

Тетяна ЗАТОНАЦЬКА  
Андрій СТАВИЦЬКИЙ

## ВПЛИВ СОЦІАЛЬНИХ ВИДАТКІВ НА ПОКАЗНИКИ ЕКОНОМІЧНОГО РОЗВИТКУ КРАЇНИ

---

---

*Досліджено вплив соціальних видатків на показники економічного зростання. Доведено, що окремі соціальні видатки гальмують економічне зростання у короткостроковому періоді.*

---

---

Основною метою бюджетної політики є створення умов для тривалого економічного зростання, яке сприяло б конкурентоспроможності національної економіки.

Розглядаючи сучасний стан бюджетної політики в Україні, можна відзначити наявну непослідовність дій щодо вибору державних пріоритетів соціально-економічного розвитку країни, зокрема залишається дискусійним, який саме напрямок бюджетного фінансування є пріоритетним: соціального або економічного розвитку. З одного боку, збільшення економічних видатків має сприяти розвитку виробництва, збільшенню інвестицій та заробітної плати населення, з іншого боку, економіка, де виробництво стає на переході всебічному розвитку людини, приречена на розвал, що підтверджується розпадом економічно міцних імперій XX століття.

Фактично за всі роки незалежності Україна не спромоглася виробити чіткої стратегії бюджетного розвитку, яку б не лише підтримала значна частина населення, політичної еліти, а й яка впроваджувалася б у життя. Реалії свідчать, що протягом останніх 15 років в Україні майже щорічно змінюються уряди, програми та дії яких суттєво відрізняються. Звичайно, в таких умовах представники кожного нового уряду насам-

перед критикують попередній. З переходом до парламентсько-президентської форми правління прояви такої політики тільки посилювалися та сягнули нових висот. Причому, як правило, така критика не сприймається опонентами як реальні зауваження через проблему різних цілей, які ставили перед собою уряди.

Зростання державних видатків у другій половині XX ст. у країнах із ринковою економікою супроводжувалося загальним поліпшенням якості життя громадян: розширенням соціальних гарантій держави, поліпшенням житлових умов, підвищенням рівня освіти, вдосконаленням системи охорони здоров'я і збільшенням тривалості життя населення [1]. Іншими словами, саме ефективне використання "людського капіталу" може дозволити країні забезпечити економічний розвиток у довгостроковій перспективі.

Починаючи з 80-х рр. XX ст. активно змінюються підходи до існуючих теорій економічного зростання, рушійною силою економічного розвитку стає людина або "людський капітал". Основними розробниками цих теорій є П. Ромер, Р. Лукас, Г. Беккер, Т. Шульц, роботи яких були спрямовані на вивчення впливу людського капіталу на економічне зростання в довгостроковій перспективі.

Серед вітчизняних вчених, які вивчали цей напрямок – А. Чухно, В. Гейць, А. Соколовська, І. Луніна, Д. Полозенко та інших.

Відповідно до нових теорій, продуктивність праці зростає завдяки не тільки зовнішньому, а й внутрішньому чиннику, пов'язаному з поведінкою людей, які і є рушійною силою накопичення продуктивних сил і знань.

З цієї причини підходи кейнсіанців до проблем економічного зростання визнані обмеженими, оскільки вони базувалися на ефективному використанні ресурсів та технологій. Неокласики наголошували на тому, що розвиток – це процес, якому притаманні сукупні зміни. Дослідження інституціоналістів показали, що розвиток є ширшим поняттям, охоплює не тільки економічну підсистему, а й широкий спектр неекономічних змінних, включаючи формальні та неформальні інститути, культуру та всю систему цінностей, без яких повноцінний розвиток неможливий. Таким чином, як зазначається у роботі [2], інституціоналісти, враховуючи досвід неокласиків та кейнсіанців, наголосили, що формування “людського капіталу” є основою для розвитку конкурентних внутрішніх ринків, які забезпечують стабільну макроекономіку.

Таким чином, економічний розвиток неможливий без зміни усієї системи економічних інституцій, соціальних та політичних відносин. В сучасних економічних відносинах “людський капітал” є одним із головних ресурсів і базисом для побудови нової (інформаційної) економіки. Особистість є самоціллю загальнолюдського розвитку. Одночасно вона є головним знаряддям прогресу. Вибір мети, шляхи її досягнення, а також організація безпосереднього трудового процесу в постіндустріальному суспільстві стають не технологічним, а гуманітарним завданням. Це обумовлює високий ступінь самостійності кожної людини, надає праці достовірно вільний творчий зміст [2].

