

交易费用的批评性考察

伍山林

(上海财经大学 经济学院, 上海 200433)

摘要:交易费用是新制度经济学的基础性概念。由于解释力惊人,近 40 年来,这个概念不仅频繁地出现于经济学家的论著中,而且迅速地渗透到社会科学的其他领域。然而到目前为止,这个概念尚没有确切的定义,它的性质还未被清楚地揭示出来,其他诸多方面更有待于探索。本文从思想渊源、近期进展、现实根源和分析方法等方面,对交易费用概念进行批评性考察。

关键词:交易费用;思想渊源;近期进展;现实根源;分析方法

中图分类号:F019 **文献标识码:**A **文章编号:**1001-9952(2002)08-0003-10

1937 年,科斯将新古典经济学的市场单一制度扩展为市场与企业二重制度结构(Coase, R. H., 1937, P. 386—405)。1960 年,他又将市场与企业二重制度结构进一步扩展为市场、企业与法律三重制度结构(Coase, R. H., 1960, P. 1—44)。经过近 40 年的发展,发端于科斯的新制度经济学已经成为西方经济思想中的奇葩。通常认为,科斯之所以取得令人瞩目的学术成就,主要是由于他创造性地将交易费用(transaction costs)概念引入制度分析。科斯本人似乎也认同此说。^①但是,科斯既没有明确地给出交易费用的定义,又没有详细地讨论交易费用的性质,而是“睿智”地将这些难题留给其他的经济学家。遗憾的是,经过近 40 年的努力,在交易费用的定义和性质的探索上,其他经济学家也没有取得令人满意的成果。由此产生的后果是相当严重的。首先,对交易费用概念缺乏一致性的理解,已经在一定程度上妨碍了学术思想的准确交流;在经济研究已经专业分工的今天,其他领域的经济学家难以理解“新制度经济学”的精髓(科斯等, 1999(中译本),第 93 页)。从后文论述中不难窥见,即使在新制度经济学家阵营中,对交易费用概念的认识也存在很大的差异。其次,交易费用概念屡屡被滥用,用于解释几乎所有的问题,把不易说明的因素统统归结到它的名下。费希尔(Fisher, S., 1977, P. 322)曾经尖锐地指出:“交易费用经济学已经背上不好的名声……其中部分原因是,人们对几乎任何事情都可通过适当定义的交易费用来使之合理化抱着怀疑的态度”。米尔格罗姆和罗伯茨(Milgrom, P. and Roberts, J., 2000(中译本),第 182—199 页)对此也颇有微词。最后,交易费用概念与主流理论关系微妙——要实现与主流理论的融合,就得对它进行简单化、规范化的处理;要保留它的本来面目,则只能游离在主流理论之外。

一、思想渊源述略

亚当·斯密(1994(中译本),第 20—25 页)早就观察到,货币本质上是便利交易的工具;充当货币的商品,也是朝着便利交易的方向演进的。奥古斯丹·古诺(1994(中译本),第 22—23 页)

收稿日期:2002-05-24

作者简介:伍山林(1963—),男,湖南新邵人,上海财经大学经济学院副教授,经济学博士。

发现,在交易过程中,损耗是不可避免的,交易各方总要克服摩擦;商业范围的扩张和商业设施的发展,其作用像技艺高超的工程师,通过光滑的轴承和精密的齿轮,使摩擦得以减少并趋近于理想的状况。约翰·穆勒(1991(中译本),第九章第一、第二节)认为,在大生产与小生产中,监督费用与监督积极性存在明显的差异;在个体经营与合股经营中,企业家行为具有天壤之别。很显然,他的学说合乎本文稍后将要提到的代理成本理论的精神。在马克思(1975(中译本),第148页)看来,尽管商业的专门化节约了用于商品买卖的资本,商人如同一架能减少力的无益消耗的机器,还是会招致流通过用的。^②即使是新古典经济学代表人物马歇尔,也没有完全忽视市场上和企业中存在的交易费用。他(1994(中译本),第81—87页)认为,为了开拓市场,企业必须支付推销成本;为了应付不确定性事件,企业要做相应的风险保险;如果企业中各部门生产的是相互关联的产品,部门之间清楚地分割利益将颇为困难。用现在的眼光来看,尽管除马克思外其他学者只在某些具体问题上触及了交易费用,但诸如此类的论述已经与交易费用建立了某种联系。

将交易费用纳入经济分析是从科斯开端的。作为新制度经济学的鼻祖,他在1937年就约交易费用出发,对企业的起源和边界作了别致的说明,在他(Coase, R. H., 1937, P. 390)看来,利用价格机制组织生产必然会招致交易费用,因为交易各方要搞清楚各种与之有关的价格,要进行谈判和签约。稍后,弗里德里希·A·哈耶克强调信息成本在经济体制或组织选择上的意义。他(1988(中译本),第41—57页)指出,在信息系统中,不但包括可由专家组成的机构来处理的科学信息,更重要的是那些要由现场人员进行处理的特定时间和地点的信息;经济体制或组织的合理性,在于它是否高效率地利用了相关的信息。科斯(1994(中译本),第157页)后来又将发现交易对象、告诉对方交易的愿望和方式以及履约的成本等包括到交易费用中,说明了产权安排在交易费用不为零的现实世界里的经济意义,提出了著名的“科斯定理”。施蒂格勒(1999(中译本),第58—80页)考察了“搜寻成本”,即买卖双方寻找对自己最有利的价格所耗费资源,并认为价格的离散、广告的存在以及中世纪集市的规定等都与“搜寻成本”有关。上述著名工作,尽管对交易费用做了进一步说明,还是没有提炼出一般性的概念,对它的性质也缺乏深刻的认识。

