993 年

新制度经济学的创始人——道格拉斯·诺斯 / 144

新经济史学之父——罗伯特·福格尔 / 148

1994 年

均衡博弈之父——约翰·福布斯·纳什 / 152

博弈论经济分析先驱者——约翰·海萨尼 / 155

子博弈精炼纳什均衡的创立者——莱因哈德·泽尔滕 / 159

1995 年

理性预期学派大师——罗伯特·卢卡斯 / 163

1996 年

激励理论奠基者——詹姆斯·莫里斯 / 169

信息经济学奠基者——威廉·维克瑞 / 175

1997 年

期权定价理论的贡献者——罗伯特·默顿 / 179

期权定价公式的设计者——迈伦·斯科尔斯 / 185



1998 年

福利经济学大师——阿马蒂亚·森 / 189

1999 年

欧元之父——罗伯特·蒙代尔 / 194

2000 年

微观计量经济学的开创者——詹姆斯·赫克曼 / 199

现代微观经济学创始人——丹尼尔·麦克法登 / 205

2001 年

信号理论之父——乔治·阿克洛夫 / 209

信号传递模型贡献者——迈克尔·斯宾塞 / 212

信息经济学大师——约瑟夫·尤金·斯蒂格利茨 / 215

2002 年

实验经济学研究奠基人——弗农·洛马克斯·史密斯 / 218

行为经济学和实验经济学的先驱者——丹尼尔·卡尼曼 / 220

2003 年

经济时间序列分析大师——罗伯特·恩格尔 / 226

计量经济学大师——克莱夫·格兰杰 / 230

2004 年

传统的颠覆者——芬恩·基德兰德 / 233

新经济周期理论之父——爱德华·普雷斯科特 / 236

2005 年

决策制定理论大师——罗伯特·约翰·奥曼 / 239

“周游不定的经济学家”——托马斯·谢林 / 246

2006 年

现代宏观经济学的缔造者——埃德蒙德·菲尔普斯 / 248

2007 年

机制设计理论的贡献者——埃里克·马斯金 / 253

博弈论大师——罗杰·迈尔森 / 255

年纪最大的诺贝尔奖得主——莱昂尼德·赫维奇 / 259

2008 年

新一代经济大师——保罗·克鲁格曼 / 262

2009 年

首位女性诺贝尔经济学奖获得者——埃莉诺·奥斯特罗姆 / 266

“新制度经济学”的命名者——奥利弗·伊顿·威廉姆森 / 271

2010 年

世代交叠模型提出者——彼得·戴蒙德 / 278

劳动经济学大师——戴尔·莫滕森 / 283

搜寻摩擦理论的提出者——克里斯托弗·皮萨里德斯 / 285

2011 年

理性预期学派的领袖——托马斯·萨金特 / 288

现代计量经济学的领路人——克里斯托弗·西姆斯 / 292

2012 年

市场设计修复者——埃尔文·罗斯 / 295

“沙普利值”的创立者——罗伊德·沙普利 / 298

2013 年

金融经济学领域的思想家——尤金·法玛 / 302

广义矩阵法的提出者——拉尔斯·彼得·汉森 / 307

行为金融学领域的奠基人——罗伯特·希勒 / 311

2014 年

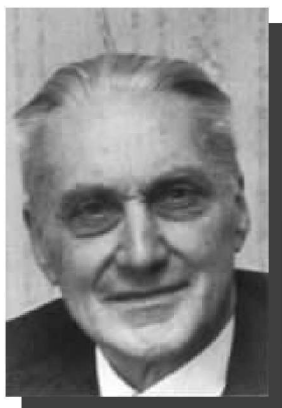
寡头垄断监管理论的贡献者——让·梯若尔 / 315

1969 年

经济计量学奠基人



拉格纳·弗里希



拉格纳·弗里希（Ragnar Frisch，1895 年 3 月 3 日—1973 年 1 月 31 日），1895 年 3 月 3 日生于挪威奥斯陆，是数理经济学和经济计量学研究领域的先驱者，主要致力于长期经济政策和计划，特别是关于发展中国家的问题。弗里希教授发展了经济规划的决策模型，设计了设法利用现代计算机技术的数学规划方法。他首先提出了经济计量学的定义，并第一个运用经济计量学的方法分析资本主义的经济波动，首创描述资本主义经济周期的数学模型，最早把导致经济波动的因素区分为扩散作用和冲击作用两大类，并将两者结合起来解释资本主义

