

科斯经济学方法评述

■ 浙江财经大学经济学院教授 茹玉骝



编者按:

特定的研究方法内生于具体的研究对象,两者之间具有内在的一致性。本文对科斯所秉持的基于“理论假设现实性”的经济学研究方法进行了较为系统的讨论,分析了这种研究方法的一般特征、历史传承及对未来经济学发展的意义。敬请阅读!

一、引言

人们通常把罗纳德·H.科斯与“企业的性质”“社会成本问题”两篇文章中所涉及的两个重要概念“交易成本”“科斯定理”和两大经济学流派“新制度经济学”“法经济学”紧密联系起来。这似乎给人们一个错误的印象,即科斯教授作品少而精,唯有“企业的性质”“社会成本问题”两篇重要的文章最为精要。而实际上科斯经济学主题广泛,对于其他作品的忽略可能会导致我们无法全面认识其所秉持的“基于理论假设现实性”研究方法的内在一致性和独特性。对科斯经济学方法论过于简单的理解,对科斯经济学思想的传播产生了负面的影响。在这个背景下,本文试图通过对罗纳德·科斯研究文本的解读,对其一生所秉持的“基于理论假设现实性”经济学研究方法特征、假设现实性的基本含义、现实性假设确立等内容开展讨论,从而对科斯经济学研究方法做一次整体性的回顾。

已有学者从不同的角度对于科斯经济学方法论展开了研究。Zerbe 强调了科斯在“社会成本问题”中隐含的把零交易成本作为基准,来说明外部性讨论过程没有考虑到交易成本的存在。Hsiung 进一步阐述了这种观点,并把它归结为一种与加里·贝克尔(Gary Backer)最大化方法(Maximizing approach)相对应的设立基准点方法(Benchmark approach),认为科斯的分析方法更具有一般性,也更容易为公众所接受。但这种观点似乎很容易产生这样的错觉,即基准点方法不为新古典经济学所用,而为科斯所特有的研究方法。事实上,主流经济学中基准模型分析方法是一种通用的方法。科斯在“社会成本问题”讨论无交易成本情况,主要是说明庇古提出的用税收和赔偿等解决外部性的方法在逻辑上没有必然性,而并非对零交易费用与产权关系无关联的强调。科斯关注的是交易费用的存在对产权制度重要性,因为制度作为产权节约的装置,会对生产组织结构产生影响。因此,用基准点的方法来概括科斯研究方法的特征并不是很完整,似乎忽略了科斯的真意。

也有学者从研究对象角度解读科斯经济学方法。Wovng 比较了科斯经济学方法论和其他理论的方法论,强调理解科斯经济学方法论的一个前提是,科斯所强调的经济学研究对象必须是以制度和经济系统运行为本,研究对象和研究方法具有密切相关性,假设现实性研究方法必然导致新制度经济学的兴起。这一点符合科斯强调的经济学研究方法必须考虑研究对象特殊性的观点,以具体制度为对象的经济学研究必然要求一种具体的而非抽象的经济分析方法。此外,Maki 采用垂直分离和水平分离(vertical isolation and horizontal isolation)等抽象概念,讨论科斯如何从现实中抽象出理论命题的一般方法论。这只能作为事后方的方法描述,而非科斯本人。在这其中作为事前的刻画,与本非科相近的,周其仁认为科斯经济学研究方法由三要点构成:第一,在真实世界里找学问;第二,重点调查问题的约束条件;第三,把从实例中得到的认识一般化。这三点对于理解科斯如何从经验调查中获取经济学理论的一般过程作了较好的概括,但等于如何把问题转化为可观察事实,如何基于假设现实性提出研究问题等未作具体展开。上述文献大多从比较的角度讨论科斯经济学的方法论,对于科斯所强调的理论假设现实性问题虽有涉及,但并未作系统性讨论。

本文以科斯本人的研究文本为例对其方法论开展讨论,结构安排如下:第二部分讨论科斯提出的经济学研究“理论假设现实性”的含义;第三部分讨论“理论假设现实性”对于理论问题提出的重要性;第四部分讨论如何通过调查确立“现实性理论假设”,强调假设确立是以现实世界调查为基础;第五部分讨论如何基于“现实性假设”提出理论命题;第六部分讨论基于假设现实性的经济学研究方法和研究对象的内在联系;第七部分为总结部分。

二、理论假设现实性的含义

假设是经济理论的基础。在“企业的性质”

