第一图书网, tushu007.com

<<经济机制设计>>

图书基本信息

书名：<<经济机制设计>>

13位ISBN编号：9787543215795

10位ISBN编号：7543215799

出版时间：2009-4

出版时间：上海格致出版社

作者：赫维茨

页数：417

译者：田国强

版权说明：本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问：http://www.tushu007.com

内容概要

本书是2007年度诺贝尔经济学奖得主赫维兹的主要著作，重点介绍了机制设计理论。
这是由赫维兹本人最早提出的一个概念，主要目的是要解释何种制度或分配机制能够最大限度地减少经济损失。
作为一个重要应用领域，这一理论为最优贸易政策研究提供了重要理论依据。
本书认为，良好的机制设计可以保证机制的有效运行，节约资源，促进社会经济的持续发展。
本书主要介绍信息有效、分散决策的经济机制的设计方法。
我们为机制设计者提供一套系统的方法，使得机制设计者根据委托人（可能是个人或政府）各种可能的既定宗旨、目标，设计制定出可以实现委托人目标的信息有效和分散决策的机制。
本书感兴趣的问题涉及分散决策或隐私保障。
对于这些问题，定义域X是集合的笛卡尔积，对F的上述分解就不是尊重隐私了。
为获得尊重隐私的F的类似分解，我们就必须使用在F定义域的乘积结构。

作者简介

利奥尼德·赫维茨（1917—2008），2007年诺贝尔经济学奖获得者，美国明尼苏达大学经济学讲座教授。
赫维茨教授在经济理论特别是机制和制度设计、数理经济学等领域的先驱研究举世闻名，享有“机制设计理论之父”的赞誉。

<<经济机制设计>>

书籍目录

出版前言译者序致谢前言1　机制与机制设计　1.1　机制与设计　1.2　环境与目标函数　1.3　机制：信息交换空间和博弈形式　1.4　初始的信息散布与隐私保障　1.5　机制设计　1.6　基于瓦尔拉斯均衡阐释的机制设计　1.7　信息有效概念的初步讨论　1.8　国家森林2　从目标到工具：构建机制　2.1　第一阶段：机制构建　2.2　第二阶段：从参数指标化的乘积结构构建分散决策机制：趋向信息指标化的乘积结构　2.3　利用“标杆法”构造划分的光滑截面　2.4　分析工具　2.5　重叠　2.6　信息效率3　使用集合语言设计信息有效的机制　3.1　引言　3.2　机制设计　3.3　机制与覆盖　3.4　构造rRM覆盖的系统方法（算法）　3.5　从截面法（TM）的覆盖构造机制　3.6　覆盖和划分　3.7　信息有效性　3.8　重访1.9节：图形表述　3.9　策略性行为　附录　划分的特性4　显示机制　4.1　引言　4.2　初始的集合论构造　4.3　拓扑情形　4.4　证明与例子参考文献

章节摘录

1　机制与机制设计

本书的目标，就是为设计能实现特定目标的分散决策经济机制提供一套系统方法。
首先，我们不是很正式地讨论一般性问题和我们的处理方法。
（分散决策）机制就是希望表示组织协调经济活动的系统的规范实体。
从家庭、企业到政府机构或整个国家，各种不同层次的经济组织都可能需要组织协调经济活动的机制。
我们将在几个不同层次上讨论经济机制的部分事例。
经济活动划分为生产、消费和交换等。
不同的经济活动都受到资源可用性和技术可行性的制约。
资源可用性和技术可行性构成经济环境的一部分。
换言之，在任何时刻，经济环境都因自然条件或过去的积累而外生给定。
资源约束和技术可行性的信息通常散布于经济人之间。
于是，没有一个经济人或其他经济实体能够完全知道技术可行或不可行的全部信息。
经济人具有各自独立的偏好。
通常，不仅将经济人的偏好解释成私人信息，而且也认为经济人的偏好是外生给定的。
经济人的偏好有双重作用。
一方面，经济人的偏好赋予个人行为的动机，成为经济环境的组成部分；另一方面，经济人的偏好也影响经济效率准则的确定，从而影响经济活动目标的界定。
新古典经济理论，特别是一般均衡理论，认为经济效率的常规概念是帕累托最优。
然而，帕累托最优是一个相当弱的要求，许多场合的经济活动的目标体现为比帕累托最优更强或至少与帕累托最优稍微不同的要求。
经济活动发生于一系列制度及其安排、法律框架、习俗、正式组织和不太规范构型等背景之中。
从相对简单的、非正式的微妙协议，到非常复杂而规范的构型（structure），经济活动的背景一应俱全。
我们将规范的构型称为机制。
类似美国那样的现代发达国家的经济活动还包括生产、消费和交换以外的活动。
通常，人们获取收入等大量认为属于经济活动的活动自身都涉及创造或运行机制的活动。
创造或运行机制的活动包括获取信息、处理信息和与其他人之间的信息沟通。
用于这些活动的资源就不能用于生产或消费。
因此，机制的评价就不可避免地需要考虑机制存在并起作用所需要的制度设计、运行和维持的现实成本。
新目标和为实现这些目标所需要的机制不断得以设计，如美国的国会或其他立法机构的立法就相当于设计新机制。
通常，出现这些新机制的原因或是现行经济体制或制度的某些方面不尽如人意，或是人们希望构建一套自认为对已有益的体制的努力。
例如，一般是大量农户为城市提供牛奶，大量农户共同构成城市的供奶站。
芝加哥的奶站主要由来自伊利诺伊、爱荷华和威斯康辛州的奶农构成。
早期进入芝加哥的牛奶很可能会感染结核病菌。
对于是否要求农户对牛群进行结核病检查并剔除感染了结核病的奶牛，多年来一直存在着公共政策争论。
要求预防接种也是一个政策问题。
现代干净的奶站都生产不掺假的牛奶，但同时也有大量小型的牛奶生产商出售劣质的掺假牛奶，出售劣质牛奶的生产商没有净化产品的动机，直到法律和检查部门要求他们净化产品为止。
清除结核病的奶牛最终能改善牛奶饮用者的健康和福利，但对奶牛的检疫和清除病牛也损害了相应农

