

新世纪高校**经济学**教材译丛

Bargaining Theory with Application

[英] 阿伯西内·穆素 著
(Abhinay Muthoo)

管毅平 郑丹秋 等译

管毅平 校

讨价还价理论及其应用



上海财经大学出版社
Shanghai University
of Finance & Economics Press

新世纪高校经济学教材译丛

讨价还价理论及其应用

[英] 阿伯西内·穆素 著
(Abhinay Muthoo)

管毅平 郑丹秋 等 译
管毅平 校



上海财经大学出版社
Shanghai University
of Finance & Economics Press

图书在版编目(CIP)数据

讨价还价理论及其应用/[美]穆素(Muthoo, A.)著;管毅平等译.

—上海:上海财经大学出版社,2005.12

(新世纪高校经济学教材译丛)

书名原文:Bargaining Theory with Application

ISBN 7-81098-539-6/F·490

I. 讨… II. ①穆…②管… III. 契约法-法的理论-高等学校-教材 IV. D913

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2005)第 117152 号

□策 划 黄 磊

袁 敏

□责任编辑 黄 磊

□封面设计 未 名

□版式设计 孙国义

TAOJIAHUANJIA LILUN JIQI YINGYONG

讨 价 还 价 理 论 及 其 应 用

阿伯西内·穆素

著

(Abhinay Muthoo)

管毅平 郑丹秋 等 译

管毅平 校

上海财经大学出版社出版发行

(上海市武东路 321 号乙 邮编 200434)

网 址: <http://www.sufep.com>

电子邮箱: webmaster@sufep.com

全国新华书店经销

上海译文印刷厂印刷

宝山葑村书刊装订厂装订

2005 年 12 月第 1 版 2005 年 12 月第 1 次印刷

787mm×960mm 1/16 18.5 印张 383 千字

印数:0 001—4 000 定价:36.00 元

序

Ariel Rubinstein 对于讨价还价理论的贡献 (Rubinstein, 1982)¹ 引发了经济学专业的想像力。此后发展起来的范围广阔、形式多样的文献中大多数论文的起源, 都可以追溯至这篇富含原创因子的论文; 尽管这篇文献可能并没有直接促成那些论文。同时, 随着讨价还价理论的发展, 应用经济学理论工作者已经运用这篇文献中的模型, 构建了形形色色的研究经济现象的模型, 而这些现象迄今为止都还没有被研究过, 或者没有被恰当地研究过。目前已经有了包括讨价还价理论**应用**的大量文献。

除了 John Nash 对于讨价还价理论的拓荒性贡献 (Nash, 1950, 1953) 之外, 本书所用的许多资料都根基于和/或受到了 1982 年后发展起来的那些(理论的与应用的)文献的启迪。

在我心目中, 写这部书有两个主要目的。首先, 从理论的视角, 我要综合与编织成一幅首尾一致的、统一的图景, 它是得自讨价还价理论文献的主要基本结论和洞见。这些章节围绕着决定讨

1 参见 Rubinstein, A. (1982), "Perfect Equilibrium in a Bargaining Model," *Econometrica*, 50: 97—110。
译者注

价还价结果的主要力量来组织。我不仅分析影响讨价还价结果的每一种力量,我还经常分析两种或者更多力量的相对影响。其次,从**应用**的视角,我要展现讨价还价理论如何富有成效地应用于形形色色的经济现象。

为了达到上述两个目的中的第一个,我不得不评估和反思那些讨价还价理论的文献。在这样做的过程中,有必要导出某些新的分析(那些文献中所没有包含的)——特别是为了发展出对于讨价还价结果具有两种或者更多的**相对**影响的理解。

由于本书提供了一套统一处理讨价还价理论的方法,而且含有新的结论,所以它半是教科书,半是研究专著。因此,本书不仅对于感兴趣于讨价还价境况(出现于众多的经济学和政治领域)的研究生,以及专业的应用经济学和政治学者有所助益,而且对于讨价还价理论和博弈论的学者也有所助益。本书可以用来学习讨价还价理论,改善人们对于讨价还价理论的理解。进一步地,它应该有助于研究者应用理论和/或构建他们自己感兴趣的特定真实生活中的讨价还价境况的模型。

