

УДК 330.113.2

Бурлуцька С.В., к.е.н., доцент

Одеський національний економічний університет

ЕКСПОРТНА ДЕТЕРМІНАНТА СОЦІАЛЬНО-ЕКОНОМІЧНОЇ ПРУЖНОСТІ

В статті здійснено дослідження впливу експортної детермінанти на параметри соціально-економічної пружності в умовах збурення. Доведено справедливість висновків щодо негативного впливу високої концентрації (низької товарної диверсифікації) експорту на реакцію економіки від шоків збурень. Визначено кількісні показники структурних зрушень в експорті України в залежності від фази пружної реакції.

Ключові слова: експортна детермінанта, соціально-економічна пружність, концентрація, диверсифікація, структурні зрушення.

Burlutska S.

THE EXPORT DETERMINANT OF SOCIO-ECONOMIC RESILIENCE

Research of effect export determinants on parameters of socio-economic resilience in terms of destruction is instrumented in the paper. Right conclusions of rather negative influence of high export concentration (low commodity diversification) on economic reaction to shock destruction are proved. Quantitative rates of structural shifts in Ukrainian export of depending on a resilience reaction phase are defined.

Keywords: export determinant, socio-economic resilience, concentration, diversification, structural shifts.

Бурлуцкая С.В.

ЭКСПОРТНАЯ ДЕТЕРМИНАНТА СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКОЙ УПРУГОСТИ

В статье проведено исследование влияния экспортной детерминанты на параметры социально-экономической упругости в условиях возмущения. Доказана справедливость выводов о негативном влиянии высокой концентрации (низкой товарной диверсификации) экспорта на реакцию экономики на шоковое возмущение. Определены количественные показатели структурных сдвигов в экспорте Украины в зависимости от фазы упругой реакции.

Ключевые слова: экспортная детерминанта, социально-экономическая упругость, концентрация, диверсификация, структурные сдвиги

Постановка проблеми у загальному вигляді і її зв'язок з важливими науковими та практичними завданнями. Функціонування сучасного світового господарства нерозривно пов'язане з розвитком глобалізаційних та інтеграційних процесів, посиленням взаємозв'язку та взаємодії структурних зрушень. Сформована в процесі еволюційних або революційних зрушень структура національної (регіональної) соціально-економічної системи обумовлює її ефективність та місце у світовому господарстві. З точки зору системної парадигми, у першому наближенні, проявом зовнішніх зв'язків відкритої економічної системи є експортно-імпорتنі потоки. А отже екзогенними чинниками структурних зрушень виступатиме кон'юнктура на світових ринках, а ендогенними – фактична спроможність національної (регіональної) системи генерувати відповідні товарні потоки. Світова фінансова криза 2008-2009 років, сучасні події в Україні були і є джерелом суттєвих збурень для національної економіки та

чинником структурних зрушень в системних та міжсистемних зв'язках. Саме це обумовлює актуальність дослідження впливу експортної детермінанти (її структурних характеристик) на розвиток соціально-економічної системи.

Аналіз останніх досліджень, у яких започатковано вирішення проблеми. В загальній теорії систем структурна диверсифікація відіграє ключову роль в забезпеченні надійності розвитку. Достатньо повний аналіз методичного інструментарію оцінки структурних чинників економічної динаміки наведено в останній публікації проф. Н. Михеєвої [1]. Комплексне дослідження впливу структурних змін та технологічного розвитку на ефективність еволюційних систем представлено у роботі проф. О. Сухарева [2]. Аналіз впливу дестабілізуючих чинників на регіональні відмінності розвитку в умовах структурної трансформаційної кризи присвячено дослідження проф. Л. Ковальської [3]. Разом з традиційними статистичними методами дослідження ступеню структурних змін доводиться доцільність використання ентропійних показників для оцінки диверсифікації зовнішньоторгового обороту в публікації проф. Г. Бакурової [4]. Разом з тим поза увагою вітчизняних дослідників залишається проблематика пружності соціально-економічних систем, як реакції на внутрішні та зовнішні збурення з метою збереження своєї функціональності та цільності. Структурні зрушення в експортних потоках є однією з визначальних детермінант пружної реакції на шоки як національної економіки, так і окремого регіону.

Цілі статті. Основною метою статті є дослідження впливу експортної детермінанти на параметри соціально-економічної пружності в умовах шокового збурення.

