

“诺思第二悖论”及其破解

——制度变迁中交易费用范式的反思

李建标¹, 曹利群²

(1. 南开大学 亚太公司治理研究中心, 天津 300071; 2. 中共中央政策研究室, 北京 100875)

摘要:诺思的国家悖论被经济学家所熟悉,而他用交易费用分析制度变迁时的悖论却很少被人们所注意。诺思认为交易费用下降是经济增长的源泉,经济制度的变迁是为了节约交易费用。同时,诺思也指出长期中交易费用是在不断增长。这种短期内交易费用的下降和长期内的增长构成诺思的又一悖论——诺思第二悖论。诺思第二悖论不仅仅是诺思的悖论,也是新制度经济学关于制度变迁分析范式的悖论。对制度变迁的分析,我们需要新的选择和新的思路

关键词:诺思第二悖论;交易费用;制度变迁

中图分类号:F091.349 **文献标识码:**A **文章编号:**1001-9952(2003)10-0031-05

一、诺思第二悖论的提出

诺思在 1981 年提出,国家具有双重目标,一方面国家通过向不同的势力集团提供不同的产权,获取租金的最大化;另一方面,国家还试图降低交易费用以推动社会产出的最大化,从而获取国家税收的增加。国家的这两个目标经常是冲突的。另外,由于存在着投票的悖论、理性的无知,加之政治市场的竞争不充分和交易的对象难以考核等因素,政治市场的交易费用更为高昂。结果,政府作用的后果往往是经济增长的停滞。这就是为人们所熟知的“诺思悖论”。

我们要讨论的是诺思体系中另外一个悖论,这里称之为“诺思第二悖论”。我们对这一悖论的破解,是通过辨析诺思整个研究思路的转型及其对于制度经济学研究的意义实现的。与此同时,我们也试图辨明交易费用的社会功用、交易费用作为制度效率标准的含义等。

诺思第二悖论体现在两个方面:(1)政府界定的产权规定了经济体系中基本的激励结构,产权的变化使得组织和组织内部的企业家从事各种活动的成本收益发生变化^①,组织和个人因此调整自身的行为,推动制度的变迁。由于非正式制度的存在,调整多在边际意义上进行。调整的方向是节约交易成本。换言之,从每一个时点上来观察,交易费用在不断下降,经济效率在不断提高。正因为此,诺思认为,交易费用的下降是经济增长的关键源泉。(2)诺思和 Wallis(1986)所做的研究显示,在美国经济中,交易费用从 1870 年占国内生产总值(GDP)的 25%,上升到 1970 年的 45%。在另一篇文章中,诺思估计在今天的西方发达国家,交易费用大致占国内生产总值的 50%。张五常先生也曾讲到,在香港这样的现代市场经济大都市中,交易费用可能要占其 GDP 的 80%以上^②。因此,从长期来看,交易费用是在不断上升,经济效率是在不断下降,以至于社会可能因此陷入停顿。这又为诺思解释历史上的经济停滞提供了理由。

收稿日期:2003-04-21

基金项目:国家社会科学基金资助项目(02BJY127);南开大学社会科学基金资助项目(NK0327)

作者简介:李建标(1965—),男,山东安丘人,南开大学亚太公司治理研究中心副教授,南开大学国际商学院博士后流动站研究人员;
曹利群(1975—),男,湖南永兴人,中共中央政策研究室,经济学博士。

悖论就出在这里。一方面,从边际意义上的短期来看,交易费用总是在下降;另一方面,每一个时期的下降最后带来的是长期交易费用的增长!前者的推论是经济不断增长,后者的推论是经济陷入停顿。反正无论经济出现什么情况,都可以用同样的原因加以解释^⑤。我们将诺思体系中的这一矛盾称作“诺思第二悖论”,但它决不仅仅是诺思的悖论,而是整个新制度经济学的悖论。包括科斯、威廉姆森在内,他们都认为组织的选择标准、制度变迁的方向就是交易费用的节约。科斯认为,市场和企业的切换旨在降低交易费用;威廉姆森进一步探讨了组织的形式,但他的看法总体上和科斯是一致的。其他制度经济学家也同意,短期内交易费用是下降的。但是,长期的交易费用是在不断地上升。由此我们就产生了这样的疑问:制度变迁的交易费用标准还正确吗?如果不正确,制度变迁的方向是什么?如何对不同的组织、不同的制度进行比较?