第1章介绍若干基本问题,提供本书的大纲。讨价还价理论及其应用的发展是在第2章~第10章。最后一章(结论),即第11章,将注意力投向本书所发展的理论的若干主要遗漏和弱点,确认讨价还价理论及其应用进一步发展所需的特定路径和未来研究的主题。

致谢

1995年10月,在受到 Ariel Rubinstein 的多次鼓励之后,我开始了本书的工作。除此之外,由于几个原因,我极大地感恩于他。其一,当然地,由于他的著述贡献,不但使本书成为可能,而且影响

了我关于这一主题的工作和思考。其二,从我在剑桥大学读研究生起,我就荣幸地有机会与他探讨讨价还价理论。在我们的讨论中,我学益殊多,获享了许多洞见。

Ken Binmore 通过他的重要而富于洞见的贡献,以及我们之间的讨论,在我的工作和思考中起了重要的作用。他还给予我写作本书的鼓励。

由于写作本书,我蓄积了诸多感激之情。许多朋友和同事对于一些章节进行了非常仔细的评论,这使我得以扎实地修改这些章节。他们包括:Roy Bailey(第1章、第2章~第4章、第11章),Craig Brett(第1章、第5章、第6章、第11章),Vince Crawford(第8章)、Martin Cripps(第2章、第3章),Leonardo Felli(第10章),Shinsuke Kambe(第7章~第9章),Ben Lockwood(第5章、第6章),Martin Osborne(第3章、第4章、第7章、第8章),以及Anders Poulsen(第3章、第7章)。

Craig Brett, Roy Bailey, Ken Binmore, Vince Crawford, Osvaldo Feinstein, Drew Fudenberg, Oliver Hart, Jim Malcomson, Martin Osborne, Alvin Roth 和 Ariel Rubinstein,就本书的一些章节,提供了若干富于助益的建议和/或评论。

如果没有使用 LATEX,我想我无法写成本书。我非常感谢 Roy Bailey,他(多年以前)把这奇妙的软件包介绍给我,帮助我学习它,而且,在我写作本书时,在我咨询如何应对时,他襄助了我。Craig Brett 在这后一方面给予我襄助。

Patrick McCartan 在出掌剑桥大学出版社期刊部之前,是剑桥大学出版社的经济学编辑,他为我写作本书花费了大量时间。Patrick 对于本书的热情和全面的支持,给予我很大的鼓励。匿名审稿人(由 Patrick 组织)给予我若干非常有益的特别和全面的评

论。Ashwin Rattan 继 Patrick 之后作为剑桥大学出版社的经济学编辑,通过其在该出版社的各个(编辑和生产)环节,非常友善和有效地调度处理了全部打印稿。与这样的同仁在剑桥大学出版社一起工作是一种快乐。

最后,必不可少地一定要提到,我的家庭给予了我许多鼓励和支持。

阿伯西内·穆素
(Abhinay Muthoo)
于埃塞克斯大学

中文版序

非常高兴看到我的书被译为中文，它给予我极大的喜悦。我希望，这将使现代讨价还价理论的理念、模型、结论和洞见，更易于为中国人学和学院的师生所接受。我很幸运，有上海交通大学管毅平教授这样的优秀学者翻译我的书。对此，我很有信心，这将是一本优秀的译著。

讨价还价，或者谈判，处于每一个社会的核心。作为个人（例如，在市场和集市里谈判价格，经常与朋友和家人就这事那事谈判），作为厂商和企业（例如，就合资与其他商务协议与外国厂商谈判），作为国家（例如，与其他国家就双边或多边的众多事务而谈判条约），我们在各个阶层和圈子里就众多事务而谈判。我的书会有助于人们更为系统地思考这样一些谈判事宜。尤其是，有助于人们发展出对于决定参与各方的相对讨价还价力量的主要因素的理解，以决定何时各方可能达成一项谈判协议，而不至于陷入代价高昂的冲突之中；更一般地，有助于人们理解决定谈判结果的因素。

