

УДК 338

МЕТОДИЧЕСКИЕ РЕКОМЕНДАЦИИ ПО ОЦЕНКЕ ЭФФЕКТИВНОСТИ ФУНКЦИОНИРОВАНИЯ РЫНОЧНОЙ СТРУКТУРЫ

А.А. Федорова

Финансовый университет при Правительстве РФ, г. Москва

Рассматривается проблема оценки эффективности функционирования рыночных структур. Представлены два основных направления экономической мысли, по-разному оценивающие эффективность на рынке: микроэкономический – статический подход, институциональный – динамический. Обосновывается необходимость разработки методических рекомендаций, учитывающих разницу указанных подходов, в целях преодоления трудностей у исследователей и Федеральной антимонопольной службы (ФАС) в общем определении эффективности той или иной рыночной структуры.

***Ключевые слова:** рыночные структуры, эффективность рынков, антимонопольное законодательство.*

Задача определения эффективности рынков занимает одно из центральных мест среди множества проблем, с которыми столкнулось общество. На сегодняшний день потребность в решении этой задачи стоит особенно остро по причине увеличения конкуренции, глобализации бизнеса, роста предпринимательских рисков.

Как понять, что рыночная структура эффективна? В первую очередь такая структура демонстрирует низкие цены на товары и услуги, большие объемы производства и реализации, обеспечивает низкие транзакционные издержки и обеспечивает высокое качество.

Представители двух основных направлений, таких как микроэкономическое и институциональное, используют разные подходы для определения эффективности. Микроэкономический подход использует статический подход для определения эффективности различных отраслей, а институциональный – динамический. Представители первого подхода утверждают, что для эффективного функционирования рынков необходима конкурентная структура, так как если на рынке будет присутствовать доминирующая фирма, то она будет назначать свою цену на продукт, тормозить инновации, сдерживать рост качества, добиваться высоких входных барьеров для защиты уже существующих компаний.

По мнению представителей институционального подхода, олигополистическая структура может быть эффективной, если обеспечивается относительное снижение цен (с учетом инфляции), рост качества, формируются единые правила для свободного входа и выхода компаний и внедрение инноваций.

Чаще всего ФАС оценивает эффективность со стороны микроэкономического подхода, предполагая, что только конкурентная структура может быть эффективной. Напротив, представители

институционального подхода утверждают, что эффективность в большей степени зависит от четырёх различных факторов, которые будут рассмотрены ниже, а не от структуры рынка.

В данной работе постараемся оценить эффективность со стороны институционального подхода. Нил Флигстин в своей работе «Архитектура рынков» определяет зрелый, стабильный рынок как рынок, «на котором идентичность и статусная иерархия фирм (доминирующих и претендентов) хорошо известны, а концепция контроля, направляющая действия акторов, которые управляют этими фирмами, разделяется всеми участниками» [4, с. 11].

По его мнению, механизм эффективного ценообразования заключается в том, что фирмам необходимы правила, которые позволят им сотрудничать со своими конкурентами, и совместно с ними «производить новые товары, делить рынки и устанавливать цены» [4, с. 94]. Это означает, что цена товара или услуги образуется под влиянием факторов, которые формируются самими фирмами при том или ином участии государства. Поэтому цена не должна меняться под действием посторонних сил, таких как дифференциация цен по времени покупки, в зависимости от статуса потребителя и т.д. Если социальные отношения на рынке установлены на легальных основаниях и прибыль фирм, которую они получают за счет реализации товаров и услуг, помогает сохранить общественное благо, то общество будет устраивать текущий уровень цен [4, с. 54].

Флигстин разделяет рынки в зависимости от четырех ключевых институциональных механизмов: «права собственности, структуры управления, правила обмена и концепции контроля» [4, с. 9].

Первый механизм – права собственности, которые означают «правила, определяющие, кто имеет притязание на прибыль предприятий» [4, с. 68]. Данный механизм позволяет определить юридические права собственности, отношения между собственниками и наемными сотрудниками, покупателями и поставщиками и т.д.

