

经济体制转型策略的决定机制 与内在逻辑

——激进与渐进转型策略的回顾与再思索

靳 涛

(厦门大学经济研究所)

【摘要】 从计划体制向市场体制的转型，对经济学本身的发展和演化带来了巨大的变革和影响，转型方式和策略的争论也持续了相当长的一段时间。本文在对转型策略争论回顾的基础上，认为从计划体制向市场体制的转型方式取决于原计划体制内部的利益冲突和矛盾积累程度。本文明确提出转型的激进程度取决于原计划体制内部的矛盾积累程度。

关键词 转型 策略 决定机制 再思索

中图分类号 F202 **文献标识码** A

The Decision Mechanism and Inner Logic of Transition Tactics

Abstract: The transition, from planning system to market system, have changed the economics itself greatly. It has been lasted for a long time for debating about the transition strategy. The text regards that transition tactics depends on conflict degree within the planning system, and the intense degree of transition depends on accumulating degree of contradiction within the planning system.

Key words: Transition; Strategy; Decision Mechanism; Thinking Again

一、激进与渐进的实施逻辑

就计划体制向市场体制转型的策略和方式来看，转型之路主要有目前大多数学者争论的渐进式转型和激进式转型。激进式又称为“大爆炸”方式或“休克疗法”；而渐进方式又称为“多米诺骨牌”效应。两者的主要区别是激进式强调转型是一次完成的，“跨越深渊不能用两步”。该转型方式的支持者认为，转型是经济体制一次全面的和一次性的转变，由于各种因素和自制度的互相关联，所以，一次性彻底的转型是效率最高的。而渐进式转型的支持

者则强调经济转型是市场体制逐步取代计划体制的过程。由于市场体制的建立和发育需要一段时间，而且人们的思想和认识也需要一段时间的学习和适应，所以，转型应该逐步推进、步步为营，这样才能取得较好的效果。激进式方案要求一个国家整体性一次完成转型，而渐进式则提倡先在部分地区试点，在试点成熟的基础上再转向其他区域。

1. 激进式转型方式实施的依据

激进式转型的目标是通过一场迅猛的改革潮流，用市场经济的雏形来取代中央计划经济。这个转型方式的依据主要来自于著名的“华盛顿共识”，在该“共识”的指导下借助一系列以稳定货币和宏观经济、迅速放开物价和市场、加快汇率改革与国际社会接轨、加快私有化进程、改革法律体系、税收体系、金融体系和政府设置等一系列改革来达到快速向市场转型的目标。

激进式转型（“休克疗法”）的倡导者美国哈佛大学的经济学教授杰弗里·萨克斯认为，在社会主义国家从计划体制转向市场体制的过程中，由于计划体制下的短缺经济特点，在放开价格和市场以后，这些国家出现通货膨胀是难免的，他依据其在南美洲对付恶性通货膨胀的经验，以货币主义理论为指导，认为在理论上采取“快刀斩乱麻”的思想，可以较快地彻底解决这一问题。萨克斯由于其在南美创造的“玻利维亚奇迹”，使得其在国际上声名大振。1989年萨克斯被波兰团结工会政府聘为波兰政府经济顾问。当时波兰的经济形势不断恶化，商品短缺，通货膨胀严重，国内经济陷入严重危机之中。此时，萨克斯提出采取果断的行动，以激进的方式来迅速稳定宏观经济，同时迅速推进从计划体制向市场体制的转型。波兰政府接纳了萨克斯的建议，1991年，捷克、斯洛伐克和保加利亚也采取了激进式转型方式。1992年萨克斯被俄罗斯聘为政府经济顾问，俄罗斯也选择了“休克疗法”。

激进式转型的主要内容是快速自由化、稳定化和私有化。萨克斯认为其选择“休克疗法”的依据是：许多经济自由化的关键步骤可以迅速实施，实际上可以由依赖政府而在一夜之间解决。如自由贸易制度的建立，市场价格机制的关键步骤及实行私有产权等是可以在短时间内完成的；宏观经济的稳定也可以在稳定货币的情况下而迅速得以解决。在西方经济学家和学者中，推崇和赞赏激进式改革的人很多，特别是主流经济学家更是这样，这些人主要包括：萨克斯（Jeffery Sachs）、阿斯琅德（Anders Aslund）、墨非（Kevin Murphy）、弗里曼（Roman Frydman）、莱亚德（Layard, R.）、胡永泰（Woo, W.）、杨小凯（Yang, X.）、利普顿（Lipton, D.）、伯格（Berg, A.）、鲍依科（Boycko, M.）等。

总的来看，我们可以把选择激进式转型方式的依据大致归纳如下：

转型国家国内危机不断加深，此时政府对经济运行的控制能力已明显减弱，政府对于推动渐进式转型已无能为力。而此时国内严峻的经济形势也迫使各国政府走激进式改革之路。人民也希望尽快改善国家和自身的福利水平，也盼望政府能够加快改革的步伐。主流经济学家在对中央计划体制做了深入分析后认为，计划体制内部是一个相互支持、相互依赖的内在逻辑体系。在这个体系系统内部，局部改革是没有用的，只有全面取代计划经济体制的所有

