

## **Външната търговия на България в контекста на европейската икономическа интеграция<sup>1</sup>**

доц. д-р [Поля Ангелова](#), доц. д-р [Любомир Иванов](#), доц. д-р [Пламен Петков](#)  
гл. ас. д-р [Красимира Славева](#)<sup>2</sup>

### **Резюме**

Настоящото изследване е с теоретико-приложен характер. Теоретичните аспекти обхващат доизясняване на идеите и концепциите за външната търговия като фактор за развитието на националната икономика. Извършва се анализ на информационното осигуряване на статистическите изследвания на външната търговия – принципи, системи за отчитане и класификации. Приложният аспект на изследването включва усъвършенстване на статистическата методология за изучаване на външната търговия, идентифициране на проблемите при изучаване на нейните количествени параметри и анализ на структурата, динамиката и взаимовръзките на външнотърговския стокообмен на България. За тази цел се апробират различни статистически методи – динамичен, структурен и регресионен анализ, като и модели за оценка на влиянието на външната търговия върху някои основни макроикономически индикатори. В процеса на изследването се извеждат основните проблеми пред външнотърговската дейност, международните отношения, платежния баланс и др.

**Ключови думи:** външна търговия, износ, внос, външнотърговски стокообмен, експортна структура, импортна структура, структурни промени, трендови модели, коинтеграционен анализ.

### **Bulgaria`s foreign trade in the context of European economic integration**

#### **Abstract**

This study has theoretical and practical character. Theoretical aspects include clarification of ideas and concepts of foreign trade as a factor for the development of national economy. It is performed analysis of information assurance of external trade surveys by focusing on principles, systems and accounting classifications. The applied aspect of the study include improving the statistical methodology for the study of external trade, identifying the problems in studying its quantitative parameters and analysis of the structure, dynamics and interactions of Bulgarian external trade. For this purpose are approbated different statistical methods – analysis of time series, structural and regression analysis, as well different models to estimate the impact of external trade on some key macroeconomic indicators. In the course of the study are shown the main problems for external trade, international relations, balance of payments and more.

---

<sup>1</sup> Настоящата статия е резултат от реализирането на научноизследователски проект №5 към Института за научни изследвания на тема “Външната търговия на България в контекста на европейската икономическа интеграция” – ръководител на екипа: доц. д-р Поля Ангелова, ф-т СО, к-ра МС. Членове: доц. д-р Любомир Иванов, МС; доц. д-р Пламен Петков, МС; гл. ас. д-р Красимира Славева, МС.

<sup>2</sup> Участието на авторите при написването на статията е както следва: доц. д-р Поля Ангелова, т.6 и увод; доц. д-р Любомир Иванов, т. 8; доц. д-р Пламен Петков, т. 7; гл. ас. д-р Красимира Славева, т.1, т.2, т. 3, т.4, т. 5 и заключение.

**Key words:** foreign trade export, import, turnover, export structure, import structure, structural changes, trend models, cointegration analysis.

#### **Увод**

Степента на конвергенция на българската икономика с европейската, както и състоянието на нейното интегриране в общото европейско стопанство са ключов момент при избора на средно- и дългосрочна икономическа политика. В краткосрочна перспектива европейската икономика е във фаза на забавено развитие и това автоматично се пренася върху развитието на българската икономика. В този аспект външната търговия се оказва ефективно средство за регулиране на вътрешното и външното равновесие на националното стопанство. В съвременните условия външната търговия със стоки и услуги е основен елемент на системата от форми, чрез които се реализира отвореността на икономиката. Тя предполага относително развити, устойчиви и съществени връзки между националното стопанство и външната икономическа среда.

Интернационалното преплитане на икономически взаимодействия е характерно за глобализацията в съвременния свят, но то следва да бъде съпроводено с формиране на управленски решения за подобряване устойчивостта на икономиката чрез определени политики в областта на външната търговия, които улесняват традиционните или предлагат нови механизми за уравнивяване. Това обуславя обективната необходимост от статистически изследвания в областта на външната търговия със стоки и услуги в контекста на европейската интеграция на България и разширяване приложението на статистическите методи и техники за анализ.

**Обект на изследването** е външнотърговският стокообмен, износа и вноса на Р. България за периода 1990-2009 г.

**Основната цел** е теоретично обосноваване и емпирично изследване на закономерностите в състоянието и развитието на външната търговия на България в контекста на европейската интеграция въз основа на статистически анализ на структурата, динамиката и факторната обусловеност на външнотърговския стокообмен за периода 1990 – 2009 г.

#### **Задачи:**

1. Идентифициране на външната търговия като фактор за развитието на националната икономика чрез преглед на идеите и концепциите за нейната същност.

2. Изясняване на предпоставките за развитието на външната търговия и оценяване степента на влиянието ѝ върху националното стопанство.

3. Анализ на информационното осигуряване на статистическите изследвания чрез изясняване на основните принципи и класификации на статистиката на външната търговия.

4. Открояване на особеностите и проблемите в отчитането на вътрешнообщностната търговия.

5. Изследване на тенденциите в изменението на външнотърговските потоци за периода 1990-2009 г. Анализирание на структурата на износа и вноса за периода 1990-2009 г.

6. Оценка на степента на отвореност на националната икономика посредством показателите: експортна квота, импортна квота, външнотърговска квота и коефициент на зависимост от външната търговия. Проследяване на тенденциите в изменението на показателите за международни сравнения във външната търговия.

