

УДК 338.2:351.863

ЩОДО МЕТОДОЛОГІЇ КОМПЛЕКСНОГО ОЦІНЮВАННЯ СКЛАДНИКІВ ЕКОНОМІЧНОЇ БЕЗПЕКИ ДЕРЖАВИ

Сухоруков Аркадій Ісмаїлович,
доктор економічних наук, професор;
Харазішвілі Юрій Михайлович,
доктор економічних наук, старший науковий співробітник

Визначено сучасний зміст поняття економічної безпеки держави. Обґрунтовано методологічні підходи до оцінки її рівня, що передбачають вибір індикаторів та їх порогових значень, використання мультиплікативної форми інтегрального індексу, нормування індикаторів, обґрунтування вагових коефіцієнтів у розрізі складників економічної безпеки. Здійснено апробацію цих підходів на прикладі оцінювання і прогнозування рівня економічної безпеки України.

Ключові слова: економічна безпека держави, індикатори, порогові значення, нормування, моделювання, прогнозування, інтегральний індекс.

Глобалізація економічного простору, ринкова лібералізація та збільшення відкритості економіки України актуалізують необхідність адекватної оцінки рівня економічної безпеки держави. За цих умов необхідним є наукове обґрунтування методів відбору відповідних показників (індикаторів) та визначення їх нормативних значень, що має забезпечити коректне уявлення про поточний і прогнозований рівень економічної безпеки держави. Економічна безпека країни може характеризуватися багатьма показниками, тому важливим завданням є обґрунтування достатнього для аналізу кола показників та визначення інтегрального показника, прийняттого для харак-

теристики динаміки рівня економічної безпеки і порівняння стану економічної безпеки регіонів країни та секторів економіки. Отже, актуальність даної проблеми полягає в необхідності сформулювати сучасний зміст поняття економічної безпеки держави, обґрунтувати методологічні підходи до комплексної оцінки її рівня та вчасного реагування на дестабілізуючі чинники.

Теорія економічної безпеки держави з часом трансформується: у ХІХ ст. виникла теорія камералізму [1], у період кризи 1929–1939 рр. була затребувана кейнсіанська концепція регулювання економіки [2], наприкінці 50-х років ХХ ст. обґрунтовані

теоретико-методологічні засади монетаризму і впроваджено відповідну політику стабілізації економіки [3], згодом з'явилися публікації щодо забезпечення економічної безпеки держави за умов глобалізації (Дж. Лючіані [4], В. Кабле [5], М. Кахлер [6], Б. Грір [7], Б. Бузан [8], Е. де Сото [9]). Сучасна теорія економічної безпеки базується на гетеродоксному підході, тобто на комплексному використанні методів, напрацьованих на різних етапах розвитку теорії економічної безпеки. Посилюється координація практичних зусиль держав у цій сфері в рамках регіональних союзів та міжнародних організацій.

На теренах СНД тематика з питань економічної безпеки держави актуалізувалася у 90-х роках ХХ ст., зокрема у російських виданнях [10] було акцентовано увагу на таких ознаках економічної безпеки держави, як стійкість та стабільність економіки, здатність її до функціонування в умовах впливу дестабілізуючих чинників. Українські вчені звернулися до цієї тематики після набуття країною незалежності [11], зокрема В. Геєць, Б. Кваснюк визначили економічну безпеку держави як здатність економіки забезпечити незалежний розвиток та утримувати стабільність суспільства за несприятливих умов. М. Павловський наголошував, що безпека досягається за умов, коли параметри системи не виходять за певні межі на заданій траєкторії розвитку системи.

