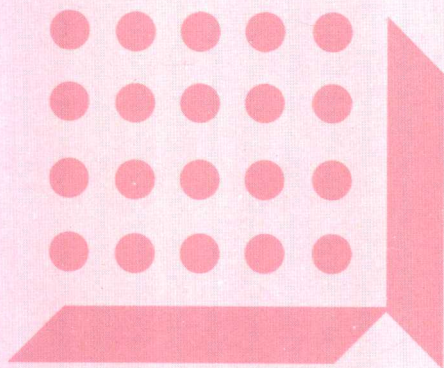


制度的性质

ZHIDU DE XINGZHI

崔鑫生 李芳 著



中国商务出版社
CHINA COMMERCE AND TRADE PRESS

制度的性质

崔鑫生 李芳 著

中国商务出版社

图书在版编目(CIP)数据

制度的性质/崔鑫生著. —北京:中国商务出版社,
2007. 11

ISBN 978 - 7 - 80181 - 788 - 4

I. 制... II. 崔... III. 涉外经济—经济管理—
研究—中国 IV. F125

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2007)第 168415 号

制度的性质

崔鑫生 李 芳 著

中国商务出版社出版

(北京市东城区安定门外大街东后巷 28 号)

邮政编码:100710

电话:010—64269744(编辑室)

010—64295501(发行部)

64266119

网址:www. cctpress. com

E-mail: cctp@cctpress. com

北京中商图出版物发行有限
责任公司发行

中国农业出版社印刷厂排版

中国农业出版社印刷厂印刷

850 毫米×1168 毫米 大 32 开本

8. 375 印张 218 千字

2007 年 11 月 第 1 版

2007 年 11 月 第 1 次印刷

印数:1 000 册

ISBN 978 - 7 - 80181 - 788 - 4
F · 1083

定价:16. 00 元

版权专有 侵权必究

举报电话:(010)64212247

目 录

绪 论	(1)
第一章 问题的引入	(7)
第一节 几个博弈案例	(7)
第二节 米勒的科层	(12)
第三节 实力元	(16)
第四节 理 性	(17)
第五节 实力元的概念	(18)
第二章 博弈的制度观	(20)
第一节 西方传统理论关于制度的观点	(20)
第二节 青木昌彦的均衡制度观	(23)
第三节 分配的制度	(24)
第四节 制度的公共产品属性	(26)
第三章 制度的性质	(28)
第一节 科斯的企业	(29)
第二节 自由经济中的相对实力	(30)
第三节 纳什的讨价还价与制度均衡	(36)
第四节 科斯定理	(43)
第五节 相对实力的显现	(49)
第六节 制度的性质	(50)

第七节 部队、监狱、警察的出现	(52)
第四章 制度的起源	(53)
第一节 一个苹果分配的案例	(54)
第二节 自由的分配均衡	(60)
第三节 公平的概念	(67)
第五章 制度的变迁	(71)
第一节 诺斯的制度变迁模型	(71)
第二节 技术驱动的制度变迁模型	(74)
第三节 利益分配模型	(75)
第四节 结 论	(87)
第六章 制度的进出口	(88)
第一节 区位与国际贸易制度	(90)
第二节 国际贸易制度的演进	(91)
第三节 制度的进出口	(93)
第四节 政府对国际贸易的影响力	(97)
第五节 国际贸易中的利益	(99)
第七章 外生的制度	(101)
第一节 加工贸易	(102)
第二节 中国的独立董事制度	(107)
第三节 1898—1912 年中国的改革	(112)
第四节 结 论	(124)
第八章 中国外经贸管理制度变迁的制度环境	(126)
第一节 加入世界贸易组织对我国涉外经济事务管理部门的 影响和要求	(127)
第二节 我国入世前后涉外经济管理制度变迁的具体约束 条件	(133)