质”一文中,科斯开宗明义指出经济学家“考察其理论基础……是不可或缺的,因为这不仅可以避免因对这些假设缺乏了解而造成误解或引发不必要的争论”。在完成“企业的性质”一文的过程中,科斯对罗宾逊夫人提出的经济理论的假设条件两大因素:一是假设是否使经济学变得易处理,二是假设是否符合现实世界一予以了关注。科斯则要求自己关于企业的假设——企业是市场价格机制的替代物——“既是易处理,同时也是符合现实……”本文对企业的定义不仅是符合现实的,也就是与现实世界厂商的含义相互吻合;而易处理,即是可以用马歇尔所发展的概念来解释,有的经济学工具,边际与替代的概念来分析,合在一起就是边际替代”显然科斯强调了两者的可协调性和一致性,并且对于“理论假设的现实性”尤为重视,并贯彻于其整个学术生涯。

科斯对理论假设现实性的强调常被一些经济学家误解。Posner 错误地认为科斯继承了一种反理论的传统,并对抽象假设怀有敌意。对此科斯专门撰文,引用自己的《经济学家该如何选择?》一文中关于假设现实性的观点予以了强烈的反驳:“毋庸置疑,我们的假设不应该完全是真实的,因为我们并不清楚如何处理而把某些因素剔除,也有因为我们从成本和收益角度看如果把一些因素纳入会觉得不划算,一旦纳入会使得我们对于现实世界分析变得更为复杂,当然假设非现实性的其他因素还可能是因为它们压根就不相关。”科斯实际上“并不是不喜欢抽象,但是抽象的程度是否恰当取决于问题的本身,反对的是不分青红皂白的抽象或者那种对我们理解经济系统运行并无益处的抽象”。可见科斯的强调,假设现实性也可能是基于现实世界的抽象,因此这种抽象并不完全是以服务理论发展为宗旨,而主要是以加深对现实经济系统运行理解为目的。可见提高对现实世界认识是现实性假设的本质含义之一。

除此之外,科斯强调的理论假设现实性还有无其他的含义呢?在“企业的性质”一文发表前,其中包括马歇尔的生产第四要素假设、克拉克和奈特企业家经理协调假设。它们虽然刻画了企业功能的某个部分,却缺乏企业内在特性的一致性描述。科斯提出的关于企业存在的理论假设是:企业内部命令式资源配置的方式是对市场价格机制配置方式的替代。与已有理论相比,这一假设更具有一般化,包含了上述其他经济学家的观点。更为重要的是,它刻画了企业内部协调关系替代市场合约关系的本质。由于边际替代是微观经济学的基本分析工具,因此关于企业合约本质的理论假设是既现实又易处理的。

这种易处理性不仅意味着可以用已有的简单的经济学概念对理论进行阐述,也意味着理论本身是能够被检验的。科斯对于企业存在性的解答是“市场的运作需要一些成本,如果组成一个组织,并授权某人支配资源,就能节省一些使用市场的成本”。他认为企业作为市场交易成本节约的装置而存在,于是企业替代市场这一假设基础上获得的条件——市场交易成本——来进行考察。他认为企业的规模“会扩张至一笔额外的交易由企业安排在内部进行的成本,等于公开市场进行同一笔交易的成本,或由另一家企业来处理成本为止”。因此,市场交易成本的大小会影响到企业的规模大小,对此科斯专门作了讨论。综上所述,科斯秉持的理论假设的现实性至少有三层含义:一是有助于加深对现实世界运行的认识;二是一般性(能刻画研究对象本质特征);三是据此推导出理论的可观察性与可检验性。从这些含义来看,基于理论假设现实性的研究方法本质上是一种经验主义的研究方法,理论命题的可证伪性决定了这种方法的科学性。

三、基于假设现实性提出理论问题

对于理论假设现实性的长期关注,构成

了科斯在诸多研究中提出重大理论问题的基础,也直接帮助科斯找到了所讨论的具体问题或研究对象。理论假设和现实经验观察往往矛盾重重。科斯很多研究大都是从对现有理论假设的现实性提出质疑和问题开始的,用经验观察提出现实性的假设,对现有理论进行检验和证伪,获得真实的理论命题,改变了人们对经济系统如何运行的认知水平。其中代表性作品包括“英国的熏肉生产与生猪周期”“企业的性质”“边际成本定价论战”“《社会成本问题》,以及后来的“经济学中的灯塔”“经济学的误导:以费雪车体和通用汽车为例”,等等。每篇文章都从假设现实性出发提出了有意义的理论问题。