Для ситуації в Україні необхідно зазначити, що в нагромадженому людському капіталі слід виокремити нагромадження як позитивного (база для розвитку і перетворень), так і негативного характеру. До останніх слід віднести: кризу ціннісних орієнтацій, світоглядних установ і мотивацій, глибоку соціальну нерівність, несправедливість розподілу доходів, глибоку диференціацію регіонів за основними соціальними показниками розвитку і нагромадженням людського капіталу, зростання негативних форм адаптації різних груп населення до нових реалій життя, освітню та культурну деградацію частини населення [3].

Соціальна сфера є дуже складним об'єктом державного регулювання. Основна проблема полягає в тому, щоби знайти кошти для надання соціальної допомоги тим групам населення, які не можуть без неї вижити, і при цьому підтримати на гідному рівні інвестування в людський капітал, без якого неможливе майбутнє будь-якої держави: освіта, наука, культура, доступна медична допомога, інформаційне забезпечення.

Основною метою фінансування соціальної сфери є підвищення її економічної ефективності, що означає здобуття найбільшої соціальної віддачі від бюджетних видатків. Економічно ефективні соціальні системи повинні забезпечувати вирішення питань соціального захисту населення, підвищення рівня життя, збереження життєвих стандартів при найменших витратах з точки зору витрат бюджету і ліквідації диспропорцій в розподілі ресурсів. Крім того, вони повинні сприяти встановленню макроекономічної рівноваги.

Особливо важливими ці питання стають в умовах світової фінансово-економічної кризи, яка призводить до значного зменшення дохідної частини бюджетів у всіх країнах світу. Висновок західних експертів

полягає в тому, що нові завдання не можна вирішити, наполягаючи на збереженні соціальних гарантій, які в теперішніх умовах приховують у собі небезпеку саморуйнування [1]. Подальше необґрунтоване зростання соціальних видатків може створити загрозу стійкості державних фінансів та перспективі економічного зростання в країні. Крім того, слід зазначити, що основна частина соціальних виплат не досягає тих категорій населення, для яких вони в принципі призначені, що свідчить про неефективність їх надання за умов відсутності їх цільової спрямованості.

Розглянуті проблеми визначили новизну роботи, суть якої полягає у побудові економетричних моделей, що дозволяють дослідити взаємозв'язок соціальних видатків та показників економічного розвитку, показати негативний вплив деяких соціальних видатків на економічне зростання. Вперше зроблена спроба показати зв'язок між соціальними видатками та показниками економічного зростання в країні у короткостроковому періоді (до 1 року). Також новизною роботи є розгляд змінних виключно у постійних цінах, що дозволяє позбутися різноманітних неточностей та некоректного аналізу внаслідок високої інфляції. Це дає можливість узагальнити отримані результати в умовах сучасної складної економічної ситуації.

Для подальшого вивчення впливу соціальних видатків на соціально-економічний розвиток України застосуємо еконо-

міко-математичний апарат з наступними позначеннями (див. табл. 1).

У процесі дослідження всі змінні були нормовані на індекс зростання цін для приведення даних до однакової бази, що дало змогу вивчати безпосередньо вплив кожного типу соціальних видатків без урахування зовнішніх чинників, наприклад, тренду, який, безперечно, виникає через постійне зростання цін. Приведення тестування на рівень інтегрованості всіх розглянутих змінних за допомогою критерію Дікі-Фулера [4] показало, що всі розглянуті змінні є інтегрованими порядку 1, тобто прирости всіх процесів є стаціонарними процесами.

Завданням дослідження є вивчення впливу соціальних видатків у динаміці в короткостроковому періоді, а тому природним є розгляд моделі виду:

$$\Delta y_t = \beta_0 + \sum_{i=1}^k \beta_i \Delta x_{t-i} + \varepsilon_t, \quad (1)$$

де:  $y_t$  – значення одного з макроекономічних показників у період  $t$  в цінах на 1.01.2001;

$x_t$  – значення одного з видів соціальних видатків у період  $t$  в цінах на 1.01.2001;

$\beta_0, \beta_1, \dots$  – коефіцієнти моделі;

$\varepsilon_t$  – збурення моделі у період  $t$ .