二、诺思第二悖论的形成:诺思研究的转向

诺思体系中隐含的悖论与诺思学术思想的形成、发展、转向紧密地联系在一起。我们通过梳理诺思的研究历程,试图说明诺思的转向代表了新制度经济学应该发生的、未来的转向。

诺思(1997)回忆到,他在早期是马克思主义者,后期转向了对新古典经济学的研究。在20世纪70年代张五常和巴泽尔去华盛顿大学之前,诺思几乎没有受到现在所称的新制度经济学的影响。他在1960、1971、1973年的著作都是坚持典型的新古典经济学的分析方法。他(1971)认为,制度一定是有效率的。个人、自愿团体和政府会考虑现有制度之外的所有可能的盈利机会,并对所有可能的机会在未来各期的成本收益进行计算,结果贴现之后,他们会挑选出净收益最大的制度安排。因此,新产生的制度一定是有效率的。但是,此效率并不是用交易费用来衡量。

为了论证制度在经济增长过程中的重要性,诺思开始注意并接受交易费用的分析框架。他认为,交易费用的存在是制度存在和起作用的前提。在交易费用存在的情况下,制度的差别是解释经济增长业绩悬殊的关键性因素。接受科斯、张五常等人思想的同时,诺思接受他们隐含的判断:交易费用(作为费用)阻碍了经济增长。具体而言,在诺思(1981)看来,交易费用耗费掉人们可能从交易中获取的交易剩余,阻碍一些获利性交易的发生,最终阻碍了经济的发展。因此,诺思和其他新制度经济学家的看法趋同,他们认为,制度变迁的目的在于节约交易费用,从而提高人们相互交易的效率。于是,交易费用成为衡量制度效率的标准。

在诺思的学术生涯中,他首先是一位经济史学家,然后才是经济学家。诺思考察了工业化革命以来经济生活的变化,他在一定程度上接受了古典经济学,尤其是斯密的思想。在1990年著作的第1页和1995年的著作中都提到了斯密及其《国富论》。我们甚至认为,诺思的思想可以被视为对斯密思想的深化。诺思(1990,1995)注意到的是,伴随着市场的扩大,人们交换的范围越来越大,这一进化要求社会创立的制度能允许匿名的、不局限于某个人的跨越时空的交换。随着交换范围的扩大,专业化分工在不断深化。“超越个人的交换对于获取从专业化和分工产生的收益是十分必要的。正是专业化和分工产生了国民财富。”在交易(直接或间接地)带来国民财富增长的同时,伴随着市场的扩大和分工的深化,交换的次数越来越多,交换的环节越来越多。如同庞巴维克提到的“迂回生产”一样,交易也在越来越“迂回”。毫无疑问,随着交换日益复杂,人类变得愈加相互依赖,交易费用不断地上升。为了获取交易中的潜在收益,必须建立更加复杂的制度结构。不同国家和地区由于文化和本地经验,建立的制度和信仰体系多种多样,最后经济增长绩效自然也多种多样。诺思由此解答了不同国家历史的多样性。

从诺思接受的古典经济学的思想来看,经济增长的过程不仅是斯密提到的分工深化的过程,也必然伴随着交易费用的增加,以及适当的组织变革和制度变迁以支持更加复杂的交易。因此,交易费用的增加并不能够简单地归结为成本的增加,它是一个无法避免的副产品。但是,诺思为了沿着科斯等人的思路推导出制度的重要性时,又必须把交易费用视为成本,把降低交易费用当