二、近期进展介评

概括地说,最近40年里,经济学家们已从契约环节、交易维度、参照系和生产过程等角度对交易费用的若干层面进行了考察(伍山林,2000)。

新制度经济学家相信,契约的各个环节都会产生交易费用。达尔曼(Dahlman, C. J., 1979, P. 141—162)认为,交易双方欲达成协议,必需相互了解,将可能提供的交易机会告诉对方,在信息的搜寻和传递上耗费资源;如果交易的一方有多个当事人,在决定交易条件时还会产生做决策的成本;相互同意的条件确定后,还有执行所订协议的成本,搞清楚对方是否履行责任的成本。因此,从契约过程来看,交易费用包括了解和信息成本、讨价还价和决策成本以及执行和监督成本。威廉姆森(Williamson, O. E., 1985, P. 20—22)强调“隐契约”的重要性,将交易费用分成事前与事后两个部分。交易费用的事前部分包括协议的起草、谈判和维护等费用。其中“维护费用”尤为复杂,它与所有权、可信承诺与诚实、契约争端的法律裁决等有关。现实世界里,所有权是交易的前提条件;可信承诺与诚实“在非标准”契约中颇为关键;对契约争端进行裁决时,存在着经济学家强调的效率与“法律中心主义”的传统之间的分歧。交易费用的事后部分包括交易偏离一致性时产生的不适应成本、矫正事后不一致性产生的讨价还价成本、与规制结构有关的设立与运行成本以及实现可信承诺的保证费用等。值得注意的是,交易费用的事前部分与事后部分是相互关联的,交易费用与其说是序贯决定的,不如说是同时决定的。

交易是经济分析的基本单位(康芒斯,1994(中译本),第11页),交易、契约与交易费用具有孪生性,因此,经济分析中决不能忽略交易费用。另外,现实世界中的组织特别是企业,均可看成

是“一系列契约的连结”(Jensen, M. C. and Meckling, W. H., 1976, P. 305—360), 交易费用分析在组织研究中应当大有用武之地。在新制度经济学中, 交易费用分析最早且最富成果的运用就是解释企业的性质。尽管如此, 基于契约过程的考察, 对交易费用的性质、交易费用的计量特点、与生产费用的区别以及受哪些因素的影响等更为根本的问题, 并没有给予足够的关注; 经济学家在契约框架下考察社会经济问题时, 往往陷入片面的交易费用决定论, 在拾起交易费用从而制度的同时, 又将新古典经济学强调的部分视为给定, 从一个极端走向另一个极端(伍山林, 2001)。

威廉姆森在交易费用理论上最大的贡献, 是看到了交易与交易维度(包括交易发生的频率、交易的不确定性程度与种类以及资产专用性条件)的关系, 并从交易维度与机会主义行为、契约形式选择和成本补偿的关系出发, 间接地考察了交易维度与交易费用的联系。在他(1996(中译本), 第25页)看来, 资产专用性使事后机会主义行为具有潜在可能性, 资产专用性程度越高, 事后被“要挟”(hold-up)的可能性越大, 通过市场完成交易所耗费的资源多于在企业内部完成同样交易所耗费的资源; 在不确定性环境下, 决策必须是应变性的和过程性的, 交易各方要以灵活机动的“关系性缔约”代替死板僵硬的“古典缔约”方式, 以节约交易费用; 规制结构的确立和运行都是有成本的, 这种成本的补偿取决于交易发生的频率, 经常发生的交易比一次性发生的交易能更好地补偿这种成本。

值得注意的是, 威廉姆森不仅没有忽视生产费用,^⑨还将生产费用与交易维度特别是资产专用性程度联系起来。他(Williamson, O. E., 1985, P. 90—95)在著名的“启发性模型”中认为, 随着资产专用性程度的提高, 通过市场来组织生产, 市场规制费用会越来越高; 通过企业来组织生产, 企业内行政费用会越来越低; 而企业生产某一物品的成本与从市场购买这种物品的支出之差, 随着资产专用性程度的提高而下降。因此, 存在一个临界的资产专用性程度, 低于这个程度, 宜于由市场来组织生产; 高于这个程度, 宜于由企业来组织生产。遗憾的是, 由于很难准确地判断交易的维度(尤其是交易的不确定性程度与种类), 对交易维度与交易费用的关系就只能进行一般性的讨论。是否可以跳过交易维度, 直接考察交易费用与规制结构之间的联系呢? 威廉姆森做了肯定的回答。他认为, 如果生产费用固定不变, 在不同的规制结构之间, 交易费用的差异相当于总费用的差异。然而, 对于这种处理方式, 有必要做进一步的商榷。因为从总费用的比较, 虽然能够知道交易费用的差额, 但不能知道交易费用的数量, 除非设定了参照系, 该参照系规定了某一规制结构下交易费用的数量。

