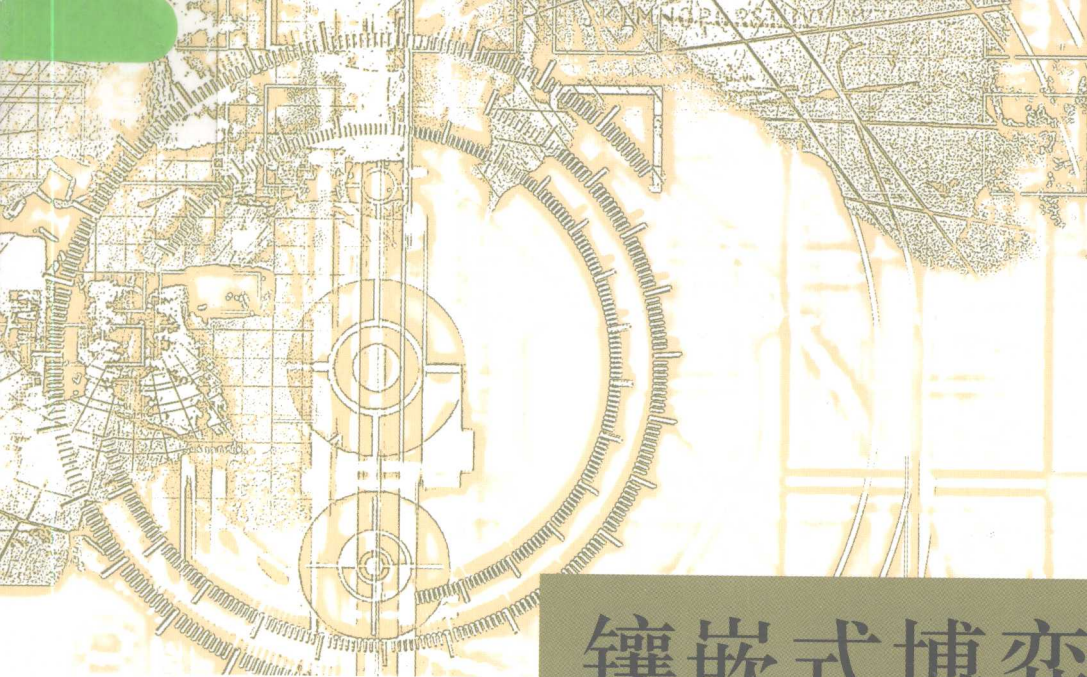




镶嵌式博弈

● 对转型社会市场秩序的剖析

王水雄 / 著

的非合作现实博弈都
一系列合作的基础之
个博弈参与人不能在标
达成均衡以及解，或者
么，那么，至少存在其
参与人会有动力通过
『呈现』另外一个层面

的博弈空间，将原标准博弈镶嵌
到新的博弈空间（乃至新的现实

空间）中去，以实现自我支持的

博弈结果。就是说，参与人有动

力通过或更改自己的效用产品，

或置换博弈框架，或变换博弈活

动对象，来获取自己所欲的博弈

解，更正『错误』，或在事实上接

纳『错误』的结果，倒过来，也有

可能有些『聪明』的博弈参与人

刘世定 主编
经济与社会文丛



F723/40

2009

镶嵌式博弈

王水雄 / 著 ● 对转型社会市场秩序的剖析

图书在版编目(CIP)数据

镶嵌式博弈:对转型社会市场秩序的剖析/王水雄著.
上海:上海人民出版社,2007

(经济与社会文丛)

ISBN 978-7-208-07122-3

I. 镶… II. 王… III. 对策论-应用-市场管理-研究-
中国 IV. F723.0

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2007)第 091380 号

责任编辑 田 青
美术编辑 路 静

经济与社会文丛

镶嵌式博弈

——对转型社会市场秩序的剖析

王水雄 著

出 版 格致出版社
世纪出版集团 www.hibooks.cn
www.ewen.cc 上海人民出版社
(200001 上海福建中路193号24层)



编辑部热线 021-63914988

市场部热线 021-63914081

发 行 世纪出版集团发行中心
印 刷 上海商务联西印刷有限公司
开 本 635×965 毫米 1/16
印 张 21.25
插 页 2
字 数 297,000
版 次 2009 年 1 月第 1 版
印 次 2009 年 1 月第 1 次印刷
ISBN 978-7-208-07122-3/F·1606
定 价 42.00 元

