

交易费用与制度安排的正反馈分析

葛 扬 林乐芬

内容提要 以交易费用的高低决定制度安排的路径是一个正反馈过程,制度安排系统是一个正反馈系统。本文建立了一多种制度安排系统的正反馈分析模型,并由此对制度安排成本—收益进行了分析、说明。

关键词 交易费用 制度安排 系统

葛 扬,厦门大学经济系博士后 361005

林乐芬,南京农业大学经贸学院博士生 210095

自交易费用(transaction costs)理论提出以来,制度安排就成为西方经济学界的热门话题。将制度安排与资源有效配置联系起来进行研究,拓展了西方经济学的新视界。以交易费用的高低决定制度安排的路径是一个正反馈过程,制度安排系统是一个正反馈系统。正反馈是事物演化、发展的原因,各种的限制和选择使演化的形态和行为既复杂又多样化,演化系统是一种以正反馈推动的非线性系统^[1]。对于制度安排这样一种人工干预的正反馈系统而言,交易费用是人们决定制度安排路径的量化尺度。没有统一的量化尺度,人们就无法获取差距信息,正反馈过程就会受阻。因此,科斯提出交易费用的概念之后,制度安排正反馈机制的建立才成为可能,制度安排才走向规范化。

一、西方经济学对制度研究的历史线索:制

度不变—制度进化—制度安排

自资本主义社会以来,人们对制度的认识经过了一个不断深化的过程。从将制度看成永恒不变到不断变化,再到可以安排,经过了“制度不变”、“制度进化”、“制度安排”几个阶段。

18世纪60年代,资本主义的经济制度、市场机制占据着绝对统治地位。古典经济学将制度视为既定的前提,是人类行为得以展开的基础,但是,对于制度是怎样产生、演变以及其存在的合理性均未做任何分析。资本主义制度被视为铁板一块、永恒不变。19世纪后期,法国“空想”社会主义试图打破制度不变的神话,然而,建立在道德伦理基础之上的空想社会主义面对现实的资本主义制度是无能为力的。建立在唯物史观和剩余价值理论基础之上的科学社会主义,为对资本主义制度进行科学的批判提供了张力,从而打破了

资本主义制度永恒不变的神话!马克思主义是从宏观社会历史跨度中,即从不同性质制度的对立中去打破的。

马克思主义经济学的创立对古典经济学产生了很大的冲击。凡勃伦、康芒斯等制度经济学的奠基者们不再恪守资本主义制度永恒不变的理念,对他们所处时代的资本主义制度表现出强烈的悲观主义,主张资本主义社会的制度或结构是可以变化的。不过,早期制度经济学所提出的制度变化的思想是基于资本主义基本制度的前提之下,是对资本主义制度的合理维护,因此,是一种制度进化观。正如凡勃伦所说:“制度必须随环境的变化而变化,因为就其性质而言,它不过是对这类环境引起的刺激反应的一种习惯方式。人类在社会中的生活,正同别的生物的生活一样,是生存的竞争,因此是一种淘汰的过程。关于人类制度和人类性格的一些已有的与正在取得的进步,可以概括地认为是出于最能适应的一些思想习惯的自然淘汰,是个人的环境的强制适应过程,而这种环境是随社会的发展、随人类赖以生存的制度的不断变化而逐渐变化的。”^[2]

20世纪30年代爆发的世界性经济危机表明,资本主义制度本身存在缺陷,制度改革与制度变迁是制度内在要求。资本主义的经济制度及其运行模式应该在现实中的政治和经济形势发生巨大变化的条件下不断地自我变革,从而表现出一些可塑性选择。随着福利经济学、反周期的财政货币政策理论、经济增长、计划理论的发展,人们认识到现代社会经济制度系统不仅是机械进化、自然淘汰的过程,而且是可以选择、可以安排的。体现了人在制度变迁过程中的主体作用,而不再是制度经济学派的机械适应的进化论原旨。于是,新制度经济学应运而生,通过财产所有权、信息的处理和使用、决策过程、行为规律等因素来制定制度安排的路径。新制度经济学认为,应该从人的实际出发来研究人,实际的人在由现实所赋予的制约条件中活动。新制度经济学的目标是研究制度演进背景下人们如何在现实世界中作出决定和这些决定如何改变世界。因此,在新制度经济学看来,制度被看做社会确立的,在生产、

