

УДК [330: 351:746.1] (339)

Губарєва І.О.

к.е.н., доцент НДЦ ІІР НАН України

МЕТОДИЧНИЙ ПІДХІД ДО ОЦІНКИ ЕКОНОМІЧНОЇ БЕЗПЕКИ НАЦІОНАЛЬНОЇ ЕКОНОМІКИ УКРАЇНИ В УМОВАХ ПОСИЛЕННЯ ІНТЕГРАЦІЙНИХ ПРОЦЕСІВ

У статті представлено методичний підхід до оцінки та співставлення країн світу за рівнем економічної безпеки, який, на відміну від існуючих, ґрунтується на сполученні міжнародних індексів, які характеризують економічну, політичну, соціальну та духовну сфери. Запропонований методичний підхід передбачає комплексне використання кореляційного, таксономічного та кластерного аналізу, може бути використаний для обґрунтування стратегії інтеграції країн світу.

Ключові слова: економічна безпека країни, міжнародні індекси, інтегральний показник, кластерний аналіз, інтеграція

Постановка проблеми. Об'єктивне оцінювання економічної безпеки національної економіки та створення ефективного методичного підходу до її аналізу – один із пріоритетних напрямків дослідження на сучасному етапі.

Аналіз останніх досліджень і публікацій. Аналіз робіт вітчизняних та зарубіжних вчених-економістів: О. І. Барановського, В. М. Гейця, С. Ю. Глазьєва, Л. П. Гончаренко, М. М. Єрмошенко, В. А. Ліпкана, В. І. Мунтіяна, Г. А. Пастернака-Таранушенка, В. В. Похилюка, В. М. Сенчагова, Г. П. Ситника та інш., а також чинного законодавства окремих країн, свідчить про відсутність єдиного підходу до вибору методичного підходу, складу показників та їх порогових значень для оцінки рівня економічної безпеки національної економіки країни. Крім того, існуючі підходи, в основному складні для

використання і не дозволяють аналітикам на основі відкритої інформації співставляти країни за рівнем економічної безпеки та з достатнім ступенем достовірності давати об'єктивну оцінку загроз національним економічним інтересам.

Виклад основного матеріалу. Під економічною безпекою національної економіки країни розуміється стан захищеності національних економічних інтересів від зовнішніх та внутрішніх загроз, що забезпечує незалежність національної економіки, її стабільність та стійкість в економічній, соціальній, політичній та духовній сферах, спроможність до постійного оновлення та саморозвитку.

Сутність економічної безпеки національної економіки реалізується в системі критеріїв і показників. В Україні оцінка економічної безпеки проводиться, відповідно до методики [1] за компонентами: макроекономічна, фінансова, виробнича, інвестиційна, науково-технологічна, енергетична, зовнішньоекономічна, соціальна, демографічна і продовольча. Оцінювання стану економічної безпеки України здійснюється за кожною компонентою та показником, який її оцінює шляхом співставлення фактичних значень індикаторів безпеки з їх пороговими значеннями – кількісними величинами, порушення яких викликає несприятливі або загрозливі тенденції в економіці. Дана методика не передбачає співставлення України з іншими країнами світу за рівнем економічної безпеки.

Огляд економічної літератури показав, що залишаються не достатньо розробленими методичні підходи та інструментарій, які б в загальному вигляді характеризували рівень економічної безпеки країн світу. З метою розв'язання даної проблеми пропонується оцінювати рівень економічної безпеки країн світу за напрямками: рівень розвитку економіки та духовності, політична стабільність, рівень соціального забезпечення населення, шляхи комплексного використання методу таксономії, кореляційний та кластерний аналіз.

Для оцінювання рівня економічної безпеки країн світу були використані значення 52 міжнародних рейтингів та індексів за 2010-2012 рр., які було

згруповано за сферами виникнення загроз економічній безпеці національній економіці країн світу: економічною, політичною, соціальною та духовною.

Під час дослідження було визначено, що деякі індекси відрізняються методикою розрахунку, але однакові за економічним змістом, серед індексів зустрічається дублювання складових та окремих показників. Так, для оцінки рівня корупції в країні у міжнародній практиці частіше всього використовується Індекс сприйняття корупції [2], який презентує міжнародна некомерційна громадська організація «Transparency International». Метою визначення даного індексу є оцінка уявлень експертів щодо рівня корупції в державному секторі різних країн світу. Результати опитування щодо сприйняття корупції в країнах використовуються Світовим банком при розрахунку Індeksu якості державного управління [3] та Індeksu легкості ведення бізнесу [4], а також американським дослідницьким центром «The Heritage Foundation» спільно з газетою The Wall Street Journal при розрахунку Індeksu економічної свободи [5]. Тому, для запобігання мультиколінійності в подальших дослідженнях, було проведено кореляційний аналіз. При формуванні системи показників для оцінки рівня економічної безпеки країн світу були відібрані тільки ті показники, коефіцієнт кореляції між якими не перевищує 0,7, адже при значенні коефіцієнта кореляції більше 0,7, зв'язок між показниками за шкалою Чеддока може бути оцінений як високий.

