

Esseitä laittomasta toiminnasta, instituutioista ja talouskasvusta*

Jenni Pääkkönen

VTT, ekonomisti

Suomen Pankki

Mielipiteet valtion tehtävistä vaihtelevat kahden ääripään välillä. Amerikkalainen näkemys mieltää valtion omien intressien edistämisen välineeksi, kun taas eurooppalaista maailman-kuvaa parhaiten vastannee mielikuva valtiosta, joka pyrkii edistämään kansalaistensa hyvinvointia. Ensimmäisen näkemyksen kannattajat korostavat, että valtion tulisi aiheuttaa toimillaan mahdollisimman vähän vääristymiä tai rajoitteita markkinoille. Jälkimmäinen näkemys puolestaan korostaa valtion roolia muun muassa julkishyödykkeiden ja palveluiden tuottajana. Siten valtio saa ja sen tulee tarvittaessa puuttua markkinoiden toimintaan.

Valtion toinen piirre on sen yksinoikeus laatia lakeja ja käyttää voimaa kansalaisiaan kohtaan. Määritelmissä kussakin valtiossa voi olla vain yksi lainvoimainen auktoriteetti

(julkisvalta) ja muut, mahdollisesti kilpailevat, auktoriteetit ovat laittomia (rikollisjärjestö tai mafia). Voimankäytön yksinoikeus antaa valtiolle valtaa yli kansalaisten ja yritysten, mikä asettaa yksityiset toimijat alttiiksi vallan väärinkäytöksille. Siten myös sääntelyssä ja valvonnassa on kaksi ääripäätä. Jos valtio sääntelee liikaa, yksityinen sektori voi lakata toimimasta (entinen Neuvostoliitto). Jos sääntelyä on liian vähän ja valtio heikko, maa voi ajautua kaaokseen (Afganistan). Siksi ei ole suoraviivaisesti niin, että maissa, joissa valtion ajatellaan ajavan kansalaistensa etua, valtiosektorin koko tai valtion laatimien sääntöjen määrä olisi välttämättä suurempi kuin maissa, joissa valtio nähdään välineenä yksityisten intressien edistämiseen.

Näkemykset valtiosta ja sen toimien oikeasta mitoituksesta ovat vanhoja alkaen yli 2000 vuoden takaa muun muassa Platonin teoksesta Valtio. Teoksessa Sokrates pohtii moraalialia, hallintoa, oikeutta ja valtion roolia yhteiskunnassa. Toisaalta Maddison (1991) arvioi kapitalistisen talousjärjestelmän pitkän aikavälin kehityskulkuja ja talouskasvun tekijöitä. Näiden kahden teeman, valtion ja talouskasvun välillä, on vahva linkki. Valtio voi monilla toimillaan

* Kirjoitus perustuu Helsingin yliopistossa 18.12.2009 tarkastettuun väitöskirjaani ”Essays on Illegal Activities, Institutions and Economic Growth”. Esitarkastajina toimivat VTT tutkimusneuvonantaja Kari Albo (ETLA) ja professori Mika Linden (Joensuun yliopisto). Vastaväittäjänä toimi professori Jukka Pirttilä (Tampereen yliopisto) ja kustoksena professori Vesa Kanninen (Helsingin yliopisto).

edesauttaa materiaalisen hyvinvoinnin lisääntymistä, ei pelkästään sen (uudelleen-) jakamista.

Tässä työssä tutkitaan julkisvallan eri toimien vaikutusta yksityiseen talouteen ja laajemmin kansantalouteen. Lisäksi arvioidaan väestön elinolojen ja talouskasvun välistä suhdetta. Ensimmäisessä ja toisessa esseessä pohditaan julkisvallan roolia harmaan talouden synnyssä. Verotus ja sääntely tunnetusti luovat kannustimet harmaalle taloudelle, mutta miten julkisvalta voisi kannustaa yrityksiä pitäytymään virallisessa taloudessa? Entä mikä on veromoraalin rooli talouspolitiikan välitysmekanismissa? Kolmannessa ja neljännessä esseessä tarkastellaan aineellisen vaurauden muodostumisen dynamiikkaa Maddisonin (1991) hengessä. Mikä on instituutioiden, nimenomaan talouden vapautumisen, vaikutus talouskasvuun? Miten instituutiot vaikuttavat muiden tuotannon tekijöiden ja talouskasvun väliseen suhteeseen? Entä onko elinajanodotteen kasvulla suotuisia vaikutuksia kansantalouteen?