消费和分配三个基本领域内做出经济决定的机制,实质上是一种正反馈机制,根据制度运行中反馈的信息,对制度进行选择,作出安排。

二、制度安排系统的正反馈分析模型

正反馈是这样一种信息,即这种信息是关于某个系统参量的实际能和参照级之间的差距,并被用来以某种方式改变这个差距。差距信息本身并不是反馈,只有当其被用来改变差距时,该信息才被称为反馈。

自工业社会以来,人们在对市场的研究中,就试图对经济系统的运行进行调节与控制,萌发了经济系统的正反馈思想。萨伊曾提出“生产创造需求”,以生产为反馈信息来调节社会经济;凯恩斯由市场经济萧条信息的反馈而提出“有效需求不足”的问题,进而推导出“充分就业”的概念,试图通过国家干预的方式实现社会有效劳动力的充分就业,从而调节资本主义国家的社会经济行为,使社会经济过程达到新的均衡状态。

对制度进行正反馈分析,是新制度经济学建立之后特别是交易费用理论提出之后的事情。将制度安排视为正反馈系统,首先必须分析制度均衡状态与制度失衡状态,只有在对这两种状态的比较分析中,才能取得差距信息,进而建立制度安排的正反馈机制。制度变迁是对制度均衡的一种反应,它是一种制度安排从均衡走向失衡,再从失衡走向新的均衡的螺旋运动。从制度均衡状态到制度失衡状态,就存在了制度变迁的可能,不过,这种潜在的制度变迁能否转化为现实的制度变迁则是一个复杂的正反馈过程。所谓制度均衡是指一种行为均衡,表征着一种状态,即在现有制度结构下,对于某一项具体的制度安排,制度安排的主体无意、或无力改变现状。所谓制度失衡是指制度均衡状态被打破。制度失衡的根本原因是,对于现有的生产力,原制度不再是最佳选择。导致制度失衡的因素是多元的,除生产力这一根本因素外,还有政府行为、国际市场的变化、意识形态等因素。若以数学函数式表示,则为

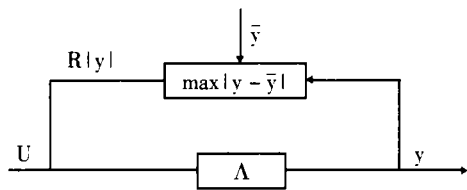
$$ES = f(x_1, x_2, x_3, \dots, x_n)$$

上式表示制度 ES 随着变量 $x_1, x_2, x_3, \dots, x_n$ 的变化而发生变迁,其中 x_1, x_2, x_3, x_n 分别表示生产力、

政府行为、国际市场的变化、意识形态等变量。

资源稀缺性是客观世界相对于人类需要而言的,经济学研究的目的在于将稀缺性的资源在不同行业之间分配,以求得最大化的经济利益。资源稀缺性是一切经济学流派所公认的前提,不过,新制度经济学率先引入制度分析,将制度视为经济资源的一种,具有与其他资源一样的稀缺性特点。这就将供给—需求概念引入制度变迁模型的研究之中。从需求方面考察,由于现存制度安排的社会净效益小于另一种可供选择的制度安排,也就是出现一个新的盈利机会,这时就会产生新的潜在的制度需求。生产力的变化发展,促使生产的手段与方式、资源的供给结构等发生变化,从而使得制度需求上升。从供给方面考察,原有的制度、规则、习惯由适应变为不适应,制度运行由高效运行变为低效运行,随之,经济效益逐渐下降,这就为进行新的制度选择扩大了空间。而且随着科学技术和信息处理水平的提高,新的制度安排费用减少,从而也拓展了新制度供给空间。

