第一部分：入门

问题

法官（judge）、检察官（prosecutor）和嫌疑人（defendant）

- 法官的目标是公平断案
- 检察官的目标是将犯人判为有罪

检察官可以调查嫌疑人，获取私人信息。

- 如果有罪，检察官如实汇报对自己有利
- 如果无罪，检察官如实汇报会损害自己效用

那么，检察官能否通过设计信息结构，提高理性法官的平均定罪概率？

基础设定：行动集、支付与先验概率

嫌疑人有两种状态：有罪（Guilty）、无罪（Innocent）

$$\Omega = \{G, I\}$$

法官（Receiver）：定罪（convict）或释放（acquit）
法官的效用函数：

审判结果与状态相符时为 1

审判结果与状态不符时为 0

检察官（Sender）的效用函数取决于法官的行为：

法官选择“定罪”时为 1

法官选择“释放”时为 0

检察官的效用与事实情况无关，只和法官行为有关。
检察官与法官共享先验信念 $\Pr(G) = 0.3$、$\Pr(I) = 0.7$

检察官行为、时点设定与基准模型

检察官可以调查，即选择一个信息结构 $\pi : \Omega \to \Delta(S)$。

检察官调查 → 检察官向法官告知结果 → 法官根据结果做出决策

基准模型 1：完全如实汇报，即令 $S = G$，
如果嫌疑人有罪（guilty,G），检察官必然告知法官有罪，即
$\pi(G \mid G) = 1$；
如果嫌疑人无罪（innocent,I），检察官必然告知法官无罪，即
$\pi(I \mid I) = 1$。
此时法官的支付恒为 1
检察官的收益是嫌疑人有罪的先验概率 0.3。

基准模型 2：不进行任何调查

无论是否有罪，检察官都告知法官同一个证据 $S=\{1\}$。即 $\pi(1 \mid G)=\pi(1 \mid I)=1$

如果法官无论收到什么信号都判有罪，法官的期望收益为 $\Pr(G)\times 1+\Pr(I)\times 0=0.3$

如果法官无论收到什么信号都判无罪，法官的期望收益为 $\Pr(G)\times 0+\Pr(I)\times 1=0.7$

基准模型 2：不进行任何调查

无论是否有罪，检察官都告知法官同一个证据 $S = \{1\}$。即 $\pi(1 \mid G) = \pi(1 \mid I) = 1$

如果法官无论收到什么信号都判有罪，法官的期望收益为 $\Pr(G) \times 1 + \Pr(I) \times 0 = 0.3$

如果法官无论收到什么信号都判无罪，法官的期望收益为 $\Pr(G) \times 0 + \Pr(I) \times 1 = 0.7$

因此，法官必然选择判无罪，检察官支付为 0。

基准模型 2：不进行任何调查

无论是否有罪，检察官都告知法官同一个证据 $S = \{1\}$。即
$\pi(1 \mid G) = \pi(1 \mid I) = 1$
如果法官无论收到什么信号都判有罪，法官的期望收益为
$\Pr(G) \times 1 + \Pr(I) \times 0 = 0.3$
如果法官无论收到什么信号都判无罪，法官的期望收益为
$\Pr(G) \times 0 + \Pr(I) \times 1 = 0.7$
因此，法官必然选择判无罪，检察官支付为 0。

检察官选择如实披露比完全不披露更有利。

检察官能否做得更好？

令 $S=\{g,i\}$， π 满足

$$\pi(g \mid G)=1, \pi(i \mid G)=0$$

$$\pi(g \mid I)=\frac{3}{7}, \pi(i \mid I)=\frac{4}{7}$$

检察官能否做得更好？

令 $S=\{g,i\}$，π 满足

$$\pi(g \mid G)=1, \pi(i \mid G)=0$$

$$\pi(g \mid I)=\frac{3}{7}, \pi(i \mid I)=\frac{4}{7}$$

此时，法官收到信号 g 并判有罪时，所获支付为

检察官能否做得更好？

令 $S = \{g, i\}$，π 满足

$$\pi(g \mid G) = 1, \pi(i \mid G) = 0$$

$$\pi(g \mid I) = \frac{3}{7}, \pi(i \mid I) = \frac{4}{7}$$

此时，法官收到信号 g 并判有罪时，所获支付为

$$judge's\ payoff = \frac{\overbrace{\pi(g \mid G)\Pr(G)}^{\text{有罪时收到信号 g 的概率}}}{\underbrace{\pi(g \mid G)\Pr(G)}_{\text{有罪时收到信号 g 的概率}} + \underbrace{\pi(g \mid I)\Pr(I)}_{\text{无罪时收到信号 g 的概率}}}$$

