

## 交易成本分析

文/金自康 蔡银寅

### 一、引论

正如哈耶克所说：“在社会科学中往往是，碰巧能测量的东西被当作是重要的。”固然，交易费用不像生产费用那样容易被准确的测量，但它在经济学中的地位却是不容忽视的。交易费用产生于所有权的转让，或者更一般的讲，产生于财产权的转让。在集权经济体制下，实行中央决策，交易费用转变为管理费用。并且，在现代市场经济制度下，交易费用有日渐增大的趋势。一般情况下我们认为在以下四个方面会产生交易费用。1、交易前准备阶段的寻找潜在交易目标，发现价格等方面的费用。2、交易发生时的谈判、签约等费用。3、交易过程中的监督执行费用。4、预防不确定性风险预测准备方面的费用。这四个方面的费用再加上因交易而产生的机会费用就构成了交易费用。

交易费用会对交易数量，交易价格和社会经济福利以及社会经济效率产生影响。直到罗纳德H科斯教授在其著名论文《企业、市场与法律》中提出交易费用的概念之后，交易的费用问题才引起了一些经济学家的注意。

在微观经济学领域内，我们仅研究两类市场，即要素市场和商品市场，两个市场主体，即厂商和家庭（消费者或要素所有者）。对于厂商来说，他们的经济活动要依靠在两个市场上的交易，厂商需要在要素市场上取生产资料后才能进行生产，当生产活动结束后，厂商所生产的产品必须拿到商品市场上出售，只有在产品后厂商的再生产活动才能继续进行。同时，对于家庭（消费者或要素所有者）来讲，他们是两个市场上交易活动的另一主体，因此，我们只从厂商的角度上研究交易行为。

由于信息技术的飞速发展，使得在短时间内获取大量的信息成为可能，同时，技术的进步也带来了另一个问题，获取信息的成本问题，随着互连网技术迅速普及，获取信息所花费的成本已经不可忽略，从某种意义上讲，信息成本已经成为交易成本的一部分，并且不能忽视。

在现实的经济活动中，由于银行利率和行业平均利润率的存在使得任何资本流动过程的时间延迟效应都要付出费用，交易的时间成为决定交易费用的另一因素。交易时间会影响到企业生产的方方面面，而交易的费用通过其对企业生产活动的影响反映出来，这是量化企业交易费用的一个切入点。对于交易费用的量化可以通过对那些可测量的量实现，这是建立交易费用函数的微观机理。

要研究交易成本，首先要对所涉及的参量进行定义。

总成本： $C$

生产成本： $C_0$

交易信息成本： $C_1$

交易成本： $C_2$

交易时间： $t$

交易价格： $p$

产量： $q$

当期银行利率： $i$

该行业当期平均利润率： $I$

利润： $P$

### 二、建立模型

#### 1、建立简单交易成本模型的前提条件。

交易的成本是一定的，交易成本有交易双方共同承担，分担的多少有交易双方的交易成本函数决定，双方的合作可以减少交易的成本，但由于他们之间构成囚徒困境博弈，从而形成的纳什均衡使双方各自按照自己的交易成本函数进行交易，交易的总成本将会变大。

我们仅选某一行业的某一企业进行研究，企业的选取具有普遍意义，并且该企业的资本一定，其交易活动能够影响起生产活动，使得产量与交易时间存在线性的相关关系。

在交易进行之前，企业必须获取一定的交易信息后才能够进行交易，而获取信息的过程要花费一定的成本，并且花费成本的多少与交易时间成反比关系。

交易的双方是非合作的交易行为，不存在一方受制于另一方或双方相互制约的现象，交易的内容和方式都具有普遍意义，不是特殊的交易行为。

#### 2、建立简单交易成本函数。

由前提条件可知，产量、交易价格与交易信息成本总可以表示为交易时间的函数，于是有：

$$q=k_1t \dots\dots\dots ①$$

$$p=k_2t \dots\dots\dots ②$$

$$C_1=k_3/t \dots\dots\dots ③$$

( $k_1$ 、 $k_2$ 、 $k_3$ 均为经验系数，可以通过对该行业的生产活动进行量化分析后得知，这里仅使用这些系数，而不要做具体的分析。)

所得的交易成本函数为：

$$C_2=f(t)=C_1+pq(I-i)t$$

$$=k_3/t+k_1k_2t^3(I-i) \dots\dots\dots ④$$

相应得到的总成本函数为：

$$C=C_0+C_2$$

$$=C_0+k_3/t+k_1k_2t^3(I-i) \dots\dots\dots ⑤$$

利润函数为：

$$P=pq-C$$

$$=k_1k_2t^2-C_0-k_3/t-k_1k_2t^3(I-i) \dots\dots ⑥$$

### 三、模型分析

#### 1、对交易成本最小的分析。

交易费用函数和利润都是关于时间的一元线性函数，因此，在一定的时间区间内，交易费用和利润都应该存在极值，不同的是交易费用存在极小值而利润是极大值。

对于交易费用函数求导得：

$$C_2' = 3k_1k_2(I-i)t^2 - k_3/t^2$$

令 $C_2' = 0$ 得：

$$t = [k_3/3k_1k_2(I-i)]^{1/4}$$

所以，方程④存在最优解，即存在使得交易成本最小的交易时间 $t$

并且： $t = [k_3/3k_1k_2(I-i)]^{1/4}$

即：交易时间为 $[k_3/3k_1k_2(I-i)]^{1/4}$ 时，交易费用最小。显然，对于利润函数进行分析的结果与对交易费用分析所得的最优解是不同的，也就是说，节约了交易费用并不一定会使利润增加。