作制度变迁的任务。不同的理论来源才是诺思第二悖论形成的根本。因为按照古典经济学的思想,长期来看,交易费用下降了,意味着交换的萎缩和分工的退化,继而是经济的退步而非增长。因此,为了破解诺思第二悖论,要么放弃新制度经济学对交易费用的看法,要么放弃古典经济学的看法,二者必居其一。

三、诺思第二悖论的破解:经济增长的两个方面

为了破解“诺思第二悖论”,韦森等人对交易费用进行了重新梳理。韦森(2002_a,第162~184页)首先指出,交易并不仅仅产生费用(costs),而且,交易还能够带来惠利(benefits)。“交易费用说到底是因为交易惠利而产生,而存在。”并且,“两者(指交易费用和交易惠利)在近代、现代及当代世界经济史上,肯定呈正相关的增长趋势。”基于这样的判断,韦森教授认为,“交易费用本身,并不是阻抑社会的交易和市场交换而产生,而是交易和市场交换的促进力量,一种保障机制”。韦森的观点引起了国内一些学者的讨论^①,为了应对争论和进一步澄清问题,韦森(2002_b)又进一步区分了“预期的交易费用”和“实际的交易费用”。他认为,由于预期的交易费用过高,导致了诺思提及的经济增长的停顿。如果交易真要发生,实际的交易费用可能并不高。韦森还引入了时间和空间的因素,认为个人付出的部分“沉没成本(sunk cost)”可能推动交易等。因此,他得到的结论是,交易费用并不必然带来经济停顿,长期的交易费用上升往往还具有一定的正功能(默顿)。由此,诺思内部的一些逻辑矛盾得以部分地消除。

我们注意到,韦森对交易和交易费用的分析考虑得越来越周全、越来越复杂,但他完全停留在交易的范畴,而未曾涉及生产领域和其他领域。此外,正如韦森自己(2002_a,第180页)所注意到的那样,诺思其实已经明确地提出交易能够带来剩余。并且,此概念在诺思体系中占了重要的地位。他认为,制度变迁的目的在于降低交易费用,较少对交易剩余的耗费。因此,我们认为,韦森忽略了诺思体系中的古典经济学思想。正如前文指出,诺思道明了与经济增长相伴随的两个方面,一是在生产领域,分工越来越细化,效率越来越高;二是分工细化后交易越来越多、越来越复杂,导致交易费用的上升。因此,经济增长与交易费用攀升相伴相生是正常的。单从此角度而言,我们没有必要对交易费用的功能进行重新界定,没有必要引入交易惠利的概念。或者,我们从另外一个角度来解释,韦森提到的交易惠利并不是来自交易,而是来自交易背后的分工深化。

诺思(1990)后期提出了适用性效率(adaptive efficiency)的概念。可以认为,这代表了他为消除理论体系的内部逻辑矛盾所做的努力^②。我们也完全可以从诺思自己的努力来破解悖论。适用性效率的提出,意味着诺思已经放弃了将交易费用作为制度效率的标准。诺思对悖论的理解也为制度经济学的发展提供了极富价值的借鉴。诺思认为,“适用性效率考虑的是一个经济随时间演进的方式的各种规则,它有助于一个社会去获取知识、去学习、去诱发创新、去承担风险及所有有创造力的活动,以及去解决社会在不同时期的瓶颈的意愿(1990,第108页)”。为了达到适用性效率,诺思明确引用并接受了哈耶克的观点,即在不确定的情况下,鼓励所有人在所有可能的方向上进行所有的创新。“适用性效率提供了分散决策过程以揭示解决问题的激励。我们有必要从失败中学习(1995,第109页)。”因此,制度变迁过程中包括正确组织的形成和错误组织的消失。但是,诺思与阿尔钦的观点不同,诺思认为,错误组织的消失不是简单地通过市场淘汰在瞬时实现的。市场上存在的组织和制度不一定是最优的。

通过提出适用性效率,诺思在理论体系中实现了统一。即经济增长来自分工的深化,伴随着交易的“迂回”和交易费用的增加,制度变迁的方向只是对日益复杂的交易提供支撑,而非一定需要降低交易费用。与之相对照的是,其他的新制度经济学却无以破解此悖论,实现理论内部的逻辑统一。在此情况下,我们有必要反思,甚至放弃交易费用能否作为制度效率的标准。

