

论制度变迁之比较分析框架的意义

南开大学经济研究所 03 级硕士研究生 李美嵩

内容摘要：对中国这样处于转型期的国家而言，理解制度变迁的机制有着重要的意义。而在几个探讨制度变迁机制的框架中，比较分析框架是较为系统化的一个。它采用博弈论等理论工具与历史知识相结合的方法，坚持了历史与逻辑的统一。本文则从博弈分析的长处、制度的概要表征均衡观、整体性制度分析、历史性分析和系统化五个角度分析该框架的理论意义，并结合中国经济社会的例子加以辅助阐述。最后，基于该框架提出分析处理历史材料、解释历史上制度变迁现象的程序。

关键词：制度变迁 比较分析 博弈

制度是重要的，但又不是一成不变的，像 1978 年后的中国就发生了许多重大的制度变迁，而这些制度又同中国二十多年来的高速增长密切相关。因而，理解制度变迁的过程或机制对理解经济发展与其他经济社会现象有重要的意义，尤其对于处于转型期的国家（如中国）和处于历史困境中的国家而言（如日本）。

经济学家们先后发展了几个框架来理解制度变迁问题，而比较分析框架是其中之一。所谓对制度变迁进行比较分析，包括两方面的含义：一方面是逻辑的，即试图在一个统一的博弈论框架下，同时结合其他学科如社会学、认知科学的贡献，通过研究在经济、组织和社会诸域的制度之间的相互依存性、参与人的策略互动等问题，分析制度变迁的特点与类型；另一方面是历史的，因为单从博弈均衡的角度考察制度问题是不完善的，从博弈框架出发可能会得出制度安排的多重性：即在相同技术、市场环境的背景下，制度安排也回因国家而异。因此，为了理解特定的制度安排在某特定国家演化生成的原因，还必须依赖历史的、比较的知识。可以看出，理解历史与逻辑的统一，是比较分析框架的特点之一。

在比较分析框架之前，诺斯等经济学家已先后提出供求框架、路径依赖框架，用以分析制度变迁。如舒尔茨：制度是某些服务的供给者，对现代制度的需求是人们的经济价值提高的结果；戴维斯，诺斯：一项新制度安排只有在创新的预期的净收益大于零时才会被创造出来；拉坦：制度变迁也是有关知识供给进步的结果；林毅夫：有限理性与不确定性是制度产生的原因。相比较他们，比较分析框架向更全面、更深刻了解制度变迁机制的目标走了一大步。正如诺斯所言：“如果新的制度经济学要实现其目标，它必须超越现有的描述、见解和假设，并将它们组成系统的理论框架。青木昌彦的《比较制度分析》将该进程大大的向前推进了。”¹

那么，该框架的意义具体体现在：

一、 博弈分析与制度分析的有效结合

1、 博弈论对制度分析的意义

博弈论通过分析个人决策之间的互动，强调主体之间、效用函数之间的相互作用和影响，彻底宣告了传统的鲁滨逊孤岛经济学的破产，也把传统微观经济分析如供求分析变成了博弈分析的特例。例如：分析制度变迁的供求框架采用了传统经济分析的供求范式，把制度看成是一种服务，分为三种形式：个人形式、

¹ 见青木昌彦《比较制度分析》封面

自愿安排形式的、政府形式的。引起对制度服务产生需求的因素包括各种促使外在利润或额外利润形成的因素，例如规模经济、风险规避、外部性内在化、人的经济价值的提高等。促进制度服务供给的因素包括社会资本的提高（比如周围居民支持率的上升）社会科学知识的进步等。另一方面，组织成本、强制成本以及未能搭便车形成的机会成本构成了制度服务供求的或有或无的成本。供求框架的一条基本逻辑是：一项制度安排是否要求被改变、或新安排是否产生以及何种形式，取决于供求双方对各自成本收益的比较。

