КА­ЗАХ­СКИЙ НАЦИО­НАЛЬ­НЫЙ УНИ­ВЕР­СИ­ТЕТ име­ни АЛЬ-ФАРАБИ

**Мухамедиев Б.М., Хитахунов А.А., Кудашева Т.В., Какижанова Т.И.**

ВЗАИМОЗАВИСИМОСТЬ МАКРОЭКОНОМИЧЕСКИХ

ПОКАЗАТЕЛЕЙ СТРАН – ТОРГОВЫХ ПАРТНЕРОВ КАЗАХСТАНА

Ал­ма­ты

«Қа­зақ уни­вер­си­те­ті»

2017

УДК

ББК

М

*Ре­ко­мен­до­ва­но к из­да­нию Уче­ным со­ве­том*

*Выс­шей шко­лы эко­но­ми­ки и биз­не­са и РИСО*

*Ка­за­хс­ко­го на­циональ­но­го уни­вер­си­те­та име­ни аль-Фа­ра­би*

*(Протокол № от ноября 2017г.)*

Мо­ног­ра­фия вы­пол­не­на в рам­ках проек­та

гран­то­во­го фи­нан­си­ро­ва­ния научных исс­ле­до­ва­ний МОН РК 1077/ГФ4

**Рецензенты:**

доктор экономических наук *А.Б. Айтбембетова*

доктор экономических наук *Н.Т. Сайлаубеков*

**Му­ха­ме­диев Б.М. и др.**

Взаимозависимость макроэкономических показателей стран – торговых партнеров Казахстана / Б.М. Мухамедиев, А.А. Хитахунов, Т.В. Кудашева, Т.И. Какижанова / Под общей редакцией Б.М. Мухамедиева – Ал­ма­ты: Қа­зақ уни­вер­си­те­ті, 2017. – 216 с.

**ISBN**

Монография пос­вя­ще­на исследованию взаимозависимости реальных, финансовых и социально-экономических показателей экономики Казахстана и других стран - основных торговых партнеров в условиях Евразийской экономической интеграции. На основе модели глобальной векторной авторегрессии и модели динамического стохастического общего равновесия получены прогнозные оценки и отклики макроэкономических показателей и неравенства по доходам на различные экономические шоки, возникающие в разных странах, и на глобальный шок мировой цены нефти. Представлен анализ влияния интеграционных процессов на доходы населения, неравенство в их распределении, уровень и качество жизни, тенденции их изменения.

Дан­ная кни­га бу­дет ин­те­рес­на ши­ро­ко­му кру­гу чи­та­те­лей, в том чис­ле пре­по­да­ва­те­лям вузов, сту­ден­там.