它认为严厉的财政政策，加上放松管理与贸易自由化，就足以使得发展中国家摆脱停滞状态，从而启动经济增长。这一共识是在美国财政部、国际货币基金组织及世界银行之间达成的共识，该共识是在20世纪80年代南美洲经验的催化下形成的。

萨克斯在担任玻利维亚政府经济顾问期间，实行了一套激进的反通货膨胀措施，成功遏制了该国的通货膨胀，使通胀率由1985年的2400%降至1987年的15%，创造了所谓的玻利维亚奇迹。

因素,才能为市场体制留下生存和替代的空间。所以,在从计划体制向市场体制的转型中,由于改革的各个环节是环环相扣和互补的,因此仅靠局部改革难以收到好的效果,在改革进程中推进一系列整体的改革是必须的。快速、全面的改革可以提高转型的效率,也可以避免转型的逆转和倒退。墨非等人认为,“大爆炸”方式可以减少效率浪费,是延迟和逆转的惟一可取方式。他们认为,如果在改革中不彻底摧毁中央计划体制,那么价格体系就得不到纠正,真正的市场机制也就不会真正形成,国内的矛盾和问题就会越来越严重。同时,如果不彻底实行市场体制,那么就还会存在向计划体制回归的可能,所以,对这些国家来讲,要想彻底摧毁旧体制就必须实行激进式的改革。

中央计划体制国家长期以来一直进行某种程度上的渐进式改革,而成效却不明显,这就容易使人们感觉到为了彻底摆脱这种尴尬的局面,选择激进式改革也是惟一的可能。特别是一些新上台的非共产党党,更是迫不及待的想改变旧体制,建立新秩序,在这种情况下这些国家选择激进式转型道路也是符合情理和顺理成章的。

2 渐进式转型方式的选择依据

渐进式转型方式认为,转型应该是逐步推进和分阶段展开的,因为各个国家所处的情况不同,人们的理性也不可能构建出一个符合本国实际的市场体制来实施,并且在转型过程中,人们的思想和工作方式、以及政府的功能定位和回归都需要一定时间的调整 and 适应,任何急功近利和拔苗助长的方式和热情都是极其有害的。

中国、越南与俄罗斯、波兰等东欧国家不同,采取了渐进的改革方式,或者可以称为一种经济增长和经济转型相辅相成的增量式改革。就像邓小平所说的“摸着石头过河”那样,边试验边推进,先选择改革成本和阻力较小的部门和领域,然后再向其他部门和领域推广。由于这种改革可以在不改变未改革领域内的人福利的情况下,而使得改革领域内的大多数人福利得到改善,从而可以使更多的人支持和响应改革,从易到难、由浅入深,使得转型不断深化和向前推进,并最大限度地保证经济的平稳增长和国家的相对安定。

就对渐进式转型的态度来看,开始的时候大多数经济学家和学者都看好激进式改革,认为改革还是应当一步到位和急风暴雨,而不能拖拖拉拉,走一步退半步。随着转型的不断深入和采取不同转型方式的国家的转型后果有了一个大致清晰的眉目时,支持渐进式转型方式的学者和经济学家也在不断增加,就目前来看主要有以下人士支持和倾向渐进式改革,他们是:罗兰 (Gerard Roland)、麦金农 (Ronald McKinnon)、诺顿 (Barry Naughton)、布兰查德 (Divier Jean Branchard)、缪瑞尔 (Peter Murrell)、钱颖一 (Yingyi Qian)、斯维纳 (Svejnar, J)、波兹 (Potres, R)、科勒德克 (Grzegorz W, Kolodko)、麦克米伦 (Memillan, J)、阿吉翁 (Aghion, P)、魏尚进 (Wei, S. J)、林毅夫 (Lin, J. Y.) 等。而中国国内的学者也大都支持渐进式改革。

张军在《中国过渡经济导论》中阐述到,“20世纪80年代末,西方许多经济学家大多感到中国所走的局部改革道路似乎已经走进了一种半途而废的尴尬境地:产权改革严重滞后、制度创新严重短缺,中国的经济体制被改成了一种既非社会主义也非资本主义的“四不像”体制。可是中国的经济不仅没有在1989年以后走向停滞,而且在这种改革方式下获得了自1976年以来最有活力和最好的增长期。这似乎难以用西方主流经济学的理论学说加以说明,这种不一致的局面最近被英国剑桥大学的彼得·诺兰 (Nolan, 1993) 称为“中国之谜”。

布坎南也批评指出,市场制度是自由交易的制度,这种制度的有效运转依赖于能促进自由交易的制度结构和能适应并按照市场理念行动的个人,而这些制度结构和具有市场理念的个人又是长期历史发展的产物,认为市场经济可以在没有历史、没有制度结构和没有市场理念条件下形成并发挥作用的想法,是一种天真的想法。科尔奈对向市场体制转型总结性的说道,“宏观稳定不是一次战役,而是一场无止境的战争。稳定性不能通过突然袭击方式获得。制度变革只能通过一系列大大小小的改革来逐步完成。我现在认识到了这一点,我很后悔当初在《路》中没有重点提出”。