总 序

刘世定

一、题 称 辨

本书题为“经济与社会文丛”，其中的“经济与社会”这一用语，并非遵循把社会生活的一块划为“经济”而另一块划为“社会”这样一种时下在不少地方流行的分类，而是遥遥呼应着社会科学史上一位重要的人物和他的重要的著作。这位人物是马克斯·韦伯，他的一部重要著作名称是《经济与社会》。

根据韦伯研究专家的考证，所谓《经济与社会》事实上是韦伯未完成的文稿，最初出版是韦伯夫人依据自己的理解整理成书的，而这个标题也是长期误置的结果，真正的书名是《经济、诸社会领域及权力》（甘阳，1998：1—2）。不过，这并不影响我们采用“经济与社会”这个简洁的标题来呼应韦伯所致力事业。

我们所说的这项事业中的一个重要内容，就是把经济和诸社会领域结合起来研究。这样做的意义自不待言。从孔德提出“社会学”这个名称时起，就批评当时的政治经济学不应该把经济领域和社会其他方面分割开来研究。但问题是怎样联系起来研究。我们每一个人都生活在经济生活和其他社会生活的联系之中，懂得事物间存在普遍联系也并不困难，但是这并不意味着当我们决定要把它们联系起来研究时就能够得到超出我们日常所知的新的知识。事实上，当孔德的批评终于在19世纪末引发经济学家的回应时，他们也并不否认把社会的各个领域联系起来分析的必要，只是认为在当时的社会科学水平上，建立统一的社会科学还为时尚早，关键是怎样才能在社会科学上迈出步子（马歇尔，1890/1981：414—415）。当时

的主流经济学家们强调有必要把经济领域独立出来研究,而韦伯却正是在把经济和其他社会领域(如宗教)联系起来研究方面迈出了实际步伐的人。

今天,中国的许多学者也在把经济和社会其他诸领域联系起来展开自己的研究工作,其中包括青年学者。本丛书试图为他们的成果提供展示的园地。

《经济与社会》作为韦伯未完成的文稿这件事,对本文丛借取这个题头来说还有一个隐喻。优秀的作品有两类,一类是登临绝顶尔后再无超越者;还有一类是开拓新路,引英才源源,大器在后。我们希望有前一类作品进入本文丛,但更现实地期盼于后者。就后一类作品而言,虽然其提问、阐述、结论俱全,但放之长线来看,后果待出,更类似一部未完成的文稿。这样的文稿,是需要群体的力量去完成的。

二、时 势 辨

在韦伯生活的时代,把经济领域和社会其他领域分离开来进行研究的趋势已经日渐明显。经济学的边际革命以后形成的均衡价格分析范式,使大多数经济学家的注意力被吸引在市场价格机制研究上面,而很少关心其他社会领域中的现象。而研究其他社会领域的学者并未感到这样的研究范式对他们的研究有何重要意义。大学的分科制度,又使得其他社会领域的研究者避免进入经济学家的“领地”。这样,在20世纪的数十年中,把经济领域和社会其他领域联系起来的研究即使有,也不成阵势。

在当代,情况开始发生变化,有越来越多的研究者致力于把原来被分离开的经济领域和社会其他领域联系起来考察。

是什么原因使得越来越多的研究者把原来分离开研究的领域联系起来考察呢?

一个原因与研究工作的逻辑特点有关。当在某个领域中的研究深入到一定程度后,人们凝炼出一些概念、命题、分析工具后可能会发现,这些概念、命题和分析工具可以扩展地用于更加广阔的领域,而不是仅仅局限于它们最初被提炼出来的领域。这方面的一个例子是加里·贝克尔

的工作。根据他的说法,经济学的研究经历了三个阶段。在第一阶段是仅限于研究物质资料的生产和消费结构,到第二阶段研究范围扩大到全面研究货币交换关系,而第三阶段其研究已经囊括了各个领域中的人类行为。第三阶段的扩展是源于贝克尔等人意识到,在经济学中提炼出来的一些概念、命题、分析工具可以看作是适合于解释诸多人类行为的一套统一的方法(贝克尔,1976/1993)。另一个例子是马克·格兰诺维特、哈里森·C. 怀特、薇薇安娜·泽利泽等的工作。他们把在社会学中发展出来的一些概念和分析框架用到在传统上社会学家并不进入的市场、货币交换、厂商等研究领域中去(Swedberg and Granovetter, 1992:2)。