制度失衡之后,其缺陷与弊端必然在社会经济的各个方面以不同形式、不同程度表现出来。决策部门正是通过对上述现象的诊断分析,对照制度安排正反馈系统参量的参照级,获取差距信息。对于一个正反馈系统来说,这是非常重要的一环。不能获取准确的差距信息,制度安排的正反馈机制是不可能建立的,当然也就不可能设计更为理想的新制度,进行制度创新。我们可以用数学模型表示制度安排正反馈机制。



图中以算子 Λ 表示已经分析的系统的活动,以 Y 表示制度安排系统的输出向量,即实际级向量,以 \bar{Y} 表示制度安排系统参照级向量,将 Y 与 \bar{Y} 进行比较,我们可以获取两个向量之间的差距信息 $R(Y)$,即 $R|Y - \bar{Y}|$,这是作出系统调节的反馈信息,在这种情况下,系统输入向量变成了 $U +$

$R(Y)$,按反馈方法用调节与自我调节的算子得到制度安排系统的数学模型:

$$Y = \hat{R}\Lambda(U)^{(3)}$$

由前述可知,影响制度安排正反馈系统的因素是多元的,因此,制度安排正反馈系统差距信息是 $R_1, R_2, R_3, \dots, R_n$ 多元差距信息的集合,制度安排的过程是 $Y_1, Y_2, Y_3, \dots, Y_n$ 多元反馈的集合。

$$\text{由此得 } Y = \sum_{i=1}^n \hat{R}\Lambda(U_i) \text{。正反馈系统不是一次}$$

完成的,而是一个不断迭代的过程。

由制度安排正反馈分析模型可知,差距信息的获得是至关重要的。差距信息是比较系统参量的参照级与实际级而获得的,因此,系统参量参照级与实际级的量化问题就显得很重要。尽管系统参量的性质也很重要,但是,常常由于因人而异而现伸缩尺度,难以作出比较进而建立反馈机制。而在系统参量的参照级和实际级均已量化的情况下,进行比较是容易的。因此,系统参量的参照级与实际级的量化是正反馈系统建立且规范的前提条件。

三、交易费用:制度安排正反馈系统的量化尺度

交易费用理论的提出,为制度安排系统参量的参照级和实际级提供了量化尺度,并且使制度安排正反馈机制的规范化成为可能。交易费用理论是用正反馈分析方法研究经济组织制度的理论。它的基本思路是:围绕交易费用节约这一核心,把交易费用作为制度安排正反馈系统参量的参照级和实际级的量化尺度,分析怎样的交易应该用怎样的组织制度来调适。

将交易作为经济学的基本分析单位,是早期制度经济学家康芒斯的贡献,而明确提出交易费用概念的则是新制度经济学家科斯。科斯在1937年发表的《企业性质》中创立了交易费用的分析框架,确立了制度安排正反馈系统的量化尺度。科斯认为:(1)获取准确的市场信息,企业必须付出代价;(2)为了克服市场当事人之间存在的冲突,需要进行谈判、缔约并诉诸法律形式,这样,建立企业间有序的联系就需要支付费用。因此,“我们必

须考虑各种社会格局的运行成本(不论这是市场机制还是政府管理机制)以及转成一种新制度的成本。在设计和选择社会格局时,我们应考虑总的效果。”^[4]这就是科斯的以交易费用进行制度安排的思想,既包括契约、规则、权利的选择与安排,也包括社会制度、经济组织的选择与安排。