在 20 世纪 30 年代早期,关于“企业的性质”研究中,科斯就以理论假设现实性作为起点,发现了现实经验观察和理论假设之间的一个重大漏洞。即如前面提到的理论上对企业有若干种假设,而现实世界中资源配置既以市场价格机制形式来配置。同时又以企业内部行政命令方式来配置,已有关于企业的假设无法解释这种现实,“经济体系是靠价格体系来协调运作……管理是在协调厂商内部生产要素。这两种歧异的观点该如何调和?”。基于以上困惑赴美国对企业行为进行调查开展研究,就调查的结果撰写了“企业的性质”这一鸿文。

此外,基于对现实的观察,在 20 世纪 30 年代科斯和罗纳德·福勒(Fowler)还对英国生猪市场价格波动周期问题进行了一系列研究,凸显出科斯对理论假设现实性的重视。科斯等对当时流行的用于解释价格波动的“蛛网理论”(Cobweb Theorem)进行了批判性检验,发表了关于英国生猪生产周期形成原因和文章者预期行为对经济研究的一系列文章,其中包括“英国的熏肉与生猪周期”“生猪周期:一种反驳”“英国生猪周期:一种解释”和“生产者预期的分析”等。“蛛网理论”在解释价格波动方面的核心观点是,认为生产者只会根据当前的价格而非未来预期而作出反应;需求发生变动时,生产者会根据市场价格调整而发生变动,价格的调整会导致市场价格调整而呈现价格波动。当需求价格弹性大于供给价格弹性,价格调整幅度就会收敛,并最终形成市场均衡;反之,如果供给价格弹性大于需求价格弹性,价格调整幅度就会发散,于是就不能形成市场均衡。这种对价格波动成因的解释固然逻辑自洽,但它是基于一个重要的非现实性假设:即生产者只对当前价格作出反应,而不会对未来价格变动作出预测。显然这个假设和经验观察并不一致。科斯等提供一种基于生产者预期进行生产调整的新价格波动理论。他们调查和统计方法相结合的研究结果表明:“养猪业并没有假设目前的价格在未来维持不变,当价格低得离奇时,他们预期未来价格会上扬。”因此他们认为农户非理性预期假设是错误的,相应的蛛网理论应该予以抛弃。当后人误认为科斯反对经济理论形式化的时候,殊不知科斯教授是较早将统计学引入经济学研究的开创者之一。

科斯对于理论假设现实性的强调也反映在“边际成本论战”(The Marginal Cost Controversy)一文。不完全竞争定价问题的讨论是 20 世纪 30 年代理论界的热点。对于平均成本递减情况下的定价问题或者说公共事业部门的定价问题,包括豪泰林(H. Hotelling)、勒纳(A. P. Lerner)、米德(James Meade)和弗莱明(John Fleming)等经济学家都认同一种对公共事业部门采用边际成本定价原则,具体的观点包括:“(1)单位产品所支付的价格等于边际成本;(2)由于平均成本递减,以至于边际成本小于平均成本,因而支付给该产品的总金额小于总成本;(3)总成本超过总收入的部分应由政府支付。”而这种最优定价方法能够有效实施需要三个重要的假设:一是政府提供产品作为市场机制的一种替代,它的运作成本至少不比市场成本要高;二是政府能够低成本地获知企业亏损相关信息,即有关

边际成本与平均成本的差价,以便提供恰当的政府补贴;三是政府的税收不会带来严重的收入重新分配的效应。然而现实中,政府收税方式提供服务的方法替代市场交易方式时,“如果没有价格机制,政府需要支付组织成本”。后面两个假设需要政府有足够的信息,但是信息收集本身需要耗费资源,所以这几个假设在现实世界中是不能满足的。边际成本定价法在政策上是无法实施的。在此背景下,科斯对上述颇为流行的不完全竞争产品的最优定价问题予以了重点考察,“边际成本论战”一文由此而生。科斯教授提出了运用“多步定价”(multi-part pricing)方法(在该文中提出的是两步定价法),即消费者根据平均固定成本支付一笔钱抵消固定成本(运费),然后再根据边际成本来收费。这样可以避免成本定价法的一系列缺点。而数十年后多步定价法才成为产业组织理论教科书的内容。

