

制度变迁理论与中国经济改革的方式选择

庄子银 邹 薇

本文认为,中国改革过程具有双轨并行格局、从边际向全局扩展、经济与政治及改革与发展过程统一的特征。本文运用动态优化分析表明,在中国改革这样一个调整成本巨大的制度变迁中,根本不可能一步到位地由原有制度“跳跃到”新制度,即采取“激进式方式”;相反地,通过“渐进式方式”可以把调整成本融汇到整个改革过程中去,逐渐地趋近于目标。因此,“渐进式方式”是中国改革的优化选择。

中国经济改革是以中国特有的政治、经济、文化、历史等制度背景为基础的一次重大的制度变迁与创新过程,它不仅关系到经济制度运行的效率和经济发展的前途,而且与千百万人的切身利益有密切关联。因此,如何选择改革的方式就成为当今理论和实践的一个重大课题。本文结合中国改革实践,运用制度变迁理论,借助动态优化方法,分析比较了两种改革方式——激进式与渐进式的稳定性,指出:渐进式改革方式是中国经济改革的优化选择。

一、制度变迁理论的基本假说

制度变迁是制度创立、变更和随时间变化而打破的方式,其变迁参数包括技术、人口、产权和政府资源的控制。近年来,制度变迁理论获得了较大发展,并对经济学的各个领域,产生了深刻的影响。我们认为,对于制度变迁过程,以下基本假说具有普遍性。

(一)任何理性的单个行为主体(个人或组织与集团)在制度变迁中追求的目标皆是自身效用或财富(净货币收益与非货币收益)的极大化。

1. 在既定的资源禀赋、技术状况和文化要素的约束集合下,单个行为主体如果认识到,按照既存制度安排,就无法获得潜在的收益,而改变既有安排,就能获得在原制度框架中所得不到的收益,那么他们将努力谋求建立起预期会对自己最为有利的制度安排。

2. 对于任何单个行为主体而言,一旦创立和利用新制度安排净预期收益为正,即变迁的预期私人收益超过私人成本时,就会产生对制度变迁的需求。并且这种净预期收益越大,则制度变迁需求越大,其需求弹性也越大。

3. 制度变迁通常是以制度结构变迁的形式出现的。单个行为主体对制度结构中各项制度安排具有不同的偏好,即他们往往支持那些于己有利的制度变迁,而阻止那些于己不利的制度变迁。因此,即使各个行为主体都存在强大的制度变迁需求,但是由于行为主体私人收益结构的差异,仍会出现行为主体对制度变迁需求结构上的不均衡性。

4. 单个行为主体总是希望把制度变迁,推进到制度变迁的预期私人边际收益等于私人边际成本的那一点为止。事实上,也只能推进到这一点上,因为这一点所对应的制度结构的任何改变都不能给经济中任何个人或团体带来额外的净收益。

(二)任何单个行为主体的理性都是有限的。由于人类所处的环境的复杂性、不确定性和人类自身能力的限制,人们不可能知道全部备选方案,不可能把所有的价值考虑都统一到一个综合效用函数中去,也无力精确计算出所有备选方案的实施后果。有限理性意味着:

1. 一般而言,改变一种正式的制度安排会碰到“搭便车”问题。只要制度安排已经被创新并建立起来,则每一受这个制度安排管束的人,不论他是否承担了创新过程以及制度运行初期的困难,他都得到同样的服务或利益。为此,每人都试图享受制度创新的收益而回避制度创新的成本,以致实际发生制度创新的密度和频率将会少于作为整体的最佳社会量。

2. 任何单个行为主体在制度变迁过程中都可能存在着机会主义倾向。所谓机会主义倾向,是指人们借助于不正当手段以谋求自身利益的行为倾向。这是由于行为主体的有限理性,阻碍了他们完整地把握复杂和不确定的环境,抑制了他们获得环境目前与将来变化的所有信息。因而,就可能出现一些行为主体利用信息不对称性环境,进行欺诈,或者利用某种有利的讨价还价地位背信弃义、要挟对方。

3. 正是由于行为主体的有限理性,才促使人类建立起种种有效制度安排(如组织),以应付个人在复杂性和不确定性面前理解力与计算力的不足。在制度化的组织内,人们可能通过专业化分工与协作,使组织总体理解力超过个人理解力,从而达到个人无法企及的目标。

