

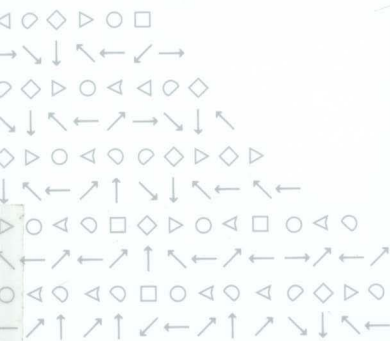
当代经济学系列丛书

Contemporary Economics Series

主编 陈昕

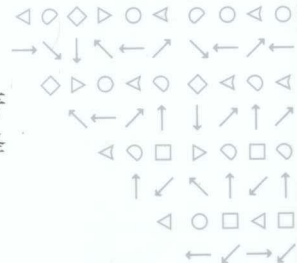


# 基于实践的 微观经济学



当代经济学译库

[美] 赫伯特·西蒙 著  
孙涤 译



格致出版社  
上海三联书店  
上海人民出版社

当代经济学系列丛书

Contemporary Economics Series

主编 陈昕

# 基于实践的 微观经济学

[美] 赫伯特·西蒙 著

孙涤 译

当代  
经济  
译库



格致出版

格致出版社  
上海三联书店  
上海人民出版社

## 图书在版编目(CIP)数据

基于实践的微观经济学 / (美)西蒙(Simon, H. A.)  
著;孙涤译. —上海:格致出版社;上海人民出版社,  
2009

(当代经济学系列丛书. 当代经济学译库/陈昕主编)

书名原文:An Empirically Based Microeconomics

ISBN 978-7-5432-1577-1

I. 基… II. ①西…②孙… III. 微观经济学—研究  
IV. F016

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2009)第 026071 号

责任编辑 田青  
装帧设计 敬人设计工作室  
吕敬人

[美] 赫伯特·西蒙 著

孙涤 译

## 基于实践的微观经济学

格致出版社·上海三联书店·上海人民出版社  
(200001 上海福建中路 193 号 24 层 www.ewen.cc)



格致出版

编辑部热线 021-63914988

市场部热线 021-63914081

www.hibooks.cn

世纪出版集团发行中心发行  
上海图宇印刷有限公司印刷

2009 年 4 月第 1 版

2009 年 4 月第 1 次印刷

开本: 850×1168 1/32

印张:4.75 插页:5 字数:98,000

ISBN 978-7-5432-1577-1/F·158

定价: 15.00 元



## 出版前言

为了全面地、系统地反映当代经济学的全貌及其进程,总结与挖掘当代经济学已有的和潜在的成果,展示当代经济学新的发展方向,我们决定出版“当代经济学系列丛书”。

“当代经济学系列丛书”是大型的、高层次的、综合性的经济学术理论丛书。它包括三个子系列:(1)当代经济学文库;(2)当代经济学译库;(3)当代经济学教学参考书系。该丛书在学科领域方面,不仅着眼于各传统经济学科的新成果,更注重经济前沿学科、边缘学科和综合学科的新成就;在选题的采择上,广泛联系海内外学者,努力开掘学术功力深厚、思想新颖独到、作品水平拔尖的“高、新、尖”著作。“文库”力求达到中国经济学界当前的最高水平;“译库”翻译当代经济学的名人名著;“教学参考书系”则主要

出版国外著名高等院校的通用教材。

本丛书致力于推动中国经济学的现代化和国际标准化,力图在一个不太长的时期内,从研究范围、研究内容、研究方法、分析技术等方面逐步完成中国经济学从传统向现代的转轨。我们渴望经济学家们支持我们的追求,向这套丛书提供高质量的标准经济学著作,进而为提高中国经济学的水平,使之立足于世界经济之林而共同努力。

我们和经济学家一起瞻望着中国经济学的未来。



青浦出版

谨以此书献给

有志于中国现代化的经济管理学人

——译者

## 贤哲西蒙

# D

### 代译序

西蒙教授于2001年2月9日逝世,享年84岁。这当然是研究学界的一大损失。在他的追悼会上,保罗·萨缪尔森说西蒙是他所遇到过的人当中最为睿智者,肯定不是应景的谀词;而经济学教科书上常称西蒙是经济学家之中的经济学家,亦非溢美的褒奖。然而国内新闻传媒对他的逝世却鲜少报道,重视程度尚不及一个三流明星。当然,若要把他的贡献同赚钱致富扯上一点关系的话,即使说是间接的都还嫌勉强。不过西蒙的影响之深远,尤其在阐述人类做选择的动机、限度、过程和评价方面里程碑式的贡献,确实是出乎其类而拔乎其粹的。