户的利益。
检疫和清除工作不能用帕累托最优作为依据，预防接种也一样。
最近，公共健康和生活质量的问题迫使国会提出类似“清洁的空气”和“洁净的水”等官方的新目标。
为实现这些目标，政府还增设了相应的机构。
通常，尽管机构设置的立法使用的概括性语言对该机构实现既定目标的方式有所规定，但不是非常明确。
经济理论知识和经济分析经验对任何一个面临机制设计问题的人都有所帮助，但经济理论迄今还没有为公共健康和生活质量的机制设计提供特别具体的指导意见。
在过去的几十年间，经济理论解释了环境信息分散于经济人的事实的具体含义。
他人无法观察获得的、一个经济人知道的重要信息诱发信息所有者产生利用这些信息的动机。
现在，存在许多研究分散决策信息（非对称信息）引起的策略性问题的理论。
策略性理论运用博弈（gameform）模型化机制。
目标函数给出理想的结果（策略性理论的文献有时也将目标函数称为社会选择函数）。
目标函数规定对应各种可能环境的理想结果。
若（在给定环境下）博弈的（纳什或其他）均衡与既定目标函数设定的结果相一致，则我们就认为通过特定博弈的博弈均衡解实施既定的目标函数。
因此，根据国会立法而委任实施特定目标函数的机构所面临的任务，就是设计一个能实施该目标函数的博弈。
仅要求均衡与目标函数设定的结果相一致还不够，还必须要求博弈具有可行性，即机制所需要的信息任务对所有人（包括机构设置者）必须是切实可行的。
例如，若机制运行需要经济人或机构对信息的观测、沟通或其他信息处理过程的数量无限大，则该机制显然没有可行性。
实际上，需要超过机制运行的可用预算的机制也没有可行性。
略微不同的说法是，机制运行的预算经费太少就不可能实施预定的目标函数。
实施理论文献讨论的许多机制的问题都需要传递巨大的信息量和使用极其复杂的策略。
至少可以这样说，实施理论涉及的机制设计的结论在指导实际应用方面的重要性至少还不清晰。
不了解实施既定目标函数的博弈所需要的信息量，实施理论的应用性就值得怀疑。
直观和已经正式证明的结论是，对于既定目标函数，在经济环境的信息分散而经济人又没有策略性地利用其私人信息时，与机制相关的信息成本就提供了实施该目标函数所需要的信息量的下界。
实施过程需要的其他成本是为实现激励相容而发生的信息成本。
可能正好出现以下情形，在某种意义上，使用不是完全激励相容但信息有效的机制的做法更有益。
在某些场合，我们需要权衡经济学尚未计算的信息成本与激励成本。
除上述已经提到的问题外，实现既定目标的机制设计过程也有些特别。
我们希望存在设计实施既定目标函数的分散决策机制的系统方法。
根据上述的机制设计思想，从经济人不采用策略性行动的假定出发设计分散决策机制是研究机制设计的系统方法的很好起点。
若根据经济人不采用策略性行为的假定证明得到：任何可以实现既定目标的机制都需要无限的资源，则毫无疑问地可以知道，在经济人采取策略性行为时，就更不可能实现既定目标。
我们开始就说明的目标是，在经济环境的信息分散于经济人的场合，我们可以提供一套系统的机制设计方法，使得我们设计的机制所实现的结果与既定目标函数所设定的结果相一致。
此外，我们还要求设计出来的机制具有信息有效性。
稍微不同的说法是，我们提出的“算法过程”或“机器”的输入是经济人集合、可能的环境集合、经济人拥有的经济环境的信息的分布及作为理性行动结果的目标函数等，其输出是信息有效的分散决策机制。
对于属于既定环境集的任何环境，输出的信息有效的分散决策机制的结果都与对应该环境而设定的目标函数的结果相同。

