

2024 年 10 月 12 日



中国财政发展协同创新中心

— Center for China Fiscal Development —

- ① 寻租行为
- ② 寻租博弈
- ③ 垄断的社会成本
- ④ 均衡效应
- ⑤ 政府政策

什么是寻租行为？

什么是寻租 (rent-seeking)?

- 根据塔洛克的定义，寻租是人们为获得垄断或取得政府其他庇护而从事的活动。
- 布坎南将寻租定义为人们凭借政府保护进行的寻求财富转移而造成的浪费资源的活动。
- 是指社会成员通过游说、行贿等活动，促使权力拥有者帮助自己确立垄断地位，以获得经济租的活动。

什么是寻租行为？

- 一个国家通过入侵另一个国家的方式来提高对本国制造业的需求，这是寻租么？
- IBM 使用标准化的零部件来组装第一批个人电脑以降低组装成本，这是寻租么？
- 一家电脑软件公司拒绝向其他软件开发商公开代码，这是寻租么？

寻租与寻利

- 一家企业正在研发新产品。如果研发成功，生产出的产品将是独一无二的，该企业也将获得垄断地位和垄断租金，直到竞争产品被引入市场。
- 一家企业在本国市场引入了一种新产品。在国外，同类产品已经被生产制造出来。该企业雇佣了一个律师团来游说政府以禁止该产品的进口。如果该企业的策略成功了，它将在国内获得垄断地位并获得垄断租金。

寻租与寻利

- 寻利 (profit-seeking) 是把资源花费在创造对社会有益的盈利机会上。正如研发这个例子所表明的那样，寻求利润推动了经济的进步，也鼓励了竞争。
- 寻租 (rent-seeking) 是把资源花费在创造对社会有害的盈利机会上。正如律师团这个例子所表明的那样，寻租阻碍了经济的发展，也限制了竞争。

确定性博弈

博弈基本结构：

有一笔价值 10000 元的奖金，所有博弈参与者同时将一笔钱放在桌子上并点燃，烧掉钱最多的人将获得这笔奖金。假设所有的竞争者都是同质的，且是风险中性的，每个人会烧掉多少钱？

- 纯策略 (pure strategy) 均衡：不存在！
- 混合策略 (mixed strategy) 均衡：
 - 2 个人: $F(B) = \frac{B}{V}$.
 - n 个人: $F(B) = [\frac{B}{V}]^{1/(n-1)}$.

完全耗散定理

完全耗散定理 (complete dissipation theorem):

在一个确定寻租博弈中，如果有两个或两个以上的竞争者，竞争者为了争夺奖金 V 所花费的资源的总期望价值恰好为 V 。

随机性博弈

确定性博弈假设一个参与者只要比他的对手有一点优势就可以获得确定性的胜利。

但现实中更高程度的努力虽然增加了获得奖金的概率，却不能确保一定获胜。

假设每个竞争者获得奖金的概率等于他们的花费占有所有竞争者寻租总支出的比例，即期望收益函数为：

$$EP_i = \left[\frac{B_i}{B_i + [n-1]B_{-i}} \right] V - B_i.$$

随机性博弈

竞争者会采取纯策略，其花费的资源为：

$$B = \frac{n-1}{n^2} V.$$

每个人的期望收益为

$$EP = \left[\frac{1}{n} \right] V - B = \frac{V}{n^2}.$$

被耗散的总租金为：

$$nB = \frac{n-1}{n} V.$$

部分耗散定理

部分耗散定理 (partial dissipation theorem):

在一个随机性寻租博弈中，如果有两个或两个以上的竞争者，竞争者为了争夺奖金 V 所花费的资源的总期望价值占 V 的比例为 $\frac{n-1}{n}$ ，这一比例随竞争者人数的增加而增加。

自由进入

在自由进入的情况下，博弈的期望收益必然为零

- 确定性博弈：部分竞争者选择不进入，部分竞争者选择混合策略，所有竞争者的期望收益均为零；
- 随机性博弈：正的期望收益 $\frac{V}{n}$ 会吸引新的竞争者直到租金价值全部耗散
 - 当 $n \rightarrow \infty$ 时, $\frac{V}{n} \rightarrow 0$ ，自由进入下随机性博弈和确定性博弈会产生等价的结果。

寻租的来源

- 垄断是政府创造的，例如政府决定一条航线只能由一家航空公司承接。如果航空公司为了获取飞行权而竞相游说政府，那么情况类似于烧钱博弈。
- 垄断地位已经存在，但垄断者必须保护自己不受潜在竞争者的威胁而采取行动，比如利用版权或专利法组织类似产品的生产，或者利用广告减少竞争，或者采取直接的行动恐吓潜在的竞争者。
- π 也被叫做垄断租，企业为获得垄断租，就愿意耗费不大于这一区域的成本以谋求垄断地位。