另一个原因和学术研究的生产函数有关系。研究领域的选择和研究者的兴趣有密切的联系,这是没有疑问的。但是,在科学研究成为职业的当代社会中,研究者们选择研究领域不能不考虑出成果的可能性、成果的大小等因素。一般而言,一个领域的先驱者进行了开拓性研究之后,跟进者在一定阶段中会取得递增的边际学术收益。他们不必像开拓者那样在基础概念、方法等方面付出那样多的努力就可以取得不错的成果。但是,在一个领域中的研究进行到一定程度以后,要再想取得超越前人研究的好成果就会越来越难。也就是说,终将出现边际学术收益递减的情况。当边际学术收益低到一定程度的时候,就会有人在依托熟悉领域的同时联系其他领域进行研究来寻求新的进展。这样的尝试一旦成功,新的跟进者又会出现。

第三个原因和社会科学研究技术的进展有关。当代社会科学发展的一个特点是获得了一些有锐度的分析工具,依靠这些工具,人们能够看到原来看不到的一些关系,或者能够更清晰地把握原来看到但看不太清楚的东西。我们可以举出几个已经在研究中发挥了显著作用的分析工具,包括:数理统计分析技术、网络分析技术、博弈论。这些分析工具的运用,使原来那种研究领域划分的有效性大打折扣。比如,统计分析技术的发展,使人们获得了更强大的手段来处理诸多社会领域中的数据,考察本来很难想到的一些变量之间的相关性,探讨它们之间的因果联系,获得新的发现;比如,网络分析技术使研究者能比较清晰地看到人们在一个领域中建立起

来的网络关系在另一个领域中发挥作用；比如，运用博弈论工具来研究策略互动过程和可行制度的形成，比较容易把博弈者来自不同领域的互动资源纳入分析并认识到制度的“多领域”复合特点。

第四个原因和解决现实问题的需要有关。解决社会问题的现实需要吸引着研究者的注意力，给他们以强有力的激励。在社会科学的发展中，就群体注意力而言，并不是在学术上令人满意地解决了一个问题以后才转向下一个问题。事实上，常常是在一个问题还没有得到满意解答的时候人们的注意力就转向了另一个问题，其间重要的动因是新的重要的现实需要出现了。有许多学术问题不是被解决的，而是被暂时搁置的，因此才有老问题在许多年后又被重新提起的现象。现实的需要对社会科学的发展来说是强大的动力来源。从当代社会中出现的一系列重要的社会现象以及其中蕴含的问题来看，是必须要把经济和其他诸多社会领域联系起来才方便研究的。我们不难开列出从宏观到微观的一个长长的问题清单，不过在这里，我们只需要列出几个大的问题就够了：全球化、传统社会主义国家的经济转型、拥有众多人口的新兴工业化国家的崛起、战略性资源的争夺和民族关系、经济发展和环境。面对这些问题，也许需要新的研究领域的划分来推进研究的专业化。

中国社会正处在迅速而巨大的变迁中。面对这样的大变迁，把经济和社会生活的其他诸领域联系起来研究实在是非常必要。而且，各个领域在变化中的相互作用为把社会诸领域联系起来分析提供了十分丰富的素材。当代中国是一个研究“经济与社会”的难得的“实验室”。

三、学 科 辨

和研究领域的交叉相联系，当代社会科学诸学科之间的互动大大增强了。其中，经济学和社会学之间的互动是特别为我们所注意的部分。

人们通常将加里·贝克尔在20世纪50年代发表的有关歧视经济学的研究作为将经济学的视角和方法扩展到传统社会学研究领域并开启这两个学科的现代互动的标志事件(Becker, 1957)，而将马克·格兰诺维特

在 70 年代发表的有关劳动力市场供需匹配中的人际关系网络的研究作为从社会学向经济学做相向运动,即把社会学的概念和分析框架用到传统的经济学的研究领域的标志性著作(Granovetter, 1974/1995)。近三十多年来,这两个学科之间的相互作用渗透到从理论到经验研究的诸多层面。在理性选择社会学、新制度经济学、新经济社会学、行为经济学、社会经济学中很容易看到这种影响的深刻印迹。

有必要指出,经过学科间的互动,今天的经济学早已经不是往日把自己的研究领域局限在与货币有关的交换上的经济学;今天和经济学互动的社会学,也早已经不是往日采取“剩余策略”即只研究经济学不研究的领域的社会学。对于今天承袭着新古典传统的主流经济学、新制度经济学、理性选择社会学、新经济社会学,与其将它们分别归入经济学或社会学,不如把它们看作是一般社会科学的不同流派。它们有各自不同的假设、概念、分析工具,但它们都以社会生活的所有领域作为自己的研究领域。

