

## ОПЫТ ЗАРУБЕЖНОЙ МОДЕРНИЗАЦИИ

*А.С. АХРЕМЕНКО,*

*А.П. ПЕТРОВ,*

*Е.А. ЮРЕСКУЛ*

### **Барьеры институционального развития в Европе: продуктивность экономики, социальное доверие и политический капитал\***

В статье рассматривается проблема институционального развития в странах Центральной и Восточной Европы. Авторы анализируют существующие подходы к объяснению причин и факторов институционального развития и стремятся выявить причины отсутствия конвергенции институтов в европейских странах в период с 1990 по 2014 г. Рассматриваются теоретические и методологические ограничения подходов к анализу институционального развития, характерных для мейнстрима современной политической науки. В ходе эмпирического анализа используется широкий набор количественных переменных, измеряющих уровни достигнутого институционального развития, показателей социального доверия и политического капитала. Авторы также применяют собственные оценки совокупной производительности факторов производства (*Total Factor Productivity, TFP*), полученные непараметрическими методами на основе статистических данных. Взаимосвязи между переменными анализируются с помощью корреляционного, регрессионного и кластерного анализа. По результатам статистического анализа выявляется механизм влияния *TFP* на институциональное развитие: результаты показывают, что высокий уровень *TFP* – необходимая предпосылка для институциональных трансформаций.

**Ключевые слова:** совокупная производительность факторов производства, институциональное развитие, социальное доверие, политический капитал, социальный капитал.

---

\* Исследование выполнено в рамках программы фундаментальных исследований Национального исследовательского университета “Высшая школа экономики”, проект Т3-37 “Экономическая эффективность и эволюция политических режимов: теоретическая модель взаимосвязи, кросс-страновой и динамический анализ”.

*Ахременко Андрей Сергеевич* – доктор политических наук, профессор департамента политической науки факультета социальных наук Национального исследовательского университета “Высшая школа экономики”. Адрес: 101000, Москва, Мясницкая ул., д. 20. E-mail: aakhremenko@hse.ru

*Петров Александр Плоун Чжо* – доктор физико-математических наук, ведущий научный сотрудник Института прикладной математики имени М. В. Келдыша РАН. Адрес: 125047, Москва, Миусская пл., д. 4. E-mail: petrov.alexander.p@yandex.ru

*Юрескул Егор Анатольевич* – кандидат политических наук, преподаватель департамента политической науки факультета социальных наук Национального исследовательского университета “Высшая школа экономики”. Адрес: 101000, Москва, Мясницкая ул., д. 20. E-mail: eyureskul@hse.ru

Тот факт, что страны Европы<sup>1</sup> находятся на разных ступенях институционально-го развития, демонстрируя широкую вариацию в качестве институтов, не нуждается в специальном обосновании. Достаточно сравнить, например, Норвегию и Молдову по уровню защищенности прав собственности, качеству государственного управле-ния или распространенности коррупционных практик. Значительно менее очевиден другой факт: наличие труднопреодолимых барьеров, стоящих на пути улучшения качества институтов теми странами, которые находятся в положении “отстающих” и “догоняющих”. Этот факт можно проиллюстрировать простым приемом описатель-ной статистики, построив гистограмму распределения европейских стран по эфек-тивности государственных институтов в оценке, например, Всемирного банка за пе-риод с 1996 по 2014 г. (см. рис. 1; здесь главное – не названия конкретных стран, а “ар-хитектура” различий между ними).

Сразу бросается в глаза отчетливая неоднородность этой совокупности: можно без труда выделить три группы (кластера) наблюдений, характеризующихся сравнитель-но низким, средним и высоким уровнем развития институтов. Аналогичные струк-туры можно наблюдать и для других институциональных индикаторов. Здесь очень важно подчеркнуть, что совокупность наблюдений распределения на рисунке 1 не только пространственная (страны), но пространственно-временна́я (страны – годы). В эмпирической части этой работы мы ясно покажем не только само наличие неодно-родностей в качестве институтов, но и почти полное отсутствие позитивной институ-циональной динамики – переходов государств из одной группы институционального развития в другую за более чем 20-летний период.

Хотя слабость “конвергенции институтов” в мировом масштабе широко призна-ется современными теоретиками неоинституционального направления [Savoia, Sen 2016], обычно речь идет о таких регионах, как Африка южнее Сахары или Полинезия. Эти регионы обладают очень выраженной спецификой исторического развития, про-слеживаемой еще со времен неолитической аграрной революции [Diamond 1997]. Но внутри Европы не существует таких масштабных различий. Почему же тогда мы на-блюдаем столь отчетливые и столь труднопреодолимые барьеры институционального

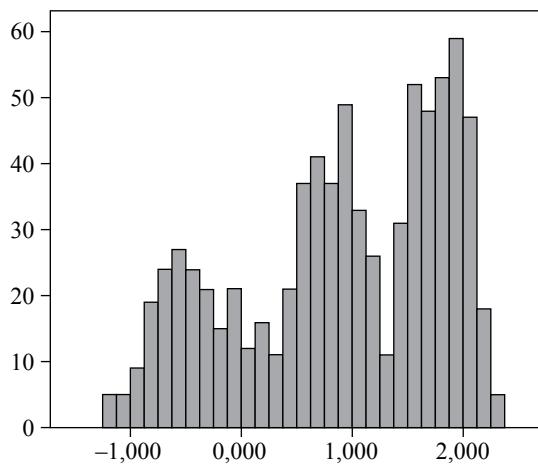


Рис. 1. Распределение европейских стран по эффективности государственных институтов (про-ект [Worldwide Governance Indicators]).

<sup>1</sup> В исследовании рассматриваются: Австрия, Албания, Беларусь, Бельгия, Болгария, Босния и Гер-цеговина, Великобритания, Венгрия, Германия, Греция, Дания, Ирландия, Исландия, Испания, Италия, Кипр, Латвия, Литва, Люксембург, Молдова, Нидерланды, Норвегия, Польша, Португалия, Россия, Румы-ния, Сербия, Словакия, Словения, Украина, Финляндия, Франция, Чехия, Швейцария, Швеция, Эстония.

развития? “Лежащие на поверхности” ответы (например, фактор принадлежности к ЕС) фундаментального объяснения этому феномену не дают. Так, членов ЕС можно увидеть и в “отстающем” (Болгария, Румыния), и в “догоняющем” (Чехия, Испания, Италия) кластерах. В то же время в кластере институционально развитых стран есть государства, не входящие в ЕС (Норвегия или Швейцария). Данная работа – попытка дать более теоретически сложный и эмпирически обоснованный ответ на вопрос о барьерах развития в Европе.

### Факторы институционального развития

“Институты имеют значение” – этот знаменитый тезис Д. Норта стал программным для современного поколения неоинституциональных экономистов и политологов. На сегодняшний день почти никто не сомневается, что качество институтов имеет огромное влияние на экономическое и социальное развитие; по этой теме накоплена гигантская литература, особенно в части воздействия институтов на экономический рост. Каузальность в связке “институты – экономический рост” хорошо объясняется с точки зрения ключевых положений неоинституциональной теории. В основе объяснения лежит теорема Р. Коуза: при нулевых трансакционных издержках любые внешние эффекты могут быть интернализированы [Acemoglu 2003; Galiani, Torrens, Yanguas 2014]. Для политической сферы это означает, что процесс перераспределения общественных ресурсов может быть “настроен” таким образом, чтобы все участники этого процесса получили максимальную прибыль [Acemoglu, Robinson, Johnson 2005]. “Качественные” институты, в свою очередь, снижают трансакционные издержки: защита прав собственности и гарантии выполнения контрактов мотивируют экономических агентов иметь более широкие горизонты планирования [Kaasa 2016]; ограничение коррупции, в свою очередь, сдерживает рентоориентированное поведение [North 1993]. Эта теоретическая схема получила неплохое подтверждение в эмпирических исследованиях [Yao, Watanabe, Li 2009; Bilenko 2013].

Но что обуславливает уровень качества институтов, какие факторы детерминируют процесс институционального развития? Здесь разногласий среди ученых существенно больше, и в целом эта проблема разработана в научной литературе значительно хуже по сравнению с мейнстримом “*institutions matter*”. Тем не менее на сегодняшний день можно выделить несколько крупных интеллектуальных традиций. Это прежде всего “историческая” традиция (подход исторического институционализма). Проведенные в этом ключе исследования опираются, как правило, на методологию *process tracing* (прослеживание процессов): ученые стремятся выявить ключевые исторические события, послужившие причиной формирования тех или иных институциональных систем, которые, в свою очередь, стали основанием для той или иной траектории экономического развития.

