



ЗАЛЕЖНІСТЬ МІЖНАРОДНОГО ТУРИЗМУ ВІД ВАЛЮТНИХ КОЛИВАНЬ

О. В. Коробкіна

*Донецький національний технічний університет
вул. Університетська, 24, 83000, г.Донецьк, Україна.*

Отримана 5 січня 2008, прийнята 15 лютого 2008

Анотація. Одним з провідних напрямків у міжнародних економічних відносинах є міжнародний туризм. В дохідній частині бюджету багатьох країн туризм займає основне положення. У даній статті розглянуті динаміка і тенденції розвитку міжнародного туризму за період 2000-2005 р. Автором проаналізована динаміка коливань курсу долара США до євро за аналогічний період. Проведено аналіз залежності міжнародних туристичних надходжень від змін валютних курсів. Крім цього, виявлені наслідки впливу коливань курсів двох світових валют, долара США і євро, на інтенсивність торгівлі туристичними послугами (зроблено прогнози щодо змін у структурі платіжного балансу і потоків туристів між країнами, що використовують євро і долари).

Ключеві слова: міжнародний туризм, валютний курс, долар США, євро, торгівля послугами, кореляційно-регресійний аналіз.

ЗАВИСИМОСТЬ МЕЖДУНАРОДНОГО ТУРИЗМА ОТ ВАЛЮТНЫХ КОЛЕБАНИЙ

Е. В. Коробкина

*Донецкий национальный технический университет
ул. Университетская, 24, 83000, г.Донецк Украина.*

Получена 5 января 2008, принята 15 февраля 2008

Аннотация. Одним из ведущих направлений в международных экономических отношениях является международный туризм. В доходной части бюджета многих стран туризм занимает основное положение. В данной статье рассмотрены динамика и тенденции развития международного туризма за период 2000-2005 гг. Проанализирована динамика колебаний курса доллара США к евро за аналогичный период. Проведен анализ зависимости международных туристических поступлений от изменений валютных курсов. Кроме этого, выявлены последствия влияния колебаний курсов двух мировых валют, доллара США и евро, на интенсивность торговли туристическими услугами (сделаны прогнозы относительно изменений в структуре платежного баланса и потоков туристов между странами, использующими евро и доллары).

Ключевые слова: международный туризм, валютный курс, доллар США, евро, торговля услугами, корреляционно-регрессионный анализ.

INTERNATIONAL TOURISM DEPENDENCE ON CURRENCY FLUCTUATIONS

O. V. Korobkina

Donetsk National Technical University

24, Universitets'ka Str., Donetsk 83000, Ukraine.

Received 5 January 2008, accepted 15 February 2008

Abstract. One of the leading directions in the international economic relations is international tourism. In a profitable part of the budget of many countries tourism takes the main position. There is considered dynamics and tendencies of the international tourism development for the period 2000-2005. The author analyses dynamics of the US dollar exchange rate fluctuations as to Euro for the same period. Dependences of the international tourist receipt of funds on exchange rate changes were analyzed. Besides, there was found out how rate fluctuations of two world currencies, the US dollar and Euro, influence the intensity tourist services trading (forecasts concerning changes in structure of the balance of payments and flows of tourists among the countries which use Euro and dollars were made).

Key words: international tourism, exchange rate, US dollar, Euro, service trading, correlation and regression analysis.

Введение

Все более заметную роль в современной мировой экономике играет туризм. Десятая часть мирового валового продукта принадлежит туризму. Во многих странах и регионах туризм является основным источником дохода населения. По данным Всемирной туристической организации число приездов иностранных туристов за пятьдесят пять лет возросло в 32,24 раза и ежегодно увеличивается в среднем на 6,5%. Особенно значителен рост количества туристов был в странах Азии и Океании (в среднем 13% в год) и Среднего Востока (10%). Немного ниже среднего мирового роста приток туристов был в Америку (5%) и Европу (6%) [1]. Значительное влияние на деятельность туристической сферы оказывает валютный курс. Поскольку туристическая индустрия не может корректировать сам валютный курс, то ей приходится приспосабливаться к валютным конъюнктурным колебаниям. Следовательно, изучение влияния валютных колебаний на международный туризм является сегодня актуальным.

