

Aula 2 - As Instituições: o que são, para que servem

- **A- Introdução :**
- A.1– Dilemas e paradoxos da interação de agentes racionais – contributos para a economia neo-institucional
- A.2- Assunções básicas da economia neo-institucional
- **B- As instituições**
- B.1- O que são e para que servem
- B.2- Instituições e mecanismos de coordenação
- B.3- Como avaliar as instituições

A.1- Teoria da escolha racional

Racionalidade centra-se num comportamento humano orientado por preferências (o que presume escolha ou ordenação de várias alternativas) baseadas no grau que proporcionam de ...felicidade, satisfação ..utilidade

A satisfação de preferências presume que estas são reveladas através da disposição de pagar (ou suportar os custos de produção) de uma unidade adicional de um bem ou serviço

Algumas propriedades lógicas das preferências

- a) **Integridade** - presume a capacidade de o indivíduo ordenar, ou **hierarquizar**, um conjunto de bens em alternativa a outro conjunto em que as quantidades variam.
- b) **Transitividade**
- c) **Maximização (não saciedade)**

Função de utilidade

A.1- Teoria da escolha racional

- **Implicações dos axiomas**
- **A) Conceito de equilíbrio**
- o comportamento maximizador dos agentes define o equilíbrio (oferta/procura -> quantidades e preços) num sistema de interação que, por inerência, se identifica com mercado.
- B) O princípio do equilíbrio (geral ou parcial) pressupõe uma análise estática, só mutável por efeito de um choque externo.
- C) Conceito **específico de eficiência** (*optimo de Pareto*).
- Aumento de eficiência significa que um incremento da satisfação de A , não implica *des-satisfação* de B.
- *Se um milhão de indivíduos aumentam o seu bem-estar à custa de perda de bem-estar de um indivíduo (e basta um) não se verifica um optimo de Pareto*

A.1- Dilemas e paradoxos dos axiomas da escolha racional

- Dilemas ou paradoxos que destacaram a importância das instituições para a coordenação entre indivíduos racionais.
- Contributo de métodos ou ferramentas baseadas em
 - Teoria de jogos (um campo de aplicação de diferentes áreas da matemática à escolha racional)
 - Filosofia Política e Lógica - As escolhas sociais e as restrições às propriedades das preferências

A.1- Teoria de jogos

- 1- Jogadores: pessoas, empresas, estados, grupos organizados ou com condições para se organizarem
- 2- Estratégia: conjunto de acções possíveis para cada jogador em interacção com outros jogadores
- 3- Resultados (payoffs) das estratégias
- 4- Tempo do jogo e informação dos jogadores: jogo simultâneo ou sequencial, finito ou infinito.

A.1- Teoria de jogos

Jogos cooperativos ou não cooperativos,
Tipificados segundo

Estratégias e Equilíbrios alcançáveis

Representação dos jogos:

Matriz de payoffs (torna mais fácil identificar o equilíbrio)

Árvore ou forma extensiva (facilita a identificação da estratégia num jogo com interacções sequenciais)

O Dilema do prisioneiro...(1)

- A história é:
- Alfa e Beta são encarcerados por envolverem-se num delito menor que daria pena de 2 anos. Mas a polícia suspeita de que a mesma parelha realizou um crime anterior cuja pena seria 3 anos.
- Os prisioneiros, cada um em sua cela, são colocados diante várias escolhas possíveis:

(1) - A origem da teoria é atribuída a **Merrill Meeks Flood** e **Melvin Dresher** – matemáticos que desenvolvem a teoria de jogos no âmbito de pesquisas do **RAND Research and Development Corporation** (*pesquisa e análise no âmbito das forças armadas americanas*).

