

<<社会制度的经济理论>>

图书基本信息

书名：<<社会制度的经济理论>>

13位ISBN编号：9787810499170

10位ISBN编号：7810499173

出版时间：2004-4

出版时间：上海财经大学出版社

作者：肖特

页数：255

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：<http://www.tushu007.com>

## <<社会制度的经济理论>>

### 内容概要

读者所看到的，是一本伟大的著作。  
作者将制度看作足博弈的结果，而不是博弈的规则本身，这种观点在经济学理论中是具有独创性的，同时这也使得演进博弈理论能够成功地用于研究制度的变迁。  
我们认为，更为重要的是，在肖特所提供的理论中，他将由演进而来的规范(制度)理解为一种“大家共享的知识传统”，用汪丁丁的话来说，这“使得人们在许多可能的均衡策略中一眼就看出哪些是‘明显’的玩法”，汪丁丁认为，认识到这一点的经济学家只有三个，他们是宾默尔(K. Binmore)、克雷普斯(D. Kreps)和本书的作者肖特。

肖特教授是在美国以及在世界上均知名度甚高的一位经济学家，其主要研究领域是实验经济学、微观经济学、博弈论，以及社会与经济制度的数理理论。  
这部《社会制度的经济理论》是肖特的第一部学术专著。  
它也是经济学说史上用博弈论方法系统研究人类社会的制度现象的第一部学术著作。

## <<社会制度的经济理论>>

### 书籍目录

“当代制度分析前沿系列”总序 林毅夫博弈论制度分析史上的第一块里程碑——肖特《社会制度的经济理论》中译本序 韦森序言

1. 社会制度的性质与功能
  - 1.1 面向一个新的经济学观点
  - 1.2 福利经济学和比较社会制度：博弈的最优规则
  - 1.3 谁应该研究社会制度博弈
  - 1.4 交通博弈
  - 1.5 制度的界定
  - 1.6 电话博弈
  - 1.7 方法
  - 1.8 制度与不确定性
2. 弟兄博弈
  - 2.1 一些博弈理论的术语
  - 2.2 对后面内容的预览
  - 2.3 自然状态理论和制度的产生
  - 2.4 可能导致社会制度创生的情况
  - 2.5 一些例子
  - 2.6 总结
3. 一个制度创生的数理理论在一个两人世界里制度的创生
  - 3.1 在一个囚犯困境世界里的制度创生
  - 3.2 超博弈
  - 3.3 在超博弈中的均衡：均衡的惯例和制度
  - 3.4 静态贝叶斯解过程
  - 3.5 分析
  - 3.6 均衡
  - 3.7 总结一般情况
  - 3.8 背景的预备
  - 3.9 我们分析的随机游走模型
  - 3.10 收敛和第一通过时间：我们模型的假设
  - 3.11 收敛和第一通过时间：一般的结果.....

## &lt;&lt;社会制度的经济理论&gt;&gt;

## 章节摘录

接下来的章节给出了一种并不典型的方法来处理经济问题。

虽然它基本上是博弈理论的方法，但它却不同于经典博弈论的表述形式，它是演化的，而不是静态的或动态的。

在经典博弈理论里，博弈的参加者被处理为完全由他们的信息和策略集合以及他们的偏好来描述的抽象的主体。

结果，在选择策略的时候，他们被允许使用的惟一信息在博弈开始之前就已经被正式地包括在博弈的描述里了。

不管怎样，我们开始研究时假设最有趣的博弈不是一次性的博弈，也不是在一些固定的参与者之间进行一次而且只进行一次的博弈，而是反复出现的超博弈（supergames），或者一次又一次重复的博弈。

此外，在这些反复出现的情况里，随着充当博弈里某些抽象角色的行为人的离开，博弈的参与者也一直在变化。

因此，博弈或由它们所描述的社会制度并没有被看作是静态的现象，而是被看作博弈参与者不断变化的演化的情况。

这种方法的结果是，随着博弈被重复地进行，博弈的参与者发展了某些特定的被社会认同的经验规则、规范、惯例和制度，并传递给后代的博弈参与者。

于是，我们的博弈参与者比经典的 $n$ 人博弈中的参与者拥有更多的信息，因为他们不仅以精炼的形式了解博弈，而且还了解被经典博弈论作为在博弈理论之外的内容而忽视了整个制度集合。

