

转型与经济学

Transition
and Economics

[比]热若尔·罗兰 著

Gérard Roland



北京大学出版社

经济
科学
译丛



梁晶工作室
LIANGJING PUBLISHING STUDIO

转型与经济学

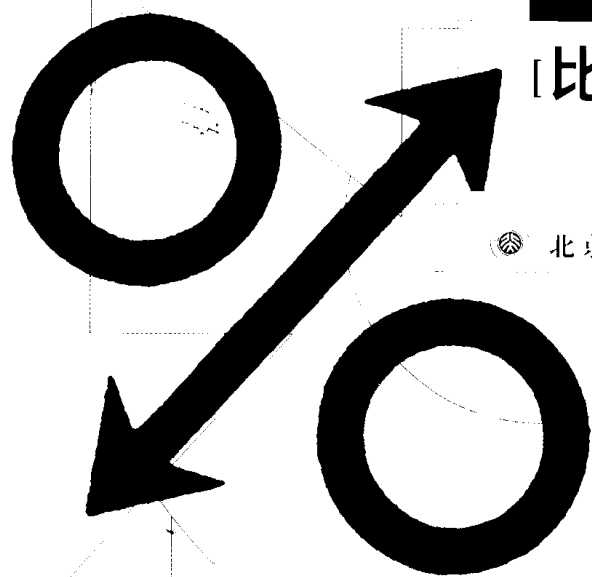
Transition
and Economics

[比]热若尔·罗兰 著

Gérard Roland

张帆 潘佐红 译

 北京大学出版社



 北京大学出版社

经济
科学
译丛

北京市版权局著作权登记图字:01-2001-1868号

图书在版编目(CIP)数据

转型与经济学/(比)热若尔·罗兰(Roland, G.)著;张帆等译. —北京:
北京大学出版社, 2002.5

ISBN 7-301-05581-1

I. 转… II. ①罗…②张… III. 企业经济-经济体制改革-研究 IV. F271

中国版本图书馆 CIP 数据核字(2002)第 023698 号

书 名: 转型与经济学

著作责任者: [比] 热若尔·罗兰 著 张 帆 潘佐红 译

责任编辑: 赵 艳

标准书号: ISBN 7-301-05581-1/F·0511

出版发行: 北京大学出版社

地 址: 北京市海淀区中关村北京大学校内 100871

网 址: <http://cbs.pku.edu.cn> 电子信箱: zpup@pup.pku.edu.cn

电 话: 出版部 62754962 发行部 62754140 编辑部 62752027

排 版 者: 林海印刷厂服务部

印 刷 者: 涿州市星河印刷厂

经 销 者: 新华书店

787mm×1092mm 16开本 23 印张 495千字

2002年5月第1版 2002年5月第1次印刷

定 价: 40.00元

未经许可, 不得以任何方式复制或抄袭本书之部分或全部内容。

版权所有, 翻版必究

献 给

海蒂、埃尔莎、弗洛朗斯和朱丽叶特，和我的父亲母亲

《经济学译丛》

编辑委员会

学术顾问 高鸿业 王传纶
胡代光 范家骧
朱绍文 吴易风

主 编 陈岱孙

副主编 梁 晶 海 闻

编 委

王一江	王利民
王逸舟	贝多广
平新乔	白重恩
刘 伟	朱 玲
许成钢	张宇燕
张维迎	李 扬
李晓西	李稻葵
杨小凯	汪丁丁
易 纲	林毅夫
金 碚	姚开建
徐 宽	钱颖一
高培勇	梁小民
盛 洪	樊 纲

(按姓氏笔画排列)

《经济科学译丛》总序

中国是一个文明古国，有着几千年的辉煌历史。近百年来，中国又由盛而衰，一度成为世界上最贫穷、落后的国家之一。1949年中国共产党领导的革命，把中国从饥饿、贫困、被欺侮、被奴役的境地中解放出来。1978年以来的改革开放，使中国真正走上了通向繁荣富强的道路。

