

УДК 330.341.44

В. В. Філіпович

Одеський національний університет імені І. І. Мечникова

**РІВЕНЬ РИНКОВОЇ КОНЦЕНТРАЦІЇ ЯК БАЗА
ДЛЯ АНТИМОНОПОЛЬНОЇ ПОЛІТИКИ**

Розглядається система показників, що описують тип ринкової структури, оцінюють економічну концентрацію ринку і є теоретичною і практичною основою для формування науково обгрунтованої антимонопольної політики. Узагальнюється основний комплекс проблем, пов'язаних з дослідженням рівня концентрації на товарних ринках.

Ключові слова: конкуренція, концентрація, рівень концентрації, ринкова структура, антимонопольна політика.

Розробка системи показників, що здатна дати оцінку стану, рівню і напрямку розвитку конкуренції на товарних ринках, останнім часом стає все більш актуальною внаслідок зростаючого впливу структури ринків, як на поведінку підприємств, так і на рішення органів державної влади. В зв'язку з цим, необхідно розглянути теоретичні підходи до дослідження ринкової концентрації на товарних ринках. Метою даної статті є узагальнення всього комплексу проблем, пов'язаних з дослідженням рівня концентрації на товарних ринках. Для досягнення зазначеної мети необхідно розглянути показники, що описують тип ринкової структури, визначити переваги і недоліки кожного з показників; із всього комплексу показників вибрати ті, які найбільш вірно відображають стан конкурентного середовища на товарному ринку.

Зазначені проблеми аналізують такі вчені, як С. Б. Авдашева, Н. М. Розанова, В. В. Балюкевич, Д. Росс, Ф. Шерер, В. М. Горбатов та інші. Їх праці лягли в основу написання даної статті.

Для кількісної оцінки ступеня концентрації ринку у світовій практиці використовують цілу систему показників. У зарубіжній і вітчизняній економічній літературі [1; 2; 3; 4; 5; 6] представлені методи дослідження і технологія розрахунків таких основних коефіцієнтів, що вимірюють рівень концентрації: індекс концентрації (CR); Герфіндала-Гіршмана (HHI); Лінда (L); відносною концентрації (Do); ентропії (E); дисперсії логарифмів ринкових часток фірм (σ^2); варіації (V); Джіні (G); Холла-Тайдмана (HT) або Розенблюта (I). Для аналізу адаптаційних можливостей всіх вимірників концентрації в практиці антимонопольних органів розглянемо їх методи розрахунку, економічне значення, переваги і недоліки.

Найпоширеніший показник для характеристики концентрації — коефіцієнт ринкової концентрації (CR). Він показує акумульовані частки концентрації найкрупніших одиниць і визначається як сума ринкових часток k найбільших продавців ринку (може вимірюватися в частках або у відсотках). Ринкова частка суб'єкта може розраховуватися як відношення не тільки обсягу продажів, але і чисельності зайнятих, розміру активів або доданої вартості даного підприємства до сумарного значення показника для ринку в цілому [4, с. 5]. В більшості промислово розвинених країн коефіцієнт концентрації обов'язковий при статистичному

моніторингу стану ринку, причому в різних країнах розраховуються частки різного числа підприємств. Даний коефіцієнт дозволяє не тільки зіставити рівні концентрації різних галузей або ринків, але і проаналізувати їх динаміку, встановити, за рахунок часток яких підприємств (великих, середніх або малих) намітилося перегруповування ринкової влади.

Графічно інтерпретацію даного коефіцієнта представляє крива концентрації. При цьому найважливішою умовою її наочності є розташування на осі абсцис числа підприємств, а на осі ординат накопичувальних питомих вагів, що припадають на аналізовані підприємства, ранжировані в порядку зменшення значень даної ознаки [4, с. 6]. Чим вища концентрація, тим крутіша крива і більша площа між нею і бісектрисою.

Істотний недолік показника концентрації полягає в його «нечутливості» до різних варіантів розподілу часток між конкурентами. Тому в статистичній практиці останніми роками почали ширше використовуватися інші показники, що характеризують рівень концентрації в цілому для даної сукупності підприємств. Найпопулярніший узагальнюючий показник — коефіцієнт Герфіндаля-Гіршмана (ННІ) [7, с. 28] враховує як чисельність підприємств, так і нерівність їх стану на ринку, а також характеризує рівень монополізації. Значення коефіцієнта знижується із збільшенням числа підприємств і зростає з посиленням нерівності між підприємствами при будь-якій їх кількості. При зведенні в квадрат часток ринку коефіцієнт дає більш високу вагу показників крупних підприємств, ніж малих. Це означає, що якщо точні дані про частки ринку дуже маленьких підприємств відсутні, то підсумкова помилка не буде великою. Коефіцієнт Герфіндаля-Гіршмана обчислюється як сума квадратів часток всіх підприємств, діючих на ринку, і може вимірюватися в частках або відсотках.