将这个信息严密地包含在博弈理论分析里是本书的贡献之一。

在我们的分析之中，博弈参与者是真实的，而不是抽象的主体。

他们能够发展信用，创生经验规则和社会制度，并且遵守它们。

在第3章中，我们将看到这种方法详尽的影响。

在第3章的这一部分，我尝试证明制度创生的过程可以被有意义地表示为一个超博弈，其中，所出现的均衡的行为惯例或社会制度是建立在随着博弈进行的历史展开而创生的行为规范之上的。有非常重要的一点需要指出，这一点也使这种方法显得独特，实际被创生来解决所描述的重复囚犯困境博弈的社会制度是一个随机事件，如果历史可以被重复，在同样的情况下，可能建立一个完全不同的惯例。

这一点表明，在任何时点上存在的制度集合真的是历史的偶然事件，今天存在的制度完全可能以一种非常不同的方式得以演化。

所有我们知道的关于一个社会的制度历史的知识是什么已经发生了，而不是什么可能会发生。

最后，关于这一章中实际给出的模型，显然它是非常一般性的，如果不是特别一般性的话。

事实上，它更像是一个框架，这样的现象的各种模型都可以放在其中，因为简单地通过界定不同的作为行为描述的SBSP和规范更新规则，并考察所获得的结果，使用我们的框架可以建立一系列特殊的模型。

然而，至此所使用的一般性程度具有不将我们局限于某个SBSP的好处。

在这一章的第二部分，我们证明，当我们的模型与任何满足一组最起码的标准的SBSP相联系来使用的时候，将得到一个单一的随机扩散过程，它对任意给定的博弈规定了规范的出现，而且这个过程有一个惟一的解。

当这被完成后，我们提供一个实例，它将我们的理论用到一个特殊的协调问题中去，阐明实际将产生什么样的扩散过程类型。

我们的分析将被严格地限制在囚犯困境类型的问题中，除非我们考虑的是协调问题。

然而，的确存在着更有信息效率的策略类型。

如果采用其中被称为“行为策略”的一种，策略计算中所需要的信息存储与回收的数量就能够被极大地削减。

行为策略背后的思想是相当简单的。

## &lt;&lt;社会制度的经济理论&gt;&gt;

与混合策略对全局范围内的每个纯策略赋予一个概率分布所不同，一项行为策略仅对每个局部的信息集赋予概率分布，从而定义了参与者在该信息集上选择可行行动将使用的概率权重。

换言之，参与者采用行为策略就不必计算所有的纯策略并对每个纯策略赋予一个概率权重，他只要为他的每个信息集选择一个概率分布。

这就简单多了。

制度与新古典理论 如同德布鲁（Debreu 1959）和阿罗与哈恩（Arrow and Hahn 1971）的工作中可见到的那样，今天的经济学是一门有限地讨论制度的科学。

其中仅有的社会或经济的制度就是所有行为人在里头根据给定参数孤立行动的竞争性市场。

这种制度细节的缺乏必须被视为理论的不足。

为更好地理解这一点，让我们来看一个一般竞争均衡现象的典型的新古典模型。

模型首先需要声明在所考察的理论世界中只存在两类行为人——消费者与生产者。

消费者消费商品并提供劳动以便在给定的预算和时间约束下最大化其效用。

他们最大化行为的结果由需求的对应或函数来概括。

生产者被假定为通过将投入转化为产出来最大化利润。

他们最大化行为的结果由供给的对应或函数来概括。

至此，这个模型仍足够无害，但它只描述了符合简单的理性行为假定的行为人共同存在于其中的物质世界。

然而，在封闭这个模型时就有一个问题产生，因为，此时我们还需要一种协调两类行为人决策的机制。

理论家们则将其求助于一个扭转局势的人（*deus ex machina*），而不是直面这个问题。

一个虚拟的拍卖人被想像成向供求双方报价并计算这些价格下将出现的需求与供给量。

这个假设的问题并不在于脱离实际，因为虽然这种虚拟的拍卖人显然是不存在的，但可以说市场在发挥作用时就好像他的确存在似的。

更确切地说，这种假设有以下两点不足： 1. 它使模型丧失了所有行为的或策略的复杂性及其益处。

新古典的行为人令人厌烦，他们只会在固定的价格参数下算计最优的行动。

他们被限制于一种且仅一种行为，像自动化的机器那样对拍卖人作出响应。

没有企业的组织或联盟形成，没有作弊或撒谎，没有威胁——只有诚实地根据参数来行动。

这个举足轻重的假定被摩根斯坦（Morgenstern 1972）称为瓦尔拉斯—帕累托情结（Walras-Pareto fixation），并且已经受到博弈论专家尤其是马丁·舒贝克（Martin Shubik 1973, 1974）的强烈批评。

