



博弈论与实验经济学论丛 · 1

实验经济学引论

：原理 · 方法 · 应用

葛新权 王国成 / 著

An Introduction to Experimental Economics



社会科学文献出版社
SOCIAL SCIENCES ACADEMIC PRESS (CHINA)



实验经济学引论： 原理·方法·应用

葛新权 王国成 / 著

An Introduction to Experimental Economics



社会科学文献出版社
SOCIAL SCIENCES ACADEMIC PRESS (CHINA)

· 博弈论与实验经济学论丛 · 1 ·

实验经济学引论

——原理 · 方法 · 应用

著 者 / 葛新权 王国成

出 版 人 / 谢寿光

出 版 者 / 社会科学文献出版社

地 址 / 北京市东城区先晓胡同 10 号

邮政编码 / 100005

网 址 / <http://www.ssap.com.cn>

网站支持 / (010) 65269967

责任部门 / 财经与管理图书事业部 (010) 65286768

电子信箱 / caijingbu@ssap.cn

项目经理 / 周 丽

责任编辑 / 张景增

责任印制 / 盖永东

总 经 销 / 社会科学文献出版社发行部

(010) 65139961 65139963

经 销 / 各地书店

读者服务 / 市场部 (010) 65285539

法律顾问 / 北京建元律师事务所

排 版 / 北京中文天地文化艺术有限公司

印 刷 / 世纪兴源印刷有限公司

开 本 / 889 × 1194 毫米 1/32 开

印 张 / 11.5

字 数 / 272 千字

版 次 / 2006 年 9 月第 1 版

印 次 / 2006 年 9 月第 1 次印刷

书 号 / ISBN 7 - 80230 - 283 - 8/F · 064

定 价 / 28.00 元

本书如有破损、缺页、装订错误，

请与本社市场部联系更换



版权所有 翻印必究

北京市教育委员会
《知识管理与实验经济学平台》资助

总 策 划：王国成 葛新权 王文举

论丛工作室成员名单（以姓名拼音为序）：

陈 禹（中国人民大学经济科学实验室）

方齐云（华中科技大学经济学院）

费方域（上海交通大学 Smith 实验经济学研究中心）

葛新权（北京机械工业学院）

黄 涛（北京大学光华管理学院）

李保明（清华大学公共管理学院）

李建标（南开大学 Selten 实验室）

李雪松（中国社会科学院数量经济与技术经济研究所）

卢方元（郑州大学商学院）

任玉琬（重庆大学经济与工商管理学院）

阮陆宁（南昌大学经济与管理学院）

唐五湘（北京机械工业学院）

王国成（中国社会科学院数量经济与技术经济研究所）

王文举（首都经济贸易大学）

汪贤裕（四川大学工商管理学院）

王性玉（河南大学工商管理学院）

武义青 (河北经贸大学)

谢识予 (复旦大学世界经济系)

许 冰 (浙江工商大学数量经济研究所)

易 江 (华中科技大学经济学院)

张守一 (中国社会科学院数量经济与技术经济研究所)

张许颖 (河南财经学院)

张屹山 (吉林大学商学院)

朱恒鹏 (中国社会科学院经济研究所)

朱莉琪 (中国科学院心理研究所)

丛书总序

全国博弈论与实验经济学会决定，从 2006 年起编辑、出版《博弈论与实验经济学论丛》，下面我就有关问题作些简要的说明。

先说博弈论。它又叫做对策论，产生于我国古代。1944 年美国冯·诺依曼和摩根斯特恩合著的《博弈论与经济行为》，奠定了这门学科的理论基础，但它没有考虑不同的信息结构，过于抽象，使实际应用受到了限制。1950 ~ 1951 年美国纳什除研究合作博弈论外，还着重研究了非合作博弈论，证明了纳什均衡。以后非合作博弈论的发展，基本上是沿着纳什均衡展开的。经过许多学者的多年努力，确定了非合作博弈论的基本内容，包括完全信息静态模型和动态模型、不完全信息静态模型和动态模型、非对称信息模型。近一个时期以来，规制论、学习论等发展很快，成果很多，值得重视。

