

СТАТИСТИЧНА ОЦІНКА РІВНЯ ЗБАЛАНСОВАНOSTІ ЗОВНІШНЬОЇ ТОРГІВЛІ УКРАЇНИ

Обґрунтовано необхідність розробки системи показників збалансованості зовнішньої торгівлі, що мають характеризувати різні аспекти зовнішньоторговельної діяльності в їх взаємозв'язку та взаємозалежності. Визначено шляхи приведення статистичного обліку у повну відповідність до міжнародних і європейських стандартів

Постановка проблеми. Зовнішня торгівля відіграє важливу роль у розвитку економіки країни та отриманні нею належного місця у світовому просторі [1]. Існує багато теорій міжнародної торгівлі, за якими науковці намагалися визначити ефективні напрями зовнішньоторговельної діяльності. Але на сьогодні жодна з теорій не відповідає у повній мірі сучасним тенденціям світового економічного розвитку, тим більше, що на практиці мають місце нерівномірності економічного розвитку країни.

Забезпечення повного та достовірного обліку даних зі статистики зовнішньої торгівлі завжди посідало чільне місце у дослідженні зовнішньоторговельної діяльності країни. Останніми роками здійснено значні кроки у формуванні єдиної достовірної інформаційної бази статистики зовнішньої торгівлі для забезпечення відповідною інформацією органів державного управління та інших користувачів цієї важливої для економічного розвитку країни інформації.

Статистика зовнішньої торгівлі призначена розробити систему показників, у якій відображені найважливіші аспекти зовнішньоторговельної діяльності. Кожен показник цієї системи має посісти певне місце в дослідженні зовнішньої торгівлі та охарактеризувати конкретну сферу економічних відносин з іншими державами. В цілому, статистикою зовнішньої торгівлі сформовано систему статистичних показників, за допомогою яких можна оцінити збалансованість зовнішньої торгівлі

України. Однак слід наголосити, що ця система статистичних показників не в повній мірі відповідає вимогам Організації Об'єднаних Націй, Всесвітнього Банку, Євростату та інших міжнародних організацій. Разом з тим, виходячи з аналізу літературних джерел [3; 4; 5; 6], можна стверджувати що комплексне теоретичне та методологічне висвітлення проблеми збалансованості зовнішньої торгівлі досі не здійснено. Приймаючи це до уваги, нами запропонована більш ефективна та дієва система, яка, з одного боку базується на положення сучасної економічної теорії, а з іншого – використовує методичні підходи та положення економічної статистики та галузевих статистик і вимоги статистичних міжнародних організацій і, в результаті, із певною трансформацією підходів з огляду на предмет дослідження, може бути позитивно сприйнята світовою спільнотою та допоможе оцінити рівень збалансованості зовнішньоекономічної діяльності і підвищити її ефективність.

Аналіз останніх досліджень і публікацій. Окремі аспекти статистичної оцінки зовнішньої торгівлі України досліджували А.В. Головач, А.М. Єріна, В.Б. Захожай, Р.М. Моторин, А.В. Сбітнев. В їх працях основна увага приділялась статистиці обсягів зовнішньоекономічної діяльності суб'єктів господарювання, регіонів і держави в цілому. Разом з тим поза полем зору дослідження ще залишаються проблеми побудови показників для оцінки збалансованості зовнішньої торгівлі.

Метою дослідження є обґрунтування

системи показників збалансованості зовнішньої торгівлі на рівні держави відповідно до міжнародних і європейських стандартів.

Виклад основного матеріалу дослідження. Система показників збалансованості зовнішньої торгівлі – це сукупність показників, що характеризують різні аспекти зовнішньоторговельної діяльності в їх взаємозв'язку і взаємозалежності. Ці показники, в свою чергу, поділяються на абсолютні та відносні. До абсолютних належать:

експорт (E) – вартість вивезених товарів і

послуг (дохід від продажу);

імпорт (I) – вартість ввезених товарів і послуг (витрати на придбання);

зовнішньоторговельний оборот (E + I) – обсяг експорту та імпорту;

сальдо торговельного балансу (E – I) – різниця між експортом та імпортом. При позитивному сальдо торговельний баланс називають активним, при від'ємному – пасивним.

Відображення цих показників можна представити на прикладі зведеного зовнішньоторговельного балансу (табл. 1).

