

媒体聚焦诺奖之赫维茨

诺贝尔经济学奖揭晓,年届九旬的赫维奇形容自己的获奖心情是“又惊又喜”,他认为属于他的时光已经逝去。事实上,他所开创的机制设计理论对于当下中国的经济改革开放和社会制度转型都具有十分重要的现实意义。笔者整理出国内媒体对于赫维茨的一些报道,希望对老先生有一个全景的展现。当然,要想对他更深入的了解,还要钻到老先生所做的学问中去。

<第一财经日报>赫维奇耄耋之年 诺贝尔经济学奖不期而至:

对机制设计理论在福利经济学中应用尤感高兴

<http://www.china-cbn.com/s/n/000005/20071017/000000080936.shtml>

王慧卿

编者按

90岁的赫维奇(Leonid Hurwicz)、57岁的马斯金(Eric S. Maskin)和56岁的迈尔森(Roger B. Myerson)分享了2007年诺贝尔经济学奖。他们是“机制设计理论”的开创者和发展者。

目前,他们分别任教于明尼苏达大学、芝加哥大学以及普林斯顿高等研究中心。这三位美国经济学家将分享1000万瑞典克朗(约合154万美元)的奖金。

赫维奇(Leonid Hurwicz)成了所有获得诺贝尔经济学奖的人当中年龄最高的一位。而在诺贝尔经济学奖候选人名单上,赫维奇的名字已经出现二十多年了。

去年诺奖公布之前,就有人预测说,赫维奇绝对有获得诺奖的资质,但是他永远也不会获得这个奖项。毕竟,1917年出生在莫斯科的他,已经年届90。然而,正是在赫维奇庆祝90大寿后不久,诺贝尔经济学奖终于不期而至。

“我还以为我的时代已经过去。对于获诺贝尔奖来说,我实在太老了。”15日在得知自己获奖后,赫维奇在位于美国明尼那波利斯的家中说,“不过这笔奖金对一个已退休的老人的确不无补益。”

“我是通过倾听和自修来学习经济学的”

按照惯例,诺贝尔奖网站总编亚当·史密斯在奖项公布后通过电话对赫维奇进行了简短的采访。史密斯告诉赫维奇,他是诺贝尔奖历史上所有获奖人中年龄最大的。赫维奇的妻子伊夫林·赫维奇转述了一遍史密斯的话,然后问赫维奇:“你为自己活了那么长而高兴吗?”随之,两人一齐大笑。

的确,赫维奇的诺奖来得有些迟。在他获奖之前,2000年他的学生丹尼尔·麦克法登(Daniel L. McFadden)就因为“对分析离散选择的原理和方法所作出的发展和贡献”,与詹姆斯·J.赫克曼共同获得了诺贝尔经济学奖。

而在1996年,应用赫维奇开创的“机制设计理论”的基本概念和原理,开创信息经济学领域的“委托-代理理论”的米尔利斯和维克瑞也获得了诺贝尔经济学奖。

不过,除诺贝尔经济学奖以外,有更多其他的荣誉肯定了赫维奇的成就。比如,美国总统奖。至今只有四位美国经济学家拿到过总统奖,除赫维奇外,其他三人是阿罗、萨缪尔森(Samuelson)和弗里德曼。这个奖对美国人来说,比诺贝尔奖还难拿。另外,赫维奇还是美国国家科学院院士、美国经济学会院士、明尼苏达大学校董事会讲座教授,同时也是世界计量经济学会成员。

赫维奇是犹太人，1917年出生于莫斯科。一战期间他随家人一起移民波兰，在那儿度过了自己的中学和大学时光。二战爆发时，他正好在瑞士，没法回到波兰。1940年，他辗转来到美国。幸运的是，甫到美国，他就成为了著名经济学家萨缪尔森的助手。

在此之前，他只在华沙大学取得过类似硕士的法学学位。赫维奇说：“我是通过倾听和自修来学习经济学的。”此后，赫维奇也并没有去读任何经济学博士学位，但是却在能人辈出的明尼苏达大学经济系从副教授做到正教授。目前，退休后的赫维奇仍在明尼苏达大学享有名誉教授头衔。

