

CAMBRIDGE

诺 / 贝 / 尔 / 经 / 济 / 学 / 奖 / 获 / 得 / 者 / 丛 / 书

Library of Nobel Laureates in Economic Sciences

经济学中的理性

**Rationality in Economics:
Constructivist and
Ecological Forms**



弗农·L·史密斯 (Vernon L. Smith) 著



 中国人民大学出版社



诺/贝/尔/经/济/学/奖/获/得

Library of Nobel Laureates in Economic Sciences



经济学中的理性

Rationality in Economics: Constructivist and Ecological Forms



弗农·L·史密斯 (Vernon L. Smith) 著

李克强 译

中国人民大学出版社

· 北京 ·

图书在版编目 (CIP) 数据

经济学中的理性/ (美) 史密斯著; 李克强译. —北京: 中国人民大学出版社, 2013. 2

(诺贝尔经济学奖获得者丛书)

ISBN 978-7-300-16998-9

I. ①经… II. ①史… ②李… III. ①经济学-研究 IV. ①F0

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2013) 第 013482 号

诺贝尔经济学奖获得者丛书

经济学中的理性

弗农·L·史密斯 著

李克强 译

Jingjixue zhong de Lixing

出版发行 中国人民大学出版社

社 址 北京中关村大街 31 号

电 话 010-62511242 (总编室)

010-82501766 (邮购部)

010-62515195 (发行公司)

网 址 <http://www.crup.com.cn>

<http://www.ttrnet.com>(人大教研网)

经 销 新华书店

刷 北京中印联印务有限公司

规 格 160 mm×235 mm 16 开本

印 张 21 插页 1

字 数 348 000

邮政编码 100080

010-62511398 (质管部)

010-62514148 (门市部)

010-62515275 (盗版举报)

版 次 2013 年 10 月第 1 版

印 次 2013 年 10 月第 1 次印刷

定 价 59.00 元

版权所有 侵权必究 印装差错 负责调换

序 言

在 20 世纪五六十年代，我开始完善并应用实验经济学的方法来研究市场行为和表现，并于 1963 年开始教授实验经济学方面的研究生课程。这些早期的研究工作一直在持续进行中，并于 60 年代不时地加入经济学设计和“政策”应用方面的实验。因此，20 世纪 60 年代在实验室实验中检验了美国债券的拍卖规则。在各方因素的驱动和帮助下，20 世纪 70 年代，在美国财政部进行了一次实地实验，涉及 16 次债券拍卖，由此推动了 80 年代和 90 年代相关的政策改革。

在亚利桑那大学，我和几位杰出的学生和同事一起，于 1976 年开始在实验室进行电子交易的实验——实验室里的“电子商务”（Williams, 1980）。这些实验主要是为了测试和探索在实验室控制条件下市场表现的理论和其他假设。20 世纪 80 年代，随着我们研究的逐步深入，将实验经济学更加系统地应用于学术以外的商业、法律、工程、管理以及其他实践领域的交流和相互作用的研究框架中，我们的研究成果不断丰富，并为在全世界范围采用的市场机制以及应用于对现有市场机制规则评价体系的后评价提供了检验平台。

所有这些实验室的经历，改变了我们对于经济分析和行为的思考方式，因为实验方法有自己的生命力——这是一个我最初没有清醒意识到的事实，因为我当时完全受主流的经济学思维方式影响。我的思维转变开始于 20 世纪 60 年代，但进程十分缓慢。产生这种变化的原因有很多，但具有独特意义的是，在富有挑战性的设计和实验进程中，我得到了一些足以刷新自身认知的发现，推动我去研究代理人交易过程中制度安排的规则和过程。很少有人像阿尔伯特·爱因斯坦那样，如此精通于通过制定详细并富有想象力的心理实验——或者说是思维实验，这是由

恩斯特·马赫引入德国的一个概念——来不断获得新发现。科学家需要现实实验的挑战来训练他们必需的细节思维。这种实践支持并促进了实验知识在经济学和所有科学中的发展。这种知识具有自己的生命，其传统和技术截然不同与每个特定科学相关的理论和检验假设。