Таблиця 1. Зведений зовнішньоторговельний баланс України [2]

(млн.дол.США)

	Експорт		Імпорт		Сальдо	
	2002	2003	2002	2003	2002	2003
Усього	22012,4	27314,8	18168,4	24478,1	3844,0	2836,7
Товари та послуги						
Країни СНД	6807,5	8367,9	9263,8	11845,3	-2456,3	-3477,4
Інші країни світу	15204,9	18946,9	8904,6	12632,8	6300,3	6314,1
в т.ч. країни ЄС	4187,5	5308,5	4321,4	6159,0	-133,9	-850,5
Товари	17957,1	23066,8	16976,8	23020,1	980,3	46,7
Країни СНД	4377,4	6044,4	8968,2	11508,5	-4590,8	-5464,1
Інші країни світу	13579,7	17022,4	8008,6	11511,6	5571,1	5510,8
в т.ч. країни ЄС	3530,0	4559,3	4037,6	5800,2	-507,6	-1240,9
Послуги	4055,3	4248,0	1191,6	1458,0	2863,7	2790,0
Країни СНД	2430,1	2323,5	295,6	336,8	2134,5	1986,7
Інші країни світу	1625,2	1924,5	896,0	1121,2	729,2	803,3
в т.ч. країни ЄС	657,5	749,2	283,8	358,8	373,7	390,4

Дані табл. 1 відображають загальний стан, який склався в зовнішньоторговельній діяльності країн за два роки. За даними цієї таблиці, у 2003 р. порівняно з 2002 р. відбулося зростання зовнішньоторговельного обороту, який становив відповідно 51,8 та 40,2 млрд. дол. США, збільшилися обсяги експорту товарів і послуг (на 24 %) і склали 27 млрд. дол. США, обсяги імпорту теж збільшилися (на 35 %) і склали 24 млрд. дол. США, але експорт переважав імпорт на 2,8 млрд. дол. США, про що свідчить активне сальдо торговельного балансу. Лише у товарообороті з країнами СНД та ЄС як у 2002 р. так і у 2003 р., сальдо від'ємне через значне збільшення обсягу імпорту товарів.

Домінуючу роль в товарообороті відіграє торгівля товарами, частка якої в 2003 р. складала 84,4 % (у 2002 р. – 86,9 %) торговельного обороту, у той час як питома

вага послуг становила лише 15,6 % (у 2002 р. – 13,1 %).

Важливе значення для оцінки рівня розвитку та збалансованості зовнішньої торгівлі мають відносні величини, які дозволяють більш глибоко аналізувати процеси руху експортно-імпортних потоків. До них належать:

Коефіцієнт покриття (табл. 2) – характеризує співвідношення експорту з імпортом, що показує ступінь збалансованості зовнішньої торгівлі:

$$K_n = E / I.$$

При активному сальдо торговельного балансу $K_n > 1$, при пасивному – $K_n < 1$. Різниця $(1 - K_n)$ характеризує масштаб його дефіциту (-) чи профіциту (+).

Таблиця 2. Коефіцієнт покриття імпорту експортом в Україні у 2003 році

	Експорт (млн. дол.)	Імпорт (млн. дол.)	Коефіцієнт покриття
Товари та послуги	27314,9	24478,2	1,12
Товари	23066,9	23020,2	1,00
Послуги	4248,0	1458,0	2,91

Розраховано за даними Держкомстату України [2]

Як видно з табл.2, за 2003 р. в зовнішній торгівлі експорт перевищував імпорт, однак, коефіцієнти покриття з торгівлі товарами та послугами різні. Значення коефіцієнта покриття по торгівлі товарами дорівнює 1,00.

Отже, процес торгівлі товарами відбувався збалансовано. При цьому по торгівлі послугами експорт значно перевищує імпорт, що спричиняє профіцит торговельного балансу.

Таблиця 3. Збалансованість зовнішньої торгівлі України у 2003 році

Рік	Експорт (млн. грн.)	Імпорт (млн. грн.)	ВВП (млн. грн.)	Коефіцієнт відкритості економіки (експортна квота)	Коефіцієнт імпортової залежності
2003	154395	147525	264165	0,58	0,56

Розраховано за даними Держкомстату України [2].

Коефіцієнт відкритості економіки (експортна квота) (табл. 3) – співвідношення експорту з внутрішнім валовим продуктом, що характеризує ступінь відкритості економіки країни:

$$K_{ек} = E / ВВП.$$

За критерієм Світового банку економіка країни вважається відкритою, якщо на макrorівні експортна квота перевищує 35 %, якщо ж її значення значно вище, то економіка вважається “надвідкритою”, що свідчить про залежність від кон’юнктури світових ринків і вразливість до зовнішніх шоків.