詹森和麦克林(Jensen, M. C. and Meckling, W. H., 1976, P. 305—360)以企业家拥有企业全额资本的情况为参照系, 讨论了企业还存在其他筹资方式时代理成本(它是交易费用的一种具体形式)的性质。他们观察到, 当企业家自己的资本在企业资本中的比例下降时, 企业家将更有积极性非生产性地使用企业资源, 因为由此产生的收益全部归己而成本按所占企业资本的比例分摊; 企业家的进取、奉献和创造精神将大不如前, 因为由此产生的成本全由自己负担而收益只按所占资本的比例分享。因此, 企业家在追求自己的货币与非货币收益的总和最大化的过程中, 所采取的行动将与企业资本的其他所有者的要求不一致。这样, 当企业家不完全拥有企业资本从而产生代理关系时, 不仅会产生剩余损失(residual loss), 即企业此时的市场价值与企业家拥有全额资本时企业的市场价值的差; 企业资本的其他所有者还会适度地监督企业家的行动, 并为此耗费监督费用; 企业资本的其他所有者为了在企业采取危及及其利益的行动后有所补偿, 往往要求企业家预先拿出一定数量的保证金。上述三个方面合称为代理成本。张五常以鲁宾逊·克鲁索经济为参照系说明现实世界中的交易费用。他认为, “在最广泛的意义上, 交易成本包括所有那些不可能存在于没有产权、没有交易、没有任何一种经济组织的鲁宾逊·克鲁索经济中的成本”, 即“包括一切不直接发生在物质生产过程中的成本”(张五常, 1996(中译本), 第58页)。稍加分析不难发现, 这个定义隐含着如下三层意思。首先, 鲁宾逊·克鲁索经济里的成本与现实世

界里的物质生产过程中的成本具有一致性并且能够准确地计量。其次,从现实世界里总成本中扣除这种成本,剩下的部分都可归到交易费用的名下。最后,交易费用必须定义得十分宽泛(张五常,1999a(中译本),第65—66页)。其原因是,现实世界里的生产通常采取联合的形式,不同种类的交易成本只有在边际上才能分离,人们很难直接“把一种类型的交易费用与另一类型的交易费用区分开来”(张五常,1999b,第2页)。

这种考察的最大好处,是通过参照系把现实世界里因利益冲突而引起的交易费用凸显出来了。不过,这种考察也存在明显的缺陷。例如,现实中经济主体即使知道了总成本,由于不知道鲁宾逊·克鲁索经济里成本究竟是多少,从总成本中扣除这个未知部分,作为剩余的交易费用也是无法确切地知道的。事实上,科斯也不赞同像张五常那样(广义地)定义交易费用,认为这个定义引入了超现实的东西,在应用上难免不引起混乱(科斯等,1999(中译本),第92页)。又例如,张五常尽管看到了直接区分不同类型的交易费用的困难,但他认为交易费用与物质生产过程中的成本能够分离开来。这是一个通常不能成立的假设。

在诺斯(North, D. D., 1994(中译本),第4、第8章)看来,将生产要素组织起来生产物品或劳务时,要付出转化费用(transformation costs)和交易费用,转化费用与交易费用的和等于生产费用。在新古典世界里,交易费用等于零,转化费用等于生产费用;在现实世界中,交易费用大于零,它在生产费用中扮演重要的角色。诺斯的交易费用学说的要义是:(1)转化费用与交易费用均受制度与技术的影响。他(诺斯,1994(中译本),第84页)说:“界定、保护产权及实施合约是要耗费资源的。制度加上所利用的技术决定了这些交易费用。将土地、劳动力和资本投入并转化为物品和服务这类产出要耗费资源,这一转化不仅是所利用的技术的函数,而且也是制度的函数”。因此,“制度决定交易费用,技术决定转化费用”^④的脱离实际观念,应该受到严厉的批评(诺斯,1994(中译本),第89页)。(2)在转化费用与交易费用之间,往往存在着此消彼长的或者说替代(trade-off)的关系。相当多情况下,人们选择的不是交易费用下降的技术和制度,而是交易费用上升但转化费用更快地下降的技术和制度。(3)即使从事后来看,交易费用也存在计量上的困难。例如,获得信息、排队等候、贿赂等耗费的资源以及监督不完备导致的损失等,往往难以计量。

从这种认识出发不难得到,由于交易费用不仅受制度的影响,还与技术有关,那么即使从狭隘的节约交易费用的原则出发,也要对技术与制度的组合进行选择;一般情况下,应当从生产费用最小的原则出发选择技术和制度的组合,只有生产费用最小的技术与制度的组合,才是合乎经济理性的。但是,在一般情况下,使生产费用、转化费用或交易费用最小技术的制度的组合并不具有一致性。^⑤

三、现实根源举要

为什么存在交易费用?科斯没有给出明确的说明,威廉姆森是新制度经济学家中对此用力最多的人。他认为,从主观上来说,人们处理各种问题并作出相应的决策时,尽管意欲理性,但只能达到其知识和经验所能及的、符合经济原则的程度。在现实经济生活中机会主义(opportunism)行为会天然地存在。它是“自我利益的狡诈的追寻行为。它不仅包括说谎、取巧和欺骗等赤裸裸的形式,而且包括那些微妙的欺诈形式……”。一般地说,机会主义不仅与信息不完全、信息披露失真有关,还与误导、曲解、隐瞒、使人迷惑和造成其他混乱等故意行为有关”(Williamson, O. E., 1985, P. 47)。从客观上来说,现实世界中的交易不可能发生在新古典环境之中,交易各维度会独立地或组合地影响到规制结构的选择,产生数量不等的交易费用。笔者认为,交易费用的现实根源尽管难以悉数列出,但知识与经济的差异性、资源和稀缺性、事件的概率性和不确定性以及空间的局限性等均是不可忽略的因素,它们独立地或组合地引起交易费用。^⑥