(三)复杂的现实世界和有限人类理性使个人无法迅速、准确和低成本地作出理性判断时,他们便会借助于包括价值观念、伦理规范和道德准则在内的意识形态来走“捷径”。

1. 这条捷径是否有效,这取决于人们对价值信念或意识形态的虔信程度。一般地,个人对于周围的制度安排及制度结构符合于道德准则的信念越坚定,则个人搭便车或违犯这些价值观念与社会准则的可能性越小。

2. 对现行制度安排合法性的认同,能够在一定程度上淡化机会主义行为。因此,任何政府能通过意识形态教育来增进社会成员总体意识形态的积累,降低治理国家的交易成本。

3. 个人的意识形态是相对稳定的。诸如收入分配、劳动分工及其它制度安排的变迁,并不立即引起个人意识形态的变迁。但也存在结构性不均衡问题。一般而言,青年人比老年人更愿意接受新的意识形态并为之作出投资。

4. 意识形态具有刚性。尽管随着制度不均衡的出现,意识形态与现实之间的缝隙会增大,然而,假若为了恢复均衡而强制推进制度创新,并改变原来的意识形态,那就很可能会伤害统治者权威的合法性。在矛盾激烈的时候,统治者可能会采取非常措施来维护旧的无效率的制度安排和既有的意识形态的纯洁性。

(四)在制度变迁中,国家被视为一种追求自身效用或福利最大化的行为主体。国家在政治力量对比中具有暴力上的比较优势^①,在制度变迁中存在双重偏好。一方面,它通过确立竞

争与合作的基本规则,建立要素与产品市场的产权结构,来实现统治者及其集团的效用最大化;另一方面,国家力图通过提供公共或准公共产品或服务,以降低经济交易中契约的确立、谈判与执行的成本,促使社会产出最大化,由此:

1. 国家在制度创新中的双重目标不一定是和谐一致的,统治者垄断租金最大化的产权结构与节约交易成本,刺激经济增长的有效制度安排之间往往存在紧张关系。国家目标偏好的差异将对制度变迁的方向、速度、形式、广度、深度和时间路径产生重要影响。

2. 政府在政治力量对比和资源配置权利上均处于优势地位,它的制度供给能力意愿支配着制度变迁进程。尤其是国家可以在很大程度上弥补制度创新的供给不足,因为任何个人或非国家的组织都会面临搭便车问题,而国家没有搭便车问题,所以制度创新主要来自国家统治者,而不会来自其它组织或个人。

3. 一般地,只要统治者的预期收益高于强制推动一项制度变迁的预期成本,他就会采用行动来消除制度不均衡。尽管如此,如果制度变迁会降低统治者可获得效用或威胁到统治者生存,那么国家可能仍然会维持某种无效率的制度安排。

4. 统治者与其代理人的效用函数并非一致。尽管统治者会试图监视其代理人的行为,实施一种促使代理人忠诚的奖励制度,并不断灌输和强化诚实无私、尽职尽责的意识形态。但他仍然无法完全控制官僚机构,无法彻底消除官僚机构的自利行为。因此,统治者能否建立有效的制度安排,在相当程度上取决于统治者与官僚机构之间的效用函数的一致程度。

5. 制度变迁采取何种具体形式,取决于统治者及其集团的偏好和利益与制度变迁取向是否一致。如果统治者集团的私人利益与社会成员的社会利益基本一致,那么制度变迁可能是在原有制度框架下的改良或调整;相反地,如果统治者及其集团的私人利益已经与社会成员的社会利益根本冲突,那么制度变迁就会诉诸革命的形式而发生。

7. 对于一般社会成员来说,只要他们所支持的制度变迁能够以他们可以接受的速度、广度和深度进行,只要他们为了增进自己的利益而产生的对新的制度的安排需求,能够被满足到令他们感到满意的水平,那么在政体和政治秩序改变的预期净收益不小于零的情形下,制度变迁究竟在何种形式和何种政体与政治秩序下进行,便是无关紧要的;反之,在政体与政治秩序改变的预期净收益小于零的情形下,社会成员倾向于选择维持原有的政体与政治秩序。