二、向市场转型中激进与渐进的逻辑争论

转型的动机和意义就是因为旧的经济体制阻碍了人们对潜在获利机会的取得,影响了经济系统的获利,而人们预期通过经济转型可以建立起来的新体制所能带来的预期收益,将高于旧体制带给人们的实际收益。经济转型的现实告诉我们,不管是激进式转型还是渐进式转型都要经历一个非常艰巨的过程;同时,该过程在新旧体制的交替中是需要我们付出成本的,激进式和渐进式转型路径可能会导致不同的收益和成本,所以二者的比较也必须从这方面考虑。

从主流经济学的观点看,改革能够进行的前提条件是新制度的收益减去转型的成本后大于旧制度的收益,即 $W_n - TC > W_o$, 其中 W_n 为新制度运行起来之后对实行新制度的预期收益, TC 为转型中的总成本, W_o 为旧制度带来的收益。

根据樊纲的转型成本分类,转型的总成本包括实施成本和摩擦成本,可以表示为:

$$TC = IC(S) + FC(S)$$

其中 $IC(S)$ 为实施成本, $FC(S)$ 为摩擦成本。从实施成本来看人们倾向于激进式转型;而从摩擦成本来看人们更倾向于渐进式转型。激进式转型的效率损失较少,而渐进式转型的摩擦损失较少,对于某一个国家的具体选择要具体分析。总的来说,由于 $TC = IC(S) + FC(S)$, 我们使总成本最小的选择就应该是一个可行的选择。

由于 $IC(S) = a + bS$, 其中 a, b 为大于 0 的参数; $FC(S) = a + \frac{da}{\beta}(e^{-\beta s} - 1)$, 其中 a, d, β 为常数, $a, \beta > d > 0$, 要解决的问题就是:

$$\min TC = IC(S) + FC(S) = (a + bS) + \left[a + \frac{da}{\beta}(e^{-\beta s} - 1) \right]$$

令 $TC' = 0$, 则 $b - dae^{-\beta s} = 0$, $b = dae^{-\beta s}$

两边取自然对数

$$\ln b = \ln a + \ln d - \beta S$$

求得最优解为:

$$S^* = \frac{\ln a + \ln d - \ln b}{\beta}$$

我们从上式中可以看出,改革遇到成本较大阻力时 (b 较大), 最优解 S^* 较小, 采取激进式转型比较好; 在摩擦成本较大 (a 或 d 较大或 β 较小) 时, 最优解 S^* 较大, 采取渐进式转型比较好。

转型的路径选择问题在经济分析的框架中就是制度变迁中的最值问题。此时，可以用公式表示为 $T_W = (W_A - W_B) - T_C$ ，其中 T_W 为转型总收益， W_A 和 W_B 分别为新旧制度结构下的收益， T_C 为转型成本。对于经济转型过程的绩效可用图 1 表示。

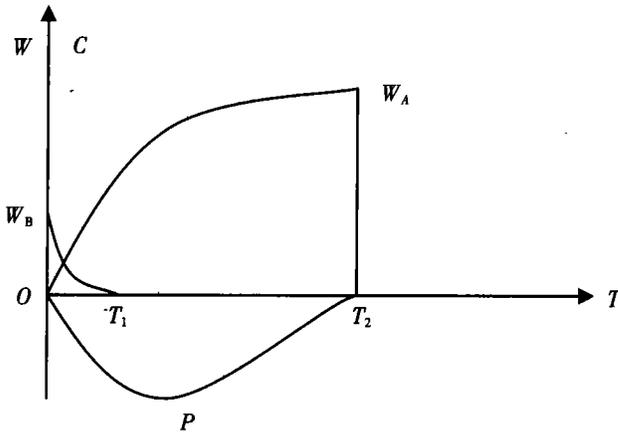


图 1 经济转型效益图解

图 1 中横轴表示转型的时间 T ，纵轴表示转型的收益 W 和成本 C 。在转型开始 T_0 至转型结束 T_2 的过程中，旧体制逐渐退出历史舞台，它所带来的收益 W_B 急剧减少，到转型过程中期 T_1 以后，旧体制的残余部分往往只能带来成本。新体制从转轨初期带来收益，至转轨结束时预期收益全部实现（从 O 到 W_A 点）。同时，在转型过程中付出成本，从转轨前期成本逐渐扩大，到达顶点（ P ）后逐渐减少，至转型结束时全部消失。图中 $OWAT_2$ 所围成的面积是新体制所带来的总收益， $OWBT_1$ 是旧体制消亡过程中带来的总收益，两者之和是经济体制转型过程中过渡型制度安排的总收益。 OPT_2 是经济转型的总成本。过渡型制度安排的总收益与经济转型的总成本的差额就是经济转型效益。