本章试图利用不太规范但直觉的方式解释机制设计的步骤及其使用的概念。
因此，我们在本章尽可能地讨论简单的机制设计问题，并最低限度地使用技术工具。
我们首先讨论古典福利经济学的问题，再在1.8节分析讨论出现于政治经济学背景的机制设计问题。
具体事例是政府管制国家森林。
我们运用到第3章涉及的集合论语言分析国家森林的事例。
属于引言性质的第1章仅直观地而非正式地讨论国家森林的机制设计问题，3.8节将非常正式地分析国家森林的机制设计问题。
1.1　机制与设计　　从整个国家到单个企业或家庭等很小的经济活动单位都可能面临“如何组织经济活动”的问题。
无论经济活动的范围大小，只要经济活动涉及不止一个经济人，关于经济环境的关键信息散布于经济人之间的事实成为经济机制设计问题的根源所在。
若只有一种组织方式，就没有选择问题。
然而，我们知道治理和调节经济活动的制度、法律和非正式协议等都随时间、空间和经济活动类型的变化而变化，从而可能存在多种组织经济活动的制度。
为从各种可能的制度中理性选择制度，采用的分析方法不仅要求能够描述不同机制的表现形式和运行特征，还要求提供不同制度的比较准则。
我们最熟悉的体制或机制是市场机制。
对于市场，明确描述调整过程的典范是瓦尔拉斯动态调整过程。
瓦尔拉斯动态调整过程已经成为解释在完全竞争市场的价格如何实现均衡的基本工具。
瓦尔拉斯动态调整过程的稳定性也得到了广泛的研究。
即使在新古典经济学框架中，也有很多原因使得经济学不能局限于动态调整模型。
第一，存在着行为合理性的问题。
第二，对于许多存在完全竞争均衡的经济环境而言，依据瓦尔拉斯调整过程的价格调整过程并不收敛于均衡，即使局部收敛也很困难。
第三，部分经济环境可能不存在竞争均衡（例如明显存在商品的不可分性时）或不可能存在竞争均衡（例如存在规模报酬递增时）。
第四，部分经济环境的竞争均衡可能不是有效的（例如出现商品的不可分性、外部性或公共物品时）。
此时，瓦尔拉斯调整过程不能得到令人满意的结果。
第五，即使瓦尔拉斯调整过程确实收敛于有效的（瓦尔拉斯）竞争均衡，但瓦尔拉斯竞争均衡导致的资源配置也可能不能满足公平性或者为部分人提供最起码的生活保障等其他方面的目标要求。
尽管人们早已认识到瓦尔拉斯机制的不足，但几乎对于各种瓦尔拉斯机制的不足都存在类似基于税收的社会保障或转移支付等政策形式的“补救措施”。
部分学者研究非古典经济学环境的竞争机制失灵的补救措施，具体提出规模报酬递增的边际成本定价、伴随公共物品的经济的林达尔定价及对有害外部性的庇古税和市场化的污染权等，而且相应模型的稳定性都优于瓦尔拉斯调整过程。
很多场合，为机制设计问题提出的解决方案都存在着严重缺陷或不足。
这个事实在实践中通常诱发不断为改善机制绩效的修改努力。
机制的修改过程通常导致日益严重的官僚化和决策的集中化。
通常，基于官僚化和决策集中化解决问题的制度最终需要很高的信息处理和规则实施成本。
经验表明，我们应该区分两种目标：　　·有些目标适用于（我们想要的）机制结果（我们将知道，这些目标可以用目标函数表示）；　　·有些目标与机制运行相联系，例如信息处理和沟通成本（这些目标不能用目标函数表示；通常，可以通过不同的方式和不同的成本实现相同结果）。
其他比较重要的问题就是激励相容问题、行为规则的实施成本，及实施博弈规则的成本等。
……

版权说明

本站所提供下载的PDF图书仅提供预览和简介，请支持正版图书。

更多资源请访问:http://www.tushu007.com