

Глава 26. Особенности прогнозирования платежного баланса, системы межотраслевых и внутриотраслевых внешнеторговых процессов

Моделирование платежного баланса в макроэкономической модели. В современной экономике, в которой процессы глобализации в значительной степени определяют резкое увеличение межстрановых финансовых потоков, анализ и прогнозирование их движения становится одним из важнейших направлений экономических исследований.

С этой точки зрения платежный баланс страны представляет собой важнейший набор данных о финансовых потоках во взаимоотношениях с внешним миром. В современных условиях при разработке прогнозов во внешнеторговой сфере уже недостаточно только представления о возможной динамике экспорта и импорта товаров и услуг на уровне экономики или отдельных секторов. Прогноз должен быть комплексным, включающим как показатели внешнеторговых отраслевых потоков, так и динамику основных показателей платежного баланса.

Отражая движение товаров и услуг за границу, а также встречные финансовые потоки, платежный баланс является важным статистическим элементом анализа и прогнозирования экономической динамики. Так, он довольно наглядно характеризует текущее состояние валютно-финансовых отношений страны с внешним миром.

Понятие открытой экономики подразумевает относительно свободное перемещение товаров и финансовых потоков между странами – участниками мирохозяйственных связей, поэтому проблема анализа и учета международных торгово-финансовых потоков становится для России весьма актуальной. Мера эффективности участия страны в мировой торговле и международном разделении труда можно представить по данным платежного баланса страны.

Публикуемые платежные балансы разрабатываются по единой межстрановой методике Международного валютного фонда (МВФ). В настоящее время действует пятое издание этой методики. В соответствии с рекомендациями МВФ существуют два типа балансов: в *аналитическом представлении* – расширенный баланс с детализацией по статьям и *нейтральном представлении* – отражаются лишь основные агрегаты. При этом аналитическое представление составляется с учетом специфики внешнеэкономических отношений данной страны. В современных российских условиях аналитическое представление платежного баланса характеризуется разбивкой основных статей по экономическим секторам. В частности, отдельно рассматривается государственный, банковский и коммерческий секторы, что позволяет исследователям получить более детальную картину влияния внешнеэкономических связей на отдельные показатели экономики. Наличие выделенного «сектора государственного управления» позволяет всесторонне исследовать взаимодействие основных показателей платежного баланса и бюджетной системы.

В хронологии становления современной модели платежного баланса России можно выделить четыре основных периода.

Первый (1992-1996 гг.) характеризовался постоянным наращиванием объемов экспорта на фоне удовлетворительной внешнеэкономической конъюнктуры и резким увеличением доли сырьевых товаров в структуре экспорта. Основными причинами роста экспорта в этот период стали спад внутреннего спроса, наличие большого количества свободных ресурсов, общая социально-экономическая нестабильность в стране. Одновременно с этим импорт после обвала 1992-1993 гг. перешел в фазу уверенного роста со смещением структуры в сторону потребительской составляющей. Решающее значение для показателей платежного баланса имела динамика внешнеторгового оборота. Ввиду неблагоприятной внутриэкономической конъюнктуры значительная часть экспортных доходов (легальными и нелегальными путями) выводилась из страны. Так, за 1992-1996 гг. отток капитала (по методологии платежного ба-

ланса) составил 47 млрд. долл. США. Основным заемщиком на внешних рынках являлось государство, которое остро нуждалось в финансовых средствах для финансирования неотложных нужд. Общий объем заимствований за 1992-1996 гг. составил 49,7 млрд. долл., что сопоставимо с приведенными выше оценками вывоза капитала.

Второй период (1997-1998 гг.) обусловлен спадом показателей счета текущих операций платежного баланса, и следовательно, сокращением внешних потоков финансовых средств в экономику. Правительство пыталось решить проблему дефицита денежных средств путем активного заимствования как у международных финансовых организаций, так и на открытых финансовых рынках. Однако в условиях продолжавшегося ухудшения внешнеэкономической конъюнктуры и развития негативных тенденций в народном хозяйстве, такая политика потерпела провал. В результате в стране произошел тяжелейший финансово-экономический кризис, одним из результатов которого стало резкое снижение курса национальной валюты и сокращение импортных поставок.

Третий период (1999-2003 гг.) связан с резким ростом показателей счета текущих операций, увеличением экспорта на фоне благоприятной внешнеэкономической конъюнктуры и ускоренных темпов роста производства в сырьевых отраслях, восстановительным ростом импорта после провала 1998-1999 гг. Одновременно с этим сохранялся значительный отток капитала из страны, составивший за 1999-2003 гг. 70,6 млрд. долл.

Четвертый период (2004 г. – настоящее время) характеризуется резким повышением значимости операций с капиталом и финансовыми инструментами. Международные обязательства банков и предприятий увеличиваются высокими темпами. Одновременно с этим рост цен на мировых энергетических рынках позволяет наращивать положительное сальдо внешней торговли. Все это приводит к постоянному росту валютных резервов не только ЦБ России, но и всей экономики в целом. Происходит резкое сокращение вывоза капитала. В 2005 г. впервые за современную российскую ис-

торию по итогам года наблюдался чистый приток капитала в размере 900 млн. долл., в 2006 г. эта тенденция сохранилась.

Таким образом, за последние 15 лет страна прошла путь становления современной российской модели платежного баланса, основанной на сопоставимой значимости для экономики и счета текущих операций, и счета операций с капиталом. Благоприятная внешнеэкономическая конъюнктура и экономический рост выступают причинами радикального изменения в структуре финансовых потоков. Наиболее наглядно это можно проиллюстрировать динамикой обязательств (рис. 26.1).

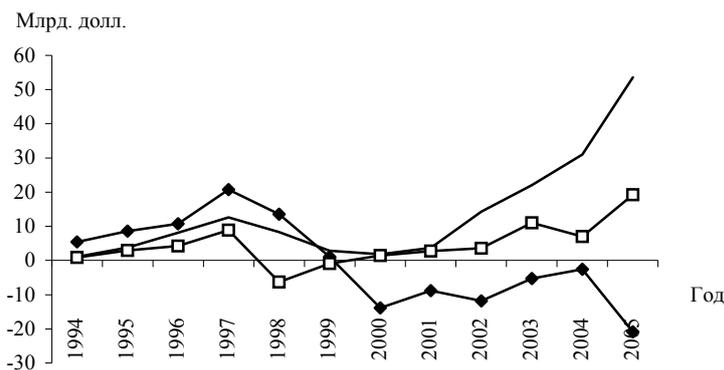


Рис. 26.1. Динамика обязательств экономики 1994-2005 гг.:
 —◆— Правительство, —□— банки; —— нефинансовые предприятия

Можно отметить, что обязательства правительства за последние шесть лет сократились более чем на 63 млрд. долл., что позволило практически вдвое сократить сумму долга бывшего Советского Союза. Если в 1990-е годы государство было основным заемщиком на мировых рынках, то в настоящее время наблюдается политика ускоренного сокращения внешнего государственного долга. Несомненно, что такая политика стала возможной благодаря сверхдоходам от внешнеэкономической деятельности.

