

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



SELECTIONS OF  
SIMON

---

*by*  
HERBERT SIMON

---

西蒙选集

---

[美] 赫伯特·西蒙 著  
黄涛 译

---

 首都经济贸易大学出版社

SELECTIONS OF SIMON

---

# 西蒙选集

[美] 赫伯特·西蒙 著

黄 涛 译

/// 首都经济贸易大学出版社

**Selections of Simon**

© The MIT Press

根据 MIT Press 原版翻译

**图书在版编目(CIP)数据**

西蒙选集/(美)西蒙(Simon, H. A.)著;黄涛译. -  
北京:首都经济贸易大学出版社,2002.1

(诺贝尔经济学奖获奖者学术精品自选集)

书名原文:Selections of Simon

ISBN 7-5638-0979-1

I.西… II.①西… ②黄… III.企业管理-经  
济理论 IV.F270

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2001)第 045696 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 19.375 印张 492 千字

2002 年 1 月第 1 版 2002 年 1 月第 1 次印刷

ISBN 7-5638-0979-1/F·554

著作权合同登记号

图字:01-1999-1491 号

定价:39.00 元



HERBERT A. SIMON

赫伯特·西蒙 Herbert Simon (1916~2001)

---

美国卡内基-梅隆大学教授。1978年为表彰他“对经济组织内决策程序所进行的开创性研究”，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

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**

## 译 序

2001年2月9日,一个博学多才的头脑停止了思考,赫伯特·亚历山大·西蒙(Herbert Alexander Simon)去世,终年84岁。本书的出版希望能作为对这个杰出人物的纪念,表达我们对他的敬意。

1919年6月15日,作为一个德国移民的后裔,西蒙出生在美国威斯康星州的密尔沃基市。他在芝加哥大学获得了博士学位,并在那里开始了他的执教生涯,随后他倡导建立了卡内基—梅隆大学的工商管理研究生院,此后一直作为心理学教授在那里工作。1978年他由于“对经济组织内决策形成过程的先驱性研究”(诺贝尔奖颁奖辞)而获得了诺贝尔经济学奖。

作为一个思想活跃、精力旺盛的研究者,西蒙的兴趣并不局限在某一个学术领域,而在通常被认为相距甚远的多个领域他都做出了杰出的成绩,这其中包括人工智能、心理学、政治学、社会学和经济学。

由于西蒙在多个研究领域的杰出成就,他获得了诸多荣誉,除了诺贝尔经济学奖外,他在1975年获得了计算机领域的最高荣誉——图灵奖,1986年获得了美国的国家科学奖章。1993年,美国心理学学会因为他对心理学做出的杰出成就而颁发特别奖。1994年,他成为中国科学院14位外籍院士之一。1995

年人工智能国际联合会和美国公共管理学会对他在相关领域的成就颁奖。

在经济学领域，西蒙的成就在于，对“经济人”的概念予以了重新阐释。传统的经济理论中总是假设经济人如同一部精密的计算机器，在所面临的任何形势中均会以当前形势中最优的方式采取行动。换言之，经济学家仅需要考虑在其面临的经济管理形势中何种选择在数学上最优，就可以描述经济人的理性行为。

西蒙认为，在复杂的社会经济形势中，人不是全知全能的上帝，只有有限的计算能力和分析能力，无法充分利用所掌握的大量信息来计算并得到最优选择，在这种情况下人们不是在寻求“最优”，而是在寻求“满意”。这相当于心理学上的“行为主义”，人们设计或改变行为模式是为了使自己得到对刺激更好的反应结果。对此我们可以通过国际象棋的例子来理解，从理论上来说，国际象棋可以通过对有限的树形结构寻求最优而得到最佳策略，博弈论的理论分析也说明国际象棋的结果是严格确定的，如果是全知全能的两个上帝弈棋的话，那么确定了谁先谁后也就确定了结果，没有下棋的必要。然而无论是国际象棋大师，还是超级计算机，都没有足够的计算能力分析每一种可能下法的对弈结果。如果在这样一种严格局限的形势中人们都无法得到理论上最优的策略选择的话，那么怎能期望人们在现实复杂的经济形势中如同传统经济理论中所认为的那样采取最优化的策略呢？