В рамках данного подхода показано, что исходные институциональные установления имеют долгосрочное влияние как на институциональное, так и на экономическое развитие государств, в полной мере демонстрируя эффект *path dependence* – зависимость от траектории предшествующего развития [Acemoglu, Johnson, Robinson 2001]. Для исследований данного типа характерен следующий объяснительный механизм: исходные институциональные установления (как правило, связанные с историческими предпосылками формирования государств: к примеру, наследие британского колониализма или наличие природных ресурсов) либо способствуют, либо препятствуют определенным типам поведения. Это может быть, например, стремление получать ренту или желание вести бизнес [Engermann, Sokoloff 1994]. Закрепленные таким образом поведенческие паттерны ведут, в свою очередь, к появлению новых институтов, способствующих тем же типам поведения. Важный тезис подобных работ – основополагающая роль институтов в формировании “троп зависимости”, а сами исходные институты образуются в результате действия случайных исторических факторов – таких, как распределение общественных ресурсов в результате работы правовой системы

[*Djankov, Glaeser, La Porta, Lopez-de-Silanes, Shleifer 2003*] или сочетание организации экономики с коалициями экономических агентов [*Moore 1966*].

Для стран Европы примером может служить исследование Р. Ла Порты и его коллег [*La Porta, Lopez-de-Silanes, Shleifer 2008*], посвященное анализу правовых традиций в европейских странах и влиянию системы права на работу государственных (в том числе – экономических) институтов. В нем с помощью историко-правового анализа прослеживаются каузальные механизмы влияния системы права на возникновение тех или иных формальных институтов, которые, в свою очередь, послужили факторами формирования привычных черт развитой институциональной системы. К примеру, в разных системах права отличаются взгляды на независимость судов – основополагающего фактора защиты прав собственности.

Тем не менее в ряде исследований рассматривается альтернативный подход: ученые указывают на взаимозависимость институтов с другими факторами развития. К примеру, К. Соколофф и С. Энгерманн отмечают, что исходная обеспеченность европейских колоний в Латинской Америке природными ресурсами мотивировала политические системы этих государств сохранять закрытость и поддерживать имущество неравенство: проще было получать ресурсную ренту. Колонии же в Северной Америке не располагали широкими возможностями для добычи ресурсов, а более суровые природные условия обеспечили необходимость повышения производительности через справедливое распределение средств и соблюдение права собственности [*Sokoloff, Engermann 2000*].

Историко-институциональная школа породила ряд важных открытий и заслуженно принадлежит к “мейнстриму” современных исследований в области институционального развития. Однако для задач настоящей работы эта методология имеет существенные ограничения. Так, исторический институционализм ориентирован или на сравнительные исследования политических систем количественными методами, или на глубинные кейс-стади. В первом случае необходимость формирования большой выборки приводит к сравнению крайне разнородных систем; во втором очень трудно обобщать полученные результаты. Кроме того, стремясь выявить причины экономической и политической дивергенции государств, авторы крайне незначительное внимание уделяют прикладным вопросам. В работах отсутствуют рекомендации по преодолению институциональных барьеров; результаты показывают, как прошлое влияет на настоящее, но механизмы политических изменений, приводящих к эффективным общественным системам, остаются за рамками исследований.

Тем не менее анализ “институциональной истории” именно для Европы может оказаться важным. Хотя бы потому, что развитие институтов во второй половине XX в. зависело напрямую от принадлежности к тому или иному “лагерю” (СССР, страны “народной демократии” и др.). В данном контексте интерес представляет работа [*Gerring, Bond, Barndt, Moreno 2005*], использующая более сложную методологию. Ключевое ее предположение – кумулятивный характер институциональных изменений: институты рассматриваются не как “мгновенный снимок” существующих в обществе формальных правил, а как комплекс отношений, правил и гражданских навыков, складывавшийся на протяжении многих лет. Институциональное развитие, таким образом, происходит в процессе накопления так называемого политического капитала (*political capital*).

Один из характерных механизмов его накопления – “самообучение” граждан (*learning*). Требуется, чтобы не только правительство умело отличать успешный курс от провального; необходимо также, чтобы этой способностью обладали граждане. Чтобы долгосрочно поддерживать эффективный курс против популизма с его обещанием мгновенного улучшения за счет (не афишируемых) проблем в будущем, требуется негативный опыт, связанный с последствиями прихода к власти популистов. Но и политическим элитам требуется опыт разрешения конфликтных ситуаций в рамках определенных “правил игры”, а не только факт наличия таких правил. Этот аспект накопления политического капитала и называется собственно “институционализацией”

(*institutionalization*). Оба механизма работают только в рамках демократических режимов, и политический капитал можно рассматривать как длительность непрерывного развития общества в условиях демократии. Европейские страны (даже западные) существенно различаются по этому показателю, и в эмпирической части работы мы исследуем влияние политического капитала на уровень качества институтов в Европе.

Другая традиция связывает уровень качества институтов с накопленным в обществе социальным капиталом. Это понятие прочно вошло в концептуальный багаж общественных наук в 1990-е гг. после появления фундаментальных работ [Coleman 1988; Putnam 1994; Fukuyama 1995; Knack, Keefer 1998]. С тех пор объем научной литературы по этой проблематике вырос на порядки<sup>2</sup>.

Из многочисленных классификаций и типологизаций социального капитала для рассматриваемой нами проблематики имеет значение прежде всего его основополагающее деление на структурный (сетевой) и когнитивный (ценностно-нормативный). Первый тип связан с участием в горизонтальных организациях; второй – с ценностями и установками, среди которых ключевую роль играет социальное доверие (*social trust*). Сетевой социальный капитал содействует улучшению качества институтов посредством облегчения доступа к информации, лучшей координации и контроля, в том числе за деятельность государства [Burt 1992]. Но еще больше способствует институциональному развитию социальное доверие: оно сокращает трансакционные издержки за счет “достройки” формальных институтов неформальными. Как отмечает Ф. Фукуяма, индивиды не нуждаются в “подробной контрактно-правовой регламентации их отношений, потому что существующий между ними моральный консенсус является базисом их взаимного доверия” [Fukuyama 1995, р. 53]. На эмпирическом уровне также фиксируется наличие корреляций между уровнем социального доверия, с одной стороны, и отсутствием коррупции и “беспристрастностью” (*impartialness*) государственных структур – с другой [Delhey, Newton 2005].

Социальное доверие обычно подразделяют на институциональное – доверие к формальным институтам и обеспечивающим их функционирование государственным структурам (например, к правоохранительной системе), и межличностное доверие. Значимость институционального доверия в данном контексте специальных пояснений не требует, а вот относительно межличностного доверия необходимо сделать одну важную оговорку. Чтобы выполнять фундаментальную функцию поддержки формальных институтов, межличностное доверие должно обладать особым свойством: способностью быть “связующим” (объединяющим, *bridging*). Такое социальное доверие “равномерно распределено” в обществе на практическом уровне, что выражается, в особенности, в доверии к незнакомым людям. В противовес “связующему” доверию, “связывающее” (*bonding*) доверие существует только внутри относительно малых, гомогенных групп (семья, религиозная община, этническая диаспора или организованная преступная группа и т.п.). Преобладание “связывающего” доверия над “связующим”<sup>3</sup> порождает дефекты институциональных систем, что отмечал еще Р. Патнэм применительно к южным регионам Италии. В данном исследовании мы сосредоточимся на зависимости качества институтов от межличностного доверия “связующего” типа и от институционального доверия в странах Европы.

Понятие производительности лежит в основе экономической науки: в самом общем случае это уровень выпуска на единицу затрат (*output per input unit*). Понятие общей производительности факторов производства (*Total Factor Productivity, TFP*) возникло в макроэкономике в начале XX в. как попытка объяснить “взрывной” экономический рост индустриальных государств, в первую очередь – США. *TFP* – комплексное понятие, отражающее экономический рост, не объясняемый увеличением факторов производства (в неоклассической экономике факторов производства два: труд

<sup>2</sup>Обзорные работы см. [Durlaufand, Fafchamps 2004; Adler, Kwon 2002; Tamaschke 2003; Woolcock 2010].

<sup>3</sup>Данная классификация в литературе часто применяется не только к межличностному доверию, но и по отношению к социальному капиталу в целом.

и капитал) [Solow 1956]. Названная учеными “мерой нашего незнания о производственной функции” общая производительность факторов включает в себя целый ряд параметров экономической системы, отвечающих за повышение производительности, и чисто экономических (уровень развития технологий, степень внедрения уже существующих технологий в процесс производства), а также связанных с управлением процессом. Среди последних – качество менеджмента, способность оптимально распределить ресурсы (факторы производства), степень владения работниками современными технологиями и оборудованием [Mahmood 2012]. На многочисленных эмпирических примерах (в том числе, на материалах европейских стран [Silaghi, Alexa 2015; Baran 2013]) показано, что чем выше *TFP*, тем активнее экономический рост государства. Учитывая комплексный характер понятия “совокупная производительность факторов производства”, можно говорить о том, что *TFP* способна выступать обобщенной мерой эффективности экономической системы.