而我们说，供求双方权衡各自损益的过程就是一个博弈过程，特别是制度领域内，人们之间的策略的相互作用普遍存在着。一个经典例子：为了解决工厂污染对周围居民损害的问题，假定居民被赋予对工厂索赔的权利，一种可以被提供的制度产品是居民的自组织，同工厂进行谈判，由工厂按照居民数量赔偿。传统解释认为，由于搭便车的缘故，这种安排很难被应用，但现实中，有时却出现了类似的安排。那么根本问题是：产生的条件是什么？一个简单的博弈模型便能解答这个问题，假设甲、乙两个居民，A 代表索赔给每位居民带来的收益，a 代表甲、乙参与自组织的安排各自承担的组织成本，a+a 代表由于一方未参与该安排，施加在另一方上的组织成本。那么，甲乙的策略选择状况就可用下面这个支付矩阵表示（括号中的前一项代表甲的损益，后一项代表乙的损益）

		乙	
		参与	不参与
甲	参与	A-a A-a	A-a-a A
	不参与	A A-a-a	0 0

简单的分析告诉我们，自组织安排不能产生的条件是 $A-a-a < 0$ 。

从上面的例子也可以看出，当把博弈论作为方法和工具用来分析制度及其历史的时候，更能显示博弈论在该领域中的作用。因为制度的核心问题就是内在的策略性问题。例如，考察制度离不开对组织的分析，组织分析就经常需要策略行为理论来支撑。比如行业协会，要考察其相应的产生、性质等问题，就应该了解政府企业间以及企业与企业之间的策略互相作用的情况。而博弈论正提供了一个适合分析策略环境的理论框架，当然，博弈论本身也是需要发展的理论。事实上，在其对制度分析的应用上，博弈论本身也在不断的被改进。

2、比较分析框架对传统博弈论所做的改进

传统的经济学和博弈论假定经济主体是完全理性的，即人对自身所面临的利害得失具有充分的认识，完全能够推导出自己的最优选择。或许由于这种假设简单明了，诺斯等人基本上沿用上述假定。例如，诺斯仍采用基于完全理性的基础上的投资学模型，计算制度服务所提供未来收益的净现值。但是，我们说，分析工具是否有价值不在于它是否简单，而在于其是否合适，那么，再可被称为复杂系统的现实社会中，上述假定显然是不合适的，人们要清楚的权衡自己所面临的所有利害得失，并选择最佳的行为几乎是不可能的。因而，在经济分析之中，复杂系统与有限理性的假定越来越多的被应用。

比较分析框架的贡献之一——主观博弈模型，基于如下的认识：即现实中的人类是在经验的基础上，选择与所面临的各种状况相适应的手段，采用与归纳式决策相接近的决策方式，在有限理性的假设上，抛弃了传统博弈论关于参与人拥有博弈客观结构知识的假设，而假定参与人对他们进行的博弈只拥有一种主观认识，表现在 a、在特定时间参与人只是主观的启动行动集合的一部分作为备选，而非全部技术上可行的行动集 b、每个参与人拥有对客观后果函数（对于所有参与人的每一个行动组合和历史给定初始状态，都有一个状态空间下的结果相对应，反映该关系的函数被称为后果函数）的主观推断；c、除了共享公共信念系统以外，参与人拥有私人剩余信念，也作为决策约束之一。正是在以上主观对客观推断而非纯客观的

约束下，参与人得出最佳决策规则。

这种主观博弈结构可用下面的科斯盒子²表示

	博弈外生规则	内生性变量
内生于参与人	主观行动集合	主观最佳反应决策
外生性约束	主观后果函数	对他人决策的预期 \leftarrow 私人信念
	<hr style="width: 20%; margin: 0 auto;"/> 共有信念	

表中左边一列代表参与人面临的外生性规则，右边一列代表参与人选择的变量；第一行代表内生于参与人面临的微观维度，第二行代表参与人面临的外生性宏观维度。该表清晰的反映了参与人在博弈中，正式在主观的内外生、宏微观的约束条件下，做出主观的最佳反应决策规则。

