

И.В. Савчик, студент.

Н.П. Драгун, доцент кафедры менеджмента,
Гомельского государственного технического университета
им. П.О. Сухого

Антимонопольное регулирование – важнейшая составная часть экономической политики государства во всех странах с развитой рыночной экономикой. Антимонопольное регулирование требует выявления, прежде всего тех отраслей, где вероятность сговора выше. В этой связи возникает задача оценки такой вероятности. Рассмотрим дуополистический рынок однородных продуктов, на котором фирмы одновременно устанавливают цены, а предельные издержки постоянны (т.е. ограничения по мощности отсутствуют). Если бы фирмы установили свои цены раз и навсегда, эта отрасль соответствовала бы модели Бертрана (равновесие достигалось бы при установлении обеими фирмами цен, равных предельным издержкам).

В более реалистичной модели должна быть предусмотрена возможность периодического изменения цен. Время делим на ряд периодов и предполагаем, что в каждом периоде фирмы одновременно устанавливают цены. Если одна фирма зная о том, что вторая фирма в каждом периоде будет самостоятельно приравнивать цену к предельным издержкам, то ее оптимальным ответом будет также приравнивание цены к предельным издержкам. Однако возможно существование иных состояний равновесия. Существуют случаи, когда фирмы применяют следующие жесткие стратегии. В первом периоде они обе устанавливают цену на монопольном уровне p^M и делят монопольную прибыль поровну ($1/2\pi^M$). В каждом следующем периоде, перед тем как установить свои собственные цены, фирмы изучают их прошлое. Если оказывается, что в прошлом все цены находились на монопольном уровне, т.е. если обе фирмы «не нарушали конвенцию», то каждая фирма устанавливает p^M в текущем периоде. В противном случае цена устанавливается на уровне предельных издержек.

Чтобы определить, достижимо ли при таких стратегиях равновесие, мы должны проверить, насколько существенны для фирм стимулы к неотклонению. Если обе фирмы следуют своим равновесным стратегиям, то ожидаемые дисконтированные выигрыши первой фирмы составят [1, с.134].

$$V = \frac{1}{2} \pi^M \cdot \frac{1}{1-\delta} \quad (1)$$

где δ – фактор дисконтирования.

Иногда возникает ситуация, когда фирма, устанавливая монопольную цену, не равную p^1 , то ее выигрыш в будущем составит ноль, т.к. обе фирмы тут же возвращаются к цене на уровне предельных издержек. Кроме того, выигрыши будущих периодов являются функцией не величины ценового отклонения, а вообще

его наличия, наилучшим ценовым отклонением для первой фирмы будет отклонение, которое максимизирует краткосрочную прибыль. Если первая фирма установит цену чуть ниже, чем вторая, то она получает весь спрос и совокупную прибыль. Отсюда следует, что выигрыш при оптимальном отклонении составляет $V' = n^M$ (краткосрочная прибыль плюс нулевая прибыль будущих периодов). Условие, при котором предложенные стратегии приводят к равновесию, — это $V > V'$.

$$\frac{1}{2} n^M \cdot \frac{1}{1-\delta} \geq n^M \quad (2)$$

Как правило, фактор дисконтирования колеблется от нуля до единицы. Существует несколько причин, по которым $\delta < 1$. Первая — это альтернативные издержки времени: в один период времени инвестор может использовать 1 д.е., для того чтобы получить $(1+r)$ д.е. в следующем периоде, где r — ставка процента за период. В этом случае δ равен [1, с. 134]:

$$\delta = \frac{1}{1+r} \quad (3)$$

В предыдущем уравнении ставка процента соответствует ставке за период между последовательно принимаемыми решениями. В частности, допустим, что r — годовая ставка, а фирмы меняют свои цены с частотой f (раз в год). Еще один важный фактор, который необходимо учитывать при расчете фактора дисконтирования, — это то, что выигрыша может не быть вовсе.

Учитывая факторы, влияющие на δ , формулу 2 можно интерпретировать следующим образом: цены, установленные на основе сговора, тем вероятнее будут равновесными, чем чаще фирмы взаимодействуют и чем больше вероятность выживания и роста отрасли. Например, что касается частоты изменения цены, легче возникнуть сговору между двумя заправочными станциями (устанавливают цены каждый день), чем между двумя летними курортами. Также сложнее будет договориться двум фармацевтическим фирмам на рынке медпрепаратов, где товары устаревают достаточно быстро, нежели фирмам на рынке цемента.

Библиографические ссылки

1. Кабраль, Луис М.Б. Организация отраслевых рынков: вводный курс / Луис М.Б. Кабраль; пер. с англ. А.Д. Шведа. — Мн.: Новое знание, 2003. — 356 с.
2. Хэй, Д. Теория организации промышленности: в 2 т./ Д.Хэй., Д.Моррис; пер. с англ. под ред. А.Г.Слуцкого. — СПб: Эконом.школа, 1999. — Т1. — 384с.