中国改革开放的目标是建立一个有效的社会主义市场经济体制，加速发展经济，提高人民生活水平。但是，要完成这一历史使命决非易事，我们不仅需要从自己的实践中总结教训，也要从别人的实践中获取经验，还要用理论来指导我们的改革。市场经济虽然对我们这个共和国来说是全新的，但市场经济的运行在发达国家已有几百年的历史，市场经济的理论亦在不断发展完善，并形成了一个现代经济学理论体系。虽然许多经济学名著出于西方学者之手，研究的是西方国家的经济问题，但他们归纳出来的许多经济学理论反映的是人类社会的普遍行为，这些理论是全人类的共同财富。要想迅速、稳定地改革和发展我国的经济，我们必须学习和借鉴世界各国包括西方国家在内的先进经济学的理论与知识。

本着这一目的，我们组织翻译了这套经济学教科书系列。这套译丛的特点是：第一，全面系统。除了经济学、宏观经济学、微观经济学等基本原理之外，这套译丛还包括了产业组织理论、国际经济学、发展经济学、货币金融学、公共财政、劳动经济学、计量经济学等重要领域。第二，简明通俗。与经济学的经典名著不同，这套丛书都是国外大学通用的经济学教科书，大部分都已发行了几版或十几版。作者尽可能地用简明通俗的语言来阐述深奥的经济学原理，并附有案例与习题，对于初学者来说，更容易理解与掌握。

经济学是一门社会科学，许多基本原理的应用受各种不同的社会、政治或经济体制的影响，许多经济学理论是建立在一定的假设条件上的，假设条件不同，结论也就不一定成立。因此，正确理解掌握经济分析的方法而不是生搬硬套某些不同条件下产生的结论，才是我们学习当代经济学的正确方法。

本套译丛于1995年春由中国人民大学出版社发起筹备并成立了由许多经济学专家学者组织的编辑委员会。中国留美经济学会的许多学者参与了原著的推荐工作。中国人民大学出版社向所有原著的出版社购买了翻译版权。北京大学、中国人民大学、复旦大学以及中国社会科学院的许多专家教授参与了翻译工作。在中国经济体制转轨的历史时期，我们把这套译丛献给读者，希望为中国经济的深入改革与发展做出贡献。

《经济科学译丛》编辑委员会

1996年12月

内容简介

转型是过去十年间主要的经济事件之一。这一转型不仅影响了大约16.5亿人口，而且使经济学的关注焦点从标准的价格与货币理论转向合同及其制度环境。转型经济研究表明，制度不仅是至关重要的，而且制度向更高效率的演进取决于初始状态和持续的政治上的支持。

早期的转型经济学政策文献把关注点集中在所谓华盛顿共识上。与此不同，本书对当前的研究提供了综述，分析了转型实践提出的、经济学理论和决策者还不能回答的问题。本书说明了转型研究如何使我们加深了对资本主义经济体系和大规模制度变迁的动态变化的理解。

本书分为3编。第1编考察了政治程序是如何动态地对大规模改革作出决策的。第2编考察了在既存市场缺位的情况下自由化对一般均衡和宏观经济的影响。第3编考察了企业在从国有向私有转变过程中的经济行为，比较了私有化、结构重组和金融改革的作用。虽然着眼于转型经济学，本书的讨论也与政治经济学、发展经济学、公共经济学、公司财务以及微观和宏观经济学息息相关。

作者热若尔·罗兰是美国伯克利加州大学经济学教授，欧洲经济学与统计学研究中心（ECARES）的常驻研究员。

这是转型经济学的第一部综合性著作。热若尔·罗兰(Gérard Roland)把现代经济学理论工具与他对前社会主义国家的深刻了解结合起来,阐明了我们对社会主义向资本主义转型过程中的成功和失败的理解。更进一步说,《转型与经济学》引导读者更加深入地思考大规模制度变迁,思考是什么使一些资本主义经济比另一些更加成功。任何对转型经济学、发展经济学、政治经济学或企业与组织理论的研究持严肃态度的人,都应该阅读《转型与经济学》一书。

——伦敦大学学院和哈佛大学 菲利浦·阿吉翁(Philippe Aghion)

热若尔·罗兰极好地总结了十年来的转型经济学研究,使我们大家受益匪浅。他本人在这一领域做出了重大的贡献。他的著作清楚地说明了以应用性理论作为开端的这一领域,是如何创造出政治经济学和公共经济学举世闻名的新思想的。

——法国图卢兹社会科学大学经济学教授 让-雅克·拉丰
(Jean-Jacques Laffont)

