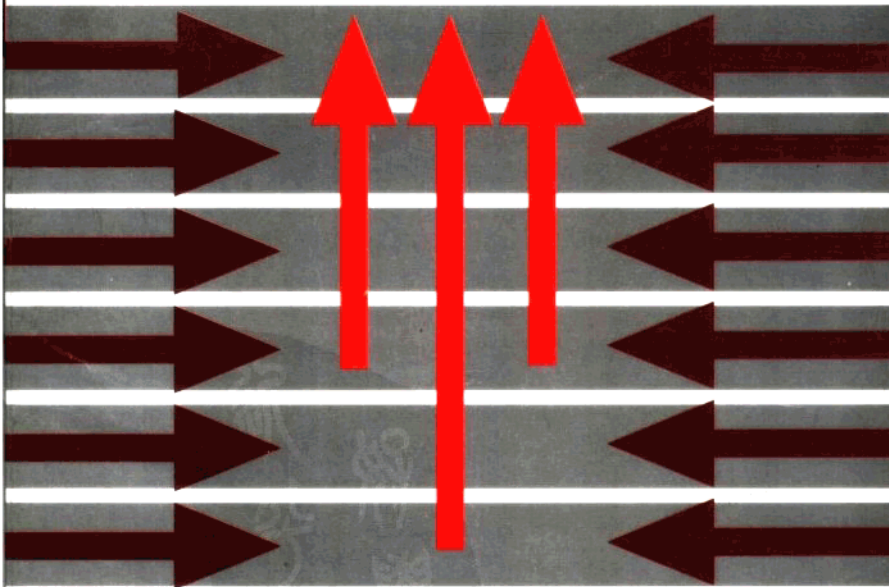


管理激励与约束

侯光明 著

Incentive and Constriction in Management



北京理工大学出版社

管理激励与约束

侯光明 著

北京理工大学出版社

内 容 提 要

现代管理的根本任务在于最大限度地调动人的积极性使之创造性地努力工作。因而,管理激励与约束问题是现代管理的核心问题之一。

本书针对管理活动中的激励与约束问题,从管理学的角度出发,在对管理激励与约束的基本概念、原理和管理激励与约束机制设计问题进行系统研究的基础上,建立了管理激励与约束理论的基本框架,提出了管理激励与约束机制设计的合作博弈决策方法和隐蔽违规行为的约束机制设计方法,并结合管理应用实践介绍了解决道德危害和逆向选择问题的激励与约束机制设计方法。

本书可供高级管理人员、政策研究人员以及有关研究人员阅读,还可作为管理科学与工程等专业研究生、本科生的参考教材,以及高级管理人员的培训教材。

图书在版编目(CIP)数据

管理激励与约束/侯光明著. —北京:北京理工大学出版社, 1999. 7

ISBN 7-81045-610-5

I. 管… II. 侯… III. ①激励②约束 IV. C936

中国版本图书馆 CIP 数据核字(1999)第 27893 号

责任印制:田长新 责任校对:陈玉梅

北京理工大学出版社出版发行

(北京市海淀区白石桥路 7 号)

邮政编码 100081 电话(010)68912824

各地新华书店经售

北京房山先锋印刷厂印刷

*

850 毫米×1168 毫米 32 开本 9.125 印张 172 千字

1999 年 7 月第 1 版 1999 年 7 月第 1 次印刷

印数:1—5000 册 定价:16.00 元

※图书印装有误,可随时与我社退换※

序



对人的行为的激励与约束在社会生活中普遍存在，是管理活动的基本内容之一。然而，长期以来在管理学领域内缺乏对此问题的系统、深入研究。现代社会组织、特别是企业面临的环境发展迅速、复杂多变。在激烈、残酷的市场竞争中，人是企业最宝贵的资源。为实现企业目标而充分调动起来的企业员工的积极性与创造精神，是企业竞争力永不枯竭的源泉。因此，在现代管理中激励与约束就更显重要。侯光明同志的专著《管理激励与约束》反映了他对管理活动中激励与约束问题进行系统、深入研究的新成果。作者从管理学的角度出发，提出了激励与约束的定义，比较全面地分析了管理活动中激励与约束的内容、意义，提出了有关基本概念。特别是把约束作为与激励相对应的管理学范畴，分析了激励与约束的辩证关系。作者在其他学科，特别是经济学有关激励研究成果的基础上，在理论与实践相结合上对管理激励与约束的机制设计问题进行了新的探索，特别在隐蔽违规行为的约束机制设计、管理激励与约束多因素、多阶段合作博弈等问题上得出了有特色的初步成果。侯光明同志上述具有创新意义的工作，初步形成了管理激励与约束理论的基本框架。希望本书的出版将进一步推动这一领域的研究和应用。