Виклад основного матеріалу дослідження з повним обґрунтуванням отриманих наукових результатів. Безсумнівною перевагою диверсифікованих економік вважається їх менша чутливість до коливань динаміки окремих галузей та шокових збурень. Спад в одній галузі може компенсуватися ростом в іншій, що забезпечує стабільність економіки в цілому. Це також сприяє формуванню ефективної зайнятості: згладжування шоків в окремих галузях; формування більш гнучкого ринку праці за рахунок міжгалузевого переливу робочої сили. Різні ступінь еластичності попиту та пропозиції окремих галузей, відмінності у експортній орієнтації виробництв, диспропорції у капіталі та працездатності (загалом диверсифікація економічних структур) гіпотетично повинні не тільки забезпечити меншу уразливість соціально-економічної системи до шоків, але й більш високі темпи відновлення від шоку. Система з спеціалізованою економічною базою буде більш сприйнятлива к певним (притаманним домінуючим галузям) шокам та матиме менші можливості до переорієнтації. Практично різноманітність альтернативних шляхів відновлення економіки залежить від специфіки існуючої спеціалізації. Так, домінування добувної промисловості матиме різний вплив на пружність соціально-економічної системи порівняно, наприклад, з переважаючим сектором високих технологій.

Систему структурних зрушень вважають специфічним чинником динаміки ефективності функціонування соціально-економічної системи. Основним показником ефективності економічної структури є максимізація національного продукту або у випадку регіонів – валового регіонального продукту. Формування національного (регіонального) продукту є результатом: по-перше, існуючої структури випуску(складу та пропорцій між галузями) ; по-друге, спрямованістю та структурою інвестицій; по – третє, внутрішнім та зовнішнім попитом. Значний промисловий потенціал України, сформований ще у часи СРСР, не можливо було реалізувати тільки в межах

національної економіки. Значну частину продукції вітчизняної обробної та видобувної промисловості отримували закордонні споживачі. Так, за даними Державної служби статистики, за останні 5 років частка експорту товарів та послуг в структурі ВВП складала від 56,4% до 52,2% (у фактичних цінах). Разом з тим досить у експортних потоках відбувалися значні структурні зрушення. Чинниками цих зрушень стали відсутність інвестицій спрямованих на модернізацію промислового комплексу, рентоорієнтована поведінка олігархічних структур, офшорна організація бізнесу [5, с.42]. Сформовані таким чином абсолютні та відносні переваги у міжнародній торгівлі забезпечили збагачення обмеженого кола зацікавлених осіб, та разом з тим стали драйверами системної економічної кризи та втрати Україною спроможності адсорбувати (пружно реагувати) на шоківі збурення.

Фахівці бюджетного управління МВФ Н. Коста Нето та Р. Ромеу у результаті дослідження впливу фінансової кризи 2008-2009 років на обсяги експорту країн Латинської Америки визначили певні істотні залежності [6, р.4]: різноманітність експорту сприяє підвищенню продуктивності країни, а тому продуктова диверсифікація торгівлі здатна обумовлювати наслідки впливу кризи (криза створює більш несприятливий вплив на менш продуктивні виробництва або галузі). Це дозволяє висунути гіпотезу щодо можливості існування аналогічної залежності для вітчизняної економіки. Для аналізу концентрації торгівлі (експорту) використовується показник подібний до індексу Герфіндаля-Гіршмана. Експорт поділений на n груп, частка S_i (у відсотковому виразі) кожної групи піднесена до квадрату, а індекс концентрації є сумою отриманих значень (максимальний рівень концентрації 10000):

$$IHH = \sum_{i=1}^n S_i^2. \quad (1)$$

Результати проведених розрахунків (рис.1) не дозволяють ідентифікувати безумовний якісний зв'язок між обсягами експорту та його товарною концентрацією.

