

产权的经济分析：从“交易费用”到“博弈均衡”

■ 汪丁丁

华盛顿大学经济系的老教授巴泽尔(Y. Barzel)，在新制度经济学圈内享有很高的声誉。他不像科斯,从法学而不是经济学角度来研究经济制度,也没有张五常那般的锋芒;他用了新古典经济分析的武器来挑战其余一切理论。他保持着广阔的研究领域,从排队等候的经济分析,到奴隶制度和法治的起源,有些像诺斯;但与后者不同,他基本上是一个微观经济学家,他不喜欢空谈诸如“文化”、“心理因素”、“意识形态”这类不可操作的概念。

摆在读者面前的这本书,是巴泽尔教授自己的产权理论研究的一个“小结”。我这么说,是因为他最近研究的重点更加偏向于国家与法律方面,而不再是制度的微观经济学案例分析。如果我们按照通常的看法把学者的思维分做两类,抽象类(abstract mind)的和实例型(concrete mind)的,那么巴泽尔属于后者。你读他的文章、著作,或与他交谈,会马上发现他喜欢寻找实例来引出他的思想或理解你的思想。接触时间长了,我意识到这种“用例子说话”的方式不仅仅是对观念加以解释的一种方式,而且,它隐含着这样的信仰:一个精心寻找的实例往往提供了比任何一种理论模型都丰富得多的内容。是案例引导制度经济学家思考,而不是制度经济学家的思考引导他们去“炮制”案例。我一直喜欢援引巴泽尔的这本书,就是因为书中讨论了大量的案例。这些例子取自以色列、美国和欧洲的历史和现实生活,它们不是被动地被叙述为“文本”。任何读者都可以重新发掘这些历史与现实生活的例子,并且从中找到新的事实,甚至否定作者对这些例子的分析。正是在这个意义上,我认为这是实例引导我们去思考。巴泽尔这本书的第1章是理论总结。在这一章里,他勾勒出了他的产权理论的基本点。根据我的理解,这些基本点是:

①一切人类社会的一切社会制度,都可以被放置在产权(或“权利”)分析的框架里加以分析。

②一切权利分析的基本单位是“个人”,所谓“组织”的行为最终可以分析成个人行为的整合。

③任何个人的任何一项权利的有效性都要依赖于(a)这个人为了保护该项权利所做的努力。(b)他人企图分享这项权利的努力,和(c)任何“第三方”所做的保护这项权利的努力。由于这些努力是有成本的,世界上不存在“绝对权利”。

④权利的转让、获取和保护所需要的成本叫做“交易费用”。如此定义下的“交易费用”之所以存在,是因为关于资产的各种有用性和潜在有用性的信息是有成本的。

⑤由于信息成本,任何一项权利都不是完全界定了的。没有界定的权利于是把一部分有价值的资源留在了“公共领域”里。公共领域里全部资源的价值也叫做“租”。

⑥产权的界定是一个演进过程。随着新的信息的获得,资产的各种潜在有用性被技能各异的人们发现,并且通过交换他们关于这些有用性的权利而实现其有用性的最大价值。每一次交换都改变着产权的界定。

⑦产权界定的演进过程有理论上的均衡状态(没有人愿意偏离这个状态):对每一个潜在的寻租者而言,寻租的边际成本等于该寻租者在其已经享有的权利下能够得到的租的边际增量。

⑧“只有一种所有制形式确实能够使来自资产的净收入(从而它对于初始所有者的价值)实现最大化。决定所有权最优配置的总原则是:对资产平均收入影响倾向更大的一方,得到剩余的份额也应当更大。”因此,资产将产生的净收入取决于关于资产的权利的事前界定。

⑨ 研究那些用于界定和转让产权的合同,这是产权分析的核心内容。所谓“市场”,“企业”,或者“政府”,“俱乐部”等等组织形式,只不过是人与人之间各种合同的表现形式。它们都可以被还原为个人以及与之联系着的一组合同。

可以看出,在巴泽尔的产权理论里,“交易费用”概念已经不再起主要作用了。起着主要作用的是“公共领域”(public domain)概念。而博弈论也许是描述公共领域里寻租者们行为及其结果的最好工具。巴泽尔虽然没有明确使用“博弈”概念,但他的案例分析充满着博弈论描述。也正因此,我把这本书当成新制度经济学从“交易费用”到“博弈均衡”的发展的一个重要转折点(参见汪丁丁,《从交易费用到博弈均衡》,《经济研究》1995年9月;“产权博弈”,《经济研究》1996年10月)。