我期望，作为这项译事的结果，中国的教师现在有更多的机会

接触讨价还价理论及其应用的资源。这将使他们在诸如经济学、国际关系、管理学、企业与商务等学科中,把这一主题融入各种课程之中,在此过程中讨价还价显然起着重要的作用。

最后,我要感谢上海财经大学出版社在中国出版我的书。

阿伯西内·穆素
于埃塞克斯大学
2005年9月

Preface to the Chinese Edition

It gives me immense pleasure and much delight to see that my book has been translated into Chinese. I hope that this will make the ideas, models, results and insights of modern theory of bargaining much more accessible to students and teachers in Chinese universities and colleges. I have been fortunate to have had a excellent scholar as Professor Yiping Guan of Shanghai JiaoTong University to have translated my book. I am as a result confident that this will be an excellent translation.

Bargaining, or negotiations, lie at the heart of every society. We negotiate as individuals on many matters in a variety of spheres (for example, over prices in markets and bazaars, and often with friends and family about this and that), as firms and businesses (for example in negotiating joint ventures, and other commercial agreements with foreign-based firms) and as nations (for example in negotiating treaties with other nations, bilaterally or multilaterally, over many different issues). My book should help one to think more systematically about such negotiations. In particular, in helping to develop an understanding of the main factors that determine parties' relative bargaining power, that determine when parties are likely to reach a negotiated agreement rather than engage in costly conflict; and more generally, the factors that determine the outcome of negotiations.

I hope that as a result of this translation, teachers in China will now have easy access to a resource on bargaining theory and its applications. This should enable them to put this topic on a variety of courses in subjects such as economics, international rela-

4 ◀▶ 讨价还价理论及其应用

tions, management, business and commerce, in which bargaining clearly plays an important role.

I would like to finally thank Shanghai University of Finance and Economics Press for publishing my book in China.

Abhinay Muthoo
University of Essex
September 2005

译者序

在下面的文字里,我不打算像通常那样罗列本书的概要,评论本书的得失。我只想简要说说自己学习和研究相关理论的几分见解,偏于方法论的基本假设和相关理论的贯通。这样可能有利于读者免除译者序、作者序和第一章预备知识之间的雷同感,可能有利于提高读者阅读正文的边际效用。

生活在社会中的各方行为人,有共同的利益要寻求合作,同时他们对于如何合作以分配利益又有分歧,这就是讨价还价的境况。建基于博弈论,对此境况展开分析,形成讨价还价理论,再设法应用,是本书《讨价还价理论及其应用》的主旨。这样来理解讨价还价行为及其理论,不外是将其看作社会博弈行为的一种类型。

作为学人,我们学习和欣赏理论之树的丰茂,须臾不可忘记这丰茂的根本所在:在讨价还价理论的背后,隐含了很强的逻辑预设——以极大的概率由生物和人类千百万年行为验证了的假设:社会各方,即各个行为人,是出自利己的理性动机来寻求合作以获取精神或者物质利益最大化的。如若不然,何以讨价还价?怎样达成均衡?这正是笔者近几年一再阐述的经济学信息范式的要

义：利己的理性动机是经济学第一假设，无论人们的行为表现为利己还是利他，都无法不受到根本性的利己动机的驱策。¹经济学二百多年的努力，都根基于这一假设。博弈论及其重要分支讨价还价理论，强化了这一假设的普适性，而且与信息经济学一起，重新谱写了经济学的各个分支，尤其是基础性的微观经济学和产业组织理论。今年（2005）的诺贝尔经济学奖得主之一的 Robert J. Aumann 教授，在他主编的三卷本《博弈论手册》（*Handbook of Game Theory*）第一卷的序中强调：**博弈论研究互动的决策者行为，是从经济学理性出发的，不是从心理学或者社会学观点出发的。**这是经济学大家经年研究的学问积粹和有益提醒，我们后学不可不深思其义。

有不少学者，特别是社会学和心理学学者，不同意这样强调理性动机的重要性，甚至认为把经济学大厦建立在理性动机假设之上是错误的。他们认为，人未必是完全理性的，有时还是非理性的。我认为，造成如此歧见的关键是：把行为动机与导致行为偏离行为动机的条件混同了。这里的条件，主要就是信息约束条件。所谓非理性行为，都可以程度不同地归结为：理性动机的行为人在信息约束不同条件下的行为结果。