Починаючи з 1984 г., цей показник з деякими уточненнями, що стосуються кількості підприємств (50 найкрупніших), частки яких ураховуються у формулі, використовується в практиці антимонопольної діяльності США [2, с. 39]. У виданому посібнику із застосування законодавства про злиття Міністерства юстиції США констатується, що воно схильне дозволити будь-яке злиття на ринках, для яких ННІ становить менше 1000. Навпаки, при ННІ, що перевищує 1800, вірогідна заборона всякого злиття фірм, представлених на ринку. У разі, коли значення індексу знаходиться між 1000 і 1800, необхідні додаткові дослідження. Відповідно до різних значень коефіцієнтів концентрації Герфіндаля-Гіршмана виділяються три типи ринку за ступенем концентрації: високо-, середньо- та низькоконцентровані. Така типологія ринків дозволяє проводити порівняння між країнами та робити міжгалузеві зіставлення, абстрагуючись від методики розрахунку.

Показники ринкової концентрації дозволяють оцінити ступінь монополізації ринку, рівномірність розподілу продавців. Чим більше продавців з рівномасштабною поставкою продукції діє на ринку, тим менші відповідні показники.

Разом з позитивними характеристиками ННІ має істотний недолік — для його розрахунку необхідна повна аналітична база про всіх суб'єктів ринку, що є достатньо проблематичним в умовах дефіциту інформації про показники діяльності суб'єктів ринку.

Дискретним показником концентрації є також Індекс Лінда (L). Він представляє цілу систему індексів концентрації, розрахованих для найкрупніших одиниць, ранжованих за збільшенням [8, с. 140], і дозволяє виявити фірми, що входять в ядро олігополісу. Індекс визначає ступінь нерівності між лідируючи-

ми на ринку постачальниками товарів і використовується як визначник «межі» олігополії. Непорівнюваність значних витрат при розрахунку показника і можливих результатів не стимулює використання коефіцієнта в практичній діяльності. Об'єктивна необхідність такого громіздкого показника нічим не виправдана.

Коефіцієнт Розенблюта (I) і Холла-Тайдмана (НТ) [8, с. 141] розраховується на основі зіставлення рангів підприємств на ринку і їх ринкових часток. Вагами вихідних ознак виступає рангове число одиниць, великі суб'єкти оцінюються для розрахунку з меншою вагою, ніж малі. Тим самим даний коефіцієнт у набагато більшій мірі залежить від малих підприємств, ніж коефіцієнт Герфіндала-Гіршмана. Максимальне значення коефіцієнта рівне 1 (в умовах монополії), мінімальне - $1/n$ (n - число підприємств в галузі). За економічним змістом даний показник схожий з коефіцієнтом ННІ, проте до переваг коефіцієнта Холла-Тайдмана слід віднести можливість обліку співвідношення розмірів підприємств - крупних продавців, що допомагає здійснити більш глибокий аналіз структури товарного ринку. Слід зазначити, що коефіцієнти Розенблюта і Джіні функціонально зв'язані, що дозволяє проводити факторний аналіз динаміки концентрації, виявляти причини зміни її рівня [9, с. 39].

Щодо коефіцієнта ентропії (Е), в економічній літературі пропонуються два варіанти розрахунку. Перший відносний показник є сумою часток продажів підприємств, що діють на ринку, зважених по натуральному логарифму зворотної їй величини [10, с. 45]. При другому варіанті розрахунку використовуються не зворотні величини, а частки значень ознаки, зважені по натуральному логарифму [4, с. 7]. Абсолютні значення коефіцієнта ентропії, отримані при різних методах розрахунку, економічне значення не міняють і дозволяють не тільки аналізувати тенденції, що відбуваються на одному і тому ж товарному ринку за певний період, але і зіставляти різні типи ринків. Зважування часток ознаки за допомогою їх логарифма в показниках ентропії не допускає такого значного впливу великих одиниць, як в коефіцієнті ННІ.