与使用“魔杖”的新古典方法不同，马丁·舒比克最近的工作是力图将这些模型封闭于一个关于交易的非合作博弈框架之中。

2. 不过就我们的目的而言更为重要的是，新古典模型的封闭方式剥夺了模型中所有的制度的多样性。

借此我想说的是，通过假设一个虚拟拍卖人的存在，该理论是在做出一种极端的制度假定：经济中惟一存在的制度是竞争性的市场，并且经济中所有的信息必须由这些市场上形成的价格来传递。

这显然是一种极端情况。

这一经济中没有货币、没有政府、没有法律体系、没有产权制度、没有银行——简而言之，没有社会创造出来的通过提供竞争性价格中没有的信息来帮助协调经济与社会活动的许多社会制度。

当我们意识到看似无害的虚拟拍卖人的存在对新古典模型结果的影响时，我们就能够回顾我们的步骤并考察使模型运作所必需的假定。

一旦这么做，我们就马上会发现这些应当是为使赋予模型的制度结构足以达到其目的——实现一种分散的竞争性均衡所必须的最低限度的假设。

对这些假定的放松将立刻导致新古典经济学的制度框架不足以达到其目的。

这个模型实际上是逆推的。

给定假定的制度安排——竞争性市场——模型考察存在分散经济均衡的经济环境的种类。

于是这些经济环境就成为这项理论研究的焦点。

## &lt;&lt;社会制度的经济理论&gt;&gt;

因此，如果我们以更少限制的方式来封闭这个模型，那么经济学就能够更为自由地研究更多类型的经济环境[参见赫维兹（Hurwicz 1973a）]—包含非凸性、非连续性和外部性的经济。

于是理论的任务将是去解释产生于一种特定环境中的制度安排的种类，或者是指导我们设计出在任何给定的环境中能达到“令人满意的”配置状态的制度[对这一点的进一步分析可以参见赫维兹（Hurwicz 1973a, b）]。

如果新古典理论只是存在于“实证的”经济学之中，那么上述被摆错了位置的制度的重点所造成的损害也许能够被有意义地加以控制。

然而，当这种理论成为规范经济学的基础时必须引起一些重视。

就我们所讨论的而言，福利经济学的两个基本定理，每个竞争性均衡都是帕累托最优的，以及只要通过适当的收入再分配，每个帕累托最优结果都能够由一个竞争性均衡来实现，会产生极其有趣的结果。

从根本上说，这两个定理是在宣称，就经济福利而言，福利最大化所必需的惟一制度正是新古典理论中假定的竞争性市场。

这两个定理成为新古典模型封闭方式的一种辩护，同时也证明了这种理论有限的制度特征的合理性。

这两个定理对于经济学家处理社会问题有着不良的影响。

当市场制度在比如说有着不确定性和外部性的经济中失灵时，新古典经济学家并不像他应该做的那样去试图解释怎样的一组制度将被创造以取代市场制度。

相反，他尝试重新界定和扩充经济的商品空间，以使得市场重新成为可行的制度。

例如，考虑一下当阿罗与哈恩（Arrow and Hahn 1971）在他们的模型遇到不确定性问题时所作的分析。

当现实世界中的社会团体面临这个问题时，他们设计了各种机制来帮助他们分散预期中的未来风险。

农业合作社、保险公司以及自助团体都是为了解决这一问题。

另外，经济理论方面则认为如果商品空间得到足够的扩展以便将商品定义成数量取决于未来自然状态的商品，那么这个问题就能解决。

有了这个假定，这回虚拟拍卖人再次被请来为一个扩展了的“相机经济”（contingent economy）叫价，并且市场制度再次被证明足以实现配置目标。

阿罗（Arrow 1970）在处理外部性问题时使用了同样的把戏。

这里，外部性被视作只要生成一个扩充的商品集便能得以纠正的市场失灵。

这次新创造出的商品是外部性本身，而为了有效地配置商品则需要诉诸于外部性的市场。

要指出的一点并非是，这种方法是荒谬的或甚至是错误的。

我要说的是，今天的经济理论可以被视为将理论封闭的极端方式合理化的一种努力。

放松理论的这些方面必将扩展理论的范围并使之更为切合实际。

.....