检察官能否做得更好？

令 $S=\{g,i\}$，π 满足

$$\pi(g\mid G)=1,\pi(i\mid G)=0$$

$$\pi(g\mid I)=\frac{3}{7},\pi(i\mid I)=\frac{4}{7}$$

此时，法官收到信号 g 并判有罪时，所获支付为

$$judge's\ payoff=\frac{\overbrace{\pi(g\mid G)\Pr(G)}^{\text{有罪时收到信号 g 的概率}}}{\underbrace{\pi(g\mid G)\Pr(G)}_{\text{有罪时收到信号 g 的概率}}+\underbrace{\pi(g\mid I)\Pr(I)}_{\text{无罪时收到信号 g 的概率}}}$$

$$=\frac{1\times 0.3}{1\times 0.3+\frac{3}{7}\times 0.7}=\frac{1}{2}$$

检察官能否做得更好？

法官收到信号 g 并判无罪时，所获支付为

$$judge's\ payoff = \frac{\overbrace{\pi(g \mid I)\Pr(I)}^{\text{无罪时收到信号 g 的概率}}}{\underbrace{\pi(g \mid G)\Pr(G)}_{\text{有罪时收到信号 g 的概率}} + \underbrace{\pi(g \mid I)\Pr(I)}_{\text{无罪时收到信号 g 的概率}}}$$

检察官能否做得更好？

法官收到信号 g 并判无罪时，所获支付为

$$judge's\ payoff = \frac{\overbrace{\pi(g \mid I)\Pr(I)}^{\text{无罪时收到信号 g 的概率}}}{\underbrace{\pi(g \mid G)\Pr(G)}_{\text{有罪时收到信号 g 的概率}} + \underbrace{\pi(g \mid I)\Pr(I)}_{\text{无罪时收到信号 g 的概率}}}$$

$$= \frac{\frac{3}{7} \times 0.7}{1 \times 0.3 + \frac{3}{7} \times 0.7} = \frac{1}{2}$$

检察官能否做得更好？

法官收到信号 g 并判无罪时，所获支付为

$$judge's\ payoff = \frac{\overbrace{\pi(g \mid I)\Pr(I)}^{\text{无罪时收到信号 g 的概率}}}{\underbrace{\pi(g \mid G)\Pr(G)}_{\text{有罪时收到信号 g 的概率}} + \underbrace{\pi(g \mid I)\Pr(I)}_{\text{无罪时收到信号 g 的概率}}}$$

$$= \frac{\frac{3}{7} \times 0.7}{1 \times 0.3 + \frac{3}{7} \times 0.7} = \frac{1}{2}$$

如果收到信号 i，法官可以确定嫌疑人无罪。

检察官能否做得更好？

法官收到信号 g 并判无罪时，所获支付为

$$judge's\ payoff = \frac{\overbrace{\pi(g \mid I)\Pr(I)}^{\text{无罪时收到信号 g 的概率}}}{\underbrace{\pi(g \mid G)\Pr(G)}_{\text{有罪时收到信号 g 的概率}} + \underbrace{\pi(g \mid I)\Pr(I)}_{\text{无罪时收到信号 g 的概率}}}$$

$$= \frac{\frac{3}{7} \times 0.7}{1 \times 0.3 + \frac{3}{7} \times 0.7} = \frac{1}{2}$$

如果收到信号 i，法官可以确定嫌疑人无罪。
假定判有罪和无罪的收益相同时，法官会选择对检察官有利的选项。

检察官的收益

检察官的收益完全取决于发出信号 g 的概率，即

$$prosecutor's payoff = \underbrace{\pi(g \mid G)\Pr(G)}_{\text{有罪时收到信号 g 的概率}} + \underbrace{\pi(g \mid I)\Pr(I)}_{\text{无罪时收到信号 g 的概率}} = 0.6$$

因此，只要检察官发出有罪信号，法官一定会判有罪。此时检察官的收益为 0.6。

检察官的收益

检察官的收益完全取决于发出信号 g 的概率，即

$$prosecutor'spayoff = \underbrace{\pi(g \mid G)\Pr(G)}_{\text{有罪时收到信号 g 的概率}} + \underbrace{\pi(g \mid I)\Pr(I)}_{\text{无罪时收到信号 g 的概率}} = 0.6$$

因此，只要检察官发出有罪信号，法官一定会判有罪。此时检察官的收益为 0.6。

可以看出，不同情境下检察官的支付满足：

什么都不披露 $(0) <$ 完全披露 $(0.3) <$ 选择性披露 (0.6)

主体

信息发送者（Sender）和信息接受者（Receiver）
状态空间 Ω 是有穷的，且无论是 S 还是 R 都观测不到具体的状态。
S 和 R 都了解先验概率 $p \in \Delta(\Omega)$
接受者可以采取行动所构成的集合 A 是紧集。
信息接受者 R 的效用函数:$A \times \Omega \to \mathbb{R}$ 满足连续性。
信息发送者 S 的效用函数:$A \times \Omega \to \mathbb{R}$ 满足连续性。

时间线与 partial implementation

1 信息发送者 S 选择信息结构 $\overset{\text{给定}\Omega\text{，以一定概率发送信号}S}{\pi : \Omega \to \Delta(S)}$

