

Національна академія наук України

Науково-дослідний центр індустріальних проблем розвитку

АНАЛІТИЧНА ДОВІДКА

**Оцінка зовнішньоторговельної безпеки України в контексті включення у
ланцюги доданої вартості**

Харків, 2019

Вступ

Сучасні підходи до оцінки зовнішньоекономічної безпеки, зокрема її торговельної складової, зосереджуються головним чином на визначенні експортних та імпорتنих квот та залежності економіки країни від критичного імпорту енергоресурсів та борговому навантаженні. Певним недоліком методик, що застосовуються в Україні, є включення тимчасових орієнтирів, як, наприклад, питома вага імпорту енергоносіїв. Попри важливість цього показника він може і не мати критичного впливу, якщо ефективна переробна промисловість та галузі послуг забезпечують експорт національної доданої вартості у необхідному обсязі.

Крім того, використовувані наразі підходи не враховують сучасні тенденції до вертикальної спеціалізації та включення країн до глобальних ланцюгів створення вартості. Але, як зазначається в аналітичних матеріалах Організації Об'єднаних Націй з промислового розвитку (UNIDO) та Організації Об'єднаних Націй з торгівлі й розвитку (UNCTAD), розвиток глобальних ланцюгів поряд із значними перевагами та відкриттям нових можливостей може мати і суттєві довгострокові ризики. Тому при оцінці зовнішньоекономічної безпеки урахування процесів інтеграції, які у світовій практиці оцінюються показниками міжнародної торгівлі доданою вартістю, є доцільним та необхідним.

Формування переліку показників оцінки визначається можливим ризикам зовнішньоекономічної діяльності, якими для України є наступні:

- надмірна залежність національної економіки від експорту посилює ризик нестабільності через вплив коливань на світових ринках, особливо сировинних;
- надмірна залежність від імпорту кінцевої продукції сприяє виникненню дисбалансу у зовнішній торгівлі та, як

наслідок, збільшенню валового корпоративного та державного боргу. Так саме залежність від імпорту проміжної продукції, яка необхідна для вироблення кінцевої продукції внутрішнього споживання, призводить до значних цінових шоків на внутрішньому ринку, спричинених зовнішніми чинниками;

- довготривала тенденція до зростання від'ємного сальдо зовнішньої торгівлі може стати причиною посилення боргового навантаження на економіку країни та навіть привести її до дефолту;

- велика питома вага одного з економічних партнерів знижує стабільність зовнішньої торгівлі та посилює ризики «торгових війн»;

- переважання експорту низькотехнологічної та сировинної продукції призводить до занепаду власної переробної промисловості, негативно впливає на інвестиційні та інноваційні процеси у країні, що знижує конкурентоздатність її економіки на світовому ринку.

Запропонований підхід до оцінки зовнішньоторговельної безпеки України ґрунтується на інтегральній оцінці за напрямками: баланс зовнішньоторговельної діяльності, імпортозалежність внутрішнього ринку та експорту, прогресивність експорту і випуску товарів, що дозволяє разом із показниками експортної та імпортної залежності врахувати вплив руху доданої вартості в економіці країни та міжнародній торгівлі. Застосування зазначеного багатовимірного підходу дозволяє вести постійний моніторинг та виробляти й приймати ефективні, науково-обґрунтовані рішення на всіх рівнях для запобігання потенційних та зниження існуючих загроз зовнішньоекономічній безпеці, що можуть виникати в процесі включення країни у глобальні ланцюги створення доданої вартості.

Порядок проведення оцінки

Інтегральна оцінка рівня зовнішньоторговельної безпеки країни здійснювалася у порядку, представленому на рис. 1. Масив вихідної інформації був сформований на основі офіційних даних Державної служби статистики України [1] та бази даних Організації Об'єднаних Націй Comtrade [2].



Рисунок 1 – Порядок проведення оцінки зовнішньоторговельної безпеки країни

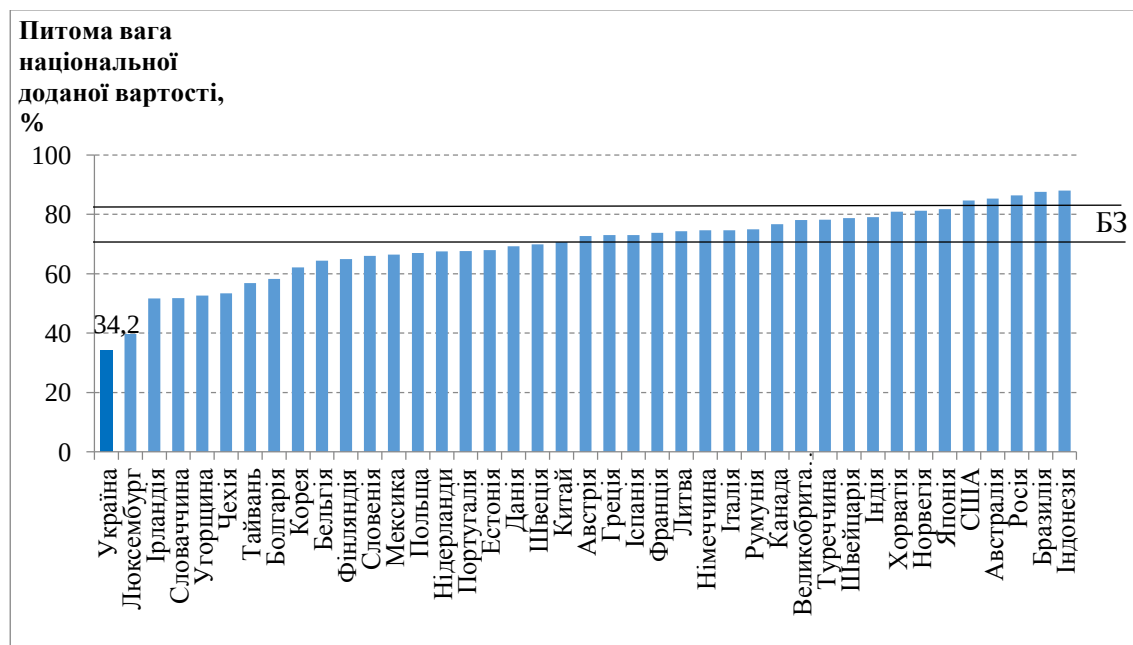
Узагальнюючи підхід до оцінки макроекономічних дисбалансів та диспропорцій, підхід Організації економічного співробітництва та розвитку (ОЕСР) та його адаптацію до умов України, а також наявний досвід оцінки зовнішньоторговельної безпеки в Україні та світі, було сформовано систему показників. Запропонована система показників є несуперечливою, достатньою, відповідає вимогам об'єктивності, доступності та порівнюваності, виключає дублювання інформації, а також дозволяє оцінити зовнішньоторговельну безпеку за трьома напрямками: баланс зовнішньоторговельної діяльності, імпортозалежність внутрішнього ринку та експорту, прогресивність експорту і випуску товарів (рис.2).