经济周期，为当代经济周期理论奠定了重要基础。他在把经济计量学的理论和方法应用于社会经济活动方面，也做出了许多贡献。由于他在经济计量学及其应用方面做出的贡献，1969 年，他和简·丁伯根一起荣获首届诺贝尔经济学奖。

学术创新及主要贡献

弗里希作为经济计量学“三合一”的开山之祖而最负盛名。“三合一”



即把经济理论、数理方法和统计学应用于实际经济问题的分析中。经济计量学是弗里希创造的一个名词，也在经济学的许多领域均有广泛的影响。

1. 微观经济学

弗里希的一些早期文献论述了效用理论和指数理论的基本原则。他的早期论文《经济理论中的消费问题》（1926）探讨了消费者选择的一个公理。他假定订购一种商品转向订购另一种商品是有序的，由此他推导出一种效用函数，这是唯一适合递增线性转换的函数。除了研究效用函数外，他还承担了测算实际效用的开拓工作。这一研究成果在他的《测量边际效用的新方法》（1932）一书中得到体现。后来，经济学家们偏爱效用的普通方法而不是他的基本效用函数。在1936年的一篇著名论文《一般经济理论的年度评述：指数问题》中，弗里希进一步阐述了这样的思想：在两种不同的情况下，价格指数能够被成本率限定以达到特定的效用水平。

弗里希早期的另一个重要研究，是在传统微观经济学核心的生产理论领域方面。这一研究最后引导他创立了著名的数学规划，即不必受最小（或最大）限制因素所约束的最优化学科。

在学术生涯的后一阶段，他转向需求分析，并在1959年的一篇论文中提出了“一个在具有多种成分的模型中测算所有直接的交叉需求弹性的完整系统”。在这个系统中，货币的边际效用可以依赖于价格水平，并且需求弹性与货币弹性（货币边际效用弹性）之间具有简明的关系。

2. 经济动态学

授予弗里希和丁伯根诺贝尔奖时，诺贝尔奖评选委员会特别参考了他们的有关经济动态学方面的研究成果，这是弗里希通过用经济观点来解释经济周期时发现的一个领域。他早期在这个领域的研究中认识到，只用加速原理不能解释经济周期的高层转折，不同经济周期的转折点的经验性比较也不能简单地用一种动态关系，而需要用一个完全动态的系统来加以解释。他的经典文献是1933年发表的《动态经济学的传播和推动问题》一文。该文指出一个经济周期能够通过一个持久性随机振动模型进行解释，他建议最好是一种熊彼特式的模型。这个模型与凯恩斯的经济周期和宏观动态分析有某些相似性。后来，他对此做了更具体的阐述。

弗里希1936年发表的《论均衡和非均衡概念》一文在该领域进行了另一个重要的创新，为动态经济学方法论的建立和有关术语的形成做出了很大贡

献。有关动态经济学的其他研究成果还包括《论解决经济学中出现的混合差和微分方程的技术问题》（1935）、《银行活动中的反周期管理方法》（1936）、《两个经济变量的图示分析》（1937）和《经济周期理论要素的一般分析》（1947）等。

3. 经济计量方法论

估计经济关系的方法的选择对弗里希来说是很有吸引力的。他从观察中认识到，经济学家通常不得不进行“被动观察，当一个巨大的决定系统中的所有方程实际上已经被同时运用时，调查者对发生的事物的观察必定受到限制”。

这个“观察”有两个含义。第一，有鉴于经验数据的统计分析是一个独立变量的自然选择，那么，在经济关系的估计中不必这样做。结果，古典回归分析的独特估计者不再受到赏识。第二，当系统中的所有方程被相互联系和同时运用时，弗里希承认 k 维变量之间的关系处在一个受限制的变量域中——不受限制的只有维 $k-1$ ，但这种情况甚少。这意味着在任何经济关系上要分离不同变量的影响是困难的。

弗里希在《供求曲线的统计结构存在的圈套》（1933）一书中阐述了第一个问题。他考虑一个二维的价格和数量分布图应该怎样被解释，作为需求曲线、供给曲线，抑或两者间的什么。第二个问题是在他的古典著作《运用完全回归系统的统计合流分析》（1934）中加以阐述的，该书进一步体现了他的一些未发表的文稿的思想。