所以，由以上分析，经济转型的效益最大化受到两个因素影响：经济转型过程中过渡性制度安排总收益的大小和经济转型总成本的大小。经济转型的最佳方式和路径的选择同样也应考虑上述两个因素的影响。从过渡型制度安排总收益中我们知道它包含新、老制度两种制度收益的总和，在渐进的条件下，新制度由于是局部的推出和对原有老制度中最不足环节（改革最容易，问题最突出和人们最容易接受）的更替，那么过渡性制度安排的总收益一般会大于原有制度的总收益。所以在渐进式转型过程中的早期目标和阶段目标的过渡型制度安排收益肯定要大于激进式转型过程中的早期目标和阶段目标的收益，这是因为新制度的制度收益很难在转型的初期和一段时间内表现出来，因为市场体制的发育需要时间和培育，并不存在老制度退出新体制就发挥效用简单替代，在激进式转型的初期和相当一段时间，其转型过程制度安排总收益会小于其原有制度安排的总收益。其次，从转型的成本来看，渐进式改革的成本是一个逐步释放的过程，而激进式转型的成本却是在短期内一次性释放，那么在短期和一段时间来看，激进式转型的成本要大于渐进式转型的成本，所以，由以上两方面的收益与成本分析可知，在转型的开始及持续的相当一段时间，渐进式改革的绩效要好于激进式转型，从长期来看，则很难比较两种转型的优劣。

根据德瓦特里庞和罗兰（1995、1997）的关于两种转型方式比较的模型，来进一步分析激进式和渐进式转型的优劣。他们在模型中假设，考虑两项改革， $i = 1, 2$ ，其结果具有不

确定性, 这种不确定性取决于各自的所实现的自然状态 O_{1j} ($j=1, 2, \dots, J$) 和 O_{2k} ($k=1, 2, \dots, K$)。当两项改革都已实施 (“全面改革”) 时, 代理人收益的净现值在 O_{1j} 和 O_{2k} 都实现的情况下为 $F(O_{1j}, O_{2k}, t)$ 。当只有改革 i 已经实施 (“局部改革”) 时, 代理人收益的现值在 O_{im} 实现的情况下为 $P(O_{im}, t)$ 。

假定当两项改革都实施时收益是不随时间变化的: 对于所有 t , $F(O_{1j}, O_{2k}, t) = F(O_{1j}, O_{2k})$ 且 $P(O_{im}, t) = P(O_{im})$, 并进一步假设无论改革 1 还是改革 2 率先实施, $F(O_{1j}, O_{2k})$ 都保持不变。改革的互补性是用假设 $P(\cdot) < F(\cdot, \cdot)$ 来模拟的。 ξ 表示两项改革的逆转成本。

$$BB = (1 - \delta) E_{j,k} F(O_{1j}, O_{2k}) + \delta E_{j,k} \max \{-\xi, F(O_{1j}, O_{2k})\}$$

这样, 在一个时期中人们体验结果 $F(O_{1j}, O_{2k})$, 此后可以决定是否放弃一揽子改革。而在渐进式改革中, 首先进行第一次改革 1, 在了解到 $P(O_{1i})$ 以后, 可能会发生逆转, 或者继续走向改革 2。假定改革 1 已经率先实施, 且人们已经熟悉信号 S_{1n} , 那么持续收益

$$R_2(S_{1n}) = (1 - \delta) E_{j,k} [F(O_{1j}, O_{2k}) | S_{1n}] + \delta E_{j,k} \{-\xi, F(O_{1j}, O_{2k}) | S_{1n}\}$$

由于对 $F(\cdot, \cdot)$ 的预期随 n 而增加, 则可以定义 n : 当且仅当 $n \geq n$ 时, $R_2(S_{1n}) \geq -\xi$ 。也就是说, 只有信号比 S_{1n} 还糟时逆转才会发生。这样, 以改革 1 打头阵的渐进主义一揽子改革 GR_{12} 的事前收益就可以表示为:

$$GR_{12} = (1 - \delta) E_{j,k} P(O_{1j}) + \delta Prob(n < n) (-\xi) + \delta Prob(n \geq n) E[R_2(S_{1n})]$$

式中, 如果 P_n 表示与信号 S_{1n} 相对应的概率, 当 $n=1, \dots, n, \dots, N_i$ 时, 则有

$$Prob(n < n) \equiv \sum_{n=1}^{n-1} P_n \text{ 和 } E(n \geq n)[R_2(S_{1n})] \equiv \sum_{n=n}^N \frac{P_n}{P_n + \dots + P_{N_i}} R_2(S_{1n})$$

可以用下式把 GR_{12} 的表达式重写为:

$$BB = Prob(n < n = E[R_2(S_{1n})] + Prob(n \geq n) E[R_2(S_{1n})], \text{ 于是得到}$$

$$GR_{12} = (1 - \delta) E_{j,k} P(O_{1j}) + \delta BB + \delta Prob(n < n = \{-\xi - E(n < n = [R_2(S_{1n})])\}$$

我们从上式就可以比较激进式与渐进式的优劣, 上式第一项 $(1 - \delta) E_{j,k} P(O_{1j})$ 总是 < 0 , 这是渐进主义下第一期的阵痛, 是由各项改革间强烈的互补性造成的。第二项是与大爆炸相比渐进主义可能代价高昂的拖延。如果 $BB > 0$, 拖延是坏的, 如果 $BB < 0$, 结果相反。第三项代表早期逆转的选择值, 如果 n 存在, $\{-\xi - E(n < n = [R_2(S_{1n})]) > 0\}$, 对于 $n < n$, $R_2(S_{1n}) < -\xi$, 早期逆转的选择的价值将严格为正值。