**УДК**

**ББК**

© Мухамедиев Б.М., Хитахунов А.А.,

Кудашева Т.В., Какижанова Т.И. , 2017

ISBN

© КазНУ имени аль-Фараби, 2017

СОДЕРЖАНИЕ

|  |  |
| --- | --- |
| Введение……………………………………………………………………... | 6 |
| 1 ОБОБЩЕНИЕ МИРОВОГО ОПЫТА ФОРМИРОВАНИЯ ЭКОНОМИЧЕСКИХ ИНТЕГРАЦИОННЫХ ОБЪЕДИНЕНИЙ И АНАЛИЗ ТЕОРЕТИЧЕСКИХ ПОДХОДОВ К ИЗУЧЕНИЮ ИХ ВЛИЯНИЯ НА СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКИЕ ПОКАЗАТЕЛИ СТРАН | 9 |
| 1.1 Регионализм и мировой опыт формированияинтеграционных объединений…………………………………………….... | 9 |
| 1.2 Влияние экономических интеграционных объединений на социально-экономические показатели стран………………………………  | 20 |
| 2 СТАТИСТИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ И ОЦЕНКА ИЗМЕНЕНИЙ В ДИНАМИКЕ СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ В ОТРАСЛЕВОМ РАЗРЕЗЕ КАЗАХСТАНА, РОССИИ И БЕЛАРУСИ, ОБУСЛОВЛЕННЫХ СОЗДАНИЕМ ТАМОЖЕННОГО СОЮЗА……… | 30 |
| 2.1 Национальные счета и экономическая структура……………… | 30 |
| 2.2 Торговые показатели…………………………………………….. | 37 |
| 2.3 Анализ финансовых показателей……………………………….. | 40 |
| 2.4 Динамика индексов физического объема для секторов экономики Казахстана………………………………………………………. | 43 |
| 3 АНАЛИЗ И ОЦЕНКА ВЛИЯНИЯ ЕВРАЗИЙСКОЙ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ ИНТЕГРАЦИИ НА ДОХОДЫ НАСЕЛЕНИЯ, НЕРАВЕНСТВО И ИХ РАСПРЕДЕЛЕНИИ, А ТАКЖЕ НА УРОВЕНЬ И КАЧЕСТВО ЖИЗНИ, ТЕНДЕНЦИИ ИХ ИЗМЕНЕНИЯ…………………………. | 45 |
| 3.1 Показатели качества жизни и глобализация…………………… | 45 |
| 3.2 Влияние Евразийской интеграции на неравенство…………….. | 49 |
| 4 ОБСЛЕДОВАНИЕ МЕТОДОМ АНКЕТИРОВАНИЯ ИЗМЕНЕНИЙ В СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКОМ СТАТУСЕ ДОМОХОЗЯЙСТВ………………………………………………………….. | 62 |
| 5 ПРОВЕДЕНИЕ ЭКСПЕРТНОГО ИНТЕРВЬЮ В СТРАНАХ-УЧАСТНИЦАХ ЕВРАЗИЙСКОГО СОЮЗА ДЛЯ ВЫЯВЛЕНИЯ УГРОЗ СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКОМУ ПОЛОЖЕНИЮ НАСЕЛЕНИЯ, А ТАКЖЕ ВОЗМОЖНОСТИ ДЛЯ ЕГО УЛУЧШЕНИЯ.……………….……………………...................................... | 83 |
| 6 СТРУКТУРА И ОЦЕНКА ГЛОБАЛЬНОЙ МОДЕЛИ ВЕКТОРНОЙ АВТОРЕГРЕССИИ, ОБЕСПЕЧИВАЮЩЕЙ УЧЕТ ВЗАИМОСВЯЗЕЙ МАКРОЭКОНОМИЧЕСКИХ ПЕРЕМЕННЫХ ПО ГРУППЕ СТРАН……………………………………………………………. | 93 |
| 6.1 Модель глобальной векторной авторегрессии………………… | 93 |
| 6.2 Проверка и обработка статистических данных………………… | 97 |
| 6.3 Оценка индивидуальных моделей векторной авторегрессии и коррекции ошибок…………………………………………………………... | 98 |
| 6.4 Прогнозирование макроэкономических показателей………… | 102 |
| 7 АНАЛИЗ ОТКЛИКОВ МАКРОЭКОНОМИЧЕСКИХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ НА ШОКИ В МИРОВОЙ ЭКОНОМИКЕ…………….  | 105 |
| 7.1 Влияние на макроэкономические показатели стран мировой цены нефти…………………………………………………………………... | 105 |
| 7.2 Влияние шоков макроэкономических показателей в России… | 108 |
| 7.3 Влияние шоков макроэкономических показателей в Китае….. | 110 |
| 7.4 Влияние шоков макроэкономических показателей в ЕС…….. | 111 |
| 7.5 Влияние шоков макроэкономических показателей в Беларуси и в Казахстане………………………………………………………………... | 115 |
| 7.6 Влияние шоков макроэкономических показателей в США…… | 116 |
| 8 ОЦЕНКА ВЗАИМОЗАВИСИМОСТИ МАКРОЭКОНОМИЧЕС-КИХ ПОКАЗАТЕЛЕЙ СТРАН – ТОРГОВЫХ ПАРТНЕРОВ НА ОСНОВЕ МОДЕЛИ ДИНАМИЧЕСКОГО СТОХАСТИЧЕСКОГО ОБЩЕГО РАВНОВЕСИЯ………………………………………………………………. | 118 |
| 8.1 Модель динамического стохастического общего равновесия…  | 118 |
| 8.2 Влияние технологических шоков на макроэкономические показатели стран…………………………………………………………….. | 121 |
| 9 ВЫПОЛНЕНИЕ СЦЕНАРНЫХ РАСЧЕТОВ ПО МОДЕЛИ ДЛЯ ВЫЯВЛЕНИЯ ПОСЛЕДСТВИЙ ВХОЖДЕНИЯ СТРАНЫ В ЭКОНОМИЧЕСКИЕ ИНТЕГРАЦИОННЫЕ ОБЪЕДИНЕНИЯ………… | 127 |
| 9.1 Анализ влияния единых торговых тарифов на страны ЕАЭС.. | 127 |
| 9.2 Анализ последствий вхождения Казахстана в ЕАЭС на основе гравитационной модели…………………………………………………….. | 134 |
| 9.3 Оценка эффектов создания и отклонения торговли вследствие вхождения Казахстана в ЕАЭС…………………………………………….. | 137 |
| 10 ИССЛЕДОВАНИЕ ПОСЛЕДСТВИЙ СОЗДАНИЯ ЭКОНОМИЧЕСКОГО ИНТЕГРАЦИОННОГО ОБЪЕДИНЕНИЯ ДЛЯ СТРАН-УЧАСТНИЦ, В ЧАСТНОСТИ, ВЫГОД И ВЫЗОВОВ КАЗАХСТАНА В УСЛОВИЯХ ЕАЭС……………………………………. | 147 |
| 10.1 Последствия создания региональных интеграционных объединений…………………………………………………………………. | 147 |
| 10.2 Влияние Евразийской экономической интеграции на экономику Казахстана………………………………………………………. | 149 |
| 10.3 Обрабатывающая промышленность Казахстана…………….. | 158 |
| 10.4 Применение модели векторной авторегрессии………………. | 164 |
| 11 ОЦЕНКА ПОСЛЕДСТВИЙ ВКЛЮЧЕНИЯ В ТАМО-ЖЕННЫЙ СОЮЗ И ЕВРАЗИЙСКИЙ ЭКОНОМИЧЕСКИЙ СОЮЗ НОВЫХ ЧЛЕНОВ…………………………………………………………… | 167 |
| 12 ОЦЕНКА РОЛИ ТРАНСПОРТНОЙ ИНТЕГРАЦИИ И ТРАНЗИТНЫХ КОРИДОРОВ НА ПРИМЕРЕ АВТОМАГИСТРАЛИ «ЗАПАДНАЯ ЕВРОПА – ЗАПАДНЫЙ КИТАЙ» С УЧЕТОМ ГЕОГРАФИИ КАЗАХСТАНА КАК СТРАНЫ, НЕ ИМЕЮЩЕЙ МОРСКИХ ПУТЕЙ СООБЩЕНИЯ………………………………………..  | 173 |
| 12.1 Новый Шелковый путь…………………………………………. | 173 |
| 12.2 Экономическое развитие Казахстана…………………………. | 174 |
| 12.3 Трансконтинентальный транспортный коридор…………….. | 176 |
| 12.4 Влияние Нового Шелкового пути на торговлю и экономическое развитие Казахстана………………………………………. | 179 |
| ЗАКЛЮЧЕНИЕ………………………………………………………. | 185 |
| СПИСОК ИСПОЛЬЗОВАННЫХ ИСТОЧНИКОВ……………….. | 190 |
| ПРИЛОЖЕНИЕ А – Анкета для исследования субъективной оценки влияния интеграционных процессов на качество жизни населения ……………………………………………………………………. | 198 |
| ПРИЛОЖЕНИЕ Б - Статистические данные для расчетов по модели глобальной векторной авторегрессии…………………………….. | 203  |
| ПРИЛОЖЕНИЕ В - Динамика реальных и финансовых показателей стран ЕАЭС……………………………………………………. | 207 |
| ПРИЛОЖЕНИЕ Г - Данные для расчетов по расширению интеграционного объединения……………………………………………... | 210 |