7. Сравнителен анализ на географската структура на външната търговия и установяване на закономерностите във външнотърговските отношения между България и държавите от ЕС–15, Балканския полуостров и Русия.

### **1. Външна търговия – идеи, концепции и източници на статистическа информация**

Теоретичната основа на настоящото изследване на външната търговия се базира на класическите и съвременните концепции за ролята на външната търговия в развитието на националната икономика. Използван е интердисциплинарният подход, като за целта са проучени и систематизирани публикации на български и чуждестранни автори в областта на външната търговия, международната икономика и статистиката. В изследването са използвани са статистически методи за анализ на временни редове, за анализ на структурните промени, за разкриване на връзки и зависимости и иконометрични методи и модели.

Идеите и концепциите за външната търговия са проследени в хронологичен ред, следвайки тяхното възникване и преминаване от една икономическа школа в друга. Външната търговия и значението ѝ за развитието на националната икономика е обект на изследване от представителите на различни икономически школи, като за едни от тях е имала водеща роля, а за други второстепенна.

Външната търговия заема водещо място в школата на меркантилистите У. Стафорд, Т. Мън, Ж. Колбер, А. Монкретиен, Г. Скаруфи и др., които разглеждат причините, условията и интересите за развитието на търговията. Според тях външната търговия има определяща роля в икономическото развитие и нарастването на националното стопанство. Считат, че търговският баланс е важен показател за благосъстоянието на страната и трябва да бъде активен. Физиократите Ф. Кене, Ж. Тюрго и др. разработват концепцията за “естествения ред” са привърженици на свободната конкуренция и ненамесата на държавата в икономиката.

Същността, особеностите и факторите за развитие на външна търговия са разгледани от представителите на класицизма У. Пети, Д. Хюм, А. Смит, Д. Рикардо и др. Адам Смит си поставя за цел да докаже, че всяка страна може да печели от развитието на външната търговия и създава теорията на абсолютните предимства в международната търговия. Според теорията за абсолютните предимства в основата на международната търговия е производството, а не обръщението. Всяка страна според разполагаемите природни ресурси и производствени възможности се специализира в производството на стоки, за които има абсолютни предимства. Стоките, за които страната няма абсолютни предимства, се осигуряват чрез внос. Теорията на А. Смит не обяснява причините, поради които се извършва търговия между страни, дори когато нямат абсолютни предимства.

Д. Рикардо поставя основите на теорията за относителните (сравнителните) предимства на нациите във външната търговия, основаваща се на различията в относителните разходи за производството на стоките в различните страни. Според Рикардо търговията е изгодна за двете страни и в случаите, когато едната от страните произвежда по-ефективно всички стоки, които са обект на международна размяна. Д. Рикардо е привърженик на свободната търговия и противник на протекционизма. Д. Рикардо развива и

теорията за автоматичното уравнивяване на търговския баланс, която е актуална и днес, тъй като предполага по-голяма свобода както външната търговия, така и в международните валутно-финансови отношения. Теорията за относителните предимства на нациите във външната търговия е най-големият принос на Д. Рикардо в теорията на външната търговия, тъй като обосновава възможността дадена страна да участва изгодно в международната търговия, когато не притежава абсолютни предимства. В основата на международната търговия са сравнителните предимства, а не абсолютните предимства.

Принципът на Д. Рикардо за относителните предимства е в основата на теорията на Е. Хекшер и Б. Олин за външната търговия, според която всяка страна се специализира в производството и износа на стока, за която интензивно се използва производственият фактор, намиращ се в по-голямо изобилие, и внася стоки, производството на които е свързано с производствения фактор, който е в по-малка наличност. Според теоремата на Хекшер-Олин при свободна търговия между две страни условията на търговия в тях ще съвпадат, а относителните цени на производствените фактори ще конвергира.

До края на 40-те години на XX в. теоремата на Хекшер-Олин е в основата на теорията за международната търговия. Възгледите на Е. Хекшер и Б. Олин за свободната търговия се споделят и доразвиват от П. Самуелсън и В. Леонтиев. В. Леонтиев извършва емпирична проверка на теорията за сравнителните предимства, изследвайки за продължителен период структурата на външната търговия на САЩ, но открива редица противоречия.

Кейнсианската концепция за свободна търговия и отворена икономика е водеща през 60-те години на XX в. Тя се основава на теорията на Дж. М. Кейнс и е доразвита от неговите последователи, които се придържат към следните основни принципи: националната стопанска система не е идеална и нейното функциониране предполага кризи на свръхпроизводството и значителна безработица; налице е недостатъчно ефективно търсене; националният възпроизводствен процес може да се регулира от държавата, която чрез различните инструменти на макроикономическата политика може да въздейства върху ефективното търсене.

Неокласическата концепция за отворената икономика се основава на принципа за пазарната ефективност, според който свободният пазар притежава сили и механизми, осигуряващи функционирането на националната икономика в условия на вътрешно и външно равновесие. Според тях пазарът може да се регулира сам и не е необходима намеса на държавата чрез механизмите за макроикономическото регулиране.

Глобализацията и засилването на интеграционните процеси води до възникване на неолибералната теория за световните интеграционни процеси. Според Я. Тинберген и Д. Пиндер интеграцията е свързана с отстраняване на бариерите за свободно движение на производствените фактори и стоките и със създаването на международни органи за координация на стопанските процеси. Според представителите на структурализма интеграцията трябва да се разглежда като структурно явление, в което отделните части се свързват в едно цяло.

