

LA POLARIZZAZIONE DEGLI SCAMBI INTERNAZIONALI E I RAPPORTI TRA CEE, EFTA ED EUROPA ORIENTALE (*)

1. Introduzione

Il Capitolo 1 del Rapporto analizza, anche quest'anno, l'orientamento degli scambi internazionali e, in questo contesto, ripresenta e aggiorna alcuni calcoli e considerazioni sul fenomeno della polarizzazione del commercio internazionale per grandi aree comprensive dei principali paesi industrializzati, utilizzando a questo scopo anche un indice apposito che ne misura il grado di "introversione".

Nel nostro contributo monografico vogliamo invece riproporre una analisi simile e complementare alle precedenti, con lo scopo di estendere la prospettiva ad un passato in cui i fenomeni di polarizzazione dovrebbero essersi verificati in modo assai più sicuro e rilevante, a seguito della formazione di mercati comuni ed aree di libero scambio (la CEE e l'EFTA); ma con lo scopo anche di utilizzare tale prospettiva per guardare in avanti e inferire cosa potrebbe risultare, soprattutto per la CEE, dall'eventuale ed almeno in parte probabile suo allargamento verso i paesi dell'EFTA e dell'Europa Orientale.

Si era notato, nei precedenti Rapporti, come risultasse effettivamente dai dati una lieve tendenza ad una maggiore integrazione interna per l'area della CEE, ma non per le altre principali aree dei paesi industrializzati. Si era inoltre accennato a come gli sviluppi dell'Europa Orientale, ed in particolare l'unificazione tedesca, ma anche il notevole riorientamento degli altri paesi — Polonia, Cecoslovacchia, Ungheria in testa — verso i paesi non-COMECON, potessero modificare tali processi di polarizzazione. Inoltre, e su ciò non ci si è soffermati nei precedenti Rapporti, è ormai chiaro che i paesi dell'EFTA, individualmente, ma forse anche in gruppo, si presentano alle porte della CEE per aderirvi o per rafforzare i legami di associazione con essa. E ancora: i negoziati GATT attualmente in corso (Uruguay round) non mancheranno di alterare anche in modo geografico la distribuzione del commercio internazionale, e diversamente a seconda se dovessero terminare in modo liberista e multilaterale, o sostanzialmente chiudersi con un fallimento, che potrebbe accentuare allora la polarizzazione degli scambi internazionali. Ma dei negoziati GATT in particolare, e delle loro implicazioni, si riferisce più in dettaglio in altra parte di questo Rapporto.

Vogliamo quindi nel nostro contributo esaminare più particolarmente e da tali punti di vista l'esperienza passata della CEE e gli insegnamenti che essa ci potrebbe fornire per tentare una valutazione delle possibili implicazioni del suo allargamento in direzione dell'EFTA e dell'Europa Orientale. In realtà, oltre a queste due aree che premono alle porte della CEE, ve n'è un'altra, che preme anche con maggiore urgenza e non solo con richieste di maggiori scambi di prodotti, ma soprattutto con spinte demografiche che si trasformano in immigrazione più o meno legale; in ciò accomunandosi, anche se per diversi motivi, all'area dell'Europa Orientale: si tratta naturalmente dei paesi del bacino del Mediterraneo, del Medio Oriente e di talune parti dell'Africa.

La valutazione, oltre che la misurazione, del grado di sviluppo del commercio della CEE al suo interno piuttosto che al suo esterno, e delle possibilità di ulteriormente perseguire o meno questa strada anche con allargamento dei confini dell'Unione Economica Europea, comportano delicati problemi che vanno ben oltre lo scopo di questo Rapporto; ma che non possono comunque essere neppure in esso ignorati, se non altro per il semplice motivo che movimenti di prodotti e movimenti di persone sono per lo più sostituiti gli uni degli altri.

