

Kockázat kezelése a tranzakciókban : optimum, méretgazdaságosság, egyensúly - egy játékelméleti modell

Kállay László

Budapesti Corvinus Egyetem

Kivonat

A tranzakciók megvalósítása során keletkezhet veszteség, aminek mértéke az aktorok veszteségsökkentésre irányuló erőfeszítésein múlik. Ezt a döntési problémát egy olyan játék modellezi, amelyben a veszteségmegosztási szabályon múlik, hogy az egyensúlynál a tranzakció megvalósításának költsége hogyan viszonyul a társadalmi optimumhoz. Definiálok a hatékony veszteségmegosztási szabály fogalmát és bemutatok egy veszteségmegosztási elvet, amelynek az alkalmazása hatékony veszteségmegosztási szabályt eredményez. A tranzakciók során valamelyik aktor törekedhet arra, hogy opportunistá magatartással szerezzen nyereséget a másiktól, aki próbálja ennek mértékét csökkenteni. Bemutatok egy játékot, amelyik modellezi ezt a döntési problémát.