Коефіцієнт імпортової залежності (критичний імпорт) (табл. 3) – співвідношення імпорту з внутрішнім валовим продуктом, що характеризує ступінь імпортової залежності країни:

$$K_i = I / ВВП.$$

Безпечним для економіки країни вважається значення $K_i \leq 15\%$, перевищення свідчить про велику залежність економіки країни від зовнішніх поставок, що обумовлюється слабкістю національного виробництва.

Оскільки доходи від експорту мають покривати витрати на імпорт для стабільного розвитку економіки необхідно забезпечити певну пропорцію між імпортовою залежністю та експортною квотою. Оптимальне

співвідношення між ними називають “збалансованістю зовнішньої торгівлі”.

Як видно з табл. 3, у 2003 р. значення коефіцієнта відкритості економіки України 0,58 значно перевищує вказаний критерій і свідчить про надвідкритість економіки, а відтак і про залежність її від кон’юнктури світових ринків і вразливість до зовнішніх шоків. Відповідно меншою є частка внутрішнього ринку в структурі ВВП.

Щодо імпортової залежності, то значення цього коефіцієнту в три рази перевищує безпечну межу.

Така залежність від зовнішніх чинників свідчить про істотний дисбаланс між розвитком зовнішньої торгівлі та розвитком внутрішнього ринку України.

Коефіцієнт покриття функціонально пов’язаний з коефіцієнтом імпортової залежності та експортною квотою:

$$(I/ВВП) \times (E/I) = (E/ВВП).$$

У цілому, економіка вважається відкритою, коли зовнішньоторговельний оборот у відношенні до ВВП більше за одиницю. У 2003 р в Україні значення цього показника становило 1,14.

Структура зовнішньо-торгівельного обороту є динамічною, тобто з кожним роком змінюється питома вага окремих статей експорту, імпорту товарів та послуг. Тому

доцільно розраховувати інтенсивність структурних зрушень за допомогою середнього лінійного або квадратичного відхилення часток:

Інтенсивність структурних зрушень в експорті товарів та послуг оцінюється за допомогою середнього лінійного (\bar{l}) або квадратичного (σ) відхилення часток:

$$\bar{l}_d = \frac{\sum_1^n |d_{i1} - d_{i0}|}{n},$$

або

$$\sigma_d = \sqrt{\frac{\sum_1^n (d_{i1} - d_{i0})^2}{n}},$$

де $d_{i1}-d_{i0}$ – відхилення часток структури відповідно поточного та базисного періоду;
 n – число складових сукупності.

Зазначені показники дозволяють встановити як в середньому змінювалися частки окремих груп експорту та імпорту товарів і послуг. Проаналізуємо ці зміни на прикладі товарної структури експорту (див. табл. 4).

Таблиця 4. Аналіз динаміки та структурних зрушень експорту товарів

Товари	Структура експорту у % до підсумку		Відхилення часток ($d_{02}-d_{01}$)	Темпи приросту (%)
	2002 (d_{01})	2003 (d_{02})		
Всього, у тому числі:	100	100	–	–
Продовольчі товари та сировина для їх виробництва	13,3	11,8	-1,5	-11,3
Мінеральні продукти	12,5	15,2	2,7	21,6
Продукція хімічного та пов'язаних з нею галузей промисловості	7,8	8,4	0,6	7,7
Недорогоцінні метали та вироби з них	39,7	36,8	-2,9	-7,3
Механічне обладнання, машини та механізми та їх частини	9,8	10,1	0,3	3,1
Інші товари	16,9	17,7	0,8	4,7

Розраховано за даними Держкомстату України [2]

Відповідно до даних табл. 4, найбільша частка в експорті товарів припадає на недорогоцінні метали й вироби з них (37 %) та на мінеральні продукти (15 %).

Розглядаючи зміни у товарній структурі експорту в динаміці, можна побачити, що за два роки частка продовольчих товарів зменшилася на 11,3 % а недорогоцінних металеві виробів з них на 7,3 % за рахунок збільшення питомої ваги в експорті інших груп товарів. Найбільш високими темпами зростала частка в експорті мінеральних продуктів (21,6 %).

Наведений аналіз дає можливість детальніше та глибше дослідити процеси діяльності зовнішньої торгівлі в динаміці експорту/імпорту товарів і послуг за їх структурою, а також в геополітичному розрізі.