就分析人类行为的经济学而言，信息至关重要，重要到如同基因之于人体。有人说，合约特别重要。不错。不过，如果说，合约关系是经济交易的要件，信息就是合约的基因。信息约束改变了，合约订立前后的状态、过程和结果必然改变。有什么样的信息条件，就有什么样的合约结果。反之，合约的任何改变，都意味着信息的改

1 参见拙文：《经济学信息范式刍论》，载《经济研究》1999年第6期；以及《理性动机与利他行为》，载《中国社会科学评论》2002年第1卷第2期。

变。信息是因,合约是果。在此,因果无法倒置。一句话,信息是否完备(完全)或者对称,严重制约着合约的各个方面——讨价还价、签约、履约以及仲裁——交易的全过程。对于这一科学认识的肯定,便是诺贝尔经济学奖曾经在1996年和2001年,两次颁给了对于信息经济学做出杰出贡献的经济学家。而今年的诺贝尔经济学奖,继1994年之后,再一次颁给了对于博弈论做出杰出贡献的两位经济学家:Robert J. Aumann和Thomas C. Schelling,更强调了这一认识。这是经济科学自我意识确立的呈现,是经济学前沿发展无法不偏重于信息这一人类行为基因使然。博弈论与信息经济学(或者合约理论,或者激励理论)一样,都把理性动机和信息约束作为分析人类行为的最基本假设。在信息范式的烛照之下,在经济分析之中,尽管理性动机不二,却由于信息约束的各异,同类人或者不同人的行为,演化出形形色色的行为结果,折射出人性多样化的谱系。

以博弈论为基础的讨价还价理论,不仅在理论上逻辑井然,而且在实践中获得了一些成功。这一理论逻辑,在本书的第一章中有简明的总体交待,其后的各章依次展开,逐步深入探讨,这里不赘。值得一述的是,这一理论近十几年来在实际应用中的成功,或可加固我们的理论信念。

博弈论在整个20世纪80年代取得了长足的进展,于90年代不断蚕食领先大学中研究生教科书的领地。可是,博弈论在经济学中的地位,尤其是它在拍卖实践中的应用价值,一直争议不绝。例如,在1985年的计量经济学会世界大会上,就爆发了相关论争。讨价还价研究者不相信博弈论可以解释许多拍卖行为,置疑博弈论改进拍卖设计方案的可行性。而拍卖理论和产业组织理论学者却相信,博弈论启发和引导了他们的研究。看来,只有实践的检验

才能给出有力的裁判。

1993,由著名经济学家 R. Wilson 和 P. Milgrom 领导的研究小组,设计了以博弈论为主导的无线电频谱拍卖方案,随即为美国联邦通讯委员会(FCC)所接受,作为美国频谱拍卖的基础,付诸设计实施。1994年,美国联邦通讯委员会主持了第一次新的频谱拍卖活动。《纽约时报》在1995年的一篇文章中,称颂这一频谱拍卖是“前所未有的伟大拍卖”。到了2000年,美国国家科学基金会在纪念其50周年的时候,特别肯定了美国频谱拍卖的成功,给予博弈论的基础研究以强力资助。而同年在英国的无线电频谱拍卖,创下了340亿美元的纪录,其设计者之一赢得了英国女王的赞许,荣获了“不列颠帝国指挥官”的头衔。与此同期,美国的博弈论学者还将其理论应用于“全国居民匹配计划”,力图使2万名美国医生按年度与需要就医的居民相匹配。类似的成功,还可以枚举。至此,以博弈论为基础的讨价还价理论及其在拍卖中的应用,结出了经验的硕果,置疑博弈论应用可行性的观点暂时蛰伏了。

P. Milgrom 教授在总结这次美国频谱拍卖机制的设计时认为:传统的博弈论对于行为人的理性假设和预期分析较为简单,在实际应用中往往捉襟见肘;拍卖理论的经济实验检测也有违于不少细节理论。但是,在几个关键趋势的预测上,以博弈论为基础的拍卖理论捕捉到了拍卖出价的重要特征,得到了实验的支持。对于真实世界中的拍卖设计者来说,这一理论还需要精炼,需要对于关键命题应用性检测的实验补充,需要来自经验推理和实际判断的补充。²这与 Muthoo 教授在本书第11章跋中关于讨价还价理论不足的总结在精神上是一致的,即理论的不完备在所难免,关键是

2 参见 Milgrom, 2004, *Putting Auction Theory to Work*, Cambridge University Press, p. 2.