上述特征,回应了孔德、涂尔干把社会学看作是基础社会科学的理想。当年,被马歇尔等人认为可望而不可即的事情,正在成为现实。经济学和社会学的密切互动,“经济学帝国主义”也好,“社会学帝国主义”也好,预示着能否形成基础社会科学的疑问正在学术实践中被超越。有意义的问题是,不同的研究范式各自具有怎样的长处和不足。

经济学和社会学的互动,除了在学科关系方面引发出一些新的特点,如传统学科边界日益模糊、基础社会科学的不同学派的形成等之外,特别值得注意的是,已经产生并在继续产生一些有潜力的学术生长点(刘世定, 2001)。今天的经济学和社会学的互动,不仅在产生某种整合趋势,而且同样在激励多样化。收入本文丛的作品,都包含有在经济学和社会学的互动中探索新的学术生长点的努力。

参考文献

Becker, Gary. S., 1957, *The Economics of Discrimination*. Chicago and London: The University of Chicago Press.

贝克尔,加里·S., 1976/1993,《人类行为的经济分析》,上海三联书店、上海人

民出版社。

甘阳,1997/1998,《韦伯文选第二卷编选说明》,载于马克斯·韦伯:《经济、诸社会领域及权力》(甘阳编,李强译),三联书店。

Granovetter, Mark, 1974/1995, *Getting a Job: A Study of Contacts and Careers*. Chicago and London: The University of Chicago Press.

刘世定,2001,《经济学和社会学:来自关系史的思考》,载于乔健、李沛良、马戎主编:《二十一世纪的中国社会学人类学》,第173—194页,丽文文化事业股份有限公司。

马歇尔,1890/1981,《经济学原理》(陈良璧译),商务印书馆。

Swedberg, Richard. and Granovetter, Mark, 1992, "Introduction", in Mark Granovetter and Richard Swedberg [eds.], *The Sociology of Economic Life*. Westview Press.

前 言

本书的核心问题是用博弈论来对当前中国转型社会的市场秩序展开分析。

本书面临并试着完成至少如下五重理论任务:(1)最为基本的是,通过批判经典博弈论建模路径及其在面对现实经验分析上的不足之处,反思经典博弈论的缺陷,进而给出一个新的、能够容纳社会学一些重要关怀的博弈表述方式——镶嵌式博弈;(2)在填充一些重要的社会因素之后,形成镶嵌式的社会分化及秩序机制模型,并以此为理论框架,使纯粹逻辑形式的博弈论有助于经验性和实证性研究;(3)用这个分析工具从理论层面来剖析市场的分化、关联与秩序问题;(4)在现实层面关照中国社会转型(主要是市场化进程)中的市场的分化、关联与秩序的机制问题;(5)在以上探讨的基础上回应诸如层级制、制度变革、社会分化等实质性理论。

经典博弈论的每一个博弈模型的应用(也就是经济学对博弈论的应用)背后都有一个故事。在利用博弈模型对经验现实进行模型化并展开分析的时候,经典博弈论没有意识到任何可以抽象为一个标准的非合作博弈的现实博弈都是镶嵌在一系列合作的基础之上的。这意味着现实生活中能够用理论模型“相对孤立”并抽象出来的博弈能不能够顺利达成均衡、达成何种均衡,其分析不应仅仅限于能够数学化的标准博弈模型框架之内。就是说,面对现实生活,博弈论不应该仅仅满足于在数学形式上求均衡和博弈解。同时,在不能从数学上获得博弈解或均衡的时候就增加或变更前提假设来让博弈模型有解或有均衡,从是否有利于经验研究(特别是秩序剖析)的角度来说也是不可取的模型化思路。

镶嵌式博弈作为一种博弈表述方式,同时是一种分析策略。其主要命题如下:每个标准的非合作现实博弈都是镶嵌在一系列合作的基础之上的。如果博弈参与人不能在标准博弈中达成均衡以及解,或者博弈“出

错”，那么，至少存在其中的一个参与人会有动力通过“引入”或“呈现”另外一个层面的博弈空间，将原标准博弈镶嵌到新的博弈空间（乃至新的现实空间）中去，以实现自我支持的博弈结果。就是说，参与人有动力通过或更改自己的效用产品，或置换博弈框架，或变换博弈活动对象，来获取自己所欲的博弈解，更正“错误”，或在事实上接纳“错误”的结果。反之，也有可能有些“聪明”的博弈参与人通过设置一些标准的非合作博弈，让对方占据明显的好处，以获得标准博弈背后镶嵌着的“合作”。