2. La polarizzazione del commercio CEE nel periodo 1960-1989

Nel riconsiderare il fenomeno della polarizzazione o meno degli scambi, attorno alla CEE in particolare, abbiamo ritenuto opportuno risalire indietro negli anni in modo da ricoprire il periodo della prima integrazione della CEE a sei paesi, il suo successivo allargamento a nove paesi e poi a dieci e dodici. Come si ricorderà, ciò è avvenuto per tappe appunto, coinvolgendo dapprima (dal 1957) la Francia, la Germania Occidentale, l'Italia, il Benelux; successivamente (dal 1973) anche il Regno Unito, l'Irlanda e la Danimarca (che si scorporarono così dall'EFTA); poi (dal 1981) la Grecia; e infine (dal 1986) anche la Spagna e il Portogallo. Da ultimo, in realtà, abbiamo avuto, nell'ottobre del 1990, l'ingresso implicito della Germania Orientale nella CEE attraverso la sua unione nella nuova Germania. Purtroppo i dati sui quali abbiamo potuto lavorare cominciano solo dal 1960 e

(*) di Giorgio Basevi e Giorgio Poli

arrivano al 1989. Su di essi abbiamo ricalcolato diverse forme di indici, tutte riconducibili all'indice di "introversione" già usato nel Rapporto e la cui formula si trova alla pagina 23 del Rapporto ICE 1989.

Naturalmente, come tutti gli indici, anche questo ha diversi difetti. Anzitutto esso non varia potenzialmente fra zero e uno, bensì fra zero e un numero massimo (variabile) determinato dal rapporto dell'interscambio mondiale rispetto all'interscambio dei paesi dell'area considerata. Questo valore massimo si avrebbe nel caso limite in cui un'area commerciasse solo all'interno di se stessa (completa introversione). Un modo per correggere tale difetto potrebbe essere quello di riponderare l'indice per riportarlo a variare fra zero ed uno, ma ciò equivarrebbe ad eliminare il denominatore dell'indice stesso; in questo modo l'indice di introversione si ridurrebbe al peso dell'interscambio all'interno dell'area rispetto al totale dello scambio dell'area. Quest'ultimo indicatore però può fornire un segnale distorto se, ad esempio, la domanda interna dell'area considerata (e quindi anche l'interscambio entro l'area) ha una dinamica significativamente diversa rispetto al resto del mondo (1). Faremo ricorso a questo stratagemma alla fine delle nostre rielaborazioni.

Un secondo difetto di questo indice, anch'esso già richiamato nel precedente Rapporto, è che essendo i dati in valori a prezzi correnti, essi risentono delle variazioni dei cambi, che potrebbero influenzare sistematicamente gli andamenti degli indici, falsandone l'interpretazione, nei periodi di più rilevante e perdurante modifica dei cambi stessi fra le principali monete. Cercheremo di analizzare questo aspetto in quanto segue.

Un terzo difetto, o forse una interessante caratteristica, dell'indice di introversione è che esso può subire brusche variazioni quando l'area di paesi cui è riferito altera la propria composizione, ad esempio a seguito di entrate di nuovi paesi; questo caso è particolarmente importante nella storia della CEE, e macroscopicamente evidente se si risale con l'indice agli anni in cui entrarono Gran Bretagna, Irlanda e Danimarca. In particolare, in tali casi, l'indice cala se i paesi entranti commerciavano relativamente poco con l'area al momento dell'ingresso. Collegato a questa caratteristica, vi è un quarto problema nel calcolo dell'indice: quando esso sia riferito ad un'area che cambi di composizione, lo si può calcolare o con riferimento al totale dell'area quale si configura alla fine del periodo (12 paesi nel caso CEE), o all'inizio (6 paesi nel caso CEE), oppure ad un'area a composizione "mobile".

La Fig. 1 mostra l'evoluzione dell'indice di introversione della CEE (a composizione mobile) dal 1960 al 1989. Si noterà come esso cresce quasi regolarmente fino al 1972 e cade precipitosamente a seguito dell'ingresso di Regno Unito, Danimarca e Irlanda nel 1973. L'indice prende poi a crescere nuovamente, ma con oscillazioni e cadute, sulle quali è opportuno soffermarsi. In particolare si osserva una caduta fra il 1976 e il 1979.

