

诺贝尔经济学奖获奖者著作丛书

现代决策理论 的基石

[美] 赫伯特·西蒙 著

北京经济学院出版社

· 诺贝尔经济学奖获奖者著作丛书 ·

现代决策理论的基石

有 限 理 性 说

〔美〕 赫伯特·西蒙 著
杨 砾 徐 立 译

北京经济学院出版社

1989年·北京

现代决策理论的基石

yiandai Juece Lilun De Jishi

〔美〕赫伯特·西蒙 著

杨砾 徐立 译

北京经济学院出版社出版

(北京市朝阳区红庙)

北京经济学院出版社永乐印刷厂印刷

新华书店北京发行所发行

850×1168毫米 32开 6.125 印张 159 千字

1989年3月第1版 1989年3月第1版第1次印刷

印数: 0001-1000

ISBN 7-5638-0056-5/F·45

定价: 4.15 元

《诺贝尔经济学奖获奖者著作丛书》

编辑委员会

顾问	厉以宁	宋承先	张培刚	胡代光
	钱荣堃	高鸿业	黄范章	谭崇台
主编 编委	贾湛	梁小民		
	于同申	马在新	甘华鸣	厉以平
	吕立勤	李玉臣	李盛平	余永定
	张家慈	沈志华	邹蓝	吴衡康
	杨河清	杨德明	俞品根	施炜
	彭元	彭剑锋	薛进军	

编者献词

近年来，我国经济学界介绍了不少现代西方经济学家的著作，对我国经济学理论的研究起了积极的作用。为了使这种介绍更具有全面性和代表性，我们决定系统地翻译出版获诺贝尔经济学奖的学者的主要著作，作为翻译丛书奉献给广大读者。

诺贝尔经济学奖是当今世界上最有影响的经济奖。它是1968年瑞典中央银行在其建立300周年时为纪念诺贝尔奖提供者而设立的基金，全称是“纪念诺贝尔经济学奖”。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1987年为止已颁发19届，共有欧美的25位经济学家获奖。获奖的经济学家们的经济理论基本上代表了西方经济学的主要成就，对西方经济学的发展有较大的影响。读者通过这些著作能全面、深入、系统地了解和研究西方经济学，从中吸取对我国经济改革和经济学发展有价值的东西。

当代西方经济学最显著的特点之一是数学方法的应用。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。本世纪以后经济学家又把经济理论、数学和统计学结合起来建立了经济计量学，用于解决实际问题，并取得了重要进展。从某种意义上可以说经济学的数学化是经济学精密化、实用化的标志。在获奖的经济学家中，有三分之一以上在这方面作出了开创性的贡献。获得第一届诺贝尔经济学奖的挪威经济学家R.费瑞希和荷兰经济学家J.丁伯根是经济计量学的创立者。以后获奖的美国经济学家P.萨缪尔森、K.阿罗、W.列昂惕夫、T.库普

曼、L.克莱因、G.德布鲁，英国经济学家J.希克斯、苏联经济学家L.康托洛维奇都在经济学数学化方面作出了重要贡献。

在流派林立的当代西方经济学中，新古典综合派是公认的“主流派”。这一派继承并发展了凯恩斯主义，对西方各国的经济政策和经济理论都有重大的影响。因此，在获奖的经济学家中属于这一派的有相当比例，如美国经济学家P.萨缪尔森、L.克莱因、J.托宾、F.莫迪利亚尼、R.索洛，都是这一派的代表人物。

70年代后西方经济政策与经济理论的显著变化是自由主义的影响日益增强。代表自由主义的奥地利经济学家F.哈耶克，美国经济学家M.费里德曼、G.斯蒂格勒、J.布坎南先后获得诺贝尔经济学奖，便反映了这种趋势。

经济学是一门实用性很强的科学。因此，获奖者中还有一批对解决各种实际问题作出贡献的经济学家，如：美国经济学家S.库兹涅茨和英国经济学家R.斯通对国民收入统计作出开创性贡献；美国经济学家A.刘易斯和T.舒尔茨对研究发展中国家经济发展问题有独特贡献；瑞典经济学家B.奥林和英国经济学家J.米德对国际贸易和国际经济关系问题作出重要贡献；美国经济学家H.西蒙对管理科学的发展起了重要作用。

本丛书的选编以获奖者的代表作，特别是在西方经济中影响重大的名著以及对我国经济改革和社会主义经济理论有启发和借鉴的著作为主，每位获奖者的著作至少选一本，以保持其系统性与代表性。

