

В. Ю. ПОПОВ,
кандидат економічних наук,
доцент кафедри економіки підприємств,
Національна академія статистики, обліку та аудиту

Аномалії в розвитку української економіки у системі статистичних показників

В статті виявлено ознаки, які характеризують аномальні відхилення в розвитку української економіки. Економічний цикл досліджено з використанням статистичних показників для встановлення ступеня відповідності положеннями теорії циклів та міжнародного порівняльного аналізу.

Ключові слова: економічний розвиток, аномалія, криза, статистика, валовий внутрішній продукт, циклічність, занепад.

Постановка проблеми. Циклічність економічного розвитку є загальновизнаною проблематикою наукових досліджень. Відповідні наукові пошуки послідовно розгортались в таких основних напрямках: встановлення хронологічної послідовності економічних циклів, виявлення закономірних причин циклічності, розроблення механізмів усунення негативних наслідків циклічних змін в економіці. Незважаючи на відсутність єдності серед науковців в жодному з цих напрямів, циклічність однак сприймається як незаперечний факт реальності. Це положення свідчить про наявність певного прихованого парадоксу в сучасній економічній науці. Адже теоретично обґрунтовані концепції далеко не завжди призводять до позитивного економічного розвитку на практиці. Разом із тим, саме аномальність того, що в результаті збагачення обов'язково має бути збідніння (нехай і тимчасове), є тим сигналом, який вказує на необхідність переосмислення існуючої системи наукового пошуку.

Аналіз останніх досліджень і публікацій. Переважна більшість науковців пов'язують циклічність із закономірністю економічного розвитку, а цикл визначають як проміжок часу від початку однієї економічної кризи до наступної. Існують різні бачення щодо елементів економічних циклів. Наприклад, деякі джерела визначають тільки дві стадії циклу – скорочення виробництва з обов'язковим наступним його збільшенням та відновленням, а деякі виокремлюють стадії піднесення, депресії, кризи та пожвавлення. Найбільш поширеним є таке бачення: “Періодично повторювана послідовність періодів підйому та розширення економіки, тимчасового спаду та наступного пожвавлення, відновлення, відома як діловий цикл” [1, с. 361].

Переважною більшістю науковців циклічність розглядається як причина тимчасового призупинення економічного розвитку при загальному позитивному тренді збільшення багатства. Але останнім часом набуває поширення погляд на циклічність як на причину формування стійкої тенденції до занепаду економіки. Необхідність концептуального переосмислення природи циклів обумовлюється декількома причинами.

Перша причина вважається основною і має досить тривалу історію досліджень. Наприклад, А. Афталіон пояснював причину циклу тривалістю процесу виробництва; К. Жугляр вважав причиною циклу порушення в грошовому обігу; С. Кузнець пов'язував причину циклу з періодичною необхідністю оновлення житла; Дж. М. Кларк пов'язував цикл із надзвичайним збільшенням попиту на предмети споживання; А. Шпітгоф ознакою наявності циклічних коливань та економічної кон'юнктури у цілому вважав рівень споживання чорного металу; М. Д. Кондратьєв причиною циклічності вважав механізми нагромадження, акумуляції і розсіювання капіталу; М. І. Туган-Барановський сформулював інвестиційну теорію циклів.

Друга причина може розглядатись як логічний наслідок проблематичного характеру першої причини. Дійсно, якщо циклічність притаманна природі економічної динаміки, тоді чому її наслідком в одних випадках є потужний економічний розвиток, а в інших – занепад?

Витоки бачення циклічності як причини формування тенденції до занепаду економіки знаходимо в теорії економічного розвитку Й. А. Шумпетера. Він вважав кризи своєрідними порушеннями розвитку та такими явищами, що навіть перебувають до нього в “опозиції”. У зв’язку з тим, що “всі кризи – це події, які зупиняють попередній економічний розвиток”, він припустив: “Цілком можливо, що справжні причини криз лежать поза суто економічною сферою, тобто що кризи – це наслідки порушень економічних процесів із зовні” [2, с. 208, 209]. Стан депресії в економіці він визначає як “аномальність”, що виникає внаслідок надмірної паніки підприємців, яка спричиняє епідемію банкрутств та призводить до краху кредитної системи взагалі [2, с. 224, 230]. Тобто тут ми бачимо чітке розмежування: нормальний перебіг депресії пов’язується з нормальними процесами поглинання й ліквідації (перехід до нового виду діяльності, перетік капіталу в іншу галузь і т. ін.), а аномальний – з надмірними темпами поглинання й ліквідації, поштовхом до яких є психологічний елемент – надмірна паніка підприємців.