В результаті проведення кореляційного аналізу кількість показників, що можуть бути використані для оцінки економічної безпеки національної економіки країни, скоротилися до 25. Оцінити рівень економічної безпеки національної економіки в економічній сфері можна за такими показниками як: конкурентоспроможність, економічна свобода, залучення у міжнародну торгівлю, нерівномірність економічного розвитку, економічна нестабільність; в соціальній сфері: якість освіти, розвиток соціального забезпечення, людське благополуччя, демографічний тиск, міграція біженців, наявність невдоволених груп населення, економічне благополуччя, економічний добробут; в політичній сфері: захист прав власності, політична стабільність та відсутність насилля,

якість державності, загальна нестабільність, легкість ведення бізнесу, доступ до ринку; в духовній сфері: рівень корупції, свобода преси, особиста свобода, вплив групових та/або кланових еліт, вплив інших держав або політичних суб'єктів, інституціональні основи демократії.

Існує багато методів побудови агрегованих, інтегральних, узагальнюючих або синтетичних показників, які розрізняються за способами редукції показників – ознак. Так, для розрахунку узагальнюючих, комплексних показників успішно застосовуються таксономічні методи, факторний аналіз, евристичні методи зниження розмірності, побудова зведеного (інтегрального) латентного показника якості (або ефективності функціонування) складної системи, багатомірне шкалювання й інші. [6] Для повної редукції числа ознак економічної безпеки національної економіки країни (одержання тільки одного узагальнюючого інтегрального показника) можна успішно використовувати всі ці методи, оскільки кожний з них має безсумнівні специфічні особливості, які складають його переваги. Запропоновано, для побудови узагальнюючого інтегрального показника економічної безпеки національної економіки країни, застосувати метод таксономічного показника розвитку, який дозволяє звести сукупність ознак досліджуваного явища до однієї синтетичної ознаки.

Інтегральний показник економічної безпеки національної економіки країни було розраховано за сферами виникнення загроз: економічній, політичній, соціальній та духовній для країн Європейського союзу, Митного союзу та України. Побудований таксономічний показник синтетично характеризує значення факторних ознак досліджуваних результуючих показників. Високі значення цього показника свідчать про високі значення ознак, що враховують, низькі – навпаки. Найважливішою його перевагою є те, що цей синтетичний показник може показувати розходження в процесах, що характеризують рівень економічної безпеки країни. По його величині можна судити про наявний потенціал росту для окремих країн і кластерів у контексті ключових факторів, і, відповідно, про доцільність застосування до них управлінських впливів. Характерною властивістю таксономічного

інтегрального показника є те, що його значення знаходиться в інтервалі від 0 до 1. Інтерпретація даного показника наступна: він приймає високі значення при близьких значеннях показників у системі до еталону і низькі значення при далеких. [7] Для висновків було використано шкалу, розроблену на основі закону Фібоначчі. У табл. 1 наведено результати оцінки рівня економічної безпеки національної економіки країн Європейського союзу, Митного союзу та України у 2012 р.

Таблиця 1

Оцінка рівня економічної безпеки національної економіки країн Європейського союзу, Митного союзу та України у 2012 р.

