

РОЗДІЛ 1. ЕКОНОМІЧНА ТЕОРІЯ ТА ІСТОРІЯ ЕКОНОМІЧНОЇ ДУМКИ

РИНКОВА ТРАНСФОРМАЦІЯ ЕКОНОМІКИ ЯК ФАКТОР ПІДВИЩЕННЯ СУСПІЛЬНОГО ДОБРОБУТУ У ПОСТСОЦІАЛІСТИЧНИХ КРАЇНАХ

MARKET TRANSFORMATION OF THE ECONOMY AS A FACTOR OF INCREASING SOCIAL WELFARE IN THE POST-SOCIALIST COUNTRIES

У статті досліджено вплив таких факторів, як свобода прийняття економічних рішень, рівень реформування економіки, характер соціальної політики, економічний розвиток країни, на рівень суспільного добробуту в постсоціалістичних країнах Центральної та Східної Європи, які було розподілено на три кластери за показниками ефективності економіки та соціальної справедливості, виміряних рівнем доходів на одну особу та індексом Джині. Для кожного кластеру було побудовано модель множинної лінійної регресії.

Ключові слова: ринкова трансформація, суспільний добробут, індекс Джині, економічна свобода, постсоціалістичні країни.

В статье исследовано влияние таких факторов, как свобода принятия экономических решений, уровень реформирования экономики, характер социальной политики, экономическое развитие страны, на уровень общественного благосостояния в постсоциалистических странах Центральной и Восточной Европы, которые были разделены на три кластера по показателям

эффективности экономики и социальной справедливости, измеренных уровнем доходов на душу населения и индексом Джини. Для каждого кластера была построена модель множественной линейной регрессии.
Ключевые слова: рыночная трансформация, общественное благосостояние, индекс Джини, экономическая свобода, постсоциалистические страны.

The article examines the influence of such factors as the freedom of economic decision-making, the level of economic reform, the nature of social policy, economic development of the country on the level of social welfare in the post-socialist countries of Central and Eastern Europe. The factors were divided into three clusters according to the performance indicators of the economy and social justice, measured by the per capita income level and the Gini index. For each cluster, a multiple linear regression model was constructed.

Key words: market transformation, public welfare, Gini index, economic freedom, post-socialist countries.

УДК 330.12

Борщенко Т.І.

аспірантка кафедри економічної теорії, макро- і мікроекономіки Київський національний університет імені Тараса Шевченка

Постановка проблеми. Наприкінці ХХ століття відбулися кардинальні зміни, що призвели до трансформації політичної та економічної систем в країнах Центральної та Східної Європи (ЦСЄ) в результаті розпаду Радянського Союзу. Як наслідок, спостерігається різний соціально-економічний розвиток та рівень добробуту країн. Через різні пріоритети та цілі ці країни також характеризуються різними рівнями соціально-економічного розвитку. Крах соціалізму у цих країнах є переконливим історичним фактом, що говорить про перевагу ринкової економіки над централізованим плануванням. Після близько 30 років політичних, соціальних та економічних перетворень можна спостерігати значну диференціацію соціально-економічного розвитку окремих країн ЦСЄ та, відповідно, рівня їх суспільного добробуту. Досвід цієї групи країн дає важливий емпіричний матеріал для вивчення впливу ринкового реформування на економічне зростання та суспільний добробут.

Аналіз останніх досліджень і публікацій. Дослідження чинників, що впливають на рівень суспільного добробуту, належить до найбільш актуальних проблем сучасної економічної науки. Останні найбільш вагомі здобутки у цій сфері відображені у працях відомих сучасних економістів:

Я. Корнаї, О. Бланшара, М. Кремера, Н. Бергрена, Ш. Грубеля та ін.

Постановка завдання. Метою статті є визначення, чи є ринкова трансформація економіки фактором підвищення добробуту в постсоціалістичних країнах.

Виклад основного матеріалу дослідження. Суспільний добробут безпосередньо характеризує якість та рівень життя населення, проте залишається відкритим питання, чому країни досягають різного рівня добробуту, навіть маючи доволі подібні стартові умови.