这本书接下来的八章,是巴泽尔对自己以及与他的思想发展关系密切的几个经济学家的研究成果的介绍。巴泽尔自己因研究“排队问题”(第2章)和奴隶制度的经济学分析(第6章)而成名。“排队”被认为是所有非市场资源配置方式中最重要的一种。而巴泽尔从



66 可以看出,在巴泽尔的产权理论里,“交易费用”概念已经不再起主要作用了。起着主要作用的是“公共领域”(public domain)概念。而博弈论也许是描述公共领域里寻租者们行为及其结果的最好工具。巴泽尔虽然没有明确使用“博弈”概念,但他的案例分析充满着博

99 弈论描述。

研究奴隶制度的兴衰推导出关于国家与法治起源的重要线索,并且,他在第6章里批评了因为研究奴隶制而得到诺贝尔经济学奖的福格尔的“非制度经济学”的看法。巴泽尔认为奴隶主监督奴隶劳动的成本和政府保护奴隶主对奴隶的财产权利的越来越高的费用最终导致了奴隶制度的废除。

在对五花八门的“合同”进行制度经济学分析之前,巴泽尔讨论了最简单的“地主—农民”合同的四种形态(第3章)。在介绍张五常

的博士论文(关于土地合同的讨论)的同时,他正确地指出张五常以个人风险态度来解释在亚洲地区如此普遍的“分成合同”是不成功的。因此,巴泽尔提出他自己的一个解释:由于监督土地肥力的变化非常困难,地主与农户倾向于接受“分成合同”。

在第4章里,前面列出的第6个基本点被进一步展开。由于一项资产可以有許多属性(有用性或潜在有用性),并且这些属性完全由一个人占有往往不是最有效率的产权安排,所以对一项资产的所有权往往被分割给若干技能各异的个人。当这些人的利益之间不是完全一致的时候,就产生了“组织”的必要。因此,巴泽尔定义“组织”为“对所有权被分割的实体的管理”。进一步,他认为“企业”存在的理由在于“大型设备时常有重要属性易产生公共财产问题,所以……它们将由某一集权的组织所拥有,……称为企业”。这也是博弈论制度经济学家们(例如哈特和莫尔)的看法。巴泽尔批评了科斯将交易合同简单地分为“企业”和“市场”两类,他列举事实说明许多合同既不属于“企业”也不属于“市场”。和张五常的观点一样,巴泽尔主张把“企业”和“市场”还原成“合同”。在这一章里,巴泽尔对火灾保险和股东对“挑选经营者”风险的担保职能的分析相当精彩,结论也与众不同。

前述第7个基本点在第5章(“权利的形成”)里得到展开,这就是我所谓“产权博弈”的解释。其中起了重要说明作用的是阿姆拜克的“强力制造权利”的例子。在这一章里,巴泽尔批评了德姆塞茨的观点。后者曾经认为当一种公共资源的产权价值上升时,公众倾向于把这种资源的经济界定得更加清楚。而张五常和巴泽尔分别指出,决定了产权界定的不是资源的总价值(租),而是资源对特定个人(潜在寻租者)的价值减去攫取资源所需的成本(寻租成本),即资源的净价值(净租)。因此,“先验的推理不能表明私人所一定会比政府所有更具有效率。”

对私人权利的限制是否必定降低效率?许多新制度学派的领导人对这个问题回答是肯定的(例如张五常)。巴泽尔批评了这种“盲目自由化”的倾向,指出,当资产具有许多有用属性并且为了实现这些属性的最高价值把这些属性分属给了许多个人的时候,限制每一个所有者的权利往往是防止个人侵占“公共领域”的有效安排。例如“效率”要求电冰箱

制造商保修并且占有“制冷剂可能泄漏”这一属性(由于用户往往缺少这方面技术的信息),虽然购买了电冰箱的人占有着“电冰箱制冷”这一属性。“效率”于是进一步要求限制电冰箱使用者的使用过程,例如不得用于商业目的或者不得违反操作规则使用冰箱。许多“道德风险”问题都可以当成交易双方从“效率”出发而对各方的“私有产权”加以限制的理由。巴泽尔进而讨论为什么许多非市场配置手段要比市场配置手段更有效率,例如“无偿献血”比卖血更有效率。这些是第7、8、9章的内容。

在结论(第10章)里,巴泽尔再一次强调了“公共领域”概念的普遍性:“公共领域随处可见。商品世界中成千上万的属性都可置于其中;……”而为了防止参与分工合作(“把同一商品的所有权分解开,归不同人所有,可能效率会更高”)的个人随意侵占公共领域里的价值,就必须对每一项权利施加限制条件。“为监督和维护这些限制条件的执行,就需要组织。”