甘仞初

1999年6月

目 录

第一章 绪论	(1)
1.1 问题的提出	(1)
1.2 国内外研究概况和本书的意义	(2)
1.3 本书的特色、结构和内容	(6)
第二章 基本概念	(9)
2.1 引言	(9)
2.2 管理激励与约束的定义	(10)
2.2.1 激励与约束的管理学定义	(10)
2.2.2 管理激励与约束的辩证关系	(18)
2.3 管理激励与约束的基本内容	(23)
2.3.1 管理激励的基本内容	(23)
2.3.2 管理约束的基本内容	(29)
2.3.3 管理激励与约束的有机配合	(34)
2.4 管理激励与约束的基本形式	(43)
2.4.1 激励的基本形式	(43)
2.4.2 约束的基本形式	(49)
2.5 管理激励与约束因素	(54)
2.5.1 基本激励因素	(55)
2.5.2 基本约束因素	(58)
2.5.3 管理激励与约束的内容、形式及 因素之间的关系	(60)
2.6 管理激励与约束的地位、作用及意义	(63)

2.6.1	管理激励与约束在现代管理中的地位	(63)
2.6.2	管理激励与约束的作用	(68)
2.6.3	管理激励与约束的重要性和必要性	(73)
2.7	结论	(76)
第三章	管理激励与约束机制	(79)
3.1	引言	(79)
3.2	管理激励与约束机制的构成	(79)
3.2.1	管理学的激励与约束机制	(79)
3.2.2	形成管理激励与约束机制的三个基本要素	(82)
3.2.3	激励与约束机制运行中使用的管理资源	(84)
3.2.4	管理激励与约束机制体系	(85)
3.3	管理激励与约束机制的建设和完善	(88)
3.3.1	建设和完善管理激励与约束机制的步骤	(89)
3.3.2	管理激励与约束机制建设的原则	(100)
3.3.3	建设和完善激励与约束机制应注意处理好的若干关系	(108)
3.4	管理激励与约束机制的设计	(109)
3.5	结论	(111)
第四章	决策论与博弈论基础	(113)
4.1	引言	(113)
4.2	决策论基础	(113)
4.2.1	概述	(113)
4.2.2	基本概念	(113)

4.2.3	期望效用最大化原理	(116)
4.3	博弈论基础	(121)
4.3.1	概述	(121)
4.3.2	扩展形式的博弈	(122)
4.3.3	策略形式博弈	(130)
4.3.4	博弈论解的概念	(131)
4.4	合作博弈	(136)
4.4.1	双人合作博弈	(136)
4.4.2	多人合作博弈	(139)
4.5	激励与约束机制设计理论综述	(142)
4.5.1	实现理论	(142)
4.5.2	委托—代理理论	(145)
4.5.3	两种理论的比较	(147)
4.6	结论	(149)
第五章	道德危害问题的激励与约束机制设计	(151)
5.1	引言	(151)
5.2	道德危害和激励与约束机制	(152)
5.2.1	道德危害和激励与约束机制设计	(152)
5.2.2	风险与保险	(156)
5.3	信息不对称条件下激励与约束机制的设计	(161)
5.3.1	委托—代理模型	(161)
5.3.2	最优补偿强度 β 的设计	(163)
5.4	激励与约束机制设计中的信息原则及应用	(165)
5.4.1	委托—代理关系的数学模型	(166)
5.4.2	方差最小化信息原则	(166)