类似地,科斯在“社会成本问题”一文中的分析表明,如果不考虑交易成本,那么就一定有非通过庇古所提出的征税方法来纠正外部性的问题。产权的重新界定本身也同样可以达到目的,显然无交易成本的假设是不现实的。因此当交易成本存在情况下,法律对于产权的界定是非常重要的。错误的产权界定,可能使得那些明显可以以低成本改进资源配置效率的交易无法实现。一些著名教科书把灯塔想当然地作为纯公共产品代表,其假设是认为灯塔服务不具有排他性,收费的困难性使得灯塔服务只能依靠政府征税来提供。对于这一公共产品经典案例,科斯对这种假设和理论提出了异议,因为这种理论仅仅是一种逻辑的推演,没有任何的根据。科斯希望弄清楚,现实世界中灯塔服务究竟能否由市场或私人来提供;如果能,那么又是以什么样的方式提供的。为此科斯翻阅了大量英国灯塔建造的历史资料,意外地发现,在英国灯塔建造的早期历史中,很多灯塔不仅是私人出资建造的,并可以通过一定的组织向过往船只收费。从而驳斥了流行的认为公共产品供给市场失灵时(无法收费或收费成本太高)需要政府供给的经典论断。如果离开了真实制度体系整体运行方式的考察,仅凭借逻辑很可能获得很完美的理论,但可能是极端错误的完美理论。

假设的现实性是获得正确理论的基础,科斯另外一篇近作“经济学的误导:以费雪车体和通用汽车为例”为我们提供了另一个范例。Klein、Crawford 和 Alchian 提出了目前在理论界流行的一种解释企业纵向一体化行为的观点:即当上下游企业之间存在投资专用性投资导致的敲竹杠问题时,企业会通过兼并的方式解决这个问题,以提高生产和投资的效率。该理论的一个假设是专用性投资会产生敲竹杠的情况,同样,在科斯看来这个假设非现实性的,并非基于事实本身的考察。科斯教授基于他 20 世纪 30 年代对于通用汽车收购费雪车体厂(Fisher Body)的实地调查,证明收购并不是由于专用性投资的问题,而是为了降低运输成本,保证车体厂能够位于通用汽车流水线附近。这说明确实假设的专用性投资导致敲竹杠理论并不真实,其中的理论逻辑链条存在严重的误导性。科斯对 A. O. 斯密斯工厂与通用汽车长期合约关系进行考察,发现当时的商人对于资产专用性带来的风险也不以未然,认为可以通过“另外一些合约设置予以解决”。那么为何如此众多著名而诚实的经济学家会相信这个“诚实的错误”呢?科斯教授认为一个深层次的原因是“经济学已经变成一个由理论推动的学科,按照斯蒂格勒的话,‘自从发明效用最大化理论以后,经济学就很少关注事实’……所研究的系统是存在于经济学家头脑中而不是存在于这个逻辑,而没有发现事实”。理论假设现实性是提出有现实解释力理论命题的必要条件之一,“当他们的理论不是基于企业是如何行为的调查结果,结论错得离谱便不足为怪了”。

四、如何提出现实性理论假设

正如上一小节分析的那样,现实性的理论假设在科斯全部的经济学研究中具有举足轻重的地位,那么如何提出现实性的理论假设呢?从前面的讨论中我们可以知道,它以大量事实调查为基础。无论是对于生猪价格周期中“生产者”理性预期假设也好,还是企业理论中企业合约性质的研究方法也好,都体现了这一点。科斯的假设方法在现实性理论假设提出和理论命题获得之间本身是密不可分的整体。假设的选择和理论命题提出都是经验调查的产物,假设真实性特征决定了所推导理论具有可观察与可检验性。这和主流经济学用形式化逻辑演绎出命题的研究方法迥然不同。本节主要围绕“企业性质”一文假设确立过程为例,说明如何在调查中确立具有现实性的理论假设。

具体到科斯所提出的“既然市场机制可以发挥资源配置作用,为何会存在企业这种组织形式”这样的问题时,如何在现实世界中

去寻找问题的答案,或者说如何寻找问题的约束条件?一旦找到了问题的约束条件,答案便唾手可得。因此首先要将问题转化为可观察的研究对象,需要找到分析问题的角度。科斯是以企业垂直一体化决策因素为研究对象开展调查和研究的,并基于他对成本理论的解悟,很自然地将企业一体化决策行为和成本节约问题联系起来。“一体化决策”和“成本节约”联系起来开启了寻找问题答案的正确方向。