二、中国经济改革过程的特征

关于经济改革的方式,存在着两种截然对立的思路:一种是以萨克斯(J·Sachs)和李普顿(D·Lipton)为代表的西方学者提出的“激进式”方式,其核心是私有化,即资产或服务功能从公有制向私人拥有或控制的转移,旨在通过大规模推行私有化和市场价格自由化,以提高有关资产或服务功能的经济实效,促进经济决策的非政治化,削弱公共部门,实行较广泛的资产私有制^②。另一种是以我国改革实践为代表的“渐进式”方式,即在“摸着石头过河”的过程中,形成了一种颇具特色的改革方式。

有些学者认为中国改革特征为:增量改革、试验推广、非激进性^③。也有的学者把中国改革归结为政府主导型制度变迁方式,认为政府主体制度所供给的能力与意愿、政府的政治与经济目标和政府的行政权威决定了改革方式的渐进性^④。我们认为渐进性已经包括了试验推

广，非激进性等涵义，而政府主导与渐进性无必然因果关系。渐进式改革方式必然要经历较长的时间跨度，面临较多的利益冲突，涉及较广的制度安排层次，其特征概括为：

首先，改革面临市场化与工业化双重任务。中国是一个发展中大国，传统农业异常庞大，农村劳动力仍占总劳动力 60%。从发展阶段、资源条件、经济制度与经济政策等方面看，中国改革的初始条件具有令人惊异的多样性。改革面临着双重任务，其一是改造传统农业和促进经济二元结构一元化，即实现工业化；其二是打破组织上的二元结构，构建社会主义市场经济制度，完成市场化转型。从西欧历史经验可以看到，要完成这两项任务中任何一项，都不得不付出极大代价，经历漫长时日。我国固然可以汲取他国经验教训，在工业化、市场化过程中少走弯路，但是如此艰巨的双重任务重叠在同一个时间段上，这就必然决定了改革方式不会是一步到位的激进式的，而只能是历时较长的渐进过程。

其次，双重体制并行的特定格局。中国改革是在试验中逐渐推广的。因此，改革进程在不同部门、不同地区、不同类型的企业及经济生活的不同层面，广泛地存在差异性。这种差异性的根源，从需求方面看，是不同经济主体从特定改革措施、步骤中获得的私人收益与承担私人成本各不相同，因而对改革的需求强度参差不齐；从供给方面看，是决策者权衡各个经济利益集团的改革需求，相应地在改革步骤供给上采取差别政策。正是这种差异性导致了中国经济生活中普遍存在双重体制并行局面。在一定时期内，改革这一特征可以减轻制度变迁的震荡，利用和发挥原有制度若干机制的作用，促使新制度成长发育并逐步形成优势，最后完成转型。但是也要看到，双重体制如果长期并存，相互间的摩擦、冲突与损耗会增加制度变迁成本，使得许多预期的改革步骤走形或延迟，改革过程因此比预想的还要漫长曲折。

再次，从边际改革到存量改革。有些学者认为：“不从对资产存量的再配置入手，而着眼于在资产增量的配置上引入越来越多的市场机制的改革方式”，即“增量改革”，是我国改革的重要特征^⑥。我们认为，在改革之初，边际改革特征比较明显，边际改革在开始时往往容易取得鼓舞人心的超常成效。但是这种并不彻底的改革很容易在原有制度框架中失去激励能力，致使改革进入收益递减阶段。这从承包制暴露出的问题中就反映得十分明显。所以，随着改革的推进，边际改革势必为更深层次的存量改革所取代。以边际改革为存量改革作铺垫，由增量到存量，由表层到深层逐步地推进改革，这是中国改革过程的一个重要特征。

又次，改革是经济过程与政治过程的统一。政府通过制度创新所追求的是双重目标：一是通过降低交易成本使社会总产出最大化；二是通过使权力中心及它所代表的利益集团的垄断租金最大化实现政治支持最大化。因此，须结合政治市场结构，政治力量对比关系，才能分析改革进程的方向、深度、广度等各个方面及其影响因素。从改革的供给方面看，中央决策者总是谋求巩固与加强其政治权威，尽可能地争取社会支持或尽可能地减少公共反对的社会力量。因此，中央决策者在改革时间路径的每一个阶段上，将把政治改革和经济改革分别推进到改革的边际收益与边际交易成本相等时为止。因此，中央决策者会通过不断地试验，一方面，将政治改革的供给方向、速度、形式、广度和深度控制在预期有利于巩固和增强其政治权威的限度内；另一方面，把经济改革作为谋求最大限度政治支持的重要途径，将经济改革进程控制在预期有利于巩固与加强政治权威的限度内。从改革的需求方面看，改革的私人收益与社会收益、私人成本与社会成本之间存在差异，这就蕴含了外部性和“搭便车”等问题，刺激了各集团为追求额外利益而普遍谋求改革的“饥渴症”。因此，局部改革措施一经出