西蒙的广博可从他的研究范围得到佐证,从心理学、经济学、政治学、行政学到生物学、统计计量学、管理学、运筹学,乃至物理

学、力学和计算机科学,他无不建树宏富。仅他在卡内基·梅隆大学的网页([www.psy.cmu.edu/psy/faculty/hsimon](http://www.psy.cmu.edu/psy/faculty/hsimon))上所列出的发表了的研究成果就有千种之多。至于他研究的精深,亦可从所获得的奖项略见一斑。除了诺贝尔经济学奖(1978年)外,他又获得过计算机界的最高奖——图林奖(1975年),管理科学的最高奖——冯·纽曼奖(1988年)、美国政治学的最高奖——麦迪森奖(1983年),以及难以数计的其他奖项。众多的领域凡经他的研究涉及的,皆能臻于至境。这种智慧,这类点石成金的功力,即使不说“绝后”,至少可在“空前”之畴。

在诸多的社会科学学科中,经济学勉强能挤入科学之亚流,算是个例外。以方法论,经济学奋力沿用并融合自然科学及数学的成果,称得上谨严;然而就其对象来论,经济学不得不面对其所处理的对象——人的行为的变异性,而使物理科学方法的逻辑分析每有捉襟见肘之缺憾。大哲学家伯特兰·罗素曾声称经济学太容易,他不屑于去深究;大物理学家马克·普郎克却承认经济学太艰难,故不敢去涉猎。两位贤哲大概都不会讳认经济学的晦涩吧。西蒙对经济学研究的情有独钟,在我看来,就是为了寻求突破实际的人是怎样选择决策来增进自身的利益的。他的兴



趣发轫于这个问题的解答,他的热忱焕发于这个问题的澄清,他的探索,包括挑战各类谬误,始终矢志不渝。

西蒙早期的训练是行政管理。对公共决策过程的切近观察,使他感悟到人群和个人行为的独特逻辑和外在的物理环境出入很大,这也许能够帮助解释,为什么西蒙的经济学研究从一开始就没有被主流套住的原因。从20世纪40年代起,西蒙着重研究人类知性行为的因果秩序,极具原创性。他的研究成果,也是他的博士论文,总结成《管理行为》(*Administrative Behavior*)一书,于1947年问世。该书堪称经典,历久弥新地成为众多管理理念的前导和研究方法的源头。在1997年第四版的导言里,西蒙明确表示,原书的结论在五十年里并没有大的变动,大部分的内容还值得保留。通讯和信息处理技术的进步影响了人们的社会实践和社会价值观,改变着管理和决策过程,但是人类组织四千年来的决策(或选择)机制以及群体行为的基本架构,却没有本质性的改变。(我愿再次强力推荐《管理行为》一书,它第四版的中译本2004年已出版。该书言简意赅,高屋建瓴,尤其能够切中要旨,是一本管理经济的极为难得的好书。)

西蒙的深邃理解和透彻剖析引导他得出

不少基础创新的结论，与主流学派为了简化分析的需要而提出的牵强假设大异其趣，并产生龃龉甚至冲突。这使他和主流经济学派渐行渐远。虽然在早期，西蒙的理论多半建立在他个人的天才卓识之上，没经过太多严格的科学实验证明。但在50年代后，管理的实践和行为科学的实验逐步证实了西蒙非凡的洞察力是符合实际和领先群伦的。西蒙在1957年出版的《人、社会和理性模式》一书，连同他用生物实验方法揭示出来，人和小白鼠一样，他们追求自身利益的理性都是有限度的。西蒙令人信服地证明，同纯逻辑推导的结果大相径庭，人类的自利追求并非无止境的全局最大化(global rationality)，而是止于适度的满足，这种“有限理性”(bounded rationality)的诠释对经济学的“理性人”基本公理假设构成了严重的挑战。

西蒙对统计和计量学科的理论研究导致他倡导用非对称分布函数(俗称 Zipf 分布)来替代费雪的正态分布。这也说明了西蒙相信人类的行为有着强烈的倾向性，他们所追求、向往的和所畏惧、回避的原本就非常地不对称。比起正态分布所暗指的“过犹不及”，把过分的盈利和过度的亏损都处理为风险，均为人们所趋避的假设，不对称倾向要更切合实际且合理。