Благоприятно развивающаяся экономическая ситуация также придала импульс динамике заимствований банков и нефинансовых предприятий на мировых рынках. Период экономического роста 1999-2006 гг. убедил мировое финансовое сообщество в относительной безопасности кредитования российских финансовых и промышленных организаций. Это стало причиной того, что в 2005 г. объем зарубежных обязательств бизнеса превысил 50 млрд. долл., банковского сектора 18 млрд. долл. Казалось бы, такой мощный поток финансовых средств (9,1% объема ВВП, или 50% объема накопления основного капитала) должен отразиться на динамике инвестиций, однако этого не произошло. Возможно несколько каналов распределения этих финансовых потоков. По-видимому, значительная часть внешних заимствований трансформируется в потребление (на это косвенно указывает наибольшее количество обязательств, приходящихся на ссуды и займы), другая часть обязательств используется на проведение операций на внутренних финансовых и фондовых рынках (в то же время доля портфельных инвестиций в структуре обязательств крайне незначительна). Такая модель заимствований может свидетельствовать об общем дефиците денежных средств в экономике, когда в условиях искусственного сдерживания денежного предложения со стороны монетарных властей бизнес ищет новые источники финансирования. Стремительный рост обязательств бизнеса должен в некоторой степени настораживать, так как в условиях возможного снижения деловой активности это может привести к кризису неплатежей по капитальным операциям.

За последние годы финансово-экономические отношения с внешним миром усложнились. Сейчас уже недостаточно анализировать торговый баланс страны вне его взаимной связи с основными показателями счета текущих операций, а также вне комплексной оценки воздействия внешнеэкономической деятельности на основные макроэкономические индикаторы. С этой точки зрения крайне актуальным становится адекватный прогноз основных показателей платежно-

го баланса страны во взаимосвязи с основными параметрами развития ее народного хозяйства.

Целям и задачам макроэкономического моделирования наиболее полно удовлетворяет структура платежного баланса в аналитическом представлении. В этой версии платежного баланса произведено разделение основных статей по экономическим субъектам (органы государственного управления, органы местного управления, банки, нефинансовые предприятия) и в отличие от классического «нейтрального» представления результатом небаланса является величина изменения валютных резервов экономики за текущий период (этот показатель не следует путать с изменением золотовалютных резервов Центрального Банка РФ так как он включает в себя и валютные счета Минфина).

Моделирование абсолютно всех показателей платежного баланса – трудоемкая задача, поэтому необходимо определить круг моделируемых статей. Предполагается, что внешнеэкономические операции сектора государственного управления являются параметрами экономической политики, и следовательно, в логике построения макроэкономической модели должны задаваться экзогенно. Принимая во внимание результаты анализа сложившейся в настоящее время структуры экспорта, возможно автономное описание четырех основных экспортных потоков (экспорта нефти, нефтепродуктов, газа и прочих товаров). Такое разделение подсказывает анализ текущей статистики внешнеэкономической деятельности. В 2005 г. экспорт нефти составил 34% стоимостного объема экспорта, экспорт газа – 12 и нефтепродуктов – 13, что в сумме охватывает около 60% всего стоимостного объема экспорта (в долларах США).

Статистика торгового баланса на первый взгляд крайне благоприятно характеризует ситуацию в российской экономике. Однако такое впечатление обманчиво.

Объем экспорта в 2005 г. достиг 243 млрд. долл. (31% ВВП), положительное сальдо внешней торговли в этом году составило 118 млрд. долл. Если посмотреть на динамику торгового балан-

са, то можно отметить, что, начиная с 2003 г., наблюдается устойчивое увеличение положительного сальдо внешней торговли (рис. 26.2).

Млрд. долл.

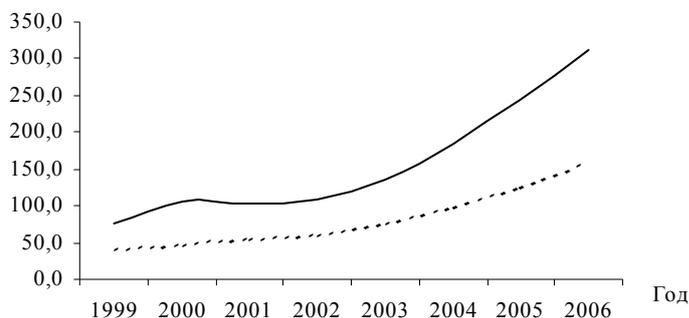


Рис. 26.2. Динамика экспорта (—) и импорта (----) 1999-2006 гг.

Если в 1999-2004 гг. рост экспорта поддерживался высокими темпами прироста валовых выпусков сырьевых отраслей, то в 2005-2006 гг. этот прирост сильно замедлился (с 8-10 до 1,5-2,5% в год). Причиной этого стало исчерпание резервов незагруженных мощностей и недостаточные объемы инвестиций в 1990-е годы. Можно предположить, что в среднесрочной перспективе исправить ситуацию будет крайне сложно. Таким образом, рост экспорта в стоимостном выражении в настоящее время преимущественно определяется динамикой цен на мировых сырьевых рынках и в меньшей степени – внутренними факторами. Снижение темпов роста добычи в нефтяном и газовом секторах обуславливает возможность реальных ресурсных ограничений на экспорт нефти и газа, поскольку при высоких темпах экономического роста (5-7% в год) в такой энергоемкой экономике, как российская, адекватно увеличивается и внутренний спрос на энергоресурсы.

Альтернативой такому развитию событий остается значительное снижение энергозатрат в народном хозяйстве, однако этот процесс весьма инерционен. Другая возможность избе-

жать негативных тенденций в развитии энергетических секторов – диверсификация потоков экспорта, однако и на этом пути существуют очевидные барьеры, связанные с низкой конкурентоспособностью российских предприятий перерабатывающей промышленности на внешних рынках.