由以上分析, 大爆炸在以下情况充分结合的条件下将是最优的: 太多的阵痛; 从局部改革中学习不到任何知识; 大爆炸一揽子方案的预期结果为正且很大。但是渐进主义在以下情况充分结合的条件下则可能是最优的: $BB < 0$; 早期逆转的选择值足够高; $E_{j,k} P(O_{1j})$ 的负值不要太大。

所以, 渐进主义在早期逆转这一优势的选择是大爆炸所不具备的。在转型结果不好时, 渐进主义就可以在早期进行逆转。分析表明, 逆转成本和总和和不确定性的影响, 是选择大爆炸或渐进主义的关键因素。不同转型方式改革的成果取决于对未来改革结果所提供的信息

丰富程度。这一富有信息的条件是否在实际中出现，可能取决于人们所考察的是哪一种改革一揽子方案。除了以上的分析，渐进主义所提供的弹性改革，由于在总和不确定情况下成本较小，此时，采取渐进方式会更加得到人们的青睐。

三、渐进与激进策略选择逻辑的实质

在转型研究中有一个问题长期以来一直被人们所忽视，这就是原计划体制国家原有体制的绩效状况和矛盾积累程度问题。由于不同国家原有计划体制的绩效状况和适用程度会影响到一个国家和社会的危机程度和矛盾冲突程度，也会进一步影响到人们对待转型的态度和看法。其实，任何激进与渐进的转型策略都是与一个国家原有体制下的绩效状况和矛盾累积程度相对应的，不是都可以任意选择和相互比较的。

从计划体制的实施结果来看，有一个有趣的现象，即计划体制对经济发展的不适应程度随着时间的推移越来越严重，这从社会主义计划体制国家的增长率下降趋势就可以明显印证，如前经互会成员国工业产值增长率的变化就很好地说明了这一点，见图 2。

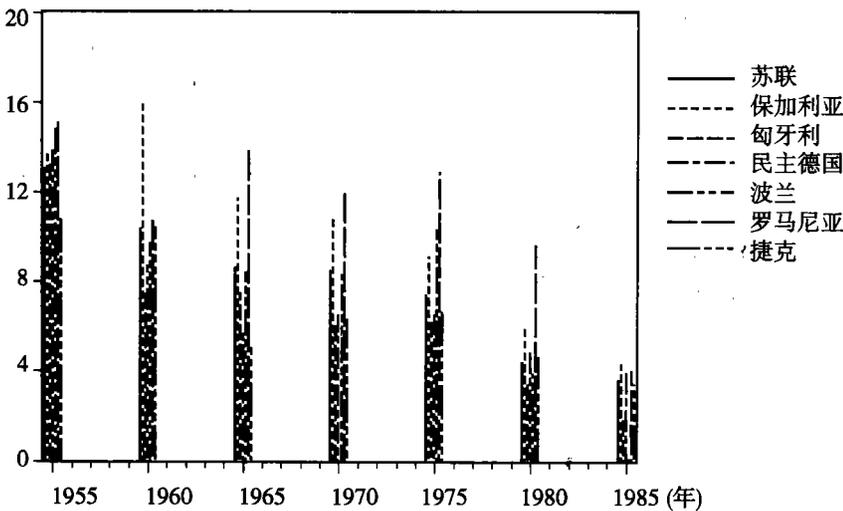


图 2 前经互会成员国工业产值增长率的变化 (%)

数据来源：根据《经互会统计年鉴》1989年、《苏联国民经济统计年鉴》1990年数字整理计算。

推论 1 计划体制的绩效递减规律。计划体制在时间变化的过程中都会出现绩效下降的趋势，因此就会产生进一步变革的要求。在计划体制形成和发挥作用的过程中，制度绩效呈现出递减趋势，我们可以称之为计划体制绩效递减规律。一般来说，计划体制在其形成和制定之初，其绩效是一条斜率为正的曲线，因为在制度磨合和发育的过程中制度边际报酬为正，但是，随着时间的推移，环境和人们效用的变化而导致制度滞后程度逐渐加剧，制度绩效的边际报酬就会递减，制度绩效曲线达到其斜率为零的点之后就会呈现出向下弯曲的趋势。并且制度递减的趋势在达到某个阶段后会进一步加剧，因此，向下倾斜的曲线会变得更加陡峭，见图 3。

前经互会成员国是指以苏联为主的包括一些东欧社会主义计划体制国家在内的社会主义国家所组成的一种经济互惠组织。这些国家主要包括苏联、保加利亚、匈牙利、民主德国、波兰、罗马尼亚、捷克斯洛伐克等国家。

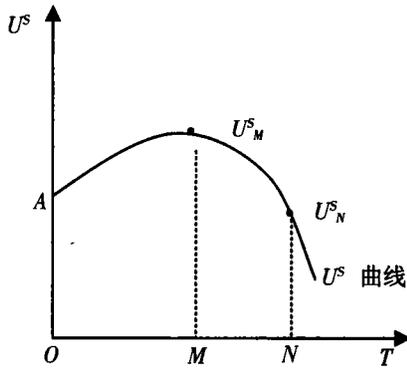


图3 计划体制绩效曲线变化图

推论2 计划体制绩效递减规律中的阶段分解。在图2中，纵轴为制度绩效函数 U^S ，横轴为时间， M 和 N 分别表示制度绩效曲线变化的两个重要时间点， M 点为制度绩效的边际变化由正为负的转折点，在 0 至 M 时刻制度绩效边际报酬为正， M 点之后则为负，即存在 $d U^S / dt < 0$ 。当达到 N 点后，制度绩效会加速递减，也就是说，当达到 N 点后，制度的无效程度和对社会经济发展的负面影响会加剧，即存在 $d (d U^S / dt) / d^2 t < 0$ 。图3的制度绩效曲线可以直观地刻画出计划体制的绩效递减规律。