Изследването на външната търговия и познаването на механизмите на въздействие върху националната икономика са важно условие за интегрирането на страната в ЕС и стабилна основа за провеждане на успешна икономическа политика.

## **2. Информационно осигуряване на статистическите изследвания на външната търговия**

Статистиката на външната търговия се характеризира с редица особености като: точно определяне на момента на отчитане, определяне на границите между икономическите територии, определяне на статистическата стойност, използване на системи за обща и специална търговия, отчитане на вътрешнообщностната търговия и др. За осъществяване на статистическа дейност, свързана с вътрешнообщностната търговия със стоки между България и страните от ЕС, е приет Закон за статистиката на вътрешнообщностната търговия със стоки. Статистиката на външната търговия в България е изградена в съответствие с възприетите принципи и системи за отчитане.

За отчитането на търговията със страните от ЕС се използват Интрастат декларации, информацията от които се въвежда в информационната система "Интрастат" на НАП. За усъвършенстване обхвата и качеството на статистическата информация, предоставяна на Евростат и други потребители, се налага доценка на статистическите данни чрез специална Методика за доценка на търговията със страните-членки на Европейския съюз. Статистическата информация за вътрешнообщностната търговия със стоки, получена посредством системата Интрастат, отговаря на изискванията за качество, обхват, съпоставимост, пълнота и навременност на данните. Статистическата информация за вътрешнообщностната търговия се използва за формирането на търговската политика на страната, за защита на търговските интереси, за получаването на основни макроикономически индикатори.

Статистическият праг за наблюдение, при събиране на информация за вътрешнообщностната търговия със стоки, се определя след анализ на търговската активност на фирмите, търгуващи със страни от ЕС, търгуваните стоки и техния дял в общата търговия с ЕС, европейските страни партньори на България и тяхната значимост за стокообмена на България. Доценката на търговията със страните-членки на ЕС се извършва съобразно структурата и географското разпределение на изпращанията и пристиганията през предходната година.

Статистическите данни за външната търговия дават възможност за определяне на мястото на страната в международната търговия и за установяване степента на зависимост на националната икономика от износа и вноса. За извършване на групировка по категорийни признаци във външната търговия се използват класификациите. Чрез статистическите класификации се осигурява подреждане на характеристиките на изследваното явление в раздели, групи, подгрупи и др.. Класификациите се прилагат многократно и за продължителен период от време. В статистиката на външната търговия се използват утвърдените международни класификации и номенклатури, а не национални класификации и номенклатури.

За провеждане на международни сравнения във външната търговия е необходимо както хармонизиране на методологията за наблюдение на външната търговия, така и използване на утвърдени класификации и номенклатури. Като се има предвид, че националните стопанства произвеждат стоки, които са типични само за тях или няколко страни, то използването на утвърдени международни класификации дава възможност за сравнимост и съпоставимост на данните.

Международна сравнимост на данните за износа и вноса се постига с използването на следните класификации и номенклатури: Стандартна международна търговска класификация; Хармонизирана система за описание и кодиране на стоките; Класификация по широки икономически категории; Комбинирана номенклатура; Интегрирана митническа тарифа и Номенклатура на страните и териториите за целите на външнотърговската статистика. Използването на утвърдени международни класификации и извършването на групировки дава възможност за по-пълно характеризиране на икономическите явления и процеси и за изследване на тяхната структура.

### **3. Статистическо изследване на динамиката на износа, вноса и външнотърговския стокообмен**

В края на ХХ в. в България се извършват значителни промени в политическото, икономическото и социалното развитие на страната. От централно-планирана икономика трябва да се изгради пазарна икономика. За периода 1990-1998 г. страната започва преход към пазарна икономика, отваряне на икономиката към света, излизане на нови пазари и загуба на традиционни пазари на СИВ. Изменя се както географската и стоквата структура на износа и вноса. До 1990 г. важно място във външнотърговския стокообмен на България заемат страните от Централна и Източна Европа, но най-вече Русия. На тези страни се пада около 75 % от външнотърговския стокообмен на България.

За установяване на тенденцията в изменението на износа, вноса и външнотърговския стокообмен на България за периода 1999-2009 г. е извършен анализ в следната последователност:

1. Проверка за наличие на тенденция чрез изчисляване на автокорелационен коефициент от първи порядък ( $r_1$ ), корелационния коефициент на Спирман ( $\rho$ ) и Кендал ( $\lambda$ ), тестовите характеристики на Бокс-Люнг ( $BL$ ) и Бокс-Пиърс ( $BP$ ).

2. За редовете, в които е доказано, че съществува тенденция на развитие, посредством метода на най-малките квадрати е изследвана нейната форма. Изборът на най-подходящ модел се основава на стандартната грешка на модела, критерия за адекватност на Фишер, коефициента на детерминация, коригирания коефициент на детерминация, информационните критерии на Акайке и Шварц.

Периодът от 1999 до 2009 г. обхваща години, в които започва стабилизация на българската икономика в резултат на започналите реформи в средата на 1997 г., въвеждането на валутен борд и преговори за членство в ЕС. Динамиката на износа в съпоставими цени за периода 1999-2009 г. показва нарастване, което най-силно е изразено през 2008 г.

Нарастването на стойностния обем на износа е резултат от ефективното използване на конюнктурата на международните пазари и на експортния потенциал за определени групи стоки. Същевременно в българския износ има стоки (химически продукти, дървен материал, дрехи, обувки, лекарства и др.), за които е налице неизползван експортен потенциал и могат да се превърнат във фактори за нарастване на износа през следващите години. Нарастването на стойностните обеми на повечето от изнасяните стоки, автоматично води до увеличаване на вноса материали, кожи и други продукти, които са необходими за производството на ишлеме.