热若尔·罗兰把经济分析工具与对经济和政治制度的严密论证结合起来,撰写了雄心勃勃而又名副其实的开创性著作。这是对社会变迁的公共政策分析。

——伯克利加州大学工商、经济和法律凯泽讲座教授 奥利弗·威廉姆森
(Oliver E. Williamson)

热若尔·罗兰是转型经济学这一激动人心和举足轻重的领域的主要人物之一。我希望这本好书将成为那些想理解这一复杂而丰富的领域的人们的入门书。

——普林斯顿高级研究所 埃里克·马斯金(Eric Maskin)

本书是热若尔·罗兰所做的关于后共产主义转型的重要的、前沿性研究的极好的总结。它也是对转型问题文献的准确而全面的综述。本书将成为研究生教学的极好教材,也将引起尚未从事转型研究的学者的兴趣。

——哈佛大学经济系 雅诺什·科尔奈(János Kornai)

目 录

致 谢	1
引 言 转型与经济学	4
第 1 章 理解转型	16
1.1 对转型缺乏预见	16
1.2 转型的出人意料之处	17
1.3 转型前的初始状态	20
1.4 转型的目标与约束条件	25
1.5 转型的不同模式	27
1.5.1 改革道路和策略的不同	27
1.5.2 自由化之后宏观运行的不同	30
1.5.3 企业对所有权与公司治理结构的变化的反应的不同	33
1.5.4 小结	34
第 1 编 政治约束条件与改革策略	37
第 2 章 不确定条件下的改革政治	39
2.1 政治约束条件的重要性	39
2.2 事前与事后政治约束	40
2.3 渐进主义与中期现状偏好	41
2.4 总和不确定性	44

2.4.1	大爆炸与渐进主义之间的权衡取舍	44
2.4.2	互补性作用与改革动力	50
2.4.3	逆转成本的作用	53
2.5	最优顺序	54
2.5.1	预期结果不同的改革顺序	55
2.5.2	风险不同的改革顺序	56
2.5.3	支持者不同的改革顺序	57
2.5.4	事前可接受性与事后不可逆转性之间可能的权衡取舍	58
2.5.5	外生与内生的“再次当选”或未来支持及相关文献	59
2.5.6	转型经济中的改革顺序	59
2.5.7	改革顺序的其他应用：欧洲一体化	61
2.6	转型的速度与内生投资	62
2.7	中国：M型与U型组织	67
第3章	确定条件下的政治约束	75
3.1	效率与对改革的受损害者的补偿	75
3.2	无转移支付与多数投票	77
3.2.1	分而治之的策略	77
3.2.2	为得到多数支持给改革打包	79
3.3	转移支付与不对称信息	81
3.4	分离与转移支付	83
3.5	有关政治约束与转型速度的其他模型	86
3.6	一些关于政治约束的经验研究文献	88
3.7	改革的政治经济学的替代方法	89
第4章	大规模私有化的政治经济学	91
4.1	对可能的私有化逆转的模拟	92
4.1.1	私有化的逆转	93
4.1.2	多重均衡与私有化的临界量	95
4.1.3	无偿奉送型私有化的政治影响	97
4.2	把股份分给全民还是分给内部人	99
4.3	撒切尔低价	103
4.4	经验证据	105
4.5	大规模私有化的经济成本	106
4.6	第1编的结语	107
第2编	资源配置的变化	111
第5章	部门再配置的最优速度	113
5.1	劳动力市场的摩擦	115
5.1.1	阿吉翁—布朗夏尔模型	115
5.2	内生的资本积累	118
5.2.1	转型的最优速度	120