Важливого значення при аналізі зовнішньоторговельної діяльності має визначення приблизних прогнозних рівнів показників (наскільки це є можливим).

Оскільки величина показників зовнішньої торгівлі змінюється з часом, і ці зміни за відносно сталих умов можуть проявляти певну закономірність, можна виявити загальну тенденцію розвитку. Вона може проявлятися у зростанні або поступовому зниженні рівнів ряду. В свою чергу, таке зростання чи зниження рівнів може відбуватися по-різному: рівномірно, прискорено чи уповільнено. На практиці часто зустрічається ситуація, коли ряди динаміки через коливання рівнів не виявляють чітко вираженої тенденції.

З метою виявлення основної тенденції застосовують різні способи згладжування та аналітичного вирівнювання динамічних показників зовнішньої торгівлі.

Процес аналітичного вирівнювання динамічного ряду показників зовнішньої торгівлі дає змогу не тільки з'ясувати тенденцію розвитку, але й кількісно її

виміряти, а також передбачає, що фактичні значення y_t змінюються обчисленими на основі певної функції $Y = f(t)$, яка називається трендовим рівнянням (де t – зміна часу, Y – теоретичний рівень ряду).

Вибір типу функції ґрунтується на теоретичному аналізі сутності явища. Суттєвим підґрунтям при виборі функції є аналіз ланцюгових характеристик інтенсивності динаміки. На базі конкретних розрахунків нами доведено, що для вирівнювання ряду при аналізі зовнішньої торгівлі доцільно обирати поліноміальний тренд 2-ого ступеня, параболу II-го порядку:

$$Y_t = a + bt + ct^2,$$

де параметр функції a – рівень ряду при $t=0$ (t – порядковий номер періоду),

t – порядковий номер періоду,

b – початкова абсолютна швидкість динаміки,

c^2 – прирощення абсолютної швидкості.

Параметри рівняння визначаються методом найменших квадратів:

$$\sum y = na + b \sum t + c \sum t^2,$$

$$\sum yt = a \sum t + b \sum t^2 + c \sum t^3,$$

$$\sum yt^2 = a \sum t^2 + b \sum t^3 + c \sum t^4$$

Прогнозування рівнів експорту або імпорту може здійснюватись методом екстраполяції тренду (продовження виявленої тенденції за межі динамічного ряду). При цьому прогнозний, очікуваний рівень Y_{t+v} залежить від бази прогнозування та періоду упередження v . Результатом використання цього методу є точковий прогноз, який продемонстрував досить високу точність прогнозу (його середня похибка на 2004 не перевищує 3,5 відсотків).

Змістовний аналіз зовнішньоекономічної діяльності країни передбачає системне використання описаних показників. Це дає комплексну оцінку економічного розвитку держави відносно інших країн світу, допомагає оцінити економічний потенціал і є базою для планування напрямків зовнішньої торгівлі товарами та послугами.

Висновки та перспективи подальших досліджень. Перспективами подальшого

покращення зовнішньоекономічної діяльності України є розвиток співробітництва з ЄС та вступ до СОТ. З 1996 до 2003 р. частка зовнішньоторговельного обороту України та країн ЄС зросла з 12,9 % до 22,5 % від загальної суми, а в абсолютних показниках відповідно з 4,9 млрд. дол. до 10,4 млрд. дол. США. Згідно з прогнозами Міністерства економіки у 2005 р., після вступу до ЄС країн-кандидатів Україна може збільшити зовнішньоторговельний оборот з ЄС приблизно у 1,5 рази – до 15,0-16,0 млрд. дол. США на рік.

Загальний обсяг прямих іноземних інвестицій в Україну з країн-членів ЄС за станом на 1 січня 2004 р. склав 2,4 млрд. дол. США, або 35,8 % від їхнього загального обсягу.

Протягом 2000-2003 років Україна суттєво активізувала переговорний процес зі вступу до СОТ. За станом на 18 лютого 2004 р. Україна підписала 23 двосторонніх протоколи з доступу до ринків товарів та послуг.

У контексті забезпечення правової складової вступу України до СОТ продовжується спільна робота Уряду та Верховної Ради України щодо приведення національного законодавства у відповідність до норм і правил СОТ. Основним завданням на 2005 р. є повне завершення процесу набуття Україною членства в СОТ, зокрема завершення проведення всіх двосторонніх переговорів і розробка проекту звіту Робочої групи з розгляду заявки України про вступ до СОТ та проекту Протоколу про вступ України до СОТ.