5.4.3	应用举例·····	(170)
5.5	多目标问题激励与约束机制的设计·····	(176)
5.5.1	设计思路与步骤·····	(176)
5.5.2	化 n 个观测指标为综合激励与约束指标 的方法·····	(179)
5.5.3	综合应用举例·····	(182)
5.6	管理激励与约束的多因素、多阶段合作博弈 决策模型·····	(184)
5.6.1	管理激励与约束合作博弈模型·····	(185)
5.6.2	单阶段管理激励与约束合作博弈·····	(188)
5.6.3	多阶段管理激励与约束合作博弈·····	(191)
5.7	结论·····	(197)
第六章	隐蔽违规行为的约束机制设计 ·····	(199)
6.1	引言·····	(199)
6.2	隐蔽违规行为的约束机制设计·····	(200)
6.2.1	隐蔽违规行为·····	(200)
6.2.2	有效约束·····	(202)
6.2.3	隐蔽违规行为的约束机制设计·····	(204)
6.2.4	小结·····	(208)
6.3	隐蔽违规行为的隐性约束机制设计·····	(209)
6.3.1	数学模型·····	(210)
6.3.2	隐性约束机制研究·····	(212)
6.3.3	小结·····	(218)
6.4	结果可观测隐蔽违规行为的另一种约束机 制设计方法及多维激励与约束问题的机制 设计·····	(220)
6.4.1	结果可观测隐蔽违规行为·····	(220)

6.4.2 委托—代理模型下结果可观测隐蔽违规行为 的约束机制设计	(221)
6.4.3 委托—代理模型下多维激励与约束机制 的设计	(224)
6.5 结论	(231)
第七章 逆向选择问题的激励与约束机制设计	(233)
7.1 引言	(233)
7.2 逆向选择问题及其解决办法	(234)
7.2.1 逆向选择的概念	(234)
7.2.2 逆向选择问题的解决办法	(239)
7.3 逆向选择问题的激励与约束机制设计实例 分析	(242)
7.3.1 创造信息传递环境的实例分析	(242)
7.3.2 建立信息甄别机制的实例分析	(244)
7.4 信息激励与约束机制设计	(249)
7.4.1 概述	(249)
7.4.2 信息激励与约束的 Groves - Clarke 机制	(251)
7.4.3 信息获取存在成本情形的 Groves - Clarke 机制	(253)
7.4.4 小结	(263)
7.5 结论	(263)
后记	(265)
主要参考文献	(267)

第一章 绪论

1.1 问题的提出

中国改革开放的总设计师邓小平同志早在 1985 年 3 月就曾深刻指出：“有理想，还要有纪律才能实现。纪律和自由是对立统一的关系，两者是不可分的，缺一不可。我们这么大一个国家，怎样才能团结起来，组织起来呢？一靠理想，二靠纪律。组织起来就有力量。没有理想，没有纪律，就会像旧中国那样一盘散沙，那我们的革命怎么能够成功？我们的建设怎么能够成功。”江泽民同志在党的十五大工作报告中也明确指出：“要加强科学管理、探索符合市场经济规律和我国国情的企业领导体制和组织管理制度，建立决策执行和监督体系，形成有效的激励和制约机制。”现代管理的根本问题是调动人的积极性的问题，尽管现代管理有诸多职能和的实现各职能的方法，但归根结底，管理的目的在于最大限度地调动人的积极性，使之在管理目标方向上创造性地高效地努力工作，而这一目的必须靠实施有效的激励与约束才能得以实现。管理实践中实施的激励与约束与经济学、心理学研究激励与约束的内容、重点有所不同，管理者与被管理者既有合作，又有冲突，管理中不但要激发人们的工作动力，而且要规范人和组织的行为。现实中，管

理激励与约束尚没有较为系统的理论，实践中存在不少问题，使得不少执行者感到为难，接受者不以为然。激励与约束的扭曲、不当和受到轻视，制约了工作效率的提高，影响了人们的心理健康和整体素质的提高，给管理系统带来了不必要的麻烦和震荡，甚至影响到管理系统乃至社会大系统的正常运转。实践的挫折和理论的缺憾呼唤系统的、科学的管理激励与约束理论与方法。

1.2 国内外研究概况和本书的意义

激励问题是当代经济学研究的核心问题之一，有效的报酬结构能产生强大的激励效应，它也是现代公司的特征之一。近年来西方经济学家对激励机制有了较深入的研究，1996年度诺贝尔经济学奖授予英国剑桥大学詹姆斯·莫里斯教授（James A·Mirrlees）和美国哥伦比亚大学威廉·维克多教授（William Vickrey）。瑞典皇家科学家认为，他们对非对称信息条件下激励性经济理论做出了基础性贡献。