Рисунок 2 – Система показників для оцінки зовнішньоторговельної безпеки

Інтегральна оцінка рівня зовнішньоторговельної безпеки України розраховувалася як зважене середнє значення стандартизований оцінок за дев'ятьма представленими критеріями.

Порівняльна оцінка стану зовнішньоторговельної безпеки була побудована за даними 2014 р. для 40 країн світу й України [3].



БЗ – безпечна зона, якій відповідає стандартизоване значення 100 %

Рисунок 3 – Розподіл країн світу за критерієм «Питома вага національної доданої вартості в експорті, %» у 2014 р.

На рис. 3 показано розподіл країн світу за одним з головних критеріїв, а саме, питомою вагою доданої вартості національного походження в експорті. Як видно на рисунку, у 2014 р. в Україні цей показник був найменшим серед досліджених країн. Отже, можна очікувати, що рівень зовнішньоторговельної безпеки також буде невисоким. Разом з тим слід зазначити, що великі значення питомої ваги національної доданої вартості у експорті також знаходяться поза межами безпечної зони. Такі значення притаманні країнам, основними експортними товарами яких є енергоресурси, отже кон'юнктура світових ринків визначає прибуток у відповідних видах економічної діяльності і обсяги експортованої доданої вартості.

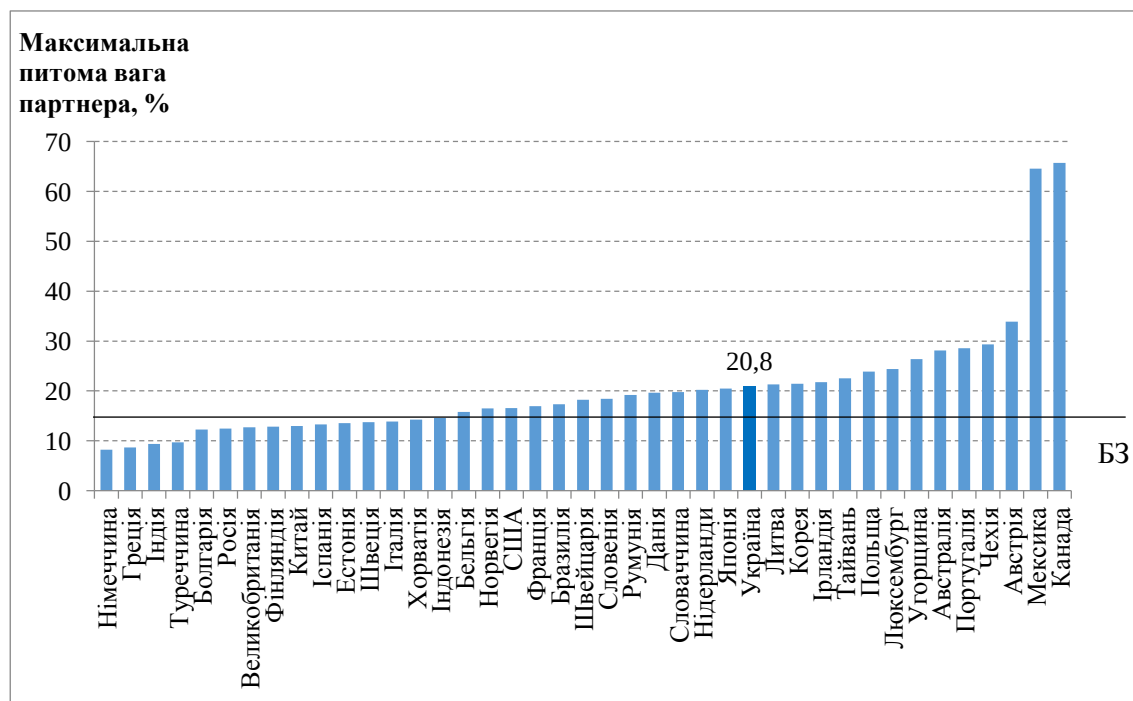


Рисунок 4 – Розподіл країн світу за критерієм «Максимальна питома вага країни-партнера у загальному обсязі товарообороту» у 2014 р.

Найбільш критичними виявилися значення за критерієм питомої ваги провідної країни-партнера, яка склала 20,77 % усього товарного експорту (рис. 4), та частки високотехнологічного експорту у 3,55 % усього товарного експорту (рис. 5).

Критичне значення за критерієм максимальної питомої ваги країни-партнера складає 16,7 %, якщо ж значення за цим критерієм перевищує 30 %, то така ситуація є абсолютно небезпечною. Як видно на рис. 4, у 2014 р. максимальна питома вага країни-партнера (РФ) в Україні була вищою за безпечний рівень, але не досягала критично високого рівня. Найгіршою за цим критерієм була ситуація у Мексиці та Канаді, для яких питома вага США в обсязі зовнішнього товарообороту перевищила навіть 60 %, що пояснюється активною участю цих країн у торговому об'єднанні НАФТА. Найбільш географічно диверсифікованою є зовнішня торгівля Німеччини, що може слугувати орієнтиром для розвитку зовнішньої торгівлі України.