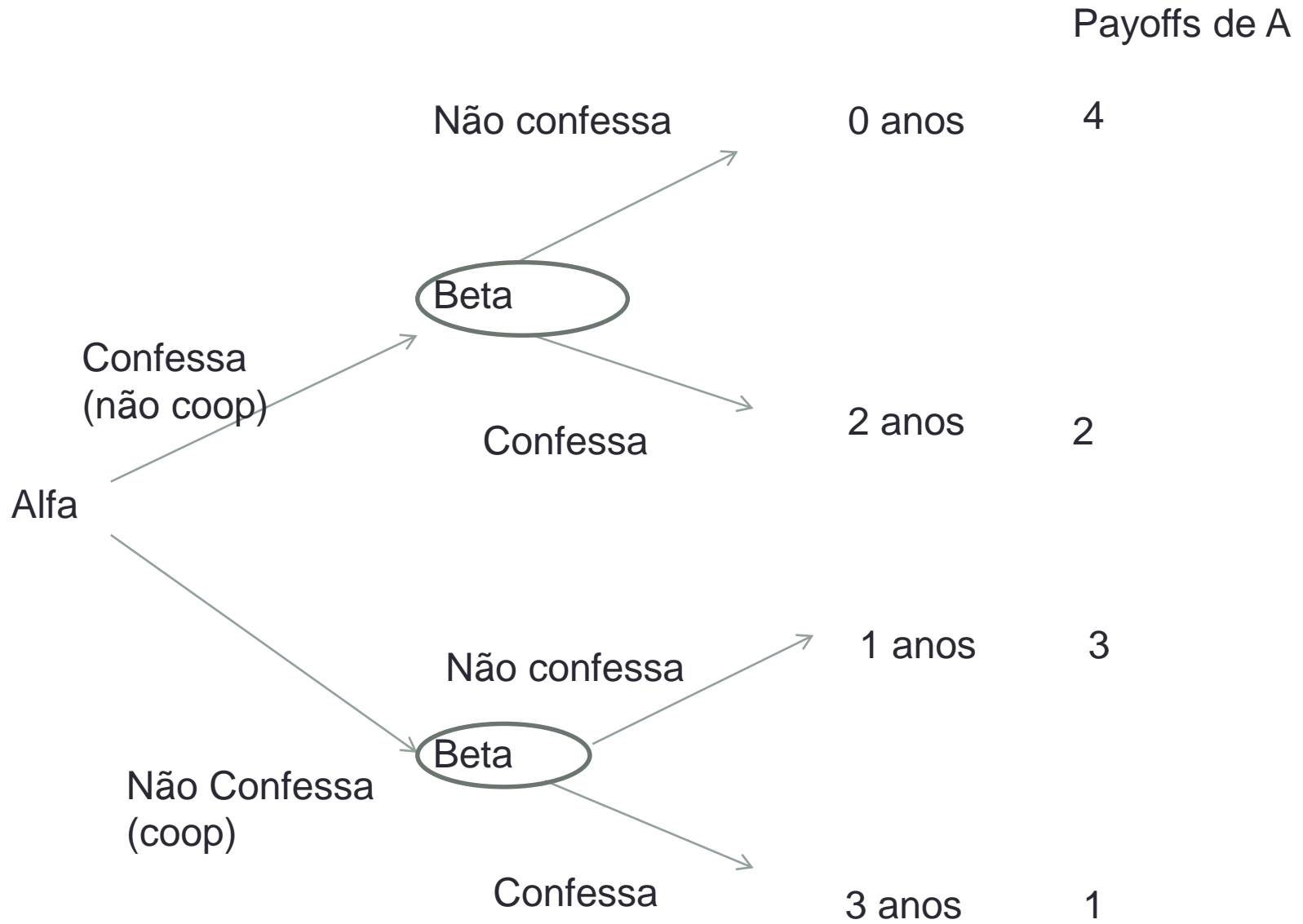
Albert Tucker (também matemático) apelidou-o de *dilema de prisioneiro* dando-lhe o enunciado (o enredo) habitualmente descrito.

O prisioneiro...