第三节 涉外经济管理制度变迁的方向	(139)
第四节 涉外经济管理制度变迁的路径	(146)
第五节 结 论	(147)
第九章 入世前后我国涉外行政法律制度的变迁	(148)
第一节 入世对我国涉外行政法律制度的影响	(149)
第二节 我国入世前后涉外行政法律制度的变迁	(159)
第三节 结 论	(171)
第十章 入世与外贸管理制度的变迁	(174)
第一节 WTO 对外贸管理制度的要求	(174)
第二节 入世前后我国外贸管理体制的变迁 (1979—2004 年)	(199)
第三节 入世前后我国外贸管理制度的变迁 (2001—2004 年)	(215)
第四节 结 论	(248)
参考文献	(250)
后 记	(259)

绪 论

一争两丑，一让两美。

——中国古训

以政为争，不要以争为政。

——苏东坡

制度研究的传统发端于科斯的《企业的性质》。在诺斯揭示出制度对经济增长的作用之后，制度的研究似乎就成为发展中国家用来提高经济增长绩效、改善人民生活水平的重要工具。由此看来，似乎制度研究的意义重大，尤其是对于发展中国家更是如此。然而制度研究的重要意义并不在于揭示制度是否可以促进经济的增长，而在于揭示何种制度不会阻碍经济的增长。套用一句数学术语就是：制度不是经济增长的充分条件，而是其必要条件。当然，影响经济增长的因素很多。那些想从本书中寻找可以即时促进经济增长金钥匙的探宝者在读完最后一页时，将不免会有所失望。此时毛泽东的一句词“天若有情天亦老，人间正道是沧桑”或许能为探宝诸君带来些许安慰。

制度究竟如何影响经济的增长？对制度本质的探究有助于我们理解制度对经济发展的作用，也有助于解释制度变迁过程中的某些影响经济发展速度和质量的若干规律，这对于理解和指导发展中国家的经济发展具有重要意义。

一、制度的利益分配属性

要达到上述的目标,首先就应该确定“制度”的概念。在没有对制度准确定义之前,所有对制度的讨论与研究都是无源之水、无本之木。对制度的看法除目前公认的组织形式、外生规则、博弈均衡产生的共有信念(share beliefs)之外,制度还应当具备其他的基本性质。我们将用比较大的篇幅来论证制度的分配属性。正是因为制度的分配属性,制度和经济增长之间才没有必然的因果关系。从此出发,可以探究制度演变的基本途径和制度演进的动力来源。

有关制度的概念现在有三种认识:① 制度是一种组织形式;② 制度是外生的规则(诺斯的观点);③ 制度是一种博弈均衡产生的共有信念(代表人物青木)。持第一种观点的人已经不多了,主流的看法集中在第二种和第三种观点上。正如青木所说的,第二种观点解释不了制度的起源问题,它只能把制度看成是一个凭空诞生的“上帝之手”。青木在前人把博弈论引入制度研究的基础上,进一步认为制度是一个博弈均衡产生的共有信念——这和以前博弈论学家们所持的均衡制度观有所不同。这样就解释了制度的起源问题,在一定程度上也解释了制度的演变:他把制度的演变看成是一个均衡向另一个均衡转变的过程;他也揭示了转变的原因,认为制度的演变是因为有些成员对现有均衡的违背。遗憾的是,青木并没有解释为什么有些成员会违背现有的均衡;也没有解释在制度演变——从一种均衡向另一种均衡的演变过程中,会发生什么变化。照此推理,如果存在三个或者三个以上的均衡,那么制度的演变就是无序的,制度向哪一个均衡点转移就会出现什么问题。

笔者对这三种制度观点都不敢苟同。在总结前人的基础上,特别是受到张曙光有关国际利益分配观点的影响,笔者认为把制度解释成一种利益的分配将有助于解决上述问题。利益的分配以参与分配的各方实力为基础,在一个理性的社会里,实力强大的一