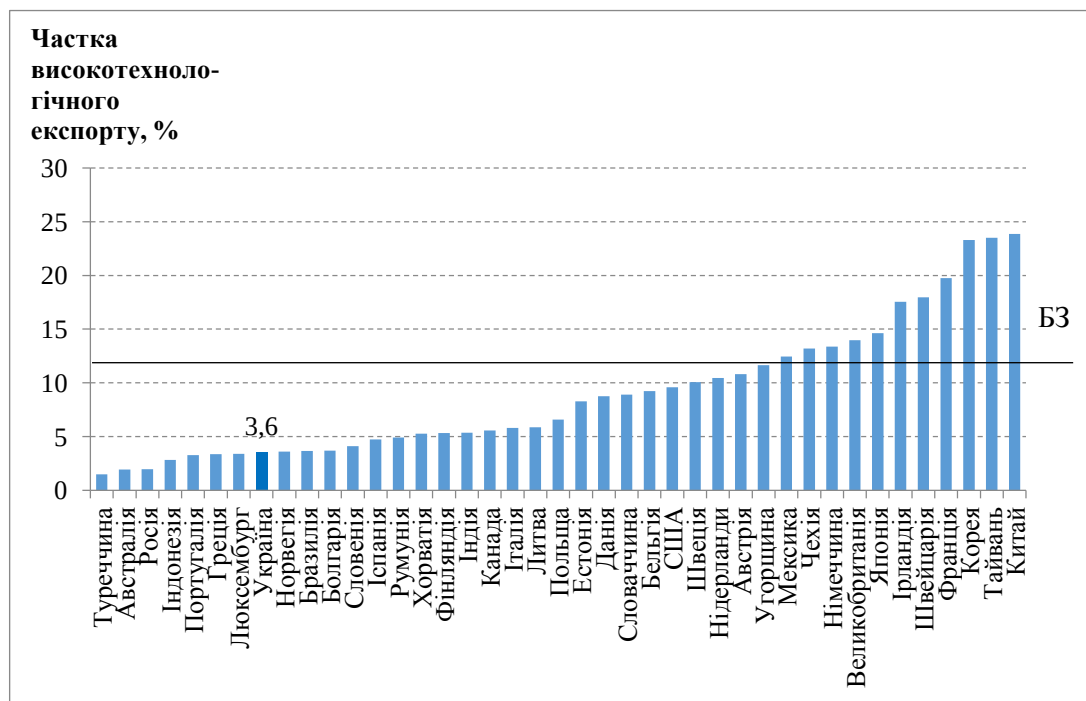


Рисунок 5 – Розподіл країн світу за критерієм «Частка високотехнологічного експорту в загальному обсязі товарного експорту» у 2014 р.

Критичним для зовнішньоторговельної безпеки України виявилось у 2014 р. значення за критерієм частки високотехнологічного експорту (рис. 5), яка склала лише 3,6 %. Сировинний характер експорту, низька конкурентоспроможність вітчизняних товарів на світових ринках, скорочення експорту продукції машинобудування призвели до вкрай низького рівня прогресивності експорту. Як видно на рис. 5, найбільші частки високотехнологічного експорту характерні для країн, що розвиваються та промислово розвинутих країн, які є розробниками та виробниками продукції машинобудування, фармацевтичної продукції тощо. Порівняння даних рис. 3 та рис. 5 дозволяє зробити висновок, що нарощування експорту лише за умови втілення у ньому доданої вартості національного походження може призвести до спотворення структури експорту у бік сировинного та відповідного занепаду вітчизняної переробної промисловості. Тому потребує удосконалення державна політика підтримки експорту у частині стимулювання виробництва та експорту високотехнологічних товарів.

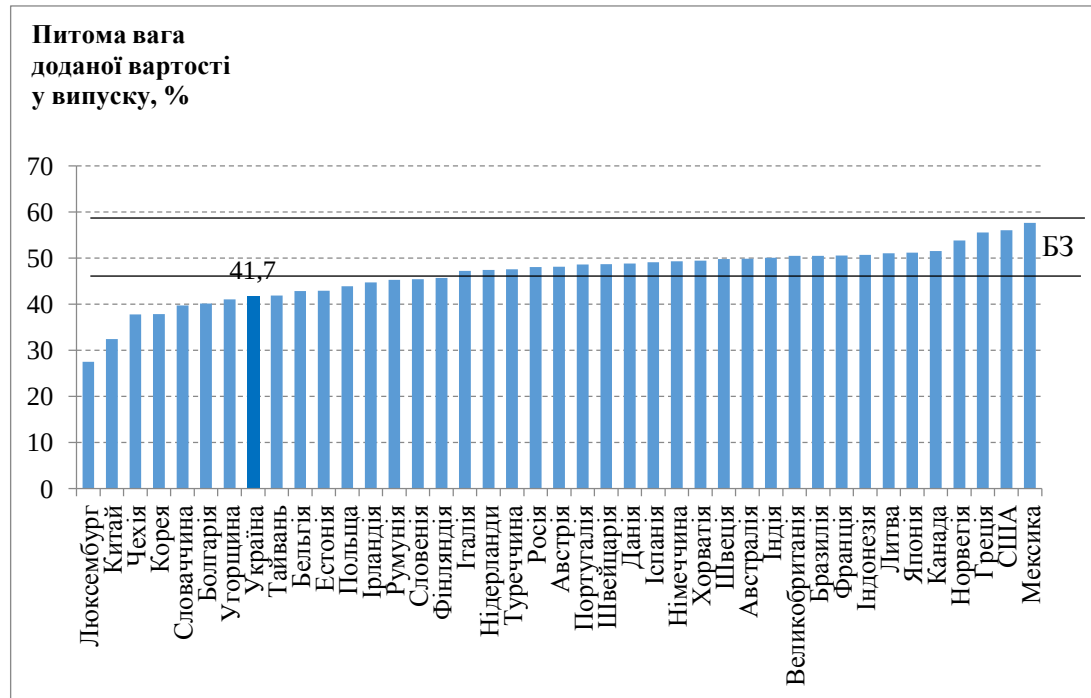


Рисунок 6 – Розподіл країн світу за критерієм «Питома вага доданої вартості у випуску» у 2014 р.