在我看来，经济理论逐渐成为了一个在贯彻执行现有的交易机制条件下，对均衡价格和分配形式进行预测的理论框架。实验提供了一个缩小纸面上的均衡理论和市场机制控制下的代理人所做出的经济决策之间的差距的方法。市场机制对于市场参与者来说比较复杂，他们绝不是像我们这些经济学家在研究经济理论时所想的那样做出决策。实验作为一种替代品，填补了动态过程分析的空白，动态过程分析并不是标准均衡理论的一部分，标准均衡理论在任何过程下只关注均衡结果。

早期的研究结果，以及它的复制与延伸结论，也同样重要。这些理论认为，人们可以很快地学会如何在非公开的信息不完全的环境中采取行动，他们通过运用现有制度的行为（财产）权利规则以及人们天生的认知技能，来寻找交易机会，并随着时间的推移，实现仅有完全信息假设的模型所预测的均衡结果。人类在规则控制的动态过程的中心运作良好，但却没有意识到未来可能面对的困境。引发我最新见解的核心因素是一个逐渐成长的、令人不安的、还没有解决的困惑，即经济代理人抑或经济主体是如何获得使他们能在社会经济环境中达到如此良好运作的内生知识的，这个“知识获得之谜”很少被经济学和心理学承认、研究或理解。虽然代理人的行为并非由我们构建理论时所采用的心理过程所控制，但是，他们在几乎不存在对称信息的重复市场中的高效率却令人吃惊、心生敬畏。我认为这很好地说明了为什么在通信时代，这些机制依然能够存在、成长，并且每天都产生新的变化。

说来惭愧，我逐渐意识到，在传统模型中，我们除了知道实验对象或经济代理人是如何采取行动的以外，没有人知道他们是如何及时处理信息的——如果你询问他们，你会发现他们自己也不清楚。这个观察与理论的复杂程度无关；即使把理论家放在实验中，事实上我已经这么做了，他们也不能清楚地解释自己与他人是如何在某一机制下相互作用的。此外，在分散的非公开信息市场中，他们的行为表现并不比典型的学生研究主体更有效或无效。在不完全信息环境中的重复行为或实时行为，是一种不同于基于“给定”信息假设模型的操作技能，它支配着经济环境，人们在其中探寻均衡、最优性和福利等命题。这一决策技能基于人类强大的获得内生知识的能力，这一能力几乎不能用任何自然或书

面语言的词汇片段来描绘。

在实验室中对于这种技能的发现和观察的研究结果已经为工业和政府领域的管理者和决策者建立有效的相互作用机制提供了理论基础。通过展示、亲身示范以及与相关人群共同学习、开展有益对话交流，这些实践者很容易将实验框架与实际相联系；主体是“我们”，而不是由“我们”和“他们”所构成的团体。做到这一点根本不需要任何标准的经济学背景，尤其是当所设计的问题太复杂以至根本不能用传统的方法建模的时候。实践者关注的是问题的解决方案，并没有很自然地联系到经济理论的研究课题及其“应用”，因为他们不会自动地把这些与自己的经验相联系，但当他们亲眼看到和体验到，并成为这些新的市场和管理机制体系设计和测验过程中很活跃的一分子时，他们就会认识到模型的有效性。实验提供了定义一门共同语言的方法，并为解决问题提供了经验基础。

经过几十年在实验室的实验调查，我意识到，静态均衡理论逐渐具有新的和更具活力的生命，因为标准理论遗漏了对于我们理解在分散的信息环境中信息和分配规则如何能够影响均衡形成最重要的部分。均衡理论开始于一个偏好/生产框架，以支持市场价格和派生的效用、特定的稳定性以及该系统分配的性能。但是该理论包含了一个有组织的信息交换基础上的非价格发现过程，以及规定了在信息交换中协议出现方式的规则。这是不包括过程的静态均衡理论，该理论的思维方式仍将主导不对称信息模型，并持续带来新的重要贡献。