Междисциплинарные работы, изучающие влияние социально-политических факторов на развитие экономики, указывают на положительный эффект политических институтов на общую производительность факторов (*TFP*). Традиционный для экономических исследований подход “больше *TFP* – больше экономического роста” трансформируется политической экономией в духе “исторического подхода”. В работе [Acemoglu, Gallego, Robinson 2014] показано, что и *TFP*, и экономический рост, и факторы экономического роста (такие, как человеческий и физический капитал) – взаимосвязанные понятия, среди которых невозможно выявить направление каузальности, поскольку все три переменные обозначают одно и то же – экономическое благосостояние. Авторы показывают, что институциональные условия, ведущие к наращиванию всех трех факторов, одинаковы. Объяснительный механизм лежит в русле неоинституционального подхода: политические правила (например, защита прав собственности или протекционистские политики) напрямую влияют на процесс перераспределения ресурсов в экономике и либо способствуют, либо препятствуют успеху высокотехнологичных организаций. Так, в условиях защищенности прав частной собственности более эффективные фирмы выходят на первый план, что ведет к более эффективному перераспределению ресурсов и общему росту *TFP*, а вслед за ним – и экономическому росту. Если же в обществе существуют политические правила, ограничивающие свободную конкуренцию (к примеру, коррупция, кумовство), то они выступают как дополнительная нагрузка на экономику и снижают ее общую производительность [Hall, Jones 1999].

Таким образом, большинство исследований связи между институтами и *TFP* (шире – экономической эффективностью) считают первые причиной, а вторую – следствием. Однако существует и другой подход, радикально иначе рассматривающий направление каузальности в этой паре. Здесь мы рискнем обратиться к нашим собственным работам, в которых строится и исследуется системно-динамическая модель производства и перераспределения ресурсов в различных институциональных условиях [Akhremenko, Petrov 2014]<sup>4</sup>.

В основе экономической части модели вполне традиционно лежит производственная функция с двумя факторами: частным и государственным капиталом. Последний понимается как общественное благо, “работающее” на систему в целом (например, объекты инфраструктуры или системы образования и здравоохранения). Произведенный выпуск облагается налогом, изъятые таким образом средства реинвестируются в государственный капитал, подверженный амортизации. Процесс инвестирования в государственный капитал характеризуется специальным параметром, определяющим, какая доля средств будет потрачена “целевым образом”, а какая уйдет на трансакции (например, поддержание аппарата распределения), рентные платежи и иные непроизводительные издержки. Ставка налога и эффективность государственных

<sup>4</sup> Можно также обратиться к нашим работам в журналах “ПОЛИС” (2016, № 6, с. 95–113) и “Политии” (2015, т. 3, № 78, с. 50–74).

инвестиций – “параметры политического курса” (*policy parameters*), они могут определяться внутри системы посредством специальных механизмов принятия решений. К таковым относятся, с одной стороны, борьба между группами интересов: “капиталистами”, максимизирующими частный капитал, и “рантье”, максимизирующими рентные платежи, получаемые с государственных инвестиций. С другой стороны, сравнивается механизм “ретроспективного голосования”, когда корректировка политического курса зависит от предшествующих экономических показателей системы (обратная связь), с “волонтиаристским” принятием решений, когда политический курс определяется случайной функцией и его корректировка не предусмотрена. Уровень общей эффективности *TFP* задается исследователем экзогенно.

В результате аналитического и численного исследования модели мы получили следующие основные результаты. Во-первых, высокий уровень *TFP* расширяет возможный набор политических курсов, ведущих к экономическому росту. При более низкой *TFP* лишь отдельные сочетания курсов ведут к росту благосостояния. При очень низкой *TFP* экономический рост невозможен. Таким образом, *TFP* обеспечивает экономическую устойчивость системы к выбору неоптимальных решений и, соответственно, выбору механизма принятия таких решений. Так как институты и представляют собой, в значительной степени, правила принятия решений, *TFP* повышает устойчивость системы к неоптимальным институтам.

Во-вторых, повышение *TFP* ведет к сближению позиций групп интересов. Более строго, в пространстве политических курсов (“ставка налога – ставка ренты от государственных инвестиций”) мы наблюдаем сокращение расстояния между идеальными точками групп интересов, определяемыми как точки с максимальными полезностями. Группы интересов уходят, таким образом, от “игры с нулевой суммой”, что создает предпосылки для социальной кооперации, выработки устойчивых соглашений по поводу “правил игры”. Другими словами, возникают предпосылки для формирования “хороших” институциональных равновесий.

В-третьих, с ростом *TFP* увеличивается способность политических систем с обратной связью поддерживать экономический рост. При низкой *TFP* “демократические” системы (основанные в нашей модели на ретроспективном голосовании) склонны отвергать политические курсы, ориентированные на экономический рост в долгосрочной перспективе, но приводящие к кратковременному снижению благосостояния. В системах без смены власти (авторитарные режимы) правительство, реализующее долгосрочный план развития, не рискует быть смещенным в результате потери электоральной поддержки. Напротив, в демократических системах с высокой *TFP* производительность экономики компенсирует краткосрочный негативный эффект политического курса, успешного в долгосрочной перспективе. Следовательно, высокий уровень экономической эффективности способствует лучшей экономической “выживаемости” демократий.

Означает ли сказанное выше, что рост *TFP* приводит к улучшению качества институтов, есть ли здесь жесткая причинно-следственная связь? В общем случае, нет; хотя бы потому, что рост *TFP* позволяет лучше работать экономике с любыми институтами (эффект “устойчивости к неоптимальности”). Создает ли рост *TFP* экономические предпосылки для улучшения качества институтов? Мы полагаем, что да. Система с более высокой *TFP* способна лучше поддерживать “хорошие” институты по сравнению с низкоэффективной системой.

Итак, в эмпирическом исследовании мы проверим гипотезы о влиянии четырех факторов на качество институтов в Европе:

- политического капитала как накопленного опыта демократического развития;
- межличностного доверия как составляющей социального капитала;
- институционального доверия как составляющей социального капитала;
- совокупной производительности факторов производства.

Из самых общих соображений очевидно, что мы столкнемся с проблемой “коллинеарности” – взаимного влияния независимых переменных.

## Переменные и данные

Для проверки гипотез о влиянии политического капитала, социального доверия и совокупной производительности факторов производства на качество (развитость) институтов в европейских странах необходимо прежде всего определить характеристики выборки и ввести измерения соответствующих переменных. В общем случае мы рассматриваем подавляющее большинство государств, географически относящихся к Европе, за временной период с 1991 до 2014 г. Выбор нижней границы интервала вполне очевиден: именно тогда новую государственность обретают страны бывшего СССР, а также происходят кардинальные трансформации политических режимов стран Центральной и Восточной Европы. Верхняя граница задана наличием необходимых данных.

Впрочем, проблема доступности данных актуальна и для 1990-х гг.; в наибольшей степени с точки зрения операционализации понятия “качество институтов”. Ряд авторитетных индексов институционального развития (например, Worldwide Governance Indicators, Transparency International) дают первые оценки с 1995–1996 гг., оставляя неожиженным важный период начала 1990-х гг. Поэтому мы были вынуждены построить два институциональных индикатора:

– *Institutions90-14*, охватывающий весь рассматриваемый отрезок времени, но рассчитанный на основе всего четырех доступных переменных: Legal Structure and Security of Property Rights Index Института Фрэйзера [Fraser...], Bayesian Corruption Index [Bayesian Corruption Index], Andrew Williams Transparency Index [Andrew Williams], а также Index of Political Corruption проекта “Varieties of Democracy” [VDEM]. В силу особенностей используемых данных, полученный показатель в большей степени отражает уровень коррупции/транспарентности (три исходных переменных из четырех), а также, в значительно меньшей степени, защищенность прав собственности (одна переменная). Индикатор *Institutions90-14* получен сверткой четырех указанных переменных в первую главную компоненту (83% общей вариации данных) методом факторного анализа;

– *Institutions96-14*, охватывающий период только с 1996 г., но зато основанный на значительно более разнообразных исходных данных. Он полноценно учитывает три традиционно представленных в литературе и исследованиях составляющих качества институтов: транспарентность и противодействие коррупции; защищенность прав собственности; качество государственного управления. В измерении транспарентности к уже использованным при расчете *Institutions90-14* трем переменным добавлены Corruption perceptions index, предоставляемый “Transparency International” [Transparency International], и Control of Corruption Index, входящий в Worldwide Governance Indicators Всемирного банка [Worldwide Governance Indicators]. Защищенность прав собственности, кроме индекса Института Фрэйзера, представлена показателем Property Rights в Индексе экономической свободы Фонда “Heritage” [Heritage Foundation], а также Rule of Law Index – составляющей Worldwide Governance Indicators. Для измерения качества государственного управления использованы еще три показателя: Quality of Government, рассчитанный в рамках проекта International Country Risk Guide (ICRG) [International Country Risk Guide], а также Government Effectiveness и Regulatory Quality, вновь из проекта Worldwide Governance Indicators. Как и в случае с первым индикатором, *Institutions96-14* получен с помощью факторного анализа (первая главная компонента, охватывающая 89% совокупной вариации данных).