Вторым механизмом является структура управления, которая включает «общие правила, определяющие отношения конкуренции или сотрудничества...», а также то, «как должны быть организованы предприятия» [4, с. 69–70]. Данный механизм позволяет определить законные и незаконные способы контроля конкуренции.

Следующий механизм – правила обмена. Они помогают определить «кто и с кем может вести дела, и каковы при этом условия осуществления трансакций» [4, с. 71]. Такой механизм должен определять правила, касающиеся перевозки грузов, страховки, денежного обмена, соблюдения контрактных обязательств и т. д., также стандарты безопасности товаров и их качества.

Последним механизмом, предложенным Флигстином, является концепция контроля. Она выражает «свойственные данному рынку соглашения между акторами внутри предприятий по поводу принципов их внутренней организации (т. е. форм иерархии), способов конкуренции или сотрудничества (т. е. стратегий) и внешней иерархии (т. е. статусного упорядочивания) предприятий на данном рынке» [4, с. 72].

По мнению Флигстина, если на рынке сформированы данные четыре механизма, согласно которым компании будут производить новые товары,

делить рынки и устанавливать цены, то даже в случае монополии/олигополии, компании не смогут завышать цены на товары и услуги.

Что касается качества, то в институциональном анализе качество является результатом определённых конвенций, норм, которые воплощаются в стандартах, а для барьеров входа и выхода на рынке должны существовать единые правила, которые помогают избежать хищнического захвата фирм. Как пишет Флигстин: «Справедливая торговля предполагает, что новички на рынках не должны осуществлять хищнические практики, которые способны нарушить стабильный порядок... Предприятиям не нужно прямое государственное вмешательство в случае проблем, вызванных конкуренцией, так как это может закончиться появлением общественной собственности или ряда привилегированных предприятий» [4, с. 94].

Выше дано общее описание институциональных факторов эффективности рынков. Однако их необходимо «приземлить», представить в виде методических рекомендаций, которые можно использовать для определения эффективности функционирования того или иного рынка.

Во-первых, необходимо определить цель нашей диагностики рынка. Это предполагает выбор определенной отрасли (вида экономической деятельности в соответствии с классификацией Росстата) для анализа основных индикаторов эффективности. Различные отрасли можно разделить на три группы: эффективные, среднеэффективные и неэффективные. Если рынок эффективен, то на нем присутствуют низкие цены, высокие объемы производства, низкие транзакционные издержки, высокое качество, следовательно, вмешательство государства на таком рынке должно быть минимизировано. Если рынок среднеэффективен, то необходимо определить какие из показателей отстают от «эталонных» и повлиять на них. В случае неэффективности рынка необходимы незамедлительные меры со стороны представителей государства – Федеральной антимонопольной службы.

Во-вторых, необходимо провести анализ основных показателей эффективности рынка. Допустим, что на одном рынке цены каждый год снижаются на 2 %, а на другом на 5 %, тогда они оба эффективны, или нет? По этой причине для сравнения различных отраслей необходима общая шкала определения эффективности, а именно балльно-рейтинговая система. На данный момент такая система находится в стадии становления. Отдельные рейтинги выставляются фирмам и отраслям различными агентствами (Эксперт РА, РусРейтинг, Fitch's, Moody's, Standart and Poor's и т.д.). Эти рейтинги играют существенную роль при определении кредитных рисков, перспектив инвестиций и т.д.

В качестве примера балльно-рейтинговой оценки, которая применяется для определения эффективности различных инновационных проектов, рассмотрим практику Российского гуманитарного научного фонда (РГНФ) и Российского фонда фундаментальных исследований (РФФИ), которые проводят экспертизу проектов в области гуманитарных и общественных наук [2, с. 253]. Главной задачей экспертизы является оценка «научного и технического уровня проекта, возможностей его выполнения и эффективности» [2, с. 250].