科斯定理的经典表述是:“在交易费用为零的世界中(标准经济理论的一个假设),各方之间的谈判将会导致带来最大财富的安排,并且这与权利的初始分配无关。”^[5]这就是说,当交易费用为零,不管初始权利怎样界定,均可通过市场自由交易达到资源的最优配置。科斯定理揭示了通过市场调节资源配置不是没有代价的,企业具有替代市场机制、节省费用的性质。这暗含着市场的自由交易过程对不当的法定权利安排有一种纠偏和矫正的作用。从这个意义上说,企业是以权力的运用,即企业家的组织、指挥、协调来代替市场机制调节功能,是以自觉的力量代替不自觉的力量^[6],在市场经济体制中,本来就存在替代市场作用的工具。

交易费用为零只是一个理想状态的假定,而经济研究的对象必须是存在交易费用的现实世界。由于现代市场交易不是传统经济学所认为的实物交易,而是渗透着行为的权利和个人拥有的、由法律设置的权利,所以在交易费用的现实世界中,法律制度将会对经济系统的运行有着重要的作用。科斯认为,在交易费用存在的情况下,“合法权利的初始界定会对经济制度的运行效率产生影响。”^[7]这被称为“科斯第二定理”,并被认为是真正的“科斯定理”。它将产权界定与交易费用联系起来进行研究,指出产权明晰是降低交易费用、减少制度运行摩擦的基础。可见,“交易费用”不仅是制度安排正反馈系统的量化尺度,还是衔接“权利初始安排”和“资源配置效率”的一个至关重要的中间变量。

科斯理论的建立在西方经济学界产生了巨大的影响,掀起了制度经济研究的浪潮。威廉姆森是其中的杰出代表。他认为,任何一个能表述为协约问题的经济—组织问题,均可以在节约交易费用这个意义上进行深入的探讨。威廉姆森的主要贡

献是以交易费用作为经济分析的核心,特别是修正了市场交易中经济行为的前提假设。其一,机会主义假设。是指交易双方向其对方提供虚假信息,以种种非正当投机办法实现自我利益。机会主义假设的导入,使交易更为复杂化,交易费用也会相应提高。其二,不确定性假设。在市场交易中,由于机会主义的存在,交易过程具有不确定性。因为任何契约都不可能无懈可击,总会给机会主义行为留下可乘之隙,结果,交易谈判及所达成的契约越趋复杂化,交易费用也会提高。其三,有限理性”假设。在现实经济活动中,由于不确定性和机会主义行为的存在,加之不完全信息的限制,人们的理性是有限的,结果市场交易中的人不是“理性人”。其四,资产专用性假设。指为了某一特定的交易而选择的持久投资。随着市场的拓展和分工的发展,会产生使用日趋专一的生产要素。生产要素越专用,设计程序就越简单,制造费用就越低,市场的交易费用则越高。威廉姆森提出的四个假设,深化和发展了交易费用理论,使交易费用理论更逼近现实经济活动,增强其对经济现实的解释力。

科斯和威廉姆森的研究,提出了将特定经济体制的运行费用与在其运行下资源配置的有效性相比较,或者将不同经济制度的运行效率及运行费用相比较的方法。制度选择以最低费用为标准,制度安排以降低费用为导向,以交易费用为量化尺度,通过制度安排正反馈机制,实现权利初始安排合理化,把握权利结构调整的方向,提高市场机制运行效率,实现社会经济稳定协调。

四、交易费用理论的合理性和局限性

交易费用理论的建立,是经济学理论的一次革命。将交易费用作为制度安排正反馈系统的量化尺度,将前人解释同一问题的许多因素,比如风险因素、信息因素、习俗因素等囊括起来,采用新的分析框架,对资源配置进行经济学分析,从而在西方经济学界创立了一种新的范式。

(1)交易费用理论揭示了运用价格机制的代价,以及价格机制的局限性,冲破了传统经济理论的框架,奠定了新制度经济学的基础。古典经济理论和新古典经济理论实际上包含了一条重要的假设,这就是包括信息获取和处理在内的市场交易

