Присвоение ренты и социальная разнородность

Никита Суслов,
Новосибирский государственный университет, Новосибирск

Социальная неоднородность, институты и экономическое развитие: опыт межстранового анализа

Никита Суслов,

Новосибирский государственный университет, Новосибирск

- Неоднородность (она же фрагментация, диверсифицированность, разнообразие): наличие групп, имеющих и/или осознающих свои отличия;
- Скорее культурное разнообразие. Две стороны:

  - многообразие культур, возможность взаимного обучения;

  - культурные различия: трудности во взаимопонимании, возможность конфликтов

Alberto Alesina & Eliana La Ferrara «ETHNIC DIVERSITY AND ECONOMIC PERFORMANCE», 2004

«Конфликт предпочтений, расизм, предубеждения часто приводят к действиям, которые оказываются суб-оптимальными с позиции общества в целом, к подавлению меньшинств, что может ***вызвать гражданские войны*** или, по крайней мере, ***разрушительные процессы, связанные*** с политической нестабильностью».

«Но этническое смешение также предоставляет ***разнообразие в возможностях***, накопленном опыте, культуре, что может оказаться производительным и обеспечивать ***инновации и созидание***. США есть впечатляющий пример такого “плавильного котла” расовых различий».

Литература

- Расовая и этно-лингвистическая фрагментация мешает развитию (Easterly and Levine, 1997; Collier and Gunning, 1999). *Трагедия сабсахариальной Африки: недостаток социального капитала, общественных благ, неадекватная политика*

- Демократия, бедность и фрагментация (Barbone, Cord, Hull and Sandefur, 2007; Brusco et al., 2002; Keefer and Khemani, 2005). *В бедных странах этническая фрагментация уменьшает выгоды от демократии*. С другой стороны, в условиях демократии *лучше представлены маргинальные сообщества, что ухудшает политику и качество институтов*

Литература

- Trade-off между степенью гетерогенности и размерами государств (Alesina & Spolaore, 2005, Desmet et. al. 2007a)
- Trade-off между продуктивными выгодами разнообразия и издержками коммуникации (Lazear, 1999 a, b; O'Reilly Williams and Barsade, 1997)
- Сегрегация этносов (компактное проживание) ухудшает качество экономической политики (Alesina and Zhuravskaya, 2008)
- Гетерогенность воздействует на налоговую систему Desmet et. al. 2007b, Alesina and La Ferrara, 2004)

Литература

- Фрагментация есть важный позитивный фактор, обеспечивающий гибкость реакции на глобальные вызовы (Alesina & Giavazzi , 2005)

- Двойственный характер фрагментации (Alesina and La Ferrara, 2004): разнообразие – фактор в производственной функции, отчуждение воздействует на уровне предпочтений

Модель издержек и выгод диверсификации (Alesina and La Ferrara, 2004)

$$\max \{N \cdot [u(c) + v(g, K)\}, \qquad v_K<0$$

$$N \cdot c + g = N \cdot f(x, K)$$

$$g = t \cdot N \cdot f(x, K) \qquad f_{xK}>0$$

где g – общественное благо, c – частное благо, x – затраты фактора, N – число членов сообщества, K – количество групп, t – налоговая ставка

Выводы анализа модели:

- Большая фрагментация может вести к росту продуктивности и частного потребления, но связана с уменьшением налогообложения и сокращением производства общественных благ

- Рост индивидуального дохода увеличивает выгоды от разнообразия и содействует большей фрагментации

- Трейд-офф между выгодами от фрагментации и издержками использования коммуникаций ведет к тому, что большие страны более диверсифицированы. Но этот вывод верен при ограничениях на внешнюю торговлю