20 世纪 80 年代，当我国一些学者了解到国外博弈论发展的新动向后，立即开展了对它的学习与研究，成立了全国经济对策论研究会（中国数量经济学会的分会之一），举办了多次讲习班，召开了多次研讨会，撰写了大量的论文，出版了许多专著，在一些院校开设了这门课程，促进了我国博弈论的发展。博弈论是一门数学，当它与经济学结合后就产生了经济博弈论，此外还

有军事博弈论、政治博弈论、体育博弈论等等，这套丛书所说的博弈论，在一般情况下是指经济博弈论。

经济系统不仅有人的参与，而且人是其主体，人有各种利益，其中经济利益是决定其行为的主要因素。博弈论研究的对象是局中人在利益相互影响中的策略选择及其后果，这就抓住了经济系统的本质，从而向传统的经济学与管理学提出了严肃的挑战，使这两门科学面临一场深刻的革命。事实上，博弈论已经对传统的微观经济学与管理学进行了全面的改造，对宏观经济学与管理学的改造也已经取得了许多成果，估计本世纪内可以完成这项任务。

再说实验经济学。它是一门新兴的集经济学、管理学、社会学、行为学、心理学、计算机科学等之大成的综合性学科，为经济学与管理学的发展开辟了一条全新的途径。

在人们的传统观念中，经济学是一门观察的科学，是不可能进行实验的。与 1867 年马克思在《资本论》第一卷第一版序言中所说的情况相比，现代社会经济生活和经济学都发生了重大变化，分析经济虽然不能用显微镜和化学试剂，但在特定条件下进行可控和重复实验已经成为可能，从而可以加快经济学与管理学的科学化进程。所谓实验经济学，就是借助数学、计算机和其他技术，对社会经济系统进行试验，模拟经济现象，检验经济理论，制定经济政策。实验经济学有广义和狭义之分，广义的实验经济学包括经济计量模型、系统动力学、系统仿真模拟等，而狭义的实验经济学则是对不能用上述方法定量分析的问题采用人或计算机实验所进行的研究，现在所说的实验经济学，是指狭义的实验经济学。

实验经济学的应用领域非常广泛，在基本经济理论方面，通过实验能检验抽象假设，研究公平与效率、风险态度、利己与利他、愿望（动机）与能力等行为倾向的差异；在模拟市场竞争

时,通过实验数据能分析消费者和企业行为,分析公平、诚信、市场制度、规则设计与均衡产出的关系;在资本市场与投资方面,可重点研究投机预期心理;在产业组织方面,可分析寡头垄断、自然垄断行业的竞争与规制的成因与影响;在社会经济层面,可对人力资源开发、社会保障、劳动力转移等等问题进行实验;在宏观经济和国际经济方面,可研究财政政策与货币政策的调控方向和力度、国际贸易规则、国际合作与外交谈判、全球反恐联合行动等。随着对实验经济学的深入研究,它的应用范围还会不断地扩大。

在国外,实验经济学研究起步于20世纪50年代,发展很快。美国及以色列双重国籍的经济学家丹尼尔·卡尼曼和美国经济学家弗农·史密斯荣获了2002年诺贝尔经济学奖,以表彰他们在行为和实验经济学研究方面所做出的开拓性工作。

随着改革开放的不断深入,20世纪80年代我国学者已经注意到实验经济学这个新学科,部分高校逐步为研究生开设了证券交易、国际贸易、企业资源规划和财务管理等模拟实验专题讲座。但这门学科对研究条件要求高,研究难度大,我国在这方面的研究还处于起步阶段,进展不快。鉴于实验经济学的重要性与应用的广泛性,我国应该有组织地把它的研究与应用开展起来。