ВВЕДЕНИЕ

В современном мире происходит усиление взаимовлияния процессов, протекающих в разных экономиках. Поведение реальных, финансовых и социальных показателей в стране зависит как от ее экономической политики, так и от процессов в других странах. Глобализация и региональная интеграция способствуют свободному передвижению товаров, услуг, капитала и рабочей силы, что меняет структуру экономики, открывает новые производства, повышает уровень конкуренции, способствует модернизации и инновациям в производственном секторе. Страны начинают адаптировать свою экономическую политику для повышения конкурентоспособности своей экономики.

Процесс регионализма, который развивается в рамках ГАТТ/ВТО, стал новым трендом развития мировой экономики. Начиная с 1990-х гг., по данным Международного торгового центра и ВТО, количество региональных торговых соглашений показало резкий рост, а с 1947 г. было заключено более 800 торговых соглашений. Последствия создания интеграционных объединений носят разные формы и характер, связанные с изменением торговой политики. Влияние регионализма на экономики стран является значительным, однако, экономические последствия интеграции до сих пор остаются неоднозначными, зависящими от разных факторов. К выгодам от интеграции можно отнести ее положительное влияние на экономический рост, привлечение прямых иностранных инвестиций, рост доходов населения, снижение бедности. Мировой опыт оценки последствий формирования интеграционного объединения показывает, что страны в большинстве случаев оказываются в выигрышном положении.

В научной и практической литературе много работ посвящено влиянию интеграционных процессов на экономический рост страны, динамику и объем внешней торговли, финансовые и товарные потоки, и крайне мало работ изучает влияние на качество жизни населения, хотя конечной целью всей интеграции как раз таки и является улучшение благополучия граждан. Представленная работа содержит как количественные, так и качественные оценки данных процессов. Изучение влияния ЕАЭС на развитие экономик стран-участниц ведется с разных сторон, при этом, анализу и оценке влияния на уровень и качество жизни населения, на неравенство и уровень бедности, не уделяется достаточно внимания, несмотря на то, что интеграция оказывает на них серьезное влияние и не всегда только положительное.