方必然会占据利益分配上的优势。利益分配中的策略将只在短时间内发挥作用;在时间足够长的情况下,如果利益分配不对实力产生影响(当然这和事实是不吻合的),那么策略的应用或者影响将会耗散,最后的均衡必然会由相对实力决定。

但这仍然不能解释制度的起源问题。交易成本的引入有助于解决这一问题:相对实力的发现会花费成本,因此,制度就被发明出来替代发现相对实力的“政治市场”,这意味着在没有形成对对方相对实力的正确认识之前是不会出现制度的。在制度的诞生之前一定会有显示相对实力的“争斗”。然而,持续不断的“争斗”会消耗掉过多的社会资源,使参与分配各方整体的利益受到损失。为了解决这个问题,在对对方实力认可^①的前提下,使用制度固化参与分配各方的分配份额。

二、分配的根据

对于制度的分配根据问题,这里引入了“实力元”的概念加以解决。从博弈的制度观出发,这里主要聚焦在制度的博弈研究上,最终博弈均衡的多样性和其支付函数设置就可以最终统一在博弈参与者的“实力元”上。这样就解决了博弈论不可能解决制度均衡的唯一性问题。方法是在博弈论关于参与人、博弈规则等基本要素的基础上引入参与人的“实力元”,认为一个参与人的支付函数应该和他的相对实力相对应。进一步,当一个额外的博弈参与人加入博弈时,博弈的支付函数也必须和最新“参与人组合”的相对实力相匹配。于是制度就发生了一次演进。一个稳定的制度应当符合制度约束下博弈各方的利益分配现状,符合其博弈各方相对实力分布。这样的制度才能稳定存在,否则该制度就不可能诞生或者稳定存在。

① 在这一点上,相对实力认同和青木的共有信念类似。

纳什在叙述博弈理论时所涉及的“两人讨价还价模型”(包括合作博弈和非合作博弈)假设两人的谈判能力相同(在合作博弈中,纳什提及谈判力不等的情况),并且隐含着合作优于非合作的前提条件。这种博弈论舍弃的信息对理解制度相当重要。在现实中,谈判能力往往是不对等的,那么博弈的均衡点肯定不是位于 $x=y$ 的直线上。因此,如果将制度理解成是纳什均衡,那么在“相对实力”概念的作用下,纳什均衡就只会唯一存在,这样青木的制度演进也就站不住脚了:相对实力分布不变,则制度也就不会改变。

三、制度为什么不能被复制

在一个社会群体中成功的制度可以被复制到另外一个社会群体中吗?制度复制的必要条件是什么呢?只要制度涉及的参与利益分配各方的相对实力和被复制制度涉及的参与人的相对实力分布相同,那么制度的复制就有可能,否则,即使表现最为优异的制度的复制也必将受到阻碍,最终不了了之,无疾而终。参与博弈各方的相对实力分布相同,这一条件过于苛刻,在现实生活中很难达到,因此制度的复制也就很难被观察到。即使如此,在现实社会中还是有些许蛛丝马迹暴露了制度复制的痕迹。当制度的利益分配特征不那么明显时,制度被复制的可能性也变大了。

我们可以从国际贸易的视角来研究制度的复制问题。由此,也就不难理解国际贸易条约的诞生和发展。可以进一步得出结论,一个国家的出口不仅取决于相对的生产成本,还取决于相对的制度成本,即一个国家的相对比较优势由两个因素共同决定:有形的生产成本和无形的制度成本。

四、制度变迁的动力来源

在制度变迁的研究中,如果把制度具有的利益分配属性囊括

进去,就可以对诺斯的制度演进模型进行改进,使其结果更加符合客观事实。诺斯认为制度的研究主要取决于两个因素:利益创造和利益发现。那为什么还要考虑利益分配的因素呢?这是因为利益的分配会直接影响到制度变迁的动力,进而影响制度的演化。