2005年8月19~20日,北京机械工业学院工商管理分院召开了我国首次“实验经济学学术会议”,来自中国社会科学院、北京大学、中央社会主义学院、首都经贸大学、北京机械工业学院、国家银监会和《经济研究》编辑部等单位的专家学者参加了会议,与会人员交流了开展实验经济学研究的经验体会和有关信息,对今后的活动作出了安排。同年12月,首都经贸大学在北京召开了“博弈论与实验经济学学术会议”。八月会议只讨论了实验经济学的有关问题,而十二月会议的内容增加了博弈论,会议举办者将两门学科结合起来,绝非巧合,而是科学发展的必

然，因为目前国内外实验经济学主要在研究博弈论模型，当然，数理经济学和其他学科模型，如罗默的内生经济增长模型，也属于这门学科的研究范围；八月会议的代表局限于北京，而十二月会议的代表除来自北京外，还来自上海、天津、重庆、湖北、河南、河北、浙江、江西、四川等地；八月会议的代表全部是经济研究工作者，而十二月会议的代表除经济研究工作者外，还有心理学家和计算机专家。十二月会议决定将全国经济对策论研究会更名为全国博弈论与实验经济学会，增加了研究会的领导成员，并力争每年召开一次研讨会，出版一本著作，形成系列丛书。

这套丛书的出版，不仅是博弈论与实验经济学的大事，也是整个经济学与管理学的大事。读者通过这套丛书可以及时了解国内外博弈论与实验经济学的最新研究成果，可以吸收更多的人，特别是青年学者投入到这两门学科的学习与研究中来，扩大研究领域，深化研究层次，取得更多更好的成绩，为经济学与管理学的科学化、为我国社会主义现代化作出越来越大的贡献。

张守一

2006年3月1日

前 言

本书是《博弈论与实验经济学论丛》的第一本。本书主要介绍实验经济学的基本理论，以及研究现状与发展趋势，分上、下两篇。

上篇是实验经济学基础知识——原理与方法，介绍实验经济学的界定、形成与发展、定位与作用，以及理论基础和相关学科；实验经济学原理与基本方法和程序，包括实验与模拟、经济实验三要素、基本程序、经济系统设计；经济行为与实验类型，分类对经济行为进行实验研究；当代经济学发展特点与趋势，实验经济学与行为经济学的密切关系，实验经济学研究对象与方法的回归，实验经济学旺盛的生命力与广阔的应用前景，实验经济学的局限性、困境、挑战与启示。

下篇是实验经济学新进展。按应用领域分别介绍：检验经济学基本理论，包括基本行为假设、经济环境描述与规则；现实经济的实验研究，包括竞争均衡与拍卖、均衡条件和变化、产业经济、金融保险、证券交易模拟、资本重组、劳动经济、社会保障、国际经济与贸易；相关专题，包括决策建议、效果模拟、验证分析；最后一章实验经济学在中国，介绍发展概况、前景展望，以及如何更有效地研究中国经济问题。

2005年8月19~20日在北京召开的我国首次“实验经济学

学术会议”(由北京机械工业学院举办)上,张守一教授就提出了出版实验经济学丛书的设想与思路,以及本书的基本框架与内容,得到了全体代表的肯定,并形成了会议决议。丛书编辑组织机构与具体事项又在12月份的“博弈论与实验经济学发展研讨会”(由全国博弈论研究会、首都经贸大学和全国数理经济学会举办)上得以确认和落实。

本书目录与内容安排确定,以及编写主要由葛新权教授和王国成教授完成。在编写过程中,北京机械工业学院研究生李会莉、刘津、邵慧燕3位同学翻译了相关的国外文献,为本书的撰写提供了比较充实的素材。在此,向他们表示感谢。

在介绍国内研究现状的编写中,得到了南开大学李建标教授、上海交通大学费方域教授、中国人民大学陈禹教授、复旦大学谢识予教授等的大力支持,无私地为我们提供资料,为本书增色,在此表示衷心的感谢。