把制度绩效的变化与制度变迁的成本变化结合起来，就可以较为明确地确定计划体制矛盾激化程度的不同累积阶段。

根据皮瑞若等 (Pereira L, 和 Abud J, 1997) 的观点，可以把制度变迁的总成本分为调整成本和延误成本，制度变迁的总成本是调整成本 C_1 和延误成本 C_2 之和，即曲线 C 。总成本曲线一般来说是逐渐递增的，特别是在经过 T_k 时刻以后会加速递增。其实，可以把计划体制下的制度变迁成本变化与计划体制的绩效曲线结合起来，这样就能认清这一问题，见图4。

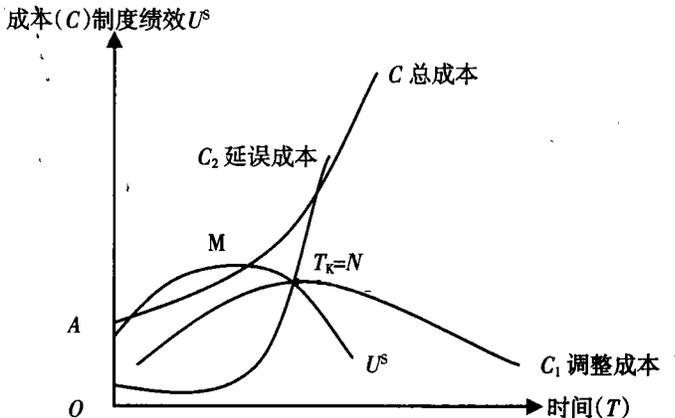


图4 制度绩效、变迁成本综合演示图

T_k 时刻以后，延误成本会急剧加大，而实施成本变化较为平缓，这就造成制度变迁的总成本在 T_k 时刻以后会急剧增加。从总成本变化曲线来看，其在 T_k 点以前总成本曲线斜率较缓，而在 T_k 时刻以后，总成本曲线的斜率明显变陡，这也说明总成本在 T_k 点以后呈明显快速增加趋势。

计划体制的绩效变化曲线和制度变迁成本曲线都是以时间尺度来衡量变化的，所以，放在同一个坐标轴上考察是适当的。我们据此可以把从计划体制向市场体制的变迁和转型分为三个发育程度不同的阶段：

第一阶段，制度危机潜伏阶段，即图 3 中 AM 阶段。在计划体制的实施初期，在统筹资源和组织社会化大生产方面有着市场体制无法比拟的优势，特别是由于计划体制实施之初，计划体制的弊端和症结都没有充分暴露，此时计划体制的危机和矛盾处在潜伏阶段，推动制度变迁的动力小。

第二阶段，渐进策略优势阶段，即图 3 中 MN 阶段。计划体制在某些方面已开始表现为无效，此时，人们开始对现存制度抱有某种程度的不满，希望某种新制度来取代现存制度，或对现存制度进行某些方面的改良，此时，计划体制的负面效果已逐步显现。由于此阶段计划体制的延误成本变化不大，所以，是推进渐进式转型的较佳时期。

第三阶段，激进策略优势阶段，即图 4 中 $N = T_k$ 点以后阶段。计划体制绩效急剧下降，制度延误成本和制度总成本加速增加，这一阶段制度变迁和转型的延误都会对社会经济发展和转型绩效产生巨大不利影响。此时，任何渐进式的制度变迁的收益都不足以补偿制度延误成本的增加，所以，该阶段是推行激进式变迁的较佳阶段。

在胡震等 (2002) 引用的跨时期改革深度模型的基础上，本文通过转型成本变化和转型时机的抉择来分析和揭示不同方式转型的实施机理。

对于一个社会来说，当改革成为必须的时候，我们可以假定改革的效用是当期进行改革深度的函数。由于改革是此时社会的共识，随着改革的推进人们效用函数的变化一般来说应该是增益性的，从改革进程的长期趋势来看，可以假定改革带来的效益是改革深度的增函数。人们的效用函数可以用常替代弹性函数表示为：

$$u(E(t)) = E(t)^{1-\theta} / (1-\theta)$$

式中， t 为时期序号， $E(t)$ 为改革的深度， θ 为风险规避系数，是边际效用关于 $E(t)$ 的弹性， θ 值越小， $E(t)$ 增大引起的边际效用递减越慢，也就是说，社会越容易接受突变式的激进改革策略。