青木把制度看成是一种均衡向另一种均衡的转变,是沿均衡点的转变。而诺斯的模型主要认为只有“创新改变了潜在的利润”^①、潜在利润的显现,或者“创新成本的降低使制度安排的变迁变得合算了”^②,制度才有可能演变。但这并不是制度演变的充分条件,而只是制度演变的必要条件。青木只是描述了制度演变的可能途径,而没有涉及制度演变的充分条件。

笔者把诺斯的两个必要条件归纳为利益创造和利益发现,考虑到制度演变的充分条件,我们加上了第三点——利益分配:只有利益分配才最终导致了制度的演变,制度最终的归宿一定要和博弈参与方的相对实力相匹配。

五、实证研究

从上面对制度的研究成果可以得出很多推论:如果听任理性人按照相对实力进行分配,社会就必定会达到最优,但是经济可能会因为失去激励而增长缓慢^③;如果一个国家的基本制度不变,那么这个国家的贫富差距在很长一段时间内就会维持相对稳定;贫富差距不会影响经济发展;反过来,一个国家的经济发展必然会带来贫富差距的扩大……所以只要可以得到社会成员的财富(收入)分配差距的扩大和经济增长率之间的正相关关系,就可以证明上述的结论。邹恒甫(北京大学、武汉大学、世界银行研究员)已经在

①② L. E. 戴维斯, D. C. 诺斯,《制度创新的理论:描述、类推与说明》,《财产权利与制度变迁》,上海三联书店 1991 年版。

③ 当然经济增长还和许多因素相关,不可能全部由于激励得到。

几篇论文里使用了大量的数据得出了类似的结论：一个国家的基尼系数只有在社会发生动荡的时候才会剧烈变化，同时往往伴随有经济的动荡。这里需要进一步证明的是：一个国家的经济发展必然会带来贫富差距的扩大。它可以进一步引申出这样的结论：经济的增长会和社会的贫富差距相背离，即经济增长越快，贫富差距就越大，即基尼系数越大；经济增长越慢，基尼系数就越小。它们是一对变量，一对不可兼得的变量，追求经济增长，必然会扩大基尼系数；减小基尼系数，就会影响经济增长。基尼系数和经济增长的因果关系尚待进一步的研究来明确。

还可从另外一个角度证明上述结论：一个国家关于贫困救助的转移支付会随着经济的发展逐渐增加，但其增长速度会慢于经济发展速度，进而经济发展的速度受制于用于贫困救助的转移支付增加的速度。

一个理论问题的实证是如此困难。不仅受制于我们能够获得的数据，受制于数据的准确性，还受到我们不能预知因素的困扰。即使如此，如果我们能够从具体的实证研究中证明我们的推论，至少就可以表明我们关于制度具有利益分配属性在某种程度上来讲是正确的。

本书的实证研究将主要集中于以下几个方面：国际贸易中伴随产品的进出口还存在制度的进出口；制度从一个社会群体被复制到另一个社会群体中；然后我们撷取中国入世前后涉外经济管理制度的变迁，来研究当增加另外一个交易主体后，一个交易系统内原有制度的变化情况。

第一章 问题的引入

不妨先看几个著名的完全信息静态博弈例子。之所以在这里重新表述这些脍炙人口的博弈案例,是因为笔者试图从这些例子中引申出博弈对制度演进的作用。从另一个角度讲,把历史上著名的例子拿出来作为靶子,不仅能够调动大家阅读的兴趣,而且也能节省大家阅读的时间,还会省却笔者在编写例子上花费过多的时间和精力。从福利经济学的角度来看,这虽然称不上是一个帕累托最优,但至少称得上是一个次优的结果。

第一节 几个博弈案例^①

一、囚徒困境^②(Prisoner's dilemma)

囚徒困境讲的是两个嫌疑犯作案后被警察抓住,分别被关在不同的屋子里审讯。警察告诉他们:如果两人都坦白,各判刑 8 年;如果两个都抵赖,各判刑 1 年(或许因证据不足);如果其中一