Коефіцієнт ентропії характеризує ступінь деконцентрації ринку і дозволяє більш глибоко досліджувати тільки динаміку концентрації: чим більше Е в порівнюваному тимчасовому періоді, тим більша економічна невизначеність, тим нижчий рівень концентрації продавців на ринку і їх можливість впливати на ринкові ціни. В статичному вимірюванні цей показник не інформативний, оскільки відсутні оцінкові критерії.

Слід зазначити, що в основі розрахунку всіх вищенаведених індексів (ННІ, Е, НТ, I) лежить сума зважених часток кожної з одиниць сукупності, що дозволяє об'єднати ці показники в групу сумарних показників концентрації.

Пропорційність ринку, що представляє в першу чергу співвідношення між різними його елементами, є найважливішою умовою поступального розвитку. Відносні вимірники концентрації, що оцінюють варіабельність суб'єктів ринку, рівномірність розподілу часток і співвідношення розмірів окремих суб'єктів між собою, представляють непрямі, але необхідні показники концентрації.

Слід зазначити, що висока концентрація не тотожна монополізації, оскільки серед суб'єктів висококонцентрованого ринку може бути рівномірний розподіл часток і активна конкурентна боротьба, що демонструє повну відсутність монопольної влади. І, навпаки, чим нерівномірніше розподілені частки між підприємствами, тим помітніша тенденція до зниження конкуренції і зростання монополізації ринку. При аналізі цих коливань і вивченні умов формування

конкурентного середовища важливе місце займає коефіцієнт варіації [11, с. 8; 12, с. 67]. Варіація, а отже, і рівень концентрації вищий при більшому відхиленні від середньої крайніх значень ряду. Даний коефіцієнт можливий для аналізу і зіставлення в часі як для одного товарного ринку, так і протягом одного тимчасового періоду для різних товарних ринків. Чим нижчий коефіцієнт варіації, тим рівномірніший розподіл обсягу виробництва або продажів між підприємствами і нижчий рівень концентрації.

Дисперсія логарифмів ринкових часток характеризує розподіл між підприємствами обсягів продажу, зважених по натуральному логарифму. Дисперсія визначає можливу ринкову владу підприємств через нерівність їх розмірів. Чим більша дисперсія, тим більша нерівномірний і концентрований ринок, тим слабкіша конкуренція і сильніша ринкова влада великих підприємств. Даний показник ідентичний розглянутому раніше коефіцієнту варіації.

Однак дисперсія і коефіцієнт варіації не відображають середніх розмірів підприємств. За низьким коефіцієнтом варіації можуть приховуватися суб'єкти, що мають домінуюче положення або монопольну владу. Тому один з даних показників доцільно застосовувати як допоміжний засіб для оцінки нерівності розмірів фірм при різному рівні концентрації.

Коефіцієнт відносної концентрації (До) характеризує співвідношення числа найбільших підприємств на ринку і контрольованої ними частки реалізації товару. При $K > 1$ концентрація відсутня, ринок є конкурентним. При $K < 1$ на ринку спостерігається високий ступінь концентрації, ринкова влада підприємств велика. Про вплив найбільшого підприємства на ринок можна говорити тоді, коли обсяг його продажів складає принаймні 20% ринку. При $K = 1$ між частками існує лінійна залежність [13, с. 42; 8, с. 150]. Проте вимір концентрації локальних ринків виробництва, нерідко представлених невеликою кількістю суб'єктів (через обмежену статистичну інформацію), може привести до невірних висновків. В той же час даний показник є інформативним при аналізі значної кількості суб'єктів, що формують ринок. Даний коефіцієнт є найбільш «примхливим» до кількості суб'єктів досліджуваної сукупності, найменш інформативним і більш розмитим у порівнянні з іншими показниками у зв'язку з відсутністю уточнених оцінкових критеріїв отриманих результатів.

Найбільш наочно ступінь нерівності компаній на ринку, що представляє відносну концентрацію, можна зобразити графічно за допомогою кривої Лоренца. [7, с. 31]. На осі ординат знаходяться акумульовані значення частки ринку розташовані за збільшенням, а на осі абсцис - відсоток суб'єктів ринку, впорядкований за збільшенням (зменшенням). Криву Лоренца можна використовувати, щоб порівняти розподіл обсягів виробництва (або інших ознак) в різні періоди часу.