二、提出了适合分析制度变迁的概要表征的均衡制度观

制度的定义取决于分析的目的。在已有的分析制度变迁的框架中，对制度的定义包括 a、制度即博弈的特定参与人，如协会、学校 (Nelson, 1994)；b、制度即社会的博弈规则，分为正式的（如宪法、合同）和非正式的（社会惯例、习俗）(North, 1990)；c、博弈均衡观，其中一种的代表性观点是，认为制度是行为规则，作为博弈的结果而产生，内生于经济过程，而不像第二种观点推导的，制度是有政治或立法过程中制定的。

而比较分析框架着重发展了第三种制度观，用一句话概括即“制度是关于博弈如何进行的共有信念的自我维系统。”³“共有信念”是参与人共享的关于博弈将实际进行方式的预期，预期是均衡的，因为只要参与人对别人行动规则的信念是可维持的，那么偏离自己的行动规则是不合算的，而且该预期是对博弈均衡路径显著和固定特征的浓缩性表征；“自我维系统”表明制度是自我实施，自我强化的。从而可以看出，该制度观下的制度性质包括a、内生性b、信息浓缩性c、耐久性和稳定性d、普遍性e、多重性。由于以上定义及性质，我们把这种制度观简称为概要表征的均衡观，并且认为这样的制度观比上述制度观更适合用来分析制度变迁，因为它有助于理解或解决以下几个方面的问题

- 1、部分解决了博弈规则论产生的无穷尽的循环推理。考察制度变迁，就需要解决制度起源和实施问题，按照博弈规则论的说法，经济博弈的正式规则不可能由博弈中的参与人自己制定变更，它们的确立必须先于博弈过程。问题是，这部分正式规则从何而来，博弈规则论为了解决这个问题，区分了规则的制定者和

²科斯盒子：青木昌彦以科斯命名的分析博弈结构的盒状图

³见青木昌彦《比较制度分析》第 28 页

实施者，那么，随即产生的问题是，这些实施者又被怎样的规则去激励去实施他理应实施的博弈规则？这样的规则又如何被制定的呢？这无疑在博弈的逻辑结构上产生了无穷尽的循环推理。那么，比较分析框架通过将制度看作是博弈过程的内生稳定的结果，而且同时认为历史事件和过去通行的规则在均衡制度的决定上又有重要作用，从而将上面产生的循环推理引向从过去和历史继承下来的社会结构，而非博弈的逻辑结构。

2、 有助于理解制度与政策、法律之间的关系

所有成文法、政策在前两种制度观往往被认为是制度安排的一部分，而比较分析框架则分析了他们之间的区别联系。制度作为一种均衡现象，制约着参与人的策略互动，并反过来又被它们在连续变化的环境下的实际决策不断再生产出来，通过这种方式制度又被客观化了。因此，制度有可能表现为明确的条文形式（如成文法），但并非所有成文法都可看作是制度，关键是看人们是否相信它，是否满足制度的普遍性，即是否被绝大多数的参与人所共享感知，如果一项人为设置在一些人看来是相关的，从而影响其行为决策，而另一些人认为与他们无关，置之不理，并且两部分人的比例无过大差别，那么这种人为设置就不应看作是一种制度。例如，中国股票交易中明确规定，不允许交易人坐庄借机操纵股价，但是人们相信的是，资金雄厚的交易者会利用种种手法（如用买来的身份证开设多个账户）成为庄家，绕开这项规定，而且这是普遍现象，那么与其说把这项规定视为制度，不如说把坐庄现象视为制度。