Абсолютният прираст с верижна база показва, че най-голямо нарастване на износа има през 2006 г. спрямо 2005 г. От изчислените темпове на прираст с

база 1999 г. се вижда, че най-голямо нарастване (184,67 %), спрямо базисната година, има през 2008 г. Тенденцията в изменението на износа се представя най-добре чрез експоненциална функция  $\hat{y} = 9836e^{0,1215t}$ . За този модел са получени най-високи значения на коефициента на детерминация ( $R^2 = 0,9091$ ) и на теста за адекватност  $F = 90,034$ .

Абсолютният прираст на вноса с верижна база показва, че най-голямо нарастване има през 2006г. спрямо 2005 г. Значителен спад във вноса с 6835 хил. лв. е налице през 2009 г. спрямо 2008 г., като основна причина за него е започналата финансово-икономическа криза, довела до спад в производството, затруднено финансиране на фирмите, спад в износа, поради конюнктурата на международните пазари.

Проверката за наличие на тренд във вноса на Р. България за периода 1999-2009 г. е извършена на основата на ранговия корелационен коефициент на Спирман  $\rho = 0,9545$  и Кендал  $\lambda = 0,8545$  и автокорелационния коефициент от първи порядък  $r_1 = 0,9407$ . За представяне на тенденцията в изменението на вноса най-подходящ е модела на експоненциалната функция  $\hat{y} = 11086e^{0,137t}$ . За този модел са получени най-високи значения на коефициента на детерминация ( $R^2 = 0,9316$ ) и на теста за адекватност  $F = 91,045$ .

Външнотърговският стокообмен на Р. България следва динамиката на износа и вноса и за целия период бележи нарастване. Проверката за наличие на тренд във външнотърговския стокообмен на Р. България за периода 1999-2009 г., показва че стойностите на корелационния коефициент на Спирман  $\rho = 0,9727$  и Кендал  $\lambda = 0,8904$  и автокорелационния коефициент от първи порядък  $r_1 = 0,9154$  са по-големи от теоретичните и в динамичния ред съществува тенденция. За представяне динамиката на външнотърговския стокообмен най-подходяща е експоненциалната функция  $\hat{y} = 20917e^{1301t}$ , за която са получени най-високи значения на коефициента на детерминация  $R^2 = 0,9257$  и на теста за адекватност  $F = 91,1405$ .

Тенденцията за превес на вноса над износа се запазва през целия период. Стабилно нарастване на вноса се установява след 1999 г. с около 10% годишно. Причини за нарастването на вноса са стабилизирането на икономиката, нарасналото търсене на суровини, материали, енергийни ресурси, увеличаването на цените на петрола, започналото обновяване на икономиката, намаляването и отпадането на някои митнически ставки, повишаването на реалните доходи на населението и др.

#### **4. Оценка на интензивността на структурните промени в износа и вноса на Р. България**

В икономиката на България след 1989 г. настъпват промени, които водят до значителни икономически реформи. Дотогава България внася евтини суровини от Съветския съюз, разполага със сигурния пазар на СИВ, а инвестициите са насочени към тежкото машиностроене, химическата промишленост, енергетиката и електрониката. В структурата на националната икономика през 1989 г. най-голям относителен дял има промишлеността (59,4%), на услугите се падат 29,7 % и 12,9 % на земеделието.

Промяната в организацията на икономическите процеси, отварянето на страната към света и възможността за достъп до международните пазари стават причина за значителни промени в географската и стоковата структура на външната търговия. За идентифициране на състоянието и тенденциите в националната икономика съществено място заема изследването на стоковата структура на износа и вноса, с цел разкриване на засилващите се или отслабващите се позиции на отделните стокови групи.

Изследването на динамиката в относителните дялове на отделните стокови групи в износа и вноса на Р. България за периода 1992-2009 г. е направено по раздели на Стандартната международна търговска класификация. Състоянието и динамиката на външната търговия в значителна степен зависи от нейната структура и настъпилите структурни промени. Структурата на националната икономика зависи от природните ресурси, работната сила, капитала, бизнес климата, икономическата свобода, данъчната политика, членството в различни организации структури и др. Структурата на външната търговия зависи в значителна степен от природните ресурси, тъй като чрез нея се набавят суровини, с които страната не разполага или има в ограничено количество, или се изнасят ресурси, от които страната има в изобилие.

Структурата на външната търговия е отражение на структурата на националната икономика. Увеличеното производство е свързано от една страна с нарастване на вноса на отделни суровини, материали и др. компоненти, участващи в производството, а от друга страна води до нарастване на износа на съответния краен продукт, произведен в България.

Установените изменения на относителните дялове, по раздели на SITC, за периода 1992-2009 г. дават основание за изследване промените в стоковата структура на експорта, чрез следните обобщаващи измерители на структурни изменения: интегрален коефициент на структурни изменения  $K_S$ ; евклидово разстояние  $d$ ; обобщаващ измерител на структурни изменения, изчислен въз основа на евклидовото разстояние  $K_d$ .

Интензивността на промените в стоковата структура на износа и вноса за изследвания период е най-голяма от 1992 до 2004 г., като стойността на интегралния коефициент е най-голяма през 2003 г. за износа и през 2004 г. за вноса. След 2004 г. интензивността на структурните промени в износа и вноса намалява, което дава основание да се твърди, че стоковата структура е относително стабилна.