对于这一问题，西蒙的回答就是有名的“有限理性”(bounded rationality)理论，其核心特征就是“满意化”(satisficing)，人们寻求的不是获得最高回报的策略选择，而是寻找一种足够让人满意或者说“足够好”的行动过程，因此经济学或管理学的重要

研究任务就是描述人们的行为模式,刻画他们如何形成决策从而决定自己的行动过程,简单说来就是决策形成过程。

他的这种思想可以说引发了微观经济学的一场“革命”。大师的作用在于让人们从一个新的角度来看问题和研究问题,在西蒙之后,人们对待经济数学模型的态度就发生了变化。这并不是说最优化经济数学模型失去了意义,这些模型仍有意义,但是它们应该被视为一种近似,是人们对复杂经济现实做出简化后用严格数学推理来帮助自己决策的工具。也就是说,它们可以被理解作为一种特殊的满意化策略,并不是寻找对于现实来说最优的决策,而是寻找现实世界一种简化近似的数学模型中的最优来作为我们“可满意”的决策。而这只是现实人类有限理性行为的一种表现,此外,还存在其他或许更为现实、更为重要的方式。例如,人们可直接建立一定的行为规范或准则,由此作为对现实问题的满意化选择。经济学或管理学如果不深入考察这些行为模式或者行为变迁,那么就很难说明现实中人们实际做出的选择。

西蒙对有限理性的研究自然地将他带到计算机科学领域,西蒙和阿伦·纽厄尔最早尝试用计算机来模拟仿真人类的决策形成过程。他们在1955年发明了第一个“思考机器”,成功地编写出程序来证明数学定理,从而开创了人工智能这一新的研究领域。

在长期的学术研究生涯中,西蒙在他所感兴趣的多个领域中均取得了众多成果,其中包括大量学术论文和27本书,在他的著作中,最著名的是《有限理性模型》(Models of Bounded Rationality, 1982初版, 1997再版),《人工智能的科学》(Sciences of Artificial, 1969初版, 1996再版),《管理行为》(Administrative Behavior, 1947初版, 1997再版)。

本书是《有限理性模型》一书的节选,原书是由西蒙众多文章汇集而成的文集,分为上下两卷,内容极为丰富。在编辑出版中文版时,西蒙本人进行了节选,在原书8个部分中挑选了4个最具代表性的部分构成了这个中文版本。本书所收录的论文包含了西蒙对各种经济管理主题的思考,用有限理性这一主线形成一个松散的整体。读完全书我们会发现,西蒙对彼此差异很大的各类主题处理方式非常灵活,其广泛的兴趣和独特的创见均会给人留下深刻的印象。其中一些论文已成为经济管理科学的经典,成为相关学科理论体系的重要组成部分,而其他论文或许因为时间流逝和世事变迁而有所褪色,但其解决问题的方法会给人以莫大教益和启迪。读毕回味,会让人对何为有限理性有更为清晰、更具有立体性的理解,而不仅仅是原则性地了解或仅仅知道几个简单的概念。

应当说明的是,西蒙先生为使本中译本自成体系,从其众多文章中选编了现在的文章,有的入选文章是其某一篇文章的节选。因此中译本中的某些脚注、引文出处指原文本版的页码。为使读者进一步研究的方便,我们对其未做处理,致使现在的中译本中有些注码并没有相应的注文(或页码)希望读者注意。

本书尚未译毕,惊闻先生仙逝,不禁为之扼腕,谨以本书的出版慰先生在天之灵。思索者已然逝去,但其思索长留人间,永为探索科学的人们所记忆。

黄 涛

北京大学光华管理学院

# 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 张理象 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



# 目 录

译序 .....	i
----------	---

## 一般经济理论

1 生产和雇佣安排的线性决策规则 .....	3
2 不确定性下具有二次型目标函数的动态规划 .....	42
3 问题最优解搜索:全解或无解 .....	53
4 生产率增长对城乡人口比例的影响 .....	72
5 核能和落后地区的工业化 .....	87
6 注解:宏观经济稳定性的一些条件 .....	119
7 动态系统中变量的聚合 .....	125
8 论生产关系的简约解释 .....	162
9 雇佣关系的规范理论 .....	184

## 有限理性说

10 理性选择的行为模型 .....	205
11 理性选择和环境结构 .....	228
12 从实质理性到过程理性 .....	245