Одночасно необхідно постійно здійснювати аналіз та визначати шляхи підвищення конкурентоспроможності економіки України в умовах членства в СОТ через приведення національної системи стандартизації у повну відповідність до міжнародних та європейських стандартів і норм, створення привабливого та безпечного інвестиційного середовища.

У 2005 р. необхідно забезпечити ухвалення законопроектів, спрямованих на наближення законодавства України до законодавства ЄС та відповідних міжнародних норм і стандартів СОТ.

У зв'язку з розширенням ЄС, особливо

гостро постають питання запобігання негативним для України наслідкам розширення ЄС та відвернення загроз торгово-економічної ізоляції від країн Західної та Центральної Європи, уникнути яких можна шляхом повного виконання вимог Угоди про партнерство та співробітництво між Україною та ЄС.

Поглиблення економічних відносин з країнами СНД також є напрямком подальшого розвитку зовнішньоекономічної діяльності України. Країни СНД є головними торговельними партнерами України. Україну з іншими країнами-членами СНД об'єднують такі спільні стратегічні пріоритети, як подолання системної кризи, реформування та розвиток національних економік, проведення ефективної соціальної політики, інтеграція у світовий економічний, інформаційний, політичний та культурний простір.

Подальші дослідження з цих проблем в галузі статистики повинні забезпечити можливість оцінки рівня зовнішньої торговельної діяльності в окремих регіонах і визначення їх ролі в збалансованості економічних відносин України з іншими державами.

ЛІТЕРАТУРА:

1. Закон України “Про зовнішньоекономічну діяльність” № 959 від 16.04.91 р. № 959-ХІІ (зі змінами та доповненнями).

2. Зовнішня торгівля України товарами та послугами у 2003 році. – Стат. зб., том 1 / Держкомстат України. – К. 2004. – 148 с.

3. Зовнішньоторговельна політика в економіках перехідного періоду. – К.: Ін-т екон. розвитку Всесвітнього банку, 1997. – 187 с.

4. Методологічне дослідження “Статистика міжнародної торгівлі товарами: концепції та визначення”, Організація Об'єднаних Націй, Нью-Йорк, 1998. – 402 с.

5. *Світнев А.В.* Вдосконалення механізму регулювання зовнішньоекономічної діяльності України щодо міжнародних організацій (на прикладі вступу до СОТ): Автор. дис... канд. екон. наук: 08.04.04. К. – 2004. – 22 с.

6. Working for the regions. European Union Regional Policy. – Luxembourg-Brussels: ООРЕС, 2001. – 34 р.

МАНЦУРОВ Ігор Германович – кандидат економічних наук, доцент, Київського національного економічного університету.

Наукові інтереси:
– статистичний аналіз

Манцуров І.Г., к.е.н., доц.
Київський національний економічний університет

СТАТИСТИЧНА ОЦІНКА РІВНЯ ЗБАЛАНСОВАНOSTІ ЗОВНІШНЬОЇ ТОРГІВЛІ УКРАЇНИ

Аргументована необхідність розробки системи показників збалансованості зовнішньої торгівлі, що мають характеризувати різні аспекти зовнішньоторговельної діяльності в їх взаємозв'язку і взаємозалежності. Визначені шляхи приведення статистичного обліку у повну відповідність до міжнародних та європейських стандартів

Манцуров И.Г., к.э.н., доц.
Киевский национальный экономический университет

СТАТИСТИЧЕСКАЯ ОЦЕНКА УРОВНЯ СБАЛАНСИРОВАННОСТИ ВНЕШНЕЙ ТОРГОВЛИ УКРАИНЫ

Обоснована необхідність розробки системи показателів сбалансованості зовнішньої торгівлі, які повинні характеризувати різні аспекти зовнішньоторгової діяльності в їх взаємозв'язку і взаємозалежності. Визначені шляхи приведення статистичного обліку у повну відповідність до міжнародних та європейських стандартів.

Mantsurov I.G.

STATISTICAL EVALUATION OF LEVEL OF FOREIGN TRADE EQUILIBRIUM IN UKRAINE

In the article importance of development of system of indexes of foreign trade equilibrium which will characterize different aspects of foreign trade activities in their conformity and interdependency is grounded. Ways of bringing statistical accounting into full compliance with international and European standards are defined.

Ключові слова. Система показників зовнішньої торгівлі, ступінь збалансованості зовнішньої торгівлі, коефіцієнт відкритості економіки, коефіцієнт імпортової залежності, економічна ефективність експорту та імпорту.