Si nota dalla Fig. 2 che tale caduta è accompagnata dal deprezzamento del dollaro rispetto al marco (per altro iniziato già dal 1970). Mentre questo deprezzamento di per sé tende a sopravvalutare il valore del commercio intra-CEE rispetto a quello extra-CEE, nella misura in cui il primo è relativamente più denominato in marchi ed il secondo in dollari, esso tende anche a rendere più competitivo il commercio con l'esterno della CEE che non quello con l'interno. I due effetti dovrebbero giocare nel senso opposto quando successivamente, dal 1979-80 al 1985, il dollaro si apprezza rispetto al marco, e di nuovo nel senso precedente dal 1988-89. Dalla Fig. 2 sembrerebbe che l'effetto "quantità" (effetto di sostituzione competitiva) prevalga sull'effetto "valori" (effetto derivante dalla diversa denominazione del commercio in monete legate al dollaro o al marco). Infatti la correlazione dell'indice di introversione CEE nel periodo 1973-1989 appare chiaramente positiva rispetto al cambio marco/dollaro.

3. Metodologia delle estrapolazioni per il periodo 1990-2000

Come già accennato, il nostro breve studio dell'evoluzione dell'indice di introversione della CEE durante il periodo di storia recente, che ha coinciso con le successive tappe del suo allargamento, è funzionale allo scopo di estrapolare, in modo relativamente grezzo, un possibile sviluppo del commercio della CEE a seguito di suoi ulteriori allargamenti verso i paesi dell'EFTA e dell'Europa Orientale. Per altri paesi sopra accennati non ci sarà possibile fare nulla per mancanza di dati affidabili. In realtà, anche per i dati dell'Europa Orientale la cautela è estremamente necessaria. I nostri calcoli andranno quindi valutati come indicazioni di tendenza, più che quali risultati di analisi econometriche soddisfacenti.

Nostro scopo è quindi di misurare quale evoluzione avrebbe l'indice di introversione della CEE se questa si allargasse ai nuovi paesi sopra considerati, secondo una successione temporale che commenteremo successivamente. Per far ciò passiamo attraverso la costruzione preliminare di indici di "orientamento" verso la CEE, per ogni singolo paese considerato nella nostra analisi. Tali indici sono il rapporto dell'interscambio del paese considerato verso la CEE rispetto all'interscambio totale del paese stesso.

Da un esame approssimato di questi indici, abbiamo riscontrato dei punti di rottura in corrispondenza delle adesioni di nuovi paesi alla CEE successivamente alla sua creazione. Questi punti di rottura sembrerebbero essere caratterizzati da due fenomeni: da un lato l'indice sembra subire una modifica di livello, dall'altro esso sembra alterare il proprio andamento temporale. La variazione del livello può essere spiegata dalla semplice adesione alla CEE di un paese o gruppo di paesi, a seguito della quale aumenta il numeratore dell'indice di una quantità data dall'interscambio del paese in esame con il paese o i paesi nuovi aderenti alla CEE (2). La variazione nell'andamento temporale è imputabile invece alla modifica del comportamento del paese considerato; tale modifica viene applicata ad un paese aderente all'area CEE o ad un'altra area quando da quest'ultima alcuni paesi si staccano per passare alla CEE (il che è avvenuto e potrebbe ancora avvenire per l'EFTA).

Abbiamo quindi tentato di catturare il comportamento dei vari paesi mediante l'interpolazione del loro indice di orientamento con un semplice trend lineare, ma discontinuo. Abbiamo cioè spezzato il campione di stima 1960-89 in corrispondenza delle adesioni alla CEE successive al 1957, e ciò limitatamente ai paesi già aderenti alla CEE, ai nuovi paesi aderenti, e ai paesi appartenenti all'area di provenienza dei paesi di nuova adesione. Per i paesi che hanno aderito alla CEE successivamente alla sua creazione abbiamo calcolato la differenza dei coefficienti angolari dei trend stimati dopo l'adesione, rispetto al periodo precedente l'adesione stessa. Abbiamo quindi calcolato la media di queste differenze, che è risultata essere poco al di sotto dell'unità (0,97).

Sulla base delle stime così effettuate abbiamo proceduto alla estrapolazione degli indici di orientamento per ogni singolo paese fino al 2000, aumentando sia il coefficiente angolare del trend (di 0,97) sia l'intercetta (il livello dell'indice) (3) per i paesi di nuova adesione alla CEE.

