

关照现实的非数理博弈理论

□毛志辉

冯·诺依曼和摩根斯坦是博弈论当之无愧的开创者。1928年,冯·诺依曼证明了博弈论的基本原理,从而宣告了博弈论的诞生;1944年,冯·诺依曼又与摩根斯坦合著了划时代巨作《博弈论与经济行为》,将二人博弈推广到N人博弈结构,并将博弈论应用于经济领域,从而为这一学科的发展奠定了基础。然而,真正将博弈论发扬光大并对现实社会产生重大影响的,却是托马斯·C·谢林。

传统的主流经济学沿着完全信息理论和数学表达的两条基本途径发展,就不可避免地会陷入理论推演的结论严重偏离现实的困境。与以纳什、豪尔绍尼、泽尔腾为代表的经济学家坚持采用数学语言和公理性的方法来进行研究不同,谢林以迥异于数理化的博弈论范式的研究思路独辟蹊径,发展了一套“直面现象”的非数理博弈理论。他尝试将博弈论从对相互影响的结果的艰辛晦涩的数学分析,变成通俗易懂、易于被大众接受普及的语言故事,并借此为许多重大的现实问题提供解决路径。

谢林发表于1984年的著作《选择与结果》,虽然算不上是他的代表作,但却深刻表明了他在博弈论研究中视野宏阔、纵横捭阖、关照现实的底色,同时也鲜明地体现出他研究的宽度。他毕生最为人们所称道的研究领域虽然是以军事战略和军备控制为主,但他的研究触角却广泛延伸到政治学、社会学及国际关系等公共领域,并且都有着切实的应用,以至于几乎从能源问题、种族隔离制度、犯罪行为到温室气体排放问题等,都被他“大包大揽”下来。

这部作品收集了谢林在1965—1984年间所写的十五篇重要论文,主题涉及经济分析与政策伦理学、命令与控制、道德与自我控制、死亡之际的策略关系、经济学与犯罪集团、策略分析与社会问题、压缩军费的策略、关于恐怖主义的思考、作为消费器官的大脑等,论题纷繁复杂,论述也精彩纷呈,足以引起读者的阅读兴趣。如关于命令与控制的讨论中,以企业社会责任为切入点,详细谈了劫机事件发生时的责任危机问题;关于经济学与犯罪集团的讨论中,涉及了赌博、敲诈、堕胎、走私等问题;关于策略分析与社会问题的讨论中,则分析了非暴力手段、药物控制、淫



秒图片邮购等问题。

谢林总是对那些无法被理性行为理论充分解释的现象和案例充满热情,力图将博弈论尽量扩展,使其可以考察现实世界的各种行为,并尝试采用独特的分析方法加以考量。这也是他迥异于主流经济学家之关键所在。而他对那些严肃问题的轻松“调侃”,又为他的作品平增魅力。如对人的大脑的讨论中,他不仅谈到了催眠术、恐惧症、白日梦,而且作了一个好玩的尝试,试图说明大脑除了是一个解决问题的设备,更是我们一个消费者。他还如此设问:我们是在心灵的帮助下体验人生,还是我们的心灵在我们的帮助下体验人生?恐怕真的没有人知道是谁在掌控这一切。

在这部著作中,谢林还完整地阐述了自

我控制理论。他从关注多个参与者之间的博弈转向“自我博弈”,即“以自己为对手”的博弈。他试图通过这一理论来回答什么是理性、人是如何控制自己行为的。谢林认为,每一个自我都有自己的需求与欲望,他们受一个时刻存在的“超级自我”的监督,这个“超级自我”是总的管理者与裁判者。自我管理不是单方面的行为,它发生在社会环境中,人们正是因为社会安排的缘故才在自我管理的过程中得到促进或是受到阻碍。比如一个戒烟的人会看到自己告别恶习而重获自由,还能拥有更健康的身体和更长的寿命,而他的配偶、子女、父母双亲和友人也能够摆脱吸烟的影响,他或许就会实施自我控制。

