

Sociedades Menos Individualistas Possuem os Piores Estados?

Claudio D. Shikida
Ari Francisco Araujo Jr.
Pedro H.C. Sant'Anna

Resumo

Existem muitos estudos relacionando o desempenho econômico dos países com suas instituições. Entretanto, é importante considerar a diferença entre instituições formais e informais neste tipo de análise. Quando se leva em conta tal distinção, é inevitável considerar a relação entre aspectos “culturais” (instituições informais) e a qualidade das políticas públicas ou mesmo daquele que abriga seus formuladores, o Estado. Este artigo mostra evidências de que as instituições informais são mais importantes do que as instituições formais na qualidade dos Estados.

Palavras-chave: Desenvolvimento Econômico, Nova Economia Institucional, Índice de Falência Estatal, Individualismo, Estatismo, Qualidade do Estado.

Sociedades Menos Individualistas Possuem os Piores Estados?

Claudio D. Shikida¹
Ari Francisco Araujo Jr.
Pedro H.C. Sant'Anna

Introdução

Há um espectro que ronda os discursos dos (assim) denominados “formadores de opinião”: o espectro do individualismo e de seus desdobramentos (como o livre mercado). A vitória de candidatos auto-proclamados “de esquerda” na América Latina, como Hugo Chávez na Venezuela, Rafael Correa no Equador, Evo Morales na Bolívia, além dos recentes acontecimentos mundiais relacionados à chamada crise *subprime* – parecem ter diminuído o otimismo com relação aos benefícios sociais gerados pelas economias de mercado.

Em 2008, a *World Public Organization* realizou uma pesquisa que mostra uma queda do otimismo em relação ao mercado concomitantemente a um aumento na crença da necessidade de maior regulação estatal. O fenômeno não se limita à América Latina, mas também a países de outros continentes como, por exemplo, Itália, Alemanha, Coreia do Sul, Filipinas, Nigéria e Turquia². Evidentemente, uma pesquisa deste tipo pode mostrar efeitos pontuais, de curto prazo, principalmente no que diz respeito ao impacto da crise econômica mundial, mas o discurso anti-individualista possui raízes históricas bem conhecidas e estudadas.

Apesar da unanimidade acadêmica acerca dos benefícios de uma economia de mercado, parece haver um persistente hiato entre o que os dados mostram (não apenas correlação positiva entre desenvolvimento econômico e liberdade econômica, por exemplo, mas também causalidade) e o que as pessoas percebem como benefícios oriundos do livre mercado. Como mostrou Caplan (2007), este hiato é bastante real o que tornaria inevitável o estudo de aspectos aparentemente não-econômicos na explicação do desempenho econômico. Ao longo dos anos, a literatura do desenvolvimento econômico

¹ Todos os autores integram o Centro de Economia Aplicada e Estratégia Empresarial (CEAEE) do IBMEC-MG.

² Ver World Public Organization (2008).

agregou ao modelo de Solow original o capital humano, as inovações, a história e as instituições. Ainda que não exista uma unanimidade acerca da formulação teórica de todas as relações causais, pode-se dizer que é praticamente consensual que exista uma causalidade das instituições de um país para o desenvolvimento econômico.

Uma das áreas pouco estudadas é a da influência de aspectos informais das instituições – que poderíamos chamar de “cultura” – sobre o desenvolvimento econômico³. Este artigo se situa nesta agenda de pesquisa. Não é nosso objetivo explicar a relação entre os bons resultados de uma economia de livre mercado sobre o desenvolvimento econômico. Este tema tem sido bastante explorado na literatura. Acreditamos que seja importante considerar as instituições que geram tal desenvolvimento. Em nossa opinião, é necessário, primeiramente, estudar a relação entre instituições e governos. Especificamente, nosso objetivo é entender o impacto das instituições formais e informais sobre a qualidade dos Estados já que estes, ao fazerem políticas econômicas baseadas em aspectos formais e informais das instituições, são, por excelência, o meio mais eficiente de se criar ou destruir o potencial dos mercados.

Individualismo, Cultura e Economia

Adam, Adam, Adam Smith,
Listen what I charged you with!
Didn't you say
In the class one day
That selfishness was bound to pay?
Of all your Doctrine, that was the Pith,
Wasn't it, wasn't it, wasn't it, Smith?
[LEACOCK, S. (1936), 75]

Em 1936, Stephen Leacock, economista canadense, assim se expressava – furiosa e poeticamente – acerca dos ensinamentos de Adam Smith. O poema cuja primeira estrofe é citada acima, prossegue em tom acusatório contra as consequências das idéias

³ Isto não quer dizer que não existam diversos estudos sobre o tema. O próprio Caplan (2007) desenvolveu um modelo próprio para explicar fenômenos como a persistência da diferença entre as opiniões dos economistas e dos não-economistas. Outros economistas têm destacado a importância de se entender o papel da ideologia na escolha dos indivíduos como Kuran (1995), Higgs (1987), Benabóu (2008). Aspectos religiosos têm sido, também, estudados pela *Economia da Religião*, cujo representante mais conhecido provavelmente é Laurence Iannaccone.

de Adam Smith. Conhecido como pai do liberalismo econômico, Smith foi um dos primeiros a enfatizar a importância das ações individuais para o progresso social – usualmente identificado (para fins de comparação) com uma de suas mais importantes dimensões: o desenvolvimento econômico.