3、 理解制度惰性的原因。

制度惰性一般是指一种低劣的或次优的安排虽被人们认识到了缺陷，但人们试图加以改变时，这项安排很难被改变，好比一个懒人怎么推他起床都不起来。那么，如果从制度均衡角度理解的话，由于制度是人们策略均衡的结果，当选择这种均衡的行为方式很普遍的时候，对其他参与人而言，同样选择这种行为方式在战略上最有利，从而使该制度作为一种自我约束机制固定下来，而当被要求改变时，便体现出了惰性。例如，中国应试教育转变素质教育的改革，至今看来收效并不显著，体现在学生在校的负担少了，回家后的负担多了，负担总量基本不变。即应试教育制度体现出了惰性。原因在于存在两种约束：一是中国多年来应试教育制度发展出大多数与制度相适应的人力资产类型，包括教师和家长；另一方面，考试成绩仍是入学最重要的甚至是唯一标准。在上面两个约束条件下，如果参与人在实行素质教育的方针背景下，仍采取应试教育下的应对策略，便会得到额外利益，当绝大多数参与人都采取这种策略时，应试教育自然而然很难在事实上加以改变。改革的出路在于解决上面两个约束条件。

4、 理解制度的作用。

外生博弈规则论将制度的作用理解为对参与人行为施加制约，的确，从概要表征的均衡观角度来理解，也可得出这个结论，即制度通过协调人们的信念控制着参与人的行动决策规则，引导人们朝某一特定的方向行动。但是，进一步的，我们发现制度在总体上是以参与人共担的方式协调信念的。因此，在信息不完全和不对称的世界里，制度的另一个作用是帮助理性有限的人参与决策所需的信息加工成本，这也被认为是制度产生的原因之一。

三、 整体性制度分析的意义

在供求框架中，分析一种制度的产生与否以及产生形式，采用的是局部均衡分析，即假定其他制度安排是既定的，分析单个制度市场的供求状况。即使提到制度之间的关系，也因感到由于分析工具的匮乏而不加以深究。事实上，制度之间的互补性或替代关系要比一般产品的对应关系更加强烈。制度之间的关系问题是分析制度变迁问题最为基本的问题之一。

比较分析框架则试图从整体性制度安排的角度，构建制度之间的关系框架，通过分析这种关系机

制理解制度变迁的机制。在比较分析框架看来，经济系统可看作是由以下六个域的混合体组成的，包括共用资源域、经济交易域、社会交换域、组织域、组织场。所谓域，是比较分析框架的基本分析单元，是由参与人集合和每个参与人在随后各时期所面临的行动集合组成。以上各域之间分类标准是参与人集合的构成与可变性、决策集合的对称性、如下表所显示的经济交易域和政治域之间的区别⁴：

经济交易域	参与人集合的特点	决策集合
经济交易域	由私人拥有的可交换或处置的物品的个人构成；是可变的	对称
政治域	由中心参与人——政府和私人参与者构成，是固定的	非对称

各个域之间并不是严格分开的，而可能是相互重叠和交叉的，有些可能寓于其他域之中。域之间的关联，使得域制度之间形成了关联。从而经济体制可看作是各种制度的集合，制度关联可分为共时性关联和历时性关联。前者是指在一段时期内，由于博弈之间的联结所引起的域之间的、制度之间的关联；后者是指不同时期之间由于博弈参与人的策略互动而引起的制度之间的跨时期的联结。两种关联结构都可分为三种分析性的关联机制，历时性关联是共时性关联的动态对应物。

那么，通过对共时性关联与历时性关联机制的分析，可以理解为什么有的制度在单独的域看来不合算，但为什么又会发生？有的较优的安排却被看起来较差的安排所替代等一系列供求框架都无法给予透彻解释的问题。例如，几年前在中国很普遍的学雷锋活动日的制度，在每年3月5日左右，各个学校、各企事业单位要开展一些活动，如免费为来往行人修理自行车等。那么，单独从经济交易域看来，提供这些活动费时费力，得不偿失，但由于社会交换域的嵌入，给予了这种活动很高的社会资本收益，如单位接受到的感谢信和锦旗，被媒体报道，年终向上级汇报的必要组成部分，正是由于这一点，这项安排得以产生。