4. 经济周期的动态模型

弗里希的模型有三个关键要素：有关资本启动、消费增长的加速机效应；资本启动与资本完成之间的酝酿期；消费与库存现金之间的关系。这三个要素是弗里希能够建立起经济周期的动态模型的基础。这个模型由混合的差分—微分方程构成，这比稍后的动态模型中标准的差分或微分方程更难解决。弗里希没有回避这个技术难题，而是着手把它处理了。每个要素在模型中均起关键性作用。

但是，像弗里希观察到的那样，周期几乎恒定衰减，以至于倾向瓦解，这个与实际存在的周期不衰减并不相符。不过他认为，主要模型对“传播”问题（振幅系统的结构特性）提供了一个满意的解释，只是没能解释“推动问题”（振动系统的源流）。对存在持续性周期的解释方面，弗里希强调经济关系中随机干扰的重要性。实际上，他的分析在某一个要点上与熊彼特的创造性分



析有关，熊彼特的分析也强调了振荡体系本身是该体系产生振动的根源。

弗里希将 20 世纪 30 年代的这一研究成果应用到对经济周期的广泛研究中是有意义的。早期的经济周期研究分成两个阵营：米切尔的制度经验学派和凯恩斯的理性学派。弗里希在 20 世纪 30 年代初的研究成果实际是假设了一种不同的研究方案。他并不满意用纯理性的方法去解决这个问题，因为那种方法没有把统计材料与他们的理论结合起来。同时，他对制度学派的经验研究也感到灰心丧气，因为这种研究“如果不靠理论分析加以阐述将一无所获”。

鉴于这种情况，弗里希把经济计量方法应用到经济分析中。他试图把经济、数学和统计分析结合在一起阐明经济问题。目前，弗里希有关“传播”和“推动问题”的论文，在非数理经济学家和建立了经济周期的研究学派及其拥护者中获得了广泛的重视。

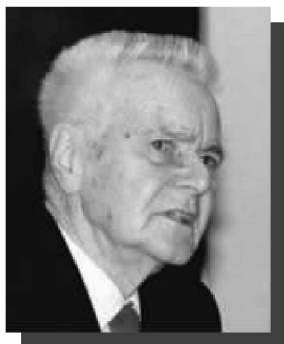
重要论著

- 《经济理论中的消费问题》（1926）；
- 《测量边际效用的新方法》（1932）；
- 《动态经济学的传播和推动问题》（1933）；
- 《供求曲线的统计结构存在的圈套》（1933）；
- 《运用完全回归系统的统计合流分析》（1934）；
- 《论解决经济学中出现的混合差和微分方程的技术问题》（1935）；
- 《论均衡和非均衡概念》（1936）；
- 《银行活动中的反周期管理方法》（1936）；
- 《两个经济变量的图示分析》（1937）；
- 《经济周期理论要素的一般分析》（1947）；
- 《生产理论》（1965）；
- 《定量、动态政治经济学》（1974）；
- 《经济计划研究论文集》（1976）。

经济计量学模式建造者



简·丁伯根



简·丁伯根（Jan Tinbergen，1903年4月12日—1994年6月9日），出生于荷兰海牙的知识分子家庭，从小受到良好的教育，在家庭的影响下，他不仅对学术研究颇感兴趣，而且对社会问题也相当关心。19岁（1922年）时，丁伯根考入了荷兰莱顿大学，攻读物理学，23岁毕业后，经过三年的努力，于1929年获得物理学博士学位。但是，就在这时，他的志趣已经不在物理学方面，而是转到经济学方面了。简·丁伯根将统计应用于动态经济理论，他发展了动态模型来分析经济进程，被誉为“经济计量学模式建造者之父”。由于他的科研成就，1969年他与拉格纳·弗里希共同获得诺贝尔经济学奖。

学术创新及主要贡献

1. 经济计量学模型

1936年，丁伯根创立了一个具有24个联立方程式的荷兰经济模型。他相信联立方程是反映大量不同性质的经济活动水平相互依存关系的最好手段。

丁伯根创建的模型涵盖与凯恩斯学派相一致的收入形成和消费支出方程式。模型中的消费是一个可支配收入的函数，并把商品和劳务的需求作为影响经济活动总水平的主要因素。他的模型还包括出口与进口，将货币流量分