Импорт в модели можно разделить на потребительский, инвестиционный и прочий (промежуточный). Здесь необходимо остановиться на технологии подобного разделения. Дело в том, что статистика внешнеэкономической деятельности, публикуемая Федеральной таможенной службой РФ, очень подробная и включает в себя до 2 тыс. товарных позиций. Их разделение на три крупные группы представляется довольно трудоемким процессом.

На более детальном уровне таможенной статистики следует сформировать экспорт и импорт по товарным группам (их насчитывается 98). Опираясь на эту статистику товарных групп и применяя экспертные оценки при их разделении на составляющие, можно получить динамику показателей импорта по трем выделенным группам товаров. Фрагмент этой динамики приведен в табл. 26.1.

Таблица 26.1

Структура импорта в РФ, оцененного в долл. США, %

Импорт	2002 г.		2003 г.		2004 г.		2005 г.				2006 г.	
	I кв.	IV кв.	I кв.	IV кв.	I кв.	IV кв.	I кв.	II кв.	III кв.	IV кв.	I кв.	II кв.
Инвестиционный	24	25	23	25	25	26	26	27	30	28	26	31
Потребительский	42	41	43	41	43	40	40	40	39	41	42	39
Прочий	34	34	34	34	34	33	34	33	32	31	32	30

Данные табл. 26.1 показывают, что за последние четыре года в структуре импортных потоков не произошло существенных изменений. На фоне экономического роста в стране несколько выросла доля инвестиционных товаров и умень-

шилась доля импорта промежуточной продукции. Стабильно высокой остается доля импортных товаров потребительского назначения.

Графический анализ совместной динамики денежных доходов населения (номинальные денежные доходы населения, разделенные на текущий курс доллара) и потребительского импорта показывает очень тесную связь между этими показателями (рис. 26.3). Поэтому можно предположить, что увеличение денежных доходов населения на фоне укрепления рубля с очень высокой эластичностью воздействует на потоки импорта, это в свою очередь отрицательно воздействует на экономическую динамику и способствует вытеснению отечественного товаропроизводителя с внутреннего рынка.

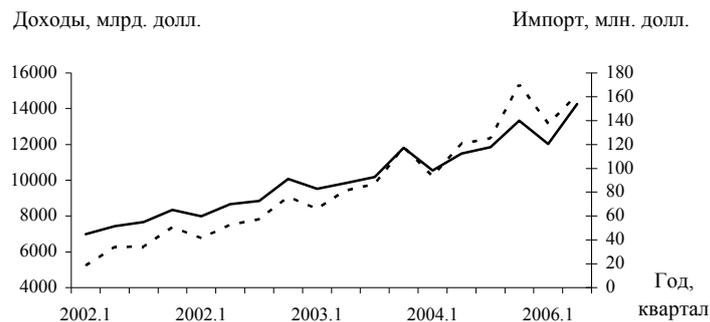


Рис. 26.3. Импорт товаров потребительского спроса (-----) и денежные доходы населения (—)

В модели должны присутствовать уравнения для экспорта и импорта услуг в следующей их детализации: транспортные услуги, поездки, прочие услуги. В отличие от экономик наиболее развитых стран¹ эта часть платежного баланса России не столь значима. В частности, экспорт услуг в 2005 г. был наибольшим за весь период наблюдений и составлял менее

¹ Например, в экономике Франции экспорт услуг приближается к 30% экспорта товаров.

10% экспорта товаров. Другая особенность России – баланс услуг в период с 1994 по 2006 г. был отрицательным.

В структуре баланса услуг за последние годы не произошло существенных изменений. Как и в начале 1990-х годов наиболее значимыми остаются статьи «транспорт» и «поездки». Если в 1994 г. на них приходилось 74% экспорта услуг, то к 2005 г. эта доля сократилась до 60%. Наиболее существенно за этот период выросла доля экспорта строительных услуг (с 2 до 9%) и услуг связи (с 3 до 8%).

В импорте услуг доминирует строка «поездки», на которую в 1994 г. приходилось 46% импорта услуг. В 2005 г. эта доля практически не изменилась – 45%. Стоит отметить рост доли «связи» в структуре импорта услуг (с 1% в 1994 г. до 8% в 2005 г.).

Прогнозные оценки для элементов счета операций с капиталом и финансовыми инструментами затруднены тем, что именно в этой части платежного баланса в последние годы происходят существенные изменения. Основное внимание уделяется прогнозированию операций сектора нефинансовых предприятий. Поведение банков на внешних рынках имеет весьма сложный характер и зависит от многих внутренних и внешних условий. Так, стремительный рост обязательств бизнеса свидетельствует, прежде всего, о том, что оценка российской экономики международными финансовыми структурами весьма высока. Российским предприятиям открывается все больше кредитных линий за рубежом. Кроме того, в российских условиях часть импорта закупается на заемные средства, таким образом, часть ссуд и займов сразу трансформируется в импортные поставки.

Моделирование основных параметров внешней торговли в рамках межотраслевого подхода. Разработка программно-аналитических средств, основанных на межотраслевом подходе, как правило, опирается на МОБ в системе СНС. Внешняя торговля в рядах МОБ представлена в виде столбцов экспорта и импорта. Кроме того, в МОБ, опублико-

ванных Госкомстатом, кроме традиционных таблиц «затраты-выпуск», содержится «таблица использования импортных товаров и услуг» (*импортная матрица*), являющаяся ценнейшим источником информации о распределении импортных потоков. Анализ импортной матрицы позволяет получить содержательные характеристики существующей модели экономического развития, роли и значимости потоков импорта. Так из «таблицы использования импортных товаров и услуг» МОБ за 2003 г. путем суммирования показателей I квадранта со столбцами потребления домашних хозяйств и инвестиций в основной капитал можно получить следующую информацию об общей структуре российского импорта: на долю промежуточного потребления приходится 39% поступающих в страну зарубежных товаров и услуг, 45% импорта потребляется домашними хозяйствами, еще 15% инвестируется в основной капитал, оставшаяся незначительная часть распределяется между другими элементами конечного спроса. Основные данные можно получить из анализа таблиц «затраты-выпуск» (табл. 26.2).