Occorre a questo punto passare dagli indici di orientamento dei vari paesi, all'indice di introversione della CEE; passaggio possibile o assegnando dei valori previsivi agli interscambi totali dei singoli paesi, o ipotizzando che l'interscambio totale di ogni paese considerato rispetto all'interscambio mondiale sia costante negli anni della previsione, e in particolare sia uguale all'ultimo anno osservato. In questa sede abbiamo optato per il secondo metodo, che ci consente quindi di ottenere l'indice di introversione della CEE mediante una semplice combinazione lineare degli indici di orientamento dei paesi componenti.

4. Risultati dell'extrapolazione

L'esercizio che abbiamo svolto considera l'adesione di nuovi paesi alla CEE nel prossimo decennio: come già ricordato, dall'ottobre 1990 la ex-Germania Democratica appartiene alla CEE. Abbiamo poi immaginato che nel 1993 anche i paesi EFTA possano entrare nella CEE o che comunque si integrino completamente con essa dal punto di vista commerciale. Nel 1995 si suppone poi che entreranno i tre paesi dell'Europa Orientale maggiormente legati all'Occidente, ovvero Polonia, Cecoslovacchia e Ungheria; infine nel 1998 verrà completata l'integrazione con la penisola balcanica, mediante l'ingresso nella CEE, o in un'area commerciale di libero scambio ad essa associata, di Romania, Bulgaria, Turchia, Jugoslavia e Albania.

La Fig. 3 riporta l'indice di introversione della CEE (considerata come area a composizione "mobile") estrapolato fino al 2000 mediante la metodologia sopra descritta. Osserviamo che, come già nel 1973 in occasione dell'entrata di Regno Unito, Danimarca e Irlanda, anche nel 1993 l'indice subisce un forte calo in occasione dell'ipotizzato ingresso dell'EFTA. Minori risultano gli effetti degli ingressi degli altri gruppi di paesi nel 1995 e 1998.

Una lettura affrettata della Fig. 3 potrebbe far pensare che l'adesione di nuovi paesi alla CEE ne ridurrebbe il grado di integrazione o introversione. Ciò deriva, come già abbiamo ricordato, dal fatto che l'indice è relativizzato alla quota dell'interscambio mondiale rispetto all'interscambio totale della CEE. Se invece eliminiamo tale riferimento riponderando l'indice rispetto al suo massimo, abbiamo quanto appare nella Fig. 4, in cui il campo di variazione dell'indice è ora fra zero ed uno (4). Negli anni della "previsione" l'incidenza del commercio intra-area sul totale degli scambi dell'area aumenta dapprima lentamente poi in modo più sostenuto, passando da 0,59 nel 1989 a 0,67 nel 2000.