西蒙戏称他幸好没有沦为全职的经济学家。他那广泛的兴趣和深厚的人文关切也不允许他仅仅停留在经济学的理论研究上。事实上，西蒙浩瀚的智慧又使他得以游刃有余，开拓出多种领域。当当之无愧地，西蒙是人工智能和数学定理计算机证明的奠基者之一。他和阿伦·纽伟尔合作的一系列开创性的研究成果改变了我们对人脑和电脑的关系的理解。纽伟尔原是卡内基·梅隆大学的博士班学生，但学院里所有的教授反而都会赶去聆听纽伟尔的报告会，来更新自己的知识结构。西蒙是纽伟尔的博士导师，两人介于师友之间，从上世纪50年代中期就开始合作，用电子计算机来证明罗素和怀特海的名著《数学原理》中的一些逻辑命题。当西蒙向罗素函告他们的研究成果时，他不无得意地指出“智慧和博学并不总是一回事”，并称计算机的智慧是如此卓越，以致还得瞒着不让学童知道，以免孩子们失去信心不肯再去费心学习加减乘除！西蒙对机器智慧的信心和期待同他对人类理性的质疑和保留形成了有趣的对照。他对人工智能过分乐观的预言，即60年代后计算机可望赛过人脑，至今未能兑现。现在学界已倾向于相信，计算机将会被证明永远无法替代人脑，电脑的运算能力是无法企及人脑的智

慧的,尤其是后者的想像力。西蒙的研究轶事在他的自传(*Models of My Life*, 1996)中有不少描写(中译本《我生活的种种模式》1998年出版),笔者就不再赘述了,这里仅略谈个人的一些感受。西蒙对中国人一向友好,尼克松的破冰之旅后不久,他就在1972年访华。所以70年代末开放伊始,我念硕士课程时,就接触到他的一些研究。我当时的感觉十分明显,西蒙的文章你只消读上一、两页,就知道是真正的大师手笔,如同听了帕瓦罗蒂的第一句歌声一样。而他的通达,也直扣人心弦。我深深地为他所折服,常思他日若能及门聆教该有多好。所幸的是,我的博士导师之一比尔·库珀教授是他的终身挚友和诤友。库珀教授也是一位极其富有创造力和个人风采的大师级人物。西蒙在自传里通篇谈到比尔,并辟有一章专门讨论他和比尔的交谊。库珀曾任卡内基·梅隆大学的管理学院院长多年,正是他将西蒙引荐到该校的。事实上,西蒙和他太太也是经库珀介绍才结成连理的。1989年底,卡内基·梅隆大学有一座大楼要以库珀命名,我出差去匹兹堡时,受库珀师之命去拜望西蒙,同时也邀请他为中国留美经济学会的年会作演讲。当时我担任学会的会长,而西蒙是学会的顾问。西蒙的谈话

睿智亲切,使人有如沐春风的感觉。我向他请益治学的方法,记得他用了一些浅显的比喻来引导,道出人类认知的通病,类似人们在黑夜中遗失了东西,常会到有烛光的地方而不去丢失的地点去寻找。他又指出,通常学者们建立的研究模型,想靠简化来加强理解要点,其把握丰富现实的方法,如同地图和地域的关系:地图的比例尺要是太小,譬如1:10 000 000,则众多具体细节必遭忽略,无法据以找到准确的地址;然而要是地图的比例尺过大,比如1:5的话,则不便携带,从而也失去其指引的功能。西蒙的这两个“寓言”,我揣摩,传递的真切涵义是,质朴的“常理”也强过准确的“悖理”,渐渐地似有所领悟。经济学的模型(其他学科亦如是)对现实的诠释能力,若不能把握一个适当的“度”的话,难免滑入吊诡之境。人们不是常常受到一些分析模型的困扰吗?囿于信息、条件、手段的限制,不得不简化。然而正是模型的这些权宜而牵强的假设,致使模型建成后推导出来的解决方案对于实际问题的解决既无益又无补。因为这类“模型方法”,削头适冠般地已经把造成问题症结的因素也一并舍弃掉了!