还应该说明的是，西方经济学是资本主义的意识形态，获奖的经济学家是资产阶级学者，因而在这些著作必然有这样那样的问题，在阅读时我们应注意这一点。但是，西方经济学作为人类文明发展的成果之一，有其不可忽视的精华，资产阶级学者对经济问题的研究有其可取之处。从这种意义上说，只要我们以分析的

编 选 说 明

有限理性说，是赫伯特·西蒙（司马贺）的全部重要理论的核心学说。鉴于它在经济理论、管理科学、计算机科学、认知心理学、设计科学和科学哲学等领域有着重大影响和显要地位，我国一些著名学者自70年代末以来已对它做了很多精细描述和介绍。西蒙教授本人多次来华讲学，以及《管理决策新科学》、《管理行为》和《关于人为事物的科学》等译本的出版，使得这一学说的概貌对我国读者来说，已经是比较熟悉的了。但是，对于它的深刻而广泛的真正含义、它同其他有关学说的差别和关系，它在科学描述上的意义和在实际应用上的作用及其区别，以及它的近期发展动态，显然还需要做进一步的研究。我们编选、翻译这本集子，就是为了给这方面的研究工作提供重要资料。当然，读者如希望了解有“科学奇才”、“世界著名博学家”之称的西蒙教授是如何驰骋于自然科学和社会科学这两大领域前沿的；或者仅希望一般性地了解有限理性说及其在诸多学科上的意义，无疑也会发现本书的价值。

根据逻辑关系和时间顺序，我们将本书全部内容分成了两部分。第一篇（“有限理性说”）收录了西蒙的5篇重要文章，其中第一篇描述了理性定义，指出了“理性”一词的多层次、多方面、多学科的不同含义及其联系。这篇短文（辞条）是了解西蒙“理性”或“合理性”概念的重要原始资料。①

① 西蒙的这一概念有其独到之处，不能被看作是一般的（传统的或某些当代的）理性概念。可参见G.米歇尔：《社会科学新词典》（纽约：阿尔频出版公司1979年版）第154—155页。

有限理性说最初是西蒙在《管理行为》一书（第4、5章）中提出来的^①。本书第二、三篇论文就是对这一基本理论的形式化概括。西蒙在谈到这两篇论文时说过：它们“为比较有限理性说和那些体现在古典经济理论及统计决策论中的各种完美理性说（全面理性说），为比较它们两者的基本假定和结构，提供了一个良好的基础。如果让我从自己已经发表的全部经济学文献中仅仅挑选两篇，送给刚刚被我们发现的外星文明人，我就会挑选这两篇。由于这两篇论文对理性行动者所做的全部假定，实际上就是面临极度复杂性时的计算顺序性（串行性）^②，因此，我相信，收到这两篇论文的外星人会毫无困难地理解它们的意思，并应用于他们自己的事务。当然，我写这两篇论文是要解释地球上事情，而不是其他世界上的事情。”^③这里反映了西蒙撰写和评价这两篇论文的科学立场。它们除了在经济学方面使读者感兴趣之外，作为人工智能与认知科学先驱在人工智能和认知科学大发展前夜所写的重要论文，也必定会使从事计算机科学和认知科学研究的我国读者感兴趣。西蒙在他后来编撰的一部经济学论文集（《有限理性模型》）和一部认知心理学论文集（《思维模型》）中，均收录了这两篇论文，同样说明了这一点。

收入本书第一篇的第四篇论文，详细地介绍了认为理性有限的一些理论（“有限理性论”）的结构，特别突出地论述了以有限理性说为基础的有限理性论。西蒙在撰写和发表该文时，已经在《关于人为事物的科学》（1969年第1版）一书中提出了建立“设计科学”的设想，这也是当今西方“设计研究”界公认的首