Проведення розрахунків показало, що кількість лагів для моделі суттєво залежить від типу соціальних видатків та макроекономічного показника. В більшості випадків величина  $k$  змінювалася від 2 до 4.

Таблиця 1

Показник	Опис
SOC-Total	загальна сума соціальних видатків, млн. грн.;
SOC-Health Care	видатки на охорону здоров'я, млн. грн.;
SOC-Edu	видатки на освіту, млн. грн.;
SOC-Physical	видатки на фізичний та духовний розвиток, млн. грн.;
GDP	ВВП, млн. грн.;
INFL_IND	індекс зростання цін (1.01.2001 = 1);
Unem	рівень безробіття, %;
Wage_Avg	середня заробітна плата, грн.

Отримані моделі були протестовані за допомогою стандартної економетричної методики на адекватність, значимість коефіцієнтів, відсутність гетероскедастичності та автокореляції. Разом з тим, не ставилося завдання знайти найкращу функціональну форму моделі, оскільки основною метою було визначення кількісного впливу соціальних видатків в динаміці.

Розглянемо отримані результати детальніше. Перша модель показує залежність між приростами зростання ВВП та приростами загальних соціальних видатків у фіксованих цінах (див. формулу 1.1).

Очевидно, що зміна загальних соціальних видатків впливає по-різному на рівень ВВП у короткостроковому періоді. Збільшення загальних видатків на 1 млн. грн. в цінах на 1.01.2001 призводить до зменшення приросту ВВП на 3,16 та 3,60 млн. грн. в фіксованих цінах за перший і другий квартали відповідно, проте спостерігається зростання приросту ВВП через три квартали на 2,47, а через чотири квартали – на

4,02 млн. грн. у фіксованих цінах. Таким чином, за один рік зростання приросту соціальних видатків на 1 млн. грн. у постійних цінах обумовлює кумулятивний ефект – 0,256 млн. грн. Іншими словами, за один рік видатки на соціальні потреби окупаються лише у випадку, якщо інфляція буде не меншою, ніж 25,6%. В усіх інших випадках збільшення соціальних виплат призводить до гальмування приросту ВВП.

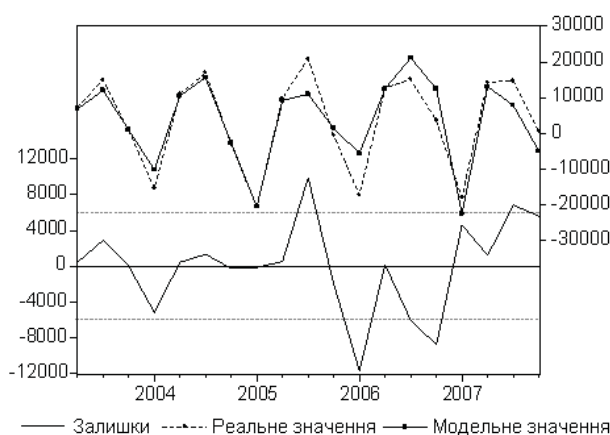
Друга модель вивчає вплив на рівень приросту ВВП видатків на охорону здоров'я (див. формулу 1.2).

Дослідження показало, що включення до моделі третього лагу є недоцільним, оскільки відповідний коефіцієнт не є суттєвим. Аналіз моделі засвідчує, що збільшення видатків на охорону здоров'я негативно впливає на прирости ВВП. Зокрема, збільшення видатків на 1 млн. грн. у постійних цінах призводить до зменшення приросту ВВП на 10,26 млн. грн. через один квартал, на 12,88 млн. грн. – через два квартали, проте обернений ефект спостерігається через

один рік – приріст 9,12 млн. грн. Таким чином, кумулятивний ефект за один рік становить – 14,280 млн. грн. у постійних цінах. Іншими словами, збільшення видатків на охорону здоров'я гальмує економічне зростання.