В течение трех лет проводились количественные и качественные замеры оценки уровня и качества жизни населения Казахстана под воздействием интеграционных процессов. С целью получения количественных оценок в 2016 и 2017 годах был проведен опрос населения. Проведенное анкетирование подтвердило влияние открытости границ во взаимной торговле на структуру потребительской корзины. Около половины населения ожидает улучшения под влиянием ЕАЭС транспортной инфраструктуры, уровня заработных плат, качества обслуживания, качества здравоохранения. В целом, большая часть опрошенных положительно воспринимает участие Казахстана в ЕАЭС. В целях получения качественных оценок проводились глубинных интервью с экспертами из Казахстана, Беларуси, России и Кыргызстана. Для того, чтобы получить всестороннюю оценку были привлечены эксперты из разных сфер деятельности: госслужащие, академическая среда (ученые, аналитики), бизнесмены стран-участниц ЕАЭС.

Количественные оценки влияния евразийской интеграции на неравенство по доходам и бедности в России, Беларуси, Казахстана проведены в период 2015-2017 годы. Расчеты опирались на исследования Kang-Kook Lee, в которых проанализировано влияние глобализации на неравенство и бедность. Статистические расчеты показали, что интеграция оказывает заметное влияние на бедность и неравенство по доходам.

Для исследования взаимозависимости макроэкономических переменных естественно было бы применить метод векторной авторегрессии, в котором не накладываются никакие априорные предположения о взаимосвязях исследуемых процессов. Однако, возникает так называемая проблема «проклятия размерности», из-за которой ее решение становится практически невозможным даже для сравнительно небольшого числа стран и принимаемых в рассмотрение показателей. Преодоление этой проблемы оказалось возможным в рамках модели глобальной векторной авторегрессии, предложенной M.H. Pesaran и другими авторами. В этом подходе проводится декомпозиция большой модели на индивидуальные страновые модели, которые затем в корректной форме сводятся в глобальную модель.

Макроэкономические показатели каждой страны, такие как темп роста ВВП, темп инфляции, обменный курс, экспорт, импорт все более подвергаются шокам, возникающим как в стране, так и в партнерских экономиках. Исследование взаимозависимости макроэкономических переменных разных стран оказалось возможным в рамках модели глобальной векторной авторегрессии. На завершающем этапе расчеты проводились по модели для 33 стран с включением в нее показателя неравенства по доходам. Получены прогнозные оценки и оценки последствий экономических шоков, возникающих в разных странах.

Для моделирования последствий технологических шоков, шоков издержек производства на макроэкономические показатели, в том числе экспорт и импорт оценена модель динамического стохастического общего равновесия для трех стран. Макроэкономические показатели каждой страны, такие как темп роста ВВП, темп инфляции, обменный курс, экспорт, импорт товаров все более подвергаются шокам, возникающим как в стране, так и в партнерских экономиках. Кроме того, следует ожидать большего влияния больших экономик на другие страны. Эффективным инструментом решения этой проблемы могут служить модели динамического стохастического общего равновесия (DSGE). Их основа была заложена нобелевскими лауреатами Kydland и Prescot в 1982 году. Они основаны на микроэкономическом анализе поведения агентов, оптимизирующих свое поведение.

В целях оценки влияния региональных интеграционных объединений на торговые потоки выполнены расчеты по гравитационной модели. Они дополнены анализом последствий создания Таможенного союза по секторам экономики Казахстана. Это влияние на макроэкономические переменные оценено исходя из анализа различных показателей, таких как производство обрабатывающей промышленности, рост занятости в обрабатывающей промышленности, привлечение инвестиций, изменение потенциала конкурентоспособности и др.

Гравитационные модели были также применены для оценки влияния строительства трансконтинентальной автомагистрали «Западная Европа – Западный Китай» на экономическое развитие Казахстана и прилегающих к ней других стран.

Результаты исследования бу­дут ин­те­рес­ны ши­ро­ко­му кру­гу чи­та­те­лей, в том чис­ле пре­по­да­ва­те­лям вузов, сту­ден­там. Они могут быть полезны для органов управления национальной экономикой, заинтересованных в повышении благосостояния населения в условиях глобализации и региональной интеграции.

Разделы монографии 6-8, 12, а также Введение и Заключение подготовлены Б.М. Мухамедиевым, подраздел 1.1 и разделы 2, 9-11 написаны А.А. Хитахуновым, подраздел разделы 1.2 и разделы 3-5 написаны Т.В. Кудашевой и Т.И. Какижановой.