Valtion ja rikollisjärjestön kilpailu

Ensimmäisessä esseessä tarkastellaan hallinnon ja järjestäytyneen rikollisuuden vuorovaikutusta ja niiden toimien vaikutusta talouden lailliseen ja laittomaan tuotantoon. Hallitus maksimoi voittoa kolmen muuttujan suhteen: se optimoi tulonsa asettamalla veron tuotannolle, tuottamalla julkishyödykkeitä ja valvomalla laitonta toimintaa. Tutkimuksessa arvioidaan kolmea erilaista skenaariota. Perusmallissa taloudessa on vain laillinen auktoriteetti ja yrittäjät, jotka voivat harjoittaa toimintaansa joko laillisesti tai laittomasti. Tässä osassa osoitetaan, että hallituksen kannattaa kantaa veroa, tuottaa julkishyödykkeitä ja valvoa laitonta tuotantoa.

Toisessa skenaariossa malliin tuodaan rikollisjärjestö, joka on periaatteessa tasavahva hallituksen kanssa. Tässä ympäristössä uutena tuloksena osoitetaan, että aina kun harmaalla sektorilla on toimintaa, mafian kannattaa kerätä suojelurahaa yrityksiltä. Yritysten kannalta tilanne on kiinnostava: pääsääntöisesti molempien yritysten voitot supistuvat mafian aktivoitumisen myötä, sillä mafian tulo lisää laittoman yrityksen tuotantokustannuksia. Tällöin hallitus korottaa veroa, jolloin laillinenkin yritys kärsii. Mafian olemassaolo siis tukee hallituksen veropolitiikkaa. On kuitenkin mahdollista, että hallitusten välinen kilpailu pakottaa laillisen hallinnon lisäämään julkishyödykkeen tuotantoa voimakkaasti, jolloin laillinen yritys itse asiassa hyötyy mafian tulosta.

Mallin kolmannessa versiossa hallitus tekee päätöksensä verosta, julkishyödykkeestä ja lainvalvonnasta ennen kuin mafia tekee päätöksensä suojelurahan keruusta (Stackelberg). Cournot-peliin verrattuna kannettu vero on korkeampi, julkishyödykkeitä tuotetaan vähemmän ja mafian keräämä suojeluraha on korkeampi. Molemmat yritykset kärsivät edelliseen peliin verrattuna. Sekä mafia että hallitus kasvattavat voittoa.

Tutkimuksessa osoitetaan, että hallitus valvoo harmaata taloutta kaikissa olosuhteissa, sillä lainvalvonta tuottaa sille lisätuloja ja tukee veropolitiikkaa. Lainvalvonnasta on haittaa yrityksille, sillä sakkorangaistus on kustannus laittomalle yritykselle, mutta laillinenkin yritys kohtaa sen myötä korkeamman veron. Mafiaan lainvalvonta ei ulotu. Yritysten kannalta ideaalitalanne olisi, että heikolla hallituksella ei olisi oikeutta monitoroida tai sakottaa laitonta tuotantoa.

Veromoraali ja harmaa talous

Optimaalisen talouspolitiikan kannalta on tärkeä tietää, mitkä tekijät vahvistavat harmaata taloutta: verotus, liika sääntely, korruptio vai heikko lainvalvonta. Tässä tutkimuksessa ehdotetaan uutta selittäjää, kulttuuriin kuuluvaa moraalikoodistoa, jota mittaamme uskonnolla. Työ on kirjoitettu yhdessä professori Vesa Kannaisen kanssa.