本书详细地描述了我的思想演变过程，也正是此书使我开始重视古典学者们与哈耶克的研究。事实上，我很久以前就阅读了哈耶克的著作（1945），他的思想甚至引领我写了斯密的相关研究（1982b），但他的其他作品我不是没有看过就是没有意识到其的重要性，因为我的头脑还不足以领悟其全部含义的深刻性。直到几年前，这种情况才有了戏剧性的改变——最近我惊讶地发现，斯密选集（2000）完全没提及哈耶克——当我“真正发现了”哈耶克并且再次阅读其经典著作时，对于亚当·斯密（1759；1982，1776；1981）、大卫·休谟以及其他伟大的苏格兰启蒙运动著作的认识就焕然一新了。从当代认知心理学领域的发展来看，亚当·斯密（1759；1982）的第一本书是特别富有洞察力的，但其中一小部分经济学观点使他获得了最多的关注。

我参加了几次自由基金会议，其间，对于古典经济学以及其后面的分支流派的讨论，帮助我实现了这些新发现，并与自己以往在实验室的

实验经历实现了新的有机结合。我一生对于实验经济学的职业研究为我带来的思想上的变化，使我能够更好地理解哈耶克和他的苏格兰前辈的思想的深层内涵，此前在某种程度上主流技术流派的研究认为其已偏离了正常轨道。

我希望通过更具体的例子和实证阐明哈耶克所谈论的——他留给我们的少数的珍贵财富——还有苏格兰的天才们试图传达给我们的东西。21 世纪将是一个再度觉醒的世纪，一个深层次文化启蒙的世纪，一个在新式分析工具的基础上进行重新调查的世纪。

因为我在本书研究建构主义和生态理性的命题时特别关注结合实验和实证的例子，所以很多例子并没有进行深入分析。不过，我尽力提供参考文献，使有兴趣的读者能进行更深入的研究。在本书的写作中，很多辅助的、相关的或补充的注释都是有意义的，我按照惯常的作风，把其中的一些作为脚注，但我也将其中的很多内容直接加入正文并用专栏形式标记，使之更容易引起读者注意，读者可以自由选择阅读或是绕过它们继续阅读正文。

在我创作本书的几年中，也出现了大量与此主题相关的著作。在许多情况下我曾尝试与这些快速发展的著作相结合，但是必定有所局限。因此，我虽然不能将所有与我的研究相关联的研究都悉数提及，但我希望读者可以更深入地研读那些著作以满足自己的学术欲求。

弗吉尼亚州阿灵顿
阿拉斯加州安克雷奇
亚利桑那州图森市

前言

规则本身可以形成一种范围广泛的秩序……在一个自发的秩序体制内，任何人都不知道也没必要知道所有应追求的目标和所有可以采用的方法。这种秩序自我形成……

哈耶克（1988，pp. 19 - 20）

现实主义者大体上对于不能把握的事情是放任不睬的，只是忙于一些琐事。

纪伯伦（1918；2002，p. 55）

实验经济学所擅长的就是对基于人类行为的微观经济学研究领域进行测量、试验和探索，而人类行为是由非标准的社会交易规则或一些更明确的机构间交换规则所支配。它还不那么擅长在人类社会和经济发展更广阔背景下进行归纳和诠释。如果我们能够找到一种方法来将近半个世纪的实验研究中所获得的研究结果应用于对人类事业更广泛的研究领域，那么这些研究结果就变得意义重大，否则，我们的研究所得就会过于狭窄、支离破碎而且只能流行一时，因为学者们会转而深入研究其他研究课题中各种错综复杂的细节。本书是我为拓展社会和市场经济行为方法研究视野而努力完成的研究成果，并就这一努力过程对于一个更大群体所能贡献的价值与读者进行交流。我知道其他学者也正在做类似的研究，因为我们在推进和深入的过程中在不时地彼此交流和分享。我现在所看到的画面仍是模糊不清的，不过它的轮廓是明确无误的。它有待他人去清晰化或改变，即使大部分人并不知道它，而仅仅用自己的方式去追求。

如果我们要去直接挑战方法论，就必须从认识构成我们的主题现象

开始，这种现象起因于非凡的社交和文化能力，从而去发现能够广泛推动提升人类福祉的各种形式的交互作用和机制。我们所构建和研究的情形，是从个人交往、协会、企业和集体中自然产生的。在这个过程中，积极活动的个体对经济活动的理解是发自本能的，但是深厚的个人经验知识能够让他们的行为更有利（Polanyi, 1962, 1969）。