## **5. Динамика на статистическите показатели за международни сравнения във външната търговия**

Изследването на динамиката на показателите за международни сравнения във външната търговия има важно значение за установяване на тенденциите във външната търговия и влиянието ѝ върху националната икономика. Важността на тези показатели се определя от необходимостта да се извършва сравнителен анализ на състоянието и отвореността на националната икономика, в сравнение с другите страни.

Проследена е динамиката на показателите за равнище на икономическо развитие, експортна квота, импортна квота, външнотърговска квота, показателите за еластичност на износа и вноса и индексите на условията на търговията. За периода 1991-2009 г. показателите експортна квота, импортната



квота, външнотърговска квота и коефициент на зависимост от външната търговия нарастват, като най-силно е изразено след 1998 г. Въз основа на това анализираният период е разделен до 1998 г. и след нея. Периодът от 1991-1998 г. обхваща години, в които страната започва отваряне към световната икономика, излиза на нови пазари, губи традиционни пазари, преживява редица сътресения и кризи, поради което трудно може да се определи видът на тенденцията. От 1998 г. започва стабилизацията на икономиката, въвеждането на валутен борд, а следващите години се характеризират с преговорите за членство в ЕС, признаването на България за действаща пазарна икономика и реалното членство на страната в ЕС. Резултатите от проверката показват, че в динамичният ред с данни за експортната квота за периода 1999-2008 г. съществува тенденция, а за най-подходящ модел е избран линейният  $\hat{y} = 31,831 + 1,533t$ , тъй като при него са установени най-високи стойности на коригирания коефициент на детерминация и на критерия на Фишер.

За периода 1991-2009 г. показателят импортна квота регистрира колебания, но се откроява тенденция към нарастване. Извършената проверка чрез коефициента на Спирман показва, че съществува тенденция, а за най-подходящ е избран линейният модел  $\hat{y} = 34,155 + 1,978t$ . Импортната квота през изследвания период променя често посоката на развитие, което се дължи по-скоро на цикличност, отколкото на тенденция, поради което не е избран на полином от по-висока степен.

Проверката на хипотезата за наличие на тенденция в изменението на външнотърговската квота за периода 1991-2008 г., показва, че  $\rho_{EM} = 0,6533$ ,  $\lambda_{EM} = 0,5294$  и  $r_1 = 0,6979$  от което следва, че съществува тенденция. Най-високи стойности на коригирания коефициент на детерминация и на критерия за адекватност са установени при полинома от втора степен  $\hat{y} = 91,102 - 3,54t + 0,271t^2$  и той е избран за моделиране на тенденцията във външнотърговската квота.

В коефициента на зависимост от външната търговия се отразяват промените в експортната и импортната квота. Коефициентът на зависимост от външната търговия за периода 1991-2008 г. нараства, но за периода 1991-1998 г. се наблюдава разнопосочно изменение и не съществува тенденция.

Изследването на динамиката на показателите, характеризиращи степента на отвореност на българската икономика, показва наличие на значителна интеграция в световната икономика. Икономиката на България не оказва съществено влияние върху световната икономика, поради малкия ѝ относителен дял в световната търговия.

Друг аспект на анализа на външната търговия е оценката на икономическото развитие чрез показателите за износ, внос и външнотърговски стокообмен на човек от населението. Показателите износ, внос и външнотърговски стокообмен на човек от населението за периода 1999-2009 г. нарастват и най-високите им стойности са през 2008 г. Върху изменението на тези показатели оказва влияние както нарастването на износа, вноса и външнотърговския стокообмен, така и намаляването на населението.

Външната търговия влияе върху икономическия растеж и за изследване на тази връзка се проследява динамиката на темпа на прираст на БВП, изчислен на основата на промяната в индекса на физическия обем. Данните за БВП, износа и вноса са по съпоставими цени на 2000 г., по изчисления на НСИ и публикувани динамични редове.

От анализиранияте показатели за периода 1995-2009 г. най-малки изменения се наблюдават в темпа на прираст на БВП. От 2000 до 2008 г. темпът на прираст на БВП е положителен и нараства, което показва, че в този период българската икономика е във възход и проведените реформи след 1997 г. дават резултат. Отрицателният икономически растеж през 2009 г. е следствие от започналата световна финансова криза, която доведе до спад в производството, намаляване на разполагаемите доходи, намаляване на инвестициите, намаляване на бюджетните приходи и др. Темповете, с които нараства износьт са по-ниски от темповете, с които нараства вносьт. До 2009 г. се запазва тенденцията за изпреварващо нарастване на вноса пред износа, което означава, че трябва да продължи структурната реформа в икономиката, да се използва рационално експортния потенциал и да се стимулира развиването на експортно ориентирани производства. Постигането и поддържането на високи темпове на нарастване на износа е важно условие за постигане на устойчив икономически растеж

## **6. Външнотърговският стокообмен на България с Балканските страни – състояние и динамика**

Балканските страни са едни от най-важните търговски и икономически партньори на България. Външната търговия с Балканските страни придоби приоритетно значение в годините на прехода и преориентацията на икономическите връзки на страната към страните от Европейския съюз и Централна и Източна Европа, както и включването ни в новосъздадени зони за свободна търговия. Чрез външната търговия се финализират резултатите от производствените, научно-техническите, инвестиционните и други форми на външноикономическата дейност чрез внос и износ на стоки и други материални ценности.