Так, в РГНФ экспертная оценка заключается в необходимости ответов на вопросы экспертной анкеты, где учитываются такие показатели, как:

- 1) четкость изложения замысла проекта (четкое, нечеткое);
- 2) четкость определения цели и методов исследования (четко, нечетко);
- 3) качественные характеристики проекта (проект имеет: фундаментальный характер; междисциплинарный или системный характер; прикладной характер);
- 4) научный задел (имеются: существенный научный и методологический задел в решении сформулированной в проекте проблемы; публикации по заданной теме; научно-методическая проработка решения проблемы отсутствует);
- 5) новизна постановки проблемы (автором впервые сформулирована и научно обоснована проблема исследования; автором предложены оригинальные подходы к решению проблемы; сформулированная в проекте проблема исследования известна науке и автором не предложены оригинальные подходы к решению проблемы) [2, с. 253–254].

После анализа данных показателей, выводится итоговое балльное заключение эксперта от 1 до 5, где 1 значит, что проект не заслуживает рассмотрения экспертным советом; 2 – проект не заслуживает поддержки; 3 – проект может быть поддержан; 4 – проект заслуживает поддержки; 5 – проект заслуживает безусловной поддержки. Также в анкете учитываются обстоятельства, которые могут затруднить объективную экспертизу, как пример, «конфликт интересов».

Такой экспертный анализ позволяет не только дать описание проекта, но и оценить его и сравнить по важности с другими.

РФФИ осуществляет экспертизу на базе сравнительного анализа двух и более инвестиционных проектов, состоящей из трех уровней.

Первый уровень включает предварительное изучение проекта и «решение следующих задач:

- отбор проектов для участия в экспертизе второго уровня;
- составление мотивированных заключений по отклоненным проектам;
- определение экспертов по каждому проекту, прошедшему на индивидуальный уровень экспертизы.

Формализация результатов экспертизы осуществляется на рейтинговой основе» [2, с. 254–255].

На следующем уровне выставляется рейтинг для каждого проекта, а на третьем уровне дается заключение.

Рейтинг по каждому проекту устанавливается индивидуально и рассчитывается по следующей формуле:

$R = r_1 + r_2 + r_3$, где R – общий рейтинг проекта; r_1, r_2 – коэффициенты, учитывающие соответственно научную ценность проекта и реальность выполнения проекта в срок; r_3 – коэффициент коррекции суммарной оценки r_1 и r_2 .

Значение показателя R колеблется от 2 до 13.

Коэффициент r_1 оценивает вероятность того, что выполнение проекта может привести к новым принципиальным результатам; обеспечить существенное продвижение в рамках данного направления; оказать влияние на прогресс в данной или смежной научной области.

Коэффициент r_2 учитывает научный уровень руководителя и потенциал возглавляемого им коллектива; научный задел и публикации по теме; информационное, лабораторное и материальное обеспечение проекта; корректность распределения задачи по этапам, результатам и срокам работы.

Рассмотренные приемы экспертизы основаны на балльной оценке [2, с. 255–257].

Как видно, балльно-рейтинговый метод имеет ряд преимуществ по сравнению с другими методами:

- 1) он позволяет сравнивать два и более альтернативных варианта/рынка;
- 2) учитывает субъективность интерпретации информации;
- 3) применим при выработке долгосрочных приоритетов государственной политики.

Попытаемся применить балльно-рейтинговый метод для оценки показателей эффективности различных отраслей. Оценка эффективности будет включать в себя анализ изменений цен на товары или услуги на определенном рынке, анализ уровня концентрации, анализ структуры управления, который позволяет понять различные законные и незаконные способы контроля в рассматриваемой отрасли и оценить уровень транзакционных издержек; анализ структуры контроля, который отражает свойственные данному рынку стандарты, (как отслеживается качество, возможности входа и выхода конкурентов, взаимодействие компаний с потребителями и государством).

Для начала необходимо определить рейтинг для каждого показателя, так показатель А означает, что рынок по данному показателю эффективен, Б – среднеэффективен, С – неэффективен.