Можно отметить, что в общей структуре российского импорта в 1998-2004 гг. произошли некоторые изменения. Так, в 1998 г. наибольшая часть импорта (50%) потреблялась домашними хозяйствами, но в дальнейшем наметилась тенденция к увеличению доли промежуточного потребления импортной продукции. Это может свидетельствовать о том, что предприятия в условиях экономического роста используют в производстве все большее количество импортных компонентов и сырья. Данное утверждение, прежде всего, относится к отраслям, в которых рост промышленного производства был наиболее интенсивным, а ресурсная база – ограниченной (машиностроение и пищевая промышленность). В то же время доля импорта, направленного на накопление основного капитала, за годы экономического роста (1999-2004 гг.) не возросла и составляет около 15%.

Таблица 26.2

Основные показатели динамики импорта 1998-2004 гг.

Показатель	1998 г.	1999 г.	2000 г.	2001 г.	2002 г.	2003 г.	2004 г.
Динамика ВВП (прирост к уровню предыдущего года, %)	-5,3	6,4	10	5,1	4,7	7,3	6,7
Вклад импорта в экономический рост, проц. п.	3,9	3,3	-5	-3,3	-4	-4,6	-5,1
Импорт, в млрд. долл. США	58,02	39,54	44,86	53,76	60,97	75,44	94,0
Эластичность импорта от укрепления рубля к доллару США (в расчете на 1 проц. п.)	-2,66	0,36	2,89	1,32	1,98	1,37	1,64
<i>Импорт и основные макроэкономические показатели</i>							
Доля импорта, %							
к валовому выпуску	14,12	15,20	13,99	13,60	13,92	13,57	14,92
в потреблении домашних хозяйств	21,15	23,17	24,28	22,16	26,01	28,10	31,11
в розничном товарообороте	48,00	41,00	40,00	41,00	43,00	44,00	44,30
Коэффициент покрытия импорта экспортом	1,27	1,65	1,83	1,52	1,43	1,48	1,89
<i>Структура использования импорта, % к общему объему</i>							
Доля импорта используемого:							
в промежуточном потреблении на потребление домашних хозяйств	35,46	37,82	38,56	39,33	39,7	40,10	41,01
для накопления основного капитала	50,39	49,49	47,12	45,52	45,00	44,00	44,01
	14,11	12,58	13,38	15,05	15,24	15,00	14,86

Анализ товарной структуры импорта показывает, что подавляющая часть наиболее важных промежуточных потоков импортной продукции (за исключением черной и цветной металлургии) используется в производстве товаров народного потребления. Это дополнительный аргумент в пользу утверждения, что в современной экономике России сложилась структура ввозимой из-за рубежа продукции, при которой наиболее значимым для динамики импортных потоков остается платежеспособный спрос населения, который в

значительной степени определяется скоростью укрепления национальной валюты. В частности, общая доля импорта в потреблении домашних хозяйств возросла с 21% в 1998 г до 28% в 2003 г. Зависимость физической динамики импорта от реального курса рубля можно проследить на рис. 26.4. Как показывает график, с 1999 г. прослеживается четкая связь между рассматриваемыми показателями.

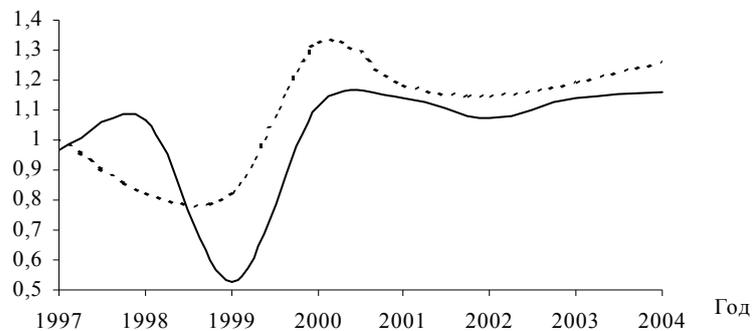


Рис. 26.4. Индексы физического объема импорта и реального курса рубля к доллару США
 — реальный курс рубля к доллару; ---- импорт

Итак, использование МОБ и импортных матриц позволяет анализировать различные аспекты взаимодействия внешней торговли и экономики страны. Далее рассмотрим основные подходы к практической разработке моделей.

Исследуя взаимозависимости параметров развития российской экономики и внешней торговли нетрудно прийти к выводу о том, что получение конкретных количественных оценок их взаимного влияния крайне затруднено в связи с большим количеством сложных связей, характерных для отечественной экономики периода реформ. Существенные результаты в ходе подобных исследований могут быть получены путем использования в качестве инструментария экономического анализа современной межотраслевой моде-

ли, включающий в себя расширенный блок внешней торговли и платежного баланса.

Подобный инструментарий позволяет более детально описать процессы во внешнеторговой сфере с учетом происходящих трансформаций, сформулировать четкие представления об основных факторах, определяющих динамику экспорта и импорта отдельных отраслей народного хозяйства. Особое внимание необходимо сосредоточить на анализе факторов, влиявших на внешнюю торговлю в годы реформ.

Произошедшие изменения в формировании отраслевой динамики экспорта и импорта России, прежде всего, характеризовались переходом от государственной монополии на внешнюю торговлю к множественности субъектов внешнеэкономической деятельности с различным отношением к внешней торговле. Если для одних основным направлением сбыта продукции был экспорт, другие были вынуждены конкурировать с потоками импорта на внутреннем рынке, третьи лишь находились под опосредованным влиянием внешнеэкономической деятельности. Подобная градация применительно к построению уравнений блока внешней торговли означает, что необходимо, прежде всего, выделить подобные группы отраслей и на первом этапе выявить основные факторы, в наибольшей степени влиявшие на динамику как экспорта, так и импорта.

На первом этапе работ по построению внешнеторгового блока необходимо получить такие уравнения, которые могли бы описывать динамику его параметров на всем периоде с 1980 по 2004 г. Предположим, что побудительные мотивы внешней торговли в значительной степени остались неизменными, т. е. никаких трансформаций с точки зрения географии и объемов поставок в части экспорта (с поправкой на развал СССР и СЭВ) не произошло. Таким образом, в рамках данной логики возможно построение уравнений экспорта «от спроса» (имеется в виду, потребность в экспорте продукции отрасли с общеэкономической точки зрения) и «от ресурсных ограничений» (данная логика базируется на ресурсной обеспеченности экспорта с учетом вы-

пуска продукции соответствующих отраслей либо потребности внутреннего рынка в соответствующих товарах). Вместе с тем подобные построения не могут достаточно достоверно отразить изменения, связанные с отменой государственной монополии на внешнюю торговлю и ростом коммерческой составляющей экспорта. Динамика экспорта в годы реформ определялась также состоянием денежно-кредитной системы страны, политикой основных фирм-экспортеров, внешней конъюнктурой и т. д.