台,则各部门、地区或企业组织竞相争取成为试点,结果出现经济特区热、股份公司热、房地产热等现象。这种寻求改革租(即在改革中利用不正当手段谋求超额收益)的现象实际上是在市场经济不发达情形下,发展中国家较为普遍的寻租行为在改革过程中的特殊表现。寻求改革租的结果是使得中央决策者与各个集团之间产生一种互为支持的机制:即中央决策者试图通过改革获得更广泛的政治支持;而绝大多数行为主体试图通过谋求和推进局部改革而获得货币或非货币利益。从积极方面看,这种机制可能有助于改革过程信息反馈和逐步推进;从消极方面看,这也可能形成中央决策者与其他行为主体之间讨价还价的不规则机制,结果延滞向规范的市场经济转型的过程。

最后,改革成为经济增长与发展的动力。从直接效应看,改革通过改变原有的生产组织和激励机制,提高资源配置效率,优化产业结构与产品结构,增加社会有效供给总量。因此,它应该使社会总供给弹性增大,供给量增加。从间接效应看,改革创造了新的效率更高的制度安排,从各方面促进经济发展:其一,制度通过影响信息与资源的可获得性,建立社会交易的基本规则以及塑造发展的动力而扩展人类的选择;其二,制度结构决定着“矫正价格”的努力的成效。我国传统经济制度的弱点,导致了大量的价格扭曲,阻碍了经济顺利发展,为此,通过制度结构来矫正价格对于经济发展具有长远的和根本的意义;其三,制度安排维护与促进技术创新。我国长期技术创新动力不足与进展缓慢,因此,要推动技术创新,还有待于创造出促进创新,界定产权和契约关系或分担外在性风险的种种制度。

三、改革过程的动态优化

改革过程可视为一个投资过程,决策者和社会公众预期从制度变迁中有所收益。引入连续的修正投资模型来分析改革过程,可得改革过程净收益极大化数学表达式如下:

$$\text{Max} \int_0^{\infty} (\pi(k) - A)e^{-rt} dt, \quad \text{s.t. } dk/dt = A - \delta k \quad (1)$$

这里, k 为改革所带来的社会总资本积累, $\pi(k)$ 为决策者和社会公众预期从改革后 k 中取得的收益。它满足 $\pi'(k) > 0$, $\pi''(k) < 0$, $\pi'(0) = \infty$, $\pi'(\infty) = 0$ 。 A 为改革过程中发生的全部交易成本,或称之为调整成本。 r 表示时间贴现率或利率。 t 为时间。其中 dk/dt 为新增的人均资本量, δ 为折旧率。初始资本状态设为 $k(0)$ 。通过动态最优化解求得关于投资的著名的托宾 q 理论的一般结论: $\pi'(k^*) = \delta + r$ (2)

这就是说,长期人均最优资本的边际收益等于利率加上折旧率,即等于资本成本(Cost of Capital),这也意味着,不论改革前初始状态 $k(0)$ 为多少, $k(0)$ 都会马上调整到最优的 k^* 水平,其间没有任何中间过渡。

如果使问题复杂一些,考虑更多的经济与非经济因素,我们可以引入制度运作成本 τ ,它象税收一样应在净收益中扣除,再引入一些有利于改革的因素(如国内舆论、国际环境支持等),记作 α ,这是改革过程的一种无形投入。那么,上述最大化问题转化为如下形式:

$$\text{max} \int_0^{\infty} (1 - \tau)(\pi(k) - A)e^{-rt} dt, \quad \text{s.t. } dk/dt = (1 + \alpha)A - \delta k \quad (3)$$

$$\text{由(3)式得出的动态最优化解为: } \pi'(k^{**}) = (r + \delta)/(1 + \alpha)(1 - \tau) \quad (4)$$

