

*Н. В. Попик,
к. е. н., доцент кафедри економічної кібернетики,
Національний авіаційний університет, м. Київ*

ЗАСТОСУВАННЯ ЕКОНОМЕТРИЧНОЇ МОДЕЛІ ДЛЯ ОЦІНКИ ПОЛІТИЧНОГО РИЗИКУ

*N. Popyk,
Ph.D., Associate Professor economic Cybernetics, National Aviation University*

THE USE OF ECONOMETRIC MODELS TO ASSESS POLITICAL RISK

У статті проаналізовано основні теоретичні аспекти застосування економетричної моделі для оцінки політичного ризику. Визначено особливості економетричного моделювання політичного ризику. Досліджено основні проблеми оцінювання, управління та прогнозування політичного ризику в умовах трансформаційної економіки.

In the article the basic theoretical aspects of econometric models to assess political risk. The features of econometric modeling political risk. The basic problem of evaluating, managing and forecasting of political risk in the transformation of the economy.

*Ключові слова: прогнозування, політичний ризик, економічна стабільність, економетричні моделі.
Key words: forecasting, political risk, economic stability, econometric models.*

ПОСТАНОВКА ПРОБЛЕМИ

У трансформаційних умовах взаємодії економіки і політики набуває вельми специфічних рис, які повинні враховуватися міжнародними економічними партнерами кожної країни. У зв'язку з цим помітно зростає реальна потреба у використанні апарату політичних наук для виявлення та пояснення політичних чинників. Сьогодні політична ситуація впливає на економічну діяльність та її стабільність. Для того, щоб уникнути несприятливих політичних рішень, дефіциту ресурсів та ймовірності здійснення небажаних подій, необхідний активний розвиток і використання нових підходів у сфері моделювання політичного ризику.

На основі вивчення політичного ризику можна зрозуміти актуальні макроекономічні проблеми з точки зору не лише внутрішнього стану країни, але і численних зв'язків країни з міжнародною економікою в цілому, що надає можливість комплексного аналізу з урахуванням усіх аспектів національної економічної безпеки. Дані про оцінки політичних ризиків дозволяють захистити зарубіжні активи компаній та урядів шляхом прогнозування можливих загроз, що виникають у політичному середовищі країни-реципієнта.

Про важливість врахування впливу політичного ризику на економічну діяльність свідчить те, що в даний час більшість країн світу складають свої рейтинги та розробляють методики для його аналізу і оцінювання.

Ситуації, коли відсутній ризик в політиці, майже не зустрічаються. Це є причиною того, що навіть ідеальні на перший погляд рішення нерідко призводять до негативних наслідків.

АНАЛІЗ ОСТАННІХ ДОСЛІДЖЕНЬ І ПУБЛІКАЦІЙ

Серед вчених, що вивчають взаємообумовленість політичного ризику та політичної стабільності, сутність та типи політичних ризиків, методологію визначення останніх та стратегії управління ними можна виділити Альгіна А. [1], Андрєєва О. [2], Андрійчука В. [3], Анохіна М. [4], Балакірева О. [5], Вітлінського В. [6], Войтовича В. [7], Кальниша Ю. [8]

На жаль, Україна, яка знаходиться у зоні постійного підвищення стану політичної ризикованості, має передусім імідж політично та економічно нестабільної держави. Саме тому актуальним є розвиток методів ана-

лізу та оцінювання політичного ризику, що є метою дослідження даної магістерської роботи.

МЕТА СТАТТІ

Метою статті є дослідження проблеми оцінювання, управління та прогнозування політичного ризику в умовах трансформаційної економіки країни.

ВИКЛАД ОСНОВНОГО МАТЕРІАЛУ

Важливим питанням сучасного етапу розвитку суспільства є його забезпечення економічною стабільністю. Існує досить гостра проблема невідповідності між існуючим і необхідним ступенем політичного ризику. Це пов'язано, на самперед, із зростанням нестабільності урядового курсу стосовно бізнесу, інвестиційної та інноваційної політики, зволіканням з раціональним вирішенням нагальних питань на рівні законодавства або непослідовністю рішень, конфліктністю між основними гілками влади тощо.