我访问西蒙办公室的次晨,正值圣诞节后,匹兹堡的气温骤降至零下二十几度,破了数十年的记录。西蒙却如约前来,在我们的

年会上作了热情洋溢的致辞，给了与会者难忘的经历。他也将自己的二卷本论文集题赠给我，署名“司马贺”。除了“贺”字有些走样之外，中国字竟写得中规中矩。西蒙能讲一些中国话，我表示钦佩之后，他又随口讲了几句日语。他横溢的智慧总是那样随时俯拾即是。

他的那套论文集我一直珍藏着，惭愧的是生性疏懒，几乎没从文集中再认真读过他的文章。不过我倒是拜读了他晚年出版的《基于实践的微观经济学》(*An Empirically Based Microeconomics*, Cambridge University Press, 1997)，该书是他在意大利客座时三次演讲的汇集。西蒙以他的阅历和洞察力，厚积薄发地检讨了经济学不少有争议的方法论和价值论的问题。他作为一个执著探索的学者和斗士，曾频频投入其中不少关键论战，读来脍炙人口。我深受该书的启发，也因此向读者隆重推荐。对于其他学人，这本书价值也应当非同小可。

孙涤 悼念西蒙老师于  
北京，2001年2月  
(本文2001年发表于《上海证券报》，后收入我的随笔集《别在市场里发呆》，上海人民出版社2004年版；2009年3月重订于洛杉矶)

# D

本书导读

很高兴《基于实践的微观经济学》终于和大家见面了。这本西蒙晚年的演讲及讨论小集子，流畅地表述了他思想的精粹。原书于1997年问世，我同年与它邂逅，深深为之打动，反复诵读之余，总想大家也能来共享。2001年西蒙教授辞世，在随即的一篇纪念文章里我做了推荐（即本书代译序“贤哲西蒙”），希望它能有中译本。之后的六年却无人响应，于是我决定自己来翻译，这个建议得到了上海世纪出版集团格致出版社社长、老朋友何元龙先生的鼎力支持，并安排了版权和出版事宜。在翻译和校订的过程中，则得到了责任编辑田青女士的很多帮助，在此先表谢忱。

在“贤哲西蒙”（代译序）里我谈到自己多年来的感受，阅读西蒙的书，就像听到帕瓦罗蒂的歌声，诚挚、睿智、隽永，超乎群论

是那么的毋庸置疑。然而西蒙的句式文采，在原文里如行云流水，译成中文，却远不是水到渠成的事。很幸运地，我得到了在北京大学汇丰商学院带教的三个学生的帮助。感谢他们参与了初译，其中陈磊负责第一篇讲演“决策中的理性”，刘璐负责第二篇讲演“组织在经济中的角色”，崔少帆则负责第三篇讲演“经济学的实证根据”及一些附录的翻译工作。我之所以邀请学生一起来参加译事，是因为这对他们的职业生涯也是一种锤炼：英语文献成了我们现代化建设的主要信息渠道，能够在母语和英文之间转换自如已成了学人的基本技能，而译书能切实地增强这一技能；其次，通过翻译，能扎实地加深理解这本难得的好书。我和担任北大副校长及北大汇丰商学院院长的老朋友海闻教授交换过这层看法，并得到了他的支持。我会继续和所带的学生合作翻译经典之作，希望每年能有一册。

我和三位学生做了不少努力来传达西蒙的原意，力有不逮之处，当然是我一个人的责任。还希望读者和同仁们不吝指正。

至于谁来读这本书，我想，是对经济和管理有兴趣的人，在这方面有过一点训练的就更好。最合适的读者，应该是大学高年级的本科生或研究生。本书虽然是西蒙和学者们



切磋的产物,针对的读者群却正是学子们,将来的经济决策者和企业组织的管理者。要能胜任我国现代化的重责,他们必得不断更新自己的理念和知识。诚如西蒙在本书结尾所殷切期待的,“开辟新路径的愿望还在,探索新的实证研究方法的愿望还在。学生们需要得到我们的帮助,否则这种愿望将遭受挫折。首先,我们需要修改课程……其次,我们需要重新审查评判论文发表及擢拔教师的程序,提高论文的现实意义的权重……”。

至于怎样来读这本书,我想最好是通过西蒙原汁原味的话来说明。本书已相当精简,不过我还是摘编了西蒙的一些原话作为导引,兹列叙如下。

读者很快就会明白,西蒙演讲的三个主旨——(1)人的理性假定是否有效,它能否保证人们达到全局最优的决定;(2)人为什么有组织认同的利他行为,使企业能够繁盛于市场,并往往优于市场安排;以及(3)经济学理论发展的障碍在哪里,为什么对组织行为和个人心理思维的实证分析非常重要,对于当下的中国全都有极为现实的意义。在现代化的转型探索中,我们比起西方的同行,更需要创新突破、更要注重务实变通、更不可因循姑且。如凯恩斯所评论的,人们或许以为观念无甚紧要,自己能摆脱观念来思考和行动,其