

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



SOCIAL CHOICE:  
MANY INDIVIDUALS OR MANY  
CRITERIA

---

*by*

K.J. ARROW

---

社会选择：  
个性与多准则

---

[美] 肯尼思·约瑟夫·阿罗 著  
钱晓敏 孟岳良 译

---

SOCIAL CHOICE:  
MANY INDIVIDUALS OR  
MANY CRITERIA

---

社会选择：个性与多准则

[美] 肯尼思·约瑟夫·阿罗 著

钱晓敏 孟岳良 译

张尧庭 钟 路 审校

**Social Choice and Individual Values**

Copyright © 1970 by Cowles Foundation of Yale University

**Social Choice and Multicriterion Decision Making**

Copyright © 1986 by MIT Press

根据 Yale University 出版社 1970 年版和 MIT 出版社 1986 年版翻译

**图书在版编目(CIP)数据**

社会选择:个性与多准则/(美)阿罗(Arrow, K.J.)著;钱晓敏等译. - 北京:首都经济贸易大学出版社, 2000.3

(诺贝尔经济学奖获奖者学术精品自选集)

书名原文: Social Choice: Many Individuals or Many Criteria

ISBN 7-5638-0840-X

I. 社… II. ①阿…②钱… III. 公共选择(经济学)-原则-研究 IV. F019.5

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2000)第 02047 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

850×1168 毫米 32 开本 10.125 印张 244 千字

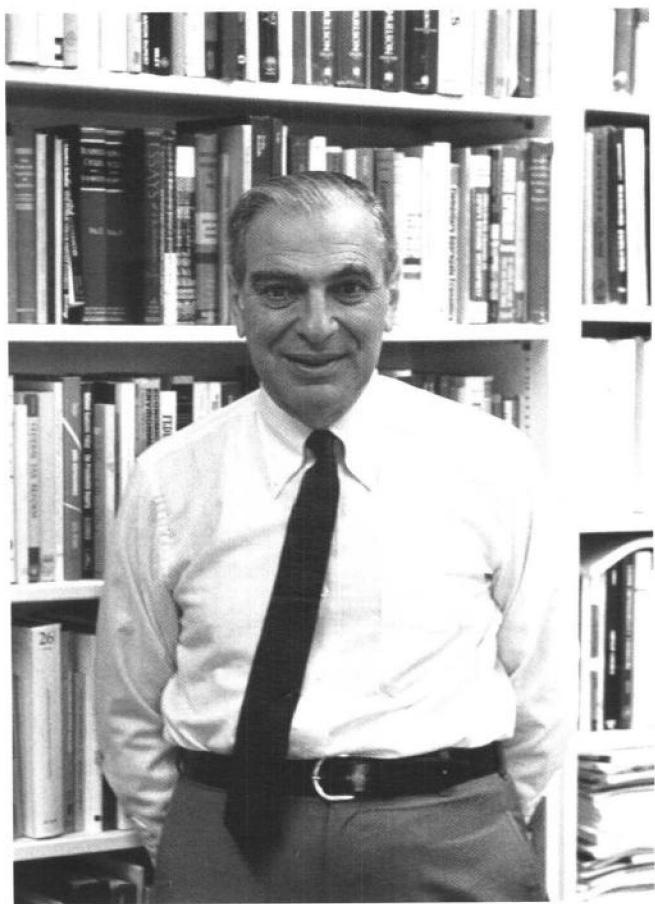
2000 年 3 月第 1 版 2000 年 3 月第 1 次印刷

ISBN 7-5638-0840-X/F·458

著作权合同登记号

图字:01-99-1489 号

定价:21.00 元



*Kenneth J. Arrow*

肯尼思·约瑟夫·阿罗 Kenneth Joseph Arrow (1921 ~ )

---

美国斯坦福大学教授。1972年因其在“一般均衡理论和社会福利经济学”方面的杰出贡献，荣获诺贝尔经济学奖。

## 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

20416103

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**

## 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)、莫迪里安尼(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**

# 中文版序言

肯尼思·约瑟夫·阿罗  
(Kenneth J. Arrow)