Сучасний норвезький економіст Ерік Райнерт в дослідженнях економіки розвитку і економічної історії широко висвітлює гостроту цього питання [3]. З використанням значного масиву статистичних даних він демонструє, що розрив між багатими і бідними країнами стрімко зростає. Причину цього явища він бачить у прихильності політиків до існуючих теоретичних підходів до розв’язання економічних проблем.

Безпорадність теоретичної науки стосовно розв’язання проблем циклічності демонструє Генріх Хезліт. Він наводить аргументацію понад 20 видатних науковців про нікчемність кейнсіанської теорії, яка була розроблена з метою недопущення повторення “Великої депресії” (1929–1937 рр.) [4]. Чисельними аргументами він спростовує достовірність базових положень, сформульованих з претензією на недопущення руйнівних криз в економіці. Від себе він дає таке узагальнення: “Незважаючи на неймовірну репутацію загальної теорії я не міг знайти в ній жодної важливої доктрини, яка була б і правдива, і оригінальна. Те що оригінальне в книзі не відповідає дійсності, а те, що правдиве не оригінальне” [5, с. 3]. Цю цитату можна поставити епіграфом не тільки до кейнсіанської теорії, а й до характеристики загального стану сучасної теоретичної науки стосовно розв’язання проблем циклічності в економіці.

Аналіз останніх досліджень і публікацій дає змогу дійти таких узагальнень. Процес накопичення багатства та економічного розвитку вважається нормальним у разі його поступового кількісного збільшення і переходу до нових якісних показників, з незначними коливаннями навколо висхідного тренду. Тоді циклічність розглядається як нормальне явище переходу на новий рівень розвитку. І навпаки, такий стан економіки, коли узагальнений тренд циклічності демонструє спадний характер, вважається аномальним через відсутність розуміння причин його виникнення. Оскільки наслідки циклічності у вигляді негативного тренду є найнебезпечнішими для економіки, від них неможливо абстрагуватися. Тому дослідження причин криз із метою подолання їх наслідків та розроблення системи превентивних заходів для їх недопущення є надзвичайно актуальними.

Метою дослідження є виявлення таких ознак, що характеризують аномальні відхилення економічних змін в Україні, на основі системи статистичних показників із формалізацією стадій ділової активності відповідно до теорії циклів та шляхом міжнародних порівнянь.

Виклад основного матеріалу дослідження. В довготривалій суперечці різних бачень причин і механізмів подолання криз “правила гри” незмінно встановлює статистика. Саме на основі статистичних обстежень неспростовно доводиться реальність того аномального фаталізму, що зростання економіки обов’язково супроводжується періодами її занепаду. Саме статистичними методами досліджень встановлюється ступень достовірності тих положень теоретичної науки, які претендують на пояснення закономірної природи циклічності та пропонують методи подолання її негативних наслідків. Відтак цілком логічним є припущення, що саме статистика має бути і остаточним “арбітром” при виявленні практичної значущості тих чи інших теоретичних положень.

Історія дослідження криз підтверджує відсутність загальної систематизації ознак порушень в економіці. Найчастіше порушення відбуваються у сфері пропо-

зиції (на виробництві, на ринку, у системі кредитування) та у сфері попиту (зміна купівельної спроможності через рівень оплати праці, збільшення цін і тарифів). Ці порушення впливають на стан рівноваги на різних ринках зокрема та на траєкторію економічного розвитку взагалі. Багаторічне дослідження криз науковцями в різних країнах дозволило виявити їх спільні чинники та визначити спільні ознаки перебігу кризових процесів.

