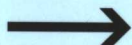
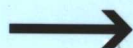
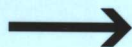


当代经济学系列丛书

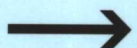
Contemporary Economics Series

主编 陈昕



一般均衡的 策略基础

动态匹配与讨价还价博弈



当代经济学译库

[美] 道格拉斯·盖尔 著

韦 森 总译校



上海三联书店
上海人民出版社

当代经济学系列丛书

Contemporary Economics Series

主编 陈昕

上海三联书店
上海人民出版社

· 经济理论的丘吉尔讲座 ·

一般均衡的 策略基础

动态匹配与讨价还价博弈

[美] 道格拉斯·盖尔 著
韦 森 总译校

当代
经济
译库

图书在版编目(CIP)数据

一般均衡的策略基础:动态匹配与讨价还价博弈/

(美)盖尔(Gale, D.)著;韦森译.

—上海:上海人民出版社,2004

(当代经济学系列丛书.当代经济学译库/陈昕主编)

书名原文:Strategic Foundations of General Equilibrium

Dynamic Matching and Bargaining Games

ISBN 7-208-05111-9

I. 一... II. ①盖... ②韦... III. ①一般均衡论

②对策论—应用—经济 IV. F019.1

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2004)第 021407 号

责任编辑 李 娜

装帧设计 敬人设计工作室

吕敬人

一般均衡的策略基础

——动态匹配与讨价还价博弈

[美]道格拉斯·盖尔 著

韦 森 总译校

生活·读书·新知

三联书店上海分店

上海绍兴路5号

世纪出版集团

上海人民出版社

200001 www.ewen.cc

上海福建中路193号

世纪出版集团发行中心发行

上海三联读者服务公司排版

商务印书馆上海印刷股份有限公司印刷

2004年4月第1版

2004年4月第1次印刷

开本:850×1168 1/32

印张:8.75 插页:5 字数:182,000

印数:1—5,100

ISBN 7-208-05111-9/F·1141

定价:18.00元

参加本书翻译的有：

季	虹	徐思嘉	徐	嫫
黄	梅	赵红	程	锋
许	键	刘康兵	李	达

本书献给我的老师 Frank H. Hahn



内容简介

自亚当·斯密(Adam Smith)以来,竞争理论在经济分析中一直居于中心地位。由当代最杰出的理论经济学家之一道格拉斯·盖尔(Douglas Gale)所撰写的这部著作,介绍了为完全竞争理论提供策略基础的一项重大研究成果。

盖尔首先对竞争理论的演化作了简要的回顾,随后,通过对动态匹配与讨价还价博弈模型广泛而严密的运用,他更为全面地解释了如何达致竞争均衡。在经济学家们已经采用的对市场所作的宏观视角的描述中,一定的行为特征——如价格接受行为等——被视作理所当然的,盖尔却使用博弈理论重新评价了这一假设,即从个体行为出发,模型化他们的策略互动。竞争均衡的策略基础揭示了这样的互动是如何导致竞争性的价格接受行为的。

道格拉斯·盖尔(Douglas Gale)为美国纽约大学经济学教授,并曾于2000—2002年间任美国纽约大学经济系主任。作为计量经济学会的研究员,他至今仍担任《经济研究评论》(*Review of Economic Studies*)的助理编辑和《计量经济学》(*Econometrica*)的合作编辑。他目前也是《经济理论杂志》(*Journal of Economic Theory*)、《经济学研究》(*Research in Economics*)和《经济理论》(*Economic Theory*)的副主编,并且也是《宏观经济动态》(*Macroeconomic Dynamics*)的顾问编辑,其研究论文见诸于国际权威杂志上。



为了全面地、系统地反映当代经济学的全貌及其进程,总结与挖掘当代经济学已有的和潜在的成果,展示当代经济学新的发展方向,我们决定出版“当代经济学系列丛书”。

“当代经济学系列丛书”是大型的、高层次的、综合性的经济学术理论丛书。它包括四个子系列:(1)当代经济学文库;(2)当代经济学译库;(3)当代经济学教学参考书系;(4)当代经济学新知文丛。该丛书在学科领域方面,不仅着眼于各传统经济学科的新成果,更注重经济前沿学科、边缘学科和综合学科的新成就;在选题的采择上,广泛联系海内外学者,努力开掘学术功力深厚、思想新颖独到、作品水平拔尖的“高、新、尖”著作。“文库”力求达到中国经济学界当前的最高水平;“译库”翻译当代经济学的名人名著;

“教学参考书系”主要出版国外著名高等院校的通用教材；“新知文丛”则运用通俗易懂的语言，介绍国际上当代经济学的最新发展。

本丛书致力于推动中国经济学的现代化和国际标准化，力图在一个不太长的时期内，从研究范围、研究内容、研究方法、分析技术等方面逐步完成中国经济学从传统向现代的转轨。我们渴望经济学家们支持我们的追求，向这套丛书提供高质量的标准经济学著作，进而为提高中国经济学的水平，使之立足于世界经济之林而共同努力。