Водночас, незважаючи на значну кількість публікацій, відсутнє єдине системне уявлення про головні функціональні та структурні характеристики поняття «економічна безпека держави», потребує вдосконалення теоретико-методологічне обґрунтування критеріїв відбору відповідних показників та нормування їх значень. У концепціях економічної безпеки держави не завжди враховуються інерційні явища, пов'язані з особливостями ретроспективного й поточного економічного розвитку та асиметричністю міжнародних економічних відносин. Не враховується феномен деформації економічних циклів, що виявляється у різних траєкторіях циклів розвинених країн і країн периферії. Методики оцінки економічної безпеки транзитивних країн не враховують повною мірою особливості національної економіки, аспекти тіньової економіки, вплив інвестиційних та інноваційних процесів на рівень економічної безпеки. Не позбавлена недоліків сама методологія оцінювання, що знижує достовірність результатів її застосування.

Зокрема, суттєвого вдосконалення потребують офіційні методики оцінювання рівня

економічної безпеки в Україні [12]. Головні недоліки цих методик, з логічної та математичної точок зору, полягають у наступному:

- використання індикаторів ВВП та інвестицій на одну особу не є коректним, оскільки не враховує обсяг і коефіцієнт завантаження капіталу;

- при оцінці стану науково-інноваційної діяльності застосовуються індикатори, які є поверховими ознаками інноваційності й відображають не розвиток, а потенціал, тобто міру здатності й готовності економічного суб'єкта до інноваційної діяльності;

- для розрахунку інтегрального індексу використовується лінійна (адитивна) форма, замість мультиплікативної (нелінійної), яка більш адекватно відображає нелінійні процеси в економіці;

- не повною мірою враховується тіньовий сектор економіки (тіньова заробітна плата, тіньова зайнятість, тіньове проміжне споживання, втрачені бюджетні надходження, енергоємність тіньової економіки тощо);

- нормування індикаторів здійснюється відносно порогових значень, але якщо поточні значення індикаторів перевищують порогові (або є нижчими порогових), що є нормою, нормалізовані значення будуть більше 1, що порушує прийняті припущення;

- нормування індикаторів здійснюється за різними масштабами, до того ж штучно вводиться округлення нормалізованого індикатора в діапазоні оптимальних значень (прирівнювання одиниці) та за межами порогових значень (прирівнювання 0), що, по-перше, означає штучну втрату інформації, по-друге, порушує безперервність функції інтегрального індексу та унеможливорює його використання в процедурах оптимізації із застосуванням градієнтних методів при визначенні коефіцієнтів чутливості інтегрального індексу до зміни керованих параметрів (індикаторів);

- визначення узагальненого інтегрального індексу як середнього арифметичного значення, розрахованого за двома методами нормалізації індикаторів (перший – в одному масштабному діапазоні, другий – за п'ятьма масштабними діапазонами), не є коректним і подібне до складання дробів без приведення їх до спільного знаменника;

- відсутність інтегральної оцінки порогових та оптимальних значень індикаторів (нижніх та верхніх) одночасно з інтегральною оцінкою індикаторів унеможливорює співставлення в єдиному масштабі динаміки інтегрального індексу економічної безпеки або її складників з пороговими та оптимальними їх значеннями.

Мета даної статті – обґрунтування методологічних підходів, що забезпечують адекватне та комплексне оцінювання складників економічної безпеки держави та апробація цих підходів із використанням реальної інформації про економічний розвиток України.

Методологічні підходи авторів до комплексного оцінювання складників економічної безпеки держави базуються на чіткій структурі поняття економічної безпеки держави; теоретичному обґрунтуванні методів відбору індикаторів економічної безпеки та нормування їх значень; врахуванні специфіки країни і часу, рівня розвитку й відкритості національної економіки, типу державного управління економікою. За основу удосконалення методології комплексного оцінювання рівня економічної безпеки держави приймається теоретико-методологічний підхід [13], що передбачає необхідність комплексного вирішення проблеми забезпечення економічної безпеки держави, обґрунтування індикаторів економічної безпеки та нормування їх значень залежно від властивостей категорії «економічна безпека держави», специфіки часу, рівня розвитку й відкритості економіки, типу державного управління економікою. Математичне забезпечення інтегрального оцінювання економічної безпеки держави також має новизну і враховує складні ієрархічні зв'язки у сфері економічної безпеки держави [14].