Вагомий внесок у дослідження криз та процесів економічного розвитку зробили науковці США з Національного бюро дослідження процесів економічного розвитку (NBER). На підставі узагальнення більш ніж 100-річного досвіду вивчення результатів перебігу економічного розвитку з його злетами і падіннями вони зробили висновки, що найбільш тривала депресія спостерігалася у США у 30-х роках минулого століття. Вона небезпідставно отримала назву "Великої".

Для усвідомлення її глибини та деструктивного впливу на економічний розвиток науковці NBER порівняли її з двома найбільш глибокими депресіями, які також мали місце в США у 1973–1975 та 1981–1982 рр. (табл. 1).

Таблиця 1

Характерні ознаки криз в економіці США

Ознака	Велика депресія (серпень 1929 – травень 1937 рр.)	Рецесія (1973–1975 рр.)	Рецесія (1981–1982 рр.)
Тривалість, місяців	47	16	16
Падіння реального ВВП, %	майже 30	3,4	2,8
Зростання безробіття, %	з 3 до 25	з 4 до 9	з 7 до 11

Джерело: складено автором за даними NBER

Порівняно з 30-відсотковим зменшенням реального ВВП та 25-відсотковим рівнем безробіття у період Великої депресії, які спостерігалися протягом 43 місяців, депресія 1973–1975 рр. тривала лише 16 місяців, спричинила 3,4-відсоткове падіння ВВП та 9-відсотковий рівень безробіття; а депресія 1981–1982 рр., при тій самій тривалості (16 місяців) спричинила значно менший рівень падіння ВВП (2,8%), але більш високий рівень безробіття (11%) [6].

Для характеристики стадії кризи науковці США застосували такі ознаки:

- зменшення ВВП відносно початкового періоду;
- від'ємні темпи приросту ВВП;
- час повернення до середніх темпів приросту ВВП (для економіки США такими вважаються 2,5%);
- зростання рівня безробіття;
- зміни індексу споживчих цін.

Зміни аналогічних статистичних показників української економіки в період 1990–2015 рр., за даними Державної служби статистики України, демонструють наступне.

Підсумковий індекс фізичного зростання ВВП в Україні за 25-річний період, який є маркером стадії ділової активності, скоротився на 41,59 в. п. від рівня 1990 р. Тобто впродовж 25 років цей показник не тільки не відновився, а й зменшився у 1,71 раза. Падіння підсумкового індексу фізичного зростання ВВП стало наслідком аномальних коливань щорічних темпів приросту ВВП (35 в. п.) за від'ємного середнього на рік значення (-1,77%) – з найбільшим від'ємним значенням у 1994 р. (-22,9%) і найбільшим додатним значенням у 2004 р. (12,1%) (рисунок).

Зміни індексу споживчих цін демонструють явну інфляційну спрямованість з максимумом у 1993 р. (102600%) і дефляцією лише у 2002 р. (0,4%) та у 2012 р. (0,2%).

Рівень безробіття, на відміну від показників інфляції та темпів приросту ВВП, демонструє відносну стабільність із загальним відхиленням у 2 рази – від найменшого значення у 1995 р. (5,72%), до найбільшого у 1998 р. (11,64%).

Аналіз перебігу та тривання економічної кризи в українській економіці, як негативної стадії ділового циклу, та міжнародне порівняння її параметрів дає підстави для припущення про аномальність її перебігу в Україні.

