

standing 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



PAPERS IN
EXPERIMENTAL ECONOMICS

by
V. L. SMITH

实验经济学 论文集 (上册)

[美] 弗农·史密斯 著
李建标 等译

F069.9/23

:1

2008

PAPI
EXPERIMENTAL ECONOMICS

实验经济学论文集

(上册)

[美] 弗农·史密斯 著

李建标 等译

首都经济贸易大学出版社

· 北 京 ·

图书在版编目(CIP)数据

实验经济学论文集/(美)史密斯(Smith, V. L.)著;李建标等译. —北京:
首都经济贸易大学出版社, 2008. 3

(诺贝尔经济学奖获得者学术精品自选集)

书名原文: Papers in Experimental Economics

ISBN 978 - 7 - 5638 - 1427 - 5

I. 实… II. ①史… ②李… III. 经济学 - 文集 IV. F069.9 - 53

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2006)第 036131 号

Papers in Experimental Economics

© Cambridge University Press

根据 Cambridge University Press 1991 年版翻译

实验经济学论文集

[美] 弗农·史密斯 著 李建标等 译

出版发行 首都经济贸易大学出版社
地 址 北京市朝阳区红庙(邮编 100026)
电 话 (010)65976483 65065761 65071505(传真)
网 址 <http://www.sjmcb.com>
E-mail publish@cueb.edu.cn
经 销 全国新华书店
照 排 首都经济贸易大学出版社激光照排服务部
印 刷 北京永生印刷有限责任公司
开 本 850 毫米×1168 毫米 1/32
字 数 944 千字
印 张 36.875
版 次 2008 年 3 月第 1 版第 1 次印刷
书 号 ISBN 978 - 7 - 5638 - 1427 - 5/F · 837
定 价 75.00 元

著作权合同登记号 图字:01 - 2005 - 0734 号

图书印装若有质量问题,本社负责调换 版权所有 侵权必究

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,诺贝尔经济学奖已备受世人关注,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就,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,为使收入到本丛书中的作品更具权威性,我们采用了由获奖者自

已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象的。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认可,如果是那样,我们将深感欣慰。

出版者

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(Sam-

uelson)、希克斯(Hicks)、阿罗(Arrow)、库普曼斯、康托罗维奇(Kantorovich)、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。

本奖项还反映出第二次世界大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(Vickrey)]、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(Schultz)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

译者序

2002年,瑞典皇家科学院将该年度的诺贝尔经济学纪念奖授予了 Daniel Kahneman 和 Vernon L. Smith 教授,前者是因为“把心理学研究和经济学研究结合在一起,特别是与在不确定状况下的决策制定有关的研究”而得奖,对于后者则是表彰其“在实验经济学领域,尤其是在可替代性市场机制实验研究”中所作出的开创性贡献。2002年的诺贝尔经济学奖标志着实验经济学已经被主流经济学界认可,从而推翻了 Samuelson (1985) 有关经济学研究不可实验的论断:“经济学家……无法进行类似于化学家或生物学家所进行的那种在受控条件下的实验,因为经济学分析很难控制其他重要因素。与天文学家或气象学家一样,经济学通常必须满足于观察。”

实验经济学本质上是一种方法论经济科学,按照 Alvin Roth 教授形象的说法,实验方法主要用于三个方面:“与理论家对话”(speak to theorists),“寻找事实”

(search for facts), “在君主耳边低语”(whisper in the ears of princes)。这三种情况,分别代表实验方法在检验已有经济理论、发现新的经济规律和制定与测试经济政策等方面的作用。与理论研究相比,实验方法完全可以在实验室中构造出与理论假设相并行(parallel)的微观经济系统(Smith, 1982, 1994),理论模型将理论假设映射到结论的同时,实验也将微观经济系统的各项设置参数映射到系统结果^①。所不同的是,理论研究的这种映射依赖于数理逻辑,而实验研究的这种映射则依赖于实验被试(subject)^②以货币收益为激励、相互作用的经济行为。以构建主义理性为基础的理论研究在更加接近现实经济世界方面显然不及实验方法(Smith, 2003)。与实证研究相比,我们在实验微观系统中观测到的现象和数据同样要依赖于实证方法来归纳总结,但这些现象和数据显然不同于现实中获得的现象和数据,实验室数据最大限度地排除了不相关因素的干扰,所有的系统结果变动都可以完全归因于我们对系统设置所作出的我们感兴趣的调整。实证研究显然做不到这一点。所以,Smith(1982)不无揶揄地将实证研究戏称为“通过听广播来推断电学法则”(deducing the laws of electricity by