Виходячи з того, що саме зростання суспільного добробуту є кінцевою метою соціально-економічного розвитку країни, важливо з'ясувати, які саме чинники визначають успішність у досягненні цієї мети, щоб свідомо активізувати їх у процесі вироблення відповідно спрямованої суспільно-економічної політики. Це дасть змогу знайти відповідь на питання, чому одні країни досягли значного прогресу, тоді як інші просунулися вперед доволі незначно.

Існує чимало сучасних економістів, які на емпіричному рівні відзначають наявність безпосереднього зв'язку між економічним зростанням і добробутом окремої країни та рівнем економіч-

ної свободи, що підтверджує висновки класичної школи економічної теорії щодо ролі вільного ринку у забезпеченні суспільного добробуту.

На думку деяких авторів [4], незалежно від вибірки країн, рівня економічної свободи та рівня агрегування є постійні позитивні взаємозв'язки між економічною свободою та економічним зростанням; при цьому економічна свобода має значно більший вплив на економічне зростання, ніж свобода політична.

Важливою площиною, в якій розглядаються наслідки досягнення певного рівня економічної свободи, є добробут населення. Н. Берггрен [2] довів, що за високого рівня економічної свободи в суспільстві всі групи населення виграють більш-менш рівномірно. Якщо ж рівень економічної свободи низький, то виграють лише окремі його верстви, при цьому може посилюватися нерівномірність розвитку суспільства. Ш. Грубель виявив додатну кореляцію між ступенем економічної свободи (розрахованою за методикою Інституту Фрейзера) і рівнем доходів населення, їх зростанням, скороченням безробіття і розвитком людського потенціалу [7].

Окремі економісти [3, с. 126] вважають, що «економічна свобода позитивно впливає на економічну перебудову, оскільки міжнародний досвід останніх п'ятдесяти років підтверджує той факт, що країни, в яких більшою мірою розвинені ринкові інститути, сформована відкрита політика у сфері зовнішньої торгівлі й інвестицій, як правило, процвітають. І навпаки, ті держави, які орієнтовані винятково на внутрішні ринки в поєднанні зі значним ступенем державного регулювання економічних процесів, демонструють повільні темпи зростання».

Однак, задля об'єктивності слід згадати і дослідження, які не показали статистично значущого зв'язку між індикаторами економічної свободи і зростанням суспільного добробуту. Наприклад, Дж. Гартний, Р. Лоусон і Р. Холкомб [8] дійшли висновку, що економічний та соціальний розвиток не можна чітко спрогнозувати на основі наявного розширення економічної свободи.

Проте загалом зростає кількість досліджень, у яких відзначається додатна кореляція між ринковим реформуванням та соціально-економічним розвитком. Зокрема, стосовно економіки постсоціалістичних країн, слід відзначити праці Я. Корнаї [9], О. Бланшара і М. Кремера [1].

Незважаючи на велику кількість досліджень, що підтверджують наявність позитивного впливу ринкового реформування на соціально-економічний розвиток країн, що переходять до ринкової економіки, це питання все ще залишається дискусійним і потребує подальших досліджень.

Зокрема, головним недоліком традиційних показників суспільного добробуту є те, що більшість

із них розраховується на основі середніх величин, наприклад, ВВП на одну особу. У результаті отримуємо кореляцію, яка не відповідає дійсності. Тому результативним показником, що представляє величину суспільного добробуту, було обрано індекс суспільного добробуту Амартія Сена. Індекс враховує не лише економічний складник – дохід населення, а й рівень справедливості розподілу в суспільстві – індекс Джині. Розраховується таким чином: $J = E(1 - G)$, де E – національний дохід на душу населення, а G – індекс Джині [11, с. 435].

Відповідно, чим менша нерівність розподілу доходів, тим вищий добробут нації. За такого підходу рівень добробуту залежить не від доходу, а від можливостей, які він відкриває.

У результаті теоретичного узагальнення наявних підходів щодо детермінант суспільного добробуту в трансформаційній економіці було виділено такі фактори впливу на динаміку добробуту, як:

- свобода прийняття економічних рішень;
- прогрес у ринковому реформуванні економіки;
- характер соціальної політики;
- економічний розвиток країни.