O interessante poema de Leacock, contudo, não se baseia em uma leitura precisa do que seja o liberalismo ou o individualismo de Adam Smith. Esta distinção foi feita de maneira precisa por Hayek (1948) em seu clássico “Individualism: *True and False*”. Neste texto, o autor expôs as diferenças entre os conceitos liberal – que ele chama de verdadeiro, no sentido liberal - e não-liberal de individualismo. Essencialmente, o individualismo liberal consiste em uma teoria social baseada na visão de que os fenômenos sociais se explicam pelas ações individuais, fruto da interação social.

A diferença entre este individualismo e o outro que dá substrato às idéias não-liberais (coletivistas), está, basicamente, sustentada no princípio de que estas mesmas ações individuais geram resultados imprevisíveis, não-planejados inicialmente. A diferença em relação à outra visão é que:

“(…) while the design theories necessarily lead to the conclusion that social processes can be made to serve human ends only if they are subjected to the control of individual human reason, and thus lead directly to socialism, true individualism believes on the contrary that, if left free, men will often achieve more than individual human reason could design or foresee. [HAYEK, F.A.von (1948) : 10-11]

Dada a imprevisibilidade das ações humanas, o individualismo liberal é caracterizado, como teoria social, pela busca de instituições que, respeitando a imprevisibilidade dos frutos destas ações, maximizem a prosperidade social. Neste sentido, a liberdade individual seria essencial para o desenvolvimento econômico, já que, sob instituições apropriadas, levaria ao melhor resultado cooperativo que uma sociedade poderia ter.

O próprio desenho das instituições é difícil de ser feito por um ou outro indivíduo (ou grupo de indivíduos), pois a descoberta das instituições mais úteis para uma sociedade só poderia ser feita de forma espontânea o que, inclusive, mostra como o

individualismo liberal é perfeitamente compatível com a cooperação entre indivíduos, a qual não pode ser obtida como fruto da coerção, já que esta seria contraditória ao fato de que não existe um único indivíduo capaz de obter a solução para qualquer problema social:

“(...) nobody know *who* knows best and that the only way by which we can find out is through a social process in which everybody is allowed to try and see what he can do. The fundamental assumption, here as elsewhere, is the unlimited variety of human gifts and skills and the consequent ignorance of any single individual of most of what is known to all the other members of society taken together. [HAYEK, F.A. von (1948) : 15]

Assim, o individualismo liberal gera as seguintes proposições: (i) o nível de coerção social deve ser mínimo, (ii) indivíduos devem seguir princípios e não metas pré-estabelecidas (e estes princípios devem ser duradouros, ou seja, devem perdurar no longo prazo); (iii) os processos sociais liberais são compatíveis com a democracia mas não se deve confundir respeito à democracia com respeito à visão da maioria.

Esta visão hayekiana das instituições mostra um otimismo nem sempre empiricamente justificado com a origem espontânea de instituições e sua relação com o desenvolvimento econômico. Boettke, Coyne & Leeson (2008) classificam as instituições em três tipos: aquelas introduzidas exogenamente por estrangeiros, as introduzidas exogenamente por membros da própria sociedade e aquelas endogenamente geradas. É razoável dizer que a visão hayekiana se enquadre neste último tipo de instituição.

Na abordagem destes autores, instituições endógenas são o substrato último da interação entre aspectos formais e informais das instituições cujo resultado nem sempre necessita ser favorável ao crescimento econômico⁴. Em última instância, aspectos culturais ou informais das instituições mostram-se importantes na determinação da trajetória das sociedades mas não necessariamente a cultura é sempre um substrato favorável ao desenvolvimento.

Uma sociedade que incentiva valores individualistas apresenta resultados socialmente desejáveis? O respeito aos direitos de propriedade que o individualismo

⁴ O exemplo citado pelos autores é o da Tanzânia, cujo costume local (instituição endógena) apresenta um tabu contra direitos de propriedade privados.

liberal implica são compatíveis com o bom desempenho sócio-econômico de uma sociedade? Pipes (2001), em sua discussão sobre o impacto dos incentivos sobre o instinto animal de posse (que leva à criação dos direitos de propriedade) mostra que, submetidos a diferentes incentivos ideológicos, indivíduos podem apresentar mudanças de comportamento. Citando um estudo de Bettelheim sobre as diferenças entre *kibbutzim* de inspiração socialista e os outros, descobriu este autor que:

“(...) israelenses criados em um ambiente espartano demonstravam uma excepcional lealdade de grupo e foram educados para se tornarem excelentes soldados, mas vivenciavam uma grande dificuldade de ter um relacionamento emocional com qualquer outro indivíduo, tanto para dar início a uma amizade como para apaixonar-se (...). Jovens do *kibbutz* admitiram ter dificuldade em escrever poesia ou pintar, porque tais atividades eram consideradas ‘egoístas’, e traziam o opórbrio para o grupo. [PIPES, R. (2001): 101]

Se indivíduos reagem a incentivos ideológicos, então é necessário entender o impacto destes. North (1989) chama a atenção para a necessidade de se compreender melhor o impacto do sistema educacional de um país no aspecto de difusão de normas e crenças sociais, não apenas no de transmissor de conhecimentos técnicos (que, na literatura, relaciona-se à formação do capital humano). A transmissão de valores é um produto de qualquer sistema educacional. Na terminologia novo-institucional, diz-se que não apenas aspectos formais das instituições vigentes em um país são ensinados (por exemplo, codificação legal), mas também os informais (por exemplo, valores culturais, religiosos)⁵.