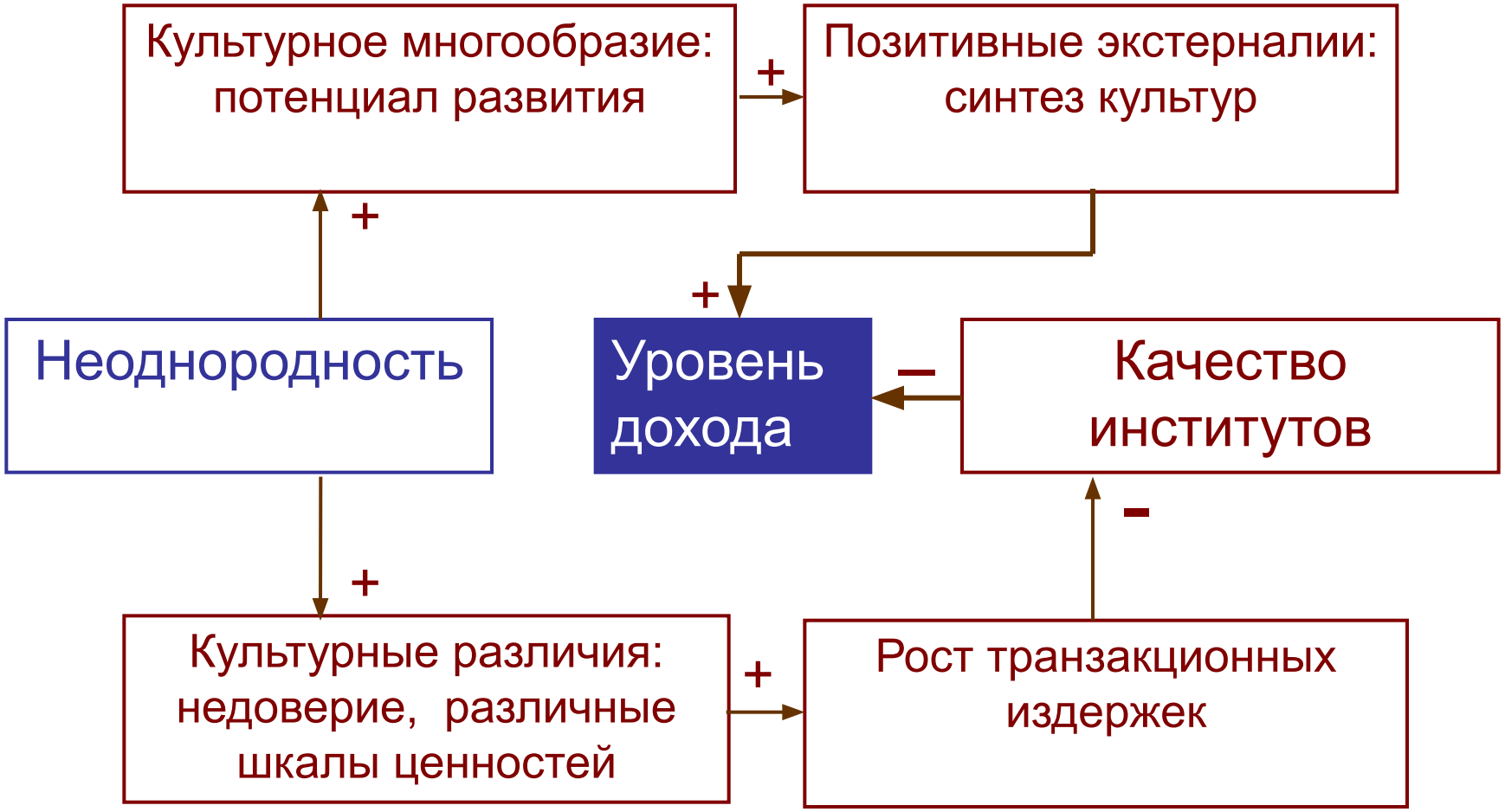
Качество экономических институтов:

совокупность условий, воздействующих на поведение агентов, и способствующих или не способствующих достижению Парето-эффективного состояния экономической системы.

«Хорошие» институты: минимизация транзакционных издержек и эффективный менеджмент; стимулируют инвестиционную активность

«Плохие» институты: поведение агентов искажается, и они принимают решения, которые (сильно) отклоняют систему от Парето-эффективного состояния.