Сучасний зміст поняття економічної безпеки держави слід трактувати як сукупність умов, за яких забезпечується захист національних економічних інтересів, можливість утримання параметрів економіки в межах нормативних значень, здатність економіки задовольняти у довгостроковому режимі потреби суспільства, генерувати інноваційні зрушення та реалізувати конкурентні переваги на світових ринках [15].

Оцінка економічної безпеки держави має здійснюватися за таким алгоритмом:

- виявлення функціональних характеристик економічної безпеки держави;
- виокремлення структурних складників економічної безпеки держави;
- визначення номенклатури показників (індикаторів) економічної безпеки;
- встановлення нормативних значень індикаторів економічної безпеки;
- моніторинг індикаторів, ієрархічне узгодження результатів та їх аналіз.

Змістовними функціональними ознаками поняття «економічна безпека держави», що характеризують її як сукупність необхідних і достатніх умов захищеності економіки держави, є наступні: задоволення національних

інтересів, структурна збалансованість економічної системи та стійкість її параметрів, забезпечення стабільності розвитку національної економіки, надійність функціонування економічної системи, ритмічність фінансово-економічних процесів, спрямованість економіки на інноваційний розвиток, відносна незалежність національної економіки. Таким чином, коло обраних індикаторів економічної безпеки держави має комплексно відбивати зазначені характеристики національної економіки та її середовища.

Виокремлення структурних складників економічної безпеки держави здійснюється з метою дослідження загроз і можливостей їх упередження у різних секторах економічної та фінансової діяльності, у соціально-демографічній сфері держави, а також з метою врахування інституційних особливостей державного управління цими сферами. Виходячи із цього, основними взаємопов'язаними структурними складниками економічної безпеки держави є: макроекономічна безпека, інвестиційна безпека, інноваційна безпека, фінансова безпека, енергетична безпека, продовольча безпека, зовнішньоторговельна безпека, соціальна безпека, демографічна безпека.

Макроекономічна безпека вважається забезпеченою за умов, коли досягається збалансованість макроекономічних відтворювальних пропорцій, зберігається стійкість економіки до внутрішніх та зовнішніх дестабілізуючих чинників та здатність до економічного розвитку.

Інвестиційна безпека – це стан інвестування національної економіки, що забезпечує її розширене відтворення і раціональну структуру.

Інноваційна безпека – стан розвитку економіки, що дозволяє генерувати якісні зрушення у виробництві, протистояти зовнішнім технологічним загрозам і забезпечувати конкурентоспроможність на світовому ринку технологій.

Фінансова безпека – це стан захищеності інтересів у фінансовій сфері, або такий стан бюджетної, податкової та грошово-кредитної систем, що гарантує спроможність держави формувати, зберігати від знецінення та використовувати фінансові ресурси для забезпечення соціально-економічного розвитку та обслуговування фінансових зобов'язань.

Енергетична безпека – стан забезпечення економіки та населення джерелами енергії, який характеризується надійними, технічно безпечними та екологічно прийнятними умовами надходження паливно-енергетичних ресурсів.

Продовольча безпека – це стан забезпеченості населення продовольством на рівні, що гарантує кожній особі можливість повноцінного раціонального харчування якісними продуктами, задоволення дієтичних і специфічних смакових потреб населення.

Зовнішньоторговельна безпека – це стан зовнішньоторговельних відносин, що свідчить про спроможність держави протистояти впливу зовнішніх загроз у міжнародній торгівлі та мінімізувати заподіяні ними збитки, активно використовувати участь у світовому поділі праці для створення сприятливих умов розвитку експортного потенціалу і раціоналізації імпорту, забезпечувати відповідність зовнішньоекономічної діяльності національним економічним інтересам.

Соціальна безпека – це стан соціальної сфери, при якому забезпечується високий якісний рівень життя населення незалежно від впливу внутрішніх та зовнішніх загроз.