很高兴得知这两本关于社会选择的书翻译出版，这使它们在华语社会中更便于使用。我希望在那里，不论是知识阶层人员还是实务工作人员，都会有所反响。

社会选择理论面对的问题是协调不同的利害关系和有分歧的价值观念。一种经济体制，实际上任何社会体制也是如此，应该尽可能满足它的成员的需求。在我们所追求的民主世界里，我们希望全体成员的需求尽量平等地得到满足；而我们今天还未认清的是，无论在美国还是欧洲，无论是东方、还是西方，政策往往是由少数人或某个人制定的。然而，社会成员难以避免地会有不同的利益和不同的价值观。如果人们彼此是隔离孤立地按自己所希望的方式生活，这些差异就将不具有任何重要性。但实际上人是社会性的动物，必须在彼此合作中获利。经济的基础是劳动分工与相互贸易，这对合作各方都有很大的好处。类似地，政府必须着力于解决各种矛盾冲突，不然这些冲突可能会对每个人都造成伤害。因此，协调的行动是必

须的。尽管人们对采取什么行动有不一致的意见，但必须达成一致的协议。

社会的进化对于这种不同价值观、不同利益、重大社会行动同时出现的情况有很多解决的办法。一个适用于小社会的方法是直接谈判。另一些是通过选举或由市场来选择。市场选择是一种分力相互作用而达成一个合力的方式，例如，商品交换可以尽量满足每个人所选取的各个不相同的目标。市场是一种有效的，且能在可能范围内避免冲突的解，但它不能解决所有的问题。市场无法处理外在的事物，诸如环境迫使一个人的行为会影响其他人，又如它不能使财产所有权的初始分配适合市场有效运行的需要。市场需要完整的法律系统来保证合约生效、确定伤害的程度、防止暴力和欺诈，只有政府或某些相似的集体机构才能合乎要求。

在工商领域内，现代的工商企业达到相当的规模时，就会以公众股份的形式为众多股东所有。他们会有不同的利益，对未来有不同的预期，对企业应怎样运作自然就有不同的看法。事实上，我首先考虑的社会选择问题是想发展一种关于非个人所有制企业的理论，这就是我最先发现的由投票多数决定的无传递性。伟大的法国精英、自由的使者孔多塞（Condorcet）在 1785 年就已看到了这一点，但是，那时无论是我还是任何其他关注这个问题的人都不可能做到的。我的贡献在于，证明了使用其他的投票或社会选择方法，只要不违背某些自然的条件，就会出现这种难以避免的无传递性。

社会选择的需求是必然的，正文中所论述的矛盾和悖论是无法避免的。这不仅对规范理论而言是问题，同样，它们也符合常见的实际现象。这些现象已经由一些学者用取自美国的数据进行了研究。我希望它们在中华人民共和国对政治和社会体

制的改革能有作用。

哈维·拉瑙特（Hervé Raynaud）和我在第二本书中指出：由许多不同准则来作选择十分相似于社会选择。如若一个企业家要对有风险的措施作出判断，又想避免与工作人员的麻烦，他会发现找出处置的方法是不容易的。这如同他们是社会中具有不同价值观的两个成员。在多准则的情况下，无论如何，各种经验法则导出的结论往往比社会选择所得到的更为可取。我希望这本书的结论对工商企业能有所帮助。

最后，我要感谢首都经济贸易大学出版社和它的领导周嘉硕先生，他建议将这两本书翻译合并为一以飨读者。



诺贝尔经济学奖获奖者学术精品自选集

首批书目：

- 社会科学中的数学和其他论文  
[英] 理查德·斯通 著
- 经济理论与经济计量学  
[美] 劳伦斯·克莱因 著  
杰姆·马奎兹 编
- 社会选择：个性与多准则  
[美] 肯尼思·约瑟夫·阿罗 著
- 中间道路经济学  
[美] 保罗·萨缪尔森 著
- 策略理性模型  
[德] 莱因哈德·泽尔滕 著
- 资产选择  
——投资的有效分散化  
(第二版)  
[美] 哈里·马克威茨 著

封面设计：小 尘

责任编辑：钟 路



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