Область між кривою, що позначає абсолютну рівність (бісектриса), і кривою Лоренца відображає ступінь нерівності суб'єктів ринку. Чим нижча концентрація, тим сильніше крива Лоренца наближається до діагоналі, і навпаки. Статистичним показником, що кількісно інтерпретує графік Лоренца, є коефіцієнт Джіні [14, с. 278; 9, с. 39]. Геометрично коефіцієнт Джіні – це відношення площі, обмеженої фактичною кривою Лоренца і кривою абсолютної рівності (бісектриса), до площі трикутника, обмеженого кривою Лоренца для абсолютно рівномірного розподілу часток і осями абсцис і ординат. Чим вищий коефіцієнт Джіні, тим більша нерівномірність розподілу ринкових часток між продавцями і, отже, за інших рівних умов, вищий рівень концентрації.

Негативними характеристиками коефіцієнта Джіні є деяка громіздкість розрахунку і дублювання в економічній інтерпретації попередніх, більш простих для обчислення показників. Коефіцієнт Джіні так само, як і інші відносні показники, характеризує рівень нерівномірності розподілу ринкових часток і слабо реагує на зміну числа одиниць сукупності, а при рівномірному розподілі зовсім нечутливий до цієї величини.

Коефіцієнти варіації, дисперсії логарифмів і Джіні досить важливі, як при теоретичних, так і практичних дослідженнях процесів концентрації. Однак у практиці антимонопольних і статистичних органів розрахунки даних показників не передбачені, хоча інформаційно-числовий масив, що використовується для обчислення відносних і абсолютних показників, один і той же, технологія розрахунків не є математично складною, а інформація про стан ринку і процесів, що відбуваються на них, більш насичена.

В умовах зміни основних акцентів антимонопольної політики — спостереження за економічними процесами і явищами на товарних ринках, контроль за поведінкою крупних господарюючих суб'єктів з метою недопущення і обмеження з їх боку антимонопольних дій, підтримка конкурентних ініціатив серед національних товаровиробників, — потрібен комплексний підхід до оцінки конкурентного середовища і аналізу концентрації. Оцінка концентрації повинна в обов'язковому порядку бути доповнена інформацією про ступінь рівномірності розподілу обсягів виробництва або продажу товарів, а також співвідношенням розмірів між господарюючими суб'єктами.

Оскільки лібералізація товарообміну є швидким способом збільшення числа постачальників на місцевий ринок, при оцінці конкуренції визначається також ступінь відкритості ринку для міжнародної і міжрегіональної торгівлі. Імпорт аналогічної продукції істотно підриває ринкові позиції національних підприємств, і навпаки, відносна закритість ринків для міжнародної торгівлі помітно підвищує небезпеку зростання монополізації і обмеження конкуренції.

Для характеристики відкритості ринку може бути використаний показник — «ступінь проникнення імпорту» (СПІ), розрахований як частка внутрішнього попиту, що покривається за рахунок імпорту [15, с. 119]:

$$\text{СПІ} = I / (P + I - E) \times 100\%, \quad (1)$$

де P — обсяг поставки конкретного товару; I — обсяг імпорту конкретного товару; E — обсяг експорту конкретного товару.

Відкритість ринку конкретного товару визначається порівнянням показника СПІ на цьому ринку з середнім показником СПІ (розрахованим для всіх товарів). Ринки, для яких відповідний показник вищий за середній, можна вважати відкритими для імпорту і навпаки.

Слід також зазначити, що на практиці зустрічаються і незаконні методи концентрації, тобто укладаються таємні угоди для узгодження цін, обсягів виробництва та продажу, розділу ринків збуту за територіальною ознакою і т. п. Це свідчить про «приховану» концентрацію, існування якої не враховується при розрахунку показників концентрації. Подібні ситуації характерні для олігопольних ринків, на яких рівень концентрації і так досить великий. Тому неврахування цієї обставини може призвести до неправильних дій антимонопольних органів.

У результаті проведеного аналізу ми прийшли до таких висновків: по-перше, такі показники як коефіцієнти ринкової концентрації (CR) та індекс концентрації Герфіндаля-Гіршмана (ННІ) є базовими для антимонопольної політики

і повинні розраховуватись в обов'язковому порядку, оскільки вони характеризують структуру товарного ринку та встановлюють його належність до високо-, середньо- або низькоконцентрованого ринку; по-друге, для отримання більш насиченої інформації про стан ринку і процесів, що відбуваються на них, слід розраховувати показники варіації; по-третє, для об'єктивної оцінки стану ринку розрахунок і аналіз показників концентрації необхідно проводити в поєднанні з показниками, що визначають ступінь відкритості ринку; по-четверте, для більш точного аналізу концентрованих ринків слід розробити методичний підхід, який би враховував факт неформального групування підприємств або хоча б вказував на можливість існування останнього.