Estudos empíricos sobre a influência da cultura normalmente abordam o desenvolvimento econômico dos países⁶. Entretanto, esse artigo procura seguir mais estreitamente a idéia original de Hayek, ou seja, testa se valores culturais –

⁵ Não é à toa, por exemplo, que o socialismo moderno dê tanta importância ao aspecto informal das instituições. Por exemplo: “Assim, a principal crise do desenvolvimento capitalista para Gramsci não é econômica, mas hegemônica. É somente quando o ‘consenso’ subjacente ao desenvolvimento capitalista começa a desmoronar que a sociedade pode se transformar. A política revolucionária é, portanto, a luta contra a hegemonia, incluindo o desenvolvimento, como parte dessa luta, de uma ‘contra-hegemonia’, baseada nos **valores e cultura** da classe operária [CARNOY, M. (1988) : 12] (grifos nossos).

⁶ Scully (1988) é um dos primeiros artigos a, explicitamente, mensurar o impacto de diferentes valores culturais (“individualistas” e “estatistas”) sobre o desempenho econômico. A diferença pró-desenvolvimento, em seus resultados, é marcante e favorável à adoção de valores individualistas.

especificamente o individualismo – têm algum impacto no arranjo sócio-econômico, e não apenas no desenvolvimento econômico. A cultura influencia a formação do Estado que, por sua vez, pode obstruir ou não o desenvolvimento econômico⁷.

Para operacionalizar o conceito de “arranjo sócio-econômico”, utilizou-se o índice de “Estados Falidos⁸” (*Failed States*), mensurado pela *Fund for Peace*. O índice é obtido por meio do *Conflict Assessment System Tool* (CAST) que processa informações contidas na base de dados *Thomson Dialog* e classifica o país conforme doze indicadores (quatro indicadores sociais, dois econômicos, e seis políticos)⁹. Na métrica deste índice, países como Iraque (113.7) e Sudão (111.4) apresentavam-se, em 2007, no topo do *ranking* (Estados mais Falidos) enquanto que, Finlândia (18.5) e Noruega (17.1), eram respectivamente o 176º e o 177º (últimos) da lista.

Um arranjo social que não logrou sucesso em indicadores sócio-político-econômicos pode ser fruto de diversos fatores e, conforme visto acima, um deles pode ser o fator cultural.

A relação entre individualismo e qualidade do Estado

Embora haja abundante literatura acerca das relações entre instituições e crescimento econômico, pouco se examina acerca dos determinantes institucionais do bom desempenho dos governos enquanto provedores de bens públicos. Parece consensual que, independente da origem dos Estados¹⁰, os mesmos são, de alguma forma necessários para a promoção do bem-estar de uma sociedade como preconizado pelos liberais clássicos, dentre eles Milton Friedman, Ludwig von Mises e Friedrich A. von Hayek (ver Holcombe (2004))¹¹.

⁷ Acemoglu, Ticchi & Vindigini (2007) apresentam um modelo que busca explicar o surgimento e a persistência de “Estados Ineficientes”.

⁸ Neste artigo, exceto se expressamente especificado em contrário, usa-se “governo” e “Estado” como sinônimos.

⁹ A metodologia deste índice encontra-se no Anexo.

¹⁰ Os Estados não surgem, historicamente, como defensores do bem-estar social. Ver, por exemplo, Olson (2000).

¹¹ Neste texto pode-se encontrar extensa discussão sobre a viabilidade ou não de sociedades anárquicas (notadamente no sentido anarco-capitalista). Especificamente no caso de se medir o grau de anarquia com a “proxy” “falência estatal”, Leeson & Williamson (2008) fazem uma interpretação bem pouco usual de que

North (1989) e De Soto (2001), dentre outros, têm enfatizado a importância do respeito aos direitos de propriedade como determinantes do desenvolvimento econômico. O ponto central é que instituições que sinalizam respeito aos direitos de propriedade maximizam o “bem-estar”, do qual o desenvolvimento econômico é apenas um aspecto, embora economistas tradicionalmente vejam os dois conceitos como sinônimos. O conceito de falência estatal, portanto, aproxima-se mais da noção de bem-estar do que simplesmente o desenvolvimento econômico¹².

Entende-se que transações econômicas ocorrem sob dois tipos de instituições, as formais e as informais. Obviamente, as leis de um país podem representar a codificação de boa parte de suas instituições informais¹³ e podemos, seguindo a literatura, identificar, para fins operacionais, as instituições formais sob o rótulo de “leis” e as informais sob o rótulo de “cultura”, incluindo-se aí os valores de uma sociedade, suas normas de conduta e tradição (Williamson (2008))¹⁴. A cultura, assim, influenciaria a formalização inicial das instituições (normas escritas) bem como seus aspectos informais. As instituições formais, por sua vez, definem o papel do governo e sua relação com a sociedade. Variados graus de proteção aos direitos de propriedade, no fornecimento de bens públicos, na extorsão consentida (impostos e similares), dentre outros, são gerados como resultado desta atuação. Na terminologia de Boettke, Coyne & Leeson (2008), a interrelação entre instituições endógenas e exogenamente estabelecidas (por nativos ou estrangeiros) seria determinante na formatação do governo e de seu papel em relação ao funcionamento dos mercados. Observam os autores que mesmo esta “exogeneidade” das instituições pode variar com a história. Neste caso, uma estratégia de investigação empírica deveria considerar testes de endogeneidade.

a anarquia poderia ser a solução para algumas sociedades.

¹² Considerações redistributivas ou sobre o impacto da ação cooperativa podem ser consideradas para diferenciar o conceito tradicional de bem-estar que normalmente se limita a considerações de eficiência econômica.

¹³ Neste sentido, a taxionomia de Boettke, Coyne & Leeson (2008) anteriormente citada levanta uma questão importante sobre o grau de exogeneidade das instituições ao longo do tempo. Em outras palavras, até que ponto conceitos como *path dependence* seriam relevantes para se explicar os diferentes graus de desenvolvimento dos países?