① 中译本列入“诺贝尔经济学奖获得者著作丛书”，已由北京经济学院出版社出版。

② 即指“一时干一事”、“一时想一事”而不是“好多事”，详见正文。

③ 《有限理性模型》（坎布里奇：麻省理工学院出版社1982年版），下卷，第204页。

次系统设想。^①因此，西蒙在该文中还特别谈及“设计领域的有限理性”。此外，该文对管理科学上的分析方法和以有限理性说为依据的启发式方法，也做了中肯的论述和评价。

第五篇文章是西蒙获得1978年诺贝尔经济学奖时发表的演讲。这篇文章集中论述了有限理性说在经济学界的发展经历、当前状况和未来前景，这自然就需要涉及围绕有限理性说而进行的其他学科领域的工作，比如心理学、组织理论等方面的成果。西蒙有一个非常著名的观点，即：经济学（特别是厂商理论）、认知心理学和组织理论所研究的课题，实际上是同一事物——人的决策过程和问题求解过程。以有限理性说为根据、从决策角度出发研究经济现象的经济学分支，在“决策理论”的总标题下，有时又叫作“行为经济学”或“行为理论”。西蒙及其同事们所发展的这一理论，在现代西方厂商理论或企业经济学上，占据着强大优势。瑞典皇家科学院1978年诺贝尔经济学奖公告指出：“现代厂商经济理论和管理研究，大多是以西蒙的思想为基础的。”^②但是，西蒙等人的行为理论不仅对微观经济学很重要，对宏观经济学也是有重要意义的。西蒙说：“…在这篇文章（《企业组织的理性决策》）中，我试图概述程序理性研究和企业行为理论自第二次世界大战以来的整个发展经历…。读者将会看到，我有一个毫不动摇的信念，那就是：人类思维过程与其产物一样，是经济理论和经济知识持续进步的具有基本重要性的课题——对厂商理论来说当然尤其如此，对经济周期理论和宏观经济学其他课题来说，也是这样。”^③西蒙还说：“关于经济增长和经济周期的正确解释是什么，其现存不确定性，靠新古典体系中的总量分析是无法予以解决的。现在的理论争论，主要在于一些特定的、个

① 详见杨砾、徐立：《人类理性与设计科学》，辽宁人民出版社1987年版。

② 《斯基地那维亚经济杂志》，1979年，第1期，第72页。

③ 《有限理性模型》下卷，第403页。

别经验性的假定，在于有关不确定情形下偏离全面理性此一事实的这种假定。这类争论，只有通过针对人类决策和问题求解过程的辛辛苦苦的微观经济学实验研究，才可以得到解决。”^①

本书第二篇是西蒙近著《论事理》的全部译文。这是西蒙依据有限理性说去探讨新问题的重要作品。其中概述和比较了四种最突出的理性说；也代表西蒙对其有限理性说的最新解释。这一部分中有关进化论与有限理性说的关系，和关于生物社会学观点的述评，在国内介绍西蒙理论的论著和译本中还相当少见。这一部分还特别突出地探讨了有限理性说在社会事务上的意义和应用；社会制度“理性”的限度及其扩展途径；科学知识在社会生活中的重大意义；专家在公共政策制定上的作用等等一系列重要的新课题。读者不难发现，这当中有不少值得探讨的新观点。

同本书第一篇相比，第二篇在论述方式上一般比较通俗，内容更广泛，论题更为新颖。不过，正如西蒙本人所说，这一部分主要是“探索一下迄今一直不在我本人的主要探索道路上。但我感觉有兴趣的和重要的偏远小路。…集中探讨那些尚成问题的或争论不休的课题，以及那些对于理解理性在人类事务中的角色尤为关键的专题。”可见，这一部分有关社会制度等方面的内容，同该部分有关各种理性说的论述及本书第一篇内容相比，具有更大的探索性和猜测性。我们不准在这里用马克思主义观点同西蒙有关社会制度方面的观点进行分析、对比。但必须指出的是，它们两者在出发点、侧重点和论证方式上，都存在着差异。尽管西蒙的有些观点同马克思主义观点相抵触，必须以批判的眼光对待之，但若从管理技术的角度去看，无疑会发现其中的合理成分。而且只有从这一角度去理解一个科学家和管理学家的论著，才是比较合适的。我们还应注意到，西蒙虽然以“人类事务”、“社会事

① 《论经济动态学的行为基础和理性基础》载《经济行为与组织》，1984年，第5期，第35页。

务”为题，但他讲的许多（不是全部）是欧美的事情。在阅读这方面的内容时，不做分析地进行简单类比或外推，是不正确的；不考虑社会背景就加以贬斥，也是不正确的。

最后，我们还想稍许说明一些译法问题。第一，“理性”有好几个替代译法，如经济学界有时采用的“合理性”和其他地方有时采用的“理智”、“有理”、“推理”等等。第二，“有限理性”也可译为“有限制的合理性”、“有界合理性”、“有约束的理性”或其他组合。第三，“有限理性说”同“有限理性论”在很多情况下是可以替代的，但根据西蒙本人所做的区别，我们用前者特指西蒙关于有限理性或合理行为的学说要旨，后者有时则指包括西蒙学说在内的多种合理行为理论——它们都给理性加上了限制和约束条件，但所加条件不同（不过，在某种程度上，它们都符合有限理性说，属于同一个“时代精神”）。第四，本书第二篇的“事理”是一个已被赋予新含义的词，指“人类事务上的理性或道理”。我国科学界早就有人主张建立一门与“物理学”相对应的“事理学”。这一主张在管理科学和运筹学（系统工程学）界常常可以听到，后来甚至有人如法炮制所谓“人理学”。尽管据我们所知“事理”一词还没有一个明确的、系统的、学术上的统一定义，但该词的含义还不至于引起混乱。本书第二篇（特别是最后一章）讲的就是事理。当然，它并不是可能的“事理学”的全部，而只是其中一个较高层次上的部分内容。除了以上说明的译法之外，还有个别译法问题将在适当的脚注里予以说明。