Esseessä mallinnetaan yrittäjien valintaa kahden sektorin, laillisen ja laittoman, välillä. Hallituksen tavoitteena on optimoida verotulot optimoimalla vero, jonka se kerää laillisilta yrittäjiltä. Verotuloilla katetaan julkishyödykkeiden tuotanto ja tulonsiirrot. Julkishyödykkeet toimivat tuotannontekijänä sekä laillisessa että laittomassa tuotannossa. Yrittäjien moraali vaikuttaa siihen, miten he arvostavat laittomasta toiminnasta saatua tuloa suhteessa lailliseen tuloon. Vastaavasti kuluttajat arvostavat ostamaansa laitonta hyödykettä vähemmän kuin laillista, mikä vaikuttaa hyödykkeen kysyntään.

Teoreettisen mallin avulla osoitetaan, että moraalitunteet vaikuttavat talouspolitiikan transmissiomekanismiin. Veronkorotus on omiaan kasvattamaan harmaata taloutta, ja sen vaikutus voimistuu alhaisen veromoraalin valitessa. Julkishyödykkeiden suhteen saadaan vastaava tulos. Julkishyödykkeiden lisääminen supistaa harmaata taloutta, ja vahva veromoraali vahvistaa tätä vaikutusta.

Harmaan talouden koosta ei ole olemassa havaintoaineistoa, joten sen arvioimiseen käytetään rakennemallia. Menetelmän idea on varsin yksinkertainen, joskin vaikea toteuttaa empiirisesti virheettömästi. On oltava mitattavia tekijöitä, jotka vaikuttavat harmaan talouden aktiiviteettiin. Lisäksi harmaan talouden aktiivi-

teetin tulee heijastua joihinkin mitattaviin muuttujiin. Silloin tietyillä rajoituksilla harmaa talous voidaan identifioida.

Empiirisen osan kontribuutioita on kaksi. Arvioimme veromoraalia maan pääuskontokunnan avulla. Hypoteesi on, että eri uskontokuntien piirissä veromoraalit poikkeavat, mikä pitäisi näkyä harmaan talouden reaktioissa talouspolitiikkaan. Näiden tulosten valossa näyttää siltä, että eri uskontokunnat eivät poikkea toisistaan veromoraalin suhteen. Sen sijaan reaktiot julkiseen kulutukseen ja tulonsiirtoihin poikkeavat. Sillä on väliä, mihin verotulot käytetään.

Lisäksi tässä työssä osoitetaan, että kaikki mallin identifikaation edellytykset eivät aineistossa täyty parhaalla mahdollisella tavalla. Eriytyisesti osoitetaan, että malliin kuuluu aina vähintään yksi suora vaikutus nk. cause-muutujista indikaattoreihin. Aiempien tutkimusten tulokset ovat mitä ilmeisimmin harhaisia, eikä harmaata taloutta ole niissä luultavasti aidosti identifioitu. Siksi tässä työssä ei tuoteta lainkaan harmaan talouden kokoa heijastavaa aika-sarjaa.

Instituutiot ja talouskasvu

Talouden instituutioiden (poliittisten ja taloudellisten) ja talouskasvun välistä yhteyttä on tutkittu laajasti. Konsensus tuntuu olevan, että hyvät instituutiot edistävät talouden kehittymistä. Toisenlaisiakin näkemyksiä on esitetty, sillä useat aiemmat tutkimukset eivät ole pystyneet eristämään vaikutuksen suuntaa. Tässä esseessä pureudutaan tähän problematiikkaan siirtymätalouksien kontekstissa.

Siirtymätaloudet tarjoavat ideaalisen joukon maita instituutioiden, inhimillisen pääoman ja talouskasvun suhteen selvittämiseen.

Ensinnäkin otoksen maat ovat hyvin homogeenisiä inhimillisen pääoman suhteen samalla kun niiden instituutioiden välillä on huomattavia eroja. Toisaalta siirtymätaloudet ovat nimensä mukaisesti muuttumassa suunnitelmatalouksista markkinatalouksiksi Neuvostoliiton romahduksen jälkeen. Tässä prosessissa maat ovat luoneet uudelleen markkinatalouteen kuuluvat instituutiot, jolloin ne ovat riippumattomia talouden alkutulosta. Siten linkki talouskasvun ja instituutioiden kehittyneisyyden välillä tulee kontrolloiduksi.