垄断的社会成本

如果考虑寻租成本的话，垄断的社会成本至少为 d ，最高可以达到 $\pi + d$ 。垄断的社会成本可能会远远大于由无谓损失所衡量的部分：

- Harberger(1954) 仅仅利用无谓损失 d 计算了 1924 年至 1928 年间美国制造业的垄断成本，大约为国民收入的 0.08%；
- Cowling and Mueller(1978) 使用寻租方法进行了计算，把广告成本也包括在福利损失的度量之中，认为美国工业的福利损失大约占公司总收入的 4% 到 13%。

垄断和竞争均衡

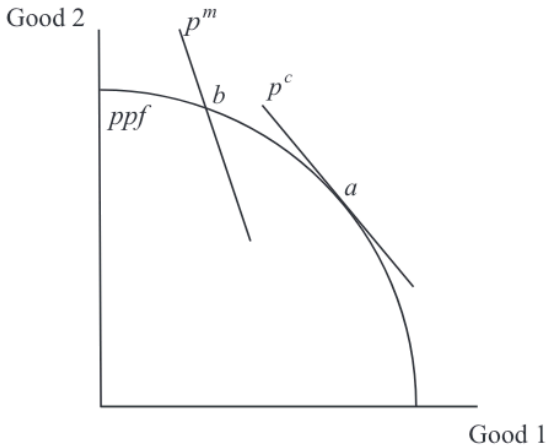


Figure 12.2
Competitive and monopoly equilibria

垄断和游说

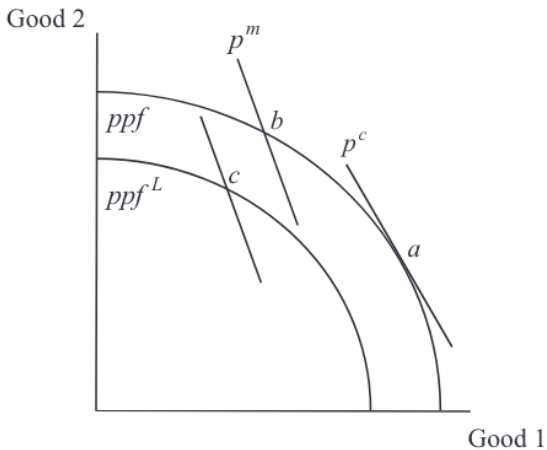


Figure 12.3
Monopoly and lobbying

游说的威胁

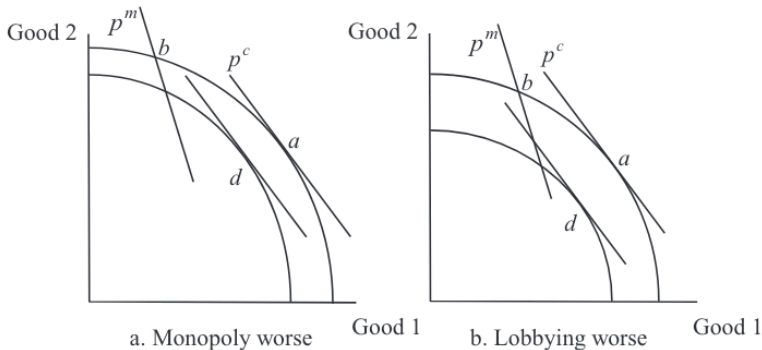


Figure 12.4
Threat of lobbying

政府政策

政府主要通过两种渠道和寻租相联系：

- 游说 (lobbying)。不从事生产性活动，而是为雇佣他们的组织寻找政府的优惠政策。
- 官僚和政治家 (bureaucrats and politicians)。官僚和政治家可以通过他们的政治选择来创造租金。这些租金可以“卖”给那些从中获益的部门。出售租金为出售者带来了收入，并会激励人们从政或者在政府部门任职。

游说

考虑一个生产两种商品的小国：

- 在没有关税时，两种商品的价格都等于 1；
- 一部分产出用于消费，一部分用于出口；
- 消费者无弹性的供给数量为 \bar{l} ，且被用于两种商品的生产 and 游说；
- 商品 2 的生产是规模报酬不变的，且一单位的劳动力可以产出一单位的产品；