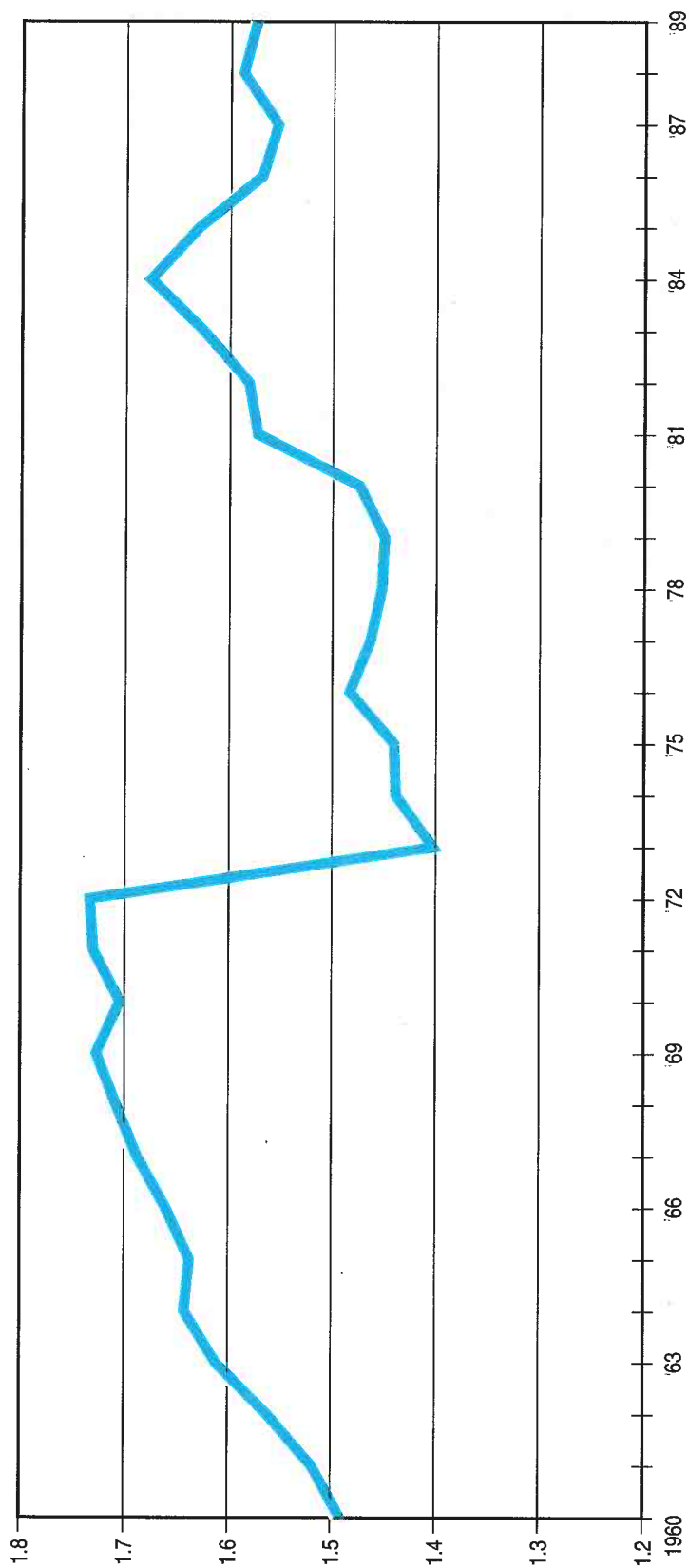
Tale risultato potrebbe essere interpretato in modo relativamente negativo per gli sviluppi del commercio della CEE con il resto del mondo. In realtà occorre sottolineare che l'aumento di "introversione" della CEE non è necessariamente il risultato di una maggiore discriminazione nei confronti del resto del mondo di quanto non risulti semplicemente dall'adesione di nuovi paesi ad un mercato comune (quale è appunto la CEE); in altre parole, non dipende da alcuna ipotesi sull'aumento del carattere più o meno protezionistico della tariffa doganale comune della CEE e delle altre forme di sua protezione doganale nel periodo 1990-2000. Infatti sulle politiche commerciali non abbiamo fatto alcuna ipotesi, che non sia quella implicita dell'adesione dei paesi considerati alla CEE stessa.

Qualora invece volessimo effettivamente valutare se la nuova CEE sarà più o meno discriminante nei confronti del resto del mondo, dovremmo allargare il discorso a quello relativo ai negoziati

GATT attualmente in corso, e valutare come essi potrebbero concludersi. Inoltre potremmo anche cercare di valutare come la nuova CEE si collocherà nei confronti delle politiche commerciali con il resto del mondo, se cioè sarà più o meno protezionistica della vecchia CEE. Naturalmente per far ciò occorre inserire opportune ipotesi di nuovi comportamenti all'interno di modelli econometrici di effettiva previsione. Ciò non è possibile fare nei limiti di questo contributo. Rinviamo per altro alle sezioni di questo Rapporto che trattano più specificatamente del GATT, riservandoci di sviluppare eventualmente il tema nel Rapporto del prossimo anno, quando i negoziati GATT in corso dovrebbero finalmente essersi conclusi, e quando anche le prospettive di allargamento della CEE dovrebbero ulteriormente essersi chiarificate.

