

Aula 2

Instituições: o que são e para que servem?

PARTE I A análise económica das instituições.

1. Dos dilemas sociais e das instituições para os resolver

1.1 Instituições

- 1.1.1 O que são?
- 1.1.2 Porque precisamos delas?
- 1.1.3 Como avaliá-las?
- 1.1.4 Como evoluem?

1.2 As funções das instituições

- 1.2.1 Promover a cooperação
- 1.2.2 Facilitar a coordenação
- 1.2.3 Facilitar a negociação e resolver conflitos
- 1.2.4 Reduzir custos de negociação

1

Conceitos a Reter

Instituições formais e informais

Instituições: avaliações pelos critérios normativos

Mecanismos de coordenação

Dilema do prisioneiro

Jogos de coordenação e do “franganote” (*Chicken*)

Equilíbrio de Nash

Equilíbrio de estratégias dominantes

2

Aula 2

Instituições: o que são e para que servem?

Bibliografia Base:

Pereira, Paulo Trigo (2008). *O Prisioneiro, o Amante e as Sereias*. Coimbra, Almedina. [Ver Cap. 2 Secção 2.1 e Cap. 3, secções 3.1 a 3.3]

Pereira, Paulo Trigo (2012). *Portugal Dívida Pública e Défice Democrático* Pg 74-77 incluindo nota 5.2 na internet em

www.iseg.utl.pt/~ppereira/finpub (ver Livros e depois Livro FFMS)

Bib. Complementar:

R. Cooter e Ulen, Law and Economics, Cap. 2 (revisão de teoria dos jogos)
Kasper and Streit (1999), Cap. 2 “Definitions: Economics, Institutions, Order and Policy”

* A referência completa de cada artigo dos readings deverá ser procurada em Pereira, P. T. (2008).

3

1.1.1 Instituições: o que são?

☞ **Instituições são restrições desenvolvidas por indivíduos de forma a estruturar a interacção humana. Podem ser *formais* ou *informais*:**

- **Instituições formais:** consistem em *restrições formais*.
 - **Regras escritas** -: regras, regulamentos, leis, constituições, contratos, direitos de propriedade, acordos de negociação.
 - **Organizações** são definidas antes de mais por um conjunto de regras, regulamentos e ou leis que determinam a posição e funções que cada agente ocupa numa estrutura hierárquica.

4

1.1.1 Instituições: o que são?

• **“Instituições” informais** – consistem em restrições informais, por exemplo:

- normas de comportamento
- convenções
- códigos de conduta auto-impostos.

5

1.1.2 Porque precisamos delas?

As instituições existem e são necessárias, porque sem elas, objectivos que os indivíduos valorizam não poderiam ser alcançados.

O alcançar desses **objectivos** (note-se que não estamos a incluir conteúdo no objectivo da instituição) pressupõe certa forma de **coordenação** entre os agentes.

6

1.1.2 Porque precisamos delas?

Quatro tipos de **mecanismos de coordenação**:

- Mercado**, competição atomística, indivíduos com preferências, valores distintos.
- Cooperação informal (não organizada)** – indivíduos que partilham valores e/ou normas de comportamento comuns.
- Cooperação formal (organizada)**– associação voluntária e formal de vários agentes com um ou vários objectivos
- Controle** - um agente tem o poder de tomar decisões e impô-las aos outros.

7

1.1.2 Porque precisamos delas?

O dilema do prisioneiro:

		Indivíduo B	
		Coop.	NC
Indiv. A	Coop	3,3	-2,8
	NC	8,-2	0,0

8

1.1.2 Porque precisamos delas?

1. Interpretação clássica do dilema do prisioneiro

- Modelo com dois agentes *racionais e egoístas*

É um contexto de interacção entre dois indivíduos. Digamos que eles têm um **objectivo**, alcançar os benefícios associados à **solução cooperativa** (objectivo de *eficiência*) por exemplo a provisão de um bem público.

Contudo, o incentivo de serem *free rider* leva-os à **solução não cooperativa**.

9

1.1.2 Porque precisamos delas?

	Mecanismo de Coord.	Característica	Resultado da Interação no Dilema do Prisioneiro
1	Mercado	Mercado	Não vai haver cooperação
2	Coop. Informal	Merc.+ Convenção	Indivíduos cooperam sem necessitar de organização
3	Coop. Formal	Associação/ Empresa	Indivíduos criam uma <i>organização</i> que os leva a cooperar
4	Controle	Estado	Uma <i>organização já existente</i> força a cooperação

Quadro 1.2 Mecanismos de coordenação, DP e eficiência

10

1.1.2 Porque precisamos delas?

	Mecanismo de Coord.	Característica	Resultado da Interação na Dilema do Prisioneiro
1	Mercado	Mercado	Não vai haver pagamento voluntário de impostos (<i>free rider</i>)
2	Coop. Informal	Merc.+ Convenção	Indivíduos podem <i>contribuir</i> se houver norma social do tipo (deves dar se poderes - caridade)
3	Coop. Formal	Associação/ Empresa	Indivíduos criam uma <i>organização</i> que os leva a dar <i>donativos</i>
4	Controle	Estado	Uma <i>organização já existente</i> força o pagamento dos impostos

Quadro 1.3 Mecanismos de coordenação, DP e redistribuição

11

1.1.2 Porque precisamos delas?

Conclusões:

Precisamos de instituições informais (2) ou formais (3 e 4) para:

- fornecer bens públicos
- operar redistribuição.