镶嵌式博弈提出的过程也就是将博弈论向经验研究拉近的过程。本书以该分析策略为基础建构镶嵌式的社会分化及秩序机制模型，作为一种经验分析的理论框架。模型中引入了效用多元、有限理性、意义赋予、仪式、记忆、既有社会结构影响等等前提假设和现实因素。

带来效用的产品向量所对应的物质现实或者特定对象是市场的基础。本书所界定的广义的市场等同于市场空间概念：市场是围绕某类产品进行争夺的人类活动领域。基于效用产品的不同，我对市场进行了划分，并且在经验研究中考察了四类转型社会中存在密切关联和层层镶嵌的不同层次的市场：物品市场、要素市场、制度市场与注意力市场。

根据镶嵌式博弈的理论逻辑，结合对转型社会市场分化、关联与秩序的经验研究，可以得到一些有关市场秩序的见解。其中主要有：标准博弈的纳什均衡不一定对应着市场秩序；即使一级市场所镶嵌着的另一级市场是不平等的，只要该级市场的“策略型均衡”能够顺利达成——博弈参与人能够在博弈框架基础上（在不推翻博弈框架的前提下）形成联合自我支持策略组合，该级市场及其所镶嵌于其中的另一级市场就都能达成至少是暂时的秩序；均衡问题越是在靠近制度市场和注意力市场的领域中呈现，秩序问题就会越严重。

经验研究在理论应用方面也得出了一些实质性看法，比如说科层制的治理问题、贫富分化的机制问题、制度建设中要关注博弈地位的问题、市场化进程中的人际关系问题以及为人处世的问题，等等。

Foreword

The key problem of this book is analyzing the market order in the transforming China by game theory. There are at least five theoretical tasks we tried to finish: (1) The most basic one is to introduce a new representation of a game—the embedded-form by reflecting on the shortages of classical game theory on building models for social-facts. (2) To form a theoretical model of polarization of society and mechanisms of social order by the embedded-form game in order to make game theory be useful to empirical research. (3) To theoretically anatomize the differentiation, correlation and order of markets by using that model as an analytical tool. (4) To empirically research the differentiation, correlation and order of markets in the transforming China. (5) To reflect on the theories of bureaucracies (or hierarchies), the institutes changing, and the polarization of society basing upon upper analyses.

There is a story behind each game theoretical model. When using some kinds of game models to analyze social realities, the classical game theory didn't realize that each true story in our life that can be made into a normal-game model is embedded in sets of cooperation or several cooperative games. It means that the game-theoretic way for social science to use this knowledge shouldn't limit its analyses by the frame of the mathematic model itself. And the normal-form (or strategic-form) and the extensive-form as the only two representations of a noncooperative game are not enough for game theory. We couldn't change the game's situations by adding hypotheses in order to get a mathematic equilibrium, if we want to let the game theory be more useful for experiential studies.

In order to match game theory and empirical studies, this book carried out embedded-form as a new representation of a game and as a new analytical strategy for the whole research. The main propositions of it are as follows: (1) Each true story in our life that can build into a normal-game model is embedded by sets of cooperative games. (2) If the players can not get what they want in the frame of the game, they will change their goods of utility, or replace the game frame, or alter their opponents so that get they want. (3) On the other hand, some intelligent players also try to form a formal game as a “trap” to benefit their opponents in order to “buy” the “cooperation” behind the game.

Basing on the embedded-form games as a research strategy, this book proposed an embedded-game model of the polarization of society and social order as a theoretical frame of empirical study to the markets. Many sociological factors were involved in the model including: limited rationality, multi-utility, meanings making, rituals, and social memory, etc.

The outputs that can bring different utilities to players were taken as the basis of markets in this research, and the field of behaviors that competitors use to win some certain outputs was seen as a market space. I distinguished five markets according to what outputs that being disputed by players: the market of goods, factors, institutions, and attentions. Many propositions about the order of market were brought forward during this research.