这就是说, τ 的加入使长期人均最优资本的边际收益 $\pi'(k^*)$ 比原来增大, 而 α 的加入使之比原来减少, 最终 $\pi'(k^*)$ 与 $\pi'(k)$ 相比的结果视 τ 与 α 的大小而定, 这是 (4) 与 (2) 式的唯一区别。除此之外, (4) 与 (2) 一样, 表明初始状态 $k(0)$ 能够马上调整到最优化水平 k^* , 中间没有过渡。由此可见, (2) 与 (4) 体现了把改革的调整成本视为一次性支付的某个值的“激进式改革方式”, 这里即使有调整, 也是一步到位的。(2) 与 (4) 所揭示的只是得到最优结果的满足条件, 但是它不能提供关于如何从 $k(0)$ 调整到 k^* 、 k^* , 或者关于改革方式的任何信息。

在中国的情形中, 改革是一个渐进的过程, 对改革进行的投入决不是一次性的, 而是一个随着改革进程而变化的函数, 可记作 $h(A)$, 它满足 $h'(A) > 0, h''(A) > 0$ 。其中 A 又是时间的函数, 即 $dA/dt \neq 0$, 那么, 改革过程净收益最大化问题现在可表示为:

$$\text{Max} \int_0^{\infty} (\pi(k) - h(A))e^{-\alpha t} dt \quad (5)$$

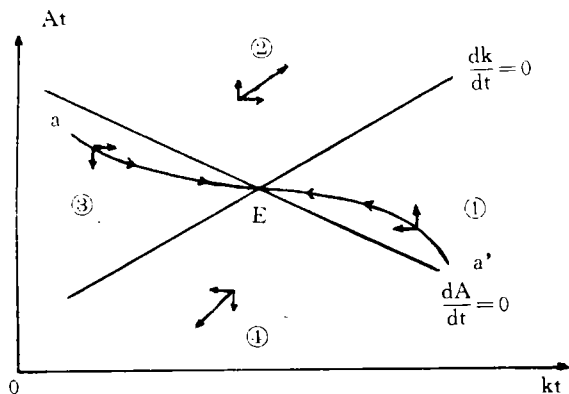
此动态最优化的解为下面两个微分方程所描述:

$$-k''(A)dA/dt = \pi'(k) - h''(A)(\delta + r) \quad dk/dt = A - \delta k \quad (6)$$

在此列出这个动态系统及其长期均衡的若干基本性质: ①由于 k 与 A 在这里均为时间的函数, 所以在通过改革实现长期均衡时, $\pi'(k)$ 不仅与 $(\delta + r)$ 相关, 而且也必然与 $h(A)$ 相关; ②解出 (6) 式, 得到均衡时的 A^* 与 k^* 满足 $\pi'(k^*) = h''(A^*)(\delta + r)$, 亦即改革带来的预期边际收益等于改革过程中所付出的边际调整成本的贴现值。这实际上是经典的微观均衡条件在时间路径上的动态扩展; ③在激进式方式中没有中间过渡, 也就不存在稳定性路径问题, 但是在这里的“渐进式”方式中, 改革要跨越一个不算短的时间序列, 因而改革过程的稳定性问题就成为不容回避且十分关键的了。渐进式方式具有稳定性吗? 把调整成本与资本分析限制在长期均衡值附近。围绕 A^* 和 k^* 进行线性化, 得到线性系统:

$$\begin{bmatrix} dA/dt \\ dk/dt \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \delta + r & \pi''(k)/h''(A) \\ 1 & -\delta \end{bmatrix} \begin{bmatrix} A - A^* \\ k - k^* \end{bmatrix} \quad (7)$$

考察系数矩阵 $|\lambda I - M| = 0$ 的两个特征根 λ_1, λ_2 , 满足 $\lambda_1 + \lambda_2 > 0, \lambda_1 \cdot \lambda_2 < 0$, 即 λ_1 和 λ_2 恰好一正一负, 这个动态系统是个稳定的鞍点 (Saddle-point) 均衡。其相位图如下:



在平面中, $dk/dt = 0$ 是上斜的, $dA/dt = 0$ 的轨迹是向下倾斜的。不失一般性, 不妨把它画成直线。一方面 $dk/dt = 0$ 把平面分成两部分, 由 $dk/dt = A - \delta k$ 可知: 在 $dk/dt = 0$ 上方, 由于调整成本 A 值很高, 那么就要求 k 也上升, 以使制度变迁具有经济上的可能性; 反之, 在 $dk/dt = 0$ 下面, 由于调整成本 (A) 很小, 那么 k 也降到较小值, 即可满足实现 $dk/dt = 0$ 之均衡条件。