四、诺思第二悖论的残余：制度边际分析的困境

我们已经部分地破解了“诺思第二悖论”，解释了交易费用和经济增长的并存。但是，我们还没有能够解决另外一个问题，即短期内交易费用的下降为什么带来长期的上升？

首先，我们注意到诺思先后受到两方面知识传统的影响：一是从制度经济学继承的边际主义分析方法，二是他自己坚持的古典经济学的分析和对历史的思考。在诺思研究的后期，他放弃了交易费用作为制度分析的标准。但是，他仍然坚持了新古典经济学的分析内核（包括边际分析）。而边际分析得出交易费用下降并不一定保证长期的经济增长。诺思所关注的是长期经济增长，我们进一步的剖析表明，不能通过边际方法提供支持。所以诺思第二悖论仍然残留在诺思的体系之中。

为了清除这一残余，我们主张放弃边际的制度分析。因为边际分析是和均衡、确定性联系在一起的，而后两者对于理解制度构成了重要的障碍。这决定了边际分析方法不适合于长期的制度变迁的分析。我们需要新的范式。诺思的转向或许在一定程度上昭示着新制度经济学的转向。

首先，边际分析无法回避的一个问题是：短期的最优化并不代表着长期的最优；短期的交易费用的下降并不一定代表长期的下降。西蒙提到一个简单的事实是，局部的极大值不等于全局的最大值。边际分析考虑的恰好是局部的极大值，比如，降低交易成本。但是，它不能保障长期的最大值，比如，交易费用的下降。当且仅当世界的发展不存在着不确定性时，极大值会和最大值重合，我们也可以从另外一个角度考虑问题，即只有假定个体在开始做边际分析之前已经考察了所有可能的路径，并从中选择了最优路径，而且在以后的发展过程中最优路径一直保持不变，边际分析才可能得出长期的最大值。

制度的变迁、组织的变革等问题，对于经济增长而言，恰好是路径选择的问题，是西蒙提到的“一阶最优问题”。边际分析做的只能是“二阶最优问题”。很显然，在制度变迁和组织变革之初，上述假定是不成立的。由于环境的不确定性和个体的有限理性，我们无以得知长期的最优路径；由于无法预料所有未来发生的事件，那么，未来的不确定性因素的出现，决定了最优路径的切换。一旦路径切换，原有路径中边际意义上的改进带来的就不可能是长期的最优。因此，西蒙争辩到，不能采用边际分析方法对待制度和组织问题，他自己最后转向了“离散结构”的方法。在杨小凯的模型中，组织形式的改变是角点解的跳跃，他使用的是超边际的分析方法，而非边际的方法。

其次，在埃格特森看来，新制度经济学保留了新古典经济学的内核——完全理性、完全信息、边际分析和均衡分析。正如威廉姆森声称的那样，“新制度经济学家认为，他们正在做的是常规分析（引者注：即新古典经济学）的补充，而不是取代”。我们也注意到，边际分析的方法和完全理性、完全信息、均衡分析方法是紧密地联系在一起的^①。如果信息是完全的话，我们可以回到诺思最初（1971）的看法，制度变迁是一个选择的过程。其实，诺思在20世纪70年代中期意识到了问题的错误，因为在完全信息条件下，交易费用并不存在，制度也没有存在的必要。同样，均衡分析强调的是问题的静态，强调的是现有秩序的维持，而非现有秩序的变迁。制度变迁恰好是一个过程的分析，而非比较均衡的分析。卢瑟福批评道，新制度经济学对于制度如何变迁知之甚少，从个体行为的变化到制度的改变，其间到底是市场的作用还是政治的过程，他们并不能回答。边际、均衡、理性的分析框架，并不能够推动制度变迁理论的进一步发展。我们需要新的选择、新的道路。