从知识社会学来看,个人获得的习惯、习俗、准则和行为规范等方面的知识,先在家庭初级社会化过程中形成,再在教育等次级社会化过程中进行调整,在进一步感知社会的过程中,还会因新经验的累积而修改。因此,在个人之间,知识和经验必然呈现出差异性。另外,从演进角度看,个人拥有的主要是内省的、人际间难以交流的、独特的知识和经验。因此,在专业分工和社会化过程中,任何个人都无法知道整个人类的知识和经验,个人的知识和经验,只不过是人类的知识与经验中的沧海一粟;随着分工的深化,对于所从事的工作和感兴趣的领域,个人拥有越来越多的知识和经验,在其他领域则与之相反(哈耶克,1997(中译本),第二章;汪丁丁,1997a,1997b)。受个人知识和经验的局限,即使面对着相同的信息,人们的反应和决策也会各不相同。只有在双方均认可能够增加自己的福利的情况下,交易才会达成。因此,在专业分工的世界里,交易在产生好处的同时,不可避免地要招致损耗,这种损耗相当于物理系统中的摩擦力。^⑦其结果是,社会不时陷入这样的局面:在知识和经验的个体差异比较不明显的经济主体群之内,虽然交易招致的摩擦力比较小,但进行交易的要求和概率比较低;在知识与经验的个体差异比较明显的经济主体群之间,虽然交易招致的摩擦力比较大,但进行交易的要求和概率比较高。此即所谓的“分工与交易费用悖论”(伍山林,2001;杨小凯和黄有光,1999(中译本);等)。

在稀缺性世界里,经济主体会利用某些(特别是信息上的)优势追寻自我利益。机会主义行为弥漫于几乎所有的经济过程中,不管是被动地利用信息还是主动地操纵信息,都使均衡具有了不确定性,往往锁定了低效率的陷阱。更为重要的是,人类从“霍布斯丛林”(霍布斯,1985(中译本),第92—132页)走向制度文明的社会,只要资源的稀缺性并没有因此而消失,制度文明在克服交易费用上就难言其彻底性。人类从“霍布斯丛林”那种交易费用极高的争斗状态,走向制度文明这种交易费用相对较低的契约世界,产生了一整套共享的制度知识。借助于它,人们能够较为准确地预期其行为的经济价值。但是首先,制度文明尽管减少了交易过程中的资源损耗,却要承担制度的制定、执行和监督的费用。其次,制度其实是其他经济要素的函数,其他经济要素一旦发生了改变,制度便要随之变迁,并且带来相应的交易费用。最后,交易者拥有的制度知识通常并不完全相同,在交易过程中,双方需要磨合或适应,并为此耗费资源。

在现实世界里,人们愿意拿出一部分资源,用以应付概率性事件;人们也发明了种种制度装置,用以分摊风险。保险业平滑着概率性事件的负面影响,能够改善社会成员的福利。但是从社会角度来看,保险业运作所耗费的资源是交易费用。当存在不确定性特别是结构不确定性,即相关问题的基本性质和可能后果在人们能够准确预期的限度之外时,契约便难以达到“购进协议明确,售出绩效确凿”,^⑧通行的是关系性缔约(relational contracting)。关系性缔约仅在一般原则的指导下,在缔约过程中随机应变,相继作出调整和补充。很显然,在调和利益的过程中,要耗费资源。

地球上的居民,不是集中于一个质点上,而是处于不同的空间位置。要获得对方的信息并为之交易,必须克服空间距离带来的障碍。经济主体为了组织异地交易,必需在寻找交易伙伴、确定产品价格、检验产品质量和移动交易对象等事务上花费通讯费用和运输费用。通讯费用与运输费用在相当大程度上具有替代性。但是,在笔者看来,尽管几乎所有的通讯费用都属于交易费用,但在运输费用中只有那些关涉交易对象的信息的寻找、处理和验证等的部分,才可归入交易费用之列;使交易对象在空间上位移的运输费用,不宜当着交易费用,尽管这种费用也是不可避免的。^⑨

上述因素通常组合地影响交易费用,以致我们难以分辨清楚究竟哪个因素在其中起了关键性作用。更为重要的是,这些因素与交易费用存在着相互联系,以致我们在很多情况下不知道究竟何者为因、何者为果。将上述诸多方面罗列出来并作为交易费用的现实根源,不仅在于它们确实与交易费用存在着紧密的联系,更由于它们比交易费用更根本、更深层。