这些因素都使得我对哈耶克关于两种理性之间重要区别的兴趣更加浓厚。我会努力将这本书中所有的讨论以及实验、实地验证和描述的例子与以下两个理性的概念联系在一起：

建构理性，当用于个人或团体时，指的是在分析和确定采用某种行动方案比其他备选的可行方案更为合理时所采取的深思熟虑的推理过程。当应用于组织机制时，建构主义指为达到理想的表现而对制度体系进行的深思熟虑的设计过程。后者包括组织机制的“最优化设计”，目的是设计出一种有效激励机制，可以影响行动个体在面临多重选择时选择更好的行动方案。

生态理性指的是以惯例、规范和不断进化的机制法则形式出现的自然规律，这些规律主宰着人类的行动，是我们文化和生物学遗产的一部分，由人类之间的互动行动产生，而不是来源于人类有意识的设计。

这两个概念本质上并非对立的；需要强调的是，这并不像有些人认为或喜欢的那样，建构主义者与生态理性之间是对抗的，实际上这两者可以并且事实上可以共同起作用、相互支持。例如，在进化过程中，建构主义者的文化创新能够提供各种变化，而生态学适者生存的过程则负责进行选择。我们会遇到很多两种理性一致的例子，在其他的例子中，它们之间虽存在分歧，但至少是在寻求融合。

举个例子，在农业革命以前，人们在信息不对称的市场中进行交易进而实现专业分工。虽然那是很久以前，所面临的问题还不是太棘手，但当时我们的祖先就能够发现并且解决一些公共问题，并且发现通过个体约定能够制造出所需的公共产品。他们克服了背叛约定的诱惑而进行有效合作，在公元前就建立了有效的拍卖系统，并且适时地把这套系统延伸至从艺术品到证券的各个交易领域。所有这些具有非凡意义的发展成就都同时伴随着互相倾轧、惩罚和暴力的形式以及持续不断出现的群体内与群体外的道德执行标准的区别对待。虽然作为经济学家，我们构建了公共产品问题的理性模型，但是在过去，在标准的经济分析中，这种分析方法在分析社会中由于个人之间的相互作用而自然形成社会行为时并不是必然要采用的。同样，在数以百计的市场实验中，那些非经济

学专业、对经济学理论一无所知，但同时对于自身所参与的活动非常熟悉的个体，事实上完全不懂理性，也不懂他们行为结果带来的所谓效率等知识，依然可以达到经济学上认为的理性结果。一旦我们认识到，我们的祖先和同时代的人们创造我们在实验中所研究的这些组织机制形式是依靠他们所传承的文化和生物遗产时，他们这种自发行为的有效性也就不太令人惊讶了。但是当我们在经济分析中继续去补充完善“无核心组织机制”（institution free core）概念时，我们（自19世纪70年代以来）的新古典主义模型却不能用来做预测，甚至都不能用来对这一重要发展方向做一些补充及完善工作。

作为理论家，我们对于建构问题的定义和“解决办法”的精雕细琢很可能导致对激励失效问题的关注，但抽象激励法可能会忽视重要的特点。以公共产品供给问题为例。最初，我们认为并且灌输给大家，靠个体行为不能有效生产公共产品。然而，在经典的灯塔例子中，由灯塔发射的信号，可以由所有船只以零边际成本获得，而灯塔却是由私人资本承担费用，此时经济学还未成为一门完善的学科。鼓励私人投资和防止搭便车者的难题在实践中得到了很好的解决，即由灯塔所有者与港口当局签订协议，允许灯塔所有者向停靠船只收取灯塔服务费（Coase, 1974）。通过这些协议，灯塔的投资成本（在产生之前是离散成本）在停靠的船只中按比例分摊，因为靠岸停靠为测量灯塔服务的使用和消费价值提供了一个有效和实用的方式。从“效用最大化”的角度来讲，理论上认为，所谓的“固定”成本，一旦发生，就不应该影响灯塔服务的价格。但是，这一论点实际上是荒谬的空想，因为它忽略了如果没有灯塔的建造而导致的无效结果。