Изменения, произошедшие в 1990-е годы, не позволяют использовать факторы, влиявшие на внешнюю торговлю в советский период, для импорта. Высокое разнообразие товаров и множественность субъектов торговли в современной российской экономике обусловили первоочередность факторов коммерческой выгоды сделок по ввозу зарубежной продукции. Произошла коренная смена механизмов формирования импортных потоков.

В целом можно сделать вывод о том, что механизмы формирования динамики экспорта претерпели сравнительно меньше изменений в сравнении с дореформенным периодом, чем механизмы формирования импортных потоков.

Принципиальную проблему разработки блока внешней торговли межотраслевой модели представляет та существенная разница в формировании потоков экспорта и импорта, которая возникла вследствие распада СССР. Внешнеторговые потоки в дальнее и ближнее зарубежье в 1990-е годы имели различную направленность.

Если экспорт в дальнее зарубежье с 1993 г. характеризовался устойчивой тенденцией к росту, основанной как на сокращении внутреннего спроса, так и на открытии экономических границ, то экспорт в ближнее зарубежье сокращался довольно значительными темпами, что объяснялось общеэкономическим кризисом на постсоветском пространстве, разрывом хозяйственных связей и т. д. При этом механизмы формирования экспорта в дальнее и ближнее зарубежье существенно различались.

Вновь образовавшиеся государства СНГ, прежде всего, объединены структурной однородностью экономик, уровнем развития производства, технологическими схемами, наличием взаимных хозяйственных связей. Под действием этих факторов возникла необходимость в создании особого их режима во взаимной торговле.

Разделение направлений потоков внешней торговли также позволяет уловить отдельные структурные изменения во внешней торговле. Так, страны ближнего зарубежья представляются в среднесрочной перспективе главными потребителями экспорта российской продукции гражданской обрабатывающей промышленности, структура торговли с ними отлична от структуры торговли с дальним зарубежьем. Хотя доля экспорта продукции таких отраслей, как машиностроение, легкая и пищевая, в страны СНГ и сократилась за годы реформ, она все-таки остается стабильно более высокой, чем в торговле с остальным миром.

Другой важный аспект формирования блока внешней торговли – необходимость учета возросшей роли тарифного регулирования внешнеэкономической деятельности. Применение в уравнениях внешнеторгового блока показателей, зависящих от уровня таможенных пошлин, значительно расширяет возможности прогнозирования путем экзогенного введения параметров тарифной политики на рассматриваемом периоде. Использование в отраслевых уравнениях показателей, отражавших изменения тарифной политики государства, с практической точки зрения может быть применено для расчетов по таким актуальным темам, как вступление России в ВТО, оценкам тех или иных мер протекционистской политики государства.

Значения среднеотраслевых импортных пошлин в 1990-е годы приведены в табл. 26.3.

Как показывают данные этой таблицы, в машиностроении и пищевой промышленности наблюдается высокий уровень среднеотраслевых пошлин, который объясняется тем, что именно эти потоки импорта стали объектами та-

рифного регулирования со стороны государственных органов. Так, в пищевой промышленности значительными барьерными пошлинами (100% и выше) облагается алкогольная продукция, а также сахар-сырец и сахар белый (до 45%), в машиностроении определяет уровень пошлин защита отечественного автомобилестроения, производства телевизоров и бытовой техники.

Таблица 26.3

Динамика среднеотраслевых импортных
пошлин в 1993-2002 гг., %

Отрасль	1993 г.	1995 г.	1997 г.	1999 г.	2000 г.	2001 г.	2002 г.
Электроэнергетика	0,00	0,00	0,00	0,00	5,00	5,00	5,00
Нефтедобыча	5,00	5,00	5,00	6,00	5,00	5,00	5,00
Нефтепереработка	5,00	5,00	5,00	6,00	5,00	5,00	5,00
Газовая	5,00	5,00	5,00	6,00	5,00	5,00	5,00
Угольная	0,00	5,00	5,00	6,00	5,00	5,00	5,00
Черная металлургия	13,80	11,00	8,80	8,60	16,10	16,00	16,00
Цветная металлургия	5,00	15,64	8,46	11,48	6,91	7,00	7,00
Химия и нефтехимия	6,92	9,44	9,75	9,64	8,06	8,00	8,00
Машиностроение и металлообработка	13,73	14,86	19,58	18,06	18,69	20,0	21,00
ЛДЦБ	15,00	18,22	17,18	17,02	15,99	16,00	16,00
ПСМ	5,00	5,00	5,00	6,00	5,00	5,00	5,00
Легкая промышленность	15,86	21,25	23,87	22,28	22,09	22,00	21,09
Пищевая промышленность	8,31	44,77	38,93	37,92	35,47	35,00	34,23
Прочие отрасли	19,80	20,13	20,22	20,46	20,94	20,94	20,04
Сельское и лесное хозяйство	0,24	13,12	16,42	11,04	14,11	14,51	16,11

Аналогичная работа может быть проведена и в отношении экспортных пошлин. Определенные трудности могут возникнуть ввиду того, что в течение 1997-1998 гг. вывозные таможенные пошлины были отменены. Трансформации в структуре вывозного тарифа во многом связаны с международными обязательствами РФ. В начале 1990-х годов сниже-

ние их уровня было одним из условий предоставления кредитов международными организациями, в настоящее время их отмена является одним из условий вступления России в ВТО.

При всей важности данного показателя для формирования прогноза экономического развития анализ фактических данных приводит к выводу, что его влияние на объемы экспортных поставок весьма незначительно, а его включение в уравнения в качестве фактора, либо применение его при расчете не позволяет серьезно улучшить качество уравнений. Можно предположить, что экспортные пошлины в большей степени связаны с бюджетным процессом и лишь в меньшей степени оказывают заметное регулирующее влияние на потоки экспорта.

Анализ показывает, что импортные потоки в значительно большей степени чем экспорт, чувствительны к изменению внешнеторговых тарифов. В частности, ввозной таможенный тариф непосредственно включается в цену товара. В силу этого изменение импортных пошлин является рычагом регулирования потоков ввозимой продукции. К примерам такого регулирования можно отнести введение запретительных пошлин на алкогольную продукцию в начале процесса реформ, защитные меры против импорта куриного мяса и ряда видов машиностроительной продукции.