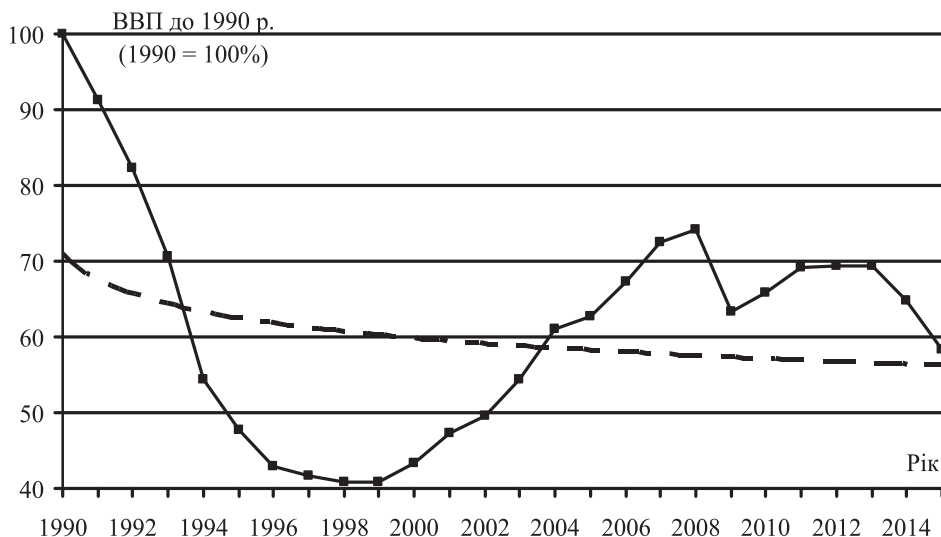


Рис. Зміни ВВП в Україні відносно 1990 р.

Джерело: складено автором за даними Держстату України

Упорядкування змін в українській економіці відносно стадій економічного розвитку:

- рецесія (падіння) – з 1990 р. до початку 1999 р., тобто майже 120 місяців. Коли економіка досягла “дна” у 1999 р., частка ВВП складала 40,84% від ВВП 1990 р., а середні темпи падіння ВВП становили 8,64%;
- піднесення (експансія) – з 2000 р. по 2008 р. включно, тобто 108 місяців. Це дозволило збільшити розміри ВВП у 2008 р. до 74,24% від рівня ВВП 1990 р. Тобто відносно 1990 р. економіка зросла на 33,4 в. п., або у середньому на 6,91% щорічно;
- рецесія (падіння) – 2009 р., яке характеризувалося від’ємним темпом приросту ВВП. Хоча ця рецесія була відносно нетривалою за часом, але дуже глибокою – ВВП за цей період зменшився порівняно з попереднім роком на 14,8%, а розмір ВВП склав тільки 63,26% від ВВП 1990 р.;
- піднесення (експансія) – 2010–2012 рр., тобто майже 36 місяців; розмір ВВП склав 69,41% від 1990 р., а середні додатні темпи щорічного приросту ВВП – 3,17%;
- стагнація – 2013 р., при 0,0% темпах приросту ВВП;
- рецесія (падіння) – з 2014 р., яке триває по цей час, із середніми від’ємними річними темпами приросту за 2014–2015 рр. 8,25%.

Деталізація змін в українській економіці відповідно до теорії циклів доводить, що незважаючи на формальну присутність усіх стадій циклу (наявність періодичної повторюваності періодів підйому та розширення економіки, тимчасового спаду та наступного пожаття з частковим відновленням) в цілому спостерігається не відновлення національної економіки, а її стиснення. Про стиснення національної економіки свідчить спадний характер узагальненого тренду економічного зростання. Рівень ВВП в Україні, який є визначальним маркером стадії ділової активності, за 25-річний період скоротився на 41,59 в. п. від рівня ВВП 1990 р. Тобто впродовж чверті сторіччя цей показник не тільки не відновився, але зменшився у 1,71 раза порівняно з показником 1990 р.

Отже, показники змін ділової активності української економіки впродовж останніх 25 років демонструють переважно ознаки кризового стану. На це вказують значно менші кількісні та часові параметри наступних за рецесіями стадій підйому та розширення економіки.

Той факт, що Україна у 2015 р. навіть не досягла рівня ВВП 1990 р., не кажучи про його декілька кратне збільшення, як в інших країнах, доводить, що національна

економіка перебуває у затяжній довгостроковій кризі, тривалість якої є аномальною. Рівень аномальності визначається тими диспропорціями в послідовних стадіях циклічних змін, які спричиняють розбалансованість економічного розвитку.

Виявлення і конкретизація параметрів розбалансованості економічного розвитку є необхідною умовою подолання його аномальності, насамперед через зрозуміння сутності порушень перебігу економічних циклів. Це потребує побудови відповідного теоретико-методологічного апарату статистичного дослідження економічних і соціальних явищ та процесів.