## &lt;&lt;社会制度的经济理论&gt;&gt;

## 媒体关注与评论

序言 思想一旦被孕育，常常要经历长时间的妊娠期，并且以极大的痛苦诞生出来。在它们成为专题论文或著作的过程中，人们必须意识到尽管貌似成熟，它们还只是婴儿。本书所呈现的关于社会制度的理论仍处于其婴儿期，还称不上完全成熟。

不过，我认为这一理论抓住了我们所考察的现象的本质，并且提供了一种论述它的规范的方法。

在评价本书余下的内容时，我们必须首先询问，当理论社会科学家试图弄通现实世界的某个方面时，他能做些什么。

在我看来，他第一步必须采取的是将所研究的现象从可能引起误导的现实世界的陷阱中剥离出来，展露它的本质。

我们常常会发现，所考察的奇特现象与我们觉得非常熟悉和自然的其一现象具有相同的形态。

正是在这些对结构相似性的识别中，现象的重要特征被得以发现，并且这个过程也是任何社会科学理论在着手处理更为复杂的问题之前必须进行尝试的，这恰恰是我在本书中试图做的工作。

我尝试着展露社会制度的本质以及它们所引发的演进问题的结构。

为此，我极大地依靠了包括标准型与扩展型的 $n$ 人非合作博弈以及现代的微观经济学理论。

博弈理论之所以被使用是因为，对于研究我们所感兴趣的现象而言，博弈论是可用的工具中最为自然的。

然而，它也只不过是一种工具，我希望对这一工具的使用不会让你偏离本书的根本目的。

一个人永远都难以知道何时该停止思索和阅读并且开始写作。

我现在决定写作本书并不是因为在这个话题上思维枯竭或者是对于何为社会制度有了完全的理解，而是因为我处于一个已经停止抽象、而具体的应用才刚刚开始思维阶段。

因此，我现在并不期待完成一项详尽无遗的工作，那将会永无尽头，而是决定在一个较为抽象与理论的层次上介绍我的思想，以使我自己和将来的研究者(如果有人感兴趣的话)能把这些想法应用到现实世界的特定情况中去。

然而这样做的弊端是，书中的相当内容显得较为抽象，并且有人可能会发现它们脱离现实。

但是我无法对此表示抱歉，因为这样的抽象是构建一项社会科学理论所必须的第一步，而本书正是这样的第一步。

我希望当读者读完本书时将会对何为社会制度以及它们怎样演化有更好的理解。

很简单，这些便是我惟一的目的。

在本书的写作过程中，许多朋友和同事的建议与鼓励使我受益匪浅。

然而，我还是欠我的妻子Anne Howland Schotter博士的最多，不论情愿与否，她都同我讨论我所有的想法并且不断指出我的逻辑错误以及一些彻底的谬论。

此外她还以编辑的眼光极大地改进了本书的风格。

缺了她，我恐怕没法完成此书的写作。

本书还反映出鼓舞我研究经济学的已故的老师Oskar Morgenstern对我的影响。

尽管患病，但Oskar仍然阅读了最初的讨论稿，本书正是由此发展而来的。

我的电话铃声常常带来他的建议与鼓励，我将永远铭记在心。

能有同事花时间阅读打印稿并对其中尚显粗糙的思想提出批评实在是太令人高兴了。

在这一点上，我必须感谢William Baumol、Geoffrey Brennan、Lewis Kornhauser、Bill Sharkey和Martin Shubik，他们都读完了全部的打印稿并促使我的思路与行文显得更为清晰。

此外，我还得感谢Albert Alexander、Juan Eugenio de la Rama和Bob McGovern，在本书的打印成稿过程中，他们每周都与我当面讨论。

他们使我很好地了解到学养深厚的研究生会对书中的内容作何反应。

.....

## <<社会制度的经济理论>>

### 编辑推荐

读者所看到的，是一本伟大的著作。

作者将制度看作足博弈的结果，而不是博弈的规则本身，这种观点在经济学理论中是具有独创性的，同时这也使得演进博弈理论能够成功地用于研究制度的变迁。

我们认为，更为重要的是，在肖特所提供的理论中，他将由演进而来的规范(制度)理解为一种“大家共享的知识传统”，用汪丁丁的话来说，这“使得人们在许多可能的均衡策略中一眼就看出哪些是‘明显’的玩法”，汪丁丁认为，认识到这一点的经济学家只有三个，他们是宾默尔(K. Binmore)、克雷普斯(D. Kreps)和本书的作者肖特。

肖特教授是在美国以及在世界上均知名度甚高的一位经济学家，其主要研究领域是实验经济学、微观经济学、博弈论，以及社会与经济制度的数理理论。

这部《社会制度的经济理论》是肖特的第一部学术专著。

它也是经济学说史上用博弈论方法系统研究人类社会的制度现象的第一部学术著作。



<<社会制度的经济理论>>

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:<http://www.tushu007.com>