5.2.2 对最优速度的偏离	122
5.3 相关的理论文献	129
5.4 关于部门和劳动力再配置的经验文献	129
5.5 关于最优速度的辩论在多大程度上是适用的?	131
第6章 价格自由化的速度与方法	132
6.1 局部自由化的陷阱	134
6.2 双轨价格自由化	136
6.2.1 有效供给与配给	137
6.2.2 无效供给与配给	139
6.2.3 计划数量大于市场数量	144
6.2.4 双轨制下的效率与帕累托改进	145
6.2.5 双轨制的实施	145
6.2.6 双轨制与腐败	147
6.2.7 转型以外的双轨制	148
6.3 关于价格自由化的阻力的证据	149
6.4 有关双轨自由化的配置效应的证据	149
6.5 结论	150
第7章 自由化与产量下降	151
7.1 中欧和东欧的产量下降	151
7.2 对产量下降的解释	152
7.3 生产链条的破坏与交易的无效率	155
7.4 搜寻摩擦与专用性投资	157
7.4.1 社会主义下的初始状态	158
7.4.2 “完全搜寻”均衡的条件	159
7.4.3 产出的动态变化	160
7.4.4 双轨自由化下的产出动态变化	163
7.5 相关文献	163
7.6 经验分析	164
7.7 结论	165
7.8 附录	166
第8章 政府崩溃与经济运行绩效	168
8.1 引言	168
8.2 政府崩溃或执法	170
8.2.1 黑手党与政府保护	171
8.2.2 犯罪和惩罚……以及赋税	172
8.3 执法与双轨制	174
8.4 加入欧盟的影响	176
8.5 经验文献	180
8.5.1 非正式经济	180
8.5.2 腐败	182

第3编

8.5.3 执法不力情况下的私人合同	184
8.6 第2编结语	187
治理结构的改变	189
第9章 解决社会主义遗留下来的激励机制问题	191
9.1 政府对企业的干预	192
9.1.1 政府对企业的控制	193
9.1.2 私有化	194
9.1.3 公共物品的私营和国营之间的取舍	196
9.1.4 控制权和信息	198
9.2 棘轮效应	198
9.2.1 社会主义下的棘轮效应	200
9.2.2 棘轮效应和经理人员劳务市场	202
9.3 软预算约束	205
9.3.1 软预算约束的基本模型	207
9.3.2 软预算约束和棘轮效应	209
9.3.3 社会主义体制下的缺乏创新	210
9.3.4 软预算约束和短缺	211
9.3.5 软预算约束和企业自主权	212
9.3.6 硬化预算约束和私有化	214
9.3.7 通过非垄断硬化预算约束	214
9.4 一些经验文献	215
第10章 私有化和结构重组政策的比较	219
10.1 私有化的不同方式	220
10.1.1 私有化的目标	222
10.1.2 私有化政策的约束条件	225
10.1.3 目标和约束条件小结	228
10.1.4 对不同私有化政策的评价	230
10.2 私有化的模型	236
10.2.1 内部人私有化的既得利益	237
10.2.2 改善激励机制与软化预算约束和资产掠夺	238
10.2.3 非现金竞标的私有化和事后道德风险	242
10.3 经验证据	246
第11章 政府机构中的激励机制	251
11.1 联邦制和预算约束的硬化	253
11.1.1 中央集权政府下的软预算约束	254
11.1.2 财政分权的硬化预算约束效应	256
11.1.3 局部分权：财政和货币政策	257
11.1.4 比较静态分析：国有企业和乡镇企业	258
11.1.5 经验证据和应用	259

11.2	联邦制和指标竞争·····	261
11.3	中国的联邦制与俄罗斯·····	264
11.4	对乡镇企业的理解·····	265
第 12 章	软预算约束和金融转型 ·····	270
12.1	解决企业的软预算约束问题·····	275
12.1.1	分散化的银行体制·····	276
12.1.2	企业间贸易拖欠与资源再配置的结构重组·····	281
12.1.3	新项目的进入·····	283
12.1.4	项目审查技术的变化·····	286
12.2	解决银行的软预算约束问题·····	288
12.2.1	银行的消极性和对复活的投机·····	288
12.2.2	银行的寻租行为·····	293
12.3	公开呆账的激励机制·····	296
12.4	经验文献·····	299
12.5	第 3 编结语·····	301
第 13 章	转型经验综述 ·····	305
13.1	我们从转型中学到了什么?·····	306
13.1.1	华盛顿共识与渐进—制度观点·····	306
13.1.2	总的评价·····	311
13.2	经济学从转型中学到了什么?·····	318
文献索引	·····	321
作者索引	·····	344
译者后记	·····	352