Міжнародне порівняння параметрів економічного розвитку України дає можливість встановити ступінь його розбалансованості та відхилень від загальних закономірностей перебігу економічних циклів. Порівняльний аналіз України і США виконано з використанням даних Держстату України та даних NBER щодо найглибшої за роки існування США кризи (“Велика депресія”) [6]. Аналіз також вказує на такі відхилення економічних параметрів України, які можна охарактеризувати як аномальні: глибина падіння ВВП – 30% у США і 41,6% в Україні; тривалість кризи – 47 місяців в США (найтриваліше явище впродовж 150 років) і 312 місяців в Україні (з 1991 р. до 01.01.2016 р.) (табл. 2).

Таблиця 3

Порівняльний аналіз кризи в США та в Україні

Показники	США (1929–1937 рр.)	Україна (1990–2015 рр.)
Стадії циклу	Відповідає теорії циклів	Відсутня стадія відновлення
Характер тренду економічного зростання	Висхідний	Спадний
Тривалість, місяців	47	312
Глибина падіння ВВП, %	Приблизно 30	41,6
Характер зміни індексу споживчих цін	Дефляція	Інфляція
Рівень безробіття, %	25	8,6

Джерело: дані Держстату України та NBER

Впродовж 1990–2015 рр. в Україні (на відміну від США) спостерігався спадний характер тренду циклічних змін з від’ємними середніми річними темпами змін ВВП (-1,77%). Це підтверджує припущення про відсутність фази оновлення виробництва в українській економіці, що є аномальним явищем. Інші показники також демонструють суттєві відхилення, але не з настільки чіткими ознаками аномальності, як показник ВВП. Зміни індексу споживчих цін в Україні мають діаметрально протилежний напрям порівняно зі США, тобто спостерігається інфляція замість дефляції, а рівень безробіття, який більш ніж утричі менший, аніж у США, майже не перевищує звичайний для ринкової економіки та не є характерним для кризового стану в економіці.

Про причини аномальних відхилень двох останніх показників можна зробити декілька припущень, які потребують додаткових досліджень. Перш за все, порушення відомого взаємозв’язку між інфляцією (дефляцією) та рівнем безробіття, з одного боку, і стадіями економічних циклів, з іншого, вважається аномальним згідно з класичними теоріями. Разом із тим, зважаючи на явно аномальний характер відхилень, не можна залишати поза увагою проблему достовірності статистичних даних і досконалості методологічного апарату статистики.

Отже, хоча теоретично в Україні зберігається певна послідовність спаду та пожвавлення ділової активності, але не відбувається головного – оновлення економіки. Це суперечить загальному визначенню циклів та може вважатися аномалією. На підставі наведених статистичних даних можна констатувати, що економіка України деградує понад 25 років поспіль, підсумковий тренд економічного розвитку в Україні має спадний характер, а така тривала деградація є аномальною (табл. 3).

Характерні ознаки аномальності змін в українській економіці

Ознака	Нормальна	Аномальна (Україна)
Характер загального тренду економічного зростання	Висхідний	Спадний
Стадії ділового циклу	Наявні всі стадії, з певною послідовністю	Відсутня стадія оновлення виробництва
Тривалість циклу	Декілька місяців або декілька десятків місяців	Декілька сотень місяців
Індикатори кризи	Високе безробіття, дефляція	Низьке безробіття, висока інфляція

Джерело: складено автором

Висновки. За результатами дослідження, що охоплює 1990–2015 рр., відповідно до обраних критеріїв виявлення аномалій розвитку української економіки можна зробити декілька висновків:

- 1) Зміни статистичних показників демонструють таку динаміку: скорочення індексу фізичного зростання ВВП на 41,59 в. п.; переважно інфляційна спрямованість індексу споживчих цін; відносно незначне відхилення рівня безробіття; падіння підсумкового тренду економічних циклів.
- 2) Перевірка перебігу циклічності в українській економіці на відповідність теоретичним закономірностям вказує на закономірну послідовність стадій циклів; сумарна тривалість стадій піднесення складає 12, падіння – 13 років; сумарна величина піднесення значно менша за величину падіння, в результаті чого ВВП зменшився у 1,71 раза; на стадіях піднесення не відбувається відновлення тих показників, які передують стадіям падіння.
- 3) Аналіз ознак циклічності при міжнародному порівнянні (Україна і США) показав відмінності за такими ознаками: різна послідовність стадій циклу; протилежне спрямування підсумкового тренду; значно більша тривалість кризисного стану в економіці; більша глибина падіння ВВП; протилежні зміни індексу споживчих цін; парадоксальна невідповідність рівня безробіття.

