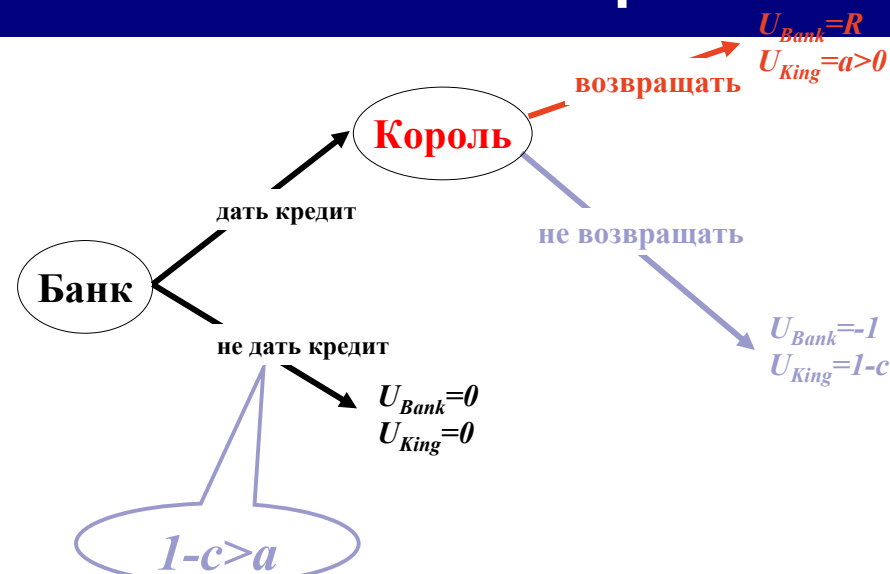


# 13

## Проблема исполнения обещаний. Политическая теорема Коуза

Политическая экономика, 2005/6 учебный год // Екатерина Журавская, Константин Сонин, Российская экономическая школа/ЦЭФИР

## Яков II и Вильгельм Оранский



Политическая экономика, 2005/6 учебный год // Екатерина Журавская, Константин Сонин, Российская экономическая школа/ЦЭФИР

1.2

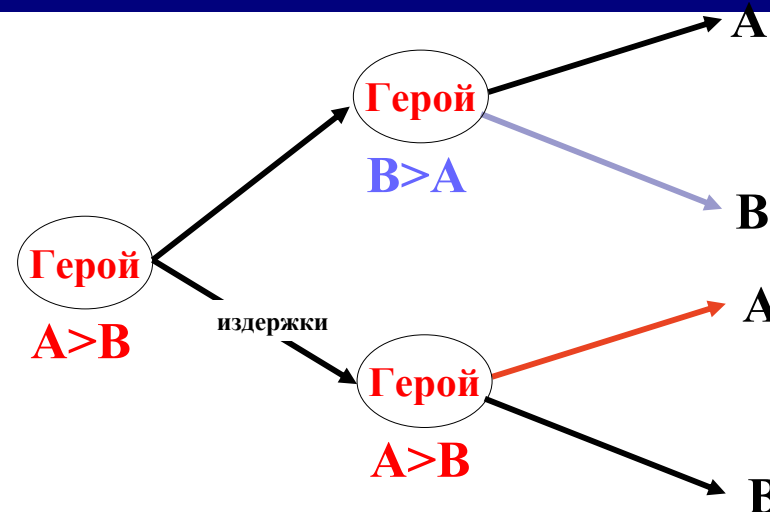
## Проблема невыполнимых обещаний

- North, Weingast (1989) – институциональная природа и экономические последствия «Славной революции» 1688 года
  - преимущества демократии перед диктатурами
- Acemoglu, Robinson (разные статьи) - политика
  - расширение демократии в западных странах
  - революции и перевороты в Латинской Америке (прошлая лекция)
- Hart (1995, 2000) – организация фирмы (в частности, зачем фирмы берут в долг)
  - Rajan, Zingales (2000) – конфликты между подразделениями фирмы
- Brocas, Carillo (1999), Gul, Pesendorfer (2001) – как сдерживать обещания, которые агент дает сам себе?
- Shepsle, Weingast (1987): партии в Конгрессе
- Schwarz, Sonin (2005) – просто иллюстрация