致 谢

《转型与经济学》一书对有关转型过程的学术研究提供了一个概览。本书强调了转型过程对经济学提出的新问题，对这些问题经济学家从传统经济学理论中找不到现成的答案。本书不仅会使从事转型经济研究的研究者感兴趣，也会使整个经济学界感兴趣。研究的覆盖面贯穿政治经济学、发展经济学、公共经济学、公司财务等领域，更广泛地说，涵盖了微观经济学与宏观经济学。本书可以作为关于转型的研究生教科书，书中的大部分材料可以用于本科生的高级课程。

在1997—1998学年，我被邀请在奥斯陆、斯德哥尔摩、布鲁塞尔和格泽西讲授一门完整的博士课程。同年，我被邀请在欧洲经济学会的夏季学校和布达佩斯的中欧大学讲授两个短期课程。1995年在东京举行的计量经济学会世界大会邀请马蒂亚斯·德瓦特里庞（Mathias Dewatripont）和我撰写关于转型经济学的概述文章，这给了我一个机会事先考虑论述的结构。在1998—1999学年，我得到斯坦福行为科学高级研究中心的研究基金，在那里我完成了本书的初稿。没有这笔基金和中心无与伦比的环境，本书的写作将遥遥无期。

这里我必须对马蒂亚斯·德瓦特里庞在学术上的帮助表示深深的感谢。当他在哈佛拿到博士学位并在麻省理工学院短暂停留回到布鲁塞尔后，我们才一起开始转型的政治经济学研究。在研究中我才直接接触到现代应用经济

学理论和应用该理论的前沿研究者的圈子。因此，我在学术上对马蒂亚斯的感谢远远超出我们在改革的政治经济学上的合作研究的意义。在帕特里克·伯尔顿（Patrick Bolton）回到布鲁塞尔以后，随着经济学高级研究欧洲中心（ECARE）的建立，马蒂亚斯还在布鲁塞尔自由大学创造了一个优越的学术环境。我在学术上也很感谢帕特里克·伯尔顿，当我们开始共同研究转型经济中的私有化政策时，我向他学到了很多前沿研究方法。帕特里克对 ECARE 优越的学术环境也有很大贡献。他邀请我们参加在马蒂农餐厅的午餐，提供了固定的机会讨论经济学，交流新思想。从一开始，ECARE 的研究环境就充满了合作与友好的气氛，促进了 ECARE 研究者之间、ECARE 研究员与许多来访者之间的学术交流。正是这种合作的环境使我开始在 ECARE 与其他同事（Erick Berglöf 和 Khalid Sekkat）和学生（Micael Castanheira 和 Frédéric Pivetta）着手本书所合作研究项目的报告。我非常感谢他们同我进行这些合作。

在 ECARE 之外，我从与钱颖一的合作中获益匪浅，在过去五六年中我与他在不同的转型项目中进行了深入长期的合作。我们都对转型过程有着长期的学术上的兴趣，都认识到转型对经济学的普遍意义。在我们一起度过的漫长的工作日中，我们共同的讨论总是并且现在还是我对转型思考的灵感源泉。我也非常感谢蒂埃里·韦迪耶（Thierry Verdier），自 20 世纪 90 年代早期以来，我们也在若干转型课题上进行了长期合作，在许多领域也有着心智上的共鸣。我还十分感谢本书研究转型的所有合作者：I. 格罗斯费尔德（Irena Grosfeld），刘遵义，E. 马斯金（Eric Maskin）和许成钢。我从他们所有人那里学到了很多，从我们的合作研究中，也从无数长期的思想交流，特别是和许成钢的交流中学到了很多东西，那已经远远超出了这些合作项目的范围。