改革的效用函数可以表示为：

$$\int_{t=0}^{\infty} e^{-pt} \frac{E(t)^{1-\theta}}{1-\theta} dt$$

p 为效用的贴现， e^{-pt} 用来表示关系紧密程度。上式中 p 越大，改革在将来效用贴现值越小，人们越支持激进式的突变改革。

改革深度的选择过程中，不考虑改革的约束条件是不现实的，而改革的约束条件是改革的成本贴现值不能产出人们对改革的承受力的贴现值。即

$$\int_{t=0}^{\infty} e^{-R(t)} c(\tau) E(\tau) d\tau \leq \int_{t=0}^{\infty} e^{-R(t)} A(\tau) d\tau$$

式中， $R(t)$ 被定义为 $R(t) = \int_{t=0}^t \gamma(\tau) d\tau$ ， τ 为时期， $\gamma(\tau)$ 为 τ 期的利息率， $A(t)$ 为 τ 时刻社会对改革的承受力， $C(t)$ 为 τ 时刻的平均改革成本。

根据改革的效用函数和约束条件可以用拉格朗日函数方法求解改革中的最大化问题：

$$L = \int_{t=0}^{\infty} e^{-\rho t} \frac{E(t)^{1-\theta}}{1-\theta} dt - \lambda \left[\int_{t=0}^{\infty} e^{-Rt} c(t) E(t) dt - \int_{t=0}^{\infty} e^{-Rt} A(t) dt \right] = 0$$

根据汉密尔顿方法, 这个方程的一阶条件为:

$$e^{-\rho t} E(t)^{-\theta} = \lambda e^{-Rt} c(t)$$

两边取自然对数, 则 $-\theta \ln E(t) - \rho t = \ln \lambda - R(t) + \ln c(t)$, 两边同时对 t 求导, 则

$$-\theta \frac{E'(t)}{E(t)} - \rho = -R(t) + \frac{c'(t)}{c(t)}$$

即

$$\frac{E'(t)}{E(t)} = \frac{R(t) - \rho}{\theta} - \frac{1}{\theta} \frac{c'(t)}{c(t)}$$

由上式, 改革深(程)度的变化必须和社会成本的变化保持一个适当的比例, 才能在改革和转型中满足最优化问题。这说明在改革和转型中改革总成本的变化对于转型策略的选择和优化是十分重要的。一般来说, 当改革总成本变化剧烈时, 改革的深度(激进程度)也会表现得更为剧烈。从前面对制度滞后三个阶段的分析知, 在不同的阶段, 改革和转型成本的变化是有显著区别的, 这也必然决定了转型方式的抉择。在转型时机选择的第一阶段, 由于原制度绩效仍在递增, 此时改革问题不会引起人们重视。在转型的第二阶段, 由于此时转型成本逐渐增加, 特别是原有制度的弊端已逐渐显现, 但由于此时人们对改革目标还不是十分清晰, 推动渐进式改革是最为有利的阶段。此时, 原有体制的绩效下降的程度和危害也是逐步加深的, 同时, 这时旧制度的绩效还存在, 所以, 在第二阶段推动渐进式改革是比较适合的。从改革成本变化与改革深度变化的耦合关系来看也是比较适合的。而到了转型时机的第三阶段, 即转型延误超过了转型容忍临界点之后, 总的来说, 也就失去了进行转型的最有利时机。转型的回旋余地势必缩小, 推动转型的风险势必加大, 社会必定要为此付出更高的成本。但此时由于人们对旧制度认识得更清晰, 对待改革和转型的态度更坚决, 推动激进式的大爆炸策略就会成为合理和惟一的选择。从总成本的变化趋势和改革深度的逻辑关系来看, 由于此时改革总成本在短时间内会发生急剧变化, 推动渐进式改革的收益可能还不足以补偿延误成本增加的危害, 所以, 推动激进式的突变转型就成为此时合理和惟一的选择。

在从计划体制向市场体制的转型中, 激进式改革策略和渐进式改革策略是在不同的转型时机下, 由于不同转型国家转型总成本的态势和变化趋势的差异而应采取的不同形式。二者由于是不同转型时机和阶段下采取的不同策略, 所以, 并没有可比性。总的来看, 激进式策略是在转型时机已处于最后阶段, 由于矛盾积累而延误成本又非常大的情况下, 不得已而采取的一种较为有利和可行的转型策略。当然, 如果能抓住时机, 在此阶段以前完全可以选择更为有利的渐进式转型策略。

四、理论检验

一般来说, 转型的激进程度取决于转型实施时原有体制的矛盾积累程度。如在图 5 中, 中国改革后至 1989 年的平均增长率为 8.7%, 而俄罗斯、捷克、匈牙利、波兰和罗马尼亚平均增长率都不足 3%, 说明在这些国家原有制度的矛盾已到了激化的程度, 而中国持续的高增长也说明了中国原有制度的矛盾不突出, 也就没有采取相对激进转型策略的内

在要求和必要。1989年随着波兰的经济形势不断恶化，商品短缺，通货膨胀严重，国内经济陷入严重危机之时，在西方市场国家利诱和鼓动下，波兰马上就采取了激进向市场体制转型的策略。此后，1991年，捷克、斯洛伐克和保加利亚也采取了激进的转型方式（这些国家在采取激进转型时经济增长已为负数，如捷克1990年经济增长率为-3.0%，保加利亚为-11.6%）。1992年俄罗斯也选择了“休克疗法”（俄罗斯1990年经济增长率为-2.0%，1991年为-9.0%）。这些国家之所以采取激进转型策略主要是因为这些国家国内矛盾激化，而改革的延误成本非常大，这个时候渐进改革带来的好处不足以补偿改革延误带来的社会弊端的增加，所以，这些国家采取相对激进的转型策略也是这个时候合理的选择。