- (1) Ed è appunto per correggere tali eventuali distorsioni dovute alle diverse dinamiche degli scambi delle aree componenti il mondo che l'indice normalmente usato nel Rapporto ICE (indice di introversione) ripondera l'indicatore del commercio intra-area sul totale degli scambi dell'area con l'incidenza degli scambi dell'area rispetto al commercio internazionale.
- (2) Ciò è vero se si suppone che l'interscambio del paese in esame con l'area commerciale nella sua composizione precedente la nuova adesione, rispetto all'interscambio totale, non subisca forti variazioni (e nel caso specifico non diminuisca in modo rilevante) in seguito all'entrata nell'area commerciale di un paese o gruppo di paesi.
- (3) L'intercetta del trend viene aumentata, nell'anno di ingresso del paese entrante nella CEE, di una quantità pari al rapporto dato dall'interscambio del paese entrante con il gruppo degli altri paesi che assieme ad esso entrano a far parte della CEE, rispetto al totale dell'interscambio del paese entrante.
- (4) Nel periodo della "previsione" è corretto utilizzare l'indice che misura la quota del commercio intra-area sul totale degli scambi dell'area (si veda la Nota 1) in quanto abbiamo ipotizzato che l'interscambio totale di ogni paese considerato rispetto all'interscambio mondiale sia costante (limitatamente agli anni della previsione) ovvero che gli scambi di tutti i paesi abbiano lo stesso profilo dinamico.