那个著名的关于放养牛群的“公地悲剧”理论，对于居住在海拔很高的阿尔卑斯山的瑞士奶酪制造商来说毫无疑问不一定是个悲剧，至少从公元1224年开始，这些制造商就在每个夏天在公地放养奶牛。夏季牧场的放养行为由一条产权规则限定，根据这一规则，“任何公民在高山放养奶牛的数量都不得超出冬季的饲养数量”^①（Netting 1976, p. 139）。这些经济学构思出来的问题，被人很好地解决了，解决问题的人完全没有学过搭便车理论，但是他们有足够的经验来协调相互之间的行为，以寻求最有效的解决办法。不管怎样，他们通过不断地进行“自然实验”，在反复试错中找到了最优化的解决方案。

^① 在科斯发现的灯塔解决方案中，内丁的研究解释说，任何航运公司通过灯塔的船只数量都不得超过所支付的船舶停靠费所涉及的船只数量。

建构主义分析向我们展示了具有排他性的公共产品的例子。在所有这样的案例中，所要研究的问题是，是否存在能够限制使用的可行办法，从而避免外部成本或使外部成本内部化，或者是确保支付可以覆盖投资成本。并不是每一个这样的组织机制设计问题都有一个人们能够自然从经验中得出的解决方案。奥斯特姆（Ostrom, 1990）研究了全世界以及新兴的自治机构解决各种不同共同财产资源问题的案例，发现他们的解决方式并未能解决所面临的管理问题。^① 像前面所举的内丁和科斯例子中的解决方案，通常是非常巧妙的，超出我们这种书面理论模型的想象，其主要价值在于使我们能够明白为什么过去以及现在还有一些问题需要解决，但是本身并不能帮我们找出这些例子的解决方案。

我们对于这两个概念如何既存在分歧又相互融合仍然没有全面的理解。特别是，我们的专业传统不适合模拟那些生态过程，生态过程有助于我们更好地理解自然涌现的社会制度。例如，不存在城邦的群体也会发现能够创造财富的分工、比较优势、交易机制和配套的产权机制吗？^②

下面我们从博弈论的角度来进一步详细阐释这两种理性：对任何观察到的问题，我们专业的研究方式是给出一个抽象的博弈模型，分析在特定情形或组织机制中发生的情况，然后将均衡结果与最优化结果进行对比——比如灯塔或公共牧场搭便车的例子。这些组织机制的模型和最优化结果都是建构理性的一次推演。但是在这些推演中，我们设定好了具体的游戏规则、可以观察到的现象，以及控制这些机制的社会组织架构和管理规则，例如让灯塔公司在市场上签订协议，或在瑞士阿尔卑斯山中构造出一个公共用地管理机构。而后者（生态理性）则是一个关于如何出于人类经验、通过生态理性自然产生经济自治机制的天然案例。现在让我们回到实验室检验，例如构建一个共有产权资源的模型（如内丁在1976年所描述的机制），有关这方面实验室的研究结果已经被发表（例如见 Cesari and Plott, 2003）。在这一实验中，在由所观测到的实际情况所决定的规则下，测试的主体相互影响。最重要的一点区别就是，由于实验者将实验条件下的所有私人价值和成本进行了分配，所以我们

^① 基于激励规则而自愿提供公共产品的实验内容，可参见史密斯（1991）的相关论述；也可见奥斯特姆等（1994）关于共同财产资源问题的理论分析、组织分析，以及实验及实地研究成果。

^② 科罗凯特等（2006）的开创性的研究尝试设计一个实验模型来研究所有问题的根源，并将研究成果发表。

就能够决定预期得到的均衡结果并可以衡量其最优性或效用。假设随着时间的推移,经过动态的相互作用,这些测试主体达到了预期的均衡。那么研究测试主体如何在未被实验模型所界定的未知的、动态的精神活动和社会因素驱动下达到有效的静态结果的能力,就是生态理性实验室案例的研究领域了。