¹⁴ Berkowitz, Pistor & Richard (2003) detalham, empiricamente, a importância da forma pela qual uma lei é adotada por um país em seu desempenho econômico. Faria (1999) mostra que, em um modelo de escolha constitucional, é possível se obter dois equilíbrios: um que busque deter o poder dos políticos e outro mais adequado ao incentivo das virtudes cívicas.

A seção seguinte procura investigar o papel das instituições na formatação dos governos sem deixar de considerar o possível problema de endogenia acima citado.

Modelo e Dados

A importância dos aspectos liberais (ou individualistas) da cultura sobre a qualidade do estado pode ser pensada, inicialmente, conforme a expressão (1) abaixo.

$$Y_i = \alpha + \beta_1 F_i + \beta_2 I_i + \sum_i \delta_i X_i + \varepsilon_i \quad (1)$$

Nesta equação Y é o índice de falência estatal, F representa as instituições formais, I, as informais, X é um vetor de variáveis de controle, e ε é um ruído branco. Desta forma, vejamos cada variável em mais detalhe.

Índice de Falência Estatal

O índice de falência estatal abrange 177 países e é calculado desde 2005. Através de metodologia própria (*CAST - Conflict Assessment System Tool*) são analisadas, por meio do exame de notícias (feitas por coleta automatizada e análise humana), três dimensões da situação de um país: social, econômica e política. A dimensão social abrange quatro indicadores; a econômica, dois; e a política, seis. A estes indicadores são atribuídos valores na escala ordinal de 0 (zero) a 10 (dez) e, posteriormente, os mesmos são agregados criando um “índice de tendência” que é submetido a nova análise que busca refinar o risco de ocorrência de conflitos no país. Em outras palavras, trata-se de um índice que mede a deterioração (falência) da capacidade de um Estado/Governo de resolver pacificamente problemas de uma sociedade ou, em outras palavras, de fornecer bens públicos básicos como segurança e estabilidade para diversos grupos sociais em suas transações econômicas e não-econômicas.

*Instituições Formais*¹⁵

Seguindo Williamson (2008) e Glaeser et al (2004), pode-se definir instituições formais como as restrições políticas às quais governos são submetidos. São utilizadas as medidas coletadas por Glaeser et al (2004):

- a) Independência do Judiciário – É a soma de três variáveis – medidas aproximadamente em 1995 - que dizem respeito à estabilidade (*tenure*) dos juízes da Suprema Corte (ou da Corte mais alta) de cada país e também dos juízes que, em última instância, cuidam de casos administrativos. A última medida trata da existência ou não de *case law*. A variável é normalizada assumindo valores entre 0 (zero) e 1 (um) de forma que valores maiores significam maior independência do Judiciário¹⁶.
- b) Representação Proporcional – Uma variável *dummy*, cujo valor 1 (um) é atribuído à existência de um sistema de representação proporcional. Uma média do período 1975-2000¹⁷.
- c) Revisão Constitucional – Soma de duas variáveis medidas aproximadamente em 1995. Uma delas diz respeito ao poder dos juízes de mudar a constitucionalidade das leis de um país e a outra diz respeito a quão difícil é mudar a Constituição do país. Esta soma é normalizada entre 0 (zero) e 1 (um) de forma que valores maiores significam maior poder de revisão constitucional pelas cortes¹⁸.
- d) Pluralismo - Uma variável *dummy*, cujo valor 1 (um) é atribuído à existência de um sistema eleitoral no qual o vencedor da eleição segue uma regra *winner-take-all*, o vencedor (por maioria simples ou relativa) controla todas as cadeiras disputadas na eleição. Média do período 1975-2000¹⁹.

¹⁵ As definições de instituições formais, informais e das variáveis de controle seguem Williamson (2008) em uma tradução quase livre.

¹⁶ Originalmente medida por La Porta et al (2004).

¹⁷ Originalmente medida por Beck et al (2001).

¹⁸ Originalmente medida por La Porta et al (2004).

¹⁹ Originalmente medida por Beck et al (2001).

Instituições Informais

A escolha das variáveis que representam as instituições informais segue Tabellini (2007) e Williamson (2008). A fonte de dados são os levantamentos de 1995-1997 e 1999-2000 da *World Values Survey*. A construção desta variável é devida a Williamson (2008) que a nomeou de “cultura”. A variável considera quatro aspectos da cultura (ou da crença média) de um país: controle, respeito, confiança e obediência. Esta última diz respeito ao percentual de pessoas na amostra que mencionaram a “obediência” como um fator importante na sociedade. “Confiança” e “respeito”, de forma similar, representam respostas positivas (“pode-se confiar na maior parte das pessoas” e “tolerância e respeito com relação aos outros”) para estes “valores”, na amostra. Finalmente, “controle” é a resposta média não-condicionada à pergunta que indica a quantidade de liberdade de escolha e controle sobre a própria vida.