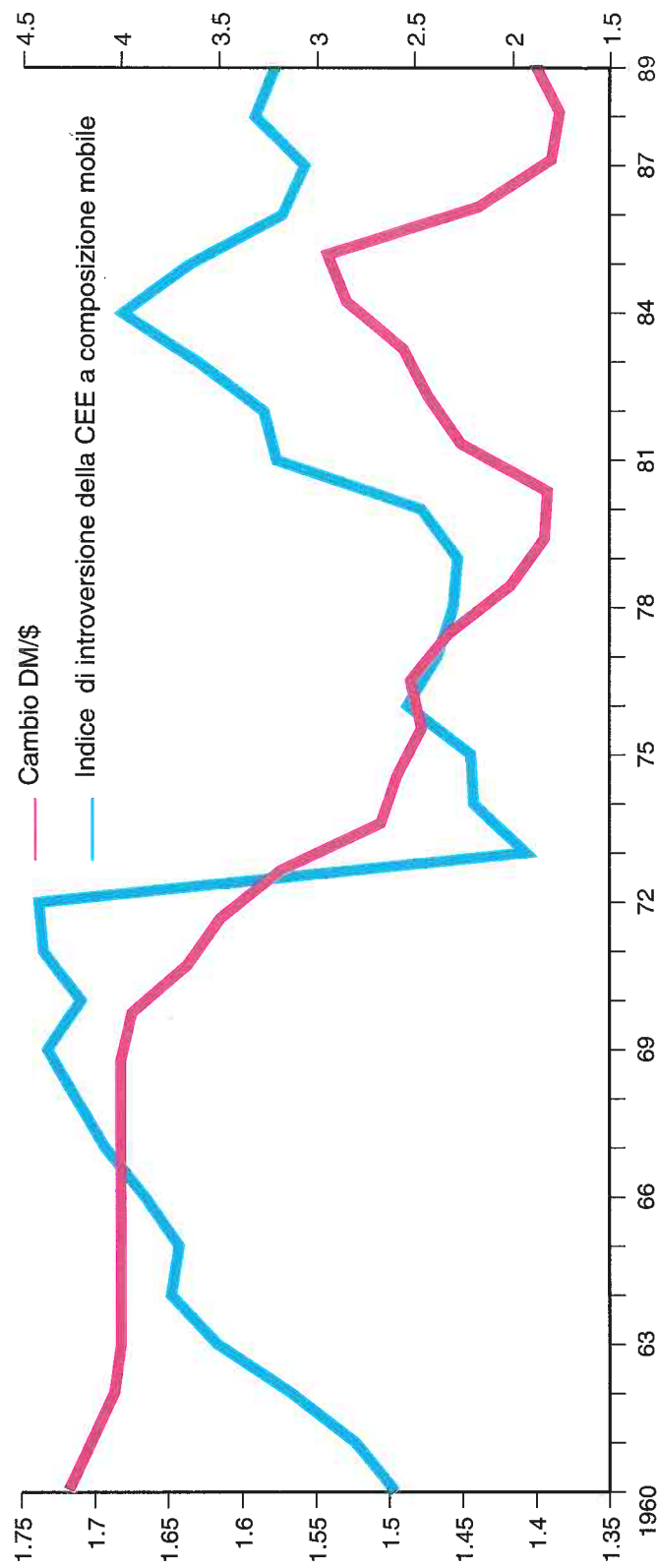
**INDICE DI INTROVERSIONE DELLA CEE
(A COMPOSIZIONE MOBILE)**



Fonte: elaborazione Prometeia da dati OCSE Serie A e FMI-DOT

Figura 1

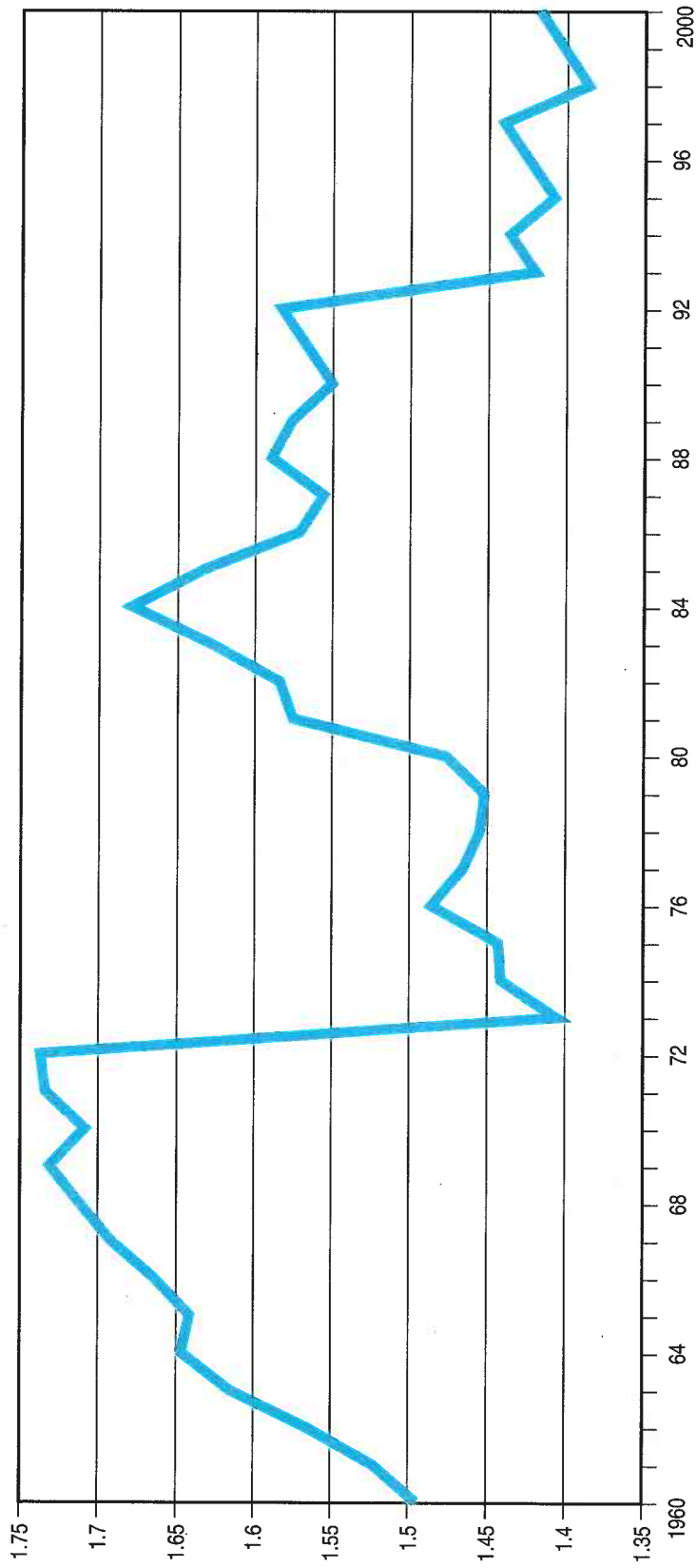
**INDICE DI INTROVERSIONE DELLA CEE
(A COMPOSIZIONE MOBILE E TASSO DI CAMBIO MARCO/DOLLARO)**