За напрямком прогресивності експорту та випуску найменш критичним було у 2014 р. значення за показником питомої ваги валової доданої вартості у випуску (рис. 6). Безпечна зона за цим критерієм становить від 46,9 % до 57,1 %, Значення в Україні складало 41,7 %, що відповідає рівню країн, що розвиваються і наближається до нижньої границі безпечного рівня. Разом з тим для розвинутих країн значення за цим критерієм майже на 10 в.п. більше, що говорить про значно меншу матеріалоємність їхніх економік, вищі продуктивність праці та прибутковість економічної діяльності. В Україні саме низька прибутковість та низька порівняно з розвинутими країнами продуктивність та оплата праці є основними причинами меншої питомої ваги доданої вартості у випуску. Цей показник має опосередкований негативний вплив на рівень зовнішньоторговельної безпеки через зниження можливостей вітчизняних підприємств для розвитку виробництва конкурентоспроможної продукції.

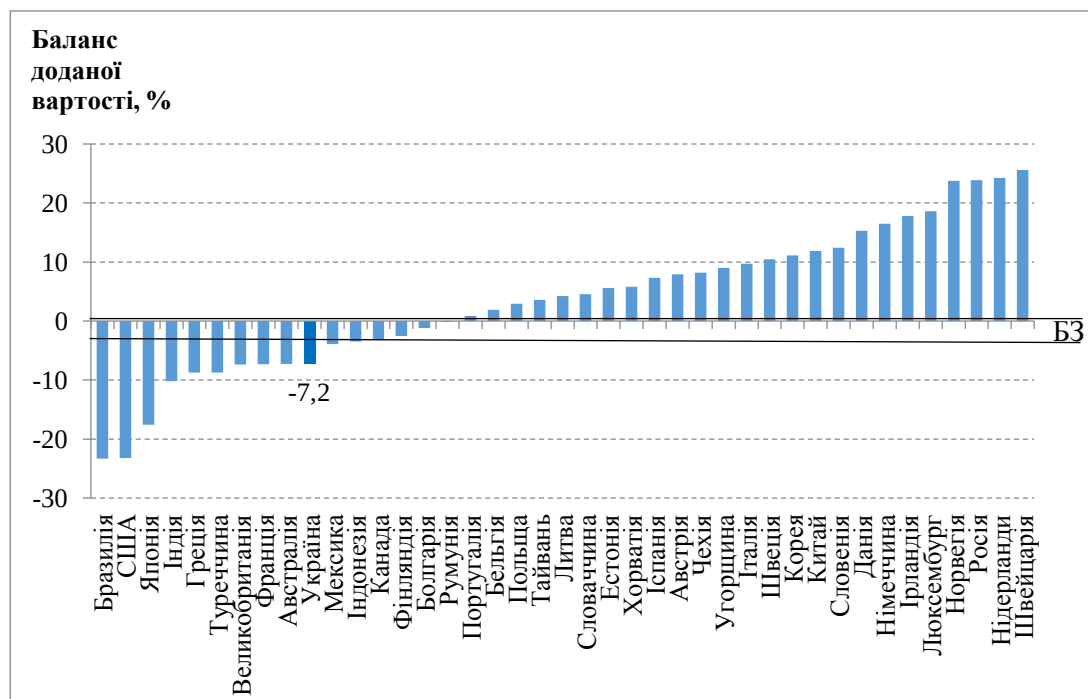


Рисунок 7 – Розподіл країн світу за критерієм «Баланс доданої вартості у кінцевому споживанні» у 2014 р.

За напрямком оцінки балансу зовнішньоторговельної безпеки України поряд із критичним значенням вже розглянутого критерію максимальної питомої ваги країни-партнера, низьким є також значення за балансом доданої вартості у споживанні у відсотках експорту (рис. 7). Безпечна зона за цим критерієм обмежена діапазоном від -2,3 % до +2,3 %. Такий вузький діапазон визначається необхідністю попередження ризику виникнення значного валового зовнішнього боргу з одного боку, та ризиком перегріву економіки з іншого. Значення для України у 2014 р. було значно менше нижньої границі безпечного діапазону, що є наслідком негативного сальдо зовнішньої торгівлі. Критерій балансу доданої вартості має більше значення для аналізу зовнішньоторговельної безпеки країни у розрізі окремих видів економічної діяльності, тому для кожного окремого виду він матиме власні межі безпечного діапазону. Слід зауважити, що найнижчі значення за цим критерієм були у Бразилії, США та Японії, які мають також великі значення валового зовнішнього боргу разом із негативним сальдо зовнішньої торгівлі.