其次是寻找问题的约束条件。影响企业的一体化决策最重要的因素有哪些?为此,科斯需要尽可能准确地收集研究对象(企业一体化决策)的信息。这种调查风格和方法为科斯教授一生所坚持,淋漓尽致地展现在企业的性质、英国的广播业、美国联邦通讯委员会、英国灯塔的运作机制等案例调查中。在对企业一体化决策约束条件的考察中,科斯教授的信息来源主要有两个方面:一是直接对企业和商业单位的实地考察和访谈;二是相关商业期刊的阅读。他通过走访深入美国企业,了解企业是如何处理上下游企业间生产关系。他还利用美国联邦贸易委员会的报告、贸易期刊,甚至是诸如电话黄页、商业期刊广告这样特殊的原始资料,并从中注意到了常人所忽略的重要事实:制造业企业存在自己销售和寻找代理商销售的两种模式。科斯注意到交易不仅仅可以在一体化的企业内部完成;在现实中交易更可能在上下游专业化公司之间完成;一体化方式和市场交易方式是并存的。

然后在调查中需要同时完成信息的抽取,即剔除与研究对象(一体化决策)不太相关的因素,从保留信息中抽取可以研究的事实,为理论诱导做准备。在调查过程中,科斯的十分注意诱导受访者对事实的陈述,希望得到一些能够用于研究的事实性陈述。科斯教授关注的事实内容包括中上下游企业之间采购活动是如何开展的、自己生产或采购决策是否为了节约成本等问题。因此他对福特汽车公司开展调查时称自己“像律师那样注意提问的技巧,使得我能够套取一些成本情况,同时又不至于让他们觉得他们被套取了……我所要的是那些和一体化理论相应的观点所隐含的陈述”,对福特汽车的采购着重了解了与一体化有关的供应合同、采购计划等情况。

通用汽车收购的费雪车体厂 6 个月以后,1932 年科斯参观了费雪车体厂,观察到另外一个事实:并购只是确保车体厂设在装配工厂附近,而并非因为资产专用性。这个事实表明资产专用性问题并不必然会导致上下游企业之间纵向一体化行为的发生。数周以后,科斯参观了当时世界上最大的,也是最先进的 A. O. 斯密斯车架厂。除了该厂高度自动化的一次成型技术外,它与通用汽车之间的长期合作关系无疑也给他留下了极为深刻的印象。科斯得到如下的事实:A. O. 斯密斯作为汽车沉重而重要的部件生产商是“通过昂贵的和高度专业化设备完成的,并运送到千里之外的通用汽车装配线,但是显然 A. O. 斯密斯注重汽车市场交易中上下游企业合约关系——一种区别于一体化安排的市场长期合约关系。专用性投资企业之间和谐合约关系给科斯留下深刻印象,成为其确立企业替代市场价格机制假设的关键一环。

科斯对于研究事实具有很强的信息抽取能力,使得他能够根据事实进一步提出诸如“为什么看来脱离专业化的活动却更有效?……为什么某些活动集结在一起置于一个控制之下可以降低成本?”等深刻的问题。尽管对这些问题,科斯当时还是有些迷惑不解,但这种企业替代市场交易行为如何对企业成本产生影响的路径无疑和后来科斯所找答案之间存在实质性联系。至少这里已涉及与市场这些重要组织形式“相互替代”“成本节约”与企业重要的元素。无论是科斯自己的实地调查,还是政府的调查报告,或者自己的间接调查和对可研究事实的信息抽取,为科斯教授确立关于企业的基本假设和理论的最后突破起到了关键作用。这里我们可以看到科斯确立理论假设的过程和理论的形成是同时推进的一个整体,而非从假设推出理论的先后线性逻辑关系。

五、基于现实性假设的理论命题提出

从科斯对企业性质问题的探寻过程中,我们会发现对可观察到研究对象反复调查和思考的结果。具体包括对各种理论猜想和备选方案加以排除的过程,即是以下过程的反复:理论猜想—事实检验—事实证伪—推翻假设—重新提出理论猜想……这个过程和目前流行的数据检验理论正确性的经验研究方法有很大差别。后者在很多情况下只能说明理论可能是正确的,并不构成说明判断理论正确性的充分条件,而通常只是一个必要条件,即存在其他正确的理论解释也为相同的数据所验证。

(下转 A3 版)