① 比较微观系统的结论和理论模型的结论,我们就可以验证理论假设是否合理,考察结论对假设的敏感性以及结论成立的边界条件,并以此修正已有理论或者建立新理论。

② 经济学/管理学实验中招募的自愿参加实验并领取实验报酬的志愿者称为被试,本书将所有的 subject 统一被译为被试。

listening to a radio play)。

传统的瓦尔拉斯经济学假设每个经济人都只是价格的被动接收者,市场出清的实现依赖于一个掌握全局供求信息的拍卖人。拍卖人在遍历所有可能的价格时,必定会发现有一个价格能使需求等于供给,那么这个价格就是市场均衡价格。瓦尔拉斯均衡理论抽象掉了市场均衡产生的动态过程,它只给出了一个可能的市场趋向。对此,Arrow 和 Hahn(1971)评论道:“如果我们不规定一个拍卖人的存在,我们就要描述,在任何时间和地点,两种商品总能以同样的价格交换是如何发生的……”。实验经济学正是发端于人们对瓦尔拉斯经济学缺乏动态特征的质疑。1948 年哈佛大学 Chamberlin 教授的课堂实验,可能是人们以实验的方式探索完全竞争市场上瓦尔拉斯均衡动态实现过程的首次尝试。但真正以严格的实验方法对瓦尔拉斯均衡理论作出检验的实验研究却是本论文集的作者 Vernon L. Smith 教授,他在其 1962 年标志着实验经济学正式诞生的《竞争性市场行为的实验研究》一文中发现,不同于瓦尔拉斯均衡所要求的条件,在完全竞争的实验市场上,只需要少量的几个仅了解自己保留卖价或买价的被试,市场交易的结果就会动态地趋向于瓦尔拉斯均衡;并且,这一过程与市场中的交易制度有关。Smith 教授极具创造性的实验性市场研究节约了瓦尔拉斯均衡前提假设的严格性,同时突出了市场交易制度的重要性,这是 Smith

教授的一个重要贡献。自此,实验研究方法逐渐开始进入主流经济学家的视野,越来越多的学者投入到了实验研究中来,越来越多的经济学领域开始用实验方法检验已有理论、发现新规律,如产业组织理论、拍卖及机制设计理论、资本市场理论、公共产品理论等^①。在上述这些领域中,Smith 教授均作出了奠基性的贡献。

Smith 教授的另外一个重要贡献是对实验研究范式的科学化、严格化所作的努力。Smith (1982) 构造的经济系统 S 由结构向量 e 和制度向量 I 构成。经济学实验被定义为系统的结构设置 (Treatment) 和制度设置到系统绩效 P (Performance) 之间的映射,不同于规范研究和实证研究的是,这个映射依靠实验被试在受控实验环境下的行为 B (Behavior) 来传导,所以,实验研究的一般性范式可以表达为: $\left. \begin{matrix} e \\ I \end{matrix} \right\} \rightarrow B \rightarrow P$ 。其中结构向量 e 体现着

实验经济学的一个重要思想,即诱导价值 (induced value) 思想,微观经济系统中所有行为人经济交往的基础,如市场实验中买者和卖者的保留价格,都是实验者诱导出来的,诱导价值思想可以使实验者在实验室中构造出他所要求的任何经济环境。在严格控制的实验室实验中,保持结构设置 e 不变,当我们仅对系统的制度

^① 对这几个经济学分支实验研究文献的一个详细综述,见 John H. Kagel 和 Alvin E. Roth 主编的《Handbook of Experimental Economics》,普林斯顿大学出版社,1995。

设置作出我们感兴趣的调整时,如将 I 变为 I' ,如果系统绩效 P 通过被试行为的传导也发生了相应的改变,如变为 P' ,那么比较 P 和 P' ,我们就可以得出两种不同制度安排 I 和 I' 的效率。这体现了实验经济学另外一个重要的思想,即比较制度思想。如果 e 和 I 的设定满足几个重要的设计原则,如非满足性(nonsatiation)、显著性(saliency)和占优性(dominance)等,那么在实验室微观经济系统成立的经济学规律在现实世界中也同样成立,这体现了实验经济学第三个重要的思想:并行性(parallelism)思想。