Гипотеза: двойственность воздействия неоднородности на экономическое развитие



Анализ имеющихся данных: этнические, лингвистические и религиозные различия для больших выборок (Alesina, Devleeschauwer, Easterly, Kurlat and Wacziarg, 2002)

Индекс Этнолингвистической фрагментации: вероятность того, что двое случайно выбранных агента окажутся из разных групп:

$$ELF = 1 - \Sigma(s_k)^2$$

В каждой спецификации для Индекса роста, уровня дохода и индексов качества институтов из двух переменных фрагментации одна имеет положительный коэффициент, а другая - отрицательный

Table 15 – Country Examples of Ethnic Fractionalization, Growth and Government Quality

Country	Aver. growth in 1980s	Aver. black market premium in 1980s	Aver. Years of School.of Labor Force, 1980s	Teleph. lines per 1000 workers, 1980s	Govern. Balance to GDP, 1980s	Corrup. (0 to 10) Higher means less corruption	Ethnic fractionalization
Africa							
Botswana	7.0%	16%	3.3	27	11.2%	6.5	0.410
Ethiopia	0.0%	76%		4	-7.1%	4.3	0.724
Nigeria	-3.3%	76%		2	0.3%	3.0	0.851
Latin America							
Bolivia	-3.3%	39%	5.0	46	-14.4%	2.8	0.74
Chili	1.9%	16%	7.0	84	-0.2%	5.3	0.19
Gayana	-2.4%	131%	7.6		-39.7%	2.0	0.62

Source: Alesina et al., Fractionalization, NBER Working Paper 9411 http://www.nber.org/papers/w9411, December 2002

Борьба за ренту

- Институциональная система = «Социальный гудвилл» - есть результат взаимодействия групп
- Борьба за ренту со стороны групп – борьба за приспособление институтов под свои интересы (Acemoglu, Johnson and Robinson, 2005; Полищук, 2008)
- Таким образом, институциональная система =«Рента»
- Количественная сторона Ренты пропорциональна полезной деятельности групп
- Количественная сторона Ренты тем меньше, чем больше объем деятельности, направленной на борьбу за ренту
- Возможность борьбы за ренту ведет к усилению конкурентной борьбы и в смысле позитивной деятельности

Много различных групп: созидательная деятельность и борьба за ренту

Предположения:

- В обществе имеется K различных групп, ощущающих свою обособленность (идентифицирующих себя).
- Размер группы k есть l_k, при этом $s_k = l_k/L$, где L есть общая численность населения
- Каждая группа k осуществляет созидательную деятельность y_k и деятельность, направленную на борьбу за ренту x_k
- Побочный эффект созидательной деятельности групп – создание «goodwill» - ценности, осязаемой на уровне обществом в целом R
- Распределение R между группами осуществляется как результат борьбы за ренту

Модель выбора усилий

$$\max_{x_k,\ y_k} \{ p_k \cdot a \cdot [l_k \cdot y_k] + s_k . u_k \cdot R \cdot \sigma_k - l_k \cdot y_k - l_k \cdot x_k)\},\ k=1, \ldots, K$$

$$x_k \geq 0,\ y_k \geq 0\ k=1, \ldots, K,$$

где

$$\sigma_k = l_k \cdot x_k / (\sum l_j \cdot x_j),\ k=1, \ldots, K$$

$$R = R(y_1, \ldots y_n)$$

x_k, y_k - индивидуальные усилия члена группы k,
u_k - индекс идентификации одного члена группы k,
R - «goodwill»=«рента»,
σ_k - доля группы k в общих усилиях на борьбу за ренту,
p_k - цена продукта, доставляемого группой k.