Обект на изследване е външната търговия (стойностния обем на износа, вноса и общия стокообмен) на Р. България с Балканските страни (Гърция, Румъния, Словения, Албания, Босна и Херцеговина, Хърватско, Турция, Македония, Сърбия и Черна гора) за периода 2000-2009 г. Целта е да се установят основните тенденции и закономерности в структурата и динамиката на стокообмена, общо и по основни търговски партньори от региона. Данните, въз основа на които е извършен анализът, са от статистическите публикации на НСИ и БНБ.

Прегледът на информацията показва, че динамиката на абсолютния обем на стокообмена на България с Балканските страни следва в общи линии тенденцията на изменение на общия външнотърговски стокообмен – нараства плавно през целия период на изследване, с изключение на 2009 г. Относителният дял на стокообмен с балканските страни в общия стокообмен на България се характеризира с относителна устойчивост, като варира от 18,7% през 2001 г. до 25,2% през 2007 г., когато е и най-голямата му стойност. Подобна е и констатацията за относителният дял на износа, като коефициентите на вариация за общия стокообмен и износа са съответно 9,61% и 9,41%.

Данните за търговския обмен на Балканските страни показват съществуването на различни приоритети в регионалната структура на външната търговия за отделните страни. От една страна се наблюдава приоритет на разгръщане на отношенията със страните от ЕС като най-важен търговски партньор на Балканските страни. След 2005 г. над 50% от външната търговия на тези страни е със страни от ЕС – Румъния и Албания около 70%, Гърция и

България – 60% и т.н. От друга страна, регионалният стокообмен на някои страни има преобладаващ дял в общия им стокообмен - Косово и Черна Гора с около 50%. Македония, Босна и Херцеговина са осъществили около 30% от общия им стокообмен с регионалните страни, а Румъния и Гърция – около 10%, като с това се оказват най-слабо интегрирани с Балканските страни от гледна точка на външната търговия. В този аспект България със среден дял от около 23% за общия стокообмен се нарежда сред страните, които съчетават общата тенденция на разширяване на външноикономическото сътрудничество в рамките на ЕС с усилията за разгръщане на регионалния търговския обмен между Балканските страни.

В динамиката на стокообмена ни с балканските страни се откроява поголемият български износ в сравнение с вноса оттам, което и обуславя активното салдо с тях. Тази закономерност е характерна само за стокообмена ни с Балканските страни, тъй като външнотърговското салдо на България след 1998 г. е отрицателно. При това може да се отчете относителната стабилност в динамиката на положителното търговско салдо с Балканските държави – размахът на вариацията в относителен размер (89%) е почти два пъти по-малък в сравнение с този на общия стокообмен (166%).

Обобщаваща количествена характеристика за интензивността на структурните промени в стокообмена на България с Балканските страни като цяло може да се получи чрез интегралния коефициент на структурни изменения и различия. Коефициентите се движат от 0,038 до 0,1907 и като се има предвид, че нормираните стойности на интегралния коефициент са в границите от 0 до 1, тези величини свидетелстват за слаби структурни изменения в съвкупността като цяло. Интензивността на структурните изменения е най-голяма в началото на периода (2001/2000 г.), след което следва рязко намаление на промените в структурата. Последващата относителна стабилизация в структурата по основни партньори е за продължителен период от няколко години. През 2007 г. коефициентите отново повишават стойността си, което свидетелства за нараснал интензитет на структурните промени. Те са логичен резултат от приемането на България в Европейския съюз и преориентацията на външноикономическите, в т.ч. и външнотърговски приоритети.

Анализът на тенденциите в изменението на общия стокообмен, износа и вноса на България с Балканските страни показва наличие на ясно изразени тенденции в динамичните редове за всички показатели. С помощта на статистическите методи за анализ е извършена проверка за наличие на тренд и са разработени и оценени получените трендови модели. Същите могат да бъдат използвани за разработване на краткосрочни прогнози в зависимост от интереса и потребностите на изследванията и практиката в областта на външната търговия.

## **7. Коинтеграционен анализ на външната търговия на България със страните от Европейския съюз (15)**

От особено значение за икономическия растеж на всяка една страна е каузалната връзка между показателите, характеризиращи провежданата външно-търговска политика. Тази политика се осъществява в две основни направления – стимулиране на вноса или рестрикция на вноса, с цел стимулиране на местното производство. Когато ръстът в обема и стойността на износа е основен фактор за икономическия растеж, с приоритет е външно-

търговската политиката в първото направление. Ако икономическият растеж води до увеличение на износа, тогава преобладаваща е външно-търговската политика във второто направление. Икономическата теория подкрепя двете теории, т.е. между темпа на изменение на износа и вноса съществуват двупосочни каузални зависимости. От една страна, увеличението на износа води до увеличение на brutния вътрешен продукт чрез ефекта на мултипликатора, а оттук и индиректно до увеличаване на търсенето от внос. От друга страна, увеличеното търсене на вносни стоки води до съкращението на производствените разходи за местното производство в резултат от реализираните икономии от мащаба, което пък от своя страна стимулира износа.