四、分析方法批评

赫尔威奇(Hellwig, M., 1988, P, 200—207)认为,在信息不完全的情况下,如果经济主体之间的策略相互作用所耗费资源叫做交易费用,那么人们在事前对它难以作出准确的估计;当人们透彻地理解了经济体系之后,交易费用概念便没有什么用处了。以此否定交易费用概念的存在性,理由显然不充分。值得注意的是,汪丁丁(1996)从多个视角否定了交易费用概念的存在性。首先,经济学里成本是按机会成本定义的,机会成本是选择的成本,人们的选择具有相当大的主观性,故不存在不碍交流的、可操作的交易费用概念;生产的技术条件一旦选定,生产的制度结构便随之确定下来,如果交易费用与制度结构存在着紧密的关系,交易费用就不能以机会成本来定义;在不确定性情况下,人们事前并不知道各种选择的机会成本究竟是多少。其次,意识形态、语言等非经济因素会通过种种方式影响人们的行为,由于诸如此类的非经济因素的成本难以确定,交易费用也就难以确定。再次,在现实世界里,个人选择都受其他人行为的影响,以致没有一个人的行为是局部均衡的,在局部均衡中不可能定义交易费用。在博弈均衡中,当均衡解不惟一时,难以准确地推测局中人的选择;均衡解确立以后,交易费用概念变得无关紧要了。最后,在现实经济中,既会产生转化费用,又会带来交易费用。这两者之间,既难以区分,也没有必要区分。很显然,汪丁丁的看法如果真的能够成立,以交易费用概念为基石的新制度经济学将岌岌可危(盛洪,1997)。

在笔者看来,经济主体总要为交易而耗费资源,但是这并不意味着必然存在一个独立的、一般性的交易费用概念。重要的是必须弄清楚,这种耗费能够确切地加以界定的条件是什么?与其他费用在性质上有什么区别?诺斯成本分解理论为我们提供了一个简单的分析框架。本文前面已经提到,在成本分解上,诺斯的基本看法是:生产费用是转化费用与交易费用的和,转化费用与交易费用都是技术与制度的函数。如果将技术记为 t , 制度记为 i , 转化费用记为 $F(t, i)$, 交易费用记为 $G(t, i)$, 生产费用记为 $H(t, i)$, 诺斯的成本分解便可写为:

$$H(t, i) = F(t, i) + G(t, i) \quad (1)$$

为了涵盖多种情况,我们假设存在相应的技术与制度的组合,分别使交易费用、转化费用和生产费用最小。当然,合理的原则应该是经济主体选择生产费用最小的技术和制度的组合。现在的问题是,从交易费用、转化费用或生产费用最小出发选择的技术与制度的组合总具有一致性吗?这里只在成本函数关于技术和制度严格凸^①(从而只需讨论一阶条件)的情况下给出三个命题,并结合相关文献进行简要评论。

命题 1: 如果转化费用只与技术对应,交易费用只与制度有关,则转化费用最小的技术和交易费用最小的制度,也使生产费用最小。

根据此命题的条件改写(1)式,可以得到: $H(t, i) = F(t) + G(i)$ 。很显然,在此式中,转化费用最小的一阶条件 $F_t = 0$ 和交易费用最小的一阶条件 $G_i = 0$, 与生产费用最小的一阶条件 $F_t = 0$ 且 $G_i = 0$ 是一致的。在这种情况下,最小的交易费用与最小的转化费用的和,也等于最小的生产费用。

这是一种极端简化的情况。但是,首先,相当多的新制度经济学文献建立在“制度决定交易费用,技术决定转化费用”的基础上。本文第二节提到,诺斯对此已经提出了严厉的批评。其次,在这种简化情况下,尽管通过制度(或技术)的选择能够使交易费用(或转化费用)最小,但是交易费用(或转化费用)最小并不是生产费用最小的充分条件;只有在技术(或制度)已经使转化费用(或交易费用)最小,或者在转化费用(或交易费用)对技术(或制度)的导数总等于零的前提下,它才是充分的。最后,在这种简化情况下,尽管在边际意义上能够把交易费用从生产费用中分离开来,但是现实世界通常并不如此简单。

命题 2: 如果转化费用与交易费用都是技术与制度的函数, 根据转化费用最小或交易费用最小所得到的技术与制度的组合, 一般地不能使生产费用最小。

从(1)式可知, 交易费用最小的一阶条件是 $G_i = 0$ 且 $G_i = 0$, 转化费用最小的一阶条件是 $F_i = 0$ 且 $F_i = 0$, 生产费用最小的一阶条件是 $F_i + G_i = 0$ 且 $F_i + G_i = 0$ 。很显然, 只有当三组一阶条件相容, 即它们在某个技术与制度的组合上均成立时, 交易费用、转化费用和生产费用才同时达到最小; 其他情况下没有这个性质。

这是诺斯讨论的情景。但是, 这种情景里, 将生产费用进行分解, 不仅是困难的, 因为有些费用从一个角度看是转化费用, 从另一角度看是交易费用; 而且也是没有必要的, 因为经济理性要求的是生产费用而不是转化费用或交易费用最小。因此, 将制度视为给定的新古典经济学和将技术视为给定的新制度经济学, 均难以直接地成为现实世界里的经济学的有效的理论构件; 现实世界里的经济学, 与其寄希望于从成本分解入手构造理论, 不如像古典经济学那样, 讨论技术与制度等因素对人们行为和经济增长的影响。