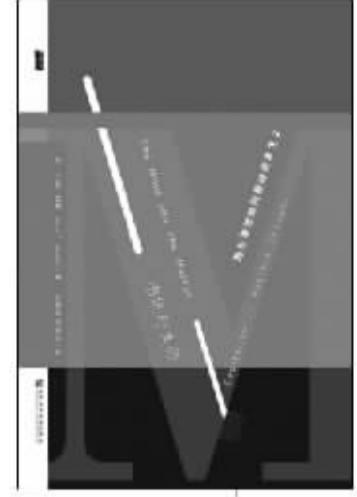
谢林观察到,在日常生活中人们喜欢自

我欺骗以使自己做应该做的事情,或者避免去做一些不该做的事情,比如抽烟、喝酒,缺乏锻炼和储蓄不足等。他认为,人们有时好像不是单一个体。他假设存在三个“我”或三个“你”。其中一个告诉自己,只要不吃午餐、不看喜欢的节目或是周末不去滑雪,就可以晚睡并省掉健身计划;或者答应另一个自己只要每天都早起就可以看五局电视棒球比赛。他把自我控制问题引申到多个“自我”的斗争之中,那么,如何妥善解决这种斗争呢?谢林提出,可以由足够诱惑力的奖品或惩罚来诱使预期希望的行为出现,或者闭着眼睛关掉“某人”。在一个完全的消费者行为模型中必然会涉及预期的自我控制分析,谢林所阐述的自我控制理论,不仅构成了他毕生的三大理论成就之一(另外两大成就是“讨价还价和冲突管理理论”、“相互依存的选择和行为理论”),而且还成为了委托代理理论的重要来源。

谢林曾经说过:“如果你要研究某个理论或者发展某个概念,如果你认为这个理论或概念将促进人们对现实世界的理解,那么就请发明一些浅显易懂的概念。”正是遵循这种思想,他发明了许多原创的概念来充实其博弈理论,也使得他的博弈论研究具有广泛的经世致用价值。对于当下的中国而言,在构建“五位一体”总体布局和“四个全面”战略布局的政策导向上,如何让人们真正形成创新、协调、绿色、开放、共享的发展理念,妥善解决贫富差距、城乡差距以及局部的利益冲突等问题,谢林的理论是具有较强借鉴意义的,在政治和经济外交战略选择上也具有一定的参考价值。

很多人认为谢林是经济学家、社会学家或国际关系学家,有人甚至认为他是核战略学家,其实这些说法都不太准确。作为一位凭借非数理博弈论的研究和应用在多个领域都取得了杰出成就的大师,我们着实很难定义谢林确切的学者身份。他的研究方式及侧重点与主流的博弈论学者是那样的格格不入,而他所取得的成就又是那样的拔萃突出,最终极大地完善、丰富和发展了现代博弈论。虽然谢林迟至2005年(其时他已是耄耋老人)才与罗伯特·奥曼一道分享诺贝尔经济学奖,但他无疑是20世纪最杰出的社会科学家之一,他自身也已成为学界一段非凡的传奇。

■ 新书快递
市场与大师

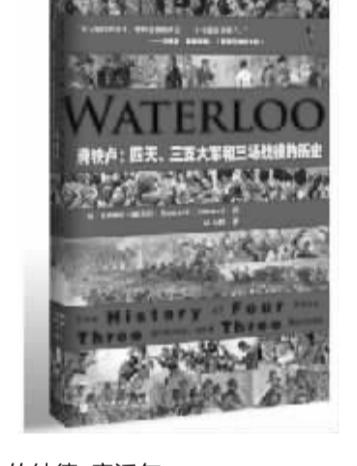


作者:杰瑞·穆勒
出版社:社会科学文献出版社
内容简介:

资本主义从来不是单单是个经济学议题。哲学家、政治家、诗人和社会科学家几个世纪来一直不断地在争论资本主义的文化、道德和政治影响,百花齐放。《市场与大师》是关于资本主义思想在西方意识形态中如何形成的一本精彩历史书籍。历史学家杰瑞·穆勒广泛地研究了意识形态中资本主义思想产生的作用及其未来影响,他的研究范围包括霍布斯、伏尔泰、亚当·斯密、埃德蒙·伯克、黑格尔、马克思、马修·阿诺德,以及二十世纪共产主义和新自由主义知识分子。这是一本关于资本主义思想史的引人入胜且通俗易懂的好书,这些思想在我们的日常生活中不断地被赋予新的意义。

作者简介:
杰瑞·穆勒,美国华盛顿天主教大学历史学教授。其著作包括《另一个失败了的上帝》、《亚当·斯密在他的时代和我们的时代》和《保守主义》等。

滑铁卢



作者:伯纳德·康沃尔
出版社:社会科学文献出版社
内容简介:

这是一个激动人心且扣人心弦的故事,讲述了英雄业绩和莫大悲剧,以及裁定欧洲命运的最后战役。

伯纳德·康沃尔融合了绘声绘色讲故事的高超技艺和一丝不苟的历史研究,叙述了每一个引人入胜的瞬间,从拿破仑逃离厄尔巴岛,到三场战役的硝烟与鲜血,乃至战役的后续。通过引用拿破仑皇帝、威灵顿公爵和普通官兵的书信与日记,康沃尔栩栩如生地呈现了参加这些著名战役是怎样一种体验。他对这些战役的详尽理解和生动描绘也清晰地展现了这四天的跌宕起伏。在这部历史中,有很多至关重要的决策,双方都有展现出惊人勇气的时刻,战局难测,直到惨痛的结局。