Країна	Сфери виникнення загроз економічній безпеці країни				Інтегральний показник економічної безпеки
	економічна	соціальна	політична	духовна	
1	2	3	4	5	6
Високий рівень економічної безпеки національної економіки					
Фінляндія	0,556	0,92	0,580	0,916	0,721
Швеція	0,566	0,85	0,578	0,890	0,706
Данія	0,568	0,80	0,562	0,894	0,690
Австрія	0,502	0,72	0,560	0,793	0,633
Нідерланди	0,537	0,72	0,407	0,879	0,609
Німеччина	0,507	0,60	0,529	0,762	0,592
Великобританія	0,498	0,59	0,497	0,712	0,567
Ірландія	0,493	0,64	0,548	0,799	0,610
Бельгія	0,475	0,70	0,508	0,738	0,594
Люксембург	0,552	0,61	0,478	0,742	0,588
Франція	0,429	0,56	0,487	0,709	0,537
Словенія	0,385	0,67	0,387	0,624	0,500
Чехія	0,430	0,63	0,370	0,557	0,486
Іспанія	0,387	0,51	0,378	0,601	0,461
Португалія	0,360	0,41	0,467	0,652	0,461
Середній рівень економічної безпеки національної економіки					
Польща	0,392	0,47	0,351	0,591	0,443
Угорщина	0,465	0,44	0,385	0,471	0,438
Словаччина	0,331	0,53	0,360	0,496	0,421
1	2	3	4	5	6
Італія	0,362	0,46	0,396	0,470	0,420
Естонія	0,431	0,39	0,260	0,499	0,385
Литва	0,513	0,46	0,180	0,427	0,367
Мальта	0,377	0,23	0,281	0,560	0,343
Латвія	0,307	0,29	0,241	0,476	0,319
Низький рівень економічної безпеки національної економіки					
Кіпр	0,268	0,30	0,352	0,236	0,285
Болгарія	0,305	0,21	0,253	0,359	0,277

Греція	0,235	0,25	0,239	0,321	0,259
Румунія	0,258	0,14	0,268	0,387	0,247
Україна	0,160	0,20	0,249	0,110	0,172
Хорватія	0,294	0,13	0,031	0,356	0,144
Білорусь	0,240	0,13	0,245	0,047	0,139
Росія	0,174	0,04	0,173	0,083	0,102
Казахстан	0,023	0,25	0,222	0,047	0,088

Як видно з табл. 1, до групи з високим рівнем економічної безпеки увійшли високорозвинуті країни (Фінляндія, Швеція, Данія, Австрія), які отримали високі значення інтегрального показника економічної безпеки національної економіки. Серед країн цієї групи суттєві загрози економічній безпеці національній економіці в економічній сфері спостерігаються в Іспанії та Португалії. У групу з середнім рівнем економічної безпеки увійшли країни, які мають проблеми в забезпеченні економічної безпеки за окремими сферами виникнення загроз. Україна увійшла до групи країн з низьким рівнем економічної безпеки національної економіки. До цієї ж групи увійшли країни Митного союзу, а також Кіпр, Болгарія, Греція, Румунія та Хорватія.

Посилення інтеграційних процесів оказує вплив на економічну безпеку національної економіки країни. Тому при обґрунтуванні інтеграційної стратегії дуже важливо не тільки оцінити рівень економічної безпеки, а і визначити групу країн для інтегрування. Кожна країна має свої особливості, але в однорідних групах країн діють близькі за змістом закономірності розвитку. З метою ранжування та виділення однорідної сукупності країн за рівнем економічної безпеки національної економіки було застосовано кластерний аналіз.

Кластерний аналіз – метод багатомірної класифікації об'єктів, який призначений для розбивки безлічі об'єктів на задане чи не відоме число класів (cluster – гроно, пучок, скупчення, група елементів, що характеризуються якоюсь загальною властивістю) [7, 8]. Число груп було визначено емпіричним шляхом з обліком якісних, неформалізованих характеристик. Основою угруповання є фактичні значення таксономічних показників. Для розподілу аналізованих країн на окремі кластери було використано ієрархічні методи, а в

якості мір подібності Євклідову відстань. Результати кластеризації країн за рівнем економічної безпеки національної економіки наведено у табл. 2.

Таблиця 2

Результати кластеризації країн за рівнем економічної безпеки
національної економіки

Склад 1 кластеру		Склад 2 кластеру		Склад 3 кластеру	
Країни	Відстань від центру кластера	Країни	Відстань від центру кластера	Країни	Відстань від центру кластера
Австрія	0,023654	Естонія	0,057393	Болгарія	0,086046
Бельгія	0,039281	Іспанія	0,046791	Греція	0,062543
Великобританія	0,074889	Італія	0,046824	Кіпр	0,089290
Данія	0,073980	Латвія	0,109863	Румунія	0,092789
Ірландія	0,033985	Литва	0,112532	Хорватія	0,128685
Люксембург	0,061505	Мальта	0,117287	Росія	0,103053
Нідерланди	0,069948	Польща	0,029664	Білорусь	0,132839
Німеччина	0,054761	Португалія	0,091705	Казахстан	0,089248
Фінляндія	0,127794	Словаччина	0,053880	Україна	0,061875
Франція	0,096621	Словенія	0,117845		
Швеція	0,095998	Угорщина	0,054076		
		Чехія	0,089725		