推论: 即使技术与制度之间存在某种关系, 命题 2 的结论也成立。

不妨假设技术与制度之间的关系是 $t = M(i)$ 。此时有: $H(M(i), i) = F(M(i), i) + G(M(i), i)$ 。由此可知, 转化费用最小的一阶条件是 $F_M \cdot M_i + F_i = 0$, 交易费用最小的一阶条件是 $G_M \cdot M_i + G_i = 0$, 生产费用最小的一阶条件是 $(F_M \cdot M_i + F_i) + (G_M \cdot M_i + G_i) = 0$ 。很显然, 只有当三组一阶条件相容, 即它们在某个维度(这里是制度)的某个水平上都成立时, 交易费用、转化费用与生产费用才同时最小; 其他情况下没有这个性质。

命题 3: 经济主体先选定一个“合意的维度”, 再在此基础上选择另一个维度, 转化费用最小或交易费用最小的条件, 一般地也不能使生产费用最小。

不妨以先选择技术维度为例。我们假设“合意的维度” t_0 是将事前制度 i_0 (经济主体根据已有的知识、经验和信息而选择的初始制度) 代入生产费用最小的一阶条件后得到的技术。现在要讨论的是, 该“合意的维度” t_0 确定下来以后, 再选择维度 i_1 时所面临的情况。此时有: $H(t_0, i_1) = F(t_0, i_1) + G(t_0, i_1)$ 。在此式中, 交易费用最小的一阶条件是 $G_{i_1} = 0$, 转化费用最小的一阶条件是 $F_{i_1} = 0$, 生产费用最小的一阶条件是 $F_{i_1} + G_{i_1} = 0$ 。很显然, 只有当这三组一阶条件相容, 即它们在制度的某个水平上都成立时, 一致性才会出现; 其他情况下没有这个性质。

首先, 按照上面程序, 如果经济主体选定的“合意的维度”与同时选择技术和制度使生产费用最小的要求一致, 那么, 基于生产费用最小的序贯选择与同时选择将没有差异。不过, 这要求经济主体关于制度和技术的知识、经验和信息在时间上具有一致性。值得注意的是在 F_i 和 G_i 恒为零的极端简化的情况下, 同时选择与序贯选择的结果总是一致的。其次, 对已经确定的维度进行调整, 固然会招致沉淀成本, 但此时经济主体将拥有较为充分的知识、经验和信息。上面的分析提示, 序贯选择尽管在所处阶段上是最优的, 但通常达不到知识、经验与信息完备时同时选择的结果; 按照不同次序选择技术与制度, 虽然进行的都是序贯选择, 由于经济主体的知识、经验和信息与选择次序并非没有关系, 结果可能并不一致。不过, 序贯选择具有一个明显的优势, 那就是对知识、经验和信息的要求比较低。本节分析说明, 只有在极端简化的情况下才能在边际意义上将交易费用从生产费用中分离出来。

根据上面的分析, 我们自然要问: 定义交易费用的意义还有新制度经济学家想象的那样大吗? 也许没有。在新古典经济学大行其道的时代, 为了将制度纳入经济分析, 经济学家构造一个与且只与制度有关的交易费用概念, 作为一种权宜之计, 是无可非议的。但是, 上面分析如果是正确的, 我们就要对科斯的重大贡献是将交易费用概念引入经济分析这个提法提出质疑。在笔者看来, 科斯的学术特质首先是特立独行的现实主义态度, 再是将制度纳入分析视野。在他那里, 交易费用或许只有工具性意义, 它也许还不是最合适的工具。

五、结论性评注

根据前文的引介、评论和分析,如下几点已经初露端倪。首先,在现实世界里,交易中总存在“冲突、依存和秩序”,总要耗费资源;无论哪种制度安排,只能使这种耗费有限地减少,不能将其完全地消除。从专业分工的角度来看,交易费用可以视为交易利益的对立物,可以理解为对交易利益的“摩擦”。交易费用的现实根源是多方面的,它们往往组合地对交易费用产生影响。其次,交易费用在计量上存在天然的困难。在事前,人们只能以其知识和经验估计其种类和数量;在事后,诸多方面也难以作出准确的估计。因此,人们通常不是按照最优化原则采取行动,而是遵循“适应”或“满意”的原则。由此就能很好地理解温特(Winter, S. G., 1993, P. 179—195)的意味深长的说法:在新制度经济学与演进经济学之间,庶几存在嫁接的可能,因为这两种分析范式中存在相容的部分。再次,追求交易费用最小化通常并不符合经济理性,生产费用(诺斯意义上的)最小才是应该遵循的法则。事实上,现实世界可能沿着交易费用逐步提高的轨道运行。就美国的情况而言,交易费用占国民生产总值的比例一个世纪里增长了近25%(Wallis, J. J. and North, D. C., 1986);在总体上,技术进步可能导致了交易费用的增加,因为技术进步往往使商品更加复杂,周满地协调生产以及搞清楚商品的各种用途等增加的交易费用,可能超过由于度量的精确以及通讯的方便等减少的交易费用。最后,从诺斯成本分解理论来看,只有在极端简化的情况下,才能在边际意义上将交易费用从生产费用中分离出来;在一般的情况下,交易费用只是生产费用有机的组成部分,不仅受制度而且受技术的影响,我们既无必要也无可能将交易费用从生产成本中严格地分离出来。这似乎意味着,在现实世界里,交易过程中尽管总要耗费资源,但是,一般性的交易费用概念通常是难以得到的。