Отже, результати аналізу дають змогу конкретизувати параметри аномальності економічного розвитку в Україні. Для встановлення причин такої суттєвої розбалансованості економічного розвитку і розроблення механізмів її подолання потрібні системні дослідження. З огляду на глибину проблематики (аномальна невідповідність фундаментальним теоретичним положенням) основою наукового пошуку має бути побудова відповідного теоретико-методологічного апарату статистичних досліджень економічних і соціальних явищ та процесів.

Список використаних джерел

1. Абель Э. Макроэкономика. 5-е изд. / Э. Абель, Б. Берданке ; Пер. с англ. – СПб. : Питер, 2012. – 768 с.
2. Шумпетер Йозеф А. Теория економічного розвитку: дослідження прибутків, капіталу, кредиту, відсотка та економічного циклу / Йозеф А. Шумпетер ; Пер. с англ. В. Старка. – К. : Видавничий дім “Києво-Могилянська академія”, 2011. – 242 с.
3. Reinert Erik S. How Rich Countries Got Rich ... and Why Poor Countries Stay Poor / Eric S. Reinert. – London : Constable, 2007.
4. Кейнс Дж. М. Общая теория занятости, процента и денег / Дж. М. Кейнс ; Пер. с англ. проф. Н. Н. Любимова. – М. : Гелиос АРВ, 2012. – 352 с.
5. The Failure of the “New Economics” / Hazlitt Henry (ed.). – Princeton, N.J. : D. Van Nostrand, 1959.

В. Е. ПОПОВ,
кандидат экономических наук,
доцент кафедры экономики предприятий,
Национальная академия статистики, учета и аудита

Аномалии в развитии украинской экономики в системе статистических показателей

В статье выявлены признаки, характеризующие аномальные отклонения в развитии украинской экономики. Экономический цикл исследован с использованием статистических показателей для установления степени соответствия положениям теории циклов и международного сравнительного анализа.

Ключевые слова: экономическое развитие, аномалия, кризис, валовой внутренний продукт, цикличность, упадок.

V. Yu. POPOV,
PhD in Economics,
Associate Professor
Associate Professor of Business Economics Department,
National Academy of Statistics, Accounting and Audit

Anomalies in the Ukrainian Economy Development in the System of Statistical Indicators

A study of change in the Ukrainian economy is made by its projection on the theoretical foundations highlighting the regularities of cyclic economic development. Terminological tool of the study is supplemented by attributes of normal and abnormal course of cyclic change in the national economy. Normal cyclic change refers to the change triggering positive economic development. Abnormal cyclic change refers to the change resulting in negative economic development.

The purpose of the study is to identify the attributes characterizing abnormal deviation of economic change in Ukraine. Statistical indicators for Ukraine are analyzed; business activity phases in Ukraine are formalized according to the theory of cycles; international comparisons are made.

Methodology of the analysis includes comparative analysis of change in the Ukrainian economy (1990–2015) at three levels. At the first level, change in GDP, consumer price index and unemployment is analyzed; at the second level, characteristic features of economic change are compared with theoretic foundations on the regularities of economic cycles; at the third level, comparison of statistical parameters of cyclic change in the Ukrainian economy and the U. S. economy is made (using NBER data on the U. S.). Comparative tables and graphs are given.

The overall downward trend of cyclic change in Ukraine, the missing renovation phase, the depth and the duration of the crisis are indications of the abnormal course of cyclic change in the Ukrainian economy. Results of the study demonstrate that the existing theoretical and methodological framework is incapable for adequate interpretation of the nature of non-economic factors' impact on the economy.

Keywords: economic development, anomaly, crisis, statistics, gross domestic product, cyclic recurrence, decline.

Посилання на статтю:

Попов В. Ю. Аномалії в розвитку української економіки у системі статистичних показників / В. Ю. Попов // Науковий вісник Національної академії статистики, обліку та аудиту: зб. наук. праць. – 2016. – № 3. – С. 31-37.