Демографічна безпека – це стан захищеності основних життєво важливих демовідновлювальних процесів від реальних і потенційних загроз.

Зазначені складники економічної безпеки держави можна поділити на складники другого рівня. Наприклад, фінансова безпека включає питання безпеки у таких сферах, як бюджетна, управління боргами держави, податкова, банківська, валютна, функціонування фондового ринку та небанківського фінансового сектору.

Номенклатура показників (індикаторів) економічної безпеки визначається з урахуванням усієї сукупності функціональних і структурних ознак економічної безпеки, національних економічних інтересів, особливостей та рівня розвитку економіки, типу державного управління, специфіки часу. Номенклатура індикаторів економічної безпеки держави визначається за принципами системності, ієрархічності, адекватності, однозначності (як стимуляторів чи дестимуляторів розвитку) [16], що дає змогу здійснювати регулярний всебічний і коректний моніторинг їх значень. Номенклатура індикаторів є відкритою, що припускає коригування індикаторів або введення додаткових індикаторів за умови економічних та інституційних змін, появи нових можливостей отримання первинних даних і методологічних можливостей. Рівень економічної безпеки країни як цілісного явища характеризується багатьма індикаторами, тому слід застосовувати інтегральні індекси. У розрізі складників безпеки пропонується набір основних індикаторів.

Макроекономічна безпека характеризується наступними індикаторами: узагальнена

продуктивність (випуск на одиницю продуктивної потужності) (*S*); темп приросту ВВП, % (*S*); рівень технології виробництва (частка ВВП у випуску) (*S*); рівень тінізації економіки, % від офіційного ВВП (*D*); рівень використання потенційних можливостей (потенційного ВВП повного завантаження макроректорів) (*S*); рівень тіньового завантаження капіталу (*D*); рівень тіньового проміжного споживання, % до офіційного ВВП (*D*).

Інвестиційна безпека характеризується наступними індикаторами: рівень інвестування (відношення валових інвестицій до ВВП), % (*S*); відношення приросту прямих іноземних інвестицій до ВВП, % (*S*); рівень інвестицій в оновлення основних засобів, % (*S*).

Інноваційна безпека характеризується наступними індикаторами: рівень видатків на науково-технічні роботи, % від ВВП (*S*); науково-технологічний прогрес (*S*); рівень фінансування інноваційної діяльності, % від ВВП (*S*); частка спеціалістів, які виконують науково-технічні роботи, осіб на 1000 зайнятих, % (*S*); частка підприємств, що займалися інноваційною діяльністю, у загальній кількості промислових підприємств, % (*S*); частка підприємств, що впроваджували інновації, у загальній кількості промислових підприємств, % (*S*); частка підприємств, що реалізували інноваційну продукцію, у загальній кількості промислових підприємств, % (*S*); частка реалізованої інноваційної продукції у загальному обсязі реалізованої промислової продукції, % (*S*).

Фінансова безпека характеризується наступними індикаторами: рівень монетизації економіки, % МЗ до ВВП (*S*); рівень зовнішнього боргу, % до ВВП (*D*); рівень внутрішнього боргу, % до ВВП (*D*); рівень стабільності валютного курсу (*S*); рівень перерозподілу ВВП через зведений бюджет (відношення доходів зведеного бюджету до ВВП), % (*S*); рівень дефіциту державного бюджету, % до ВВП (*D*); рівень трансфертів з державного бюджету до ВВП, % (*S*); рівень видатків зведеного бюджету до середньорічної чисельності населення, тис. грн / особу (*S*); рівень втрачених тіньових бюджетних надходжень, % до ВВП (*D*); інфляція, приріст за рік, % (*D*); вартість банківських кредитів, % за рік (*D*); рівень кредитування реального сектору економіки, % до ВВП (*S*); частка кредитів у обороту промисловість у кредитуванні економіки, % (*S*).