我觉得巴泽尔教授在结尾时的那一段话非常精确地说明了他写这本书的目的:“……经济学家们既然否认产权分析方法,也就很难避免做出不使用的假定,并且往往难以自圆其说。他们的经济模型都很简单,不是假定某些交易费用根本不存在……,就是假定其他人因信息成本过高而根本得不到任何信息……”。如果追问一下:是谁拥有某种商品的一切特殊属性,什么样的‘所有者’才能真正支配‘自己的’那些商品,就已经很接近于探讨交易费用问题了,也就不会再轻易地作出上述假定了。”必须指出,巴泽尔此处使用“交易费用”概念不是通常新制度经济学家使用的“交易费用”概念。后者被理解为任何一个制度的“运行成本”,尽管许多制度根本不是参与交易的个人可以选择的。巴泽尔在这本书里避免讨论如此广义的“交易费用”,他把自己的“交易费用”概念限定为“权利的获得,保护与转让的成本”。而“权利”总是个人的权利,这就避免了“交易费用”概念的困境。不过,仔细阅读本书,读者不难意识到,彻底的产权分析要求一种博弈论的眼光。而在博弈论眼光下,产权安排与资源配置是同时被博弈决定的,正好像寻租者们的博弈均衡不仅决定了资源在人们之间的配置,也同时界定了寻租者们对资源的不同权利。

经济学中的数学方法:有待澄清的几个观念

■ 中国社科院经济研究所 胡怀国

经济学中的数学方法是一种非常有用的简化工具,经济学家运用数学模型的精妙之处在于“经验”而非“逻辑”,不同经济模型之间的互补性远大于替代性。

两大体系的命运

经济学界“数学化”的高歌猛进与饱受抨击,似乎已成为一种现象:年轻学子的推崇、学术“主流”的自信、部分学者的猛烈抨击等相互交织,令人眼花缭乱。在高校里,在学术杂志中,在“规范化”、“与国际接轨”的大旗下,“数学化”大潮浩浩荡荡;在不少人眼里,不玩点数学模型,似乎就成了不入流的边缘学者。与此同时,对于“言必称数学模型”之辈,不少学者抨击其“纯粹是欺骗天真的经济系学生”,“动机不纯”兼“后果严重”。为避免陷于泛泛而谈,不妨考察一下“两大体系的命运”,即“哥白尼体系”和“凯恩斯体系”的际遇,它们或多或少都与“数学方法”有关。

数百年来,哥白尼的“日心说”似乎已成为“方法”问题的经典案例。经济学大师亚当·斯密开始做学问前,就曾先拿它“练手”(牛津大学求学期间即着手积累素材)。我们生活在21世纪,相对论、量子力学等已有近百年历史,“地心说”、“日心说”谁错得已不重要(参照点而已,浩瀚宇宙,任何一点均堪此任,选择可谓无穷),但该体系的命运还是耐人寻味的。

哥白尼体系面世之初,确实存在太多的先天不足:

(1)基础理论方面,牛顿力学(包括万有引力)出现之前,“哥白尼体系”简直是匪夷所思:地球飞速自转,“在赤道附近的每一点将日行2.3万英里,即时速1000英里或每分钟近16英里,比炮弹还要快”(斯密:《哲学论文集》,格拉斯哥版第78页)。

(2)在理论框架上,在开普勒提出“椭圆轨道”和“非匀速运动”之前,“正圆轨道”和“匀速运动”经常令该体系狼狈不堪。

(3)在理论应用或经验方面,哥白尼体系对现实世界的解释,远远比不上传统的托勒密体系精准(预测能力大致旗鼓相当)。言及此,不免想起“布鲁诺悲剧”:拿着这样的“武器”到处“叫板”,不出事才怪。

尽管如此,既然有“哥白尼革命”之谓,亦非浪得虚名。尤其在斯密眼里,该体系最大的优点是“简洁”——尤其是引入牛顿力学之后。有关启示至少包括:

(1)哥白尼体系是一个数学模型,同经济学中的数学模型并没有本质区别;

(2)不同的数学模型,在很大程度上依赖于假设前提(选择地球还是太阳为参照点);

(3)好的数学模型,应该是简洁的、开放的:如果没有牛顿力学,哥白尼体系将一无是处;

(4)数学模型的好坏,最终取决于经验证据:没有伽利略的经验观测,哥白尼体系还要走许多弯路!伽利略曾经说过,“世界是一本以数学语言写成的书”;但他还说过:“一切推理都必须从观察与实验中来”。

对于经济学家而言,“凯恩斯体系”耳熟能详,仅简要归纳如下:

(1)与哥白尼体系不同:它从现实来,到现实去,且符合人们直觉。

(2)凯恩斯主义模型非常简洁,故而“开放”,便于进一步发展。凯恩斯的《通论》,并没有使用数学语言,但易于数学化;希克斯(1937)等归纳的IS-LM模型,加减乘除而已,手工计算亦无多少工作量;萨缪尔森(1947)提出的比较静态分析,更令IS-LM模型简单直接、含义丰富、便于应用。

(3)凯恩斯主义发展的勃兴,恰逢经济数据和计量经济学快速发展的时期。借助于IS-LM模型和计量分析,任何人都可以便捷地输入数据、精确地估算出IS和LM曲线的有关参数,政策分析成为简便、直接、准确的“简单劳动”。

哥白尼体系和凯恩斯体系的不同命运,既说明了数学方法的妙用和经验检验的重要性,也说明好的数学模型应该具有什么样的特点:简单实用、便于经验检验。

数学方法:简单 VS 复杂

数学是经济分析的一种简化工具,“简化”是数学应有的意:“自然界喜欢简单化,而不爱用许多冗余的法则夸耀自己”(牛顿:《自然哲学的数学原理》法则1)。经济学大师马歇尔亦曾指出,“数学上的熏陶有助于运用极其简练的语言来清楚地表述经济学推理的某些一般关系和某些简短的过程”(马歇尔:《经济学原理》附录四)。

两大体系的命运同其简洁性有关,目前流行的DSGE模型的命运亦是如此:早在上世纪80年代,真实经济周期模型已为其提供了基本框架,新凯恩斯主义已考虑了各类“粘性”处理技巧,但始终略显繁杂,难以步出象

牙塔。此后,随着各类简化方法的引入(如“Calvo定价”,简单的一个调价概率参数便可轻松处理“粘性”问题)和计量技术的发展(计量软件使得极大似然估计、数值模拟等成为一个半傻瓜过程),DSGE模型才终于流行起来,从纯理论界步入央行等应用研究机构。

就“简洁”而言,D-S模型(迪克西特、斯蒂格利茨:《垄断竞争和最优产品的多样性》)令人印象深刻:借助于一个简单的D-S效用函数,就把规模经济情形下的分析几乎简化到完全竞争的程度,进而推动了内生增长理论、新贸易理论和新经济地理学等一系列理论创新。而诺奖得主克鲁格曼在《收益递增、垄断竞争和国际贸易》(1979)和《规模经济、产品差异和贸易模式》(1980)等论文中的“简化”,更是令人叹为观止:一种产品、一种要素(劳动)加上进一步简化的D-S生产函数,把规模经济、产业内分工时代的国际贸易问题梳理得清清楚楚,并以此开启了国际贸易理论新时代。

当然,因研究目的不同,经济学中的不同模型各具特色,有简单模型,也有复杂模型。不过,就现有文献而言,复杂的数学模型往往是该理论不成熟的表现,或有关经济理论处于初级阶段的标志,而不是相反。在这个问题上,国内某些学者似乎理解反了,似乎觉得模型越复杂,理论就越有深度,自己的水平就越高。事实也许相反:譬如自然界,山谷枝繁叶茂、虫鸟嘶鸣、热闹非凡,但不能说这个世界上就没有崇山峻岭、碧海波涛,只能说你站得不够高!

数学模型:逻辑 VS 经验

经济学中的数学模型,不仅涉及数学自身的“逻辑”属性,而且同经济活动的“经验”性质有关,不能仅仅强调前者而完全忽视后者。在古希腊哲人(怀疑论者)看来,演绎和逻辑推理并不能产生新知识,“演绎说不出任何相对于已经蕴含在前提之中的东西而出的新东西。在这种意义上,演绎是缺乏新意或同语反复”(希尔贝克、伊耶:《西方哲学史》第118页)。经济学中的数学模型同样如此,它的结论隐含在假设前提之中,而假设前提更多地属于“经验”而非“逻辑”范畴。

“形而上者谓之道,形而下者谓之器,化而裁之谓之变,推而行之谓之通,举而错之天下之民,谓之事业”(《周易·系辞》)。对于经济学家而言,数学模型中的数学推导(逻辑)属

于“器”,基于经验的各类假设和模型设定属于“道”;经济学家运用数学模型,应该“化而裁之”、“推而行之”、“举而错之”,如此才可“谓之事业”,而这种“事业”涉及诸多“经验”层面的东西。在这个问题上,国内经济学界似乎过于迷恋数学模型的“逻辑”属性,而对其“经验”属性重视不够。对于经济学家而言,数学模型的逻辑属性固然必不可少,但对于经济学“事业”远远不够。深陷其中,极易如纣王般“作奇技淫巧,以悦妇人”(《尚书·泰誓》)。