12

1.1.3 Como avaliá-las?

• Segundo a capacidade de alcançar um objectivo que satisfaz todos os indivíduos (ou pelo menos que não des-satisfaz ninguém)- **critério da eficiência**.

• Segundo a capacidade de cobrir situações de risco e de implementar resultados justos – **critério da equidade** ou justiça

• Segundo a capacidade de preservar a esfera de *autonomia* e *liberdade* individual, de interferências de terceiros – **critério da liberdade** (negativa)

13

1.1.3 Como avaliá-las?

	Mecanismos Coord.	Eficiência		Equidade (justiça)	Liberdade (negativa)
		Bens Privados	Bens Púb.		
1	Mercado	+	-	-	+
2	Convenções/ Normas	-	+/-	+/-	+
3	Assoc./ Emp.	-	++/-	++/-	+
4	Estado	-	++	+	-

14

1.1.4 Como evoluem?

Ou espontaneamente- evolução em processo tipo “darwiniano” em que as instituições se vão adaptando e sobrevivem as que melhor se adaptam ao meio exterior.

Ou por desenho intencional- processo de construção e ajustamento de instituições formais.

15

1.2 As funções das instituições

A teoria dos jogos ajuda a compreender as funções das instituições:

Um “jogo” é um modelo simplificado de interação entre agentes económicos.

Cada jogo diferente (dilema do prisioneiro, harmonia, cooperação, jogo do “franganote”,...) tem características diferentes.

16

1.2 As funções das instituições

Metodologia para analisar jogos “single shot” (2X2), ou seja uma única interação:

- Analisar se ambos os jogadores (ou apenas um) têm ou não estratégias dominantes. Se sim o jogo tem um equilíbrio de estratégias dominantes (EED),
- Se nenhum jogador tem estratégia dominante, verificar se existe um ou vários equilíbrios de Nash (EN). Um EN, corresponde a um par de estratégias em que nenhum jogador beneficia por unilateralmente alterar a sua estratégia.

Nota: qualquer EED é EN, mas o reverso já não é verdadeiro.

17

1.2.1 Promover a cooperação

		Indivíduo B	
		Coop.	NC
Indiv. A	Coop	3,3	-2,8
	NC	8,-2	0,0
		Dilema do Prisioneiro	

Numa situação de “single shot” a cooperação não irá emergir na ausência de instituições apropriadas.

A função da instituição é passar do EED (0,0) para a solução cooperativa (3,3).

18

1.2.1 Promover a cooperação

		Indivíduo B	
		↓	
Indiv. A	Coop.	3,3	-2,8
	NC	8,-2	0,0

O dilema do prisioneiro jogado n vezes (n incerto), com as mesmas pessoas e um número relativamente reduzido de agentes:

- A cooperação poderá emergir (estratégia do *tit for tat*.)

O dilema do prisioneiro jogado n vezes (n certo) a cooperação não emerge (indução retrospectiva)

19

1.2.2 Facilitar a coordenação

		Ind. B	
		C	NC
Indiv. A	C	0,0	1,2
	NC	2,1	0,0

Coordenação (I)

E neste? Existe alguma problema de coordenação?

20

1.2.2 Facilitar a coordenação

		Ind. B	
		Esq.	Dir.
Indiv. A	Esq.	1,1	-x,-x
	Dir.	-x,-x	1,1

Coordenação (II)

E neste?

21

1.2.2 Facilitar a coordenação

Há vários aspectos comuns aos problemas (jogos) de coordenação:

- Têm vários equilíbrios
- Não há estratégias dominantes
- Ou não há nenhum conflito (caso II) ou há pouco (I)
- A falha de coordenação num equilíbrio leva a situações ineficientes.
- Qualquer par de estratégias fora dos equilíbrios é ineficiente.

Daqui deriva que uma das funções das instituições é a coordenação da interacção entre agentes económicos, sejam as instituições regras informais (convenções, normas sociais) ou formais (leis), organizações voluntárias (associações) ou coercivas (Estado).

22

1.2.3 Facilitar a negociação e resolver conflitos

		Ind. B	
		Pomba	Falcão
Indiv. A	Pomba	50,50	10,90
	Falcão	90,10	0,0

Jogo do “franganote” (chicken)

Situações de conflito potencial exigem a imposição de restrições mútuas

Nesta situação há equilíbrio de estratégias dominantes? E de Nash?

23

1.2.3 Facilitar a negociação e resolver conflitos

Indiv.		Ind. B	
		Pomba	Falcão
A	Pomba	50,50	10,90
	Falcão	90,10	0,0

Jogo do “franganote” (chicken)

Dois equilíbrios de Nash:

- eficientes, mas desiguais

Três pares de estratégias eficientes e uma ineficiente.

Qual o papel da instituição neste caso?

24

1.2.3 Facilitar a negociação e resolver conflitos

Por vezes “indivíduos” impõem auto-restrições *hoje* que condicionam as suas *escolhas futuras*

O dilema de Ulisses.

Aplicação a indivíduos

Aplicação a organizações

Aplicação a sociedades

25

1.2.4 Reduzir custos de negociação

Negociações, em mercados ou no processo político, envolvem custos.

Uma das funções das instituições é reduzir esses custos de negociação ou mais genericamente *custos de transacção*.

26

1.2.5 Conclusão

As funções das instituições são, entre outras:

- Promover a cooperação:
 - provisão de bens públicos
 - redistribuição.
- Promover a coordenação.
- Facilitar a negociação e resolução de conflitos.
- Reduzir os custos de negociação.

27