① 这里关于完全信息静态博弈的例子均来自张维迎,《博弈论与信息经济学》,上海三联书店 1996 年版,第 15、17~18、20~21 页。

② 囚徒困境的定义是 Tucker 在 1950 年提出来的。Tucker 和 Nash 的著作基本上奠定了现代非合作博弈论的基础。

表 1-1 囚徒困境 (prisoner's dilemma)

		囚徒 B			
		坦白		抵赖	
		坦白	抵赖	坦白	抵赖
囚徒 A	坦白	-8	-8	0	-10
	抵赖	-10	0	-1	-1

人坦白另一人抵赖,坦白的放出去,不坦白的判刑 10 年。表 1-1 是囚徒困境的战略式表述。这里,每个囚徒都有两种战略:坦白或抵赖。表中每一格的两个数字代表对应战略组合下两个囚徒的支付(效用),其中第一个数字是第一个囚徒的支付,第二个数字是第二个囚徒的支付。(坦白,坦白)是这个博弈的纳什均衡(nash equilibrium),即不论对方如何选择,选择坦白就是个人的最优选择。虽然有符合集体理性的(抵赖,抵赖)的帕累托改进(Pareto improvement)存在,但由于缺乏相应的约束,个人理性并不能满足集体理性。

但是,这样的“囚徒困境”却经不起客观现实的拷问:在囚徒面对的“困境”中,为什么要有一个警察充当裁决者?是谁赋予了警察裁决者的权力?警察的“规则”真的有效吗?囚徒真的需要完全服从警察裁决的权威吗?如果是,才会出现上述的“囚徒困境”;如果不是,那么与其说是囚徒之间的博弈,倒不如说是囚徒与警察之间的博弈恰当。显然,此时在囚徒和警察的博弈中,双方的地位是不对等的。即使纯粹是囚徒之间的博弈,囚徒之间完全地位上的平等也是少见的。两个囚徒之间地位的不平等就会导致上述博弈的重构。

二、智猪博弈(boxed pigs)

猪圈里有两头猪:一头大猪和一头小猪。猪圈的一头有一个猪食槽,另一头安装一个按钮,控制着猪食的供应。按一下按钮会

有 10 个单位猪食进槽,但按按钮者需要付出 2 个单位的成本。若大猪先到,大猪吃 9 个单位,小猪只能吃 1 个单位;若同时到,大猪吃 7 个单位,小猪吃 3 个单位;若小猪先到,大猪吃 6 个单位,小猪吃 4 个单位。表 1-2 列出对应不同战略组合的支付水平。这里的纳什均衡是(大猪按,小猪等待)。

表 1-2 智猪博弈(boxed pigs)

		小猪	
		按	等待
大猪	按	5 1	4 4
	等待	9 -1	0 0

在这个博弈里,参与人的地位——相对实力不再平等,已经开始出现“大”与“小”的区别。但是具体到支付函数而言,大猪和小猪获得的利益份额主要取决于“按”与“先到”,猪的大与小对猪获得利益份额的影响并不大。

三、斗鸡博弈(chicken game)

两个人举着火棍从独木桥的两端走向中央火拼,每个人都有两种战略:继续前进,或退下阵来。如果两人都继续前进,则两败俱伤;若一方前进另一方退下来,前进者取得胜利,退下来的丢了面子;若两人都退下来,两人都丢面子。该博弈的支付矩阵如表 1-3 所示:

表 1-3 斗鸡博弈(prisoner's dilemma)

		B	
		进	退
A	进	-3 -3	2 0
	退	0 2	0 0

上述这些都是完全信息静态博弈的例子,但其中却蕴含着一些容易被忽视的假设。我们知道一个博弈最基本的要素是参与人(players)、战略(strategies)和支付(payoff)。参与人、行动(actions or moves)和结果(outcome)被称为博弈规则(the rules of game),而博弈分析的结果在于使用博弈规则预测均衡。^① 信息(information)被认为是参与人对于博弈的知识,尤其是有关“自然(nature)”^②的选择、其他参与人特征和行动的知识。^③