Енергетична безпека характеризується наступними індикаторами: енергоємність економіки, кг не / 1 дол. ВВП (за паритетом купівельної спроможності) (*D*); тіньова енергоєм-

ність економіки, кг не / 1 дол. ВВП (за паритетом купівельної спроможності) (*D*); частка домінуючого паливного ресурсу у споживанні ПЕР (природний газ), % (*D*); частка імпорту природного газу з однієї країни у загальному обсязі його імпорту, % (*D*); частка імпорту нафти з однієї країни у загальному обсязі її імпорту, % (*D*); частка власних джерел у балансі ПЕР, % (*S*).

Продовольча безпека характеризується наступними індикаторами: добова калорійність харчування людини, тис. ккал (*S*); м'ясо і м'ясопродукти, кг (*S*); молоко і молочні продукти, кг (*S*); яйця, шт. (*S*); риба і рибопродукти, кг (*S*); цукор, кг (*S*); олія, кг (*S*); картопля, кг (*S*); овочі та баштанні, кг (*S*); фрукти, ягоди, горіхи, виноград, кг (*S*); хлібопродукти, кг (*S*); виробництво зерна на одну особу за рік, т (*S*).

Зовнішньоторговельна безпека характеризується наступними індикаторами: коефіцієнт відкритості економіки, % (*S*); коефіцієнт покриття експортом імпорту (*S*); частка інноваційної продукції у товарному експорті, % (*S*); рівень експортної залежності, % до ВВП (*S*); рівень імпортової залежності, % до ВВП (*D*); частка імпорту товарів у внутрішньому споживанні держави, % (*D*).

Соціальна безпека характеризується наступними індикаторами: рівень використання праці (відношення оптимального попиту на працю до її пропозиції), % (*S*); рівень оплати праці у випуску, % (*S*); рівень тіньової заробітної плати до офіційної, % (*D*); рівень тіньової зайнятості до загальної зайнятості, % (*D*); рівень видатків на освіту до ВВП, % (*S*); рівень видатків на охорону здоров'я до ВВП, % (*S*); рівень прожиткового мінімуму до заробітної плати, % (*S*); частка заробітної плати у структурі доходів населення, % (*S*); рівень пенсійних видатків до ВВП, % (*D*); рівень дефіциту Пенсійного фонду України до ВВП, % (*D*).

Демографічна безпека характеризується наступними індикаторами: очікувана тривалість життя при народженні, років (*S*); коефіцієнт депопуляції (*D*); загальний коефіцієнт смертності населення (кількість померлих на 1000 осіб наявного населення), проміле (*D*); смертність немовлят (кількість дітей, померлих у віці до 1 року на 1000 народжених живими), проміле (*D*); загальний коефіцієнт народжуваності (кількість народжених на 1000 осіб наявного населення), проміле (*S*); захворюваність населення (кількість уперше зареєстрованих випадків захворювань) на 100000 населення (*D*); демографічне навантаження непрацездатного населення до працездатного (ефективної чисельності платників страхових внесків), % (*D*).

Номенклатуру індикаторів визначено у попередніх публікаціях [17] та уточнено на основі використання моделі загальної макроекономічної рівноваги «Альфа» [18].