在我的所有这些研究中，我在与以下诸位的接触中获益：Philippe Aghion, George Akerlof, Alberto Alesina, Ron Anderson, Masahiko Aoki, Anders Åslund, Chong-En Bai, Abhijit Banerjee, David Begg, Marek Belka, John Bennett, Daniel Berkowitz, Olivier Blanchard, Tito Boeri, Giuseppe Bonnano, Maxim Boycko, Jorge Braga de Macedo, Laszlo Bruszt, Bruno Biais, John Bonin, Michael Burda, Nauro Campos, Wendy Carlin, Juan Carrillo, Daniel Cohen, Simon Commander, Fabrizio Coricelli, Francesca Cornelli, Jacques Crémer, Alex Cukierman, Jean-Michel Dewaele, Michel Devroey, Avinash Dixit, David Ellerman, Saul Estrin, Raquel Fernandez, Jan Fidrmuc, Guido Friebel, Roman Frydman, Stanislav Gomulka, Roger Gordon, Brigitte Granville, Avner Greif, Denis Gromb, Roger Guesnerie, Sergei Guriev, Laszlo Halpern, Oliver Hart, Haizhou Huang, Athar Hussain, Barry Ickes, Marvin Jackson, Samir Jahjah, Claus Kasterberg, Iannis Katsoulacos, Patrick Kehoe, Michael Keren, Grzegorz Kolodko, Jozef Konings, Janos Kornai, Jean-Jacques Laffont, Patrick Legros, Mark Levin, David Li, Wei Li, John Litwack, Bentley Macleod, Dalia Marin, Jacek Mercik, Paul Milgrom, Ronald McKinnon, Tracy Lewis, John McMillan, Janet Mitchell,

Peter Murrell, Jacques Nagels, Damien Neven, Mario Nuti, Macro Pagano, Torsten Persson, Jean-Philippe Platteau, Joan Pearce, Enrico Perotti, Thomas Piketty, Jean Pisani-Ferry, Viktor Polterovich, Richard Portes, Ailsa Roëll, John Roemer, Dariusz Rosati, Jacek Rostowski, Andrew Rose, Howard Rosenthal, Ratna Sahay, David Sappington, Gilles Saint-Paul, André Sapir, Mark Schaffer, Paul Seabright, Claudia Sénik-Leygonie, Andras Simonovits, Hans-Werner Sinn, Georges Siotis, Andrei Shleifer, Mark Schankermann, Enrico Spolaore, David Stark, Oren Sussman, Pekka Sutela, Jan Svejnar, Jo Swinnen, Ariane Szafarz, Guido Tabellini, Kathy Terrell, Jacques Thisse, Jean Tirole, Daniel Treisman, Henri Tulkens, Frantisek Turnovec, Sveder van Wijnbergen, Chris Woodruff, E-Lu von Thadden, Jean Waelbroeck, Yijiang Wang, Shang-Jin Wei, Philippe Weil, Barry Weingast, Wing Woo, Charles Wyplosz, Joseph Zeira, Katia Zhuravskaya, 以及其他许多人。

我收到以下各位对本书初稿的十分有益的评论：Philippe Aghion, Daniel Berkowitz, Olivier Blanchard, Patrick Bolton, Micaël Castanheira, Daniel Daianu, Mathias Dewatripont, Guido Friebel, Irena Grosfeld, Jozef Konings, János Kornai, Dalia Marin, Enrico Perotti, Yingyi Qian, Alexander Repkin, Anouk Rivière, Mark Schaffer, Monika Schnitzer, Andrei Shleifer, Jan Svejnar, Guido Tabellini, Daniel Treisman, Wei Li, Chenggang Xu, 和 Xiaokai Yang.

特别感谢阿努克·里维埃 (Anouk Rivière), 他从第一页到最后一页逐字阅读了本书的初稿, 指出了从公式到文字的许多错误。我还要感谢鲁汶中东欧研究所 (LICOS) 的研究生们, 他们对改进若干章节的课堂教学提供了很好的反馈。我从许多同事、学生和那里收到的大量的不同的意见, 帮助我大大改善了本书的定稿。

吉多·弗里贝 (Guido Friebel) 和真吉·劳伦茨 (Gyongyi Loranth) 在 ACE 项目的框架下的助研工作给了我很大帮助。南希·戴芒克 (Nancy Demunck) 对本书的写作提供了出色的秘书辅助工作。她还绘制了许多图表。这些年来, 我一直受益于罗米·詹宁 (Romy Genin) 杰出的秘书辅助工作。没有她在数不清的管理事务上高效率的帮助, 我能用于研究的时间就会微乎其微。

我感谢麻省理工学院出版社的特里·沃恩 (Terry Vaughn) 的帮助。

最后, 我必须感谢我妻子海蒂 (Heddy) 和我的三个女儿埃尔莎 (Elsa)、弗洛朗斯 (Florence) 和朱丽叶特 (Juliette) 对我的容忍, 特别是 1999 岁末完成本书的最后那段时光。