另一方面, $dA/dt = 0$ 把平面划分成两个部分。在左侧, 由于制度变迁所能带来的资本存量 (k) 较小, 相应的边际收益 $\pi'(k)$ 也较小, 因此, 与 $\pi'(k)$ 均等的边际成本贴现值也较小, 则调整成本 A 必须降到较低水平, 制度变迁才是可行的; 反之, 在 $dk/dt = 0$ 右侧, 由于制度变迁所带

来的资本存量 k 较大,相应 $\pi'(k)$ 也较大,因此,与 $\pi'(k)$ 相等的边际成本贴现值也较大,尽管调整成本 A 上升到较大值,也还是能够满足 $dk/dt=0$ 条件。由此可见,由制度变迁带来的资本存量与调整成本的大小是正相关的。

综合起来,图中 $dk/dt=0$ 与 $dA/dt=0$ 把平面分成四个子区域。两种作用力在②④区域会发散开去,而只在①③区域中,它们才通过协同作用推动着经济体系向均衡点 E 移动,并且由于两种作用力都是累积的、渐进的,因而 aEa' 表示的是唯一优化的渐进路径。

假设一次性地支付庞大的改革成本,实行“激进式改革”,试问,是否存在一稳定路径呢?把(1)式进一步简化,把变迁收益表示为 k 和 A 的函数 $\pi(k, A)$, 满足 $\pi'(k) > 0, \pi''(k) < 0, \pi'(A) < 0, \pi''(A) > 0$, 最优化模型为:

$$\text{Max} \int_0^{\infty} \pi(k, A) e^{-\rho t} dt, \quad S \cdot t \cdot dk/dt = A \quad (8)$$

解(8)式得: $dA/dt = (\pi'_k + \pi'_A) / \pi''_A, dk/dt = A$ 。相似地,对这个系统进行线性化: $dA/dt = \dot{A} = (A - A^*) + \pi''_k / \pi''_A (k - k^*), dk/dt = \dot{k} = A - A^*$ 。该系统的特征方程的特征根 λ_1 和 λ_2 同为正。表明这个线性系统是不稳定的,不存在鞍点均衡,这个系统是发散的。

综上所述,我们可得出如下结论:

1. 经济改革是一个向着“帕累托效率”不断优化的过程,它具有“帕累托改进”性质。
2. 改革是一个公共选择过程。为此,要在政治市场上更深入地把握制度变迁的需求与供给因素。在旧的行政隶属关系与条块分割并存管理体制下,如何最大限度地扩大有利于改革的政治支持,减少不利于改革的寻租行为,这是理论与实际工作中值得引起注意的问题。
3. 改革的过程在不同时间和不同范围、不同层次上,可以有不同的具体选择。在较低层次上的局部改革,如部门性、地区性改革措施的出台,就可以在整个经济背景下,尽可能地一步到位,以减少体制摩擦和双轨冲突造成的效率损失。在边际改革已经取得相当显著成效时,也可以大幅度推进更深层的改革。
4. 改革的深度、广度,改革的预期收益,改革所要承担的调整成本,都会影响改革的方式选择。因此,仅仅出于对预期收益的考虑,或许激进式改革更吸引人,但考虑调整成本时,情形就不同了。我们尤其认为,单单静态描述或简单把调整成本处理成一次支付的常量是不够的,只有把静态的定性分析与动态的优化分析结合起来,才能找到适当的改革方式。在中国,改革的深度、广度与难度之大是前所未有的,通过改革建立社会主义市场经济体系,步入现代经济增长轨道,这样的预期固然美妙,但为此要付出巨大的调整成本。所以急于求成只会导致欲速则不达的局面,“渐进式改革”是中国改革的适当选择。

注 释:

- ① 诺思:《经济史中的结构与变迁》,1981年英文版,第23页。
- ② 李普顿和萨克斯:《在东欧创造市场经济》,载《布鲁斯经济活动论文》1990年第二期。萨克斯:《俄罗斯的私有化:若干东欧经验》,载《美国经济评论》1992年5月号。
- ③⑤ 林毅夫等:《论中国改革的渐进式道路》,载《经济研究》1993年第9期。
- ④ 杨瑞龙:《论我国制度变迁方式与制度选择目标的冲突及其协调》,载《经济研究》1994年第5期。