Важливим етапом оцінювання рівня економічної безпеки держави є встановлення нормативних значень індикаторів, що дає змогу виявити потенційні зони небезпеки та рівні небезпеки (прийнятний ризик, передкризовий стан, кризовий стан). Нормативні значення індикаторів встановлюються та актуалізуються залежно від специфіки часу, рівня розвитку й відкритості економіки, стадій економічного циклу. Нормативні значення також слід диференціювати залежно від типу економічної стратегії, кожному з яких відповідають певні заходи і ресурси. Стратегія оборонного або імітаційного типу включає заходи щодо самозбереження або слідування за лідерами, наступальна стратегія генерує активні дії щодо реалізації конкурентних переваг і зайняття лідерських позицій на ринках, антикризова стратегія спрямована на нейтралізацію криз та їх наслідків. В рамках оборонної чи імітаційної стратегії встановлюються менш жорсткі нормативи безпеки, в рамках наступальної вони підвищуються до оптимального рівня, метою антикризової стратегії є утримання параметрів безпеки у річці тимчасових граничних значень із поступовим їх піднесенням. Для кожного індикатора визначаються оптимальні та порогові значення. Оптимальні (нижнє і верхнє) характеризують припустимий інтервал величин, у межах якого створюються сприятливі умови для функціонування економіки. Порогові значення (нижнє і верхнє) – це кількісні величини, порушення яких спричинює несприятливі тенденції в економіці. Нормативи значення індикаторів переглядаються відповідно до економічних змін.

Авторами запропоновано підхід до визначення нормативних значень індикаторів, що передбачає використання одного або декількох наступних методів [16]:

- метод використання функціональних залежностей (аналітичних і статистичних);
- макроекономічне моделювання, що виявляє вплив дестабілізуючих факторів для конкретної країни в поточний період часу;
- аналоговий метод (орієнтація на показники країн-аналогів);
- законодавчий метод (нормування показників безпеки на законодавчому рівні);
- врахування оцінок міжнародних організацій;
- нормування показників у рамках міжнародних угод;
- методи експертних оцінок.

Експертні оцінки застосовуються у разі відсутності офіційної статистики щодо тих чи інших явищ і необхідності проведення цільових обстежень глибинних якісних змін і латентних явищ (ідеться про інвестиційний клімат, розвиток науки, людський розвиток, тінью економіку, відплив капіталів).

Надалі на основі моніторингу індикаторів та ієрархічного узгодження його результатів здійснюються системний аналіз стану економічної безпеки та розробка програмних заходів щодо забезпечення її прийняттого рівня.

Математичне забезпечення оцінювання рівня економічної безпеки держави здійснюється з урахуванням нелінійності економічних процесів на основі використання мультиплікативної форми інтегрального індексу [14], де вагові коефіцієнти розраховуються методом «Головних компонент» пакету Статистика [12], заснованому на факторному аналізі та внеску кожного фактора до загальної дисперсії:

$$I_m = \prod_{i=1}^n z_i^{a_i}, \quad \sum a_i = 1, \quad a_i \geq 0, \quad (1)$$

де z_i – нормовані значення індикаторів; a_i – вагові коефіцієнти; n – кількість індикаторів.

З метою забезпечення єдиної інформаційної спрямованості індикатори поділяються на стимулятори і дестимулятори. Зв'язок між інтегральним індексом I та індикатором-стимулятором – прямий, між I та індикатором-дестимулятором – зворотний. Дестимулятори перетворюються на стимулятори за допомогою нормування. Нормування індикаторів здійснюється за максимальними значеннями для індикаторів-стимуляторів та мінімальними для індикаторів-дестимуляторів:

$$z_i = \begin{cases} y_i / y_{\max}, & \text{якщо } y_i \in S; \\ y_{\min} / y_i, & \text{якщо } y_i \in D. \end{cases} \quad (2)$$

Застосування нормування індикаторів по всьому діапазону зміни індикаторів та порогових значень за максимальними (для індикаторів-стимуляторів) та мінімальними (для індикаторів-дестимуляторів) значеннями забезпечує безперервність функції інтегрального індексу й дотримання умови зміни нормованих індикаторів у діапазоні [0,1]. Необхідно відзначити, що для індикаторів-дестимуляторів нижче та верхнє порогові (оптимальні) значення змінюються місцями.

Згідно із дослідженням фахівців Держстату України [12] та власним дослідженням авторів при застосуванні методу «Головних компонент» пакету Статистика найбільш доцільно використовувати метод обертання *квартимакс* (замість *варимакс*), який перед-

бачає обертання факторних осей таким чином, щоб збільшити значення факторних навантажень, одночасно враховуючи якість структури усіх компонент. Остання характеристика дуже важлива для подальшого використання значень факторних навантажень і питомої ваги кожної компоненти у загальній дисперсії для визначення ваг індикаторів.