Политическая экономика, 2005/6 учебный год // Екатерина Журавская, Константин Сонин, Российская экономическая школа/ЦЭФИР

1.3

## Пример: сам с собой



Политическая экономика, 2005/6 учебный год // Екатерина Журавская, Константин Сонин, Российская экономическая школа/ЦЭФИР

1.4

## Жизнь в отсутствие обещаний: происхождение войн

## Литература

- Schelling (1960, 1968)
- Bueno de Mesquita (1980)
- Powell (1988, 1999, 2002, 2004, 2005) и другие работы
  - *In the Shadow of Power*
- Fearon (1995)
- Slantchev (2003, 2005)
- Baliga, Sjostrom (2004)
- Jackson, Morelli (2005)

## Конфликты и обещания

- Большие страны: Англия и Франция, Индия и Пакистан, и т. п.
- Подразделения больших фирм
  - отделы IBM
  - группировки на факультетах и кафедрах
  - фракции парламента
- Стороны, заключившие контракт, который нельзя заключить в суде
- Политик и избиратели
- Государство и Бизнес
- **Спор не может быть разрешен третьей стороной**
- **Невозможность выполнения обещаний влияет на вероятность и продолжительность конфликтов**

## Постановка

- Непрерывное время
- Две страны: А и В
  - А – потенциальный агрессор, может в любой момент напасть на В
  - В решает, сколько платить А в каждый момент
- Потребление = константа + трансфер ресурсов
- Платежи 
$$V^i = \int_0^{\infty} \beta^t U_i(c_{it}) dt$$
$$U'_i > 0, U''_i \leq 0$$
- Война – лотерея с негативной суммой
  - как только начинается война, игра заканчивается
  - трансферы могут влиять на исход

## Специфика

- Несимметричность не проблема
  - можно разрешить  $A$  делать трансферы
  - можно разрешить  $B$  начинать войну
- Игра – с полной информацией
  - выбираем равновесия, совершенные относительно подыгр – то есть все угрозы выполнимые
  - ‘вер’ нет
- Непрерывное время
- Непрерывные трансферы
- Нет производства/инвестиций Powell (1999, Ch. 2)

## Нападение и улаживание

- Нападение
  - вовсе не обязательно военная операция
  - торговая война
  - даже отмена переговоров и обращение к суду
- Уступки
  - не обязательно перераспределение ресурсов
  - любая уступка
    - Согласие на прекращение торговой войны
    - Расширение полномочий субъектов федерации
    - Согласие нанять сотрудника, которому благоволит противник

## Первые результаты

- Утверждение *В отсутствие трансферов конфликта не происходит, если ожидаемый выигрыш от войны не превосходит статус-кво*
  - Если трансферов нет, баланс сил не меняется
- Сравнительная статика
  - Мир более легко поддерживать нулевыми трансфертами, если стороны имеют примерно одинаковые ожидаемые исходы войны
    - Есть две школы
  - Мир без трансферов более вероятен, если сторон имеют отвращение к риску
- Если трансферты ненулевые, возникают проблемы, связанные с изменением баланса сил

## Поддержание мира

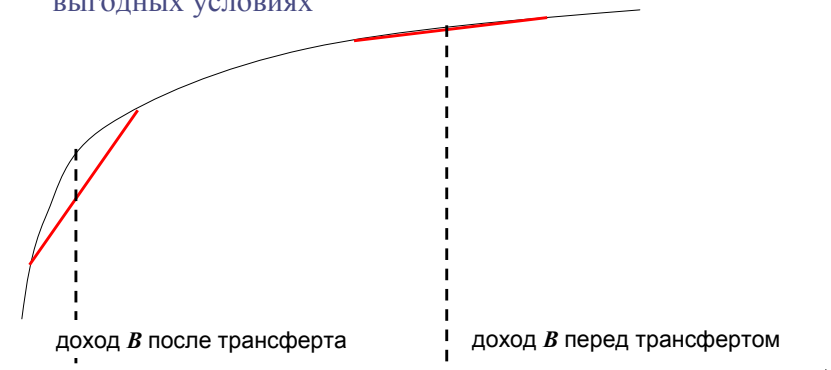
- Стороны нейтральны к риску:  $MU_i(c_i)$  постоянна
- Утверждение *Если стороны нейтральны к риску, всегда найдется такой поток трансферов (от  $B$  к  $A$ ), что в равновесии войны не будет*
- $B$  (любом) равновесии
  - $B$  передает ресурсы  $A$  так, чтобы  $A$  было всегда все равно – начинать войну или нет
  - $A$  нападает на  $B$ , если не получает этих трансфертов
- Если трансферты изменяют баланс сил, они увеличиваются со временем.
- Постоянный поток трансферов – более эффективная стратегия улаживания, чем одноразовая передача