我认为,对于各种形式的生态理性的持续深入理解,将来源于人们对于“如何”获得人类知识的过程的探究,而不是对于人类知识“是什么”的本身的探究,这很大程度上是由人类大脑的自主功能决定的。通过人与人的交往,人们可以无意识地学习到很多规则和社会经济技能规范,而这种学习过程是几乎没有任何具体指导的,就像我们学习自然语言一样;我们可以认为这是不断进化中的“社会大脑”在起作用。这与那种刻意地去学习诸如一段钢琴练习曲或参与一次竞标似的学习不一样,后者需要关注、效仿和适应性资源,但随后这也可以很快变成无意识的行为,就像所有由训练有素的大脑所控制和指挥的任何常规心理活动一样。这就是波兰尼(1962)提出的隐含知识,它通过直觉的(难以用语言表达的)过程,可以自发地动态获得。^①我们学习社会交往,并没有有意识地使用关注、效仿和适应性资源,但是所获得的技能能够使我们在交往中学有所得,这种收获使我们的这种学习常态化。人类不是“思想机器”,因为我们常常要依靠有意识的认知过程进行学习,而这种学习办法是有内在局限性的。

本书主要研究由实验经济学和实地检验及应用中的研究行为所产生的研究成果和方法,但这些研究成果和方法并没有包括本书的全部内容,也并不是此书知识所生发出的仅有的观测结论。来自实验室实验的证据被广泛认为是研究人类生涯——它的发展、意义以及变革的一个窗口。因此,贯穿本书始末我都在试图将实验室试验的发现与历史、人类学、考古学、民族学、实地实证研究、心理学(包括其重要的社会和进化分支)、动物行为学、哲学、科学方法论、神经科学、思想史和实际的生活经验相联系。

将“生态”一词与实验室研究发现联系在一起,对于那些认为实验

^① 这一知识解释了为什么实验室和实地研究的结果是可转化的,可以从一组实地观测转移到另一组,也可以从一个实验室实验转移到另一个,这本质上是一个经验结论,而不是通过探讨可以得出的方法论结论。[见史密斯(1982a)对于实地检验和实验室实验间的“平行”研究;实地检验与实验室实验的对比分析是一个人们经常探讨的问题,最近的研究来自哈里森和李斯特(2004)的探讨。]

证据在某种程度上是人造的而“生态”是自然的人来说可能会有些奇怪。但是其实“生态”只是用来描述由规则支配的、自主调节的秩序出现的结果的另一种表述，我想避免将所得到的观察人为割裂开来，将它们放在不同的箱子里，作上标记，而不是在其中寻求一致的主题。如果我们能找到合适的方法来寻求一致性，那么我们就应当承认这个观念，即在所有情况下，所有的人类个体都是直观的、感性的、探寻的并且行动着的有机体，当他们参与决策和进行选择时，他们从不自然地知识进行人为分割——除非在标准的建模过程中。至少在没有将实验证据和其在经济设计、产业化以及政策方面的应用更大程度地贯通起来，或是未经社会实践更大程度的检验的情况下，在一个市场中，或者，在一个主体与另一个实验主体在扩展博弈模式中匿名相互作用时，人们不应推测由实验主体选择的行动，因为这并不能帮助我们研究并了解人类世界。

以下五个基本命题贯穿于本书的大部分内容：

- 财富的创造根本上取决于知识和技能的分工。这包括革新和技术变革，因为这些是获取关于“如何”的隐含知识的关键。

- 分工只有通过合作和交易体系才成为可能，这种体系由个体的人类社会性和非个体的市场机制共同产生。因此，分工并不是一个只取决于市场的现象，尽管它基本是市场能够在现代世界财富创造方面取得巨大成功的主要源泉——这也是亚当·斯密第二本书的核心理论。分工和交易比市场存在的历史要久远得多，这是更好地理解人类社会的基础。

- 在任何时候，支配分工和交易体系的个人知识都是分散的、私人的，因此在所有社会制度中，信息都是不对称的。

- 新古典经济学和信息经济学通过给定信息使得非个人的社会制度达到了均衡状态。反之，实验经济学认为，通过不断地反复相互作用，通过现有的非个人的市场机制，人们也能达到均衡。

- 经济学关于以下几个命题的理论模型还有所缺失或不够完善：人们如何仅仅依靠非公开信息和现存的市场机制提供的信息就可以有效达到均衡结果；对于私人交易机制的研究如何能使我们更好地理解其在人类早期发现分工的过程中所起的作用；分工和交换如何与创新和技术变革相关；以及在人类社会的经济发展中机制是如何出现和得以流传下来的。