Долгосрочные экстерналии:

$$a=a(A-D),\ a_{(A-D)}>0,\ \text{и}\ R=R(D),\ R_D<0$$

РЕШЕНИЕ

- Общие усилия на борьбу за ренту:

$$X = \sum I_j \cdot x_j = X(D, [A-D]),\ X_D>0,\ X_{[A-D]}>0$$

- Объем ренты:

$$R=R(D, [A-D]),\ R_D<0,\ R_{[A-D]}>0$$

- Объем выпуска:

$$Q= Q(D, [A-D]),\ Q_D<0,\ Q_{[A-D]}>0$$

- ***Индекс неоднородности:***

$$A=\Sigma u_k \cdot s_k$$

- ***Индекс диверсификации:***

$$D= K\cdot(K_1-1)/(\sum(1/[s_k\cdot u_k])$$

s_k - доля группы k в численности населения
K_1 – число участвующих групп

Индекс разнообразия: [A-D]

Гипотеза об u_k:

$$u_k=\sum_{j=1\ldots K} \tau_{kj} \cdot (s_k)^{\alpha} \cdot s_j$$

τ_{kj} – расстояние между группами k и j
α – измеряет ощущение единения внутри группы

Индекс отчуждения (***Esteban and Ray, 1994, Desmet, K., Ortuno-Ortin, I. and Weber, S.,*** 2007)

$$A(\alpha,T)=\sum_{k=1\ldots K} \sum_{j=1\ldots K} \tau_{kj} \cdot (s_k)^{1+\alpha} \cdot s_j$$

$$T=\{\tau_{kj}\}$$

Очень часто: $\tau_{kj}=1$, если $k\neq j$ и $\tau_{kk}=0$. Тогда если $\alpha=0$, то $A(\alpha,T)$ - этнолингвистической фрагментации, если $\alpha=1$, то $A(\alpha,T)$ – индекс поляризации

Анализ модели:

1. Общие усилия, направленные на борьбу за ренту, тем сильнее, чем выше гетерогенность
2. «Goodwill» и выпуск тем выше, чем выше разнообразие в обществе
3. В долгосрочной перспективе рост гетерогенности сильнее сказывается на усилиях, направляемых на борьбу за ренту, по сравнению с усилиями, направляемыми на созидательную деятельность
4. То, как рост гетерогенности сказывается на полезном выпуске, зависит от соотношения интенсивностей негативных и позитивных экстерналий
5. В краткосрочной перспективе негативное воздействие гетерогенности более вероятно

Эмпирический анализ: воздействие религиозной структуры общества на качество институтов

- Различия между религиями представляют культурные различия.
- Степень однородности в религиозной сфере в данном обществе есть мера степени его культурной однородности.
- Эмпирическая база – проект «Perceptions of Life, Family and Religion and Moral», ответы на 430 вопросов о различных сферах жизни в примерно 100 странах в разные периоды времени (www (www. (www.worldvaluessurvey (www.worldvaluessurvey. (www.worldvaluessurvey.org);
- Вопрос: «К какой религиозной конфессии вы принадлежите?»
- Сформировано 10 групп религий, среди них 4 христианских, иудаисты, буддисты, ислам, индуисты, атеисты и прочие;
- Индексы качества институтов взяты для 2000 г.

Эмпирический анализ: воздействие религиозной структуры общества на качество институтов

- Опросы – в 90-е годы XX века;
- предположение о коэффициентах идентификации u_k :