作者简介:
伯纳德·康沃尔,畅销书作家,著有极其成功的“沙普”系列小说(以拿破仑战争为背景)、斯塔克”编年史、军阀”系列小说、“圣杯”系列小说和“武士”系列小说,以及独立的战争历史小说《阿金库尔》和《要塞》。

过你想过的生活



作者:泰勒·本·沙哈尔
出版社:中信出版集团
内容简介:

在现代生活中,每个人都疲于奔命,为工作、为家庭、为各种琐事忙得焦头烂额,我们很少有时间能够静下心来细细品味生活中的幸福,而是常常感到力不从心、压力甚大……作为积极心理学领域的权威专家,泰勒·本·沙哈尔继超级畅销书《幸福的方法》后,带来了这部力作。

沙哈尔博士认为,人生是由大大小小的选择构成的。我们只有做出正确的选择,才能获得真正的幸福。这些“选择”不仅指重大的人生选择,而且包括生活中那些细微的貌似不起眼的选择。作者通过阐述101个简单实用的方法,帮助我们主动寻找并创造人生中的各种可能性,同时打破自己的思维定势,改变固有的思维模式,为我们的生活带来意想不到的积极改变,从而拥有真正的幸福。

作者简介:
泰勒·本·沙哈尔,哈佛大学心理学硕士、哲学和组织行为学博士,著有畅销书《幸福的方法》。他目前致力于个人及组织机构的优势开发、领导力提升等研究工作。

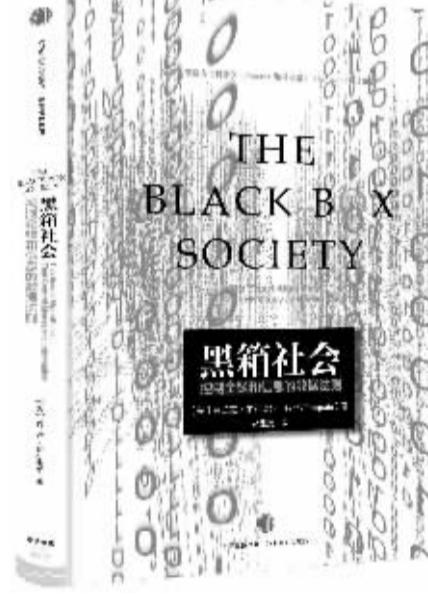
谁制造了信息时代的黑箱

□赵青新

近年来,大数据分析的话题很热,人们越来越意识到大数据的好处。但同时,科技的双刃剑效应再次显现。我们不知道自己有多少信息被记录了,这些信息会传播到哪些地方,有些人或组织会分析、利用这些信息,依据这些信息作出的判断是否准确,是否会产生歧视或者错误的结论,假如这些信息泄露可能会产生怎样的后果?

美国信息权威学者弗兰克·帕斯奎尔出版了《黑箱社会:控制金钱和信息的数据法则》一书,他决心打破这种神秘的黑箱运作机制。该书在2015年初被世界知名科技刊物《自然》(Nature)和《科学》(Science)先后推荐。帕斯奎尔的对手都很不简单:搜索引擎、金融巨鳄和政府。他采取了循序渐进的策略,首先提出警告,然后要求“知情权”,接着分析数据失控时代的网络信誉,重头戏是针对三个对手发起的“有理、有力、有节”的攻击,最终落实到建立一个“可被了解的社会”。

针对金融界主要两个方面:非法服务过程中的欲盖弥彰,以及由复杂所致的不透明性。这两种情况给了金融公司内部人士充分的机会来牟取私利和任意妄为,而公司通过复杂、神秘的计算程序隐藏风险的做法,就如同埋下的地雷终有一天会引起连环的剧烈动荡。回望2008年的次贷危机,我们不能不同意作者的看法。各大银行、金融公司对于账面利润的盲目追求,次贷市场、债券及其金融衍生品越来越复杂,甚至连专业人士都不清楚那些复杂的债券的内涵,更勿论洞察其中隐藏的危险。豪伊·许布勒,摩根士丹利的明星债券交易员,最终以90亿美元的巨亏,刷新了华尔街历史纪录。为什么一个席位就能亏掉90亿美元?