Fonte: elaborazione Prometeia da dati OCSE Serie A, FMI-DOT e FMI-IFS

Figura 2

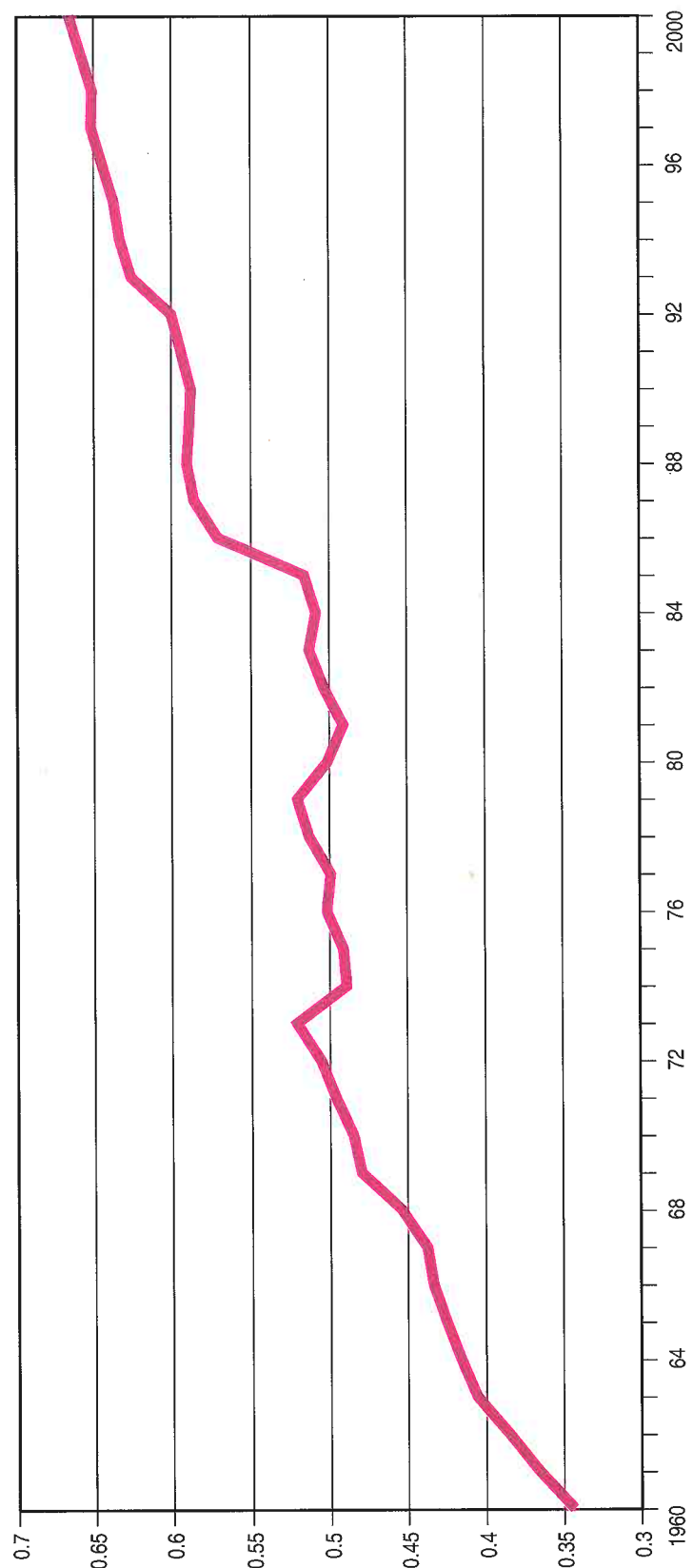
**INDICE DI INTROVERSIONE DELLA CEE
(A COMPOSIZIONE MOBILE)**



Fonte: elaborazione Prometeia da dati OCSE Serie A e FMI-DOT

Figura 3

**INCIDENZA DEL COMMERCIO INTRA-CEE SUL TOTALE DEGLI SCAMBI DELLA CEE
(A COMPOSIZIONE MOBILE)**



Fonte elaborazione Prometeia da dati OCSE Serie A e FMI-DOT

Figura 4