Анализ последних исследований и публикаций

Колебания валютных курсов оставляют некую неуверенность в мировой экономической сфере и они могут сильно воздействовать на прогнозы по получению дохода от туризма [2].

Поэтому интерес к проблеме влияния курса валют на туристическую индустрию растет из года в год. Проблемы зависимости интенсивности развития международного туризма от валютных конъюнктурных колебаний рассматриваются прежде всего в публикациях Всемирной туристической организации [1, 2 – 5, 10]. М.А.Сторчевский исследует влияние валютного курса на экспорт и импорт услуг[9]. Г. Милекянц в своей работе уделяет внимание значению евро для мировой экономики[6]. Б.Киселевский и Ю. Шиховой изучают последствия роста обменного курса доллара к евро для мировой экономики[7]. М. Арбит рассматривает влияние валютных колебаний для торговли товарами и услугами[11]. Однако проблема влияния валютных конъюнктурных колебаний на интенсивность мировой торговли услугами, а именно туристическими, исследована недостаточно.

Постановка цели

Целью данной публикации является изучение влияния изменений курсов валют на интенсивность туристического бизнеса индустрии.

Основной материал

Для достижения поставленной цели проанализируем взаимосвязь таких экономических

показателей как международные туристические поступления [3, с.16] и валютный курс доллара США относительно евро по данным Европейского Центрального банка [4] за период 2000-2005гг.

Международные туристические поступления представляют собой доходы принимающих стран от международного туризма, которые учитываются по статье экспорта этих стран и включают выплаты, произведенные приезжими, остановившимися как на один день, так и на несколько дней. Как экспортная статья они составляют приблизительно 6% от совокупной стоимости международного экспорта товаров

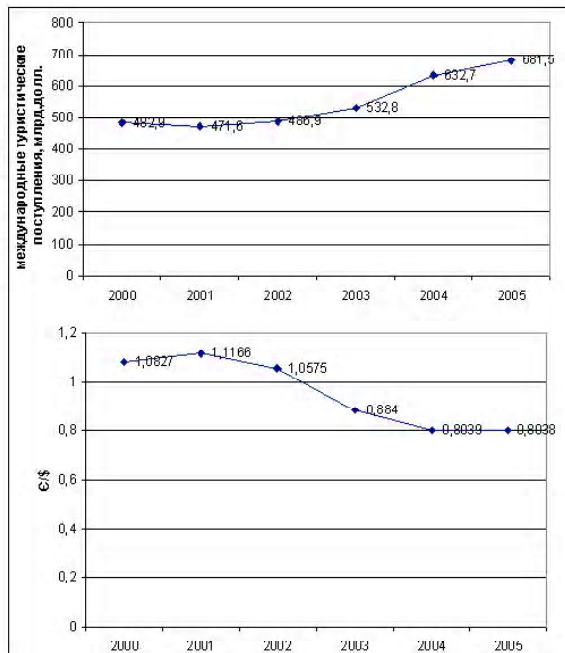


Рис. 1. Динамика международных туристических поступлений, млрд. долл. США и динамика колебаний валютного курса евро, \$/€.

и услуг и занимают четвертое место после таких товаров, как топливо, химия и автомобили. Для многих же принимающих стран, в частности для развивающихся странах и островных государств, туризм остается самой крупной статьей дохода от экспорта [5, с. 3].

Евро и доллар США являются мировыми валютами, и их паритет играет значительную роль для всей мировой экономики. Это объясняется тем, что большинство расчетов, котировок

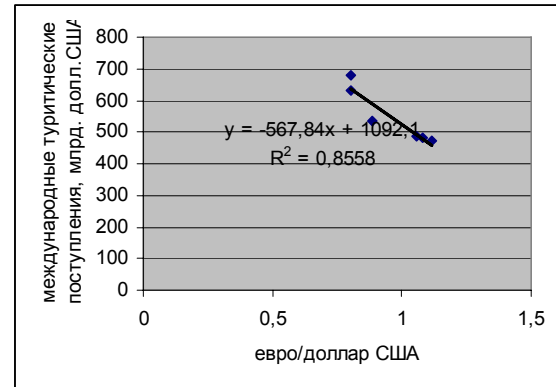


Рис. 2. Построение регрессии.