Оценки качества институтов в различных измерениях, описанных выше, хорошо согласуются друг с другом. Об этом свидетельствуют, в частности, большие доли суммарной вариации, “захваченные” первыми главными компонентами, что бывает только при наличии сильных корреляций между исходными переменными. Тем не менее все указанные выше показатели являются результатами экспертного оценивания и могут, в принципе, содержать систематические смещения, отражающие стереотипы восприятия экспертного сообщества. Поэтому для дополнительной проверки

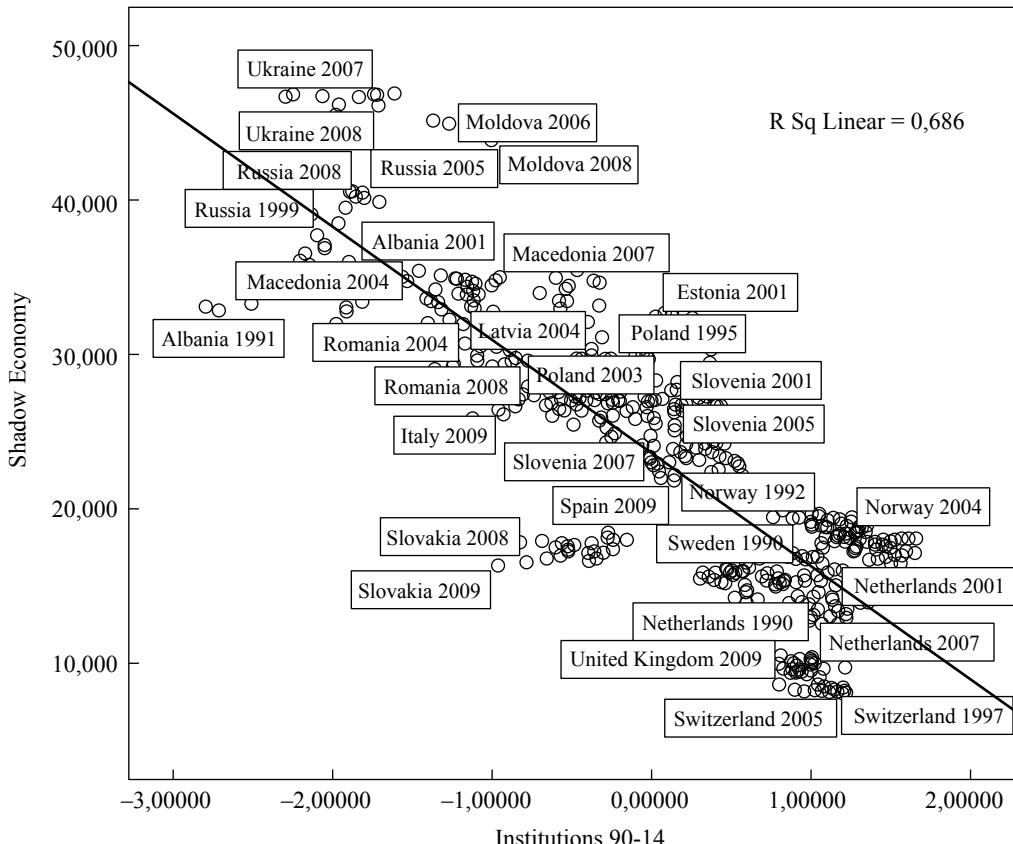


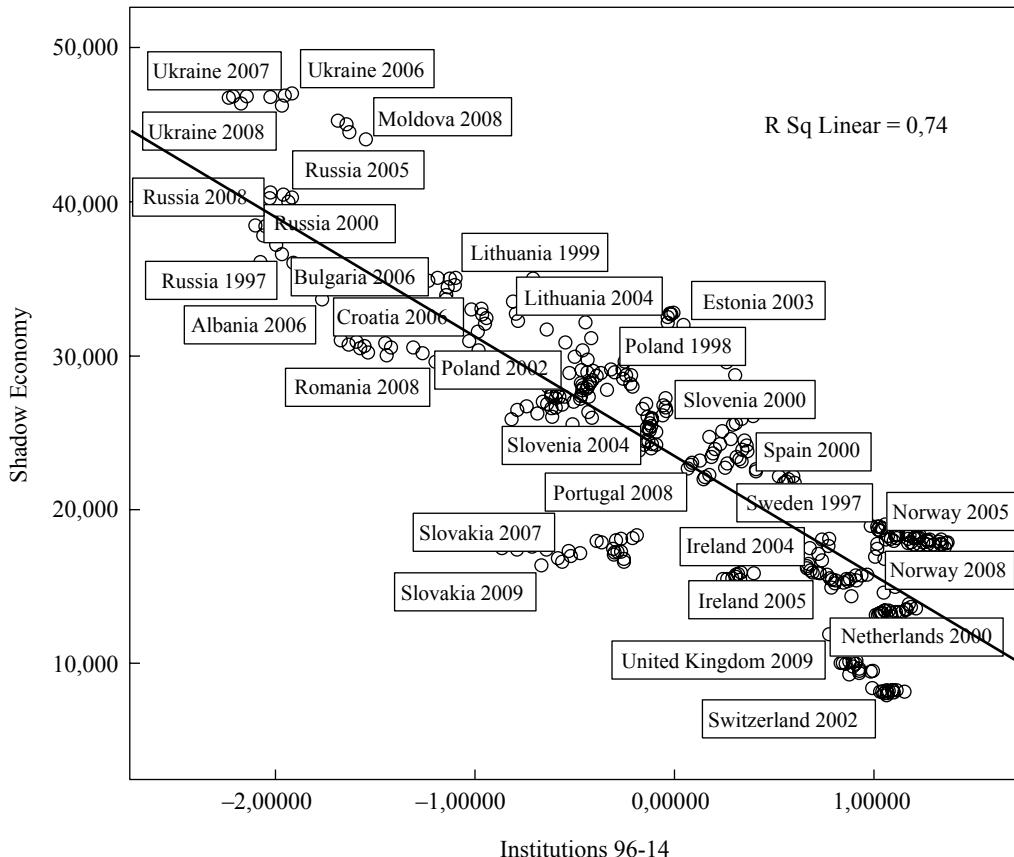
Рис. 2. Связь качества институтов с долей теневой экономики  
(простая мера качества институтов)

валидности полученных индикаторов мы используем переменную, содержательно связанную с качеством институтов и при этом полученную сугубо расчетным путем: долю теневой экономики *Shadow Economy* [Elgin, Oztunali, Oguz 2012]. Мы ожидаем, разумеется, что качество институтов и доля теневой экономики будут связаны сильно и отрицательно. Это и имеет место в действительности (см. рис. 2 и 3).

Для измерения политического капитала (*Political*) мы используем методику, предложенную в [Gerring, Bond, Barndt, Moreno 2005]. В качестве исходных данных берется переменная *polity2* (проект Polity IV [Polity IV]), обобщенно характеризующая политические режимы в странах мира с точки зрения демократических/авторитарных составляющих. Переменная принимает значения на интервале  $[-10, 10]$ , минимум соответствует “чистой” автократии, максимум – “чистой” демократии. Накопление политического капитала происходит по формуле:

$$Political(t + 1) = (1 - \delta)Political(t - 1) + Political(t), \quad (1)$$

где  $\delta$  – коэффициент обесценивания (амортизации); вслед за авторами методиками мы принимаем его равным 0,01. Уравнение (1) – почти полный аналог уравнения непрерывной инвентаризации для более традиционных типов капитала в экономике. Мы рассматриваем накопление политического капитала за последние 69 лет – с 1946 г. по 2014 г. включительно. Важно подчеркнуть, что жизнь в условиях политических режимов с доминирующими автократическими компонентами приводит к накоплению *отрицательного* политического капитала.



*Рис. 3. Связь качества институтов с долей теневой экономики  
(комплексная мера качества институтов).*

Уже на уровне описательной статистики – анализа распределения политического капитала хорошо видно, что эта переменная гораздо лучше структурирует страны Европы по сравнению с исходной – *polity2*. “Мгновенный снимок” ситуации с европейскими политическими режимами в 2013 г. (см. рис. 5) практически не обладает дифференцирующей способностью: мы наблюдаем полное господство “чистых” и близких к этому демократий, очень небольшое число гибридных режимов, тяготеющих к демократии, и единственную автократию – Беларусь. Картина на рисунке 4 совершенно иная: здесь имеет место бимодальное распределение, и лишь одна вершина приходится на развитые демократии, тогда как левая часть распределения представляет широкое разнообразие уровней политического капитала как с отрицательными, так и с положительными значениями.

Социальный капитал мы рассматриваем в данной работе, как было отмечено выше, через призму накопленного в обществе доверия. Вслед за сложившейся в научной литературе традицией и принимая во внимание фокус этого исследования, мы подразделяем социальное доверие на межличностное и институциональное, отражающее доверие к людям и доверие к институтам, соответственно.

Перейдем к операционализации межличностного доверия. На улучшение качества институтов, согласно теории, должно приоритетным образом влиять накопление “связующего” (*bridging*) социального капитала. В межличностном доверии оно отражается в склонности доверять людям в целом (в том числе и прежде всего незнакомым),

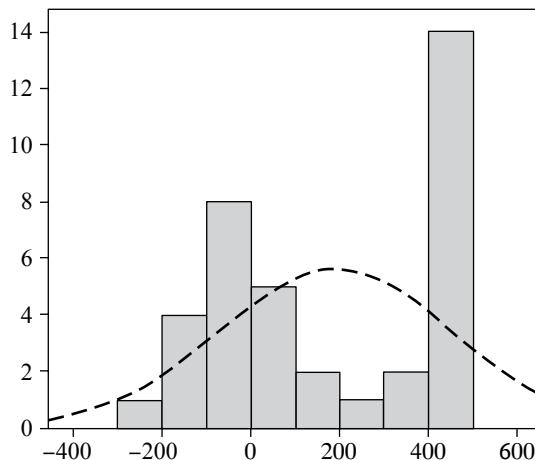


Рис. 4. Распределение политического капитала в Европе в 2013 г.