Аналогічне визначення інтегрального індексу для оптимальних і порогових значень дає можливість порівнювати в одному масштабі динаміку інтегрального індексу з інтегральними пороговими значеннями – *ідентифікувати* стан економічної безпеки, що зумовлює розроблення відповідних заходів повернення його в діапазон порогових, а краще – оптимальних значень шляхом вирішення відповідної оптимізаційної задачі [14]:

$$F(\varepsilon) = \begin{cases} (I_t - I_{t, \text{опт}}^u)^2 \rightarrow 0, & \text{якщо } I_t < I_{t, \text{опт}}^u; \\ (I_t - I_{t, \text{опт}}^e)^2 \rightarrow 0, & \text{якщо } I_t > I_{t, \text{опт}}^e. \end{cases} \quad (3)$$

Використання темпових величин у вимірі темпів приросту допускає від'ємні значення індикаторів, що може порушувати умови знаходження нормованих індикаторів у діапазоні [0;1]. Для усунення цього протиріччя пропонується метод, який полягає у зсуві по числовій осі вправо динамічного ряду індикаторів на величину, більшу максимального від'ємного значення індикатора з одночасним зсувом порогових значень для збереження існуючих пропорцій.

Безпосередня інтегральна оцінка рівня економічної безпеки держави включає формування динаміки індикаторів за даними Держстату України та макроекономічного моделювання, визначення та нормування індикаторів і порогових значень, визначення вагових коефіцієнтів та ієрархії інтегральних індексів. Використання зазначеного підходу дає можливість визначати динаміку інтегральних індексів складників та економічної безпеки України в цілому (рисунок).

П'ять складників економічної безпеки з дев'яти знаходяться нижче нижнього порогового значення (інвестиційна, інноваційна, соціальна, демографічна та енергетична безпеки), що визначає передкризовий стан. Два складники економічної безпеки (макроекономічний та зовнішньоекономічний) ледве перевищують нижній поріг і тільки два складники економічної безпеки (фінансовий та продовольчий) знаходяться у прийнятному стані.

Загалом інтегральний індекс економічної безпеки за дванадцять років ретроспективи та