A variável “cultura” é obtida, então, pela soma dos valores de “controle”, “respeito” e “confiança” e subtração do valor de “obediência”. Em que sentido esta variável pode ser considerada uma *proxy* do “valor” individualismo liberal acima citado? Inicialmente vejamos a crença negativa, “obediência”. Considere o trecho a seguir:

Poderíamos até perguntar: se um indivíduo nasce com a obrigação de obedecer, quem nasce com o direito de comandar? Se alguém deseja uma teoria das obrigações coerente, deverá existir alguém, seja um indivíduo ou um grupo, com o direito à satisfação dessas obrigações. Se eu sou constituído como um indivíduo por minha obrigação de obedecer, quem será constituído como indivíduo pelo direito a minha obediência? Tal teoria da obrigação pode ter sido coerente na era dos direitos divinos dos reis, mas ela parece um pouco fora de lugar no mundo moderno. [Palmer (2008)]

Observe que não se trata de questionar o valor “obediência” tal como colocado, por exemplo, na forma de acordos informais (por exemplo, hierarquia familiar) ou formais (exemplo, transações comerciais regidas sob leis). O aspecto anti-individual da obediência diz respeito a uma cultura na qual não se estimula a experimentação e a crítica

por parte dos indivíduos. A obediência, assim, identifica uma característica conservadora, e não liberal²⁰.

Por outro lado, “respeito”, “confiança” e “controle (sobre a própria vida)” são qualidades citadas como importantes no desenvolvimento de trocas, monetárias ou não. Normalmente a discussão sobre os impactos destes valores na sociedade envolvem discussões sobre a distinção entre o “capital social” *bonding* (ou exclusivo) e *bridging* (ou inclusivo²¹). Como destacam Meadowcroft & Pennington (2008), em uma sociedade complexa, “respeito” e “confiança” são importantes elementos para a existência de um mercado que funcione:

The development of bridging social capital, therefore, *necessarily* involves a thin set of morals, such as tolerance of others, the observance of contracts and respect for private property, that can be shared by actors with otherwise diverse and perhaps even conflicting moral codes. [Meadowcroft & Pennington, 2008, 124]

A variável “controle”, finalmente, é uma das mais óbvias dimensões da liberdade individual. Expressa, conforme Tabellini (2007), a idéia de que o esforço individual é recompensador²². É fácil pensar em um exemplo extremo no qual o esforço individual não compensa: a escravidão. Um exemplo menos extremo é o do indivíduo cujo trabalho é submetido a uma carga tributária incompatível com a qualidade de serviços públicos ofertados.

A combinação destas variáveis, na forma como postulada por Williamson (2008), tenderia a ter um impacto negativo na falência estatal, já que contribuiria para a formação de uma governança mais responsável no fornecimento de bens públicos, ao mesmo tempo que não estimularia a discriminação de grupos sociais em prol de outros.

²⁰ Ver, por exemplo, o posfácio “Por que não sou um conservador” em Hayek (1983) ou o capítulo quinto de Postrel (1998).

²¹ O primeiro diz respeito ao capital social que existe entre grupos de pessoas que dividem algum tipo de similaridade como famílias ou membros de uma mesma igreja. Já o segundo ocorreria entre grupos de pessoas mais distintos como os que envolvem trocas econômicas.

²² Em outras palavras, em um contexto de liberdade no uso das próprias capacidades, *no pain, no gain*.

Controles

As variáveis de controle utilizadas foram²³:

- a) GDPGROWTH_90_00 – Logaritmo do crescimento do PIB per capita, em paridade do poder de compra, US\$ de 2000, no período 1990-2000
- b) YEARSSCHOOLING_60 – Logaritmo do número de anos de escolaridade da população total acima de 25 anos, medido em 1960. Esta variável foi obtida de La Porta et al (1999).
- c) URBANPOP_9000 – Logaritmo do percentual da população urbana, média para os anos 1990-2000. Obtida na base de dados *World Development Indicators* (WDI) do Banco Mundial.
- d) GOVCONS_902000 – logaritmo do consumo real do governo medido em percentual do PIB, média para o período 1990-2000. Obtida na base de dados *World Development Indicators* (WDI) do BancoMundial.

Considerando Possível Endogenia

As variáveis que representam as instituições formais e informais podem ser endógenas. Ou seja, a correlação entre as variáveis que captam o efeito das instituições sobre a falência estatal e os resíduos (ϵ) é diferente de zero. Reconhecendo o problema da endogenia (causalidade reversa, erro de mensuração e omissão de variáveis), utilizou-se, aqui, o método de MQ2E com variáveis instrumentais. As equações de primeiro estágio:

$$I_i = \phi_1 + \phi_2 W_i + u_i \quad (2)$$

$$F_i = \psi_1 + \psi_2 Z_i + v_i \quad (3)$$

²³ Seguimos Williamson (2008). Contudo, ajustamos o período de algumas variáveis para 1990-2000.

Assim, seguindo Williamson (2008), a origem do código legal é o instrumento (Z) para as instituições formais (F) enquanto que a latitude é utilizada como instrumento (W) para a parcela informal das instituições (I), isto é, a cultura. Espera-se que tais instrumentos sejam suficientes para isolar o canal pelo qual tanto as instituições formais quanto as informais afetam a falência estatal. Ou seja, para Williamson (2008), Z e W são correlacionados com F e I (respectivamente) mas não são correlacionados à ε^{24} . Latitude e código legal podem ser assim descritos:

- a) LAT_ABST – Latitude do país, medida em valor absoluto. Quanto mais próximo de 0, mais próximo do Equador. Obtida de La Porta *et al* (1999).
- b) LEGOR_UK(_sil) – Variável *dummy* assumindo valor 1 (um) se o código legal do país é de origem britânica. Obtida em La Porta *et al* (1999).