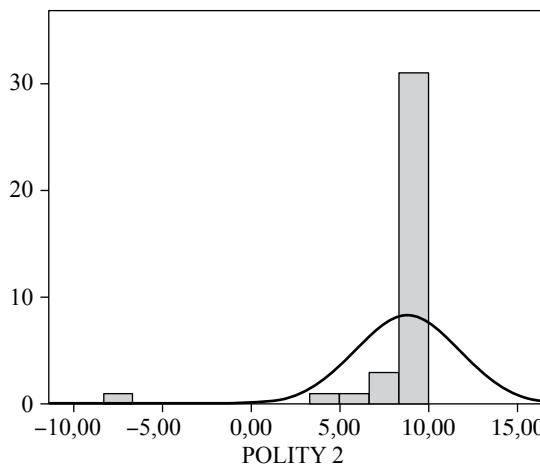


Рис. 5. Распределение *polity2* в Европе в 2013 г.

в отличие от доверия внутри семьи, религиозной или соседской общины, характерного для “связывающего” (*bonding*) социального капитала.

Наилучшая с такой точки зрения формулировка вопроса содержится в исследовании “World Value Survey” [World Value Survey] и европейской “дочке” этого проекта “European Value Study” [European Value Study]: “Доверяете ли вы незнакомым людям”? К сожалению, такая формулировка встречается только в пятой (2005–2008) и шестой (2010–2012) “волнах” этого исследования. Кроме того, его выборка охватывает далеко не все интересующие нас европейские страны. Поэтому данные EVS–WVS мы используем только как вспомогательные. Ключевые же индикаторы доверия рассчитаны на базе данных другого крупного проекта: European Social Survey [European Social Survey], охватывающего 30 европейских стран за период с 2002 по 2014 г. Формулировка вопроса здесь носит более общий характер: “Считаете ли вы, что большинство людей заслуживает доверия, или осторожность в отношениях с людьми никогда не помешает? Укажите свой ответ на шкале от 0 до 10, где 0 означает, что осторожность никогда не помешает, 10 – что большинство людей заслуживает доверия”. Используемая в нашем анализе переменная *Personal Trust* = [0, 10] рассчитана как средние арифметические ответов респондентов в рамках одной страны.

В той же базе социологических данных (ESS) имеется целый ряд “кандидатов” на роль операционального определения понятия “институциональное доверие”. По аналогии с ответом на вопрос о доверии к людям, респонденты отвечали на вопросы о доверии парламенту, политическим партиям, судебной системе и полиции. В данном исследовании мы остановились на вопросах о доверии к судебной системе и полиции как наиболее релевантных индикаторах. Как показывает опыт анализа такого рода данных, ответы на вопрос о доверии парламенту или политическим партиям невозможно “очистить” от личного отношения респондентов к текущему составу легислатуры или лидерам ныне действующих партий.

Таким образом, собственно “институциональное” содержание ответов оказывается сильно “зашумлено” влиянием текущего политического процесса и персональными предпочтениями. С этой точки зрения судебная система и полиция выглядят значительно нейтральнее. Уровни доверия к ним оказались, вполне ожидаемо, сильно коррелированы ( $r = 0,89$ ,  $p < 0,001$ ). Поэтому была взята первая главная компонента этих двух величин, объясняющая 94% их совместной вариации – переменная *Institutional Trust*.

Измерение общей производительности факторов (*TFP*) – источник многочисленных дискуссий, лежащих на стыке экономической и политической наук. В настоящей работе мы придерживаемся непараметрического подхода к оценке *TFP*: уровень производительности определяется эмпирически на основе соотношения расходов и выпуска; конкретная форма производственной функции при этом не задается.

Мы используем один из наиболее популярных на сегодняшний день непараметрических методов оценки *TFP*: оболочечный анализ данных (Data Envelopment Analysis). Метод определяет те страны выборки, в которых соотношение затрат и выпуска наиболее оптимально. Они принимаются за эталонные и формируют технологический фронтон, соответствующий наиболее развитому уровню производственной технологии (в данном случае учитывается именно совокупная производительность факторов – *TFP* – включающая в себя и эффективное распределение, и эффективное использование ресурсов, и грамотное управление производством). Каждая из стран выборки представляется в виде точки в многомерном пространстве, а измерениями пространства служат величины выпуска и затрат. Метод позволяет, используя эмпирические значения затрат и выпуска, построить огибающую кривую (или, в многомерных случаях, огибающую поверхность) и являющуюся технологическим фронтоном, с которым сравниваются позиции всех стран выборки. Наиболее эффективные государства (те, где при минимальных затратах обоих факторов производства наиболее высокий уровень ВВП) получают оценку 1, а остальные сравниваются с эффективными и получают оценку от 0 до 1 в зависимости от того, насколько они далеки от фронтира. Динамика экономического развития государства определяется изменением его позиции относительно фронтира: движение в сторону огибающей кривой соответствует росту *TFP*; движение от фронтиру – падению *TFP*. Для расчета *TFP* непараметрическими методами в исследовании используются следующие данные, взятые из базы Международного валютного фонда [IMF Database]:

- уровень выпуска  $Y$ : ВВП в постоянных ценах по паритету покупательной способности (GDP, PPP, Constant 2005 Dollars);
- уровень публичного капитала  $K_g$ : доля государственного капитала в ВВП (General government capital stock, percentage of GDP);
- уровень частного капитала  $K_p$ : доля частного капитала в ВВП (Private capital stock, percentage of GDP);
  - трудовые ресурсы  $L$ : общая численность работоспособного населения (Labor force, total).

В качестве контрольной переменной в регрессионный анализ (следующий раздел) мы включаем еще один тип капитала, связываемого в литературе с качеством институтов. Это человеческий капитал (*Human Capital*). В данном исследовании мы используем данные проекта Penn World Tables [Penn World Tables], в котором индекс

человеческого капитала рассчитывается на основе усреднения числа лет, проведенных гражданами страны в школе (years of schooling) [Feenstra, Inklaar, Timmer 2015].

Итак, были получены четыре основные для данного исследования переменные: уровень качества институтов *Institutions* (90–14 и 96–14), уровень политического капитала *Political*, два типа социального доверия *Personal Trust* и *Institutional Trust*, уровень продуктивности *TFP*.

### Эмпирический анализ

Начнем анализ влияния уровня политического капитала, социального доверия и совокупной производительности факторов производства на качество институтов в Европе с простого корреляционного анализа. Мы используем коэффициенты Спиримэна как более робастные по сравнению с “классической” корреляцией Пирсона (см. табл. 1). Полученные коэффициенты обнадеживают: во всех случаях мы наблюдаем статистически значимую и достаточно сильную положительную связь. Результаты дают основания включить все указанные выше предикторы в регрессионные модели. В качестве контрольной переменной используется уровень человеческого капитала (*Human Capital*). В таблице 2, обобщающей результаты регрессионного анализа, тестируется пять моделей: с первой по четвертую включается по одному предиктору вместе с контрольной переменной, в пятую – все предикторы и контрольная переменная. В ячейках таблицы указаны стандартизированные коэффициенты регрессии для зависимой переменной *Institutions*90–14, в скобках – для зависимой переменной *Institutions*96–14. Они практически не отличаются.

Таблица 1

#### Корреляции качества институтов с социальным доверием, *TFP* и политическим капиталом

	<i>Personal Trust</i>	<i>Institutional Trust</i>	<i>TFP</i>	<i>Political</i>
<i>Institutions</i> 96–14	0,85**	0,91**	0,65**	0,81**
<i>Institutions</i> 90–14	0,84**	0,9**	0,63**	0,8**

\*\* коэффициент значим на уровне < 0,01

Таблица 2

#### Результаты регрессионного анализа

Предиктор	Модель 1	Модель 2	Модель 3	Модель 4	Модель 5
<i>Personal Trust</i>	0,81** (0,80**)				0,14* (0,14*)
<i>Institutional Trust</i>		0,90** (0,90**)			0,57** (0,59**)
<i>TFP</i>			0,73** (0,74**)		0,16** (0,17**)
<i>Political</i>				0,8** (0,79**)	0,15* (0,13*)
<i>Human capital</i>	0,1 (−0,1)	−0,01 (−0,01)	0,05 (0,05)	0,14** (0,14**)	−0,04 (−0,05)
Скорректированный <i>R</i> <sup>2</sup>	0,60 (0,59)	0,81 (0,79)	0,56 (0,57)	0,69 (0,68)	0,86 (0,85)
<i>F</i> -статистика	108,13** (103,33**)	302,8** (285,67**)	309,3** (317,71**)	595,89** (565,815**)	144,65** (135,36**)

\* значим на уровне < 0,05

\*\* значим на уровне < 0,01

На этом этапе эмпирического анализа все наши ожидания подтверждаются. Все предикторы качества институтов – институциональное и межличностное доверие, *TFP*, политический капитал – оказываются статистически значимыми и обладают ожидаемым направлением связи – положительным. Наиболее влиятельной независимой переменной оказывается институциональное доверие, оно же (вместе с *TFP*) наиболее статистически достоверно. Примечательно, что человеческий капитал оказывается значимым только в одной модели (Модель 4), где он составляет пару с политическим капиталом.