Изложенные соображения могут явиться основой построения блока внешней торговли в межотраслевой модели функционирования национальной экономики. В качестве объясняющих переменных в уравнениях могут фигурировать выпуски отраслей, выпуски смежных отраслей, прибыль отраслей, динамика прямых иностранных инвестиций. Полученные уравнения должны пройти селективный отбор на наличие удовлетворительных статистических характеристик. Следующим этапом должно стать встраивание зависимостей в межотраслевую модель и проведение постпрогнозных и прогнозных экспериментов. Только после этих процедур можно говорить о том, что разработанные уравнения в надлежащей степени позволяют описывать экономическую динамику.

Проблемы и перспективы международной внутриотраслевой торговли России. Эмпирические исследования международной торговли товарами, проведенные во второй половине прошлого столетия, показали, что расширение внешнеторгового обмена между странами во многом определялось межстрановым обменом товарами одинаковых отраслей, который в дальнейшем получил название внутриотраслевой торговли.

Исследования воздействия образования Бенилюкс в 1948 г. и Европейского Экономического Сообщества в 1958 г. на специализацию во внешней торговле показали, что рост внешней торговли среди членов интеграционного блока происходил главным образом, вследствие специализации в производстве и экспорте товаров одинаковых, а не различных отраслей, т. е. внутриотраслевой специализации. Результат исследований оказался неожиданным, так как на тот момент экономическая теория предсказывала усиление в результате либерализации внешней торговли специализации в производстве и торговле товарами различных отраслей.

Гипотеза о межотраслевой специализации основывалась на стандартных положениях теории Хекшера – Олина, объясняющих специализацию во внешней торговле. Согласно данной теории, отрасли, в которых производственный процесс происходил с постоянным эффектом масштаба, производили только гомогенную продукцию и только на рынках совершенной конкуренции, а возможность существования одновременного импорта и экспорта страной товаров одной и той же отрасли исключалась.

Оценки явления внутриотраслевой торговли показали, что внутриотраслевая торговля объясняет более 60% торговли между странами ОЭСР. Возникло противоречие между теоретическими положениями и эмпирическими открытиями.

Основой международного внутриотраслевого разделения труда и международной внутриотраслевой торговли является эффект масштаба, использование которого приводит к

окупаемости инноваций в условиях расширенного масштаба производства (рис. 26.5).



Рис. 26.5. Схема развития внутриотраслевой торговли и эффект экономии от масштаба

Эффект масштаба производства, проявляющийся в росте прибыли за счет уменьшения издержек на единицу продукции, способствует развитию и межотраслевой, и внутриотраслевой специализации, однако имеет особое значение при объяснении именно внутриотраслевой специализации, так как она отражает специализацию вглубь, то есть бесконечную специализацию (особенно в промышленных изделиях),

выражающуюся в вертикальном и горизонтальном расширении ассортимента производимой продукции.

Необходимым условием развития международного внутриотраслевого разделения труда и как следствие внутриотраслевой торговли является емкий рынок сбыта, наличие которого гарантирует экономическая интеграция. В то время как наличие (тарифных и не тарифных) ограничений в торговле, ограничений на свободное перемещение факторов производства может препятствовать процессу внутриотраслевой специализации и внутриотраслевой торговле товарами, обладающими одинаковым качеством.

Сущность внутриотраслевой торговли определяется не только факторами предложения, но и спроса, поэтому существенным дополнением, дающим объяснение внутриотраслевой торговле, являются теории эластичности потребительского спроса. Одним из существенных факторов развития внутриотраслевой торговли является величина дохода на душу населения. Низкие доходы на душу населения являются фактором ограничения внутриотраслевой торговли из-за низкого уровня потребления, который не стимулирует развития конкуренции между производителями на основе дифференциации продукции одной и той же отрасли.

Принимая во внимание, что на топливно-энергетические и сырьевые товары приходится большая часть экспорта, внешняя торговля России неизбежно будет иметь межотраслевой характер. Однако ситуация характерная для страны в целом, наблюдается и в отдельных отраслях народного хозяйства. Например, если в странах ЕС 60% и более внешнеторгового оборота продукции машиностроения объясняется внутриотраслевой торговлей, то для России этот показатель не превышает 20%.

Высокая интенсивность внутриотраслевой торговли стран ЕС свидетельствует о развитии интеграционных процессов, которые обусловлены тем, что в условиях экономического роста, основанного на инновационном типе развития, создание многих наукоемких производств невыполни-

мо даже для самых развитых экономик. Как следствие развиваются процессы интеграции финансовых, производственных ресурсов, сбытовых сетей и взаимного проникновения на внутренние рынки. Таким образом, невключение обрабатывающих отраслей национальной экономики в процессы интеграции и кооперации затрудняет производство конкурентоспособной продукции.

К факторам, обуславливающим существование внутриотраслевой торговли, принято относить: 1). Приграничную торговлю, различия во времени производства, реэкспорт, реимпорт и обмен стратегическими функционально однородными товарами. 2). Различия в уровне потребительских доходов и в потребительских предпочтениях, вызывающие внутриотраслевую торговлю дифференцированными товарами. 3). Технологический разрыв и различия между странами в этапах цикла жизни товара. 4). Международную фрагментацию производства. При этом внутриотраслевой торговый обмен на базе 2-4 групп факторов поддерживается и развивается за счет эффекта экономии масштаба и снижения торговых барьеров.

За последние десятилетия XX в. ускорение процесса международной фрагментации производства было обусловлено, во-первых, продолжающейся тенденцией снижения транспортных издержек, во-вторых, уменьшением государственного контроля и государственного регулирования производства, внешней торговли и международного движения капитала, и, в-третьих, развитием информационных технологий, применение которых способствовало снижению рисков и издержек координации производственных блоков.

Интенсивность внутриотраслевой торговли отражает развитие внутриотраслевой специализации, которая выражается в углублении и совершенствовании разделения труда и приводит к росту эффективности производства, способствует повышению квалификации рабочей силы, и как следствие стимулирует долгосрочный экономический рост, наряду с расширением ассортимента и повышением качества произво-

димых товаров. При этом расширение ассортимента и повышение качества производимых товаров (т. е., по сути, рост конкурентоспособности) является неотъемлемой составляющей дальнейшего устойчивого роста производства.

Измерение внутриотраслевой торговли предполагает рассмотрение трех методологических вопросов: выбор показателя внутриотраслевой торговли; выбор поправки на несбалансированность внешней торговли и устранение агрегации категорий.