本书的主题可归纳如下^①：

● 众所周知的“亚当·斯密之谜”（《道德情操论》和《国富论》之间所存在的内在矛盾）是一个伪问题，其中的“交易、交换和以物换物的倾向”同时适用于个人交换（我在回顾中发现，这是斯密第一本书的核心内容，但当然不是全部的内容，因为这本书广泛地论述了人类的社会性）和市场中的公开交易（这是他第二本书的主题）（同时可见诺斯1990年和2005年的论述）。

● 哈耶克和亚当·斯密（以及和他同时代的人，包括大卫·休谟和亚当·弗格森）都充分意识到了两种理性规则：建构主义和生态主义的共生性。许多当代经济学家却持有不同观点。[当然还是有一些经济学家是同意的，特别是宾摩尔（1994，1997）；还有纳尔逊和纳尔逊（2002）。] 本书的部分篇章阐述了这两种理性规则的理论基础。

● 长期以来，传统经济学理论都是在建构理性基础上，对有动机的人类通过深思熟虑的权衡而采取行动的假设进行研究。因此，自从杰文斯1871年的理论提出后长达80多年的时间里，理论界一直遵循着他的研究，因而，不能预期到个体在不具备完全信息的情况下通过不断的相互作用仍可达到均衡的市场结果，事实上这一观点长期以来已经通过许多不同的、某些甚至涉及相当复杂的经济环境的实验而证实。

● 在建构主义者大胆探索的过程中，与之相区别的是，出现了“生态理性”机制，这些机制如此完善以至经济学家很难有再进行改进的空间，虽然经济学家一直视之为己任。第二种“理性规则”的理论基础，大体上就是达尔文的自然选择学说。就像自然系统如生态系统或人体（其本身就是一个微型生态系统）等可以进行自我调节一样，社会组织机制（如村庄、城市、市场、协会和科学团体等，它们都由内生或以规章条文形式外部化的产权制度所支持）也是如此。一般来说，人类组织机制和决策过程不是仅仅或者主要由建构主义进行支配，建构主义更重要的作用在于产生变革——社会和经济创新，而不是选择哪些能生存。

● 在市场交换实验中，为达到有效合作的结果，个体通过对可能性结果的价值（和成本）的货币化计算来追求效用最大化。因此其背后的经典行为模型——经济人假设，在这些公开交易环境下得到强有力的支持。但这些实验中的交易机制是靠强有力的外部（产权）制度支持的，

^① 这个摘要直接来源于安德列斯·奥特曼，他审查了这个稿子的早期版本。对于他为书稿所做的全面而令人振奋的审阅工作我十分感谢，这促使我对正文、参考文献和文体进一步进行了许多很有意义的修改和补充。

制度不允许不劳而获，也不允许免费赠与。因此，在严格的自我利益中心支配下的行为不会与共同的社会效用改善相抵触。但是，如果从这一观察中就得出结论，认为在更广泛的实验研究领域，在为切身利益采取行动时，人们始终遵循经济人假设，那就可能大错特错了。

● 因此，在本书的第三部分，我转向对个体社会经济交易领域的研究，这其实是二人扩展博弈理论的一部分。在这样的经济环境中，如果没有人面临对手背叛的危险，是不会达到共同效用最大化的，而如果他的交易对手服从经济人假设并且总是根据效用最大化进行决策，必然会选择背叛。但即使是在素不相识者的单次博弈中，这种背叛也不一定会出现。如果两人的交易中存在产权，他们必须达成互惠共利的共识并且共担风险，以避免任何一方不劳而获。在这种情况下，我们就可以观察到考虑他人利益的行为，其比标准模型会达到更多的合作。

● 即使不是绝大多数，也有许多学者在传统的静态均衡理论基础上，构建了加入考虑他人利益的行为效用参数的模型，他们相信我们的实验完全能控制除偏好以外的所有事情。这一模型混淆了基于信誉的互惠动机而进行的交易合作与出于无私偏好的合作。因此，我倾向于不提及经济人假设，而是采用更普遍使用的标准社会科学模型（SSSM），这一模型可以推测出一些用来解释静态自私模型（Barkow et al., 1992）预测失败原因的社会性参数或其他形式因素。