Фактором, що відображає ступінь свободи прийняття економічних рішень, було обрано Індекс економічної свободи, що розраховується Heritage Foundation. Щорічна публікація цього індексу дає змогу побачити, як останні зміни в політиці урядів впливають на економічну свободу. Основними показниками, на основі яких будується індекс, є: корупція в системі судових органів, митна та урядова бюрократія; нетарифні бар'єри в торгівлі, такі як заборона імпорту або його квотування, а також строгі вимоги щодо маркування і ліцензування; фіскальний тягар, що охоплює ставки прибуткового податку, податок на прибуток корпорацій і державні витрати як відсоток від ВВП; верховенство закону, ефективність судової системи і можливість виконання контрактів; відповідальність бізнесу, пов'язана з охороною здоров'я, забезпеченням виробничої безпеки і захистом навколишнього середовища; обмеження для банків, що стосуються фінансових послуг (продаж цінних паперів і страхування); регулювання ринку праці; активність «чорного ринку» [10].

Вимірювання прогресу у ринковому реформуванні економіки є надзвичайно проблемним завданням, адже досить складно підібрати відповідні статистичні показники, і таке оцінювання часто має суб'єктивний характер. Для порівняння країн, які мають різний рівень соціально-економічного розвитку, однак схожі вектори розвитку, необхідно мати числові характеристики цих процесів. Так, Європейський Банк Реконструкції та Розвитку (ЄБРР) щорічно публікує Звіт про прогрес у сфері трансформації економік 25 країн Центральної і Східної Європи (ЦСЕ) і колишнього Радянського Союзу (Transition Report).

Оцінка успіху реформ, які необхідно ініціювати на ранній стадії трансформації, здійснюється за такими параметрами, як: лібералізація ринків і торгівлі, мала приватизація, лібералізація цін і торгівлі, вільний доступ до іноземної валюти, розмір покриття населенням економічних витрат на надання комунальних послуг. Другий етап реформ: приватизація великих підприємств та інституційні реформи, необхідні для розвитку конкурентних ринків і створення середовища для їхнього ефективного функціонування [5].

Для побудови моделі одним із факторів було обрано середнє значення по 6 Індексам ринкового реформування трансформаційних економік, подане у Звіті ЄБРР.

Для визначення того, наскільки соціальна політика спрямована на розвиток людського капіталу, було обрано два показники: витрати держави на освіту та витрати на охорону здоров'я (у дол. США на особу). Для оцінки динаміки економічного розвитку країни було обрано показник ВВП на особу за паритетом купівельної спроможності.

Вплив обраних факторів на рівень суспільного добробуту та їх взаємозв'язок між собою схематично подано на рис. 1.

Для оцінки впливу факторів на динаміку суспільного добробуту було використано збалансовані панельні данні, які складаються із показників по 19 країнах ЦСЄ за період 1995–2016 рр., які подані в базах даних Human Development Report, Index of Economic Freedom, статистичних базах ЄБРР та Світового Банку [6; 10; 12].

Найбільшою перевагою, яку надають панельні дані, є велика кількість спостережень, які збільшують кількість ступенів свободи та зменшують залежність між пояснюючими ознаками і, відповідно, стандартні похибки оцінки.

Для підвищення достовірностей результатів моделі 19 країн Центральної та Східної Європи поділено на групи (кластери) за показниками

суспільного добробуту: доходами на оду особу та Індексом Джині. Відстань між об'єктами розраховувалася за формулою Евклідової відстані, а кластеризація здійснювалася методом одиничного зв'язку (метод «найближчого сусіда»).

Кластер 1 представлений Польщею, Угорщиною, Словаччиною, Чехією, Словенією, Хорватією, Болгарією і країнами Балтії. Для цієї групи країн характерний нетривалий (за історичними мірками) період існування планової економіки – близько 40 років, причому в менш жорсткому її варіанті.