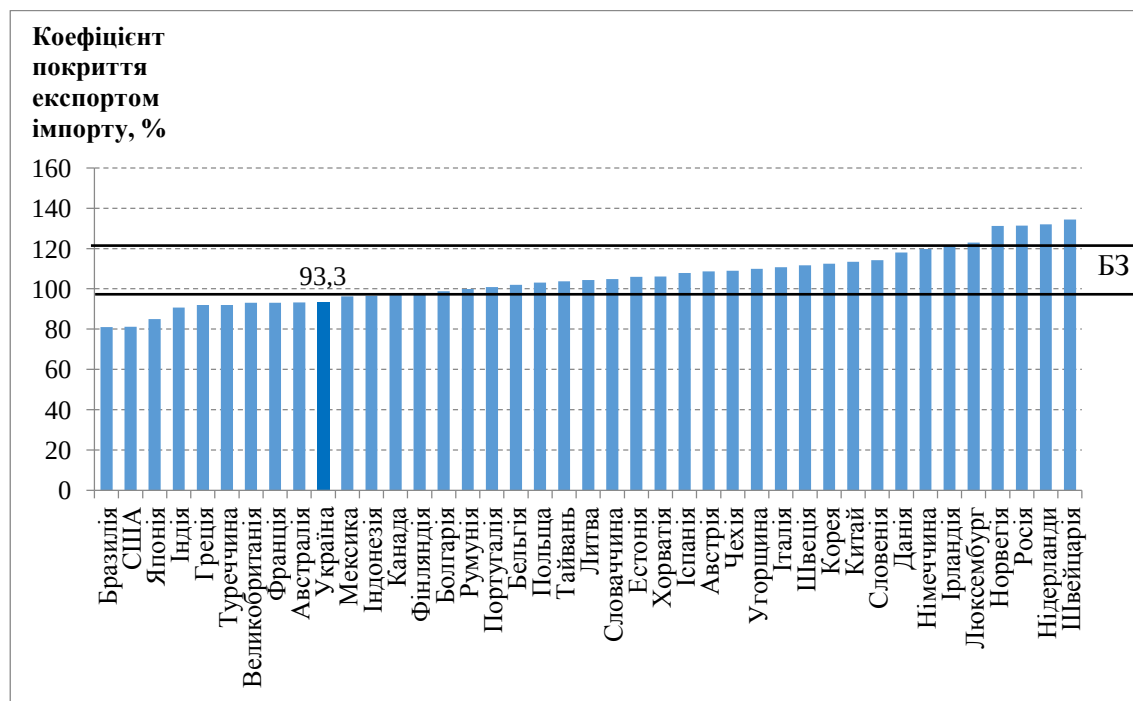


Рисунок 8 – Розподіл країн світу за критерієм «Коефіцієнт покриття експортом імпорту» у 2014 р.

Коефіцієнт покриття експортом імпорту для України у 2014 р. впритул наблизився до безпечної зони від 97,5 % до 120 %. Але це було наслідком більш стрімкого падіння імпорту у цьому році порівняно із падінням експорту, зокрема, через зниження купівельної спроможності в країні. Порівняння розподілу країн за коефіцієнтом покриття експортом імпорту із даними рис. 7 дозволяє зазначити, що сукупне негативне сальдо зовнішньої торгівлі відбивається і на балансі доданої вартості. Тому для забезпечення зовнішньої торгівлі країни необхідним є підтримання балансу торгівлі принаймні у сукупності по економіці, аби не створювати ризиків виникнення надмірного боргового навантаження на економіку.

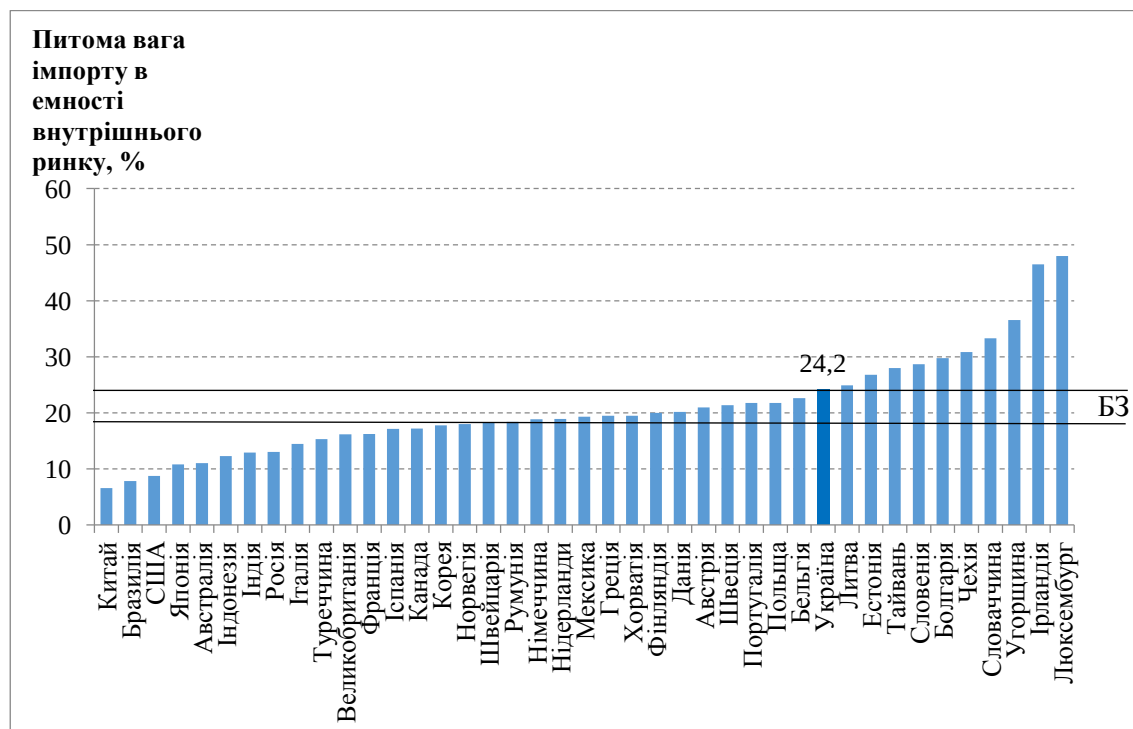


Рисунок 9 – Розподіл країн світу за критерієм «Питома вага імпорту в ємності внутрішнього ринку» у 2014 р.

За напрямом оцінки імпортозалежності внутрішнього ринку та експорту оцінка України у 2014 р. також знаходилася поза межами безпечних діапазонів, але відхилення не були такими критичними як по інших напрямках.

За показником питомої ваги імпорту в ємності внутрішнього ринку (рис. 9) значення України 24,2 % у 2014 р. незначно перевищувало верхню межу безпечного діапазону від 16,1 % до 21,8 % і відповідає рівню країн, що розвиваються. Цей показник відбиває залежність від імпорту як проміжних товарів, які використовуються для власного виробництва, так і імпорту кінцевих товарів. У контексті включення України до глобальних ланцюгів створення доданої вартості виникає ризик подальшого нарощування імпорту для проміжного споживання. Тому необхідним є стимулювання розвитку власного виробництва проміжної продукції, яке б разом із задоволенням потреб економіки мало експортний потенціал.