#### 2、利用该模型对交易时间不为零的解释。

有以上分析可知，无论是实现交易成本最小也好，利润最大也好，交易时间总不为零，而在现实中，厂商也总是在追求利润的最大化，所以，交易时间在大多数时间是存在的，只不过因行业的不同有所不同罢了。那么，在不同的供求关系下，交易时间又如何呢？显然，对与厂商来讲，如果在要素市场上是供大于求，而在商品市场上供不应求时，则厂商在获取交易信息过程中花费的成本将大大减少，甚至可以忽略，此时的交易时间趋于零，也就是说厂商不愿意囤货。同理，如果情况相反，厂商商则愿意拉长交易时间。对于另外两种情况，这里不在讨论。

在大多数情况下，企业的生产活动是从利润方面考虑的，以实现利润的最大化为目标，而实现这一目标时所花费的交易费用并不是最小的，当交易费用被考虑时，企业如果一味的节约交易的费用并不能使利润增加，这就是企业明知某种交易要花费大量的成本但也不放弃的原因。从某种角度来讲，交易费用会损害社会福利，是一种资源的浪费，但他在微观上却不受约束，企业则不会主动的考虑如何来降低交易费用。因此，通过减低交易费用来增加社会福利只有靠制度的改革来实现。

#### 3、交易内部化时的交易时间问题。

当交易成为内部交易时，交易信息是管理者发布的，这时可以认为交易信息成本不存在，交易的价格也不再受交易时间的影响，交易时间一般趋于零。事实上，现代经济学者一般认为，发生在企业内部的交易并不是无交易成本的，只不过把交易成本作为另一种形式存在于企业内部而已，称之为管理成本或内部成本。由于管理成本与企业的规模有关，所以在规模一定的情况下认为交易内部化不会引起管理成本的增加也是较为合理的，同时，由于企业内部信息流通非常便捷，所以把内部化的交易看作是无信息成本的。当然，在某些时间，由于企业管理方面的问题，交易也会持续一定的时间，但企业的这种组织方式是低效的。

### 四、模型扩展

#### 1、产量与交易时间函数关系的相对性。

有些时候，产量与交易时间是没有关系的，比如在一些军火生产或垄断企业的生产是不会受到交易时间的影响的，所以，产量与交易的时间关系具有一定的相对性，这样，交易成本函数和利润函数将发生变化，交易时间的最优解也将发生变化。

#### 2、垄断情况下的交易成本。

在垄断情况下，交易的一方控制着交易信息、交易时间和交易价格，交易的一方将不用付出

任何的交易成本，交易成本完全有另一方承担，此时双方的均衡将会使交易成本趋于最小。于是，便可以很容易的解释垄断资本主义阶段的经济危机和经济周期。在垄断资本主义阶段，厂商和家庭在交易信息方面是不对称的，厂商和家庭（消费者或要素所有者）在信息的收集上是一个智猪博弈，家庭（消费者或要素所有者）作为模型中的小猪，越来越不愿意为信息付出成本，这样厂商与家庭（消费者或要素所有者）之间的信息就不对称。从决策的效果来讲，厂商的决策效果远大于家庭（消费者或要素所有者）的决策效果，这样形成了决策的不对称。信息不对称和决策不对称导致家庭分担的交易成本越来越多，于是出现了资本家生产的相对过剩和工人购买力相对缩小的矛盾，这种矛盾的不断扩大，扩大到一定程度便会出现经济危机。当一次经济危机结束后，交易成本将从新分配，开始另一经济周期。

### 3、国家参与对交易成本的影响。

国家对经济的干涉。国家对经济的干涉一般表现在两个方面，一是国家对要素市场的控制，主要是对土地、矿产、河流等自然资源的控制；二是国家对一些商品的定价和对另一些商品的保护价。

当国家成为市场的又一主体之后，国家成为最具优势的市场主体，企业的地位相对下降，国家在交易过程中占据绝对优势地位，其分担的交易成本最少，这也是企业越来越发现与政府交易成本越来越高的原因，国家所减少的那部分交易成本通过转移支付的方式给了家庭（消费者或要素所有者），这样就缓解了资本家生产的相对过剩和工人购买力相对缩小的矛盾，经济危机发生的周期得以延长。

但是，当国家对经济的管理不当时，就会出现政府失灵的现象，此时的政府将在一定程度上扩大交易成本分配的矛盾。

### 五、结束语

交易成本虽然对产品的质量构不成任何影响，但它却对企业的正常运行起着非常重要的作用，交易成本直接影响着企业的盈利。交易成本的量化对企业的生产活动具有重要意义，由于交易成本的存在，分工便不一定是越细越好了，分工增加交易，同时会引发更多的交易成本。在专业化问题上，企业应该根据其所处行业的发展状况来决定采取何种方式来组织生产，参与社会分工。交易成本因行业的不同而具有不同的量化函数，使得不同行业的发展出现不同的趋势，那些交易成本函数系数大的，即交易成本对生产成本影响大的行业多出现纵向一体化的发展趋势，而系数小的行业则会扩大分工，进一步细化生产。

（作者单位：南京信息工程大学）

### 相关链接

[监企分开后的监狱企业定位研究](#)  
[强化外语培训为经济建设服务](#)  
[顾客资产管理研究的意义、问题及未来框架](#)  
[农村生产模式探讨](#)  
[交易成本分析](#)  
[品牌生态环境支持系统](#)  
[浅析如何加强医院财务管理](#)  
[对现代生活中体育文化消费规律的探析](#)

本网站为集团经济研究杂志社唯一网站，所刊登的集团经济研究各种新闻、信息和各种专题专栏资料，均为集团经济研究版权所有。

地址：北京市朝阳区关东店甲1号106室 邮编：100020 电话/传真：（010）65015547/ 65015546

制作单位：集团经济研究网络中心