

Outstanding Academic Works on Economics By Nobel Prize Winners
诺贝尔经济学奖获奖者学术精品自选集



THEORY OF VALUE AND MATHEMATICAL ECONOMICS:

TWENTY PAPERS OF GERARD DEBREU

by

GERARD DEBREU

价值理论及 数理经济学的 20篇论文

[美] 吉拉德·德布鲁 著
杨大勇 腾飞 译



首都经济贸易大学出版社

7-0217-07
73.5
THEORY OF VALUE AND MATHEMATICAL ECONOMICS:
TWENTY PAPERS OF GERARD DEBREU

价值理论及 数理经济学的 20 篇论文

[美] 吉拉德·德布鲁 著
杨大勇 腾飞 译

 首都经济贸易大学出版社

Theory of Value

© Cowles Foundation for Research in Economics at Yale University

Mathematical Economics: Twenty Papers of Gerard Debreu

© Cambridge University Press

根据 Cowles Foundation for Research in Economics at Yale
University 1959 年版和 Cambridge University Press 1983 版翻译

图书在版编目(CIP)数据

价值理论及数理经济学的 20 篇论文/(美)德布鲁(Debreu, G.)著;杨大勇等译. —北京:首都经济贸易大学出版社, 2002. 5
(诺贝尔经济学奖获奖者学术精品自选集)

书名原文: *Theory of Value and Mathematical Economics: Twenty Papers of Gerard Debreu*

ISBN 7-5638-0900-7

I. 价… II. ①德… ②杨… III. ①价值论-文集 ②数理
经济学-文集 IV. ①F031.3-53②F224.0-53

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2002)第 029266 号

首都经济贸易大学出版社出版发行

(北京市朝阳区红庙)

北京宏飞印刷厂印刷

全国新华书店经销

850 毫米×1168 毫米 32 开本 16 印张 410 千字

2002 年 5 月第 1 版 2002 年 5 月第 1 次印刷

ISBN 7-5638-0900-7/F·503

著作权合同登记号

图字:01-1999-1359 号

定价:38.00 元

出版说明

1968年在瑞典中央银行成立300周年之际,为纪念诺贝尔奖奖金提供者,由时任行长艾斯伯林克等人倡议,并经瑞典皇家科学院批准,设立了“纪念阿尔弗雷德·诺贝尔瑞典中央银行经济学奖”。该奖由瑞典皇家科学院委任的5~8名经济学家组成“经济科学委员会”(即奖项委员会),负责在全球范围内对入围的经济学家进行遴选并将评选意见提交科学院社会科学部,最终确定桂冠的得主。由于该奖项与诺贝尔遗嘱所设立的物理学奖、化学奖、生物医学奖、文学奖以及和平奖以同样的时间、同样的奖金额颁发,故被世人习惯地称为“诺贝尔经济学奖”。

1936年,英国经济学家约翰·梅纳德·凯恩斯发表了划时代的名著——《就业利息和货币通论》,标志着现代经济学的诞生。然而,在诺贝尔经济学奖设立以前,人们对能否称经济学为科学尚怀有极大的疑问,即使在艾斯伯林克等人提出设立经济学奖时,也遭到许多名人的反对。他们认为,经济学作为一门社会科学,以它的

价值判断为基础,其成就难以用一定的客观标准来衡量。因此,尽管经济学的研究成果在促进人类文明、推动社会进步方面已显示出极大的作用,但并未得到人们的足够重视。诺贝尔经济学奖的设立,首次使经济学奖与物理学奖、化学奖、生物医学奖、文学奖以及和平奖并驾齐驱,每年颁发给在经济学的研究领域作出杰出贡献的人士。它的设立,对经济学在门类众多的学科中确立自己应有的地位具有极为重要的作用。

今天,诺贝尔经济学奖已被世人极为关注,尤其在经济学界更被奉为至尊。从 1969 年首次颁奖起,诺贝尔经济学奖至今已颁发了 31 届,共有 44 位经济学家获此殊荣。获奖经济学家的研究成果可谓集西方经济理论之大成,几乎囊括了二战后西方经济学的主要研究成果,对西方经济学的发展具有积极、重要的影响。

西方经济学研究了市场经济条件下经济发展的基本规律,对各国在市场经济发展过程中的经验和教训进行了科学的归纳和总结。作为人类经济思想的精华,其成果是全人类共同的宝贵财富。从这个意义上讲,其对中国建立健全市场经济体系,加速经济发展具有无可辩驳的借鉴作用。因此,我们应注意研究和学习西方经济学,并在批判吸收的基础上创立有中国特色的社会主义经济理论。这也是我们出版本丛书的初衷。

考虑到许多获奖者笔翰如流,著作等身,为使收入到丛书中的作品更具权威性,我们采用了由获奖者自己

选择作品的方式确定书目。对那些业已仙逝的获奖者,则邀请其家人、同事、学生或国内专家学者代为确定作品。尽管这样做使得我们的工作变得异常艰辛,但这却是本丛书的特点及价值所在。