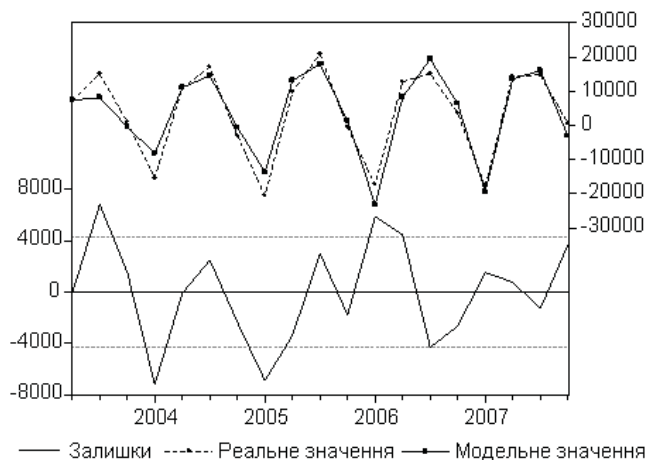
В Україні наявна незбалансованість державних гарантій безоплатної медичної допомоги з наявними фінансовими ресурсами.

$$\Delta(GDP_t / INFL\_IND_t) = 3692.82 - 3.16\Delta(Soc\_Total_{t-1} / INFL\_IND_{t-1}) - 3.60\Delta(Soc\_Total_{t-2} / INFL\_IND_{t-2}) + 2.48\Delta(Soc\_Total_{t-3} / INFL\_IND_{t-3}) + 4.03\Delta(Soc\_Total_{t-4} / INFL\_IND_{t-4}), R^2 = 0.84 \quad (1.1)$$



**Рис. 1.1. Взаємозв'язок приросту загальних соціальних видатків і приросту зростання ВВП, графічне зображення моделі (1.1)**

$$\Delta(GDP_t / INFL\_IND_t) = 4492.22 - 10.27\Delta(Soc\_Healthcare_{t-1} / INFL\_IND_{t-1}) - 12.88\Delta(Soc\_Healthcare_{t-2} / INFL\_IND_{t-2}) + 9.12\Delta(Soc\_Healthcare_{t-4} / INFL\_IND_{t-4}), R^2 = 0.91 \quad (1.2)$$



**Рис. 1.2. Взаємозв'язок видатків на охорону здоров'я і приросту ВВП, графічне зображення моделі (1.2)**

У третій моделі показано вплив видатків на освіту на рівень ВВП країни (див. формулу 1.3).

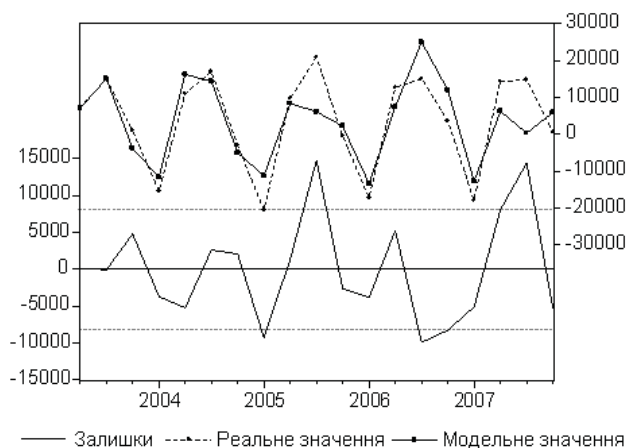
Згідно з цією моделлю збільшення приросту видатків впливає негативно в перші два квартали, після чого спостерігається позитивний вплив. Кумулятивний ефект за рік є позитивним, що визначає доцільність збільшення видатків на освіту.

Повністю негативний вплив

Внаслідок цього зростає платність ме-

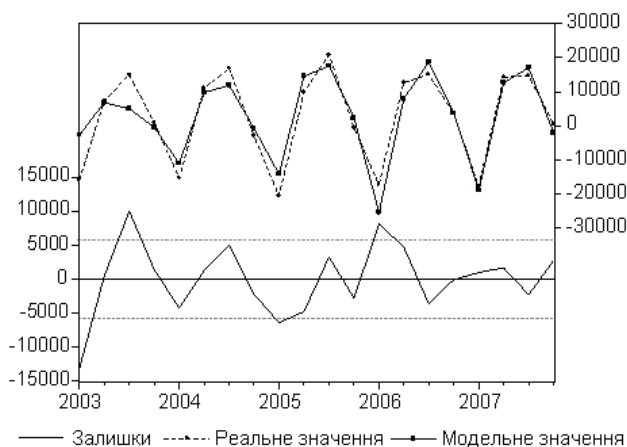
дичної допомоги, причому у неконтрольованих формах. Доступність медичної допомоги для населення знижується, при цьому в найгіршому становищі опиняються найменш забезпечені громадяни. Через це постала необхідність в уточненні системи державних гарантій щодо цього напрямку [3].