多项开创性工作

虽然没有经济学学位，但是赫维奇在经济学领域的贡献人所共知。他开始的兴趣主要是计量经济学，对动态计量模型的识别问题做出了奠基性的工作。1947年，赫维奇首先提出并定义了宏观经济学中的理性预期概念。理性预期学派已经成为当今宏观经济学的主流，其中的大师，卢卡斯和普雷斯科特分别获得1995年和2004年度的诺贝尔经济学奖。

明尼苏达大学现在已经成了理性预期学派的大本营。除了卢卡斯，其他理性预期学派的大师都在明尼苏达大学，像萨金特(Thomas Sargent)、沃勒斯(Neil Wallace)、普雷斯科特(Edward Prescott)等。

赫维奇对如何从需求函数的存在来证明效用函数的存在方面也做出了重要贡献。效用是微观经济学中的重要概念，但是一直被质疑是一个主观唯心的概念。赫维奇的工作对于现代经济学体系来说非常重要。赫维奇还和阿罗等人对竞争市场一般均衡的稳定性研究作出了开创性的贡献。

当然，赫维奇最重要的贡献仍然是他赖以获得诺奖的“机制设计理论”。信息不对称一直是经济学领域的关键问题。什么样的规则和机制能够将信息不对称造成的成本最小化？

赫维奇在1960年的一篇论文中把制度描述为一个博弈，为不同规则和机制建立了可以比较的分析框架，从而让人们增加了对于什么样的规则和机制是最好的理解。

赫维奇提出的激励兼容现在已经成为现代经济学中一个核心的概念。

对中国的经济改革非常有兴趣

尽管在学术领域做出了诸多贡献，尽管赫维奇对学生的严格要求非常出名，但他绝不是一个严肃枯燥的人。据曾师从赫维奇、现任上海财经大学经济学院院长和美国得克萨斯农工大学终身教授的田国强介绍，赫维奇的兴趣非常广泛，对语言学颇有研究，经常与学生聊语种的发源和各语种之间的关系。

虽然赫维奇拿着明尼苏达大学经济系里最高的工资，但是有时还像穷学生一样到处找免费停车的地方，而不去收费的地方停车。

可能正是因为对机制设计的研究，让赫维奇对中国的经济改革非常有兴趣，到中国访问过多次。为了访问中国时方便，他还自学中文，认识了好几百个汉字。

赫维奇80多岁的时候，身体还很好，思想也异常活跃，还在参加学术会议，并在写理论性很强的论文。

不过，在接受诺奖网站总编的采访时，赫维奇要听清电话时有些困难。他的妻子伊夫林在旁耐心地转述每句话。伊夫林也已经86岁，他们有四个孩子，现在是一个大家族的祖父祖母了。

赫维奇开创的机制设计理论已经被广泛应用到各个领域。在被问及“对哪一领域的应用最感高兴”时，赫维奇简短地说：“对它在福利经济学中的应用尤感高兴。”

<上海证券报>他们依然在静思经济学最根本难题

他们依然在静思经济学最根本难题

<http://finance.sina.com.cn/stock/t/20071018/02401726022.shtml>

◎梁捷 复旦大学经济学院研究生

专栏作者时间是最公平的。诺贝尔奖委员会在明尼苏达大学赫维茨(Leonid Hurwicz)教授九十高龄的时候，把这荣誉连带一大笔奖金颁发给他，前者是对他一生成绩的肯定，后者更是一个老年人所最最亟需的。老人一辈子研究的学问叫做“机制设计”，如果诺奖每次都能准确而又有效地把奖金颁给最应该得奖的人，那就有可能真正显著促进学术研究，这样的机制才算“好”的机制。

我们需要机制设计理论的根本原因是因为信息不对称。经济学家早就意识到，只有荒岛上的鲁宾逊才无需为信息不对称而苦恼。他只需要面对自然、上帝和自己的内心，不用撒谎、隐藏或者策略性地做一些本性不愿的事情。一旦扩展到两人以上的社会，各式各样的信息不对称问题顿时就显现出来。

已故的拉丰教授的名作《激励理论》就从亚当·斯密说起。亚当·斯密研究了农民和地主、工人和资本家之间的微妙关系。前者会设法利用一切手段来撒谎、欺骗，后者则会想尽办法监督、压榨雇员的全部劳动。两者之间的争斗是由双方各自位置所决定，永远无法调和。经济学家深知此类争斗耗费大量资源，扭曲财富配置，故而要设计出各种雇员有动力、雇主能放心的机制，以对付各种的信息不对称。