Теперь соотнесем каждый показатель эффективности рынка (изменение цены, концентрация, структура управления и контроля) с показателем рейтинга (А, В или С), и определим, при каких значениях они относятся к той или иной группе рейтинга (табл. 1).

I. Изменение цены с учетом инфляции

Рейтинг А: если изменение цены за последнее время не превышало 1 %.

Рейтинг В: если изменение цены было больше 1%, но менее или равно 1,05 %.

Рейтинг С: если изменение цены было более 1,5 %.

II. Концентрация компаний на определенном рынке

Рейтинг А: если концентрация компаний меньше или равна 1000.

Рейтинг Б: если концентрация превышает 1000, но меньше или равна 5000.

Рейтинг С: если концентрация превышает 5000.

Также в данном показателе необходимо рассмотреть, как менялся объем выручки, приходившей на крупные компании за рассматриваемый период.

III. Структура управления

Рейтинг А: если низкий уровень транзакционных издержек и коррупции.

Рейтинг Б: если средний уровень транзакционных издержек и коррупции.

Рейтинг С: если высокий уровень транзакционных издержек и коррупции.

IV. Структура контроля

Рейтинг А: Если рынок жестко регламентируется государственными органами, барьеры входа-выхода на рынок понятны и одинаковы для всех игроков на рынке, нет нарушений.

Рейтинг Б: Если рынок регламентируется государственными органами, но иногда встречаются нарушения, барьеры входа-выхода на рынок размыты и не одинаковы для всех игроков на рынке.

Рейтинг С: Если рынок плохо регламентируется государственными органами, постоянно встречаются нарушения, барьеры входа-выхода на рынок защищают интересы только крупных игроков.

Т а б л и ц а 1

Рейтинговой метод оценки эффективности			
Рейтинг	А	В	С
I. Изменение цены (с учетом дефлятора)			
Значение (в %)	$i \leq 1$	$1 < i \leq 1,05$	$i > 1,05$
II. Концентрация на определенном рынке			
Значение	$ii \leq 1000$	$1000 < ii \leq 5000$	$ii > 5000$
III. Структура управления			
Значение	Низкие транзакционные издержки	Средние транзакционные издержки	Высокие транзакционные издержки
IV. Структура контроля			
Значение	Жестко регламентируется, нет нарушений	Регламентируется, иногда встречаются нарушения	Почти не регламентируется, постоянные нарушения

Источник: составлено автором

Такой метод позволяет выявить для каждого рынка соответствующий рейтинг. Но допустим, что один рынок имеет рейтинг АВВА, а другой АААС. Встает вопрос: какой из них более эффективный? Для ответа необходимо использовать балльно-рейтинговую систему, то есть каждому рейтингу присвоить свой балл и умножить на коэффициент по значимости.

Так как у нас рейтинг может принимать три значения, то эффективному рынку (рейтинг А) будет соответствовать балл 1, среднеэффективному (рейтинг В) – балл 0,5, неэффективному (рейтинг С) – 0.

Изменение цены и концентрации наиболее важные показатели эффективности рынка, поэтому коэффициенты для данных показателей равны 0,3; для оставшихся показателей эффективности (структуры управления и контроля) коэффициенты равны 0,2.

Тем самым мы получаем уравнение балльно-рейтинговой системы для определения эффективности рынка:

$$E = 0,3*i + 0,3*ii + 0,2*iii + 0,2*iv, \text{ где:}$$

E – эффективность определенного рынка в баллах;

i – рейтинг для показателя изменение цены;

ii – рейтинг для показателя концентрации;

iii – рейтинг для показателя структуры управления;

iv – рейтинг для показателя структуры контроля.

Следовательно, показатель эффективности рынка E может принимать значения от 0 до 1, где 0 означает, что рынок вообще неэффективный (в случае, если рейтинг рынка СССС); 1 – эффективный (в случае, если рейтинг рынка АААА).

