

Применение корреляционного моделирования как метод проверки гипотезы о «голландской болезни» в XXI веке

Научный руководитель – Сапир Елена Владимировна

Лебедева Алина Романовна

Студент (бакалавр)

Ярославский государственный университет им. П.Г. Демидова, Ярославль, Россия

E-mail: Alina.Lebedeva29@yandex.ru

Актуальность: Сырьевая зависимость стран-экспортеров нефти является актуальной уже не первое десятилетие. Однако в последнее время проблема встает более остро, поскольку ставится под вопрос само существование феномена «голландской болезни» сегодня. Для решения указанного вопроса и преодоления сырьевой зависимости стран необходимо проведение полноценного анализа влияния основных связанных с энергоэкспортом факторов на динамику важнейших показателей экономического развития стран.

Разработанность в научной литературе: Обсуждение «голландской болезни» представлено в научных трудах Гуриева С. [1], Сониной К. [1], Вакуленко С. [2], Попова А. [8], Гильмундинова В. [3], Чигрина А. [4], Фетисова Г. [5] и ряда других российских экономистов, однако большая часть работ посвящена раскрытию особенностью «голландской болезни» в России и не затрагивают других сторон данной проблемы. В международной литературе изучением механизмов «голландской болезни» [6] занимались такие ученые, как Стиглиц Дж., Уорнер А., Аоки М., Тейлор Л., Бьерланд Х., Иствуд Р., Корден У. М., Хатчисон М.М., Спатофора Н., Нири Дж. П., Эдвардс С., Аути Р. М., Брунстад Р., Сакс Дж. и ряд других. Особое внимание они уделяли причинам возникновения и протеканию болезни.

Цель исследования. Провести корреляционный анализ влияния динамики мировых цен на нефть и колебаний курса национальной валюты на темпы роста реального ВВП трех стран-экспортеров нефти (Венесуэла, Индонезия и Россия) для подтверждения гипотезы о существовании «голландской болезни» в 21 веке.

Методы. Основными методами являются качественный и количественный анализ, математическое моделирование, построенное на вычислении парной корреляции Спирмена. Для всех статистических тестов проведена проверка значимости с помощью t-критерия Стьюдента ($\alpha = 0,05$).

Результаты. В ходе работы были рассмотрены данные по Венесуэле, Индонезии и России за 1971-2018 года [7]. В качестве зависимой переменной были приняты темпы роста реального ВВП, в качестве независимых - цены на нефть и курс национальной валюты (к доллару США). В качестве первоначальной гипотезы выступает предположение о наличии «голландской болезни» в рассматриваемых странах, следовательно, повышение цен на нефть приводит к укреплению национальной валюты и снижению темпов роста. Результаты исследования получились следующие. Цены на нефть ни в одной из стран не приводят к укреплению национальной валюты, а наоборот ведут к ее снижению. Можно сделать вывод о том, что динамика цен не является доминирующим фактором в становлении курса, большое влияние могут оказывать и другие факторы, в частности внутренняя инфляция. В России «голландская болезнь» явно проявилась при анализе взаимосвязи курса рубля и темпов роста. Укрепление рубля приводит к снижению темпов роста ВВП, коэффициент корреляции равен -0,51. Данный факт является симптомов «болезни», спад

темпов роста ВВП объясняется повышением спроса на «дешевый импорт» и, как следствие, уменьшением объема отечественного производства. В Индонезии и Венесуэле результаты аналогичного теста оказались статистически незначимыми, в данных странах выявлена отрицательная зависимость между темпами роста ВВП и ценами на нефть, что в свою очередь также не дает оснований однозначно отвергнуть гипотезу о наличии в данных странах сырьевой зависимости.

Ограничения и направления дальнейшего исследования: Цели данного исследования ограничили анализ взаимосвязями лишь трёх факторов. Однако в процессе анализа выявилась объективная необходимость проведения более сложного многофакторного анализа. Для раскрытия причин возникновения «голландской болезни», механизмов ее протекания, симптомов, а также воздействия на экономическое развитие и основные макроэкономические показатели требуется тщательное изучение значительно большего количества первичных факторов, в свою очередь оказывающих влияние на цены на нефть, курс национальной валюты, темпы роста ВВП и взаимосвязи между ними. Данный аспект является актуальным направлением для дальнейшего исследования.

Источники и литература

- 1) Гуриев С., Сонин К. Экономика "ресурсного проклятия" // Вопросы экономики. 2008. № 4. С. 61-74.
- 2) Вакуленко С. Российский анамнез голландской болезни. Режим доступа: <https://sociomost.com/viewtopic.php?p=39681>
- 3) Гильмундинов В. М. «Голландская болезнь» в российской экономике: отраслевые аспекты проявления // ЭКО. 2008. №12. С. 18-23.
- 4) Чигрин А.Д. Производить невыгодно: последствия "голландской болезни" в России // ЭКО. 2008. № 1. С. 3-4.
- 5) Фетисов Г. «Голландская болезнь» в России: макроэкономические и структурные аспекты // Вопросы экономики. 2006. №12. С. 38-53.
- 6) Голландская болезнь - интереснейший феномен в международной экономике. Режим доступа: <http://fb.ru/article/36075/gollandskaya-bolezn-interesneyshiy-fenomen-v-mejdunarodnoy-ekonomike>
- 7) Официальный сайт UnctadStat. Режим доступа: <https://unctadstat.unctad.org>
- 8) Попов А.В. В России обостряется «голландская болезнь» // RBC Daily. Режим доступа: www.rbcdaily.ru/archive/2005/01/19/36