2 信息接受者 R 观测到信号 S 的实现，并进行贝叶斯更新，采取行动 $a \in A$

解概念：子博弈精炼均衡/子博弈完美均衡。

定义：信号发送者偏好的子博弈完美均衡：当信号接受者 R 的两个选项无差异时，接受者会选择更有利于信号发送者的选项。

信念更新：后验信念

考虑任何信号发送者偏好的子博弈完美均衡 (Sender-preferred subgame perfect equilibrium)

给定后验信念 $q \in \Delta(\Omega)$ 令集合 $A(q) \subset A$ 为最大化信号接受者 R 期望收益的行动集合。（存在性源于 Weierstrass theorem）

$$A(q) = \arg\max_{a \in A} E_q\left[u_R(a, \omega)\right]$$

信念更新：后验信念

考虑任何信号发送者偏好的子博弈完美均衡 (Sender-preferred subgame perfect equilibrium)

给定后验信念 $q \in \Delta(\Omega)$ 令集合 $A(q) \subset A$ 为最大化信号接受者 R 期望收益的行动集合。（存在性源于 Weierstrass theorem）

$$A(q) = \arg\max_{a \in A} E_q[u_R(a,\omega)]$$

给定信念为 q，最大化信息接受者期望收益的集合。对不同 ω 各自可能性相乘取期望，采取行动 a 最大化收益。即

$$E_q[u_R(a,\omega)] = \sum_{\omega\in\Omega} \underbrace{q(\omega)}_{\omega\text{发生的概率}} \underbrace{u_R(a,\omega)}_{\omega\text{发生时采取行动}a\text{的效用}}$$

信念更新：后验信念

考虑任何信号发送者偏好的子博弈完美均衡 (Sender-preferred subgame perfect equilibrium)

给定后验信念 $q \in \Delta(\Omega)$ 令集合 $A(q) \subset A$ 为最大化信号接受者 R 期望收益的行动集合。（存在性源于 Weierstrass theorem）

$$A(q) = \arg\max_{a \in A} E_q\left[u_R(a,\omega)\right]$$

给定信念为 q，最大化信息接受者期望收益的集合。对不同 ω 各自可能性相乘取期望，采取行动 a 最大化收益。即

$$E_q\left[u_R(a,\omega)\right] = \sum_{\omega \in \Omega} \underbrace{q(\omega)}_{\omega\text{发生的概率}} \underbrace{u_R(a,\omega)}_{\omega\text{发生时采取行动}a\text{的效用}}$$

令 $\hat{a}$ 表示均衡时信号接受者 R 的行动，

$$\hat{a}(q) \in \arg\max_{a \in A} E_q\left[u_S(a,\omega)\right]$$

信号发送者的期望收益

给定后验信念 q 和信号接受者行动 $\hat{a}(q)$，令 $\hat{v}(q)$ 为信号发送者 R 的期望收益：

$$\hat{v}(q) = E_q\left[u_S\left(\hat{a}(q), \omega\right)\right]$$

基准假设

状态空间 $\Omega = \{G, I\}$，$\omega \in \Omega$
信息发送者：检察官（prosecutor）
信息接受者：法官（judge）
行动集合：$A = \left\{\text{判无罪 (acquit)}, \text{判有罪 (convict)}\right\}$

基准假设

状态空间 $\Omega = \{G, I\}$，$\omega \in \Omega$

信息发送者：检察官（prosecutor）

信息接受者：法官（judge）

行动集合：$A = \{$判无罪 (acquit), 判有罪 (convict)$\}$

先验概率：$\Pr(G) = 0.3$，$\Pr(I) = 0.7$

信号接受者 R 的效用函数：

$$u_R(acquit, I) = u_R(convict, G) = 1; \quad u_R(acquit, G) = u_R(convict, I) = 0$$

信号发送者 S 的效用函数：

$$u_S(acquit, I) = u_S(acquit, G) = 0; \quad u_S(convict, G) = u_S(convict, I) = 0$$

后验信念

$$a\left(q\right)=\begin{cases}\{acquit\} & if\ q\left(G\right)<\frac{1}{2}\\ \{convict\} & if\ q\left(G\right)>\frac{1}{2}\end{cases}$$

1. 基础文献
2. 例子：KG2011
3. 正规表述
4. 例子：王明等（2021，世界经济）
   - 基准模型设定
   - 严格执行
   - 变通执行
5. 贝叶斯劝说：正规表述

问题导入

治理失灵现象普遍存在，但治理失灵被内生于治理体系中。

- 基层政府的选择性执行
- 政策治理的变通行为
- 消极执行与运动式执行

“非正式行为”为什么在上级政府具有纠偏能力时也会被制度化？

假定上级政府 U 和下级政府 D 政策集为 $X \in \{a, b\}$
上级政府负责制定政策，下级政府负责执行政策。

1. 基础文献
2. 例子：KG2011
3. 正规表述
4. 例子：王明等（2021，世界经济）
   - 基准模型设定
   - 严格执行
   - 变通执行
5. 贝叶斯劝说：正规表述

1. 基础文献
2. 例子：KG2011
3. 正规表述
4. 例子：王明等（2021，世界经济）
   - 基准模型设定
   - 严格执行
   - 变通执行
5. 贝叶斯劝说：正规表述