Выше был вопрос об эффективности рынков с рейтингом АВВА и АААС. Рассмотрим их показатели с помощью балльно-рейтинговой системы:

1 рынок:

$$E(ABBA)=0,3*A+0,3*B+0,2*B+0,2*A=0,3*1+0,3*0,5+0,2*0,5+0,2*1=0,3+0,15+0,1+0,2=0,75$$

2 рынок:

$$E(AAAC)=0,3*A+0,3*A+0,2*A+0,2*C=0,3*1+0,3*1+0,2*1+0,2*0=0,3+0,3+0,2+0=0,8$$

Так с помощью балльно-рейтингового метода можно заключить, что второй рынок более эффективен, чем первый.

Таким образом, наши рекомендации предполагают следующий порядок.

Во-первых, необходимо определить рынок для изучения эффективности и цель диагностики.

Во-вторых, необходимо выявить основные показатели эффективности (изменение цены, концентрация, структуры управления и контроля) и вывести итоговую оценку эффективности. Для этого предлагается использовать балльно-рейтинговый метод, который позволяет сравнивать два и более рынка. Всё это позволит государственным органам определить комплекс необходимых мероприятий по повышению эффективности рынка.

Список литературы

1. Авдашева С. Б., Розанова Н. М. Теория организации отраслевых рынков. Учебник. М.: ИЧП "Издательство Магистр", 1998. 320 с.
2. Ильенкова С.Д. Инновационный менеджмент: Учебник для вузов. М.: Банки и биржи, ЮНИТИ, 1997 (http://director.at.ua/Innovatsionny_menedzhment.pdf)
3. Нуреев Р.М. Курс Микроэкономики.. 3-е изд., испр. и доп. М.: НОРМА ИНФРА-М, 2014. 432 с.
4. Флигстин Н. Архитектура рынков: экономическая социология капиталистических обществ XXI века /пер. с англ. М.: Изд. Дом Высшей школы экономики, 2013. 396 с.

METHODICAL RECOMMENDATIONS FOR ASSESSING THE EFFECTIVENESS OF THE FUNCTIONING OF THE MARKET STRUCTURE

A.A. Fedorova

Financial University under the Government of the Russian Federation, Moscow

Considers the problem of assessment of efficiency of functioning of market structures. Presents two main directions of economic thought, different opinions on the effectiveness on the market: microeconomic – static approach, the institutional dynamic. The necessity to develop methodological recommendations that take into account the difference of these approaches in order to overcome difficulties for researchers and the Federal Antimonopoly service (FAS) in the General definition of efficiency of a particular market structure.

Keywords: *market structures, market efficiency, antimonopoly legislation.*

Об авторе:

ФЕДОРОВА Анастасия Александровна – аспирант, Финансовый университет при Правительстве РФ, научный руководитель Ореховский Петр Александрович, г. Москва, тел.: +7(916)691-77-48, e-mail: nastya-fedor@mail.ru

About the author:

FEDOROVA Anastasija Aleksandrovna – Post graduate, Financial University under the Government of the Russian Federation, scientific supervisor Orekhovsky Petr Alexandrovich, e-mail: nastya-fedor@mail.ru

References

1. Avdasheva S. B., Rozanova N. M. Teorija organizacii otraslevykh rynkov. Uchebnik. M.: IChP "Izdatel'stvo Magistr", 1998. 320 s.
2. Il'enkova S.D. Innovacionnyj menedzhment: Uchebnik dlja vuzov. M.: Banki i birzhi, JuNITI, 1997 (http://director.at.ua/Innovatsionny_menedzhment.pdf)
3. Nureev R.M. Kurs Mikrojekonomiki.. 3-e izd., ispr. i dop. M.: NORMA INFRA-M, 2014. 432 s.
4. Fligstin N. Arhitektura rynkov: jekonomicheskaja sociologija kapitalisticheskikh obshhestv XXI veka /per. s angl. M.: Izd. Dom Vysshej shkoly jekonomiki, 2013. 396 s.