на всех биржах, а также банковские операции осуществляются в долларах и евро. Половина мировой торговли осуществляется в долларах, а в евро – 35 %. Кроме того, ни одна денежная единица не может сегодня противостоять доллару в качестве основной резервной валюты [6]. Доля евро в мировых запасах составляет около 15%. Ныне пара EUR/USD самая торгуемая в мире. На нее приходится до 30% мирового оборота валютного рынка [7, с. 23].

На рис. 1 представлены динамика международных туристических поступлений и динамика валютного курса доллара США относительно евро.

Как видно из Рис. 1, динамики двух показателей обратно пропорциональны. За период 2000-2001гг. наблюдалось снижение поступлений с 482,9 до 471,6 миллиардов долларов США, в то время как курс доллара поднялся с 1,0827 до 1,1166 евро за доллар. С 2001 года наблюдается падение курса доллара США, что приводит к увеличению международных туристических поступлений.

Для более детального изучения проблемы влияния валютных колебаний на поступления от туризма используем корреляционно-регрессионный анализ, который поможет определить форму связи, а также степень тесноты и существенности связи [8, 108-122]. Для анализа выбирается функциональный вид регрессии (Рис. 2).

Согласно построенному графику данная регрессия имеет вид линейной функции:

$$y = -567,84x + 1092,1, \quad (1)$$

где x , y рассматриваются как валютный курс доллара США и международных туристических поступлений соответственно.

Данное уравнение показывает, что показатели имеют обратно пропорциональную зависимость. Анализ параметра a ($-567,84 < 0$) показывает, что при понижении курса доллара на 1 пункт (например, с 0,8038 евро за 1 доллар до 0,8037 евро за 1 доллар) международные туристические поступления увеличиваются на 56,784 миллионов долларов США. Тесная связь в линейных моделях может быть измерена с помощью коэффициента корреляции (R).

Если

$$0 < R \leq 0,3,$$

то связь между признаками слабая,

$$0,3 < R \leq 0,6,$$

то связь средняя,

$$R > 0,6,$$

то связь сильная.

Проделив необходимые расчеты, получаем R равным 0,9251. Таким образом, наблюдается сильная связь между параметрами. Однако сама по себе величина коэффициента корреляции даже близкая к единице не является доказательством причинно-следственной связи между признаками. Она характеризует только меру корреляции между ними.

В завершении анализа проводится проверка истинности связи с помощью F -критерия (критерия Фишера):

$$F = \frac{r^2}{1-r^2} \times \frac{k_2}{k_1}, \quad (2)$$

где k_1, k_2 , – число степеней свободы дисперсий.

k_1 рассчитывается по формуле:

$$k_1 = m - 1, \quad (3)$$

где m для линейной функции равно 2.

k_2 рассчитывается по формуле:

$$k_2 = n - m, \quad (4)$$

где n равно количеству, в данном случае $n=6$.

Рассчитаем значение критерия Фишера:

$$F = \frac{0,8558}{1-0,8558} \times \frac{6-2}{2-1} = 23,7392$$

Фактическое значение критерия Фишера сравниваем с критическим. Если $F > F_{\text{крит}}$, то связь

между признаками существенна, F , то связь несущественна. $F_{\text{крит}}$ является табличным значением [9, с. 328] и в данном случае равно 7.71, что меньше фактического значения.

Таким образом, связь между показателями существенна, т. е. курс доллара США оказывает значительное влияние на рост международных поступлений от туризма. При девальвации доллара США увеличиваются международные поступления от туризма, а при ревальвации, наоборот, происходит снижение поступлений.

Изменения курса валюты влияет на уровень ценовой конкуренции стран. Экспорт данной страны станет более дешевым при снижении курса национальной валюты, а ее импорт – более дорогим. Высокий уровень цен на предоставляемые услуги внутри страны и низкий уровень цен за ее пределами обычно означает высокие цены на иностранную валюту. Чем сильнее желание пользоваться заграничными услугами, тем большую цену приходится предлагать за иностранную валюту [10].