Общепринятым показателем измерения внутриотраслевой торговли является индекс интенсивности внутриотраслевой торговли Грубела – Ллойда, предложенный ими для измерения внутриотраслевой торговли:

$$GL_i = \frac{(X_i + M_i) - |X_i - M_i|}{(X_i + M_i)} \quad (26.1)$$

где X_i и M_i представляют соответственно экспорт и импорт отрасли i .

Выражение в числителе индекса GL_i является величиной внутриотраслевой торговли отрасли i , показывающей объем товарооборота, в котором экспорт отрасли полностью перекрыт импортом данной отрасли. Индекс GL_i изменяется в пределах от 0 до 1. Значение GL_i , равное 0, показывает отсутствие какого-либо перекрытия экспорта импортом, а GL_i , равный 1, свидетельствует о полностью внутриотраслевой торговле.

В агрегированном индексе Грубела – Ллойда, измеряющем внутриотраслевую торговлю страны в целом, величина внутриотраслевой торговли отрасли i , измеренная с помощью индекса GL_i , имеет вес равный доле товарооборота отрасли в общем товарообороте:

$$\begin{aligned}
 GL &= \sum_1^n GL_i [(X_i + M_i) / \sum_1^n (X_i + M_i)] = \\
 &= \sum_1^n \frac{(X_i + M_i) - |X_i - M_i|}{(X_i + M_i)} \frac{(X_i + M_i)}{\sum_1^n (X_i + M_i)} = \quad (26.2) \\
 &= \frac{\sum_i^n (X_i + M_i) - \sum_i^n |X_i - M_i|}{\sum_i^n (X_i + M_i)}.
 \end{aligned}$$

В агрегированном индексе Грубела – Ллойда каждая отрасль имеет свой собственный вес, который зависит от доли отрасли в общем товарообороте.

Рассматривая вопрос измерения внутриотраслевой торговли отдельной отрасли i , экспорт и импорт которой состоит из товарных групп j , Грубел и Ллойд предложили индекс:

$$GL_{ij} = \frac{\sum_j (X_{ij} + M_{ij}) - \left| \sum_j X_{ij} - \sum_j M_{ij} \right|}{\sum_j (X_{ij} + M_{ij})}, \quad (26.3)$$

где X_{ij} представляет собой экспорт товаров группы j отрасли i , M_{ij} – импорт товаров группы j отрасли i .

Так как $\sum_j X_{ij} = X_i$, а $\sum_j M_{ij} = M_i$ индекс GL_{ij} равен индексу GL_i . Однако числитель индекса GL_{ij} имеет альтернативную форму записи.

$$\sum_j (X_{ij} + M_{ij}) - \sum_j |X_{ij} - M_{ij}|. \quad (26.4)$$

Отличие (26.4) от числителя в выражении (26.3) состоит в том, что в (26.3) абсолютная разница между экспортом и импортом берется напрямую, а в выражении (26.4) абсолютная разница между экспортом и импортом берется отдельно и затем суммируется.

Следует отметить, что сводный индекс Грубела – Ллойда, измеряющий степень внутриотраслевой торговли, не является корректным показателем внутриотраслевой торговли, если экспорт страны не равен ее импорту, потому что при наличии торгового дисбаланса он не может достичь значения единицы. Это нежелательное свойство индекса внутриотраслевой торговли возникает из-за того, что данный индекс включает в себя не только степень внутриотраслевой торговли, но и несбалансированность внешней торговли.

В связи с этим Грубел и Ллойд предложили индекс, включающий поправку на несбалансированность во внешней торговле. По их мнению, при рассмотрении общей торговли товарами, корректировка на несбалансированность внешней торговли осуществляется путем соотношения величины внутриотраслевой торговли с величиной общего товарооборота, уменьшенного на величину несбалансированности внешней торговли.

$$C = \frac{\sum(X_i + M_i) - \sum|X_i - M_i|}{\sum(X_i + M_i) - |\sum X_i - \sum M_i|}. \quad (26.5)$$

Индекс GL и величина C связаны следующим образом:

$$C = GL(1/1 - k) = GL[1/1 - (\sum X_i - \sum M_i / \sum(X_i + M_i))]. \quad (26.6)$$

Различные процедуры корректирования индекса внутриотраслевой торговли основываются только на существовании дисбаланса внешней торговли и не учитывают причин возникновения данного дисбаланса. Вместе с тем любая процедура корректирования предполагает существование предпосылок о влиянии сглаживания торгового дисбаланса на торговую структуру, и следовательно, может быть ошибочна из-за неверности исходных предпосылок. В связи с этим необходимость проведения корректирования индекса внутриотраслевой торговли на несбалансированность внешней торговли до сих пор не является общепризнанной.

Снижение степени внутриотраслевой торговли при снижении уровня агрегации данных о внешней торговле, используемых при измерении степени внутриотраслевой торговли, получило название агрегации категорий.

Теоретически явление агрегации категорий означает, что оцененная степень внутриотраслевой торговли включает в себя и межотраслевую торговлю.

Эмпирически агрегации категорий имеет место в том случае, когда существуют разнозначные торговые дисбалансы на более низком уровне агрегации данных, чем при измерении внутриотраслевой торговли.

Одни из основных методов устранения агрегации категорий состоит в перегруппировке классификации внешней торговли таким образом, чтобы полученные в результате перегруппировки категории наиболее точно соответствовали теоретической концепции отрасли.

Расчет интенсивности внутриотраслевой торговли России проводился на основе следующей модификации индекса Грубела – Ллойда:

$$GL_c = \frac{\sum_i \sum_s \sum_c \sum_j (X_{isjc} + M_{isjc}) - \sum_i \sum_s \sum_c \left| \sum_j X_{isjc} - \sum_j M_{isjc} \right|}{\sum_i \sum_s \sum_c \sum_j (X_{isjc} + M_{isjc})} 100, \quad (26.7)$$

где X_{isjc} представляет собой экспорт товара j подотрасли s отрасли i в страну c ; M_{isjc} – импорт товара j подотрасли s отрасли i из страны c .

Как видно из формулы (26.7), в числителе абсолютная разница между экспортом и импортом товаров j подотрасли s в страну c берется напрямую, что основывается на предпосылке о гомогенности товаров в рамках определенной подотрасли, т.е. производитель, работающий в конкретной подотрасли, может производить любой товар из ассортимента данной подотрасли. В то же время в силу предпосылки о негомогенности товаров отдельных подотраслей в рамках отрасли абсолютная разница между экспортом и импортом товаров подотраслей s отрасли i берется отдельно и затем суммируется.