## Изъятие выигрыша

- **Утверждение** *В любом равновесии А получает не больше, чем (в ожидании) если бы война начал сегодня.*
  - Поскольку В никогда не заплатит больше
- Теперь - отвращение к риску
  - $MU_i(c_i)$  строго убывает
- **Утверждение** *Если стороны не любят риск и трансферты не влияют на соотношение сил, существует расписание трансфертов, обеспечивающий мир*

## Войны от страха

- *Если стороны не любят риск, мирного равновесия может не быть*
  - Слабая сторона, **В**, предпочитает драться раньше на более выгодных условиях



## Войны на опережение

- Две причины
  - Трансферты могут сделать сильную сторону еще сильнее (и она будет требовать еще больших уступок/трансфертов)
  - Даже если трансферты не влияют на соотношение сил, отношение слабой стороны к исходу конфликта
- Rajan, Zingales (2000): лучше передавать производственные мощности, а не те ресурсы, которые могут пойти на борьбу за власть
- В нашей основной постановке война начинается в  $t=0$ 
  - из-за концепции равновесия
  - Если добавить экзогенный временной тренд войны станут начинаться и в моменты  $t>0$

## Цитаты

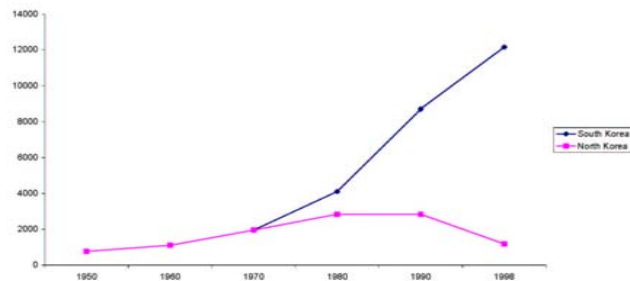
- Taylor (1954): "Every war between the Great Powers [in the period of 1848-1918] started as a preventive war, not a war of conquest",
- Carr (1964): "The most serious wars are fought in order to make one's own country military stronger or, more often, to prevent another country from becoming military stronger".
- Hirschleifer (2001): if the opponent [the potential aggressor in our setup] is hostile and non-appeasable, the best possible strategy is to keep the aggressor poor, so that if he opts for a war, he has as little resources as possible. Thus, there are incentives to start a war earlier
- Наиболее известная история утешения – политика Англии по отношению к Германии в 30е годы
  - (May 13, 1940) Churchill: "What is our aim? I can answer in one word: Victory - victory - at all costs, victory, ... however long and hard the road may be; for without victory, there is no survival."

## Исторические спекуляции

- Карл I, Людовик XIV of France, Николай II, ...
- Каждый из них мог бы спасти свою жизнь, сделав соответствующие уступки оппозиции
  - но ни один из них этого не сделал (хотя Карл...)
- Возможно, потому, что они боялись, что каждая следующая уступка даст оппозиции больше возможностей требовать новых уступок
  - В итоге, последняя схватка начиналась в очень неблагоприятных условиях
- Людовик XIV (кардинал Мазарини) во времена Фронда рискнул войной на раннем этапе и выиграл

## Политическая теорема Коуза

## Почему одни государства проводят плохую экономическую политику, а другие - хорошую?



## Политическая теорема Коуза

- Термин был независимо введен Hoff (2000) и Acemoglu (2003)
- Hoff (2000)
  - “institutions would follow private property rather than the other way around.” (Shleifer, Vishny 1998).
- Acemoglu, D. (2003) Why Not a Political Coase Theorem? Social Conflict, Commitment, and Politics, *Journal of Comparative Economics*, 31 (4), 620-653.