Стартові можливості для розвитку цієї групи держав були вельми сприятливі. В економіці зберігалися елементи приватної власності і приватної ініціативи, відносна збалансованість народного господарства або невеликий обсяг диспропорцій, готовність населення до прийняття цінностей ринкової економіки. Порівняно швидке й успішне просування до ринкової економіки зумовлено також тісними економічними та історичними зв'язками із Західною Європою. Реформи здійснювалися в результаті поєднання еволюційного і радикального варіантів перетворень. Переважно еволюційний характер реформ характерний для Угорщини, Словаччини, Словенії, Хорватії. Радикальні методи реформування застосовувалися в Польщі і меншою мірою – в Чехії. У результаті перетворень сформувалася односекторна модель перехідної економіки. Відзначається порівняно швидке й успішне просування до ринкової економіки.

До другого та третього кластерів увійшли такі країни, як Білорусь, Румунія, країни колишньої Югославії, Албанія, Республіка Македонія, Російська Федерація, Білорусь та Україна. Для більшості цих країн характерним є більш тривале існування адміністративно-командної системи (понад 70 років) в найбільш жорсткому її варіанті. Економіка характеризувалася максимальним одержавленням засобів виробництва, тотальним регламентуванням господарської діяльності,

придушенням будь-яких спроб приватної ініціативи і приватної власності, крайнім ступенем монополізації господарської діяльності. Для країн третього кластера характерним, зокрема, є поєднання низького рівня доходів населення із низьким рівнем нерівності за доходами.

За використання методу найменших квадратів були побудовані моделі множинної лінійної регресії на основі панельних даних для кожного кластера.

Залежні змінні: y – індекс суспільного добробуту (за Сеном).