书名:《黑箱社会》
作者:弗兰克·帕斯奎尔
出版社:中信出版集团

什么没有人发现许布勒即将犯下的错误?这场危机无情地剥下了金融精英闪亮的外衣,裸呈出内在的苍白、软弱、保守,以及贪

婪。长久的合作和利益勾连,早就稀释了评级报告的权威性,漂亮的账面信息掩盖了背后隐藏的危险。金融黑箱仿佛潘多拉魔盒,终有一天会被打开。

“阳光是最好的杀毒剂”,如作者所说,“我们可能无法阻止信息的收集,但我们可以限制它的使用方法”。搜索记录曾经给一个找工作的德国姑娘造成了不小的麻烦,她仅仅因为浏览过不良网站而被默认辨别为特殊行业从业者,这一类过错不应该成为永久的困扰,所以作者提出的追踪数据源的建议是很必要的。数据库中的错误数据一旦扩散,目前几乎是无法控制的,作者提出建议,当有公司建立个人信息档案时,当事人应当拥有审核和更正的权力,如果发现错误就提请更正,正确的数据可以通过链接传输给数据库的后续使用者。目前全世界还没有这项技术,基于这一工作的庞大和复杂性,没有数据操控商有意向去做,而这就是政府必须发挥的职能,应该通过法律强制规定以保护公民的隐私。

很显然,作者将打破黑箱的希望寄托于政府,通过黑箱的危害性的展示来唤醒民众,并且提请互联网企业和金融界规范自身的行为。这是一种可行方案,开放式的信息应用或许会带来一种多边共赢格局,我们对此拭目以待。

IPO的梦想与浮沉

□张鹏

我们有必要对新股发行制度的变革进行一番审视,不仅要比较出注册制和审核制两者的优劣,更重要的是看清未来市场发展的方向和出路。由王骥跃和班妮这两位资深投行人士编著的《梦想与浮沉:A股十年上市博弈(2004—2014)》一书带我们直入投行一线,既有翔实而精到的IPO案例分析,也有对资本市场制度建设的深刻反思与独到建言,严肃性和可读性相得益彰,让人读来为之侧目别有新得。

作者缘何要从2004年说起?皆因这一年是中国资本市场制度建设过程中的重要一年。中小板开板、保荐制度推出、询价制度改革试点等各项制度,打下了此后十年A股市场的重要基础。“之后十年证券市场的制度发展和政策演变,大多是在2004年相关制度基础上的修补和完善。”这本以编年体案例的写作方式精选了2004—2014年60余个IPO案例,仔细梳理和深入解读了IPO过程中可能遇到的种种问题及成因。尽管作



书名:《梦想与浮沉:A股十年上市博弈(2004—2014)》
作者:王骥跃 班妮
出版社:机械工业出版社

者直接参与过的案例非常有限,但每个案例背后上市公司的命运都是中国经济和A股市场光荣与浮沉的折射。“我们站在2015年审视当下中国资本市场,会发现包括发行限价指导、发行审核过长、发审制度受到质疑、IPO募集资金规模和投向的设计存在问题、上市后企业反而走下坡路等种种问题,中国资本市场虽然建立了一系列制度规范,但一些深层次的问题和矛盾至今尚未找到很好的解决方案。”

从我国新股发行制度的发展脉络来看,从早期的行政主导的审批制到2001年以来至今的核准制,再到全国人大已经授权未来将要实施的注册制,新股发行的市场化方向更加明晰,这也是我国资本市场制度建设的总体方向和目标。作者认为,核准制的核心是监管部门进行合规性审核,强化中介机构的责任,加大市场参与各方的行为约束。正是在核准制问题越来越多、没有取得预期效果的情况下,注册制的呼声才日渐高涨。作者认为,注册制的出现有其必然性。首先,A股容量今非昔比,对新股的接纳程度大幅提升

高。其次,实行注册制也是中国经济转型的需要,新兴行业需要上市融资支持。最后,实行注册制也是政府简政放权、转变职能的需要。“按照目前公开披露的信息,注册制将实行监审分离,IPO的具体审核由交易所完成,证监会将工作重点转向对IPO的监管。”

需要指出的是,我国A股市场限于投资者结构以散户为主、价值投资理念尚未普及、政府监管能力和法治水平等原因,呈现出投机相对过重、市场波动较大等特点。尽管经过2015年以来股市波动的教训,注册制目标和预期更加明确,但这个改革的过程将注定非常曲折,需要监管层在认真考虑A股市情、遵循市场规律的前提下,以更强的定力去推动市场和法治建设,明确市场预期、平滑市场波动。站在当下的时点上,王骥跃和班妮两位作者所做的工作自然更加富有意义。《梦想与浮沉:A股十年上市博弈(2004—2014)》这本书既是对核准制的存疑和告别,也是对注册制的祛魅和呼唤。愿中国A股包括注册制在内的市场化改革的短痛更短、长利更长。

作者简介:
泰勒·本·沙哈尔,哈佛大学心理学硕士、哲学和组织行为学博士,著有畅销书《幸福的方法》。他目前致力于个人及组织机构的优势开发、领导力提升等研究工作。