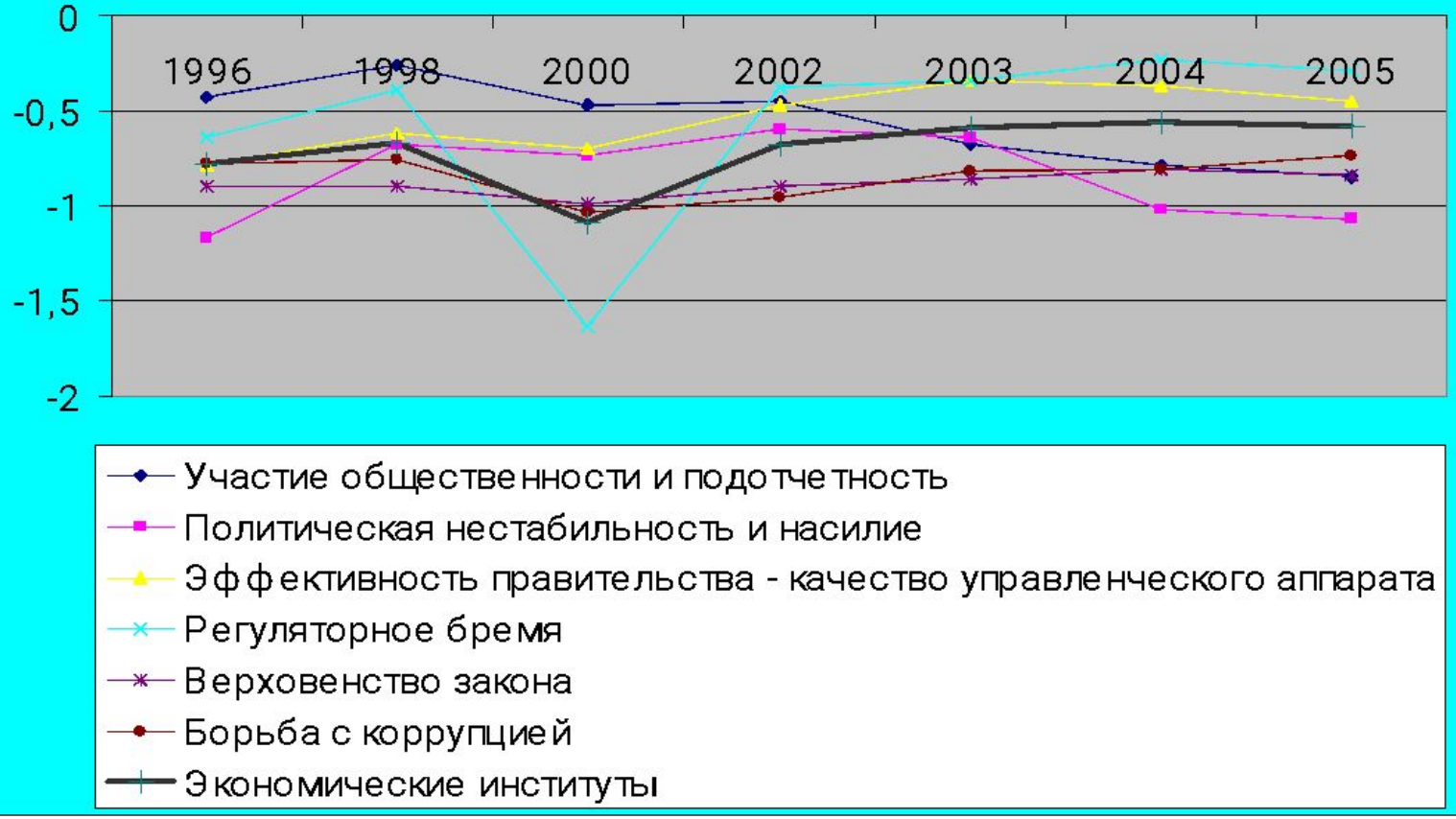
1) Либо α=1: $u_k = s_k \cdot (1-s_k)$ – индекс поляризации

2) Либо α=0: $u_k = (1-s_k)$ – *индекс этнолингвистической фрагментации*

Индексы качества экономических институтов (Мировой Банк)

- ***VA -*** (Voice and Accountability -Участие общественности и подотчетность) - мера возможности для населения участвовать в выборах своего правительства.
- ***PS -*** (Political Instability and Violence - Политическая нестабильность и насилие) - мера возможности дестабилизации функционирования или неконституционного устранения существующего правительства.
- ***GE -*** (Government Effectiveness - Эффективность управления) - качество управленческого аппарата, способность правительства достигать поставленных целей.
- ***RQ*** - (Regulatory Quality – Качество регулирования) - мера не использования нерыночного вмешательства в экономику со стороны правительства.
- ***RL -*** (Rule of Law - Верховенство закона)- учитывает уверенность экономических агентов в то, что имеющиеся правила в экономике будут соблюдаться, а контракты - поддерживаться.
- ***CC*** (Control of Corruption - Борьба с коррупцией) - мера оценки агентами коррумпированности данной экономики.