- Se A confessar (não cooperando com B) e B não confessar = A vai em liberdade = 0 anos
- Se A não confessar e B confessar = 3 anos (pena máxima)
- Se confessarem ambos, reduz-se a pena de ambos para 2 anos
- SE ambos não confessarem, ambos ficam com 1 ano

		Beta	
		não confessa	confessa
Alfa	não confessa	<div style="display: flex; align-items: center; justify-content: center;"> A ↓ 3,3 B </div>	<div style="display: flex; align-items: center; justify-content: center;"> A ↓ 1,4 B </div>
	confessa	<div style="display: flex; align-items: center; justify-content: center;"> A ↓ 4,1 B </div>	<div style="display: flex; align-items: center; justify-content: center;"> A ↓ 2,2 B </div>

Dilema do prisioneiro



O prisioneiro

- Jogo não cooperativo
- Há uma estratégia dominante
- **O contributo relevante do dilema do prisioneiro: o equilíbrio não é maximizador de payoffs. As preferências individuais podem não resultar em bem estar social**
- Payoff superior para a não cooperação se outros cooperarem – payoff para o passageiro clandestino.

Jogos de múltiplo equilíbrio

		Ind. B	
		Esq.	Dir.
Indiv. A	Esq.	1,1	0,0
	Dir.	0,0	1,1

Há uma estratégia dominante de cooperação mas como há dois Equilíbrios, a cooperação (direita ou esquerda) precisa de convenção formal ou informal entre os jogadores.

Estratégia dominante : cooperação

		índividuo B	
		cooperar	não cooperar
Indivíduo A	cooperar	8,8	3,-1
	não cooperar	-1,3	0,0

Estratégia dominante é cooperação. Incentivos individuais coincidem com bem-estar social

Jogos de múltiplo equilíbrio

		B	
		pomba	falcão
A	pomba	50,50	10,90
	falcão	90,10	-100,-100

Os contextos importam?

- *comportar-se-iam de forma idêntica os dois prisioneiros num jogo repetido? Se fosse finito? E se fosse infinito?)*
- Os contextos (timing do jogo) e informação: jogos de one-shot e jogos reiterados definem diferentes payoffs.
 - Tit-for-tat: reciprocidade como estratégia
 - Experiências (economia comportamental) reviram o modelo comportamental do homo *oeconomicus* destacando justiça como um valor determinante das preferências.
 - Mudando as regras do jogo, os agentes alteram as suas estratégias. As regras são incentivos; constroem comportamentos.

O contributo da teoria de jogos

- Múltiplos equilíbrios apontam a necessidade de regras (convenções) para coordenação num dado equilíbrio
- Os jogadores podem ter pay offs superiores em situação de cooperação: revelam a importância de regras formais ou informais que incentivam a cooperação
- Jogos revelam que comportamentos maximizadores comportam problemas de coordenação quando os incentivos individuais não coincidem com bem-estar social.

Contributo da filosofia política

- preferências sobre preferências de terceiros (direitos individuais e dos outros) descobrem situações em que o axioma da *transitividade* não se verifica na escolha racional colectiva.

Paradoxo de Condorcet

Eleitores	1 ^a preferencia	2 ^a preferencia	3 ^a preferencia
Eleitor 1	A	B	C
Eleitor 2	B	C	A
Eleitor 3	C	A	B

Candidato A ganha a B em dois casos (pelo votos de 1 e de 3); Mas pela mesma ordem de razões se pode argumentar que qualquer candidato ganha por dois votos em três

$A > B > C$, mas A só é preferível a C num único caso (do votante 1);. Ou $B > C > A$, mas $B > A$ só para um eleitor – a transitividade não se verifica.