我们和经济学家一起瞻望着中国经济学的未来。

上海三联书店
上海人民出版社



中译本译序

这些年来我在各种场合经常讲中国经济现象是经济学研究的一个大金矿，研究中国的经济问题有可能产生一批世界级的经济学大师。我的信念源自经济理论的作用在于解释经济现象，其作用的大小由所解释经济现象的重要性决定。在现代社会中，各国经济紧密相连，发生在世界经济中心的经济现象所产生的影响远大于发生在周边小国的经济现象，所以，自亚当·斯密出版《国富论》，经济学成为一门独立的社会科学以来，世界级的经济学大师大多先后产生于作为世界经济中心的英国和美国。而我预测中国的经济规模很有可能在本世纪30年代超过美国，中国将有可能逐渐成为一个新的领导经济学思潮的国际中心。如果我的乐观预测是正确的，那么中国经济学界的第一个诺贝尔经济学奖获得者，

最有可能来自于从事制度经济学研究的经济学家。

从工业革命开始至西方殖民强权兴起，许多亚洲和非洲国家纷纷继拉丁美洲国家之后沦为被殖民地。20 世纪初民族自决运动风起云涌，到了第二次世界大战之后，亚、非、拉被殖民国家终于迎来了民族解放，开始了独立建国后的追赶发达国家的努力。但是，除了东亚的日本和几条“小龙”外，世界上绝大多数发展中国家和地区不但没有赶上发达国家或缩小与发达国家的差距，而且，这个差距还在不断扩大。到 2001 年底世界人口总数为 61.3 亿，中低收入国家和地区的人口就占了 81.5%。发展中国家和地区怎样缩小与发达国家的差距、甚至赶上发达国家仍然是当今世界最大的经济问题之一。

根据索洛 (Robert Solow) 在 20 世纪 50 年代提出的新古典增长理论，发达国家和发展中国家可以采用同样的技术来生产，由于发达国家资本较多，资本的边际报酬较低，因而发展中国家会有比发达国家更高的资本积累，取得更快的经济增长，两者的人均收入差距应该逐渐缩小；然而，许多发展中国家经过 30—40 年的努力，并未取得预料中的快速增长。由于新古典增长理论不能解释发达国家和大多数发展中国家之间收入差距持续扩大

的现象,罗默(Paul Romer)和卢卡斯(Robert Lucas)在20世纪80年代提出了内生增长理论,认为一个国家的技术创新速度是由人力资本积累、研究和开发、“干中学”等因素内生决定的;发达国家在这些方面的投资多于发展中国家,因此,技术变迁较快避免了资本的边际报酬递减,使得发达国家经济保持持续增长,并且拉大了和发展中国家的收入差距。然而这个理论也有缺陷,韩国、中国台湾、中国香港、新加坡以及后来加入的中国等亚洲新兴工业化经济体,在20世纪最后30年间实现了超乎寻常的经济增长,赶上了发达国家或大大缩小了与发达国家的差距,但是它们在追赶时期并未在内生增长理论所强调的因素上比发达国家有更多的投资。到了20世纪90年代末,以哈佛大学的罗德里克(Dani Rodrik)、施莱弗(Andrei Shleifer)和阿斯莫格鲁(Daron Acemoglu)等为首的一批经济学家,开始把眼光从资本积累和技术创新转移到制度问题上来,试图从市场效率、政府干预、腐败程度等制度因素出发来解释发展中国家发展绩效的差异。^①

① 有关这方面的文献回顾请参见林毅夫和刘明兴为2003年5月21—22日在印度举行的第15届世界银行年度发展经济学会议所准备的论文《发展战略、自生能力和落后地区的发展挑战》。英文稿可从北大中国经济研究中心讨论稿网页下载。

制度对经济发展的重要性从我国改革前后的经验中可以得到印证。主流经济学家们对于市场和政府这两个最重要的制度应该如何发挥各自的作用的认识并没有多大分歧。世界银行和国际货币基金组织等国际发展机构中的经济学家们,根据主流经济学的认识提出了“华盛顿共识”,并从 20 世纪 80 年代初起,以此共识来推动绝大多数发展中国家的经济改革。可是根据世界银行的一位经济学家伊斯特利(William Easterly)的研究,1960—1979 年间发展中国家人均国民生产总值的年均增长率为 2.5%,进行了改革后的 1980—1998 年间年均增长率反而下降为 0.0%。^①因此,伊斯特利将 20 世纪的八九十年代称为“迷失的年代”。

“迷失的年代”的出现反映了经济学家们虽然已经认识到了制度的重要性,但是对制度是怎么形成的,以及怎么作用于经济的了解却还远远不足。西方主流经济学是以有效的市场制度为前提建立起来的,直到 20 世纪 60 年代以科斯(Ronald Coase)、诺思(Douglas North)、阿尔钦(Armen Alchain)、德姆

① William Easterly, “The Lost Decades: Developing Countries’ Stagnation in Spite of Policy Reform 1980 - 1998”, paper prepared for the Global Development Network meeting in Cairo, February 2001.