西蒙学术思想在众多领域里的重要地位，是得到了当今世界学术界公认的。经济学上就不必多说了。^①从心理学上看，出版包括认知心理学著作在内的现代心理学著作，在促进我国学术进步

^① 可参阅《管理行为》中译本序言（范家骧撰），或厉以宁、秦婉顺：《现代西方经济学概论》（北京大学出版社1983年版），第十五章。

上，是有重要意义的。

虽然我们力求译好这本书，但由于能力有限，误译之处在所难免。真诚希望读者提出宝贵意见。

杨砾 徐立

1987年12月14日

前 言

为中译本出版而作

为了建立理论，特别是为了建立那些使我们能够据之推理的理论，我们要对现实进行简化。我们不是试图捕捉真实世界的每一个复杂因素，而是仅仅抓住其中最重要的因素，并且小心防止使我们从理论中得出的推论，超越理论本身对现实的近似界限。

古典经济理论对人的智力做了极其苛刻的假定，为的是产生那些非常动人的数学模型，用来表示简化的世界。在这方面，近年来人们已经提出了疑问，怀疑那些假说是否与人类行为的事实相距过远，以至根据那些假说所得出的理论同我们所处的现实状况已经不再有什么关系了。本书各篇文章正是提出了这种疑问。

不过，除了批评正统经济学家关于具有完美理性的经济活动者的观念之外，我还试图更进一步。我试着描述了一种受到较多限制的理性。在人的决策行为方面，这种理性同事实相吻合的程度要好得多。我认为，我所提出的“寻求满意的人”这一模型同那种“追求最优的人”的古典概念相比，在有关经济行为的经验研究中获得了多得多的支持。

我们在理论中采用不同的人类行为模型，会给经济政策造成差异。如果说人们只具备有限的理性，那么搞清楚实际决策过程就变得重要起来了。在这种情况下，我们就不可效仿经济学家们那样单纯地论证说：人们会采取最合理的决策。因此，本书各篇文章讲的是寻求满意的人的决策过程。

杨砾和徐立先生为翻译这些文章而付出了辛勤劳动，我要向他们表示感谢。不过，书中任何缺陷的责任当在作者，不应归咎于他们两人。

赫伯特·西蒙

1988年1月9日于美国宾州 匹兹堡

目 录

前 言

第一篇 有限理性说

一	理性的定义	(3)
二	理性抉择的行为模型	(6)
	理性抉择的某些普遍特征	(8)
	实质性的简化	(12)
	解的唯一性与存在性	(19)
	关于动态关系的进一步说明	(22)
	结论	(23)
	附录：关于如何合理决定可接受报酬的一个例子	(25)
三	理性抉择与环境结构	(29)
	生物的环境	(31)
	感知力，存贮能力与生存	(33)
	多目标抉择机制	(36)
	关于环境的进一步说明：线索	(39)
	关于多目标的最后评注	(41)
	结论	(43)
四	有限理性论	(45)
	引言	(45)
	棋艺的理性抉择途径	(49)
	设计领域的有限理性	(57)
	管理科学上的有限理性	(59)

结论.....	(62)
五 企业组织的理性决策.....	(64)
作为经济学的决策理论.....	(65)
刻画有限理性的特征.....	(76)
新古典理论复兴.....	(83)
行为理论的进展.....	(88)
结论.....	(94)

第二篇 论事理——人类事务上的理性

一 几种理性说.....	(106)
推理限度.....	(107)
价值.....	(109)
主观期望效用.....	(113)
行为说.....	(117)
直觉理性.....	(122)
直觉与情感.....	(126)
结语.....	(130)
二 理性与目的论.....	(132)
作为理性适应的进化.....	(132)
达尔文模型.....	(135)
社会进化与文化演变.....	(144)
进化过程中的利他主义.....	(147)
进化的短见.....	(153)
结语.....	(157)
三 社会事务上的理性过程.....	(160)
制度理性的限度.....	(163)
制度理性的加强.....	(169)
公共信息库.....	(173)
结语.....	(182)

第一篇

有 限 理 性 说