● 我们的大脑与社会经济世界的演变、运行模式存在有趣的相似性。世界和我们的大脑都可以自然产生问题的解决方案，本质上是通过各种形式的选择完成的，而这种选择却基本不属于我们所谓的正式思考推理的范畴。在世界范围内，我们的社会大脑自然产生解决问题的机制，人体的大脑自然形成内部非主动意识的处理能力，使我们能够在日常生活中不需要持续的监测和有意识的控制就可以自然行动，这是一个对作为稀缺资源而突然出现在大脑中的急智的适应。我们没有察觉这些处理过程，并且我们有着以自我为中心的倾向，认为一切尽在掌控之中，这自然导致哈耶克（1998）所总结的“‘致命的自负’；认为我们有能力从推理中获取技能”（p. 21）。

● 哈耶克在对人类社会的生物学和文化学协同进化过程的研究中提出了三种较为复杂而又自发产生的规则：（1）思想的内生处理规则；（2）社会交换的外部规则；（3）延展的市场规则。这三种规则都是生态理性中非常重要的概念。第一种规则来源于对感知的神经心理学方面的研究，由哈耶克自 20 世纪 20 年代开始研究，其相关成果于 1952 年发

表。第二种规则研究的是小群体交易中的人类社会性。在本书中，这个概念被特别用来研究扩展形式二人博弈的交换行为。第三种规则研究的是市场经济秩序和社会福利，也是哈耶克最著名的理论遗产。以上三种规则都将在本书中进行系统回顾，尽管它们并不是实验经济学起源的动因和发展的推手，也不是我自己在实验中所获得的。

● 实验经济学使我们能够学习和更好地理解生态理性，以及建构主义与生态理性能够互相融通的方式。具体来说，实验经济学有助于我们检验一些由生态理性驱动过程所产生的建构理性主张是否可行。例如，在第12章，我们将检验源于互惠偏好（以德报德）而非利他主义偏好的二人信任博弈中的合作主张。实验提供了一个成本相对较低的研究方法，研究那些不是或可能是的命题。但是要确保成功和透彻，我们还必须跳出实验室，关注相关的实地研究和实践应用。

● 随着众多新兴计算机通信技术的发展，这些研究成就已衍生出一门新的子学科——经济系统设计（ESD）学，它将建构主义工具和从经验（生态进程）中获取的知识相结合，从而形成新的集体决策体系，在实验室和实地检验，并根据经验来修正。检验是至关重要的，因为我们的建构可能会由于没有设计正确的参数、设立了不适当的假设、对参与者来说不可执行或不现实等原因而发生错误。

本书中的建构主义和生态学命题也同样适用于包括经济学在内的所有科学实验方法。我将在第四部分对这部分成果进行发展应用，以解释人们会曲解科学家，认为他们既不定义自己做什么，也不定义自己应该做什么，尽管科学家所做的本身已经说明了他们所说的事情。我也将探讨科学（和数学）方法的不完备性，以及为什么说构建一个合理的科学研究方法论的失败尝试并不会导致恐慌或后现代的冷嘲热讽。人类社会性拯救了世界，它支配着我们的科学体系的运行，并使我们能够在各种弄虚作假的实验的扭曲下艰难前行。在这方面，人类在科学研究方面的成功与人类在财富创造方面的成功没有什么不同，都是通过市场和其他由人类智慧创造的社会创新所支持的分工实现的。

最后，在第14章，我简要探讨了新兴的神经经济学科学，虽然其主题和神经系统科学的理念已经在全书前后适当的地方多次出现。

目 录

第一部分 理性、市场和机制

第 1 章 重新发现苏格兰哲学家	3
社会和经济秩序中的交换	3
从苏格兰所学到的	6
第 2 章 关于理性的两种形式	11
导 论	12
建构主义理性	13
建构主义理性的局限和困惑	18
生态理性	22
启 示	27

第二部分 公开交换：市场的扩展秩序

第 3 章 理性秩序中两个概念之间的关系	31
导 论	31
放宽航线管制	32
加州能源危机	35
经济系统设计	38
建构主义作为对自然出现的规则的理性重建	41
第 4 章 市场制度和功能	45
知识、机制和市场	45
艾奥瓦州电子市场	51
策略检验：理论与行为	53