垄断利润

假定商品 1 的成本函数为 $C(y_1) = \frac{1}{2}y_1^2$ ，关税为 τ ，因此商品 1 在国内市场上的价格为 $1 + \tau$ 。

假设所有企业的产品都在国内市场上销售，那么企业的利润水平为：

$$\pi_1(\tau) = y_1[1 + \tau] - \frac{1}{2}y_1^2.$$

利润最大化的产出水平为：

$$y_1 = 1 + \tau.$$

因此，如果能成功地获得关税保护，垄断者在该水平下的利润水平为：

$$\pi_1(\tau) = \frac{1}{2}[1 + \tau]^2.$$

劳动市场均衡

劳动市场均衡要求劳动供给必须等于：

- 用于商品 1 生产的劳动力 l_1 ；
- 用于商品 2 生产的劳动力 l_2 ；
- 用于游说的劳动力 l_L 。

即 $\bar{l} = l_1 + l_2 + l_L$ 。因此

- 企业 1 需要的劳动力为 $l_1 = \frac{1}{2}[1 + \tau]^2$ 。
- 根据完全耗散定理，游说的资源成本恰好等于由此外生的额外利润。因此该企业用于游说的劳动力应为：
 - $l_L = \pi_1(\tau) - \pi_1(0) = \frac{1}{2}[2\tau + \tau^2]$ 。
- 商品 2 的产出等于投入该商品生产的劳动力，所以 $l_2 = y_2$ ，即
 - $l_2 = \bar{l} - \frac{1}{2}[1 + 4\tau + 2\tau^2]$ 。

劳动市场均衡

由此我们可以得出：

$$y_1 + y_2 = \bar{l} - \frac{1}{2}[2\tau^2 + 2\tau - 1].$$

- 国民收入随着关税税率的平方递减。可能存在的关税使得资源被用于游说，这些资源减少了商品 2 的产出和用世界价格衡量的国民收入。

创造租金

- 政治创租 (political rent creation) 是指政府官员利用行政干预手段来增加私人企业的利润，人为地创造租金，诱使私人企业向他们贿赂以得到这种租金。
- 抽租 (rent extraction) 是指政府官员故意提出某项会使私人企业利益受损的政策作为威胁，迫使私人企业割舍一部分既得利益与之分享。

设租与腐败

- 以公权谋公利。这是理所应当的，因为设立公权就是为了公利。
- 以私权谋公利。这种行为是利他主义的表现，是需要提倡的道德规范。
- 以私权谋私利。这是利己主义的表现，只要不损害他人和社会的利益，这种行为是被允许的。
- 以公权谋私利。这种行为以损害他人和社会的利益为前提，会导致巨大的社会成本。

设租和腐败都是滥用公共权力以谋求私人利益，因此设租和腐败之间没有实质性的区别。

设租成本

一旦寻租/设租成功，那么

- 租金的获得者确实得到了好处；
- 设租的政治家或官员可以从租金中获益；
- 损失来自于那些参与竞争最终却没能获胜的人。

由此可能会产生两种经济成本，包括：

- 经济中可能会产生大量的扭曲，扭曲会被不断地创造出来，直到政策制定者无法从中获得额外的好处。
- 政策可能会频繁变动，产生巨大的政策不确定性。

寻租-设租关系

表 1: 一般商品交易关系与寻租-设租关系的差异

比较内容	商品交易关系	寻租-设租关系
交易领域	存在于经济市场	存在于政治市场
交易方式	公开的竞价交易	隐蔽的幕后交易
交易性质	合法的交易	非法的交易
交易后果	增进社会福利	浪费社会资源

寻租治理

以 W 和 B 分别表示官员的薪水和设租收益，则设租者的私人收益可以表示为 $W + B$ 。如果设租活动受到查出的概率为 P ，则反设租的前提条件为：

$$W > (1 - P)(W + B).$$

如果设租活动受到查处，不但设租利益被剥夺，而且要给设租者降职降薪。以 W_0 表示降职前的薪水，以 W_1 表示降职后的薪水，则反设租的条件是：

$$W_0 > (1 - P)(W_0 + B) + W_1 P.$$

如果进一步对设租者处以罚款和监禁，还要受到舆论的谴责或社会的歧视。以 M 代表惩罚损失，则反设租的条件是：

$$W_0 > (1 - P)(W_0 + B) + W_1 P - MP.$$

寻租治理

- (腐败旋转门) 当 W_0 和 M 给定时, W_1 越大, 即设租者越容易在其他位置上找到工作, 并且获得合法或者不合法的收入, 则设租的私人成本越小;
- (高薪养廉) 当 M 和 W_1 一定时, W_0 越大, 说明当前薪水越高, 设租所面临的机会成本也越大;
- (高压反腐) 当 W_0 和 W_1 一定时, M 越大, 说明社会道德规范对设租的惩处越严厉, 设租成本越高。