另外，整体性制度分析同时揭示了改革战略——“多米诺骨牌”战略的有效性：这种战略就是，在渐进式的改革中，首先确定在多种制度中位于基础部位的制度结构，通过改革这些基础结构，对相互关联的结构进行改革。例如中国的农村改革——城市改革及国企改革——政治体制改革的改革思路到目前为止取得了较大的成就，根本在于在中国这个人口众多且农民的比重非常高的国度里，农业是基础性产业，相应的，农村方面的制度安排是社会改革的基础的制度结构。而家庭联产承包责任制的成功为后来其他领域的改革打下了很好的基础。

四、突出历史是重要的。

正如上文中提到的，单从博弈均衡的角度分析，会得出均衡的多重性。反映在现实中，即在技术和生态条件相同的条件下，各国的制度安排表现出多重性。要解释这种现象，就要引入比较和历史的知识。言外之意，制度变迁的最终结果不仅取决于博弈均衡，还取决于各自制度发展的历史轨迹。

在路径依赖框架中，就已体现了上述思想。诺斯认为，制度变迁具有路径依赖的性质，制度变迁一旦踏上路径，便会因报酬递增机制得到自我强化，因为“人们过去的选择决定了今后可能的选择”⁵。换句话说，不同制度的社会适应性依存于经济制度所面对的历史环境，制度变化以已有制度为依据。相应的，比较分析框架接受并继承了路径依赖思想，并通过对制度历时性关联机制的分析将其体现和深化。历时性关

⁴关于各个域的含义与其他域之间的区别，由于篇幅有限，不能一一列举，感兴趣的读者可参考。

⁵见诺斯《经济史中的结构与变迁》（中译本序言）

联机制分为三类，第一种机制为重叠社会嵌入（社会嵌入指社会交换域嵌入到其他域之中，使得参与者必须跨域协调策略），即由于社会交换域的参数变化速度一般慢于其他域如经济交易域，引起社会嵌入模式随时间推移不断变化，从而，已有的社会嵌入结构对制度转型产生促进或阻碍的作用，或是在一定条件下被重置。第二种机制是博弈关联方式的新组合，如原来在地理上相互分隔的交易域得以融合或是在中介组织协助下，出现了新型的捆绑方式，那么由于原由关联方式的制约，新制度不一定出现而可能是旧制度持续存在；第三种机制是历时性互补机制，即单独看来不合算的新决策，由于另外的域已经有了互补的新制度或参数，两种域的互补性机制会使新决策获得强大推动力，从而可能引发新制度在新域的出现，甚至是跨域的整体性制度安排的变化，但其发生与否取决于互补性的强度。从第三种机制也可引申出来对政府政策在制度变迁中的作用的讨论。制度的变迁不像政策设计论坚持的，制度是政策设计的结果。原因在于互补性机制的存在。例如，某项政策的初衷是改变参与者决策的方向但决策变化通过互补性域参与者决策之间的相互强化作用，最终可能导致意想不到的整体性制度变迁，如青木昌彦所分析的日本主银行制的来源；或者政府政策会有助于某些域新制度的缺乏，但由于与新制度互补的人力资产类型的缺乏，新制度仍然不可能出现。

五、将分析制度变迁的逻辑更系统化了

已有的分析制度变迁的框架基本上是由一些零杂的思想材料构成，而比较分析框架通过引入博弈均衡模型，制度的概要表征均衡观，制度关联结构等逻辑内容向系统化的目标前进了一大步，他的基本框架用文字语言可以基本概括如下：

1、 制度是关于博弈如何进行的共有信念的自我维系统，制度变迁即参与者行动规则的策略选择连同相关的共有信念，同时发生的一种基本变化。

2、 参与者根据主观博弈结构——主观行动集合，主观后果函数、公共信念系统、私人剩余信息等反复运用同样的规则推断环境、预期报酬，参与者的主观博弈是再生的，相应的，共有信念的部分也不断的被再生为制度，我们称之为既存制度。

3、 在环境发生巨大变化，连同博弈结构的内部均衡积累到一定阶段时，即内外因素的结合会导致参与者出现普遍认知的严重失衡，引发参与者开始重新定位主观博弈模型，采用新决策。一旦许多人同时修改其决策启用集，系统实施新决策，就会出现制度危机；