Tässä tutkimuksessa osoitetaan, että talouden vapauden ja talouskasvun välinen suhde on aiemmin ajateltua monimutkaisempi. Näyttää siltä, että heikolla lähtötasolla instituutioiden vaikutus talouskasvuun on pelkästään positiivinen, mutta talouden vapautumisen myötä instituutioiden vaikutus muuttuu negatiiviseksi instituutioiden ja yksityisten investointien negatiivisen yhteisvaikutuksen myötä. Vapaa markkinatalous ja korkeat yksityiset investoinnit voivat syödä talouskasvua (tuottavuuden kasvua). Talouden vapautta voi olla liikaa.

Väestönkasvu ja tuloerot

Kasvututkimuksessa on jo hyvän aikaa sitten todettu, että eri tavoin heterogeenisten maiden väliset tuloerot eivät näytä supistuvan. Tässä tutkimuksessa tarkastellaan, voidaanko väestömuuttujien avulla jakaa maat riittävän homogeenisiin maaryhmiin, jolloin vähenevän rajatuottavuuden mukaisesti köyhemmät maat kasvaisivat rikkaita maita nopeammin ja tuloerot vähitellen kuroutuisivat umpeen. Tämä essee on kirjoitettu yhdessä professori Ulla Lehmijoen kanssa.

Väestönmuutos ilmenee samanaikaisesti useissa muuttujissa, mutta viimeisen kymme-

nen vuoden aikana useat tutkijat ovat korostaneet elinajanodotteen merkitystä. Elinajanodotteella on vaikutusta muun muassa siksi, että pidempi elinajanodote tekee kannattavaksi investoinnit koulutukseen eli inhimilliseen pääomaan. Pidempi elinaika siten edistää tuottavuuden kasvua.

Elinajanodotteen avulla maat jaetaan kolmeen ryhmään, jotka vastaavat karkeasti Galorin ja Weilin (2000) Malthusilaista, jälki-Malthusilaista ja vakaan kasvun klubeja. Tutkimuksessa arvioimme ryhmien sisäistä konvergenssia vuosina 1960–2003 yksikköjuuritestin eri versioiden avulla ja lopuksi arvioimme ryhmien välistä konvergenssia tulevaisuudessa.

Aikaisemmin laajasti käytetty, joskin ilmeisen harhainen, beta-konvergenssi puhuu tuloerojen supistumisen puolesta. Tässä työssä osoitetaan, että aineistossa esiintyy poikkileikkausriippuvuutta, minkä johdosta niin kutsutut ensimmäisen sukupolven yksikköjuuritestit ovat harhaiset, vaikka vertailun vuoksi nekin tulokset esitetään. Ensimmäisen sukupolven testit tukevat konvergenssia, mutta vähiten harhaiset testit, IPS ja Pesaranin (2007) myöhempi modifikaatio siitä eivät tue tätä löydöstä.

Luotettavimmat tulokset puhuvat vahvasti väestönmuutoksen ja tuloerojen supistumisen yhteyttä vastaan. Saatujen tulosten valossa näyttää siltä, että väestönmuutos ei yksinään riitä ajamaan tuloerojen supistumista vaan tarvitaan aktiivisia toimia, jotta maiden väliset tuloerot eivät repeä entisestään. □

Kirjallisuus

Galor, O. ja Weil, D.N. (2000), "Population, Technology and Growth: From Malthusian Stagnation to Demographic Transition and Beyond", *American Economic Review* 90: 806–828.

Maddison, A. (1991), *Dynamic Forces in Capitalist Development: A Long-Run Comparative View*, Oxford University Press.

Pesaran, M. (2007), "A Simple Panel Unit Root Test

in the Presence of Cross-Section Dependence", *Journal of Applied Econometrics* 22: 265–312.

Platon (390 eea), *Valtio*, Otava (suom. Marja Itkonen-Kaila, 2006).