注释：

①即诺思提及的相对价格的变化。通过阅读原文，我们认为，此处的 price 不是简单的价格含义，而应该被理解为“行为的代价(The cost at which something is obtained)”（《美国传统词典》对 price 的第二种解释）。由此，我们才能理解诺思的意识形态影响相对价格等论述。遗憾的是，翻译上的问题误导了一批中文读者。

②这是笔者与张五常先生面谈时，张先生提到的。

- ③相反的事实能够在同一个理论体系中得到解释,本身说明了理论体系的问题,因为它无法被证伪。
- ④韦森教授在文中提到的有《经济学信息报》的高小勇。在私人信件往来中,他还提到了林毅夫教授。感谢韦森教授提供了他在此方面的文献,并宽容地鼓励我们申明一些“不同意见”。
- ⑤遗憾的是,诺思的这种努力被他宏大的理论体系所淹没了。在他那宏大的体系中,存在着各种各样的逻辑矛盾和各种各样的“突围”方式。
- ⑥威廉姆森试图在保留新古典经济学其他几个假定的前提下对完全理性的假定进行修订,提出了有限理性。但是,正如迪屈奇评论到,威廉姆森的这种努力是失败的,只是给理论体系带来了更多的逻辑矛盾。迪屈奇批评到,威廉姆森误解了西蒙有限理性的概念,他只是接受了信息的复杂性,而抛弃了信息的不确定性的含义。我们知道,西蒙的有限理性包括两点内容,一是信息是如此之复杂性,以至于个人不能收集和处理全部的信息,二是信息的不确定性,个人连可能收集到什么信息和出现什么结果也不清楚。如果考虑到不确定性,整个新古典经济学的框架是无以承载的,它成为了决定新制度经济学发展的一个重要暗流(刘刚,2002)。

参考文献:

- [1]D North. Institutional change and American economic growth[M]. Cambridge University Press,1971.
- [2]D North. Institution ,institutional change and economic performance[M]. NY,Cambridge Uni Press,1990.
- [3]D North. The rise of the western world;A new economic history[M]. New York,Cambridge University Press, 1973.
- [4]D North. Structure and change in economic history[M]. New York,W. W North and Company Inc. 1981.
- [5]诺思. 制度、意识形态和经济绩效[A]. 詹姆斯·道. 发展经济学的革命[C]. 上海:上海三联书店、上海人民出版社,2000.
- [6]诺思. 制度变迁理论纲要[A]. 易纲. 经济学与中国经济改革[C]. 上海:上海人民出版社,1995.
- [7]North,Prologue. The frontiers of the new institutional economics[M]. Academic Press,1997.
- [8]韦森(a). 难得糊涂的经济学家[M]. 天津:天津人民出版社,2002.
- [9]韦森(b). 预期的和实际的交易费用[N]. 21世纪经济报道,2002-11-06.
- [10]韦森. 社会制度的经济分析导论[M]. 上海:上海三联书店,2001.
- [11]贾根良. 制度变迁:凡悖论传统和诺思[J]. 经济学家,1999,(5).
- [12]李建标. 经济制度变迁的基本逻辑与制度安排的可设计性[J]. 经济评论,2001,(2).

The Second“North Paradox”and Its Solution: Rethinking on Transaction Cost Paradigm in Institutional Transition

LI Jian-biao¹, CAO Li-qun²

(1. Research Center of Asia-pacific Corporate Governance, Nankai University, Tianjin 300071, China;

2. Research Lab of Central Governmental Policy of CCP, Beijing 100875, China)

Abstract: “North paradox”about nation is well-known while his another paradox about analyzing institutional transition with transaction cost has been neglected. North held that the descent of transaction cost is the source of economic growth, while the transition of institution is to reduce transaction cost. He pointed out at the same time that transaction cost in the long run is always mounting up. The descent of transaction cost in the short run and growth in the long run constitutes another paradox of North’s—the second North Paradox, which is not only North Paradox, but also an analyzing paradigm paradox about institutional transition employed by new institutional economics. We need to have new choice and new ideas to analyse institutional transition.

Key words: the second “North Paradox”; transaction cost; institutional transition