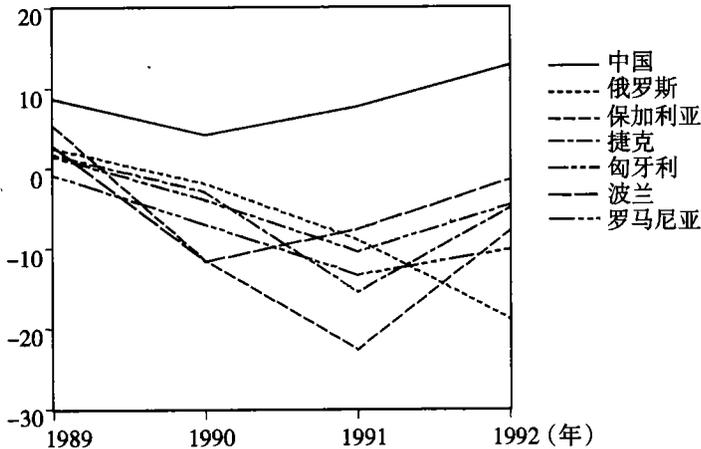


图5 中国、俄罗斯和东欧的增长率 (%)

数据来源：萨克斯和吴永泰(Sachs 和 Woo, 1994), 世界银行《1996年世界发展报告: 从计划到市场》。

从计划体制向市场体制的转型方式，取决于社会各级主体对新制度的预期效用变化和利益驱使下所表现出的利益冲突和矛盾积累程度。人们对新制度预期效用的变化又是导致各级制度变迁主体冲突和矛盾的主要根源。转型和改革的激进程度取决于原计划体制内部的矛盾积累程度。

参考文献

- [1] Williamson, J : *What Washington Means by Policy Reform*, Chapter 2 in *Latin American Adjustment: How Much Has Happened?*, John Williamson (ed), 1990, Washington: Institute for International Economics, 1990.
- [2] Sachs J *The Economic Transformation of Eastern Europe: The Case of Poland*, *The American Economist*, 1992, 36 (2): 3~ 11
- [3] Brada, Josef C. and King, Arthur E , *Sequencing Measures for the Transformation of Socialist Economies to Capitalism: Is There a J - Curve for Economic Reform?*, Research Paper Series # 13, (Washington, D C : Socialist Economies Reform Unit, World Bank, 1991
- [4] Muphy K, Shleifer A Vishny R *The Transition to a Market Economy: Pitfalls of Partial Reform*. *The Quarterly Journal of economics*, 1992, 107 (3) : 889~ 906

- [5] 罗兰:《转型与经济学》,北京大学出版社,2002。
- [6] Che, Jiahua, and Yingyi Qian, *Institutional Environment, Community Government, and Corporate Governance: Understanding Chinas Township - Village Enterprise*, 1998a, *Journal of Law, Economics, and Organization* 14 (1), 1~ 23
- [7] Qian, Y. and C. Xu, *Why China's Economic Reforms Differ: The N - Form Hierarchy and Entry/Expansion of the Non - State Sector*, *Journal of Economic Transition*, 1993, 1: 135~ 160
- [8] 拉迪:《中国未完成的经济改革》,中国发展出版社,1999。
- [9] Woo, Wing Thy, *The Real Reasons for China's Growth*, *The China Journal*, 1999, No. 41, 115~ 138
- [10] 张军:《中国过渡经济导论》,立信会计出版社,1996。
- [11] 布坎南:《自由市场与国家》,北京经济学院出版社,1988。转引自张宇:《过渡政治经济学导论》,经济科学出版社,2001。
- [12] 科尔奈:《后社会主义转轨的思索》,吉林人民出版社,2003。
- [13] 樊纲:《两种改革成本与两种改革方式》,《经济研究》1993年第11期。
- [14] 冯舜华等:《经济转轨的国际比较》,经济科学出版社,2001。
- [15] Roland, G. , *Political Constraints and the Transition Experience*, *Zecchini S* 169~ 187, 1997
- [16] 宋则行、樊亢:《世界经济史》下卷,经济科学出版社,1998。
- [17] Pereira L. , Abud J. , *Net and Total Transition Costs: Timing of Economic Reform*. *World Development*, 1997, 25 (6): 905~ 914
- [18] 胡震、宋海荣、胡君 :《过渡经济学》,湖北人民出版社,2002。
- [19] 周冰、靳涛:《经济体制转型方式及其决定》,《中国社会科学》2005年第1期。
- [20] Jeffrey Sachs and Wing Thy Woo, *Structural Factor in the Economic Reforms of China, Eastern Europe and Former Soviet Union*, *Economic Policy* 18, April 1994
- [21] Kornai: *what the Change of System from Socialism to Capitalism Does and Does Not Mean*. *Journal of Economic Perspective*. Volume 14 Number 1 winter 2000

(责任编辑:刘 强)