赫维茨在帮助阿罗解决一些一般均衡理论的问题以后，开始思考信息和机制的问题。1960年，赫维茨写了一篇名为“资源配置中的最优化与信息效率”的论文，当时的主流经济学家里只有马沙克(Marschak)能为他提供一些参考意见。马沙克在上世纪五十年代就研究过激励问题，但他发现主流的放任自由市场经济只研究“负激励”即惩罚，而很少关注企业里广泛采用的物质激励。可最终，他还是把激励问题放在了一边。

在马沙克的帮助下，赫维茨的研究马上引起学界的关注。大家意识到，赫维茨的机制设计理论与市场管制、市场甄别、公共品提供等重大经济问题有着密切联系。很多经济学家都投入了这方面的研究，当时不过二三十岁的迈尔森和马斯金都是其中的活跃分子。上世纪七十年代是机制设计理论突飞猛进的时代，新定理、新机制不断被发现。马斯金在1977年写成“纳什均衡和福利最优化”，给出可以用纳什均衡来实施的机制的充分和必要条件。迈尔森则在1979年发表“激励兼容与讨价还价问题”，1981年发表“最优拍卖设计”，指出机制设计理论的拓展方向。

而整个机制设计理论框架中的两个核心问题还是由赫维茨解决的，一条是激励相容原理，另一条被称作显示性原理。所谓激励相容，就是机制设计者要把个人追求与整个社会追求结合起来思考。如果有一种制度安排能使得行为人追求个人利益的行为，正好与社会实现集体价值最大化的目标相吻合，这一制度安排就可称作“激励相容”。

显示原理则是诱使行为人披露真实私人信息，从而消除信息不对称的理论基础。赫维茨证明，任何一个说假话的机制都可以用一个说真话的机制来取代并获得同样的结果。行为人说假话只是因为有利可图。一旦我们设计出合理机制，

使得行为人若是选择说谎就要按照对自己不利的方式来实践，那么行为人就会用对自己更有利的真话来取代假话。我们虽然不知道每个行为者的私人信息，但是可以利用机制设计，使得行为人理性地根据真实情况来选择。

这样，机制设计理论就有效地克服了两种最常见的市场失灵。一种是逆向选择，即所谓劣币驱逐良币问题。好的机制能有效分离开“劣币”和“良币”，从而保证市场的健康运行；另一种情况叫道德风险，即接受委托的代理人利用委托人无法有效监督而偷懒、作弊、浪费等等。机制设计理论就设法把代理人的工作结果与其他形式结合起来，潜在地对代理人的工作形成激励。

这一整套理论，不仅有极深远的理论意义，对于有着社会主义传统的国家更有巨大吸引力。从赫维茨到马斯金和迈尔森，都收过不少中国学生。其中较为著名的就有田国强、钱颖一、李稻葵、王一江等，现在都已成为国内经济学界中流砥柱。中国从上世纪八十年代开始建设市场经济，马上就面临国有企业缺乏激励，市场交易缺乏诚信之类的市场失灵情况。机制设计正是治理这些顽疾的灵药。所以，机制设计理论伴随着博弈论和信息经济学早早地传入中国，成为中国学者在改革实践过程中最最偏爱的经济理论之一。

可是也有一些学者对此表示忧虑。机制设计理论有潜在的“僭越人类理性”、“干预自发秩序”的倾向。哈耶克在 1945 年那篇著名的“知识在社会中的利用”中就已说明，人类社会的信息结构过于复杂，而且动态演化，是一切已知和未知理性所不可能完全统辖的。机制设计理论大大提升人们的自信，使得一部分经济学家自以为能聪明地设计一切制度。这在长期缺乏自发秩序和民主法治的中国社会中尤其危险。

赫维茨、马斯金和迈尔森倒完全没有这些抱负。诺贝尔经济学奖只奖励原创性理论突破，不奖励任何实践活动。期颐之年的赫维茨早已看淡一切，毕竟他的得意门生麦克法登在七年前就已获得诺贝尔奖。迈尔森仍在孜孜不倦地研究政治经济学，连续发表最出色的论文，为“芝加哥学派”再添一枚奖牌。马斯金则在普林斯顿高等研究院，他是研究院 26 名特聘教授中唯一一名经济学家，和爱因斯坦、哥德尔、冯·诺依曼等杰出头脑一样，安静地思考着最根本的经济学难题。