Измерение динамики институционального развития в России



Измерение человеческого капитала:

ALTINOK, N and MURSELI, «H. International Database on Human Capital Quality»

- 105 стран, включая Армению, Молдову, Россию, Украину
- Мера качества человеческого капитала для периода 1964-2005,
- Основа – накопленное образование и результаты тестов

Оценка системы уравнений, Трехшаговый метод оценки, 56 наблюдений (индекс поляризации)

	Верховен. Закона, 2000	*ln* [Инв/ВВП], 2001-06	*ln* [Темп роста ВВП] за 2001-06
Константа	**.65** (Z-V=5.2)	**3.24** (Z-V=46.6)	**-.69** (Z-V=-1.7)
ln [Инв/ВВП]			**.34** (Z-V=2.5)
[A-D]		**-5.43** (Z-V=-3.9)	
*[A-D]*HC*		**.06** (Z-V=3.7)	
*[A-D]*KILL,*	**-.22** (Z-V=-4.3)		
INI, 2000		**-.20** (Z-V=-2.4)	**-.46** (Z-V=-3.4)
*RL*INI*, 2000			**.13** (Z-V=2.2)
Струкурная переменная	**1.85** (Z-V=4.8)		
"R-sq"	**0.44**	**0.22**	**0.44**

*

Popov, V., Why the West Became Rich before China and Why China Has Been Catching Up with the West since 1949: Another Explanation of the “Great Divergence” and “Great Convergence” Stories, *Working Paper No. 132 CEFIR/ES Working Paper series October 2009*

- *Ломка институциональных систем = снижение качества институтов надолго*
- *Запад: смена модели роста – XVII-XIX вв.*
- *Черная Африка и Латинская Америка – рабство или колониальная зависимость*
- *Восточная Европа и Балтия – социалистический лагерь*
- *СНГ – двойная ломка институтов*

Эластичности темпов прироста ВВП от индексов неоднородности

	Количество экономик в группе	Рассчитано с использованием		Число убийств на 100 тыс. чел.
		Индекса поляризации	Индекса ELF	
Арабские страны	4	-0,10	-0,04	1,81
Западная Европа	18	-0,50	-0,06	1,37
АТР	9	-0,36	-0,11	2,84
Восточная Европа и Балтия	11	-0,55	-0,41	3,19
Мир в среднем		-1,22	-0,88	8,65
СНГ	4	-1,63	-1,26	10,84
Северная Америка	3	-1,81	-1,41	6,15
Латинская Америка	7	-3,94	-3,07	23,31
Россия		-4,86	-3,82	29,70
Черная Африка	3	-4,59	-5,06	23,31
Бразилия		-8,12	-6,78	30,80
Южная Африка		-7,20	-8,04	39,50

ВЫВОДЫ:

- двойственное воздействие неоднородности на показатели роста диагностируется как через посредство институтов, так и непосредственно
- большая неоднородность означает худшее качество
- краткосрочный экономический рост в 2000х гг. при прочих равных был ниже там, где социальная неоднородность была выше

СПАСИБО ЗА ВНИМАНИЕ!

Модель выбора усилий: цены

Функции спроса на продукты групп:

$$q_k = s_k \cdot a \cdot [1 - a \cdot p_k]^{(1/\beta)}$$

q_k – продукт группы k.

Appendix

Коэффициенты парной корреляции между индексами качества институтов и долями групп отдельных религиозных конфессий (групп конфессий) в общем населении стран (75 наблюдений)

	VA	PS	GE	RQ	RL	CC
Протестанты	0.449	0.356	0.502	0.407	0.487	0.515
Католики	0.308	0.165	0.134	0.207	0.090	0.112
Православные	-0.184	-0.075	-0.302	-0.213	-0.276	-0.294
Прочие Христиане	-0.029	-0.022	-0.022	0.006	-0.031	0.002
Мусульмане	-0.551	-0.483	-0.423	-0.473	-0.370	-0.391
Иудеи	0.023	-0.208	0.062	0.057	0.057	0.057
Буддисты	0.003	0.165	0.164	0.119	0.154	0.135
Индуисты	-0.016	-0.146	-0.074	-0.117	-0.052	-0.090
Атеисты	0.082	0.309	0.161	0.164	0.147	0.126
Прочие	-0.156	-0.011	0.015	-0.078	-0.013	-0.003