Тем не менее полученные результаты еще не позволяют сделать однозначный вывод о направлении “стрелы причинности”: каждая из независимых переменных может, вообще говоря, рассматриваться и как зависимая от качества институтов. Поэтому мы построили еще одну регрессию, где вместо *достигнутых уровней* использовались *темпы прироста* в процентах. Для всех независимых, зависимой и контрольной переменных по формуле  $\left(\frac{y_t}{y_{t-1}} - 1\right) \times 100\%$  рассчитаны показатели динамики. Кроме того, учтена возможность задержки влияния во времени: регрессии посчитаны также для лагированных переменных с лагами от 1 до 4 лет.

Если бы удалось зафиксировать влияние изменений независимых переменных (особенно лагированных) на изменение зависимой, это было бы чрезвычайно весомым аргументом в пользу наличия причинной связи. Однако значимой статистической связи такого типа *выявить не удалось*. Таким образом, несмотря на тесную связь между достигнутыми показателями социального доверия, политического капитала, продуктивности, с одной стороны, и качества институтов – с другой, их изменения во времени оказываются не связанными (во всяком случае, на статистически достоверном уровне). Таким образом, прямолинейная стратегия поиска “причин и следствий” здесь срабатывает не до конца. Это наводит на мысль о наличии более сложного и тонкого механизма связи между рассматриваемыми показателями; сам факт связи при этом сомнений не вызывает.

Чтобы попытаться обнаружить такой механизм, на следующем этапе эмпирического анализа мы перешли к более детальному анализу распределения стран Европы по группам признаков. На рисунке 1 уже было в самом общем виде показано, что европейские страны тяготеют к делению на три кластера институционального развития. На данном этапе эта картина требует существенного уточнения. Какие страны формируют группы “развитых”, “догоняющих” и “отстающих” в институциональном смысле стран? Есть ли государства, совершившие переходы из одной группы в другую?

Прежде всего пространственно-временная совокупность наблюдений – европейские страны за период 1990–2014 гг. были разбиты на кластеры методом *K*-средних. Этот метод основан на минимизации расстояний между объектами внутри кластеров с одновременной максимизацией расстояний между центрами кластеров. В результате для каждой страны в каждый год мы получаем оценку принадлежности к одному из трех кластеров: “развитые” (3), “догоняющие” (2) и “отстающие” (1). Возрастание номеров кластеров соответствует возрастанию качества институтов.

Такой результат дает нам еще одну важную возможность: отследить переходы страны из кластера в кластер. Например, для Польши значения кластерной принадлежности с 1990 по 2014 г. меняются следующим образом: 1111222...222. Это означает, что в 1993–1994 гг. Польша перешла из кластера “отстающих” в кластер “догоняющих” и далее в нем оставалась. Таким образом, можно выделить два типа европейских стран. Первую, со стабильным качеством институтов (страны, не совершившие переходов) мы обозначим номерами соответствующих кластеров (1, 2, 3). Вторая – “переходная” группа будет обозначаться двумя номерами кластеров, между которыми был совершен переход, и стрелкой, показывающей направление перехода. Например, запись 1 → 2 означает переход из “отстающих” в “догоняющие”, запись 2 ← 3 – переход из “развитых” в “догоняющие” (увы, в отдельных странах

Таблица 3

## Группы институционального развития в Европе

Группа	Страна
1	Албания, Беларусь, Болгария, Босния и Герцеговина, Молдова, Россия, Румыния, Сербия, Украина.
$1 \rightarrow 2$	Польша
$1 \leftarrow 2$	Греция
2	Венгрия, Италия, Испания, Кипр, Латвия, Литва, Словакия, Словения, Чехия
$2 \rightarrow 3$	Эстония
$2 \leftarrow 3$	Португалия
3	Австрия, Бельгия, Великобритания, Германия, Дания, Ирландия, Исландия, Люксембург, Нидерланды, Норвегия, Финляндия, Франция, Швеция, Швейцария

имеет место и институциональный регресс). Следует подчеркнуть, что мы фиксируем только “устойчивые” переходы, как в случае с Польшей; колебания страны между группами (напр., 23322332) таковыми не считаются. Всего получается семь групп (см. табл. 3).

Прежде всего таблица 3 вновь подчеркивает огромную инерцию институционального развития. Из 36 европейских стран за 24 года только две – Польша и Эстония – смогли сильно улучшить качество институтов, и только Эстонии удалось войти в “клуб” европейских государств с наиболее развитыми институтами. Еще в двух странах – Греции и Португалии – наблюдался некоторый институциональный регресс. Остальные же государства остались в своих группах развития.

На следующем этапе анализа сформируем аналогичные разбиения для независимых переменных и “наложим” их на разбиение зависимой. Результат для пары “качество институтов – TFP” приведен в таблице 4. Курсивом в скобках показаны “переходы с понижением”.

Таблица 4

## Комбинированная группировка стран Европы по признакам качества институтов и продуктивности

Институты <i>TFP</i>	1	$1 \rightarrow 2$ ( $1 \leftarrow 2$ )	2	$2 \rightarrow 3$ ( $2 \leftarrow 3$ )	3
1	Албания, Босния и Герцеговина, Молдова, Украина				
$1 \rightarrow 2$ ( $1 \leftarrow 2$ )	Болгария, Румыния, Россия			Эстония	
2	Сербия		Чехия, Италия, Испания	(Португалия)	Финляндия, Исландия
$2 \rightarrow 3$ ( $2 \leftarrow 3$ )		Польша (Греция)	Литва, Словакия		Австрия, Бельгия, Дания, Франция, Германия, Ирландия, Нидерланды, Норвегия, Швеция, Швейцария
3					Люксембург, Великобритания

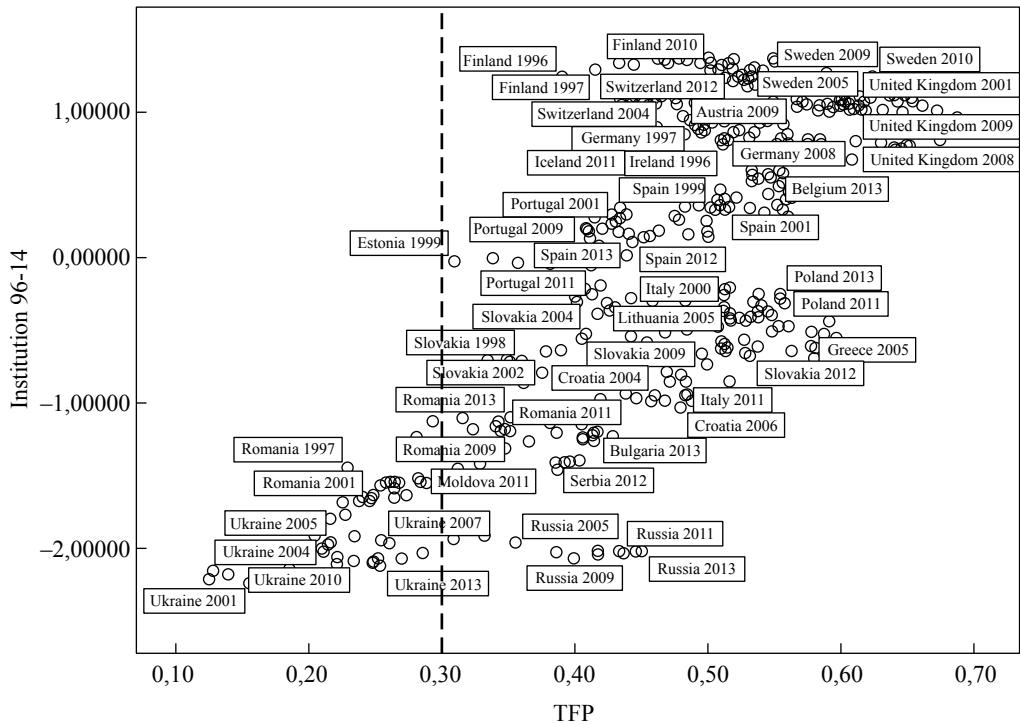


Рис. 6. Страны Европы в пространстве “продуктивность – качество институтов”.

Полученная группировка позволяет сделать несколько существенных наблюдений.

1) Низкая продуктивность экономики не позволяет иметь качественных институтов и даже не дает шанса на улучшение институтов до среднего уровня. Все страны, входящие в кластер 1 по уровню продуктивности, входят в тот же кластер по уровню институционального развития.

2) Обратное, в общем случае, неверно: можно обладать средним уровнем *TFP* и при этом находиться в кластере отстающего институционального развития. Переход 1 → 2 по продуктивности не обязательно ведет к институциональному “рыжку” (Румыния, Россия, Болгария).