Факторні ознаки: x_1 – Індекс економічної свободи; x_2 – індекс

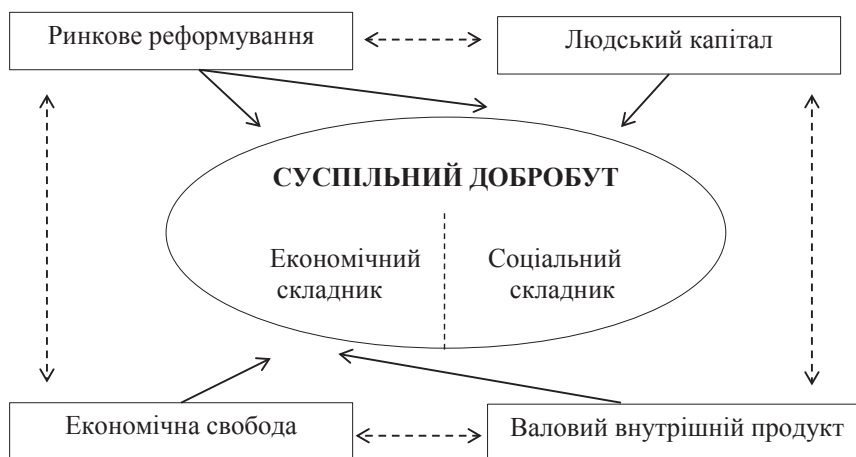


Рис. 1. Схема взаємодії чинників суспільного добробуту

Джерело: розроблено автором

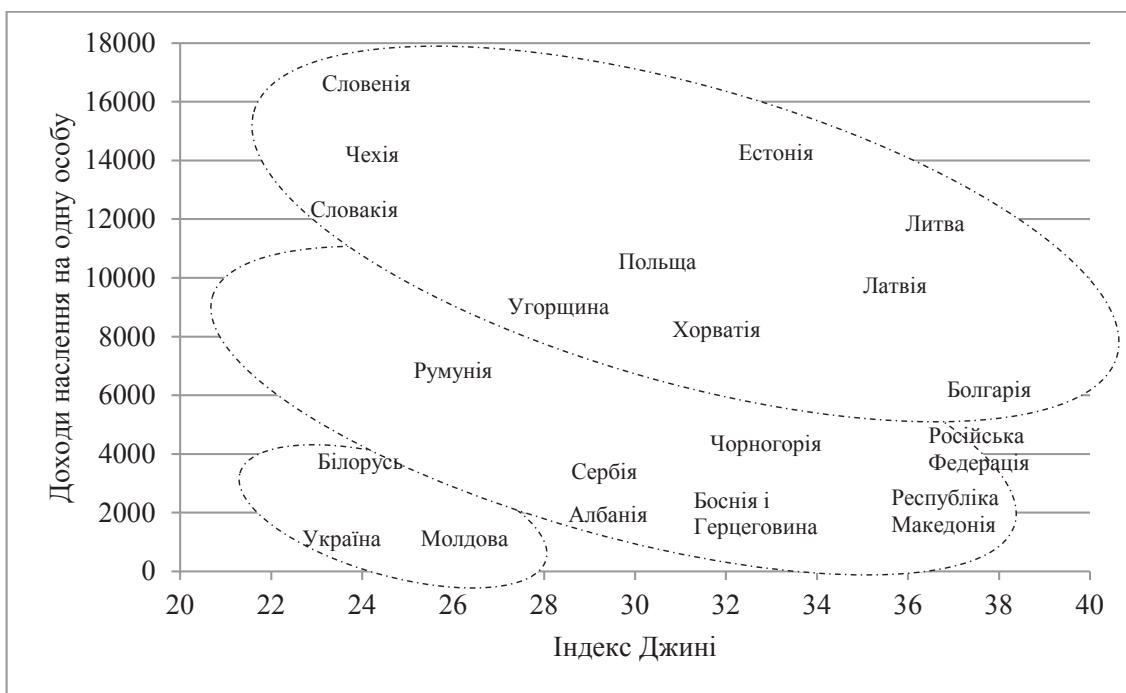


Рис. 2. Розподіл країн на кластери за даними 2016 р.

Джерело: розраховано автором на основі даних [12]

упровадження реформ; x_3 – витрати на освіту; x_4 – витрати на охорону здоров'я; x_5 – ВВП за паритетом купівельної спроможності на одну особу.

$$Y = C(1) \cdot X1(-1) + C(2) \cdot X2(-1) + C(3) \cdot X3 + C(4) \cdot X4 + C(5) \cdot X5$$

Побудова регресійної моделі для всієї сукупності постсоціалістичних країн не дала адекватних результатів: вплив факторів виявився незначущим, а коефіцієнт детермінації низьким. Результати регресійного аналізу подані в табл. 1.

C – незалежна змінна;

AR – авторегресійна компонента, усуває залежність прогнозованого показника від його ж значення у попередньому періоді;

R^2 – коефіцієнт детермінації, демонструє тісноту взаємозв'язку між змінними.

Для країн, віднесених до кластера 1, характерним є високий ступінь впливу факторів на рівень суспільного добробуту. Всі коефіцієнти – зі знаком «+», що свідчить про додатний взаємозв'язок між факторами та результативною змінною. Фактори

«Індекс економічної свободи» та «Індекс реформування економіки» включені до моделей із лагом в один рік, тому що вони розраховуються на основі даних попереднього року.

Країни другого кластера демонструють подібну ситуацію, однак фактор «Індекс економічної свободи» є незначущим щодо впливу на суспільний добробут. Така ситуація може пояснюватися недостатнім рівнем економічної свободи та відсутністю певної тенденції у динаміці Індeksu. Всі інші фактори характеризуються тісним додатним взаємозв'язком із рівнем добробуту.

Для країн третього кластера виявилось, що фактори «Індекс економічної свободи» та «Індекс реформування економіки» є незначущими. Це може бути пояснено низьким рівнем економічної свободи та незавершеністю ринкового реформування економіки у цих країнах. Цікавою є також наявність від'ємного зв'язку між суспільним добробутом та рівнем ВВП на одну особу.

Таблиця 1

Результати регресійного аналізу для кожного окремого кластера країн

	$X1(-1)$	$X2(-1)$	$X3$	$X4$	$X5$	C	$AR(3)$	R^2
Кластер 1	0.2079 (0,0035)	1.4735 (0,0000)	1.3967 (0,0000)	0.0155 (0,0071)	0.3117 (0,0000)	- 5.9744 (0,0000)	0.2382 (0,0000)	0,996
Кластер 2		1,8076 (0,0000)	0.6143 (0,0000)	0.0615 (0,0001)	0.4657 (0,0002)	2.0376 (0,0071)	1.0449 (0,0000)	0,986
Кластер 3			1.0517 (0,0000)	0.0198 (0,0000)	-0.1689 (0,0000)	1.1271 (0,0000)	0.9541 (0,0000)	0,995

Джерело: розраховано автором на основі даних [6, 10, 12]

Висновки з проведеного дослідження.