在本丛书面世时,我们由衷地感谢那些为本丛书的出版提供过帮助的机构和人士,他们是:瑞典驻华大使馆文化处、美国驻华大使馆文化处及杨更琪先生、法国驻华大使馆文化处、英国驻华大使馆文化处、挪威驻华大使馆文化处、荷兰驻华大使馆文化处、爱立信(中国)有限公司业务开发及礼宾事务经理刘国来先生、瑞典皇家科学院经济科学委员会及托尔斯滕·珀森先生、北京大学图书馆沈正华女士等。没有他们卓有成效的工作,本丛书的顺利出版是不可想像的。我们还要感谢北京市新闻出版局及有关领导,他们对出版本丛书的支持为我们出好丛书提供了保证。我们更要感谢欣然允诺担任本丛书顾问及编委的学者们,他们的亲切指导,特别是为我们推荐能够胜任翻译工作的译者,对保证丛书质量起了关键作用。此外,我们还要感谢许许多多帮助过我们的朋友们。

我们希望本丛书能得到中国广大读者的承认,如果是那样,我们将深感欣慰。

出版者

2000年3月

诺贝尔经济学奖获奖者学术精品自选集

丛书编辑委员会

(以姓氏笔画为序)

顾 问	王宏昌 张理泉 高鸿业	厉以宁 范家骧 董辅初	李京文 胡代光	吴易风 陶大镛
编 委	丁 冰 刘 伟 何宝玉 金 碚 盛 洪	王则柯 李庆云 茅于軾 周嘉硕	冯 虹 张一弛 林 岗 梁小民	平新乔 张维迎 林毅夫 海 闻

策划工作室

总策划	刘 红	薛 捷		
成 员	陈文冰	陈 侃	周义军	杨 玲

为《诺贝尔经济学奖获奖者学术精品自选集》所作的序言

1968年,瑞典银行(Sverigs Riksbank)在其300周年志庆活动时宣布设立一个新的奖项,即“纪念阿尔弗雷德·诺贝尔瑞典中央银行经济学奖”,并承诺对该奖项提供永久支持。

同时,瑞典皇家科学院承担了与自1901年起开始运作的诺贝尔奖完全相同的程序来对获奖者进行评选的任务。这样,每年年初科学院都会收到250~300个提名建议,通常涵盖多达百名以上的候选人(未经邀请主动提名的个人没有计算在内)。科学院奖项委员会(成员5~8名)首先对世界各地的候选人进行专业评估,然后,再以报告的形式将奖励意见提交给科学院社会科学部(The Social Science Class of the Academy)。最后,科学院的全体成员要在10月份齐集一堂,以决定奖项的最终归属。

本奖项的评选原则与诺贝尔奖完全一致,完全遵循

阿尔弗雷德·诺贝尔的遗愿——奖励在其所处领域有最为重大发现、发明或发展的科学家。在实践中,这就意味着要考虑到参选者学术成果的独创性、在理论与实践当中的重要性及其对科学工作的影响。科学院及奖项委员会也在一定程度上考虑到了候选对象及其学术成果对社会的影响,包括其对公共政策的影响。

在本奖项设立后的前 30 年里,科学院及奖项委员会对“经济科学”一词采取了相当广泛的理解。因此,奖励对象涉及经济学邻近学科的很多重大科学成就。有几个奖项实际上是授予了“跨学科研究”的成果,处于经济学、政治学、社会学及历史学等学科的交叉点。

本奖项设立后 30 年的运行也反映出本世纪下半叶经济学研究的特点与走向。首先,获奖情况清楚地表明美国在这一领域的优势地位。43 名获奖者中,有 28 人是美国公民,尽管其中 4 人,即里昂惕夫(Leontief)、库普曼斯(Koopmans)、德布鲁(Debreu)和哈萨尼(Harsanyi)的出生地及受教育地均非美国。其他获奖者来自英国(6 人),瑞典、挪威(各 2 人),法国、印度、荷兰、前苏联、德国(各 1 人)。获奖一人次以上的大学有:芝加哥大学(8 人)、哈佛大学(4 人)、剑桥大学(4 人)、麻省理工学院(3 人)、伯克利大学(2 人)、奥斯陆大学(2 人)、普林斯顿大学(2 人)、斯坦福大学(2 人)、耶鲁大学(2 人)。

在获奖成果的内容方面,经济分析中的演绎法与数

学公式化表述成为其显著特征。例如,萨缪尔森(Samuelson)、希克斯(Hicks)、阿罗(Arrow)、库普曼斯、康托罗维奇(Kamtorovich)、德布鲁、阿莱斯(Allais)等人的获奖,还有金融经济学方面的获奖者马克威茨(Markowitz)、米勒(Miller)、夏普(Sharpe)、默顿(Merton)和斯科尔斯(Scholes),以及博弈论研究方面的获奖者哈萨尼、纳什(Nash)、泽尔滕(Selten)等。