3) Две страны (Эстония и Польша), совершившие институциональный скачок, одновременно увеличивали *TFP*. Одна страна, пережившая регресс институтов, одновременно снизила уровень продуктивности (Греция). В то же время в Португалии имел место регресс институтов без снижения продуктивности.

4) Страны с высоким уровнем продуктивности одновременно обладают и высоким качеством институтов.

С этими наблюдениями хорошо согласуется одна гипотеза: *достижение определенного значения продуктивности является необходимым, но не достаточным условием построения “хороших” институтов* (2 и 3 кластеры в нашем случае). Порог *TFP* своего рода “пререквизит” (*prerequisite*) институционального прогресса. В то же время достижение этого порога не гарантирует улучшение институтов, а лишь открывает для него “окно возможностей”. Здесь работает именно тот механизм, который описан нами в теоретической части. Эмпирически это можно показать на простой диаграмме рассеивания для Европы (см. рис. 6).

Обратите внимание, что до перехода “порога *TFP*”, составляющего для этой выборки примерно 0,3 (пунктирная линия на рисунке 6), нет ни одного случая достижения высокого или хотя бы среднего качества институтов: левая верхняя часть

Таблица 5

**Комбинированная группировка стран Европы по признакам качества институтов  
и межличностного доверия**

Институты	1	$1 \rightarrow 2$ ( $I \leftarrow 2$ )	2	$2 \rightarrow 3$ ( $2 \leftarrow 3$ )	3
Межличност- ное доверие					
1	Болгария, Россия, Украина	Польша (Греция)	Кипр, Чехия, Венгрия, Словакия, Словения	(Португалия)	Франция
$1 \rightarrow 2$ ( $I \leftarrow 2$ )			Италия		Германия
2			Литва	Эстония	Австрия, Бельгия, Ир- ландия, Люксембург, Испания, Швейцария, Великобритания
$2 \rightarrow 3$ ( $2 \leftarrow 3$ )					Нидерланды
3					Дания, Финляндия, Исландия, Норвегия, Швеция

Таблица 6

**Комбинированная группировка стран Европы по признакам качества институтов  
и институционального доверия**

Институты	1	$1 \rightarrow 2$ ( $I \leftarrow 2$ )	2	$2 \rightarrow 3$ ( $2 \leftarrow 3$ )	3
Институцио- нальное доверие					
1	Болгария, Россия, Украина				
$1 \rightarrow 2$ ( $I \leftarrow 2$ )		Польша	Чехия, Венгрия	(Португалия)	Бельгия, Франция
2			Кипр, Сло- вакия, Словения		
$2 \rightarrow 3$ ( $2 \leftarrow 3$ )		(Греция)	Венгрия, Литва, (Италия)	Эстония	Ирландия, Нидер- ланды, Испания, Великобритания
3					Австрия, Да- ния, Финляндия, Германия, Исландия, Люк- сембург, Нор- вегия, Швеция, Швейцария

диаграммы пустая. После преодоления порога мы наблюдаем резкий рост дисперсии траекторий институционального развития.

Построим аналогичные комбинированные группировки для других исследуемых нами признаков. В таблице 5 представлен результат сопряжения межличностного доверия и качества институтов.

При низком качестве институтов уровень межличностного доверия будет гарантированно низким. В то же время, можно иметь институты среднего (Кипр, Чехия, Венгрия, Словакия, Словения) и даже высокого (Франция) качества в условиях социального недоверия. Более того, в этих условиях можно как улучшать качество институтов (Польша), так и ухудшать его (Португалия, Греция). Общества же с высоким уровнем межличностного доверия наверняка будут институционально развитыми.

Все эти наблюдения наводят на мысль, что *повышение качества институтов является необходимым, но недостаточным условием для роста межличностного доверия*. По достижении более высокого уровня институционального развития страна может повысить (но может и не повысить) показатели межличностного доверия. Причем “выбор” первого варианта явно зависит от культурных факторов: все без исключения страны третьего кластера межличностного доверия (Дания, Финляндия, Исландия, Норвегия, Швеция) – протестантские государства Северной Европы. Таким образом, в данном случае исходная предпосылка исследования о роли межличностного доверия как предиктора качества институтов оказалась неверной; скорее имеет место обратное влияние.

Перейдем к институциональному доверию (см. табл. 6). Низкое качество институтов не позволяет иметь ни средних, ни высоких уровней институционального доверия.

*Таблица 7*

**Комбинированная группировка стран Европы по признакам качества институтов и политического капитала**

Институты	1	$1 \rightarrow 2$ ( $1 \leftarrow 2$ )	2	$2 \rightarrow 3$ ( $2 \leftarrow 3$ )	3
Политический капитал					
1	Албания, Беларусь, Россия, Сербия				
$1 \rightarrow 2$ ( $1 \leftarrow 2$ )	Болгария, Молдова, Румыния, Украина	Польша	Чехия, Латвия, Литва Словакия, Словения	Эстония	
2					
$2 \rightarrow 3$ ( $2 \leftarrow 3$ )		(Греция)*	Испания		Германия
3			Италия		Австрия, Бельгия, Кипр, Дания, Финляндия, Франция, Исландия, Ирландия, Люксембург, Нидерланды, Норвегия, Швеция, Швейцария, Великобритания

\* В Греции качество институтов упало, но политический капитал вырос.

Но верно и обратное: при низком институциональном доверии не наблюдается стран с иными институтами, кроме слабых. Повышение качества институтов (Эстония, Польша) сопровождается повышением уровня институционального доверия, а снижение их качества (Греция) – снижением доверия к институтам (впрочем, в Португалии регресс институтов пока не сопровождался соответствующим снижением доверия). Эти наблюдения дают основания полагать, что в данном случае имеет место *взаимное влияние (или даже “соразвитие”)*, когда улучшение качества государственных институтов стимулирует рост доверия к ним, а рост доверия, в свою очередь, способствует институциональному развитию.

Наконец, о сопряжении качества институтов и политического капитала (см. табл. 7). Результаты группировки позволяют предположить, что здесь вновь имеется некий вариант “порогового эффекта”, хотя и менее выраженного по сравнению с *TFP*. Почти все (за исключением Италии) страны с наивысшим (3) уровнем накопления политического капитала имеют качественные институты. В то же время переход во второй кластер политического капитала еще ничего не гарантирует: здесь мы имеем широкий спектр уровней институционального развития от Молдовы и Болгарии (1-й кластер) до Эстонии (переход в 3-й кластер). Таким образом, 70-летняя история непрерывного демократического развития (а для многих стран 3-го кластера – существенно дольше) почти всегда обеспечивает высокое качество институтов. Чего нельзя сказать о сроке в 20–30 лет. Можно предположить, что в рамках стабильных демократических практик должна произойти, как минимум, одна смена поколений; впрочем, этот феномен заслуживает отдельного исследования.

\* \* \*

Итак, по результатам нашего анализа обрисовываются некоторые контуры механизма институционального развития. Первое, что должно быть реализовано, – повышение производительности экономики (*TFP*) до определенного критического значения. После этого может быть запущен “успешный” сценарий: институциональные реформы находят поддержку со стороны населения, что выражается в росте институционального доверия, которое в свою очередь толкает вперед развитие институтов. Это делает возможным рост межличностного доверия (роста социального капитала связующего типа), дополнительно закрепляющего положительную петлю обратной связи между институциональным развитием и доверием к институтам со стороны общества. Все эти процессы и представляют собой накопление политического капитала; по достижении некоторого уровня (возможно, связанного со сменой поколений) его накопление делает институциональное развитие необратимым. По крайней мере, в обозримой исторической перспективе.

При этом критически важными элементами этого сценария являются, судя по всему, преодоление “порога *TFP*” и появление петли положительной обратной связи между развитием институтов и ростом институционального доверия. Косвенным образом об этом свидетельствует и отправная точка нашего эмпирического исследования – регрессионный анализ. В таблице 2 с его результатами видно, что в обобщенной модели (5) именно *TFP* и институциональное доверие обладают наибольшей статистической значимостью.

Впрочем, широко используемые инструменты количественной политологии, и прежде всего регрессии разных типов, ориентированы на выявление прямолинейных причинных отношений. Рассматриваемые нами связи, такие как “служит необходимым условием для...”, “формирует петлю обратной связи с...”, “придает процессу необратимый характер” требуют разработки специального дизайна, в том числе соответствующих динамических моделей. Это очень большой методологический вопрос, нуждающийся в отдельном рассмотрении.

## СПИСОК ЛИТЕРАТУРЫ

Так как в списке литературы приведены только иностранные источники см. REFERENCES.