Література

1. *Авдашева С. Б., Балукевич В. В., Горбачев А. В.* Анализ роли интегрированных структур на российских товарных рынках / Бюро экономического анализа — М.: ТЕИС, 2000. — 302 с.
2. *Азоев Г. Л.* Конкуренция: анализ, стратегия и практика. — М.: Центр экономики и маркетинга, 1996. — 208 с.
3. *Задирако И. Н., Седова Е. И., Яковлев А. А.* Задачи и методология исследования товарных рынков в условиях современной российской экономики // Вопросы статистики. — 1999. — № 3. — С. 15–22.
4. *Фойерштатк Р.* Развитие статистики концентрации в производящем секторе // Экономика и статистика. — 1983. — № 5. — С. 5–13.
5. *Горбатов В. М.* Концентрация капитала и производства: понятие и методы оценки // Бизнес-информ. — 2005. — № 1–2. — С. 10–13.
6. *Singer E. M.* The structure of Industrial Concentration Indexes // Antitrust Bulletin. — Vol. 10, January-April. — 1965. — P. 75–104.
7. *Шерер Ф., Росс Д.* Структура отраслевых рынков: Пер. с англ. — М.: Инфа-М, 1997. — 698 с.
8. *Авдашева С., Розанова И.* Подходы к классификации рыночных структур в экономике России // Вопросы экономики. — 1997. — № 6. — С. 138–154.
9. *Яковлев А. А.* Статистическая оценка уровня монополизации производства // Вестник статистики. — 1990. — № 9. — С. 39–45.
10. *Авдашева С. Б., Розанова Н. М.* Теория организации отраслевых рынков: Учебник / Ин-т «Открытое общество». — М.: Магистр, 1998. — 320 с.
11. *Розанова Н. М., Авдашева С. Б.* Применение традиционной методологии анализа рыночных структур к условиям России // Вопросы статистики. — 1997. — № 5. — С. 7–16.
12. *Статистика рынка товаров и услуг: Учебник / И. К. Беляевский, Г. Д. Калугина, А. В. Коротков и др.; Под ред. И. К. Беляевского.* — М.: Финансы и статистика, 1997. — 432 с.
13. *Монополизм и антимонопольная политика / А. В. Барышева, Ю. В. Сухотин, В. Н. Богачев, И. Т. Лашинский.* — М.: Наука, 1993. — 240 с.
14. *Макконнелл К. Р., Брю С. Л.* Экономика: Принципы, проблемы и политика: В 2 т. / Пер. с англ. 11-го изд. — М.: Республика, 1992. — Т. 2. — 400 с.
15. *Албегова И. М., Емцов Р. Г., Холопов А. В.* Государственная экономическая политика: опыт перехода к рынку. — М.: Дело и сервис, 1998. — 319 с.

В. В. Филиппович

Одесский национальный университет имени И. И. Мечникова
Кафедра экономической теории и истории экономической мысли.

**УРОВЕНЬ РЫНОЧНОЙ КОНЦЕНТРАЦИИ КАК БАЗА ДЛЯ
АНТИМОНОПОЛЬНОЙ ПОЛИТИКИ**

Резюме

Коэффициенты рыночной концентрации (CR) и индекс концентрации Герфиндаля-Гиршмана (HHI) являются базовыми для антимонопольной политики и должны рассчитываться в обязательном порядке, поскольку они характеризуют структуру товарного рынка и устанавливают его принадлежность к высоко-, средне- или низкоконтро- ванному состоянию. Для получения более насыщенной информации о состоянии рынка следует рассчитывать показатели, характеризующие вариацию и степень открытости рынка. Также необходимо разработать методический подход, позволяющий выявлять факт возможности неформального группирования предприятий.

Ключевые слова: конкуренция, концентрация, уровень концентрации, рыночная структура, антимонопольная политика.

V. V. Filippovich

Odessa National University of I. I. Mechnikov

**LEVEL OF MARKET CONCENTRATION AS A BASE FOR AN ANTIMONOPOLY
POLICY**

Summary

The coefficients of market concentration (CR) and the Herfindalya-Hirshmana (HHI) index are base for an antimonopoly policy and must settle accounts without fail, as they characterize a structure and commodity market condition. For the receipt of more saturated state information the market it is necessary to expect indexes which characterize variation and degree of market openness. Also it is necessary to develop methodical approach which will allow to expose the fact of the informal grouping of enterprises.

Key words: competition, concentration, level of concentration, market structure, antimonopoly policy.