Знаходження оптимального співвідношення між втручанням держави в розвиток економіки та дією ринкових інститутів є актуальною проблемою для більшості країн Центральної та Східної Європи. Відстеження закономірностей у тенденціях зв'язків між значеннями Індексів економічної свободи, Індексом ринкового регулювання, спрямованості соціальної політики, величиною ВВП і окремими індикаторами розвитку економіки дає змогу ідентифікувати можливі джерела зростання суспільного добробуту.

На основ наявних теоретичних та емпіричних досліджень було визначено наявність прямого зв'язку між факторами ринкового реформування, специфікою соціальної політики, економічним розвитком країни та зростанням суспільного добробуту в країнах ЦСЄ, які досягли досить високого рівня суспільного добробуту.

У менш розвинених країнах вплив розглянутих факторів на рівень суспільного добробуту не такий однозначний. Це пояснюється відсутністю достатнього рівня економічної свободи, незавершеним процесом ринкового реформування, диспропорціями матеріального та нематеріального виробництва.

Отже, з одного боку, більшості країн ЦСЄ вдалося здійснити суттєві зміни на шляху побудови ринкової економіки та забезпечення високого рівня суспільного добробуту, а з іншого – все ще наявні проблемні місця у сфері розбудови якісного та конкурентного підприємницького середовища, корпоративного управління, надійної правової системи тощо. Основна причина цього для більшості колишніх радянських країн, у тому числі й для України, полягає у відсутності цивілізованих ринкових інститутів, які нереально створити за рахунок реформ, що мають «частковий», непослідовний характер. Особливої актуальності у світлі вищезазначеного набувають подальші дослід-

ження, спрямовані на виявлення шляхів підвищення якості та модернізації вітчизняного інституціонального середовища.

БІБЛІОГРАФІЧНИЙ СПИСОК:

1. Blanchard O. The economics of transition in Eastern Europe. Oxford: Clarendon Press. 1997. P. 34–56.
2. Berggren N. The Benefits of Economic Freedom / N. Berggren. URL: http://www.freetheworld.com/papers/berggren_review.pdf.
3. Bhagwati J. Economic Freedom: Prosperity and Social Progress / J. Bhagwati // Paper presented to the Conference on Economic Freedom and Development, Tokyo, June 17–18, 1998. P. 123–157.
4. Doucouliagos C. Economic Freedom and Economic Growth: Does Specification Make a Difference? / C. Doucouliagos, A. Mehmet Ulubasoglu // European Journal of Political Economy. 2006. P. 60–81.
5. Havrylyshyn O. Recovery and Growth in Transition: A Decade of Evidence, IMF Staff Papers, 48. 2008. P. 53–87.
6. Human Development Index / United Nations Development programme [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <http://hdr.undp.org/en/content>.
7. Grubel H. Economic Freedom and Human Welfare: Some Empirical Findings / H. Grubel // Cato Journal. 1998. Vol. 18, № 2. P. 287–304.
8. Gwartney J. Economic Freedom and the Environment for Economic Growth / James G. Gwartney, Robert A. Lawson, R.G. Holcombe // Journal of Institutional and Theoretical Economics 155. 1998. № 4. P. 121–150.
9. Kornai J. The Road to a Free Economy. Shifting from a Socialist System: The Example of Hungary. N.Y.: W.W. Norton. 1990. 324 p.
10. Рейтинг країн за індексом економічної свободи Heritage Foundation. URL: <http://www.heritage.org/index/explore.aspx?view=byregion-country-year>.
11. Sen A. Resources, Values and Development. First Harvard University Press Paperback Edition. 1997. 560 p.
12. World Bank Open Data: <https://data.worldbank.org/>.