本书作者之一王国成博士受国家留学基金资助,作为高级研究学者于2004年下半年在美国乔治·梅森大学的ICES(2002年诺贝尔奖得主V. Smith教授领导的经济学科跨学科研究中心)访学和开展相关研究,其间收集和了解到一些实验经济学与行为经济学的相关资料和前沿动态,并做了一次专场学术报告;回国后进一步整理研究有关资料,本书中的部分内容已先期发表。作者非常感谢V. Smith教授以及ICES提供的非常难得的机会及优越的学术研究条件,非常感谢中国留学基金杰出学者项目的资助。特别是,衷心地感谢V. Smith教授和ICES的6位专家学者,以及上海交通大学安泰管理学院费方域教授、秦向东博士为我们无私地提供实验软件与实验设计及实施经验,为本书策划与编写,以及以后的研究奠定了良好的基础。

本书的出版受到北京市教育委员会《知识管理与实验经济学平台建设项目》(葛新权教授为项目负责人)资助,特别要感

谢北京市教育委员会科技与研究生工作处处长叶茂林博士和赵清副处长的大力支持。

本书的出版，还要感谢出席 2005 年北京实验经济学会议和“2005 全国博弈论与实验经济学发展”会议的专家学者，他们在这两次会议上的发言对本书撰写提供了有价值的启发；还要感谢所列参考文献的作者，以及其他参考文献的作者，他们的成果为本书的完成提供了基础。

特别地，要感谢我们的老师，也是这套丛书总序的作者张守一教授。他不仅是这套丛书，也是这本书的策划者，提出了总体思路与框架性结构，以及很多富有见地的意见与建议，在此表示衷心的感谢。

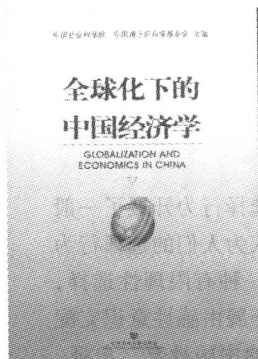
由于我们对实验经济学的认识处于起步阶段，书中难免有不妥之处，诚恳地希望得到各位同仁的批评指正，并对此深表谢意。

作者

2006 年 3 月 18 日

相关链接

更多信息请查询: www.ssap.com.cn



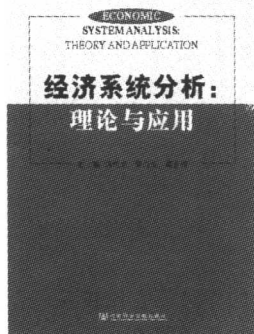
全球化下的中国经济学

中国社会科学院 中国博士后科学基金会 主编

2005年10月出版 65.00元

ISBN 7-80190-767-1/F·231

本书是值中国博士后20周年庆典之际,中国社会科学院、中国博士后科学基金会主编的博士后优秀论文集。全书分为八部分:第一部分是经济理论专题,主要是对一些经济主题进行数量模型分析;第二部分是货币与银行专题;第三部分是财政专题;第四部分是金融市场专题;第五部分是产业经济专题;第六部分是人口与就业专题;第七部分是国际经济专题;最后一部分是附录,介绍了中国博士后制度发展概况。



经济系统分析: 理论与应用

何伦志 曾力生 蒋金荷 主编

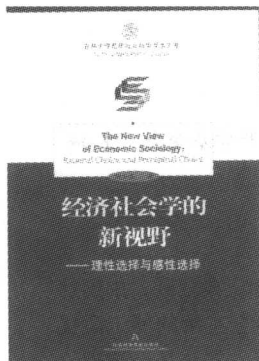
2006年8月出版 29.00元

ISBN 7-80230-244-7/F·047

科学发展观为当前我国的经济社会发展提出了一种新的发展理念。针对我国区域经济发展面临的环境污染、资源供需矛盾以及发展差距等问题,本书从系统分析的角度,探讨了经济系统分析的理论、方法,科学发展观指导下的区域发展模式、经济增长与环境保护、资源的开发利用等问题,并结合区域发展过程中的案例进行了实证分析。本书对科研人员以及对区域发展感兴趣的读者具有一定的参考价值。