Conclusões a extrair

- Equilíbrio não é necessariamente sinónimo de eficiência alocativa (dilema do prisioneiro)
- Os comportamentos dos indivíduos são determinados por payoffs, mas os payoffs são determinados por um **contexto** de interacção.
- Escolhas individual e **escolha colectiva** podem ter lógicas discordantes

A.2- conclusões : assunções básicas da nova economia institucional (NEI)

- A) Individualismo metodológico – uma teoria sobre fenómenos sociais deve partir de uma explicação do comportamento da unidade elementar do sistema em análise
- B) A racionalidade maximizadora - considera-se que ele é submetida a constrangimentos ditados por um sistema institucional (contextos)
- C) A racionalidade está também dependente da distribuição, qualidade de, e capacidade de interpretação da informação disponível, incluindo a que outros agentes possuem (racionalidade é limitada)
- D) Os indivíduos não são apenas maximizadores, podem ser oportunistas nesse intuito maximizador - um agente pode omitir informação, disfarçar as suas preferências – os contratos são incompletos
- E) O sistema social é uma interação dinâmica entre indivíduos (inseridos ou não em organizações formais) cujo comportamento é constrangido, não apenas por restrições orçamentais, mas também por regras (incentivos positivos ou negativos) e pelas escolhas dos outros indivíduos (contexto).
- F) O processo político e as instituições políticas descrevem-se pelos mesmos pressupostos da economia.

B- Instituições: o que são?

- **Instituições são restrições** desenvolvidas por indivíduos de forma a estruturar a interacção humana. Distinguem-se de organizações que são sistemas de instituições
-
- Classificação das instituições em função de
- A) como se processa a génese ou adesão a norma
- B) mecanismos de sanção

B.1-Tipologia de instituições

- Quanto à génese ou formas de adesão:
- Podem ser *formais* ou “*informais*”:
 - **Instituições informais** – génese de baixo para cima
 - Evoluem de forma adaptativa, remetem para dimensões históricas, filosóficas a antropológicas da interação
 - normas de comportamento social
 - convenções
 - códigos de conduta auto-impostos. / as regras tornam-se *habitus*

Mecanismo dominante de sanção: informal – ou chamado de auto-regulação (sanção pela primeira parte) ; admitem-se casos de a sanção vir da segunda parte aplicação de sanções.

- Podem desenvolver-se mecanismos formais de sanção específicas de certas organizações

B.1-Tipologia de instituições

- **Instituições formais:** *intencionalmente criadas por uma terceira entidade reguladora. génese de cima para baixo,*
- *menor capacidade adaptativas, e a sua eficácia depende da sua coerência relativamente a instituições informais.*
- **Regras escritas** - regulamentos, leis, constituições, contratos, direitos, acordos de negociação.
- Mecanismo de sanção formal – justiça pública

B.2- Instituições: para que servem?

- As instituições
- A- Emitem informação
- B- Introduzem previsibilidade – minimizam a incerteza
- C- Podem criar mecanismos redistributivos (jogos de soma nula)

- **Regras = Instituições** são socialmente relevantes se lhes está associado um mecanismo de sanção/ recompensa
- Contribuem para alterar relação custo-benefício de comportamentos oportunistas (curto prazo)
- Condicionam a racionalidade da escolha individual e colectiva.

B.3- Como avaliar sistemas de instituições?

- 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 social
- Segundo a capacidade de preservar a esfera de *autonomia e liberdade* individual face a interferências de terceiros – **critério da liberdade** (ausência de coerção)

B.3- Mecanismos de coordenação (sistemas institucionais)

Quatro tipos de **mecanismos de coordenação**:

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

B.3- Como avaliar sistemas de instituições?

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

Objectivos

- Identificação do contributo da teoria de jogos e de outras ciências sociais, sobretudo pelo jogo dilema de prisioneiro, para a inclusão de instituições na análise económica
- Definição de instituições e justificação da sua tipologia
- Compreender a função das instituições para coordenação social
- Identificar sistemas de instituições e mecanismos de coordenação.

Bibliografia

- **Pereira, P. T. (2008)**, *O prisioneiro, o Amante e as Sereias*, cap. 2.; cap. 3, ponto 3.1 a 3.4.
- ou
- Kasper, Wolfgang; Streit, Manfred E. (1999) *Institutional Economics*, pp.92-124
- Complementar
- Williamson, Oliver E. (2000), “The New Institutional Economics : taking stock, looking ahead”, *Journal of Economic Literature*, 38:3, pp.595-613.