В науці загальноприйнятим є визначення, що політичні ризики, це ймовірності небажаних наслідків можливих політичних та інших рішень, пов'язаних з політичними подіями, здатними завдати той чи інший збиток їх учасникам у реалізації їх інтересів. Однак, з точки зору сприйняття політичного ризику інвестором, ймовірність політичних змін, здатних негативно позначитися на діяльності компанії — це не стільки сам ризик, скільки його джерело, в той же час як ризик — ситуативна характеристика діяльності в умовах невизначеності.

З точки зору економічної діяльності, політичний ризик розуміють як ймовірність того, що державні чи недержавні учасники негативно впливатимуть на ведення бізнесу в країні через нестабільність режиму або прямо чи непрямо втручатимуться в його роботу. Політичний ризик може бути визначений як комплекс внутрішньо-державних та міжнародних, конфліктних та інтеграційних подій і процесів, котрі можуть (або не можуть) привести до змін в урядовій політиці всередині країни або в інших країнах, що може вилитися в несприятливі умови або ж додаткові можливості для фірми.

У даний час жодна сфера життя суспільства не може обійтися без прогнозів як засобу пізнання майбутнього. Особливо важливе значення мають прогнози соціально-економічного розвитку суспільства, обґрунтування основних напрямків економічної політики, передбачення наслідків прийнятих рішень. Соціально-економічне прогнозування є одним з вирішальних наукових факторів формування стратегії і тактики суспільного розвитку.

Процес пізнання економічної реальності вимагає побудови економічних моделей, причому кожна економічна модель виходить з певної економічної закономірності, яку необхідно економічно сформулювати і кількісно визначити на основі статистичних даних.

Ефективним інструментом аналізу тенденцій та прогнозування перспектив економічного росту являються економічні методи та моделі. Економіка базується на вивченні взаємодії різних економічних процесів і показників та відображення цієї взаємодії у формалізованому виді і побудові моделей. Особливо ефективно використання економіки при вивченні динаміки і тенденцій розвитку економіки, виявлення впливу найважливіших факторів на кінцеві результати.

В останні роки суттєво зросла увага до створення та використання економічних моделей для економічного прогнозування. Вважається, що найбільш ефективним напрямом примінення економіки для прогнозування є багаторівневий підхід, коли система моделей як би копіює систему управління.

За межами моделей завжди залишається ряд неврахованих факторів, а тому одержані результати являються наближеними; ні одна модель не може замінити творчої особи і описати безліч неформальних умов.

Економічні моделі являють собою системи регресійних рівнянь і тотожностей, кожне із яких використовується для визначення одного показника, що досліджується. При цьому показники, які вступають в одних рівняннях в якості змінних, в других використовуються в якості аргументу, який впливає на значення решти змінних. У більш вузькому значенні економічними моделями вважаються системи рівнянь, котрі враховують імовірний характер економічних процесів. Звідси випливає, що рівняння економічної моделі містять також і випадкові змінні, а її параметри встановлюються статистично на основі часових рядів або других, наприклад, вибіркового даних.

Економічні моделі в їх класичному виді відносяться до безкритеріальних моделей. Вони вступають в якості гнучкого і ефективного інструменту прогнозування економічних тенденцій. На основі економічних моделей можна прогнозувати як характеристики еволюційного розвитку, так і параметри стрибків.

Економічні моделі легко реалізуються на ЕОМ. На відміну від інших моделей, ці моделі будуються на основі статистичної інформації часових рядів і не вимагають затрат на відміну від моделей структурних (моделі міжгалузевого балансу) на розрахунок на перспективу різних нормативних показників (наприклад, коефіцієнтів прямих матеріальних витрат). В останній час поряд з експертними оцінками для оцінки політичного ризику стали застосовувати економічне моделювання, яке вважається одним з найбільш ефективних методів аналізу в економіці. Активно використовуються на практиці економічні моделі PSSI (Political System Stability Index), Ecological Approach, Euromoney.