相关链接

更多信息请查询: www.ssap.com.cn



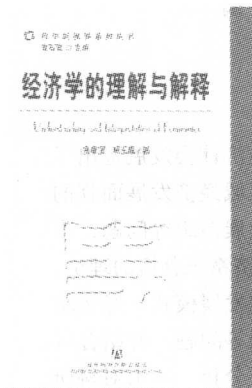
经济社会学的新视野：理性选择与感性选择

刘少杰 著

2005年10月出版 39.00元

ISBN 7-80190-787-6/F·235

本书以经济社会学视角对选择行为开展了一般理论到经验事实的丰富研究,认为人们的选择行为在很多条件的限制下,不仅是一种有限理性选择,甚至常常停留在感性层面上,开展由感性意识支配的选择行为。尤其在伦理本位的中国社会,象征、模仿、从众和习惯等因素在选择行为中的作用就更为明显,圈子社会、熟人社会 and 礼俗社会中的感性选择就更为广泛。作者以高度概括的理论阐述和深入具体的经验研究,为读者展开了一个从抽象到具体的理论视野,以选择行为研究为核心,论及社会转型、制度变迁、人力资本、社会资本、社会重建、社会理性化和区域发展战略等多方面问题,对于开展深入的学术研究和经验研究都具有积极的借鉴意义。



经济学的理解与解释

余章宝 杨玉成 著

2005年8月出版 28.00元

ISBN 7-80190-627-6/B·071

本书是一部具有开拓性意义的作品。它比较系统地阐述了关于经济学这一学科的哲学背景、历史观、政治观、方法论的观点,很具有启发性。这部著作有助于提高经济学的研究水平,也将为丰富哲学研究提供思想资源,同时,对其他学科也会产生积极的影响。

社会科学文献出版社网站

www.ssap.com.cn

1. 查询最新图书
2. 分类查询各学科图书
3. 查询新闻发布会、学术研讨会的相关消息
4. 注册会员，网上购书



本社网站是一个交流的平台，“读者俱乐部”、“书评书摘”、“论坛”、“在线咨询”等为广大读者、媒体、经销商、作者提供了最充分的交流空间。

“读者俱乐部”实行会员制管理，不同级别会员享受不同的购书优惠（最低7.5折），会员购书同时还享受积分赠送、购书免邮费等待遇。“读者俱乐部”将不定期从注册的会员或者反馈信息的读者中抽出一部分幸运读者，免费赠送我社出版的新书或者光盘数据库等产品。

“在线商城”的商品覆盖图书、软件、数据库、点卡等多种形式，为读者提供最权威、最全面的产品出版资讯。商城将不定期推出部分特惠产品。

咨询/邮购电话：010-65285539 邮箱：dushe@ssap.cn

网站支持（销售）联系电话：010-65269967 QQ：168316188 邮箱：service@ssap.cn

邮购地址：北京市东城区先晓胡同10号 社科文献出版社市场部 邮编：100005

银行户名：社会科学文献出版社发行部 开户银行：工商银行北京东四南支行 账号：0200001009066109151

目 录

上篇 实验经济学基础知识 ——原理与方法

第一章 实验室里能出经济学吗	3
第一节 什么是实验经济学	3
第二节 实验经济学的艰难发展历程	9
第三节 实验经济学的地位和作用	13
第四节 与相关学科的联系和区别	34
第二章 实验经济学原理与基本方法和程序	40
第一节 经济学中的实验方法	40
第二节 微观经济分析中市场实验的函数	52
第三节 实验方法的分类和程序	55
第三章 经济行为的异质性与实验检验	63
第一节 在心理维度上研究经济行为	63
第二节 博弈论：市场设计和检验市场行为的工具	66