От данните за динамиката на вноса и износа може да се предположи, че те споделят общи трендове, тъй като двете линии са почти успоредни. Освен това, ясно не вижда, че в динамичните редове е налице нарастваща тенденция, която евентуално предполага включването на линеен, респективно параболичен тренд при анализа. Тези констатации ни дават основание, връзката между вноса и износа да се изследва с методологията на коинтеграционния анализ. В това изследване, с помощта на коинтеграционния подход на Йохансен се изследват дългосрочните и краткосрочните каузални зависимости между вноса и износа на България, осъществени по отношение на държавите-членки на Европейския съюз преди неговото разширяване от 1.05.2004 г. Основната цел е да се тества емпирично валидността на двете основни теории за водещата роля на износа, респективно на вноса. Като основен източник за необходимите макроикономически показатели е използван сайта на БНБ (<http://www.bnb.bg>). Емпиричните оценки на тестваните иконометрични модели се осъществяват въз основа на месечни данни за износа (EXP) и вноса (IMP) на България за периода от месец януари 1995 г. до месец юли 2010 г. Динамичните редове се състоят от 187 наблюдения.

Извършена е проверка на стационарността на променливите. Тя се осъществява с помощта на ADF, т.е. разширеният критерий на Дики-Фулър. За да се обхване влиянието на сезонния фактор, стационарността на динамичните редове се тества и чрез включване на фиктивни сезонни променливи (ADF-SD). С тези критерии на проверка се подлага нулевата хипотеза, според която в редовете има единичен корен (т.е. налице е нестационарност). От извършената проверка на стационарността в двата варианта на тестваните модели, когато се отчита сезонността, се установява, че логаритмите на двете резултативни променливи (*exp* и *imp*) са интегрирани от първи порядък (дори при равнище на значимост  $\alpha = 0,01$ ).

Оценките на дългосрочните зависимости между вноса и износа са изчислени отчитайки влиянието на сезонния фактор чрез включване в тестваните модели на центрирани фиктивни сезонни променливи. Методът позволява да се определи не само матрицата на коинтеграционните вектори при даден ранг на коинтеграция, но така също и да се тестват хипотези за ранга на коинтеграцията (броят на коинтеграционните вектори). Проверката бе осъществена в няколко варианта, свързани с включването в моделите на детерминирани променливи (константа и тренд) – без константа, с константа, с константа и тренд. В крайна сметка, като изходен пункт за коинтеграционен анализ бе избран VAR(3), включващ двете статистически променливи (*imp*, *exp*).

За да се интерпретират получените оценки на коинтеграционните вектори се извършва тяхната стандартизация като за дадена променлива

значението се приравнява на единица. Понеже целта в настоящото изследване е да се подложи на оценка коя от двете теории за ролята на външната търговия е валидна по отношение на външнотърговския стокообмен със страните от Европейския съюз, нормализацията се осъществява по отношение на вноса и на износа. По този начин, получените с коинтеграционния анализ оценки се интерпретират като коефициенти на еластичност.

Всички оценки, с изключение на константата в модел 2, при който вносът е зависима променлива, са статистически значими. В дългосрочен аспект установяваме, че между вноса и износа, когато се отчита влиянието на тренда (независимо дали е ограничен или неограничен), е налице двупосочна причинност (каузалност). За изследвания периода, в резултат от влиянието на промените от технико-технологичен характер, обемът на износа, средно за месец е намалявал с 0,5%. Увеличението на износа с един процент определя намаление в обема на вноса с 0,424-0,428%, в зависимост от отчитане влиянието на тренда. От своя страна, вносът обуславя намаление в стойността на износа, средно с 2,338-2,361%. С отчитане на тренда се установява, че средномесечното увеличение на вноса през изследвания период възлиза на 1,2%. Без отчитане влиянието на техническия прогрес в модела (тренда) износът е фактор за стимулиране на вноса. Еластичността на вноса по отношение на износа се оценява между -1,046 и -1,153%.

Обобщавайки гореизнесените резултати можем да заключим, че между износа и вноса на България със страните-членки на Европейския съюз съществуват двупосочни дългосрочни и краткосрочни каузални зависимости, когато влиянието на тренда се отчита само в дългосрочен аспект. През изследвания период, между вноса и износа е налице отрицателна зависимост, като с течение на времето, във вноса се наблюдава тенденция към увеличаване, изразяваща се в 1,2% средномесечно, а износът намалява средно с 0,5%. С увеличение на вноса с един процент, износът намалява средно с 0,428%. От своя страна, процентното увеличение в стойността на износа определя намаление във вноса с цели 2,4%. Износът е нееластичен по отношение на вноса, докато вносът е еластичен спрямо износа. Коригиращите механизми се осъществяват сравнително бързо. Нарушените равновесия се възстановяват в рамките на 5 месеца и половина.

## **8. Външната търговия на България и Русия – тенденции и закономерности**

Търговският стокообмен между България и Русия нараства през периода 1995 – 2009 година. От 1 млрд. 685 млн. евро през 1995 величината нараства до 4 млрд. и 843 млн. евро през 2008 година. През 2009 година се наблюдава спад до 2 млрд. и 908 млн. евро, главно под влияние на икономическата криза. Най-голям прираст е реализиран през 2006 година – 941,7 млн. евро, а най-голям е спадът през 2009 година – 1 млрд. и 935,7 млн. евро. Средногодишният прираст в обема на стокообмена е в размер на 184,3 млн. евро, което показва стабилно, закономерно увеличение на търговските връзки с Русия през целия анализиран период. Средният темп на нарастване е 107,7%, което дава възможност да се направи извода, че стокообменът е нараствал 1,077 пъти всяка година спрямо предходната, или със 7,7% за година.