Економічні моделі також використовуються для дослідження внутріполітичної нестабільності в регіонах, у країні в цілому та в інших державах як ключового фактору політичного ризику. При цьому в аналітичних розробках, в першу чергу, враховуються фактори як діяльності політичних, їх потенціал, соціальну орієнтацію, істинні цілі та зовнішня мотивація в роботі. Все це стосується організації дослідження ризиків в умовах загальної політичної нестабільності.

Моделювання політичного ризику визначає основні напрями розвитку політики, відображає сукупність зовнішніх і внутрішніх зв'язків, залежностей між різноманітними сферами політичного та економічного життя. ґрунтується воно на принципах альтернативності, системності, безперервності, верифікації. Під час моделювання враховують не тільки конкретну ситуацію в країні, а й історичний досвід та ментальність населення. Структурно моделювання складається з конструювання моделі на основі попереднього вивчення об'єкта, з'ясування його істотних характеристик, експериментального і теоретичного аналізу моделі, зіставлення результатів з даними об'єкта, коригування моделі.

Для аналізу економічної та політичної стабільності доцільно розглядати основні критерії оцінки країни комплексно. Для виконання цієї мети підходить інструментарій економічної моделі.

Політичний ризик — один із факторів економічної нестабільності, але, щоб прогнозувати його ступінь та управляти їм, необхідно розглядати його взаємозв'язок з іншими чинниками, які мають вплив на економіку країни. Наприклад, зовнішній борг країни, валовий внутрішній продукт, платіжний баланс, кількість інвестицій, індекс інфляції і т.д.

Важливим завданням для України сьогодні є вибір оптимальної моделі розвитку, адекватної геополітичної стратегії й такої системи національної безпеки, які б забезпечили її виживання як суверенної країни, повноцінного суб'єкта міжнародних відносин.

Для точності результатів необхідно врахувати низку факторів при моделюванні політичного ризику. Отже, аналіз політичного ризику має певні особливості:

— політична традиція, недосконалість демократичних інститутів і переломний момент історичного розвитку зумовлюють значну роль особистісного фактора, який необхідно проаналізувати при оцінюванні політичного ризику;

— істотним фактором невизначеності є наявність безлічі різнотипних політико-територіальних утворень, що мають різний економічний потенціал, неоднорідний національний склад й історичні, політичні, культурні та релігійні традиції. Регіональні конфлікти прямо впливають на загальну політичну обстановку і опосередковано на ситуацію в інших регіонах, оскільки розв'язання регіональних проблем вимагає додаткових субсидій, що призводить до зростання дефіциту загальнодержавного бюджету, змін у податковому законодавстві, скорочення соціальних витрат (а отже, зростання соціальної напруженості), збільшення розміру державного боргу, коливання відсоткових ставок і валютного курсу, тобто погіршення політичного й інвестиційного клімату в країні. Для адекватного аналізу політичного ризику необхідне проведення докладних досліджень окремих регіонів (або груп регіонів), включення регіональних індикаторів у загальну схему оцінки ризику країни.

Визначення моделей розвитку України передбачає врахування відповідних чинників і обрання методики підходу до самого процесу моделювання. Побудована модель відображає політичну нестабільність як певне явище політичного життя визначеної країни, що характеризується широким застосуванням насильства проти уряду у вигляді змов, державних переворотів, громадянських війн, міжнаціональних конфліктів тощо. При цьому розрізняють нестабільність у правлячій верхівці, пов'язану з боротьбою за владу, і соціальну нестабільність, що виникає внаслідок активної діяльності опозиційних соціально-політичних сил.

ВИСНОВКИ

Отже, безліч існуючих методів та моделей доводять лише складність і багатовимірність проблематики теорії і практики аналізу та оцінки політичних ризиків. Кожен з підходів має певні переваги та недоліки. Зокрема, експертні системи критикують за те, що в них не завжди чітко простежуються причинно-наслідкові зв'язки. Інтегровані моделі вимагають значних ресурсних витрат (людські, фінансові та часові) і є географічно обмеженими. Проте економетричні моделі часто-густо виявляють критичну залежність щодо забезпечення поточними джерелами інформації більшості незалежних змінних, необхідних для аналізу.