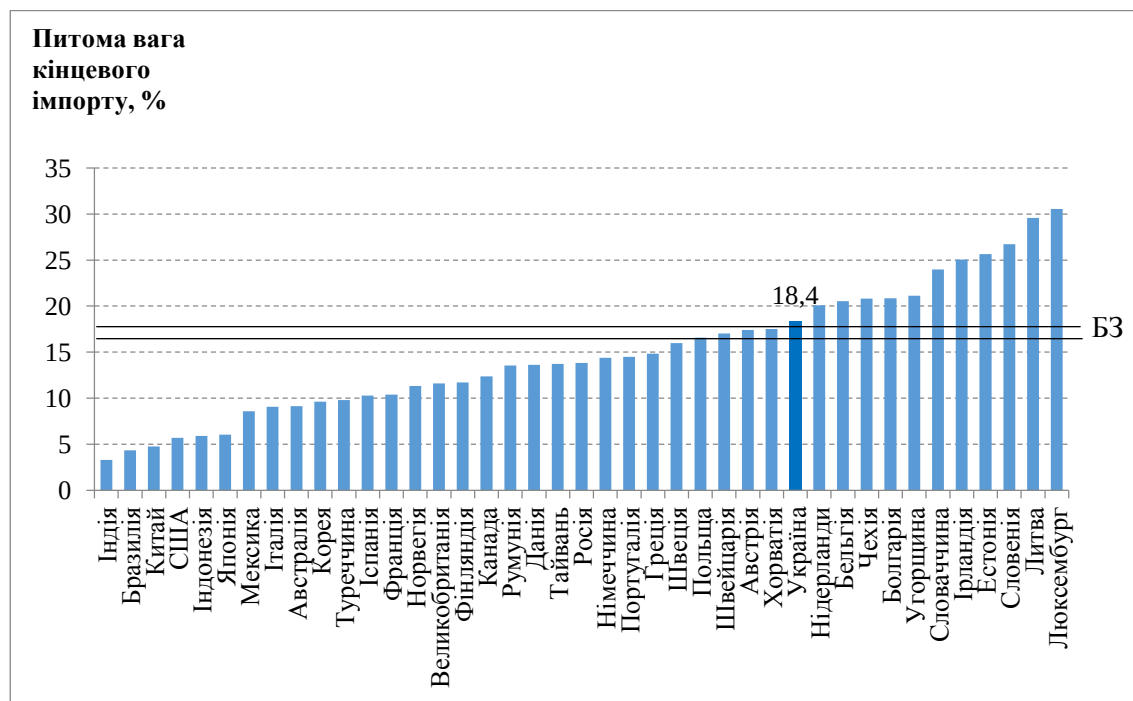


Рисунок 10 – Розподіл країн світу за критерієм «Питома вага імпорту для цілей кінцевого споживання у загальному обсязі кінцевого споживання» у 2014 р.

З точки зору спроможності економіки до забезпечення якості життя населення та задоволення його потреб найбільш суттєвим є показник питомої ваги імпорту кінцевої продукції у загальному обсязі кінцевого споживання (рис. 10). У 2014 р. значення цього критерію в Україні майже відповідало безпечному діапазону від 17,2 % до 17,4 %. Як видно на рис. 10, для більшості країн серед тих, що розглядалися, цей показник менше за нижню межу, що можна розглядати як позитивний факт. Але слід зазначити, що ці країни суттєво розрізняються за структурою та обсягами індивідуального споживання, тому малі значення імпорту кінцевої продукції для них не мають загальної основи, а тому не можуть розглядатися як критерії безпеки. Крім того, при розробці критеріїв безпечного рівня вибірка країн була ширшою (63 країни за 11 років), що забезпечувало об'єктивність критеріїв.

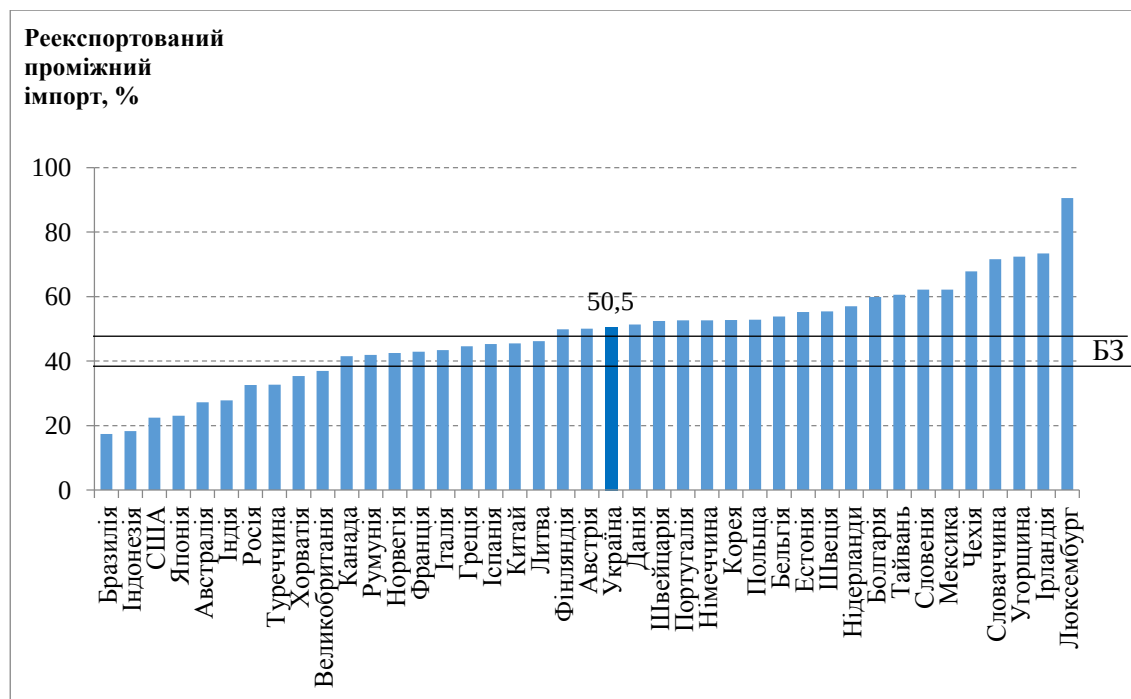


Рисунок 11 – Розподіл країн світу за критерієм «Реекспортований проміжний імпорт у % всього проміжного імпорту» у 2014 р.