4、 在参与者为解决制度危机而寻找新出路的过程中，由于制度关联结构的制约，至多有几个主要的相互竞争的预测性和规范性信念系统可能逐渐演化出来。而究竟哪个信念系统最终成为共有信念，内生为新的制度，取决于三个条件 a、新的信念系统被认为与相关域的内在状态相互一致 b、运用新的推理规则不会出现令大部分人惊奇的结果 c、产生令人满意的报酬。

那么，随着参与者反复修改的主观博弈模型同时实现均衡，相互一致，制度转型过程趋于完成。上述制度变迁机制可直观的用下面的流程图所表示：

	参数	内生变量
内生于参与者（微观）	主观行动集合	最佳反应决策规则

外生于参与人 (宏观)	主观后果函数 私人信念 共有信念——不断再生
-------------	------------------------------

既存制度——内外部因素的变化——参与人选用新策略，出现两种被观察到的结果（成功和失败）——成功的正反馈机制——许多参与人竞相模仿——既存制度被人所怀疑，发生制度危机，参与人寻找新安排——共时性和历时性关联机制的制约—— n 个新安排 (n 较小)——满足上文的三个条件——安排 l 胜出——制度转型后新的主观博弈盒子

	参数	内生变量
内生于参与人	包含新决策的行动组合集	新的最佳决策规则
外生于参与人	重新定义的主观后果函数 新的共有信念——不断再生——	新的私人信念

— 新的既存制度

正如格雷夫（1998）建议在用均衡观分析制度时要用一定的程序来处理历史信息，那么我们以上述框架为依据，提出为了解释历史上的制度变迁现象而处理历史信息时应采取的程序：

- 1、 辨清制度转型后作为共有信念的新制度作为要被解释的内生变量；
- 2、 构建与该制度有关的共时性与历时性关联模型，即确定和被解释变量产生共时与历时性关联的安排，进一步寻找与 1 中的制度的内在一致
- 3、 按照同样的思路找出制度转型前的制度及关联安排，及他们之间的内在一致
- 4、 确定内外因素的变化，及引起的采取的新策略和效果
- 5、 挖掘在特定背景下有可能出现的竞争性信念系统，及它们与 2、3 中关联性安排的关系，是一致的还是对立的。

总之，上文在阐述该框架意义的同时，也是对它的一个简略描述。可以看出，比较分析框架对制度变迁理论的发展做了较大的贡献，包括所采用的基础理论工具更为先进、模型系统化、突破原有分析方法的缺陷等方面。但完美的理论是不存在的。理论作为一系列概念与假设的逻辑统一体，总是存在着逻辑或应用方面的待需要发展的地方。那么对于比较分析框架而言，如何对改革有效的战略进行更全面的分析，如何与其他领域进行更为广泛的合作研究等，都是未来的前进方向。另外，虽然我们可以肯定的是，对中国经济而言，该框架具有很强的理论上的解释意义，但是，其现实意义特别是政策意义如何、怎样用其指导政策设计等都是需要进一步探求的问题。

参考文献

- 1、青木昌彦：《比较制度分析》，中文版，上海，上海远东出版社，2001
- 2、青木昌彦 奥野正宽：《经济体制的比较制度分析》，中文版，北京，中国发展出版社 1999
- 3、张维迎：《博弈论与信息经济学》，上海，上海人民出版社，1996
- 4、格雷夫：《经济历史和博弈论》，中文版，载《比较》第2辑，北京，中信出版社 2002
- 5、D、C、诺斯：《经济史中的结构与变迁》（中译本序言），上海，上海人民出版社 1994
- 6、L、E、戴维斯 D、C、诺斯等：《财产权利与制度变迁——产权学派与新制度学派论文集》，中文版，上海，上海人民出版社，1994

（截稿：2004年5月 责任编辑：张楷驰）