塞茨 (Harold Demsetz)、威廉姆森 (Oliver Williamson) 和张五常等为代表的“新制度经济学派”出现以后, 主流经济学家们才越来越多地将制度作为一个内生变量来研究。然而, 发达国家本身的制度已经相对成熟、稳定, 少有值得研究的大的制度变迁, 而且取材于长远的历史, 还会面临各种时代背景难于理解、资料难以收集的困难。而从发达国家和发展中国家的制度差异来研究, 对于生活、工作在发达国家的经济学家来说, 则又受到文化、历史知识的局限, 不易把握问题的实质。所以, 制度的研究, 尤其是一个发展中国家的制度结构如何向一个现代化的市场经济制度体系演进的研究, 是一个有待突破的重要领域。

我国从 1949 年建国以来, 经历了从落后的市场经济向计划经济转变、又从计划经济向完善的市场经济转轨的过程, 等于将发达国家需要几百年时间完成的制度变迁压缩在半个世纪里完成, 而且当中还增加了一个非市场经济制度的实验。这些大的制度变革脉络清晰, 影响显著, 资料易得, 不仅可以用来检验现有制度经济学的前沿理论假说, 而且可以从中提炼出许多新的理论来解释制度的形成及其发挥作用的机制。中国的经济学家在了解中国的社会经济现象上有近水楼台先

得月的优势,因此研究这半个世纪以来中国社会经济变革的成败经验,既是关心中国未来命运的当代中国经济学家的使命,也是中国经济学家最有可能对当代经济学做出巨大贡献的领域。

1995年我曾写过一篇《本土化、规范化、国际化》的文章祝贺《经济研究》创刊40周年,强调本土问题的研究,必须置于国际学术界对同一问题的研究已经取得的成果的基础之上,才能了解自己的研究对知识增量的贡献在何处,同时也必须按国际学术界前沿的分析方法来表述,才能取得国际学术界公认的成果,对国际学术思潮的发展产生影响。这些原则在制度问题的研究上同样适用。

自20世纪60年代以来,当代西方经济学界的制度研究,除了以交易费用为分析工具的新制度经济学派外,还出现了阿罗(Kenneth Arrow)、哈恩(Frank Hahn)、斯蒂格利茨(Joseph Stiglitz)和阿克洛夫(George Akerlof)等一批当代新古典主流经济学家,他们或使用一般均衡的分析方法,引进交易费用,或从信息的不对称、克服道德风险的角度来研究制度的作用和选择。这一派学者多是一些建立数理模型的高手,文章大多发表在世界顶尖的经济学期刊之上。第三个流派则是以博弈论,尤其是20世纪90年代中后

期发展起来的演化博弈论为工具进行制度分析,主要代表人物有宾默尔(Ken Binmore)、佩顿·杨(H. Peyton Young)、萨金(Robert Sugden)和格雷夫(Avner Greif)等。每一个特定的制度安排都是社会中人们共同接受的制约彼此互动行为的一套规范,它的变革又都是在一定的制度结构、发展阶段当中发生的,所以这一流派凭其分析工具之利,最有可能在制度研究上开拓出一片宽广的天地。

1987年我从美国回国之前为了了解经济改革的实质意义,曾经花了一段时间阅读新制度经济学派和阿罗、斯蒂格利茨等新古典主流经济学家有关制度的论著,后来根据我的读书心得以及对政府在制度变革中作用的分析,写了一篇“An Economic Theory of Institutional Change: Induced Change and Imposed Change”发表于 *Cato Journal*。中文译稿几经周折以《论制度和制度变迁》为名在国内发表。其后,制度分析成为国内经济学界的一个热门课题,国外的著作纷纷被译成中文,科斯、诺思成为国内经济学界耳熟能详的名字。不过到目前为止,引进到国内来的主要是新制度经济学派的论著,对于新古典主流和博弈论这两个流派的制度分析文献,国内学术界仍然知之甚少。但是我国国内有丰富的制度分析的素材,国内年轻的本科生

和研究生在数理工具的学习上也有先天的优势,因而掌握这两个流派的研究成果,并以这两个流派的分析工具来从事国内丰富的制度变迁经验的研究,将会是我国经济学人进军国际经济学术殿堂的一条大道。

复旦大学经济学院的韦森(李维森)教授最近倡议翻译出版一些有关当代制度分析前沿的专著,通过引进近几年西方几家著名出版社出版的博弈论和新古典主流制度分析的经典名著,以推动我国经济学界在制度经济学的研究和分析上再上一个台阶,并邀我为这套丛书写一个总序,我欣然答应。韦森君在国外攻读博士学位期间即已潜心研究当代制度分析的前沿各家论述,后来到英国剑桥大学访问期间更广泛收集了各种主要学术期刊上的制度分析经典文献。现在,这套十几部的丛书经他的策划,即将陆续由上海人民出版社和上海财经大学出版社出版,这是韦森君为我国经济学界所做的一个新贡献,也是我国经济学界的一件盛事。

译书要做到信、达、雅是一件辛苦而又充满挑战的工作,而韦森君在教学、研究之余,笔耕不辍,不但随笔文字隽永,发人深省,译著更是信、达、雅兼备,有上世纪初的译者之风。作为一位关心中国经济学科成长的学者,我感谢韦森君及这套丛书的诸位译者、校