---

# Barriers to institutional development in Europe: economic productivity, social trust and political capital

A. AKHREMENKO\*,

A. PETROV\*\*,

E. YURESKUL\*\*\*

\***Andrei Akhremenko** – doctor in Political Science, Professor, Department of Political Science, Faculty of Social Sciences, National Research University “Higher School of Economics”. 20 Myasnitskaya ulitsa, Moscow 101000 Russia. E-mail: aakhremenko@hse.ru

\*\***Alexander Petrov** – doctor in Physics and Mathematics, Keldysh Institute of Applied Mathematics, Miusskaya sq., 4 Moscow, 125047, Russia. E-mail: petrov.alexander.p@yandex.ru

\*\*\***Egor Yureskul** – PhD in Political Science, lecturer, Department of Political Science, Faculty of Social Sciences, National Research University “Higher School of Economics”. 20 Myasnitskaya ulitsa, Moscow 101000 Russia. E-mail: eyureskul@hse.ru

## Abstract

The paper considers the problem of institutional development in the countries of Central and Eastern Europe. We analyze existing approaches to explaining the factors and determinants of institutional development and strive to determine why there was no evidence of institutional convergence in European countries between 1990 and 2013. We look at theoretical and methodological limitations typical for mainstream approaches to the problem in contemporary political science. The data we utilize comprises a wide range of quantitative variables which measure levels of institutional development, social trust and political capital. We also use our own Total Factor Productivity (*TFP*) estimates obtained through non-parametric methods using raw data. We analyze relationships between the variables using correlations, regression analysis and clustering. The results of statistical analysis point at the mechanism through which *TFP* influences institutional development: we show that *TFP* is a necessary prerequisite for institutional transformation.

**Keywords:** total factor productivity, institutional development, social trust, political capital, social capital

## REFERENCES

- Acemoglu D. (2003) Why Not A Political Coase Theorem? Social Conflict, Commitment, And Politics. *Journal of Comparative Economics*, vol. 31, pp. 620–652.
- Acemoglu D., Gallego F., Robinson J. (2014) Institutions, Human Capital, and Development. *Annual Review of Economics*, vol. 6(1), pp. 875–912.
- Acemoglu D., Johnson S., Robinson J. (2001) The Colonial Origins of Comparative Development: An Empirical Investigation. *American Economic Review*, no 91, pp. 1369–1401.
- Acemoglu D., Robinson J., Johnson S. (2005) Institutions as a Fundamental Cause of Long-Run Growth. *Handbook of Economic Growth*, vol. 1A, Amsterdam: Elsevier B, pp. 386–472.
- Adler P. S., Kwon S.-W. (2002) Social Capital: Prospects for a New Concept. *Academy of Management Review*, vol. 27, pp. 17–40.

Akhremenko A., Petrov A. (2014) Efficiency, Policy Selection and Growth in Democracy and Autocracy: A Formal Dynamical Model. *NRU Higher School of Economics. Series PS "Political Science"*, no. WP BRP 16/PS/2014.

Andrew Williams. Andrew Williams Dataset for Information and Accountability Transparency (<https://andrewwilliamscon.wordpress.com/datasets/>).

Baran K. (2013) The determinants of economic growth in Hungary, Poland, Slovakia and the Czech Republic in the years 1995–2010. *Equilibrium. Quarterly Journal of Economics and Economic Policy*, vol. 8, no. 3, pp. 7–26.

Bayesian Corruption Index. The Bayesian Corruption Index (<http://www.sherppa.ugent.be/BCI/BCI.html>).

Bilenko Y. (2013) Economic and Institutional Fundamentals of the Divergence of Development Paths in Central and Eastern Europe. *Ekonomika*, vol. 92, no. 3, p. 24.

Burt R. (1992) The Social Structure of Competition. *Networks and Organizations: Structure, Form, and Action*. Harvard Business School Press. (<http://personal.stevens.edu/~ysakamot/sna/man/week4/burt.pdf>).

Coleman J. S. (1988) Social Capital in the Creation of Human Capital. *The American Journal of Sociology*, no. 94, pp. 95–120.

Delhey J., Newton K. (2005) Predicting Cross-National Levels of Social Trust: Global Pattern or Nordic Exceptionalism? *European Sociological Review*, vol. 21, no. 4, p. 311.

Diamond J. (1997) *Guns, Germs, and Steel: The Fates of Human Societies*. New York: Norton&Company.

Djankov S., Glaeser E., La Porta R., Lopez-de-Silanes F., Shleifer A. (2003) The New Comparative Economics. *Journal of Comparative Economics*, vol. 31, pp. 595–619.

Durlauf S., Fafchamps M. (2004) *Social Capital No 10485, NBER Working Papers, National Bureau of Economic Research, Inc.*

Elgin, Oztunali, Oguz (2012) Shadow Economies around the World: Model-Based Estimates. *No 2012/05, Working Papers, Bogazici University, Department of Economics*.

Engermann S., Sokoloff K. (1994) *Factor Endowments, Institutions, and Differential Paths of Growth Among New World Economies: A View from Economic Historians of the United States*. *NBER Historical Working Papers 0066, National Bureau of Economic Research, Inc.*

European Social Survey. European Social Survey (<http://www.europeansocialsurvey.org/data/round-index.html>).

European Value Study. European Value Study (<http://www.europeanvaluesstudy.eu/>).

Feenstra R.C., Inklaar R., Timmer M.P. (2015) The Next Generation of the Penn World Table. *American Economic Review*, vol. 105, no. 10, pp. 3150–82.

Fraser Institute (<https://www.fraserinstitute.org>).

Fukuyama F. (1995) *Trust: The Social Virtues and the Creation of Prosperity*. New York: The Free Press.

Galiani S., Torrens G., Yanguas M.L. (2014) The Political Coase Theorem: Experimental evidence. *Journal of Economic Behavior & Organization, Elsevier*, vol. 103(C), pp. 17–38.

Gerring J., Bond P., Barndt W., Moreno C. (2005) Democracy and Economic Growth: A Historical Perspective. *World Politics*, vol. 57, no. 3, pp. 323–364.

Hall R.E., Jones C.I. (1999) Why Do Some Countries Produce So Much More Output Per Worker Than Others? *The Quarterly Journal of Economics*, vol. 114, no. 1, pp. 83–116.

Heritage Foundation (<http://www.heritage.org>).

IMF Database. The IMF Official Site (<http://data.imf.org/?sk=1CE8A55F-CFA7-4BC0-BCE2-256EE65AC0E4>).

International Country Risk Guide (ICRG) (<https://www.prsgroup.com/about-us/our-two-methodologies/icrg>).

Kaasa A. (2016) Social Capital, Institutional Quality and Productivity: Evidence from European Regions. *Economics and Sociology*, vol. 9, no. 4, pp. 11–26.

Knack S., Keefer P. (1998) Does social capital have an economic payoff? A cross-country investigation. *The Quarterly Journal of Economic*, vol. 112, no. 4, pp. 1251–88.

LaPorta R., Lopez-de-Silanes F., Shleifer A. (2008) The Economic Consequences of Legal Origins. *Journal of Economic Literature*, vol. 46, no. 2, pp. 285–332.

Mahmood T. (2012) Effects of Input Composition on Technical Efficiencies of Textile Industries in Pakistan. *The Pakistan Development Review*, vol. 51, no. 2 (Summer 2012), pp. 117–130.

Moore B. (1966) *Social Origins of Dictatorship and Democracy: Lord and Peasant in the Making of the Modern World*. Boston, MA: Beacon Press.

- North D.C. (1993) The New Institutional Economics and Development. *Economic History* 9309002, EconWPA.
- Penn World Table. version 9.0 ([www.ggdc.net/pwt](http://www.ggdc.net/pwt)).
- Polity IV Annual Time Series, 1800–2014. Centre for Systemic Peace: (<http://www.systemicpeace.org/inscr/p4v2014.xls>).
- Putnam R.D. (1994) *Making Democracy Work: Civic Traditions in Modern Italy*. Princeton, New Jersey: Princeton Univ. Press.
- Savoia A., Sen K. (2016) Do We See Convergence in Institutions? A Cross-Country Analysis. *The Journal of Development Studies*, vol. 52, issue 2, pp. 166–185.
- Silaghi P.M., Alexa D. (2015) Sources of growth: Evidence from ten central and Eastern European countries during 1993–2008. *Panoeconomicus*, vol. 62, no. 5, pp. 643–661.
- Sokoloff K., Engermann S. (2000) History Lessons: Institutions, Factors Endowments, and Paths of Development in the New World. *The Journal of Economic Perspectives*, vol. 14, no. 3, pp. 217–232.
- Solow R.M. (1956) A Contribution to the Theory of Economic Growth. *The Quarterly Journal of Economics*, vol. 70, no. 1, pp. 65–94.
- Tamaschke L. (2003) The Role of Social Capital in Regional Technological Innovation: Seeing Both the Wood and the Trees. *Communities and Technologies*, Kluwer BV, Deventer.
- Transparency International – The Global Coalition against Corruption: (<https://www.transparency.org>).
- VDEM. Varieties of Democracy Project (<https://www.v-dem.net/en/>).
- Woolcock M. (2010) The Rise and Routinization of Social Capital, 1988–2008. *Annual Review of Political Science*, vol. 13, pp. 469–487.
- World Value Survey. WVS Data & Documentation (<http://www.worldvaluessurvey.org/WVSContents.jsp>).
- Worldwide Governance Indicators. The World Bank Official Site: (<http://info.worldbank.org/governance/wgi/>).
- Yao X., Watanabe C., Li Y. (2009) Institutional structure of sustainable development in BRICs: Focusing on ICT utilization. *Technology in Society*, vol. 31, no. 1, pp. 9–28.

© А. Ахременко, А. Петров, Е. Юрескул, 2017