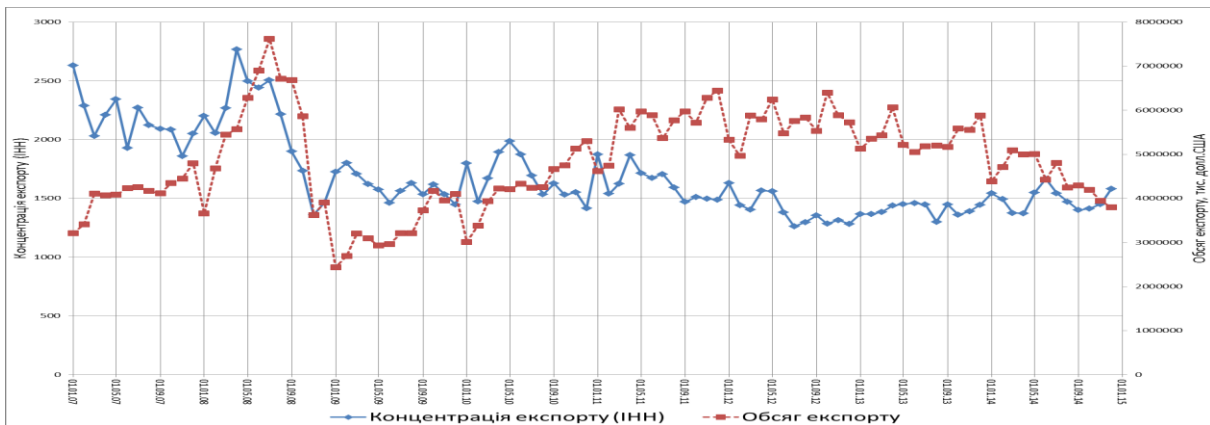


Рис.1. Динаміка обсягу експорту та його концентрації протягом 2007-2014 років

Загалом високий рівень концентрації у докризовому періоді (максимальне значення 2767,7) скоротився до рівня 1300-1600 одиниць у післякризовий період. Разом з тим, існує чітко визначений лаг відставання (3 місяці) екстремумів обсягу експорту від індексу концентрації. З урахуванням компенсації лагового відставання (табл. 1) справедливі такі висновки:

Таблиця 1

Показники структурних зрушень в експортному потоці за 2007-2014 роки

Показник		Період / динаміка обсягу експорту			
		Зростання 01.2007 – 07.2008	Падіння 07.2008 – 01.2009	Відновлення 01.2009 – 12.2011	Падіння 12.2011 – 12.2014
ІНН	Начало	2629,9	2505,3	1726,2	1487,4
	Кінець	2505,3	1726,2	1487,4	1579,8
ІНН (лаг)	Начало	-	2767,7	1736,2	1469,7
	Кінець	2767,7	1736,2	1469,7	1401,1
$\sigma_{d1/d0}$	За період	57,849	38,946	27,256	78,348
	Порівняно з 01.2007		92,752	91,620	208,706
Kg	За період	0,112	0,194	0,153	0,323
	Порівняно з 01.2007		0,256	0,343	0,520
Ks	За період	0,215	0,252	0,263	0,449
	Порівняно з 01.2007		0,269	0,328	0,452
K _r	За період	0,079	0,139	0,109	0,234
	Порівняно з 01.2007		0,184	0,250	0,395

1) у періоді зростання (01.2007 – 07.2008) еластичність експорту за рівнем концентрації складає 11,89 при варіації індексу ІНН не вище 10,44%. Отримані показники досить умовні, що обумовлено неврахуванням даних попередніх періодів, де також спостерігалось зростання;

2) у періоді падіння (07.2008 – 01.2009) показник концентрації скорочується від 2767,7 до 1736,2 одиниць (варіація 17,7%), що обумовлює еластичність експорту на рівні 1,82. Це свідчить, що зростання індексу концентрації експорту (ІНН) продукції до кризи на 1% (100 пунктів) обумовило б зростання на 1,82% обсягу скорочення експорту в умовах кризи. Отже надвисока концентрація експорту (переважно за рахунок домінування складової – «неблагородні метали та вироби з них») обумовила шоковий вплив світової фінансової кризи на вітчизняну економіку. За аналогічний період для країн Латинської Америки зростання індексу торгово-промислової концентрації на одну соту (при базовому середньозваженому рівні 2200 одиниць) приводило до скорочення експорту на 0,47% [6, р5].

3) у період відновлення (01.2009 – 12.2011) середньозважений індекс концентрації не перевищував значення 1631,9 одиниць (варіація 8,95%), а еластичність експорту мала від'ємне значення 4,37. Отже, підвищення диверсифікації продукції сприяло зростанню обсягів експорту. Разом з тим, повного відновлення експортних потоків не відбулося: максимальний обсяг після відновлення 6443 млн. дол. США порівняно з докризовим максимумом 7616 млн. долл. США. Зростання диверсифікації обумовлювалося, перед усе, не збільшенням обсягу експорту міноритарних товарних позицій, а скороченням частки домінуючих позицій. До того ж протягом 4 місяців від «дна» кризи індекс концентрації зростав від мінімальних до 1359,9 до максимальних

1801,2 одиниць, що й обумовлювалося більш високою швидкістю відновлення домінуючих позицій над міноритарними.