Uma vez estimados (2) e (3), pode-se computar a seguinte equação de segundo estágio:

$$Y_i = \alpha + \beta_1 \hat{F}_i + \beta_2 \hat{I}_i + \sum_i \delta_i X_i + \varepsilon_i \quad (4)$$

na qual o vetor X inclui as variáveis de controle citadas anteriormente. Realizamos teste para endogeneidade (teste "Durbin-Wu-Hausman") nas regressões estimadas via variáveis instrumentais tal como descrito em Hayashi (2000). A hipótese nula do teste afirma que os estimadores de MQO da mesma equação gerariam resultados consistentes, ou seja, a endogeneidade dos regressores instituições formais e informais não apresentariam efeito deletério sobre as estimativas de MQO. Portanto, a rejeição da hipótese nula sugere que os regressores são endógenos e que variáveis instrumentais seriam mais adequados. A estatística segue distribuição Qui-quadrado com “m” graus de

²⁴ Williamson (2008) cita literatura pertinente para defender “latitude” e “código legal” como instrumentos válidos [por exemplo, Acemoglu and Johnson (2005) e Easterly and Levine (2003)]. Usaremos, além disso, teste de endogeneidade dos regressores instituições formais e informais. Ver Hayashi (2000).

liberdade, em que “m” é o número de regressores especificados como endógenos na regressão de variáveis instrumentais.

Resultados

Na Tabela 1 são apresentados os resultados das regressões simples e múltiplas estimadas via MQO. Podemos notar, nas regressões simples (1 a 5), que a única variável não significativa ao nível de 10% é a “revisão constitucional” (sinal negativo). O parâmetro estimado da “cultura” sugere impacto negativo como esperado. Os coeficientes de “independência do judiciário”, “representação proporcional” e “revisão constitucional” apresentam sinal negativo (também como esperado).

Nas colunas 6 a 9 da Tabela 1 são apresentados os resultados das regressões nas quais a variável “cultura” é mantida e as outras variáveis que representam as instituições formais são adicionadas uma a uma. Podemos notar que, em todos os casos, apenas as instituições informais exercem impacto negativo e significativo sobre o índice de falência estatal, ou seja, as instituições informais contribuem no sentido de melhorar a qualidade da governança dos estados. Desta forma, os resultados sugerem que a inclusão de medidas que representam instituições formais não contribuem para explicar variação adicional da falência estatal.

A Tabela 2 (regressões 10 a 13) replica as regressões 6 a 9 com a introdução de variáveis de controles tradicionais. Os resultados são, qualitativamente, muito robustos. A variável “cultura” mantém-se significativa (5% de significância) e com o sinal esperado enquanto que as variáveis que captariam a influência das instituições formais sobre o índice de falência estatal não apresentam nível de significância estatística adequada. O mesmo ocorre, na grande maioria dos casos, com os parâmetros estimados das variáveis de controle adicionais, com exceção da “escolaridade”. Devido a possível presença de regressores endógenos, tais resultados devem ser observados com a devida cautela dado que devem estar viesados.

Para suplantar os possíveis problemas de endogenia, utilizou-se o MQ2E com os instrumentos descritos anteriormente. Os resultados são apresentados nas Tabelas 3 e 4 –

univariados (regressões 14 a 16), bivariados (regressões 17 e 18) e com controles adicionais (19 e 20). Vale notar que em apenas 3 regressões os testes sugerem que os regressores são endógenos o que sugere que a endogeneidade dos regressores instituições formais e informais não apresentam efeito deletério sobre as estimativas de MQO. De qualquer forma, nas regressões univariadas, o parâmetro estimado da “cultura” sugere impacto negativo e significativo como esperado (1% de significância). Os parâmetros estimados da “independência do judiciário” e “representação proporcional” não são significativos.

Nos resultados bivariados, a “cultura” (instituições informais) mostra-se altamente significativa e exerce influência negativa sobre o índice de falência estatal. O mesmo não ocorre com as instituições formais. Após a inclusão das variáveis de controle (Tabela 4), o resultado é mantido.

Em suma, tanto usando estimativas em MQO como em MQ2E, apenas as instituições informais exercem impacto negativo e significativo sobre o índice de falência estatal, ou seja, as instituições informais parecem dominar as instituições formais no sentido de contribuir para a melhoria da qualidade da governança dos estados.

Conclusões

Critical failing states are not failing because of one bad experience with government. They have significant histories of failing governments owing to multiple compounding factors that extend far back in their histories. [Leeson & Williamson (2008), p.9]

A história econômica é o laboratório natural para os que tentam entender os determinantes do desenvolvimento econômico. A evidência histórica mostra que governos (ou Estados) têm papel importante na promoção ou supressão do desenvolvimento econômico.

Instituições formais ou informais têm impactos sobre a sociedade, principalmente no que diz respeito ao funcionamento dos mercados. Não é difícil perceber que estes impactos são distintos e, portanto, as recomendações de políticas pró-desenvolvimento, caso necessárias, não são as mesmas. Mais ainda, instituições informais podem apresentar

uma dinâmica mais complexa do que as formais. Em outras palavras, é mais difícil entender como mudam os aspectos culturais de uma sociedade e como os mesmos influenciam o desenvolvimento econômico.

Neste artigo buscamos investigar o papel das instituições formais e informais sobre a qualidade de um governo. Evidências foram encontradas de que as instituições informais (“cultura”) são mais importantes do que as formais. Em resumo: culturas menos estatistas (ou “mais individualistas”) parecem gerar governos de melhor qualidade.

Há muitos pontos a serem explorados na análise do papel das instituições sobre as ações humanas e em como tais ações se convertem em resultados econômicos. Neste sentido, as evidências deste artigo mostram que formuladores de políticas deveriam atentar para os impactos de diferentes instituições (principalmente as informais) sobre a qualidade do estado ao invés de tomá-las, muitas vezes, como dadas. As consequências (não-)intencionais podem ser temerosas no longo prazo.