Относителният дял на търговския стокообмен между България и Русия спрямо общия стокообмен на България е бил малко над 20% през 1995 и 1996

година. Стойностите са съответно 21,2% за 1995 година и 21,6% за 1996 година. След това се наблюдава бърз спад - 18,6% през 1997 година, 15,0% през 2000 година и 8,0% през 2004 година. След това дялът на стокообмена с Русия се стабилизира, като се движи в границите между 10,0% и 12,%. Като цяло се регистрира намаление на относителния дял на стокообмена, което се съпровожда от повишаване на размера му. Следователно нарастването на търговския обмен с Русия, макар и значително, е по-бавно от нарастването както на търговския обмен на България като цяло, така и от увеличението на търговията на страната с останалите партньори. Ако през 1995 година една пета от търговския обмен на страната е бил с Русия, то през 2009 година дялът е едва една десета. Изводът, който може да се направи е, че значението на Русия като търговски партньор на България намалява непрекъснато за сметка на други страни и региони, които придобиват значение на основни търговски партньори.

Преобладаваща част от стокообмена с Русия е внос. Дялът му за целия период не спада под 75%, а даже се увеличава. През 1995 година дялът му съставлява 76,6% от общия стокообмен и нараства до 93,1% през 2000 година. През 2005 година достига до впечатляващите 94,9% - на всяко евро износ към Русия се падат по 19 евро внос или вносът от Русия 19 пъти надвишава износа ни към нея. След този момент се регистрира лек спад в дела на вноса до 89,9% - той превишава 9 пъти износа.

Изводът, който се налага, е, че нарастването на обема на търговските отношения с Русия е главно за сметка на нарастването на вноса, докато износът спада или нараства толкова бавно, че относителният му дял се понижава до изключително ниски стойности. Това е крайно неблагоприятна тенденция, тъй като води до постоянно отрицателно търговско салдо с Русия.

Разгледани поотделно за вноса и износа, данните показват, че докато през 1995 година за Русия е отивал 10,3% от износа на България, след това е регистриран сериозен спад. През 2002 година величината е по-ниска от 2% - едва 1,6%, а през периода 2004 – 2005 година спада още по-ниско – до 1,3% от целия ни износ. След 2007 година дялът на износа на България за Русия се повишава леко, но без да надмине границата от 3% - само 2,7% през 2008 и 2,5% през 2009 година. Като цяло дялът на износа към Русия спада повече от четири пъти (4,1 пъти) за 2009 година спрямо 1995 година.

В динамиката на износа на България за Русия за периода 1995 – 2009 година най-общо може да се разграничат два периода в развитието на търговските отношения. До 2003 година се наблюдава почти непрекъснат спад, като от 394 млн. евро през 1995 година износът ни за Русия спада до 93,2 млн. евро през 2003 година, което е намаление с 301,3 млн. евро, или над 4 пъти. След 2003 година износът на България за Русия започва да се увеличава, за да достигне до 412,6 млн. евро през 2008 година, след което отново следва спад до 293,5 млн. евро.

Графичният образ на динамичния ред свидетелства за наличие на тенденция с промяна на посоката на изменение. Тя не може да се установи по обичайните начини – с коефициентите на рангова корелация на Спирман и Кендал, тъй като те се използват за откриване на монотонна тенденция, а не на параболична (със смяна на посоката). Този извод се потвърждава от статистическите тестове. Заключение, основано на автокорелационния коефициент, е, че редът съдържа тенденция.

При условие, че се запазят същите закономерности, вносът от Русия ще продължи да нараства и за 2015 година според модела ще достигне 7 млрд. и

528 млн. евро. При прогнозиран износ от 1 млрд. и 112 млн. евро, прогнозата е за отрицателно търговско салдо с Русия от 6 млрд. и 417 млн. евро. Може да направим общият извод, че при запазване на съществуващите тенденции на развитие на търговските отношения с Русия, вносът от нея в България ще продължи да нараства по-бързо от износа, в резултат на което негативните тенденции ще се задълбочават и ще получават изражение в нарастване на негативното ни търговско салдо.

### **Заклучение**

Изследването на външната търговия и познаването на механизмите на въздействие върху националната икономика са важно условие за интегрирането на страната в ЕС и стабилна основа за провеждане на успешна икономическа политика. За статистиката на външната търговия са характерни редица особености, свързани с осигуряването на сравнимост, съпоставимост и съизмеримост на статистическите данни. Членството на България в ЕС постави нови изисквания за статистическото отчитане на вътрешнообщностната търговия със стоки и въвеждането на статистически праг за наблюдение.

Външната търговия е важен фактор за развитието на националната икономика и влияе върху икономическия растеж, платежния баланс, отвореността на икономиката и др. Изследването на структурните промени във външната търговия има важно значение за решаването на редица задачи с практико-приложен характер, тъй като анализът на структурите и тяхната динамика е в основата на разработването на програми и мерки за въздействие върху икономическите процеси. Промяната в организацията на икономическите процеси, отварянето на страната към света и възможността за достъп до международните пазари са причина за значителни промени в географската и стоковата структура на външната търговия.

Получените резултати могат да се използват за разработване на прогнози за структурата и динамиката на външната търговия, за оценка на въздействието ѝ върху икономическото развитие на страната и за определяне на външнотърговската политика на България, в която да се включат мерки за стимулиране на търговията, за насърчаване на износа, за създаване на условия за извършване на промени в стоковата структура на износа и вноса, за разширяване на външнотърговските връзки със страните от ЕС, Балканските страни и Русия.