4) Період падіння (12.2011 – 12.2014) фактично складається з двох часових проміжків. До кінця 2013 року спостерігалися коливання експорту коло рівня 5500 млн. долл. США з періодом 5-6 місяців. З початку 2014 року почалося досить стрімке падіння експорту обумовлене (на відміну від падіння 2008 року) ендегенними причинами – порушенням функціонування промислового комплексу Донецької та Луганської областей, проблемами у монетарному (кредитному) секторах економіки. В цілому еластичність експорту за рівнем концентрації склала 10,8 одиниць. Варіація індексу ІНН не перевищувала 7,03%, а падіння експорту склало 40,9% порівняно з максимумом 12.2011 року. Певне зростання концентрації експорту протягом останніх 4 місяців 2014 року є відображенням майже дворазового зростання частки «продуктів рослинного походження» (від 12,1% до 24,9%) в структурі експорту.

Для оцінки істотності структурних зрушень в дослідницькій практиці використовується сукупність інтегральних індексів. В межах даного аналізу обрано: квадратичний коефіцієнт відносних структурних зрушень ($\sigma_{d1/d0}$), інтегральний показник структурних розбіжностей А. Салаї (Ks), інтегральний коефіцієнт структурних зрушень К. Гатаєва (Kg) та індикатор відносних відмінностей структури В. Рябцева (Kг) [7, 8]. Результати розрахунку квадратичного коефіцієнту відносних структурних зрушень вказують на досить суттєві зміни у структурі експорту. У відносному вимірюванні в період реакції на шок 2008 року структура відхиляється на 92,752%, а у кризовий 2014 рік – на 208,706%. Індикатор В. Рябцева вказує на істотні структурні зрушення протягом 2007-2013 років та значні зрушення у 2014 році. Аналогічні висновки дає аналіз інших інтегральних коефіцієнтів. В цілому масштаб структурних зрушень 2014 року мав значно більші розміри ніж у 2008 році.

Висновки. Проведенні дослідження в цілому підтверджують справедливості висновків щодо негативного впливу високої концентрації (низької товарної диверсифікації) експорту на параметри реакції економіки на шоківі збурення. Цей висновок справедливий як для зовнішніх, так і для внутрішніх драйверів кризи. Результати аналізу експортної детермінанти соціально-економічної пружності вказують на негативний вплив «сировинної» специфіки на здатність України забезпечувати сталий розвиток. Обмеженість формату статті залишає без відповіді питання пов'язане з наявністю випереджального лагу між динамікою рівня концентрації та обсягом експорту. Також потребує додаткового аналізу взаємозв'язок експортних та імпорتنних потоків. Додатково слід зазначити, що у дослідженнях Н. Коста Нето та Р. Ромеу емпірично доведено факт пом'якшення наслідків кризи через галузеву та продуктову диверсифікацію експорту, в той же час географічна диверсифікація не має суттєвого впливу. У випадку вітчизняної економіки перша теза знаходить свою верифікацію, проте нейтральність географічної диверсифікації є досить дискусійною, що обумовлює необхідність додаткових досліджень у цьому напрямку.

Список використаних джерел:

1. Михеева Н. Структурные факторы региональной динамики: измерение и оценка /Н.Михеева// Пространственная экономика. – 2013. – №1. – с. 11-32.
2. Сухарев О. Эволюция экономических систем: структурные изменения, проблемы технологического развития и эффективности / О. Сухарев. – Новочеркасск: «НОК», 2012 – 120 с
3. Ковальська Л. Економічна безпека регіону: оцінка та механізми забезпечення //Л. Ковальська, Л. Савош // Економічний форум. - 2014. - № 4. - С. 89-95.
4. Бакурова А. Энтропийная оценка состояния торгового баланса /А.Бакурова //Бізнес Інформ. - 2013. - № 4. - С. 138-141.

5. Бурлуцький С.В. Рентоорієнтована поведінка суб'єктів вітчизняної економіки в контексті «прокляття ресурсів» / С.В. Бурлуцький, С.В. Бурлуцька // Економіка та право. 2014 - №1 (38). – С.38 – 48
6. Rafael Romeu ; Nelson Samanho da Costa Neto Did Export Diversification Soften the Impact of the Global Financial Crisis? IMF. - Working Paper No. 11/99. – 23 p.
7. Казинец Л. Темпы роста и структурные сдвиги в экономике / Л. Казинец. – М.: Экономика, 1981. – 184 с.
8. Stewart J. Assessing alternative dissimilarity indexes for comparing activity profiles / J. Stewart // Electronic International Journal of Time Use Research. – 2006. – Vol. 3, No. 1. – P. 49 – 59