Bibliografia

Acemoglu, Daron, and Simon Johnson. (2005). “Unbundling Institutions,” *Journal of Political Economy* 113(5): 949-995.

Acemoglu, D. , Ticchi, D. & Vindigni, A. Emergence and persistence of inefficient states, Dec/2007, mimeo. [<http://econ-www.mit.edu/files/2215>].

Bénabou, R. Ideology. *NBER Working Papers*, Working Paper #13907, Cambridge, 2008. [<http://www.nber.org/papers/w13907>].

Beck, T.G. Clarke, A. Groff, P. Keefer, and P. Walsh. (2001). “New Tools in Comparative Political Economy: The Database of Political Institutions,” *World Bank Economic Review* 15(1): 165-176.

Berkowitz, Daniel & Pistor, Katharina & Richard, Jean-Francois, 2003. "Economic development, legality, and the transplant effect," *European Economic Review*, Elsevier, vol. 47(1), pages 165-195, February.

Boettke, P.J.; Coyne, C.J. & Leeson, P.T. Institutional Stickiness and the New Development Economics. *American Journal of Economics and Sociology*, v.67, n.2, Apr/2008, pp:331-358.

- Caplan, B. The myth of the rational voter: why democracies choose bad policies. Princeton, Princeton University Press, 2007, 280p.
- Carilli, A.M., Coyne, C.J. & Leeson, P.T. Government intervention and the structure of social capital. *Review of Austrian Economics*, v.21, Jan/2008, pp: 209-218.
- Carnoy, M. Estado e Teoria Política. São Paulo, Papirus Editora, 1988.
- Easterly, W. and R. Levine. (2003). “Tropics, Germs, and Crops: How Endowments Influence Economic Development,” *Journal of Monetary Economics* 50: 3-40.
- Faria, J.R. Is there an Optimal Constitution? *Constitutional Political Economy*, v.10, n.2, June/1999.
- Glaeser, Edward L., Rafael La Porta, Florencio Lopez-De-Silanes, and Andrei Shleifer. (2004). “Do Institutions Cause Growth?” *Journal of Economic Growth* 9: 271-303.
- Hayashi, F. Econometrics. Princeton, Princeton University Press, 2000.
- Hayek, F.A. von. Individualism and Economic Order. Chicago, The University of Chicago Press, 1948.
- Hayek, F.A. von. Por que não sou um conservador. In: Hayek, F.A. von. *Os Fundamentos da Liberdade*, Editora Visão, São Paulo, 1983 [original de 1960].
- Higgs, R. Crisis and Leviathan - Critical Episodes in the Growth of American Government. Oxford University Press, 1987 xxxx
- Holcombe, R. G. Government: unnecessary but inevitable. *The Independent Review*, v.8, n.3, Winter/2004.
- Kuran, T. *Private Truths, Public Lies: The Social Consequences of Preference Falsification*. Cambridge, Mass.: Harvard University Press, 1995 xv + 423 pp.
- La Porta, R. F. Lopez-de-Silanes, C. Pop-Eleches and A. Shleifer 2004 “Judicial Checks and Balances” *Journal of Political Economy* 112: 445-469.
- La Porta, R, F. Lopez-de-Silanes, A. Shleifer and R. Vishny 1999 “The Quality of Government” *Journal of Law, Economics and Organization* 15: 222-279.
- Leacock, S. Hellements of Hickonomics. Dood, Mead & Company, 1936, New York.
- Pipes, R. Propriedade e Liberdade. Rio de Janeiro, Editora Record, 2001.

Leeson, P. & Williamson, C. Anarchy and Development: An Application of the Theory of Second Best. Mimeo, 2008.

Lewis, P. Uncertainty, Power and Trust. *Review of Austrian Economics*, v.21, Jan/2008, pp:183-198.

Meadowcroft, J. & Pennington, M. Bonding and bridging: Social capital and the communitarian critique of liberal markets. *Review of Austrian Economics*, v.21, Jan/2008, pp: 119-133.

North, D. C. Structure and Change in Economic History. New York, W.W. Norton & Cia, 1989.

Olson, M. *Power and Prosperity:outgrowing communist and capitalist dictatorships*. Basic Books, 2000.

Palmer, T.G. Os mitos do individualismo. In: Ordem Livre. Disponível em <http://www.ordemlivre.org/node/101>. Acesso em 21.04.2008.

Pande, R. & Udry, C. Institutions and Development: A View from Below, Nov/2005. (mimeo).

Postrel, V. *The future and its enemies*. Simon & Schuster, New York, 1998.

Scully, G.W. The institutional framework and economic development. *The Journal of Political Economy*, v.96, n.3, pp.652-662, Jun/1988.

Soto, H. de . *O mistério do capital*. Editora Record, Rio de Janeiro, 2001.

Stringham, E.P. *Anarchy and the Law*, The Independent Institute, New Bruswick, 2007.

Tabellini, G. The Scope of Cooperation: values and incentives. *Quarterly Journal of Economics*, forthcoming.

Williamson, C.R. Securing Private Property: The Relative Importance of Formal versus Informal Institutions. Disponível em <http://www.claudiawilliamson.com>. Acesso em 01.04.2008.

World Public Organization. *Erosion of support for free market system: global poll*. World Public Organization, 15 de Abril de 2008. Acesso em 23 de Abril de 2008. <
http://www.worldpublicopinion.org/pipa/articles/home_page/471.php?lb=hmpg2&pnt=471&nid=&id=>.