现有的激励理论主要有心理学的激励原理和经济学的激励机制设计理论。其中激励原理是建立在对人的行为规律的认识基础之上的，可分为马斯洛等的需要层次理论、波特和劳勒的激励模式理论、亚当斯公平理论以及强化理论等等。激励机制设计理论可以追溯到美国经济学家里奥·赫维兹（Leonturwicz），他首先提出了激励相容（incentive compatibility）的概念，并且证明了关于

信息分散化机制下的一些重要的结果，为以后的研究奠定了良好的基础。赫维兹及其追随者的研究大都是以经济制度为背景的，主要关心和论证特定的社会目标在某个机制下能否实现的问题，所以这个方向的研究也称实现理论 (implementation theory)。这个理论注重机制的数学描述和机制特点的数学论证，它对于具体的机制以及具体的激励问题尚没有作太多的关注。推进激励机制设计理论发展的另一条主线是研究具体经济关系中的激励问题的委托—代理理论 (agency theory)，这方面的研究主要是以研究各种条件下的委托人—代理人模型为出发点的，研究如何设计行动程序、报酬方案才能达到委托人的目标。这方面较早作出贡献的有 Vickrey (1961)，Spence (1971)，Rose (1977)，Mirrlees (1976, 1977)，Shancell (1979)，Holmstrom (1979)，Grossman 和 Hart (1983) 等。

近年来，国内关于激励原理及激励机制设计理论先后出现一些介绍性和应用性的文章，开始出现广泛的、多学科的研究。但总的看来，有关这方面的研究尚处在起步阶段。

如同任何理论的创立都仅只是发展了科学而不是终止了科学的发展一样，激励理论迄今还存在着严重不足：

(1) 缺乏对约束问题的系统深入研究

虽然心理学与经济学在激励理论研究方面已取得显著的成就，但对管理中的激励与约束问题特别是约束问题尚缺乏系统的深入的研究。因为经济学的激励问题仅

考虑委托人和代理人相对于工作努力的经济补偿问题，而这一经济补偿指标则既是激励因素也是约束因素（用让代理人多得补偿和少得补偿来激励与约束代理人），故而也可称之为激励与约束问题，而管理约束的核心是要将管理系统内人员的行为形成合力并指向管理目标，这里必不可缺的约束就不可简单地用一个经济补偿指标和激励等同起来，管理约束是多因素、多手段、多作用的，针对不同的管理系统和管理对象，分别起协调、规范、保护、推动等作用，约束的存在会给管理组织带来凝聚力、安全保障和工作效率，也给被管理者带来保护和素质的提高，使个人需求最终得到合理满足。

管理是为实现既定目标而组织人群的各项活动的总和，管理活动的本质是最大范围地发挥人的力量，尤其是发挥人的积极性、主动性、创造性。而人的这种发挥积极性、主动性、创造性的自觉行为的产生、强化需要来自管理者的激励，同时为了保证人的自觉行为能集中趋向管理目标，管理者还需要对其可能造成自己或管理团队甚至社会的损失的某些行为进行约束。激励与约束相伴而生，结伴而行，相辅相成，不可替代。激励不能代替约束，没有约束也不可能实现真正的激励。管理实践中，激励与约束本应象车之两轮，鸟之两翼密不可分。其中，约束在纠正、鞭策、警戒、规范人的行为，使人们行为向管理者（约束信息发出者）的指定目标趋近的过程中起着十分重要的作用。

由于约束理论的不完善，我国企业管理中出现了许

多问题。如：改革中承包单位违约、失控现象大量存在；经营中“吃回扣”等经济违纪屡禁不止；管理中约束的法规不明，程序不清，造成部分管理场混乱；分配制度上只奖勤不罚懒，以激励代替约束的现象普遍存在，使各种奖金恶性膨胀，达不到预期的激励效果，……如此等等大到社会，小到企业饱食约束不到位的苦果。

应该说上述问题不是突如其来、一朝一夕产生的，而是随着改革的深入，竞争的激烈而日趋暴露、日趋严重的，这恰恰说明竞争越激烈就越需要科学的激励和有效的约束。同激励一样，约束本身有其特定的方法、手段、强度、限度等内在规律，应以理论体系的形式存在并发挥管理指导作用。特别是“十五大”召开后的第三次全国范围的思想解放高潮，以及现代企业制度改革的实践需要都向我们提出了建立约束理论的紧迫要求。