尽管从学理上看,作为新制度经济学基石的交易费用概念还有许多问题需要澄清(程恩富, 1997; 刘元春, 2001; 霍奇逊, 1989(中译本)),但是,近40年来,这个概念还是引领着经济学家们,从抽象的新古典或者说“科斯”世界,回到丰富多彩的现实世界,从演绎的“黑板”经济学,发展到致用的制度经济学,闭塞已久的经济分析的视野,从此豁然开朗。因此,我们在审视交易费用概念的理论意义特别是提出质疑的同时,还要承认它在现实的制度分析中曾经起过的作用(张建伟, 2000);不仅如此,用发展的眼光来看,在寻找到更为合适的、可替代的分析工具之前,交易费用概念还将继续存在于经济学家的语汇中,还将继续困扰现实主义不彻底的经济学家们。

注释:

- ①《企业的性质》发表后,曾经遭到长期的冷落。但是,早在20世纪40年代初科斯就说:“我不相信我的一生中还能作出如此重要的事情”,即从交易费用比较的角度考察企业的起源和规模(Coase, R. H., 1993, P. 51)。在诺贝尔奖演讲中,他也同意:这篇论文对经济学最重要的贡献是“明确地将交易费用概念引入经济分析”(Coase, R. H., 1993, P. 231)。
- ②从后文可推测,纯粹流通费用与某些生产性流通费用都属于交易费用。对于流通费用与交易费用的关系,除笔者所持的观点外,还有两种观点。其一,科斯的交易费用概念只是马克思的流通费用概念的现代说法(朱延福, 1996);其二,马克思很少关注交易费用问题(荣兆梓, 1995)。
- ③威廉姆森所说的生产费用,在含义上接近于新古典经济学的生产费用或诺斯所说的转化费用。
- ④中国某些经济学家也认同这个假设(樊钢, 1995, 第129—130页;刘世锦, 1992;等)。
- ⑤本文第四节对此将提供一个说明。
- ⑥智力、语言等也起重要的作用。就语言来说,正如刘禹锡所说:“长恨语言浅,不如人意深”,即相当多的意思难以用语言来表达;语言还存在模糊性,往往需要解释以及对解释的再解释;等等。
- ⑦参见 Transaction Costs are the Economic Equivalent of Friction in Physical Systems(Williamson, O. E., 1985, P. 19)。

- ⑧参见 Sharp in by Clear Agreement, Sharp out by Clear Performance (Macneil, I. R., 1974, P. 691—738)。
- ⑨移动交易对象的运输费用,只取决于商品的重量、体积、易碎易腐和珍稀程度等因素,不宜视为交易费用。有些经济学家将这种运输费用视为交易费用,强调的可能是这种运输费用也具有阻碍交易的性质。由于交易费用不仅事前而且事后都存在计量上的困难,而移动交易对象的运输费用通常并不如此;由于交易费用主要取决于人的行动,而移动交易对象的运输费用主要取决于物的性质,笔者不同意他们的看法。
- ⑩一般来说,低难度的制度安排,设置(set-up)费用虽然比较低,但其他方面的耗费非常高;高难度的制度安排,其他方面的耗费虽然比较低,但设置费用非常高;介于这两者之间的某个难度的制度安排,可以使设置费用与其他方面的耗费的和达到最小。技术难度与之类似。严格凸假设可以简化问题的处理。

参考文献:

- [1] Coase, R. H. (1937), The Nature of the Firm[J]. *Economica*, 4.
- [2] Coase, R. H. (1960), The Problem of Social Cost[J]. *Journal of Law and Economics*, 3.
- [3] Coase, R. H. (1993), The Nature of the Firm: Influence, in the Nature of the Firm: Origins, Evolution, and Development[M]. Williamson, O. E. and Winter, S. G. (ed.), Oxford University Press.
- [4] Coase, R. H. (1993), 1991 Noble Lecture: the Institutional Structure of Production, in the Nature of the Firm: Origins, Evolution, and Development[M]. Williamson, O. E. and Winter, S. G. (ed.), Oxford University Press.
- [5] Dahlman, C. J. (1979), The Problem of Externality[J]. *Journal of Law and Economics*, 22.
- [6] Fisher, S. (1977), Long-term Contracting, Sticky Prices, and Monetary Policy: Comment[J]. *Journal of Monetary Economics*, 3.
- [7] Hellwing, M. (1988), Equity, Opportunism, and the Design of Contractual Relations: Comment[J]. *Journal of Institutional and Theoretical Economics*, 144.
- [8] Jensen, M. c. and Meckling, W. H. (1976), Theory of Firm: Managerial Behavior, Agency Costs and Ownership Structure[J]. *Journal of Financial Economics*, 10.
- [9] Macneil, I. R. (1974), The Many Futures of Contracts[J]. *Southern California Law Review*, 47.
- [10] Wallis, J. J. and North, D. C. (1986), Measuring the Transaction Sector in American Economy, 1870—1970, in long-term Factors in American Economic Growth[M]. Engerman, S. L., and Gallman, R. C. (ed), University of Chicago Press.
- [11] Williamson, O. E. (1985), The Economic Institutions of Capitalism[M]. The Free Press.
- [12] Winter, S. G. (1993), On Coase, Competence, and the Corporation, in the Nature of the Firm: Origins, Evolution, and Development[M]. Williamson, O. E. and Winter, S. G. (ed), Oxford University Press.
- [13] 程恩富. 西方产权理论评析[M]. 北京:当代中国出版社,1997.
- [14] 格罗斯曼,哈特. 所有权的成本和收益:纵向一体化和横向一体化的理论[A]. 陈郁. 企业制度与市场组织—交易费用经济学文选[C]. 上海:上海三联书店,上海人民出版社,1996.
- [15] 樊纲. 市场机制与经济效益[M]. 上海:上海三联书店,上海人民出版社,1995.
- [16] 古诺. 财富理论的数学原理的研究[M]. 北京:商务印书馆,1994.
- [17] 哈耶克. 经济信息与价格体系[A]. 莫里斯·博恩斯坦. 比较经济体制[C]. 北京:中国财政经济出版社,1988.
- [18] 哈耶克. 自由秩序原理[M]. 北京:三联书店,1997.
- [19] 霍奇逊. 现代制度主义经济学宣言[M]. 北京:北京大学出版社,1989.
- [20] 霍布斯. 利维坦[M]. 北京:商务印书馆,1985.
- [21] 康芒斯. 制度经济学[M]. 北京:商务印书馆,1994.
- [22] 科斯. 社会成本问题[A]. 科斯. 论生产的制度结构[C]. 上海:上海三联书店,1994.
- [23] 科斯,哈特,斯蒂格利茨. 契约经济学[M]. 北京:经济科学出版社,1999.
- [24] 刘世锦. 经济体制组织选择与国有企业制度改革[J]. *经济研究*, 1992, (4).
- [25] 刘元春. 交易费用分析框架的政治经济学批判[M]. 北京:经济科学出版社,2001.
- [26] 马克思. 资本论(第二卷)[M]. 北京:人民出版社,1975.