Tabela 1 - Regressões Iniciais

Variável Dependente: Índice de Falência Estatal									
	Resultados Univariados					Resultados Bivariados			
	1	2	3	4	5	6	7	8	9
Cultura	-0.5090*** (0.0588)					-0.5276*** (0.0706)	-0.5224*** (0.0540)	-0.5555*** (0.0658)	-0.5203*** (0.0581)
Independência Judicial		-20.2176** (8.7730)				-12,09 (11.2842)			
Representação Proporcional			-16.6443*** (3.6591)				-8.7686 (6.5881)		
Revisão Constitucional				-11,7 (13.0903)				-16,4 (11.7877)	
Pluralismo					14.9974*** (4.4780)				5.4327 (5.0409)
Constante	122.1528*** (7.5712)	77.0137*** (6.1533)	78.2252*** (2.5471)	69.1447*** (8.0628)	59.1608*** (3.8091)	132.6508*** (10.2718)	129.2164*** (7.7437)	136.6624*** (11.8045)	119.3413*** (9.2509)
R2	0.40	0.05	0.12	0.01	0.08	0.47	0.48	0.48	0.46
Estatística F	74.98	5.31	20.69	0.80	11.22	41.51	57.43	38.59	51.68
Prob > F	0.0000	0.0243	0.0000	0.3747	0.0010	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
Número de Observações	75	68	149	70	156	47	72	47	73

Nota: Erro-Padrão entre parênteses. Nível de significância: *** a 1%, ** a 5%, * a 10%.

Tabela 2 - Mínimos Quadrados Ordinários c/controles				
	Var Dep: Índice de Falência Estatal			
	10	11	12	13
Cultura	-0.3091** (0.1257)	-0.2912** (0.1158)	-0.2957** (0.1232)	-0.2933** (0.1131)
Independência Judicial	11.1585 (12.3852)			
Representação Proporcional		2.1509 (5.3633)		
Revisão Constitucional			-7.7673 (12.8868)	
Pluralismo				-3.2872 (4.6526)
Log do Crescimento do PIB	-11.0312** (5.4839)	-8.6331 (5.4881)	-9.4074 (6.0659)	-8.9391* (5.4148)
Log da Escolaridade em 1960	-19.0248*** (4.9957)	-17.0967*** (4.5043)	-18.8788*** (4.9728)	-16.1451*** (4.4280)
Log População Urbana	-1.7414 (5.5738)	-3.7318 (9.8548)	-3.8678 (8.8701)	-4.6873 (9.6581)
Log Consumo Governamental	5.5738 (17.3390)	-1.4693 (14.5258)	5.2356 (16.8552)	-3.4325 (13.0651)
Constante	53.6575 (48.4208)	93.7003* (46.7273)	81.1003** (34.4140)	104.3314** (40.2000)
R2	0.70	0.69	0.70	0.69
Estatística F	28.38	19.67	19.44	20.38
Prob > F	0.0000	0.0000	0.0000	0.0000
Número de observações	35	39	35	39

Nota: Erro-Padrão entre parênteses. Nível de significância: *** a 1%, ** a 5%, * a 10%.

Tabela 3: MQ2E com Variáveis Instrumentais

	Índice de Falência Estatal				
	Resultados Univariados			Resultados Bivariados	
	14	15	16	17	18
Cultura	-0.7291*** (0.1432)			-0.7717*** (0.1456)	-0.7210*** (0.1462)
Independência Judicial		17.1493 (21.8109)		-6.3880 (19.0731)	
Representação Proporcional			-12.4806 (9.8905)		2.8275 (14.3420)
Constante	150.1250*** (18.6547)	49.2524*** (16/6682)	75.8856*** (2.5471)	160.3676*** (20.3076)	145.6167*** (18.8260)
Teste de Endogeneidade	3.11	4.32	0.23	4.5	2.35
P-valor (Teste de Endogeneidade)	0.08	0.04	0.64	0.11	0.31
R2 Não Centrado	0.89	0.44	0.90	0.86	0.89
R2 Centrado	0.33	-0.12	0.11	0.38	0.39
Estatística F	25.23	0.60	1.57	15.61	12.55
Prob > F	0.0000	0.4413	0.2121	0.0000	0.0000
Número de observações	75	68	149	47	72

Nota: Erro-Padrão entre parênteses. Nível de significância: *** a 1%, ** a 5%, * a 10%.

Instrumentos Utilizados: Latitude e Código Legal Inglês.

Tabela 4 - MQ2E com Instrumentos e Controles		
	Var Dep: Índice de Falência Estatal	
	19	20
Cultura	-1.2310** (0.5428)	-1.0274** (0.5218)
Independência Judicial	-15.9105 (41.5280)	
Representação Proporcional		3.2155 (13.1262)
Log do Crescimento do PIB	-9.9894 (6.5824)	-9.8132** (4.7123)
Log da Escolaridade em 1960	8.9963 (16.9345)	3.2191 (13.6963)
Log População Urbana	-31.0736 (22.6655)	-17.8317 (14.2868)
Log Consumo Governamental	49.6427 (31.7798)	27.3236 (28.0754)
Constante	168.4725 (121.8198)	139.7239** (64.0245)
Teste de Endogeneidade	4.67	3.04
P-valor (Teste de Endogeneidade)	0.10	0.22
R2 Não Centrado	0.7469	0.8337
R2 centrado	-0.03	0.27
Estatística F	6.86	7.95
Prob > F	0.0001	0.0000
Número de observações	35	39

Nota: Erro-Padrão entre parênteses. Nível de significância: *** a 1%, ** a 5%, * a 10%.
Instrumentos Utilizados: Latitude e Código Legal Inglês.