以最优行为为例。在经济理论和数学模型中,通常假设每个市场主体都是精于计算的、理性的利益最大化者。该假设或效用函数的具体形式,并非严格的逻辑结果,而是一种经验的概率判断。以普罗大众为例,一日之内可谓决策无数:起床时间、牙膏品牌、早餐喝咖啡还是豆浆、上哪家网站、听哪首歌、读哪本书等。这些决策,涉及历史文化传统、个人习惯和家庭传承、客观条件和外在约束、潜意识、本能冲动甚或纯属偶然等诸多因素,并非全部是审慎计算、理性选择的结果。经济学家之所以选择“理性”,在很大程度上是基于概率事件的经验结果:个体间的相互抵消和个体内的路径依赖等,令理性选择可以“大致近似”人们在现实生活中的行为选择。

而这种选择,基于的主要是“经验”而非“逻辑”。仍以DSGE模型为例,不论该模型如何精美,仍需以其数值模拟(校准)结果是否“足够接近”现实经济为判断准绳;不仅如此,况且不论数据本身的问题,现实经济诸变量往往因时因地而异,这种基于数值模拟和历史经验数据的对比,仅限于“已经发生的事实”,故被人们批评为“以复杂的数学模型讲述众所周知的故事”。

事实上,盯住数学本身的内在逻辑,而忽略经济模型本身的经验性质,很容易陷入无聊的游戏数字,凯恩斯曾对此做过激情抨击:“在近来的‘数理’经济学中,只能代拼凑之物的部分实在太多了;这些部分的不精确程度正和它们赖以成立的假设条件是一样的。假设条件使那些作者们能在矫揉做作和毫无用处的数学符号中,忘掉现实世界的复杂性和相互依赖的性质”(凯恩斯:《就业、利息和货币通论》重译本第309页)。

经济模型:替代 VS 互补

毫无疑问,现实经济存在一些共同的东西甚至规律,但不同的时代、不同的国家,亦

必然面临特殊的问题。在这个意义上,古往今来的经济理论和模型,谈不上绝对的高低对错之分。国内学术界似乎过于强调经济模型间的“替代性”,而忽视了经济理论之间的“互补性”,进而认为当前流行的经济模型是“高级的”、正确的,而过去的经济理论似乎全是“垃圾”。果真如此,不仅太过小觑数百年来经济学家的智慧,而且有“视现实经济为玩物”之嫌;果真如此,经济学家很可能从“知识分子”退化为标准化“流水线”上的“高级产业工人”,成为《国富论》第五篇批评的有技术、没文化的群体。

笔者一直认为,任何经济理论和经济模型都有可取之处,它们之间更多地是互补而非替代关系,需结合时代背景和研究目的辩证看待。譬如重商主义,在现代经济学家眼中似乎一无是处,但在市场体系构建之初,借助于国家力量,对内打破封建制据,构建统一市场,对外武力开拓潜在市场(把“非市场”变为“市场”),在特殊条件下并非全然没有道理(相对于大使命而言,其具体“器物”层面的谬误并不重要)。一旦市场体系开始良性运作,打破垄断,自由市场自然成了古典经济学的首要选择。

不妨以人们熟悉的凯恩斯主义和新古典宏观经济学为例。按照市场机制是否对有关冲击做出了充分反应,我们可以将经济问题分为短期问题和长期问题。传统凯恩斯主义针对的是短期问题,探讨的是“短期怎么办”;新古典宏观针对的是长期问题,分析的是“如果短期这么办,长期会怎么样”。没有凯恩斯主义,ZF部门将束手无策;没有新古典宏观经济学,ZF部门将一错再错!现代经济缺了谁都不行!在这个意义上,二者是互补,这也是曼丘(2006)将凯恩斯主义称为“工程师”、把“新古典学派”称为“科学家”的主要原因,并认为“如果宏观经济学家始终记住他们的双重角色,那么该学科的进展将更为顺利、更卓有成效”(《作为科学家和工程师的宏观经济学家》第30页)。

现代市场经济在中国的历史并不长,市场机制尚未完善,同样的市场调整过程也许会经历更长的时间。从这个意义上讲,我们面临的许多中长期问题很可能是经济学意义上的“短期”问题(市场机制尚未做出完全调整),但国内学术界似乎有着用长期框架、分析短期问题的倾向,再加上过于重视数学推导、轻视经济学的厚重性和现实性,影响了对现实经济问题的准确判断。(下转 03 版)