(2) 理论体系不完善，尤其缺乏管理学激励与约束理论的研究

现有激励理论和机制设计理论主要是心理学和信息经济学的研究成果。但心理学的研究成果运用到管理实践还有相当大的距离，而信息经济学的出发点是假定人是理性的，（理性人是指有一个很好定义的偏好，在面临给定的约束条件下最大化自己的偏好）正是理性人的假设使得经济学家得以运用数学工具描述人的行为。但企业管理中的人只是有限理性的人，现实的管理实践又是相当复杂的、多变的。理想与现实，理论与实践的矛盾使得如何将信息经济学的激励设计理论应用到具体管理

中去还是一个相当大的课题。这一课题理应由管理学去完成。因为管理学的核心问题是管理人的问题,激励与约束自然是管理学应主要研究的问题。同时只有从管理学角度将各学科激励理论研究研究成果加以分析概括,开创新的激励与约束体系,探索体系的内在规律性,抽象出实施管理激励与约束的机制才能对我国现阶段企业改革与实践有更广泛的指导意义。本书理论联系实际地对管理激励与约束的概念、原理及机制设计方法等进行研究,试图把管理激励与约束互补起来,把激励与约束原理和激励与约束机制设计联系起来,用理论解释和指导实际,用实践推进理论研究,在若干方面提出自己的研究结论。对管理激励与约束的深入研究、实际应用不仅具有重要的理论意义,也具有重要的实践意义。

1.3 本书的特色、结构和内容

1.3.1 本书的特色

总体看来,本书有以下研究特色:

(1) 理论上的系统化

本书旨在管理激励与约束理论的某些方面作重点探索研究和补充的基础上,初步建立起系统化的管理激励与约束理论框架,所以本书在突出重点的同时,力求系统化。虽然主要偏重于管理激励与约束的基本概念、管理激励与约束机制和隐蔽违规行为约束机制设计的研究,但本书对管理激励与约束的原理作了综合归纳,对

实现理论和委托—代理理论的基本概念和基本内容作了介绍，特别对委托—代理理论的机制设计和逆向选择的机制设计分别专门拿出近一章的篇幅来说明其设计原理和应用。这样做是为了将信息经济学的一些研究成果应用于管理激励与约束，也是为了使整个管理激励与约束理论统一起来，同时使得在深入讨论管理激励与约束问题之前，对问题的背景都有较系统的介绍，从而使问题的实质得以清晰地呈现出来。

(2) 一般阐述与严格分析相结合，理论研究与实际应用举例相结合

管理激励与约束理论建立在严格的理论分析的基础上，有丰富的实际背景也需要规范的数学描述。为了准确清楚地表达这一复杂概念和理论，本书注重联系实际的应用研究和严格理论分析相结合。

1.3.2 本书的结构和内容

第一章介绍了国内外研究概况和本书的意义、特色和创新之处等。作为全书的引论，便于读者通过本章的阅读了解全文的背景、目的、结构、创新、特色等主要内容。

第二章：给出了管理激励与约束的基本概念，综合地介绍了管理激励与约束的基本原理，继而论述了管理激励与约束的重要性、必要性及作用。

第三章：阐述了管理激励与约束机制的基本概念，进而举例说明了建立和完善管理激励与约束机制的步骤、

原则和应处理好的几个关系。

第四章：介绍与后续章节研究内容密切相关的决策论、博弈论的基本概念和基本原理后，讨论激励与约束机制设计的实现理论与委托—代理理论，为后两章提供理论基础和问题背景。

第五章：以讨论雇工关系的委托—代理模型实例为背景，详细分析在信息不对称条件下，针对道德危害问题的激励与约束机制设计的原则，举出多目标激励与约束机制设计的应用实例，进而根据委托—代理理论的局限，提出了管理激励与约束的多因素、多阶段合作博弈决策模型。

第六章：对隐蔽违规行为的约束机制设计问题进行详细分析研究，得出显性约束机制的设计方法、隐性约束机制的设计方法和有关结论。还研究了可通过业绩指标观测的隐蔽违规行为的约束问题。

第七章：介绍了逆向选择问题及其激励与约束机制的设计方法。