随着实验经济学向实验博弈论以及个体决策等方向的延伸,同时受新制度经济学快速发展的影响,实验经济学在 20 世纪 90 年代后逐渐开始从对完全契约型经济交往(交易)的研究转向对不完全契约型经济交往的研究^①。然而,作为实验经济学的基础,这本出版于 1991 年、涵盖了 Smith 教授早期所有论著的论文集,对于中国内地还处于起步阶段的实验经济学来说,还是具有重要参考意义的。这本论文集中文版的出版得益于

① 在以 Smith 教授为代表的早期实验研究中,实验室微观经济系统中的经济交往都外生地假定可以无成本地被作为第三方的实验室所证实,交易契约一旦达成,交易双方都不再有能力影响交易剩余的分配。但是在 20 世纪 90 年代后,以 Richard H. Thaler, Colin F. Camerer 和 Ernst Fehr 等为代表的实验学者逐渐将实验研究拓展到商品质量不可完全契约化的人力资本市场和信贷市场,在这些实验市场中,交易制度对交易结果的影响更为显著。同时,交易人的非理性因素在某些情况下可能会支配市场结果。

首都经济贸易大学出版社诺贝尔经济学奖获得者学术精品出版计划,第一编辑室主任薛捷及责任编辑兰士斌为本书的出版付出了辛苦劳动。

本论文集共分为以下几个部分:第一部分囊括了实验经济学形成时期 Smith 教授的 9 篇作品;第二部分的文章重点比较了各种市场制度的绩效表现,这一部分的文献体现出实验经济学研究范式已经逐渐走向成熟;第三部分是 Smith 教授对公共产品实验的开创性研究;第四和第五部分分别包含了 Smith 教授对拍卖和机制设计与产业组织理论实验研究的奠基之作;第六部分是 Smith 教授早期对经济学的展望。

本论文集的中文版是由南开大学博士生导师李建标教授(招收博士生研究方向:①实验经济学与公司治理②制度与企业组织)带领的研究团队集体劳动之结果,李建标教授正在主持的有关实验经济学研究方面的课题有:国家自然科学基金项目(70672029)、教育部人文社会科学重点研究基地项目(05JJD630023)、国家自然科学基金重点项目(70532001)子课题、天津市社科基金项目(TJ05-GI004)、南开大学“985 工程”哲学社会科学创新基地——“中国企业管理与制度创新”研究项目。Smith 教授的论文集构成了上述研究的重要的参考文献之一。该研究团队每周一次文献讨论课,Smith 教授论文集的中文版就是这种文献讨论的成果之一。参与 Smith 教授论文集等文献讨论和初稿翻译以及制

图、校对的师生有李晓义、王光荣、刘绪光、姜涛、孙娟 (Andrew Young School of Policy Studies, Georgia State University)、袁晓龙、宗计川、李娜、高玥、祁艳玲、刘吕科、张楚哲、金雯、李颖、巨龙、张斌、马秋华、赵小妹、于娟 (新加坡国立大学经济系)、王松、杨光等, Smith 论文集的校译和最后定稿由李建标和李晓义完成。

由于我们水平有限,语言转换中的词不达意甚至错误在所难免,敬请读者批评指正,我们将非常感激。联系方式:biaojl@126.com。

译者

2007年9月25日

参考文献

Arrow, Kenneth. J. and Frank Hahn, *General Competitive Analysis*, 1971, San Francisco: Holden - Day.

Samuleson, Paul and W. Nordhaus, *Principles of Economics*, 1985, New York: McGraw - Hill.

Smith, Vernon L., "An Experimental Study of Competitive Equilibrium", *Journal of Political Economy*, 1962, 70(2), 111 - 137.

Smith, Vernon L., "Microeconomic Systems as an Experimental Science", *American Economic Review*, 1982, 72(5), 923 - 955.

Smith, Vernon L., "Economics in the Laboratory", *Journal of Economics Perspective*, 1994, 8(1), 113 - 131.

Smith, Vernon L., "Constructivist and Ecological Rationality in Economics", *American Economic Review*, 2003, 93(3), 465 - 508.