$$\Delta(GDP_t / INFL\_IND_t) = 1772.97 - 10.71\Delta(Soc\_Edu_{t-1} / INFL\_IND_{t-1}) - 10.09\Delta(Soc\_Edu_{t-2} / INFL\_IND_{t-2}) + 13.71\Delta(Soc\_Edu_{t-3} / INFL\_IND_{t-3}) + 15.74\Delta(Soc\_Edu_{t-4} / INFL\_IND_{t-4}), R^2 = 0.70 \quad (1.3)$$



**Рис. 1.3. Взаємозв'язок видатків на освіту і приросту ВВП, графічне зображення моделі (1.3)**

$$\Delta(GDP_t / INFL\_IND_t) = 5883.81 - 59.35\Delta(Soc\_Physical_{t-1} / INFL\_IND_{t-1}) - 66.40\Delta(Soc\_Physical_{t-2} / INFL\_IND_{t-2}) - 24.28\Delta(Soc\_Physical_{t-3} / INFL\_IND_{t-3}), R^2 = 0.85 \quad (1.4)$$



**Рис. 1.4. Взаємозв'язок видатків на духовний та фізичний розвиток і приросту ВВП, графічне зображення моделі (1.4)**

демонструють видатки на духовний та фізичний розвиток (див. формулу 1.4).

Значимий вплив спостерігається три квартали поспіль після зростання приросту видатків на 1 млн. грн. у постійних цінах. Як не дивно, проте навіть така сума призводить до зменшення приросту ВВП на 150,022 млн. грн. у постійних цінах. Таким чином, можна констатувати, що видати на фізичний та духовний розвиток не сприяють, принаймні у короткостроковій перспективі, організації здорової або інтелектуально розвинутої нації, яка створювала б дорожчу додану вартість у виробництві товарів та послуг.

Проте варто зазначити, що не можна ігнорувати роль культурної складової в розвитку людського капіталу. Цілком зрозуміло, що культурні традиції і ціннісні установки, прийняті у суспільстві, здійснюють суттєвий вплив на поведінку людини в процесі господарської діяльності, що має відобразитися

на функціонуванні всієї економічної системи. Культурні традиції, ціннісні орієнтири і моральні норми, прийняті у суспільстві, впливають на економіку як через соціальну організацію суспільства (система формальних і неформальних інститутів), так і через людський капітал. Для успішного проведення реформ необхідно змінити інституційну систему, однак модифікація норм поведінки людей

та ціннісних орієнтирів вимагає досить тривалого періоду. Механічне перенесення норм і законів, які склалися в розвинених країнах, в іншому культурному середовищі та інших умовах може виявитися не лише неефективним, а й загрозливим з точки зору соціальної стабільності [3].

Підсумовуючи, можна зробити висновок, що збільшення всіх видів соціальних видатків спричиняють загалом негативний вплив на прирости ВВП у короткостроковому періоді. Водночас спостерігається тенденція до збільшення позитивного впливу у середньостроковому періоді. Це означає, що необхідно витримувати оптимальний баланс між соціальними та економічними видатками, здійснювати соціальні виплати в межах національної стратегії соціально-економічного розвитку країни. Це дасть можливість за допомогою виваженої бюджетної політики сприяти зростанню людсь-

кого капіталу у довгостроковій перспективі. При затвердженні державних соціальних програм необхідно чітко сформулювати їхні цілі та очікуваний результат, який має бути оцінений з точки зору як економічного, так і соціального ефекту.

### Література

1. Луніна І. О. *Державні фінанси та реформування міжбюджетних відносин: Моногр.* – К.: Наук. думка, 2006. – 432 с.

2. Нуреев Р. М. *Развитие человеческого капитала как реальная альтернатива сырьевой*

*специализации страны // Экономический вестник Ростовского государственного университета.* – 2007. – Т. 5. – № 3. – С. 111–129.

3. *Стратегічні виклики XXI століття суспільству та економіці України: В 3 т.* –Т. 3: *Конкурентоспроможність української економіки/ За ред. акад. НАН України В. М. Гейця, акад. НАН України В. П. Семиноженка, чл. кор. НАН України Б. Є. Кваснюка.* – К.: Фенікс, 2007. – 556 с.

4. Черняк О. І., Ставицький А. В. *Динамічна економетрика.* – К., 2000. – 120 с.