По результатам расчетов интенсивности внутриотраслевой торговли (табл. 26.5) можно сделать вывод о том, что в целом

развитие внешней торговли России в отраслях обрабатывающей промышленности характеризуется тенденцией к росту межотраслевой специализации и незначительным развитием внутриотраслевой специализации, при этом интенсивность внутриотраслевой торговли всех рассматриваемых отраслей находится на достаточно низком уровне.

Высокая интенсивность международной внутриотраслевой торговли свидетельствует о развитии инновационного типа производства и интеграции отрасли в мировое хозяйство на основе международного внутриотраслевого разделения труда, тогда как низкая интенсивность внутриотраслевой торговли может указывать на отсталость в технологическом развитии.

Низкий уровень интенсивности внутриотраслевой торговли России по сравнению с отдельными странами ЕС (рис. 26.6) свидетельствует о том, что на данном этапе развития российской экономики вовлечение России в международное разделение труда основано, главным образом, на межотраслевой специализации, базирующейся на обладании значительной долей запасов мировых природных ресурсов, что сдерживает инновационный тип развития народного хозяйства.

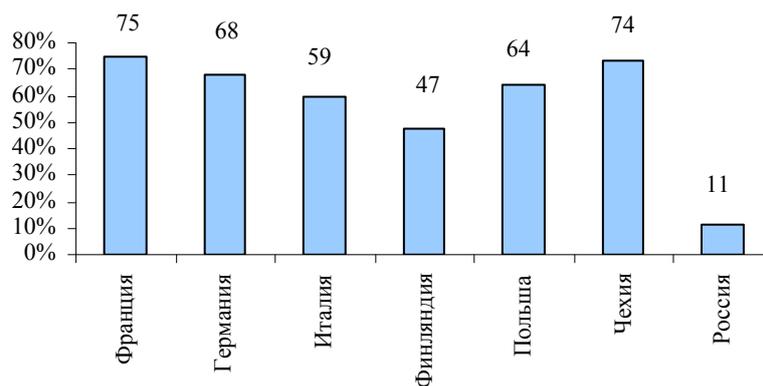


Рис. 26.6. Интенсивность внутриотраслевой торговли России и отдельных стран ЕС со всем миром в 2004 г.

таблица 26.5

Устойчивая тенденция снижения интенсивности внутриотраслевой торговли России в обрабатывающей промышленности свидетельствует о наличии технического и технологического отставания страны от ведущих мировых держав.

Если в большинстве обрабатывающих отраслей интенсивность внутриотраслевой торговли продолжит свое снижение, то вовлечение российской экономики в мировое разделение труда будет основываться на реализации конкурентного преимущества в факторонаделенности, т. е. возможности интеграции российской экономики в мировое хозяйство будут оставаться весьма ограниченными, так как основой экономической интеграции в данном случае не будет являться внутриотраслевое разделение труда, способное объединить производственные процессы различных отраслей торгующих между собой стран в единые технологические циклы.

При этом взаимная интеграция российских рынков обрабатывающих производств с рынками обрабатывающих производств других стран будет возможна только для достаточно ограниченного числа отраслей.

Основные термины и понятия

Платежный баланс.
Счет текущих операций
Счет операций с капиталом и финансовыми инструментами
Вывоз капитала
Таблица использования импортных товаров и услуг
Отраслевая структура экспорта и импорта
Международная внутриотраслевая торговля
Международная специализация и интеграция
Индекс Грубела и Ллойда
Экономия от масштаба

Вопросы для самопроверки

1. Что такое платежный баланс?
2. Кто разрабатывает платежный баланс в России?

3. Назовите основные составные части платежного баланса.
4. Каким образом внешнеэкономическая деятельность отражается в межотраслевых балансах?
5. Что такое «таблица использования импортных товаров и услуг»?
6. Какие факторы влияли на динамику экспорта и импорта в годы реформ?
7. В чем смысл разделения потоков внешней торговли на
8. Дайте определение внутриотраслевой торговли и опишите механизм ее развития.
9. Почему теория внешней торговли Хекшера – Олина не допускает возможности развития внутриотраслевой торговли?
10. Опишите основные факторы развития внутриотраслевой торговли.

Литература

1. Косарев А. Е. Анализ и прогнозирование на основе национальных счетов и платежного баланса: развитие методов. М.: Статистика, 2005.
2. Узяков М.Н. Квартальный прогноз макропоказателей экономики РФ в 2006-2008 гг. (базовый сценарий) // Проблемы прогнозирования, 2006, № 4.
3. Экономика внешних связей России. Учебник под ред. А.С. Булатова. М.: БЕК, 1995.
4. Тейл Г. Прикладное экономическое прогнозирование. М.: Прогресс, 1970.
5. Киреев А.П. Международная экономика. В 2-х ч. Ч.1. Международная микроэкономика: движение товаров и факторов производства. Учеб. пособие для вузов. М.: Международные отношения, 2002.
6. Плюцински Э. Роль внутриотраслевого обмена в торговле стран ЕЭС // Внешняя торговля, №4, 1989.
7. Balassa B. Intra-Industry Specialization: a Cross Country Analysis. European Economic Review, №30, 1986.
8. Grubel H.G. and Lloyd P.J. Intra-Industry Trade: The Theory and Measurement of International Trade in Differentiated Products // London: Macmillan 1975.
9. Kol J. The Measurement of Intra-Industry Trade // Ph.D. Thesis (Rotterdam: Erasmus University 1988).
10. Verdroorn P.J. The Intra-Block Trade of Benelux. Economic Consequences of the Size of Nations, London: Macmillan, 1960.

Таблица 26.5

Интенсивность внутриотраслевой торговли
отдельных отраслей обрабатывающей промышленности, %

Показатель	1995 г.	1996 г.	1997 г.	1998 г.	1999 г.	2000 г.	2001 г.	2002 г.	2003 г.	2004 г.	2005 г.	2006 г.
Легкая промышленность	45	47	44	41	32	33	32	31	29	30	30	23
Химическая и нефтехимическая промышленность	25	25	24	27	28	28	27	25	22	21	21	21
Промышленность строительных конструкций, деталей и материалов	38	32	28	23	23	27	23	20	21	21	20	20
Машиностроение	29	30	29	25	31	30	27	21	19	17	16	15
Сельское хозяйство	3	5	3	4	1	4	3	7	8	6	8	6
Мебельная промышленность	15	20	18	21	35	42	30	28	31	34	31	33
Пищевая промышленность	9	9	7	7	7	11	10	10	11	13	13	13