З огляду на необхідність налагодження нових виробничих зв'язків в рамках глобальних ланцюгів доданої вартості більшого значення набуває показник питомої ваги реекспортованого проміжного імпорту у загальному обсязі проміжного імпорту. Цей показник характеризує ступінь включення країни у світові виробничі ланцюги разом із ступенем залежності її виробництва. Значення показника для України у 2014 р. 50,5 % було на межі безпечного діапазону від 37,9 % до 47,6 %, що відповідає рівню розвинутих країн ЄС і говорить про достатній рівень безпеки за цим критерієм. Слід зазначити, що для більшості країн, які приєдналися до ЄС, починаючи з 2004 р., цей показник перевищує безпечну межу. Отже, включення країн, що розвиваються, у виробничі ланцюги, які контролюються розвиненими країнами, створює потенційні ризики надмірної залежності від імпорту технологій, комплектуючих, обладнання. Тому необхідним є розвиток власної виробничої бази та розробка унікальних технологій.

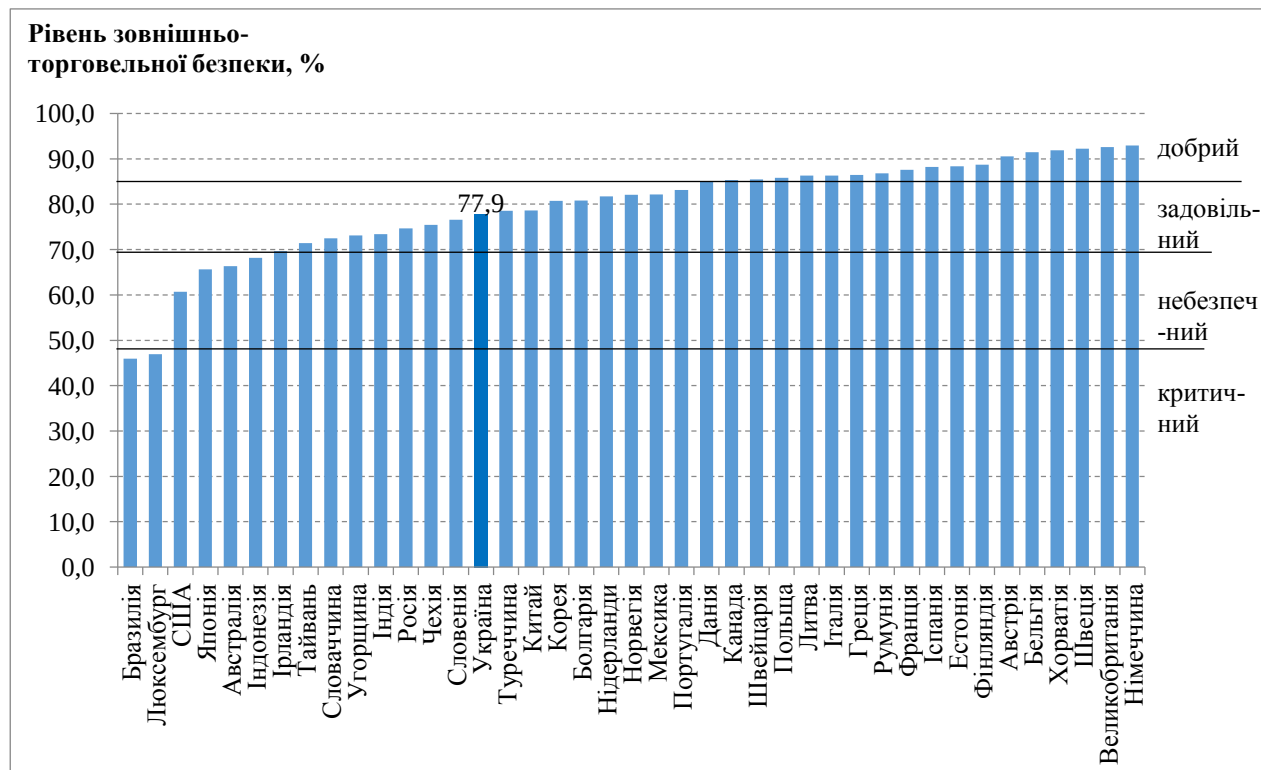


Рисунок 12 – Розподіл країн за рівнем зовнішньоторговельної безпеки у 2014 р.

Як показано вище, усі показники зовнішньоторговельної безпеки України у 2014 р. були поза межами безпечної зони, отже відповідні стандартизовані оцінки менше 100 %. Інтегральна оцінка у 77,9 % знаходиться всередині діапазону значень, який відповідає задовільному стану зовнішньоторговельної безпеки (рис.12). Головним чином це пояснюється невеликою питомою вагою імпорту у кінцевому споживанні, умовно припустимим значенням балансу доданої вартості та помірною часткою реекспортованого імпорту в усьому проміжному імпорті. Втім баланс доданої вартості залишається від'ємним, що потенційно становить загрозу зовнішньоторговельній безпеці. За рівнем зовнішньоторговельної безпеки Україна у 2014 р. знаходилась на 27-му місці, значно поступаючись більшості розвинених країн світу.

Аналогічним чином було здійснено оцінку стану зовнішньоторговельної безпеки України у 2016 р. Проміжні результати у порівнянні з 2014 р., а також результуючий інтегральний показник подані у табл. 1.

Таблиця 1 – Розрахунок рівня зовнішньоторговельної безпеки України у 2014 та 2016 рр.