Як видно з табл. 2, сукупність країн було розділено на три кластери. В перший кластер увійшли країни з високим рівнем економічного розвитку, політично стабільні та з низьким рівнем корупції (Австрія, Бельгія, Великобританія, Данія та ін.). У другий кластер увійшли країни, які мають проблеми в забезпеченні економічної безпеки в окремих сферах (Іспанія, Португалія, Угорщина та ін.). В третій кластер увійшли країни, які мають суттєві проблеми в забезпеченні економічної безпеки, політично нестабільні, з високим рівнем корупції (Греція, Кіпр, Росія, Білорусь, Казахстан, Україна).

Висновки. Як показав проведений аналіз, сучасний стан економічного розвитку України характеризується наявністю суттєвих загроз економічній безпеці національній економіці. Для оцінки рівня економічної безпеки країн світу пропонується використовувати міжнародні рейтинги та індекси. Сформована система показників дає можливість оцінювати рівень економічної безпеки національної економіки за сферами виникнення загроз: економічній,

політичній, соціальній та духовній, а також порівнювати країни світу за рівнем економічної безпеки національної економіки. Запропонований методичний підхід може бути використаний для обґрунтування стратегії інтеграції країн світу.

Список використаної літератури

1. Методика розрахунку економічної безпеки України, затверджена наказом Міністерства економіки України від 02.03.2007 г. № 60 // me.gov.ua
2. Corruption Perceptions Index 2013 [Електронний ресурс] / Transparency International. – Режим доступу: <http://www.transparency.org>
3. The Worldwide Governance Indicators 2013 [Електронний ресурс] / The World Bank. – Режим доступу: <http://info.worldbank.org>
4. Doing Business 2012 [Електронний ресурс] / The World Bank. – Режим доступу: <http://www.worldbank.org>
5. Report Economic Freedom of the World: 2013 [Електронний ресурс] / Cato Institute. – Режим доступу: <http://www.cato.org/pubs/efw/map/index>.
6. Гладченко Т.М. Науково-методичні основи створення механізму державного управління і регулювання системи безпеки підприємницької діяльності: регіональний аспект: автореф. дис. на здобуття наук. ступеня канд. екон. наук: спец. 25.00.02 «механізм державного управління» / Т.М. Гладченко. – Донец. держ. акад. упр. — Донецьк, 2004. — 19 с.
7. Буреева Н. Н. Многомерный статистический анализ с использованием ППП «STATISTICA». Учебно-методический материал по программе повышения квалификации «Применение программных средств в научных исследованиях и преподавании математики и механики» / Н. Н. Буреева // Нижний Новгород. – 2007. – 112 с.
8. Куліков П. М. Економіко-математичне моделювання фінансового стану підприємства. Навч. посібник / П. М. Куліков, Г. А. Іващенко. – Харків: Вид. ХНЕУ, 2009. – 178 с.

**ГУБАРЕВА И. О. МЕТОДИЧЕСКИЙ ПОДХОД К ОЦЕНКЕ
ЭКОНОМИЧЕСКОЙ БЕЗОПАСНОСТИ НАЦИОНАЛЬНОЙ
ЭКОНОМИКИ УКРАИНЫ В УСЛОВИЯХ УСЕЛЕНИЯ
ИНТЕГРАЦИОННЫХ ПРОЦЕССОВ**

В статье представлен методический подход к оценке и сопоставлению стран по уровню экономической безопасности, который, в отличие от существующих, основывается на сочетании международных индексов, характеризующих экономическую, политическую, социальную и духовную сферы страны. Предложенный методический подход основан на комплексном использовании корреляционного, таксономического и кластерного анализа, может быть использован для обоснования интеграционной стратегии стран мира.

Ключевые слова: экономическая безопасность страны, международные индексы, интегральный показатель, кластерный анализ, интеграция.

**GUBAREVA I.O. SYSTEMATIC APPROACH TO ASSESSMENT OF
ECONOMIC SECURITY NATIONAL ECONOMY OF UKRAINE IN THE
INTEGRATION PROCESS USELENIYA**

The article presents methodical approach to the evaluation and comparison of countries in terms of economic security, which, unlike existing, based on a combination of international indices characterizing the economic, political, social and spiritual spheres of the country. Proposed methodological approach is based on the integrated use of correlation, taxonomic and cluster analysis can be used to justify the integration strategy of the world.

Keywords: economic security of the country, international indices, the integral index, cluster analysis, integration.