Література:

1. Альгин А.П. Риск и его роль в общественной жизни / А.П. Альгин. — М.: Мысль, 1989. — 205 с.
2. Андреева О.М. Национальная идентичность как фактор социального риска в Украине / О.М. Андреева // Научные записки Института политических и этнонациональных исследований им. И.Ф. Кураса НАН Украины. — Вып. 42. (подсерия "Курасівські читання"). — К., 2008. — С. 106—114.
3. Андрійчук В. Ризик та його складові // В. Андрійчук, Л. Бауер. — К.: КНЕУ, 1998. — 319 с.
4. Анохин М.Г. Политическая система: переходные процессы / М.Г. Анохин. — М.: РИЦ ИСПИ РАН. — 1996. — 256 с.
5. Балакірева О.М. Трансформація ціннісних орієнтацій в українському суспільстві / О.М. Балакірева // Український соціум. — 2007. — № 2 (19). — С. 4—17.
6. Вітлінський В.В. Аналіз, оцінка і моделювання економічного ризику / В.В. Вітлінський. — К.: Деміур, 1996. — 212 с.
7. Войтович Р.В. Вплив глобалізації на систему державного управління / Р.В. Войтович. — К.: Політична думка, 2000. — 687 с.

8. Кальниш Ю. Політичний ризик у державному управлінні // Вісник Національної академії державного управління при Президентові України. — 2005. — № 2. — С. 314—320.

References:

1. Al'hyn, A. P. (1989), Rysk y eho rol' v obschestvennoj zhizny [Risk and its role in public life], Mysl', Moscow, Russia.
2. Andrieieva, O. M. (2008), "National identity as a factor of social risk in Ukraine", Naukovi zapysky Instytutu politychnykh i etnonatsional'nykh doslidzhen' im. I.F. Kurasa NAN Ukrainy, vol. 42, pp. 106—114.
3. Andrijchuk, V. and Bauer, L. (1998), Ryzyk ta joho skladovi [Risk and its components], KNEU, Kyiv, Ukraine.
4. Anokhyn, M. H. (1996), Polytycheskaia sistema : perekhodnye protsessy [Political system: transient processes], RYTs YSPY RAN, Moscow, Russia.
5. Balakirieva, O. M. (2007), "The transformation of value orientations in Ukrainian society", Ukrain's'kyj sotsium, vol. 2 (19), pp. 4—17.
6. Vitlins'kyj, V. V. (1996), Analiz, otsinka i modeliuвання ekonomichnoho ryzyku [Analysis, assessment and modeling of economic risk], Demiur, Kyiv, Ukraine.
7. Vojtovych, R. V. (2000), Vplyv hlobalizatsii na systemu derzhavnoho upravlinnia The impact of globalization on the system of public administration [], Politychna dumka, Kyiv, Ukraine.
8. Kal'nysh, Yu. (2005), "Political risk in public administration", Visnyk Natsional'noi akademii derzhavnoho upravlinnia pry Prezydentovi Ukrainy, vol. 2, pp. 314—320.

Стаття надійшла до редакції 23.11.2015 р.

АГРОСВІТ
www.agrosvit.info
Передплатний
індекс: 23892

**ЖУРНАЛ
ВИХОДИТЬ
24 РАЗИ
НА РІК**

Журнал «АГРОСВІТ» включено до переліку наукових фахових видань України, в яких можуть публікуватися результати дисертаційних робіт на здобуття наукових ступенів доктора і кандидата наук з **ЕКОНОМІКИ**

(постанова Президії ВАК України від 27 травня 2009 р. № 1-05/2)

Тел: (044) 223 26 28, 537 14 33, 537 14 32
Тел/факс: (044) 458 10 73
E-mail: economy_2008@ukr.net