Показник зовнішньоторговельної безпеки	Вихідне значення, %		Стандартизоване значення, %		Інтегральний показник, %		Рівень зовнішньоторговельної безпеки	
	2014 р.	2016 р.	2014 р.	2016 р.	2014 р.	2016 р.	2014 р.	2016 р.
Коефіцієнт покриття експортом імпорту	93,3	87,4 ↓	89,4	74,6 ↓	77,9	78,0	Задовільний	Задовільний
Баланс доданої вартості у кінцевому споживанні у відсотках експорту	-7,2	-12,7 ↓	93,0	85,3 ↓				
Питома вага провідної країни-партнера у загальному обсязі зовнішньої торгівлі	20,8	11,6 ↓	15,4	100,0 ↑				
Питома вага імпорту у ємності внутрішнього ринку	24,2	25,7 ↑	92,6	88,2 ↓				
Питома вага реекспортованого проміжного імпорту в усьому проміжному імпорті	50,5	48,8 ↓	93,1	97,3 ↑				
Питома вага імпорту кінцевої продукції у кінцевому споживанні	18,4	17,3 ↓	97,7	100,0 ↑				
Питома вага валової доданої вартості національного походження у експорті	62,2	62,9 ↑	72,7	75,1 ↑				
Частка високотехнологічної продукції у товарному експорті	3,6	3,7 ↑	28,1	29,0 ↑				
Питома вага валової доданої вартості у випуску	41,2	40,0 ↓	64,2	56,4 ↓				

↑ - збільшення показника; ↓ - зменшення показника

Порівняння вихідних значень показників зовнішньоторговельної безпеки для України дозволяє зробити висновок про відсутність за два роки суттєвих зрушень. Крім того, позитивні зміни в одних напрямках нівелювалися негативними змінами в інших. Так, суттєво зменшилася питома вага провідної країни партнера в обсязі зовнішньої торгівлі, що дозволило отримати за цим показником найвищу оцінку – 100 %. Так само найбільшою є оцінка за показником значущості імпорту у забезпеченні кінцевого споживання та приведення його до безпечної зони. Збільшилася також оцінка питомої ваги реекспортованого проміжного імпорту (зменшення вихідного значення також наблизило показник до безпечної зони).

Незначні зрушення у показниках якості експорту (підвищення питомої ваги доданої вартості національного походження в експорті та частки високотехнологічного товарного експорту) покращили оцінки за цими складовими. Але частка високотехнологічного експорту залишається надто низькою, а її оцінка у 29,0 % неприйнятною.

Разом з тим відбулося погіршення у інших напрямках. Найбільше знизився коефіцієнт покриття експортом імпорту, що призвело до суттєвого зниження його стандартизованої оцінки (85,3 %). Так само знизився баланс доданої вартості у кінцевому споживанні. Таким чином, оцінки за балансовою складовою зовнішньоторговельної безпеки у цілому погіршилися. Крім того, знизилася питома вага доданої вартості у випуску, що також є негативною тенденцією. Разом з тим за два роки імпортозалежність вітчизняного виробництва посилилася, оскільки питома вага імпорту у ємності внутрішнього ринку збільшилася (з 24,2 % до 25,7 %), що призвело до зниження її оцінки.

У сукупності позитивний внесок одних складових зовнішньоторговельної безпеки нівелювався негативними тенденціями в інших. Отже, інтегральна оцінка залишилася без змін 77,9–78,0 % (збільшилася лише на 0,1 в.п). Втім,

клас безпеки залишився задовільним. Таким чином, зміни, які відбувалися у зовнішній торгівлі та внутрішньому виробництві, не носили системного характеру. Найбільш проблемною залишається структура експорту, у якій високотехнологічні товари з високою питомою вагою доданої вартості національного походження займають дуже малу частку. Зменшення концентрації зовнішньої торгівлі і її географічна диверсифікація мають супроводжуватися змінами у товарній структурі зовнішньої торгівлі. Оскільки подальше поліпшення у цьому напрямку не матиме впливу на стан зовнішньоторговельної безпеки, то його треба досягати іншими засобами, зокрема, поліпшенням балансу торгівлі та заміщенням імпорту ресурсів у виробництві.

Висновки

Розроблений підхід до оцінки зовнішньоторговельної безпеки, який ґрунтується на гіпотезі про нелінійний характер зв'язку між рівнем безпеки та частками доданої вартості у торгівлі, дозволив побудувати інтегральну оцінку зовнішньоторговельної безпеки та визначити її рівень.

Універсальність підходу полягає у тому, що він дозволяє здійснювати оцінку не лише по економіці у цілому, але й по окремих видах економічної діяльності із відповідним корегуванням окремих формул.

Оцінка за запропонованою методикою рівня зовнішньоторговельної безпеки України за 2014 та 2016 рр. показала, що рівень безпеки можна класифікувати як задовільний. Але позитивні зрушення у зовнішній торгівлі, які відбулися протягом двох років, не мали суттєвого впливу, оскільки були компенсовані негативними тенденціями, зокрема у погіршенні балансу торгівлі та імпортозалежності вітчизняного виробництва. Крім того, основні проблеми – сировинна

спрямованість експорту та низький рівень високотехнологічного товарного експорту – залишаються головними перешкодами для поліпшення рівня зовнішньоторговельної безпеки. Таким чином, необхідно забезпечити стимулювання експорту товарів вищого ступеня обробки та зниження імпортозалежності виробництва товарів для внутрішнього кінцевого споживання шляхом розробки та впровадження Стратегії розвитку промисловості України та удосконалення прийнятої Експортної стратегії України.

Перелік джерел посилання

1. Державна служба статистики України // Офіційний сайт [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <http://www.ukrstat.gov.ua/>
2. Comtrade database through the WITS platform [Електронний ресурс]. – Режим доступу : <https://comtrade.un.org/>
3. Trade in Value Added Database / OECD [Електронний ресурс]. –
4. Режим доступу: https://stats.oecd.org/Index.aspx?DataSetCode=TIVA_2018_C1&_ga=2.189020715.1291037199.1548318561-518128729.1545055521

Розробники: член-кореспондент НАН України, д.е.н., професор, директор НДЦ ІПР НАН України **Кизим М. О.**;
к.е.н., доцент, завідувач сектору макроекономічного аналізу та прогнозування відділу макроекономічної політики та регіонального розвитку НДЦ ІПР НАН України **Полякова О. Ю.**;
к.е.н., старший науковий співробітник сектору макроекономічного аналізу та прогнозування відділу макроекономічної політики та регіонального розвитку НДЦ ІПР НАН України **Шликова В. О.**