## Формализация

- $Y=F(X,P)$ 
  - $X$  – характеристики
  - $P$  – выбранная политика
- $P^*(X) \in P(X) = \operatorname{argmax}_P F(X,P)$
- Вопрос о ПТК: почему выбирается  $P$  вне  $P(X)$  ?
- Трудности:
  - $P(X)$  – может быть не точкой, а множеством
  - $X$  – разные в разных странах и нет оснований ожидать, что  $F(X, P^*(X)) = F(X', P^*(X'))$ , более того,
    - $F(X, P^*(X)) > F(X', P^*(X))$  и  $F(X', P^*(X')) = F(X', P^*(X))$ 
      - например, Индонезия – Гонконг
- Чтобы отвергнуть гипотезу ПТК надо найти страны с  $X, P, P'$ :  
 $F(X, P) > F(X, P')$

## Модифицированная ПТК

- Необходимо учитывать, что некоторые факторы, которые важны при выборе политики *ex post*, могут быть неизвестны *ex ante*
  - обозначим эти факторы  $X_u$ , а остальные  $X_c$
  - у политиков есть (реализация) оценка этих факторов  $G(X_u)$
- ПТК предсказывает, что
$$P^*(X_c, G(X_u)) \in \operatorname{argmax}_P E_G F(X, P)$$
  - например, Южная и Северная Корея
- Что нужно, чтобы отвергнуть ПТК?
  - Чтобы для любого  $G$  из множества всех возможных вер  $G$  нашлись политики  $P$  и  $P'$ , такие что  $E_G F(X, P') > E_G F(X, P)$

## Модель, когда ПТК нет

- Основная причина – невозможность сдерживать обещания
- Модель
  - дискретные периоды
  - бесконечноживущее население
  - два типа производства
    - неэффективное, но неотчуждаемое
    - эффективное, но результаты можно отнять в виде налогов – зависит от усилий (есть оптимальный уровень) плюс «природных ресурсов»
    - природные ресурсы всегда облагаются налогами
  - правитель, максимизирующий свое богатство
    - богатство = налоги
    - тот же дисконтирующий фактор, но есть экзогенно заданная вероятность смены
- Институты – либо есть возможность подписывать контракты с политиком, либо - нет

## Каждый период

- Стороны подписывают контракт (если есть такая возможность). Если  $r=0$  (диктатура), правитель решает, не сменить ли на  $r=1$  (демократия)
- Агенты выбирают уровень усилий (инвестиций) и сектор, в котором производить
- Если  $r=0$ , то правитель выбирает налог. Если  $r=1$ , то народ решает, сколько отдать правителю
- Все потребляют
- Если  $r$  не равно  $1$ , правитель заменяется с экзогенно заданной вероятностью
- Можно делать обратную индукцию

## Результаты

- Стационарные симметричные (для народа) стратегии
- Если  $r=0$ , то существует такое равновесие, в котором народ ожидает от правителя, что он все забирает себе, поэтому работают на приусадебном участке
  - Парето-неэффективность
- Если есть возможность подписывать полноценные контракты
  - + политик не смещается экзогенно
  - + предположения о разделе выигрыша от Парето-улучшениято результат будет Парето-эффективен
  - то есть ПТК выполняется
  - сравнить с теоремой Коуза

1.25

## Отсутствие контрактов

- в совершенных марковских равновесиях нет ПКТ
- в не-марковских есть
  - потому что есть стратегии угроз и народные теоремы
- Результаты можно усилить/усложнить, если замена правителя экзогенна
  - и стоит сколько-то

1.26

## Неравенство и революции

## Президент Хуан против Панчо Вильи

- Принц Джон против Робин Гуда
  - Наш случай - перераспределение по принцу Джону
    - от бедных – к богатым (например, через подчинение институтов)
  - Традиционный случай – перераспределение по Робин Гуду
    - от богатых – к бедным (прогрессивное налогообложение и т.п.)
- Опыт Латинской Америки в XX веке
  - популистские режимы сменяются элитистскими и обратно
  - революции (бедные захватывают власть) и перевороты (богатые – элита захватывает власть)
- Основной вопрос: как связаны эти события и неравенство?