Для туристической индустрии «сильная» валюта делает свою страну менее привлекательной, в то время как стимулируются турпоездки в страны со «слабой» валютой. За последнее время курс евро значительно поднялся. Европейские страны, находящиеся вне зоны евро, такие как Великобритания, Швейцария, Норвегия, некоторые страны Центральной и Восточной Европы, стали менее дорогими, тогда как страны еврозоны подняли цены для приезжих из тех стран. А страны, использующие доллар, напротив, являются сейчас привлекательными для туристов [11, с. 19].

Изменение в курсах валют влияет на уровень экономического роста, который, в свою очередь, влияет на торговый баланс страны. Падение курса местной валюты может привести к более высокому уровню экономического роста из-за увеличения объема экспорта страны. Поскольку экономический рост приведет к росту доходов, это, в свою очередь, вызовет рост совокупного спроса. В результате, также может повыситься спрос на импорт услуг из-за границы. Таким образом, в долгосрочной перспективе, торговые партнеры стран с удешевляющимся курсом валюты тоже могут быть в выигрыше. Тем не менее, так как первоначально за удешевлением валюты следует резкое сокращение

импорта, в более краткосрочной перспективе торговые партнеры несут значительные потери.

Дальнейшее падение курса доллара относительно евро приведет к тому, что европейцы, воодушевленные покупательной способностью евро и низким долларом значительно чаще будут посещать Соединенные Штаты и страны, чьи валюты связаны с долларом, в качестве туристов. В свою очередь, американцы и жители стран вне еврозоны перейдут от дорогих европейских услуг к сотрудничеству с местными компаниями, оказывающими более дешевые услуги [12].

Выводы

Таким образом, изменения курса валют влияют на интенсивность развития туристической индустрии. В странах, где местная валюта связана с курсом американского доллара, удешевление доллара также приведет к удешевлению местной валюты. Изменения курса валюты влияет на уровень ценовой конкуренции стран, а также на темпы роста национального дохода. В странах, чьи валюты привязаны к курсу доллара США, падение доллара может простимулировать экспорт и уменьшить импорт, улучшив общую ситуацию с торговым балансом.

Литература

1. World Tourism Organisation. Historical perspective of world tourism/ www.unwto.org/facts/eng/historical.htm.
2. World Tourism Organisation. **Another Record Year For World Tourism**/ www.unwto.org/newsroom/Releases/2007/january/recordyear.htm.
3. UNWTO World Tourism Barometer. Volume 4, No.2, June 2006. – p. 16/ www.world-tourism.org.
4. European Central Bank. Exchange rates./ sdw.ecb.int/home.do?currentNodeId=CLEAN><5.04.2007>
5. World Tourism Organisation. Основные показатели развития туризма. 2006. – с. 12 www.unwto.org.
6. Г. Милекянц. Пишем доллар, подразумеваем евро// “Российская газета” (Федеральный выпуск). – № 4035 от 5 апреля 2006 г
7. Б. Киселевский, Ю. Шихов. Региональная мировая валюта // Валютный спекулянт. - № 8, 2004. – с. 56
8. Герасименко С. С. Статистика: Підручник – К.: КНЕУ, 1998. – 468 с.
9. Ефимова М.Р., Ганченко О.И., Петрова Е.В. Практикум по общей теории статистики/ Учебное пособие – М.: Финансы и статистика, 2003. – 336 с.
10. Сторчевой М. А. Основы экономики: Учебник / Под ред. П. А.Ватника. – СПб.: Экономическая школа, 1999. – 429 с.
11. UNWTO World Tourism Barometer. Exchange rates. UNWTO World Tourism Barometer. Volume 1, No.2, October 2003. – p. 20/ www.world-tourism.org.
12. М. Арбит. Доллар – символ мировой экономики //WeekSurvey. – №13, 2007./www.weeksurvey.com/content/view/634/248.

Коробкіна Олена Валеріївна – магістр з міжнародних економічних відносин Донецького національного університету. Наукові інтереси: міжнародні економічні відносини.

Коробкина Елена Валериевна – магистр международных отношений Донецкого национального университета. Научные интересы: международные экономические отношения.

Korobkina Olena Valerieyina – a holder of a master’s degree in international relations of Donetsk National University. Scientific interests: international economic relations.