需要不断加强理论、实验与实践的互动,以获得更充分的信息,并且精炼这些信息,以提高理论与实际拍卖操作的契合程度,在这一过程中优化讨价还价理论。

据此,我相信经济学信息范式贯通其中的讨价还价理论的可行性。我对讨价还价理论的兴趣,不仅在于这一理论对于人类社会的经济行为具有较为强劲的解释力,而且在相当程度上还可以解释政治行为和更为一般的社会行为。就是说,运用讨价还价理论的基本内核,可能在相当多的具体境况或者约束条件下,解释相当多的人类行为。这样的例子及其解释和证明,在本书中俯拾皆是,读者自可裁断。

注意,我这里说的是“可能”,把这“可能”转化为实际发生的有效解释——经得起经验验证的解释,甚至预测行为的准确率高,更加有赖于运用这一理论的学人。再好的理论,运用不当的话——多半是由于没有做好审时度势地分析约束条件的工作,也会结出不甜甚至苦涩的果子。

据《圣经》的创世纪,上帝依自己的样子造人,提醒人之初的亚当和夏娃不要吃伊甸园的禁果。可是禁果还是被尝了,人类于是有了无法根除的原罪。对此,如果你是上帝的信徒,你就不会怨上帝有过,你只能怨人之初尝鲜的欲望强过上帝律令,不懈地修行就是正解。或者,套一句佛教西来后咱们国产的格言:是和尚念歪了经:西来经正,和尚嘴歪,甚而心歪。推导的结果是,理论无过,运用有过。当然,如果你不是上帝的信徒,你也可能想到上帝之过与人祖之过或许并存,只是孰轻孰重有别罢了。再或者,和尚与经都可能不正,只是责任有别,修经与持信并行不误。我看,做理论工作的学人,对待一种理论,既要有信徒的虔敬,又要有非信徒的疑虑。虔信不疑,则批判意识消泯,无法发展理论,近乎学而不思则

罔。根本不信,则无所依傍,无法积累学问,近乎思而不学则怠。折中之中取在哪里?这是一个难题。我的考虑是:先信,后批。即先持信,进入一种理论,弄明白理论的原委,发现了不足或者谬误后,再逐渐批判和发展这一理论,即修信。这种态度,从而引致的研究作风,更合乎理论发展史。否则,不信就批,无异于不问青红皂白就打倒,无所谓发展理论,只会糟蹋理论。更重要的是,这种研究方法不合思想史的轨迹,从而不可取。发展至今的人类,其行为和社会制度的演化,都大致走过了一条试错发展的路。走此路的前提是,相信人类可以不断改进自己的境况。经济理论,包括我们面对的讨价还价理论的学习和研究,也应作如是观。

参加本书翻译的人士及其分工是:管毅平:规划全书译事和组织协调,翻译作者中文版序、目录、第1、11章、术语表;王颖:初译第2、3、4章;翁章好:初译第5、6、7章;彭海珍:初译第8、9、10章;邓艳红:初译第1、3章、术语表;郑丹秋:复译第2、3、4、5、6、7、8、9、10章;康枫:后期助理工作;管毅平:校对全书定稿。这里,之所以有初译和复译的说明,是由于初译工作的误植较多,不得不在全面校对之前复译一遍,这也是本书译稿延期付梓的主要原因。上述几位,都是我教过的博士生或者硕士生。无论如何,我向各位同学诚挚致谢。

我还要衷心感谢以下朋友的襄助与合作:

我与李维森教授的学术探讨,坚定了我用“讨价还价理论”对译书名,而不用“议价理论”或者“谈判理论”。因为,bargaining的对译“讨价还价”在经济学界几乎已成惯例,而haggling对应于“议价”较顺,negotiation则对应于“谈判”不谬,我不愿意为了书名的简短和富于商业上的吸引力而牺牲其学术性。

我与上海财经大学出版社副总编黄磊先生的合作总是愉快