1.27

1.28

## Основная идея

- Acemoglu, D., Robinson, J. (2001) A Theory of Political Transitions, *American Economic Review*
- Есть богатые (меньшинство) и бедные (большинство)
  - то есть в условиях демократии решающий голос принадлежит бедным
- Богатые
  - устанавливают низкие налоги когда находятся у власти
  - вводят (или не вводят) демократию (позволяют бедным голосовать)
  - совершают военный переворот, если налоги слишком высоки (а власть принадлежит бедным)
- Бедные
  - устанавливают высокие налоги, когда находятся у власти
  - устраивают революцию, если их что-то не устраивает
- И перевороты, и революции – издержки для всех
- У экономики бывают два состояния – нормальное и рецессия (в которую все и происходит)<sup>1.29</sup>

Политическая экономика, 2005/6 учебный год // Екатерина Журавская, Константин Сонин, Российская экономическая школа/ЦЭФИР

## Перераспределение и переворот

- Основная перераспределяемая собственность – земля
- Часто за перераспределительной реформой следовал военный переворот, который отменял ее результаты
  - Бразилия – переворот 1964 года ставил своей целью ограничение власти избранного президента Гуларта, готовившего аграрную реформу
  - Гватемала – переворот 1954 года следует за аграрной реформой 1952 года
  - Чили – переворот 1973 многие исследователи связывают с готовящейся и уже начатой реформой землепользования (43% уже перераспределенных земель было возвращено прежним владельцам)
  - Венесуэла – переворот 1948 года отменил результаты реформы, проведенной ранее в том же году
- Перераспределение проводилось популистскими / левыми режимами / правительствами, а военные перевороты опирались на узкие элиты (богатых)

Политическая экономика, 2005/6 учебный год // Екатерина Журавская, Константин Сонин, Российская экономическая школа/ЦЭФИР

1.30

## Главные закономерности

- Реальные политические системы не дают возможности обязаться выполнять обещания
  - например, богатые могут перераспределить часть доходов бедным с тем, чтобы предотвратить революцию сегодня, но не могут достоверно пообещать делать это и завтра
  - один из способов обеспечить исполнение (своих собственных) обещаний – расширить демократию (Бразилия, Перу, Уругвай – в 80е, Аргентина – 1912, 1973, Венесуэла, 1945, 1958, см. также Великобританию, Францию, скандинавские страны)
- Аналогичная проблема у бедных
  - не могут пообещать не повышать налоги завтра (что, в свою очередь, снизило бы привлекательность военного переворота для богатых)
- Особенно большие проблемы возникают, когда неравенство велико
  - потому что богатые много теряют, когда бедные у власти
  - потому что для бедных революция приносит много

Политическая экономика, 2005/6 учебный год // Екатерина Журавская, Константин Сонин, Российская экономическая школа/ЦЭФИР

1.31

## Равновесия

- Стабильный элитистский режим (диктатура)
  - революция слишком дорога
  - элита избегает революции, перераспределяя часть богатства
  - чем больше неравенство, тем больше перераспределение
- Стабильная демократия
  - перераспределение не спасает, следовательно, происходит демократизация
  - если начиналось с диктатуры, то происходит только раз
- Нестабильная демократия
  - все время существует угроза переворота
- Латинская Америка
  - бедные у власти не могут снизить налоги на столько, чтобы богатые не совершали переворот
  - и наоборот – богатые не могут удержать власть
  - во время демократии неравенство вызывает перераспределение, во времена диктатуры перераспределения нет вообще

Политическая экономика, 2005/6 учебный год // Екатерина Журавская, Константин Сонин, Российская экономическая школа/ЦЭФИР

1.32

# Выводы

- Чем выше неравенство, тем вероятнее смена режима
- Неравенство и перераспределение связаны немонотонно, общества со средним неравенством перераспределяют больше, чем очень равные и очень неравные
- Чем выше потери от перераспределения, тем легче поддерживать демократию
  - Что будет, если много природных ресурсов?
- Вероятность политической нестабильности (революции или переворота) больше в условиях рецессии
  - переходы к демократии в Аргентине, Боливии, Бразилии, Перу, Уругвае и Филиппинах
  - перевороты в Чили (1973) и Аргентине (1976)
- Реформы, направленные на уравнивание (чего?) могут укрепить демократию
  - землевладения
  - образования