- [27]马歇尔. 经济学原理[M]. 北京:商务印书馆,1994.
- [28]米尔格罗姆,罗伯茨. 谈判成本、影响成本和经营活动的组织[A]. 路易斯·普特曼,兰德尔·克罗茨纳. 企业的经济性质[C]. 上海:上海财经大学出版社,2000.
- [29]穆勒. 政治经济学原理(上卷)[M]. 北京:商务印书馆,1991.
- [30]诺斯. 制度、制度变迁与经济绩效[M]. 上海:上海三联书店,1994.
- [31]荣兆梓. 企业性质研究的两个层面——科斯的企业理论与马克思的企业理论[J]. 经济研究,1995,(5).
- [32]盛洪. 局部均衡、一般均衡与制度分析——兼评汪丁丁的“从‘交易费用’到博弈均衡”[J]. 经济研究,1997,(2).
- [33]施蒂格勒. 信息经济学[A]. 库尔特·勒布,托马斯·盖尔·穆尔. 施蒂格勒论文精粹[C]. 北京:商务印书馆,1999.
- [34]斯密. 国民财富的性质和原因的研究[M]. 上海:商务印书馆,1994.
- [35]汪丁丁. 知识沿时间和空间的互补性以及相关的经济学[J]. 经济研究,1997a,(6).
- [36]汪丁丁. 知识的互补性与本土性[J]. 中国社会科学季刊(香港),1997b,春.
- [37]汪丁丁. 在经济学与哲学之间[M]. 北京:中国社会科学出版社,1996.
- [38]威廉姆森. 交易费用经济学:契约关系的规制[A]. 陈郁. 企业制度与市场组织——交易费用经济学文选[C]. 上海:上海三联书店,上海人民出版社,1996.
- [39]伍山林. 交易费用定义比较研究[J]. 学术月刊,2000,(8).
- [40]伍山林. 企业性质解释——节约交易费用与利用社会生产力[M]. 上海:上海财经大学出版社,2001.
- [41]杨小凯,黄有光. 专业化与经济组织——一种新兴古典微观经济学框架[M]. 北京:经济科学出版社,1999.
- [42]朱延福. 科斯的交易费用理论与马克思的流通费用理论比较研究[J]. 中南财经大学学报,1996,(3).
- [43]张建伟. 现实主义、制度主义与中国经济学发展[J]. 中国社会科学,2000,(4).
- [44]张五常. 科斯[A]. 约翰·伊特韦尔. 新帕尔格雷夫经济学大辞典[C]. 北京:经济科学出版社,1992.
- [45]张五常. 经济组织与交易成本[A]. 约翰·伊特韦尔. 新帕尔格雷夫经济学大辞典[C]. 北京:经济科学出版社,1996.
- [46]张五常. 关于新制度经济学[A]. 科斯,哈特,斯蒂格利茨. 契约经济学[C]. 北京:经济科学出版社,1999a.
- [47]张五常. 交易费用的范式[J]. 社会科学战线,1999b,(1).

A Critical Study on the Transaction Costs

WU Shan-lin

(School of Economics, Shanghai University of Finance and Economics, Shanghai 200433, China)

Abstract: The concept of transaction costs is one of the most basic concepts in the New Institutional Economics. Owing to its great capacity of explaining the real world, it has not only been frequently employed by economists in their writings, but also quickly penetrated into other fields of social sciences for the past forty years. Up to now, this concept, however, has not been exactly defined, its nature hasn't been clearly revealed, and thus leaving more to be explored in many other aspects. This paper offers a critical study on transaction costs from the viewpoint of its origin of thought, its recent development, sources of reality, and methodology of analysis.

Key words: transaction costs; the origin of thought; recent development; sources of real life; methodology of analysis