活动是毫无磨擦的、瞬时完成的,因而是不存在交易费用的。因此,经济分析模型日趋精致,数学方法的运用日益广泛。但是,在成熟的外表下,经济学理论正逐步脱离现实社会经济,理想主义、客观主义倾向日趋浓厚。交易费用理论摒弃了古典经济理论和新古典经济理论的抽象性、理想性,明确提出通过市场调节资源配置是不可能没有代价的,以交易费用概念的一般化为标志,确立交易费用的客观存在性,从而使经济学理论研究从理想世界走向现实世界。

(2)以交易作为经济研究的起点,打破了西方传统经济学研究的界域,从而将人与人的权利关系纳入经济学分析框架中。贝克尔曾将经济学的发展分为三个阶段:“在第一个阶段,人们认为经济学仅限于研究物质资料生产和消费结构,仅此而已(即传统市场学);到第二阶段,经济理论的范围扩大到全面研究商品现象,即研究货币交换的关系。今天,经济研究领域已扩大到研究人类全部行为及与之相关的全部决定。”^[6]交易费用理论超越了新古典经济学的分析框架,注重考察市场交易活动以及经济组织之间的相互联系,它不仅看到市场交易活动中的物与物的关系,还看到在这背后的人与人的权利关系;不仅看到了人与人之间和谐合作的一面,还注意到相互冲突的一面;不仅提出了交易费用的概念,而且建立起制度安排的正反馈机制,从而表明,人类在进行制度安排、对微观经济活动进行控制方面跨出了重要的一步。

交易费用理论作为一种新的微观经济分析框架,适用于所有能够作为交易或协议的经济组织。但是从目前的情况看,交易费用理论还不是一种成熟和完善的理论,它本身存在着不少局限:

(1)交易费用本身存在着复杂性,它不仅包括搜集信息的费用、谈判和签约的费用,还包括在协议的实施过程中所发生的费用及必须承担的风险等;它既可以用一定量的货币表示,也可以以一定时间和精力的消耗表示。交易费用内容与形式的复杂性,导致其准确度量的难度增加。

(2)制度分析深入到社会活动的方方面面,包括传统习惯、道德伦理等非正规约束范畴。但

是,新制度经济大有存而不论之嫌,将其看成制度安排的既定背景。问题的关键在于上述非正规约束范畴难以量化,这也导致制度安排系统信息反馈的不完全性和模糊性。

(3)尽管交易费用在准确度量方面存在难度,但仍不失为制度安排中不可缺少的理念和重要的分析工具。因此,否定交易费用的存在是错误的。但是必须清醒的是,交易费用只是总费用的一部分,否则就会失之偏颇。

(4)交易费用理论在强调交易费用重要性时,忽略了经济组织变动对于直接生产成本的影响。交易费用的节约被视为是企业存在的唯一决定因素,忽视了经济组织在发挥协作劳动的社会生产力方面不可替代的基本作用。实际上交易费用理论暗含了这样一个假设,即经济组织形式的变动对物质生产过程本身没有影响,这个假设显然与实际不符。

交易费用理论自产生至今只有短短几十年的时间,其理论本身还很不完善。应该说,这是符合理论发展一般规律的,我们不必求全责备、操之过急。新制度经济学的产生、发展,既与社会经济现实有关,也与法学、组织行为学、文化人类学甚至哲学的理论发展有着密切的联系,知识的共生性表明,交易费用理论的完善,制度安排正反馈机制的进一步规范化,有赖于人类智慧的新一轮积淀。

注释

[1]郑维敏:《正反馈》,清华大学出版社1998年版,第1页。

[2]凡勃伦:《有闲阶级论》商务印书馆1964年版,第138页。

[3]马内亚·曼内斯库:《经济控制论》,中国社会科学出版社1989年版,第22~26页。

[4][7]科斯:《社会成本问题》,载《财产权利与制度变迁》第52、20页。

[5]科斯:《论生产的制度结构》,上海三联书店1994年版,第9页。

[6]科斯:《企业、市场与法律》,上海三联书店1990年版,第5页。

[8]贝克尔:《人类行为的经济分析》,上海三联书店1995年版,第3页。

〔责任编辑:天 则〕