20 世纪下半叶,经济学研究的趋势和特点之二是包括系统统计测试或评估等在内的定量研究法变得越来越重要。这主要反映在授予弗里希(Frisch)、丁伯根(Tinbergen)、里昂惕夫、克莱因(Klein)、斯通(Stone)、哈维尔莫(Haavelmo)等人的奖项上。实际上,在过去 10 年间,定量研究领域的硕果涉及了大量的数据,如果没有分析技术手段的发展(如计量经济学、投入—产出分析、程序编制、高能计算机等的发展和应用),要想取得这样的成就几乎是不可能的。

本奖项还反映出二战后宏观经济学的重要作用。在此,我们应特别注意弗里德曼(Friedman)、克莱因、托宾(Tobin)、莫迪利亚尼(Modigliani)、索洛(Solow)和卢卡斯(Lucas)等人的成就。一些研究经济体系的新方法得到了认同,这反映在奖项授予信息经济学[米尔利斯(Mirrlees)、威克里(Vickery)]、人力资源[贝克尔(Becker)]和博弈论等研究课题上。定量研究法在经济史学研究中的不断上升的重要作用表现在库兹涅茨

(Kuznets)和福格尔(Fogel)的获奖上。同样,发达国家和发展中国家经济中的制度的重要作用则体现在授予冯·哈耶克(Von Hayek)、布坎南(Buchanan)、科斯(Coase)和诺斯(North)等人的几个奖项上。对经济发展不同方面的研究成果的奖励则授予了缪尔达尔(Myrdal)、刘易斯(Lewis)、舒尔茨(Scholtz)和森(Sen)等人。

据我所知,此套丛书是首次尝试系统地出版所有获奖者的重要著作。丛书的出版本身就具有重大的意义,在中国面世其意义更加深远。我希望它的出版不仅有助于经济学的发展,而且能直接推动中国经济的发展。

奖项委员会秘书

托尔斯滕·珀森

1999 年 7 月,于斯德哥尔摩

目 录

一、价值理论

序言.....	5
1 数学	9
1.1 引言(9) 1.2 集合(11) 1.3 函数和对应(14)	
1.4 预序关系(17) 1.5 实数(21) 1.6 R^m 中的极限(23)	
1.7 连续函数(28) 1.8 连续的对应(30)	
1.9 R^m 中的向量(34) 1.10 不动点(42)	
— 注释(43)	
2 商品和价格.....	45
2.1 引言(45) 2.2 时间和地点(46) 2.3 货物(47)	
2.4 服务(48) 2.5 商品(50) 2.6 价格(50)	
2.7 利息率、贴现率和汇率(52) 2.8 理论和释义(54)	
— 注释(54)	
3 生产者.....	56
3.1 引言(56) 3.2 生产和生产集(57) 3.3 关于生产集的假设(59)	
3.4 利润最大化(63) 3.5 价格变	

化(68) - 注释(70)	
4 消费者.....	71
4.1 引言(71) 4.2 消费和消费集(72) 4.3 关于消 费集的假设(74) 4.4 偏好(76) 4.5 偏好的不履性 假设(78) 4.6 偏好的连续性假设(78) 4.7 偏好的 凸性假设(83) 4.8 财富约束(86) 4.9 偏好满 足(90) 4.10 价格-财富变化(97) - 注释(98)	
5 均衡	100
5.1 引言(100) 5.2 资源(101) 5.3 经济(101) 5.4 可达状态(103) 5.5 私有制经济(105) 5.6 市 场均衡(107) 5.7 均衡(112) - 注释(118)	
6 最优	120
6.1 引言(120) 6.2 最优与相对于价格体系的均 衡(121) 6.3 相对于价格体系的均衡是最优(126) 6.4 最优是相对于价格体系的均衡(127) - 注 释(128)	
7 不确定性	130
7.1 引言(130) 7.2 事件(130) 7.3 商品和价 格(131) 7.4 生产者(132) 7.5 消费者(133) 7.6 均衡(134) 7.7 最优(135) - 注释(135)	
《价值理论》参考文献.....	137
《价值理论》中英文索引.....	147
1. 符号索引	147
2. 术语中英文索引	150

3. 人名索引	166
---------------	-----

二、数理经济学的 20 篇论文

致谢	173
导言	177
1 资源利用系数	213
2 社会均衡的存在性定理	237
3 一个经典的税收与补贴问题	247
4 竞争性经济的均衡存在性	260
5 价值均衡与 Pareto 最优	298
6 用数字函数表示偏好序	309
7 市场均衡	317
8 不确定性下的经济学	322
9 基数效用理论中的拓扑方法	328
10 均衡分析的新概念和新技巧	344
11 经济的核的极限定理	368
12 Pareto 效用的连续性	383
13 相邻经济主体	395
14 有限均衡集经济	402
15 光滑偏好	411
16 超额需求函数	432
17 经济的核的收敛速度	442
18 经济均衡数学理论的四个方面	451
19 微分拓扑经济应用及全局分析:正则微分经济	470

XII 价值理论与数理经济学的 20 篇论文

20 最小凹效用函数.....	482
Debreu 主要作品年表	493
译者后记.....	499

价值理论