然而上述博弈的纳什均衡可能并不符合真实的情况。博弈参与人具有不同的知识,因而在一定知识的基础之上理解信息、加工信息的能力是不同的。在囚徒困境的博弈中,如果囚徒 A 一直受到所谓“忠义”思想的影响,而囚徒 B 则没有,那么即使警察告诉 A 和 B 完全一样的信息, A 在原有内在思想的指引下也会作出有悖于纳什均衡的结果,那么 $(-10, 0)$ 也就有可能成为实际的博弈结果。因此,参与人的知识不同,对信息加工和理解的能力不同,会对参与人的行动,乃至策略产生影响。博弈中的每个参与者的教育、文化背景的不同,会影响到参与人的知识集,知识集的差异会导致每个参与人对于信息的采集、加工能力的不同,因而也会使得不同的参与人在面对同一种情况时采取完全不同的行动或者策略。纳什均衡会受到博弈参与人不同知识集的影响。

影响支付函数的因素也有可能影响到博弈的结果。上述博弈中每一个给定的结果是必然的吗? 参与人能否改变博弈中的支付结果? 至少在某些情况下,简单人为给出的支付函数与真实世界不尽相符。在囚徒困境的博弈例子中,在囚徒 A 和囚徒

①③ 张维迎,《博弈论与信息经济学》,上海三联书店 1996 年版,第 46 页。

② “自然”是指决定外生随机变量概率分布的机制,是虚拟参与人(pseudo-player)。张维迎,《博弈论与信息经济学》,上海三联书店 1996 年版,第 47 页。

B坦白和抵赖两个行动之间,存在着无数中间的行动选择,这就决定了无数可能的结果。比如:如果A还兼犯有其他更为严重的罪行,而B又不知晓,那么A愿意在此支付条件下作出任何选择。

囚徒博弈省略了大量的现实信息,其中关于参与者“实力”的信息似乎尤为重要。在智猪博弈的支付矩阵中,不难看出大猪缺乏自己的理性:它选择了与小猪“公平”竞争,把自己降到和小猪一样的地位上。^① 如果大猪表现为充分的理性,它就会充分利用自己的“大”的优势,强迫小猪选择“按”,而自己选择“等待”,于是(大猪按,小猪等待)的纳什均衡就不会存在,而代之以(大猪等待,小猪按)的结果。这里我们似乎对“公平”注重不够,但原来的纳什均衡同样否认了“公平”。考虑了“公平”之后的结果是(按,按),此时大猪使用自己的实力使支付结果成为(5,1)。这个结果以降低小猪支付水平为成本,改善了大猪的支付水平——暴力的使用带来了公平,但它降低了社会总福利。暴力的使用对社会总福利的影响是不确定的。有时候暴力的使用会增加社会总福利,也有可能对社会总福利没有任何影响。^②

新增的博弈参与人也有可能改变原有博弈参与人的策略,导致博弈的重构。在斗鸡博弈里就存在这样的状况,假设存在一个共同敌人C的介入,那么A和B就有可能选择(0,0)共失面子的结果,而共同抵御C。如果C是A的同伙,纳什均衡的结果是(2,0);而如果C是B的同伙,纳什均衡的结果是(0,2)。

上述博弈事例中一些新增的信息可能会影响到博弈的最终结果。

① 当然,也可以理解为在原有支付矩阵中,关于大猪和小猪的支付函数已经考虑了其大小实力的不同,但程度显然不足。

② 我们这里对社会总福利的定义仅仅是大猪和小猪的支付水平之和,这显然是很粗糙的,也很简单,但却有助于说明问题。