目 录

引言 用博弈论来研究转型社会秩序	1
第一节 博弈论与实证研究:连接?	2
第二节 社会秩序问题:分解!	3
第三节 市场关联与秩序:一个实例	7
第四节 主题和框架	12

上篇 理论框架——博弈镶嵌与市场关联

第一章 博弈难题引出镶嵌式	21
第一节 共同知识难题:不同认知与博弈出错	21
第二节 怎么解决“出错”:两种方案	30
第三节 概率估计难题	35
第四节 可重复性难题:在什么层次上?	42
第五节 特例表述:博弈的镶嵌	47
第六节 结论:镶嵌式的动态呈现	50
第二章 均衡难定与效用多元	52
第一节 均衡难定的镶嵌式解决	53
第二节 效用、偏好及其变动	63
第三节 意义赋予“创生”效用带来约束	73
第四节 结论:镶嵌式的静态呈现	86
第三章 现实场景中的镶嵌式	89
第一节 相对地位的镶嵌	90

第二节	群体作为第三方的作用·····	94
第三节	信号、记忆与共同知识·····	106
第四节	程式化行为、仪式与博弈抢先·····	113
第五节	集体选择中的社会分化与秩序：一个机制·····	118
第六节	结论：镶嵌式的社会分化和秩序模型·····	127
第四章	镶嵌式与市场秩序机制 ·····	130
第一节	市场的界定：理论的视野·····	132
第二节	市场、市场空间及其关联：镶嵌式的视角·····	138
第三节	镶嵌式的“均衡”与市场秩序相对性·····	143
第四节	结论：镶嵌式的均衡与市场秩序机制·····	149

下篇 经验研究——市场化下的秩序

第五章	物品市场 ·····	156
第一节	早市空间中的博弈：几个例子·····	159
第二节	超市的票据、程式与交易秩序·····	172
第三节	早市：层级制底层的博弈镶嵌·····	178
第四节	小结：层级制底层的物品市场·····	191
第六章	要素市场 ·····	194
第一节	土地使用权的归属：拆迁中的博弈·····	194
第二节	金融的空间：分野还是分化·····	210
第三节	小结：要素市场与转型期的政府权力·····	224
第七章	制度市场 ·····	226
第一节	收容遣送办法的变质与废弃·····	227
第二节	制度选择的博弈：北大教改逻辑之争·····	234
第三节	小结：转型社会的制度和制度选择·····	255

第八章 注意力市场	258
第一节 注意力转向与心理秩序	260
第二节 从自我调适到群体支持	263
第三节 注意力经济与社会变革	265
第四节 小结:注意力分化与社会秩序	269
第九章 结论与讨论:转型、市场关联与社会秩序	271
第一节 核心问题:用博弈论进行一项经验研究	271
第二节 基础理论:镶嵌式作为一种博弈表述方式	276
第三节 理论应用	282
第四节 现实关怀	288
附论 实质主义与形式主义的契合:经济社会学方法论的 一个脉络	292
参考文献	310
致谢	318
后记	319

引言

用博弈论来研究转型社会秩序

“社会秩序何以可能”，一直是社会学面对的最为主要的现实问题。近代社会学一个半世纪的历史中，几乎每一个进行社会学研究的人，在将理论热情倾注于这个学科中时，都直接或者间接地就这个问题提出过自己的观点。而从数千年学术研究的历史来看，无数的哲人和思想家也都从未忽视过该问题。面对如此浩瀚的文献和思想的累积，后辈学人似乎没有必要在这个领域里面凑热闹了。

不过，身处目前中国市场转型和改革攻坚阶段的历史时刻，我们在“社会秩序何以可能”这个问题上，根据具体情境和运用新的研究工具也许能够看到一些新的东西。所谓具体情境指的是，在庞大的层级体系（科层制理想型的现实对应）下，我们这个计划主导资源分配的国家中自下而上一个个市场的出现；而所谓新的研究工具主要是博弈论以及一些社会互动理论。

虽然本书的具体问题在理论的宏大层面会指向“社会秩序何以可能”，但是本书并不试图去笼统地建构“如此做就能实现社会秩序”的理论，而只是从小处着眼，来明确社会秩序建构中的一些环节问题。这不仅有利于我们在实际中找到经验证据和材料；而且对这些环节性问题的详细解剖，常常能够让我们看到原来不曾留心的东西。

根据哈耶克的理解，刻意地建构社会秩序几乎是不可能的。因为哈耶克所特别看重的“人类合作中不断扩展的秩序”，“并不是人类的设计或意图造成的结果，而是一个自发的产物”，并且有一个进化选择和传播的过程（哈耶克，1988/2000：1）。“刻意地建构社会秩序”虽然不可能，但是像哈耶克那样承认人类理性的边界，进而明确一种“社会秩序理论”仍然是可能