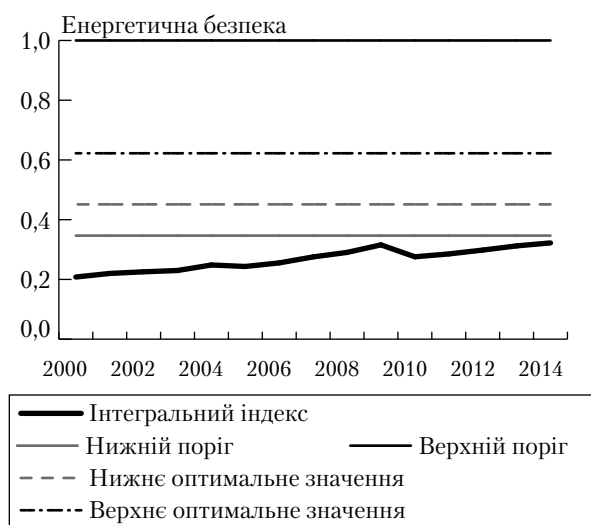
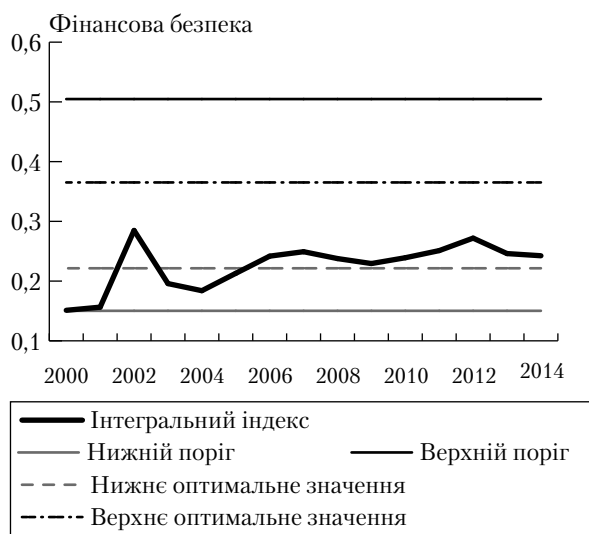
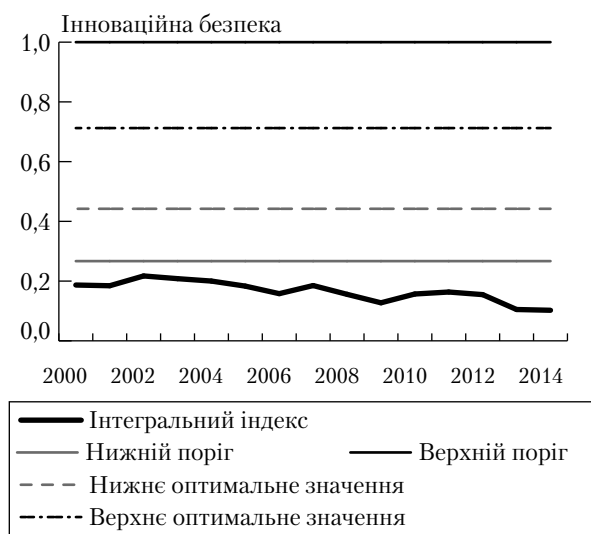
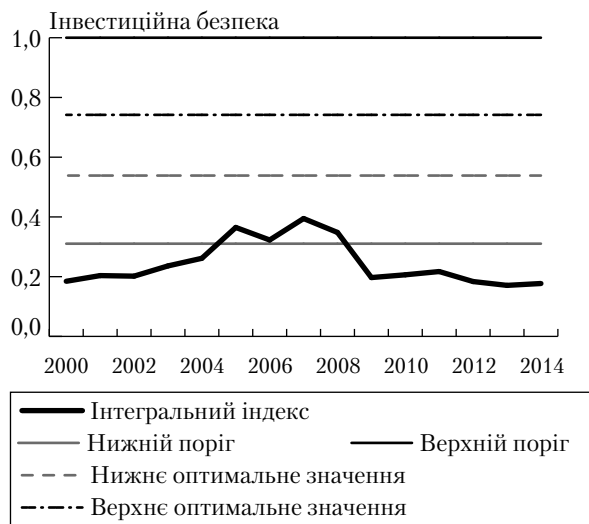
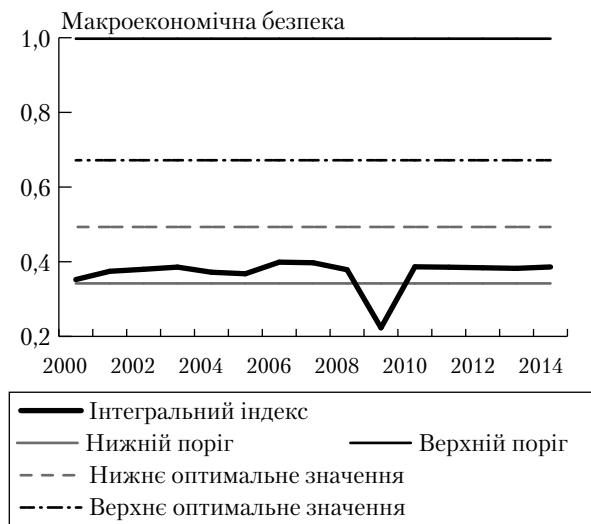


Рис. Динаміка інтегральних індексів складників економічної безпеки України

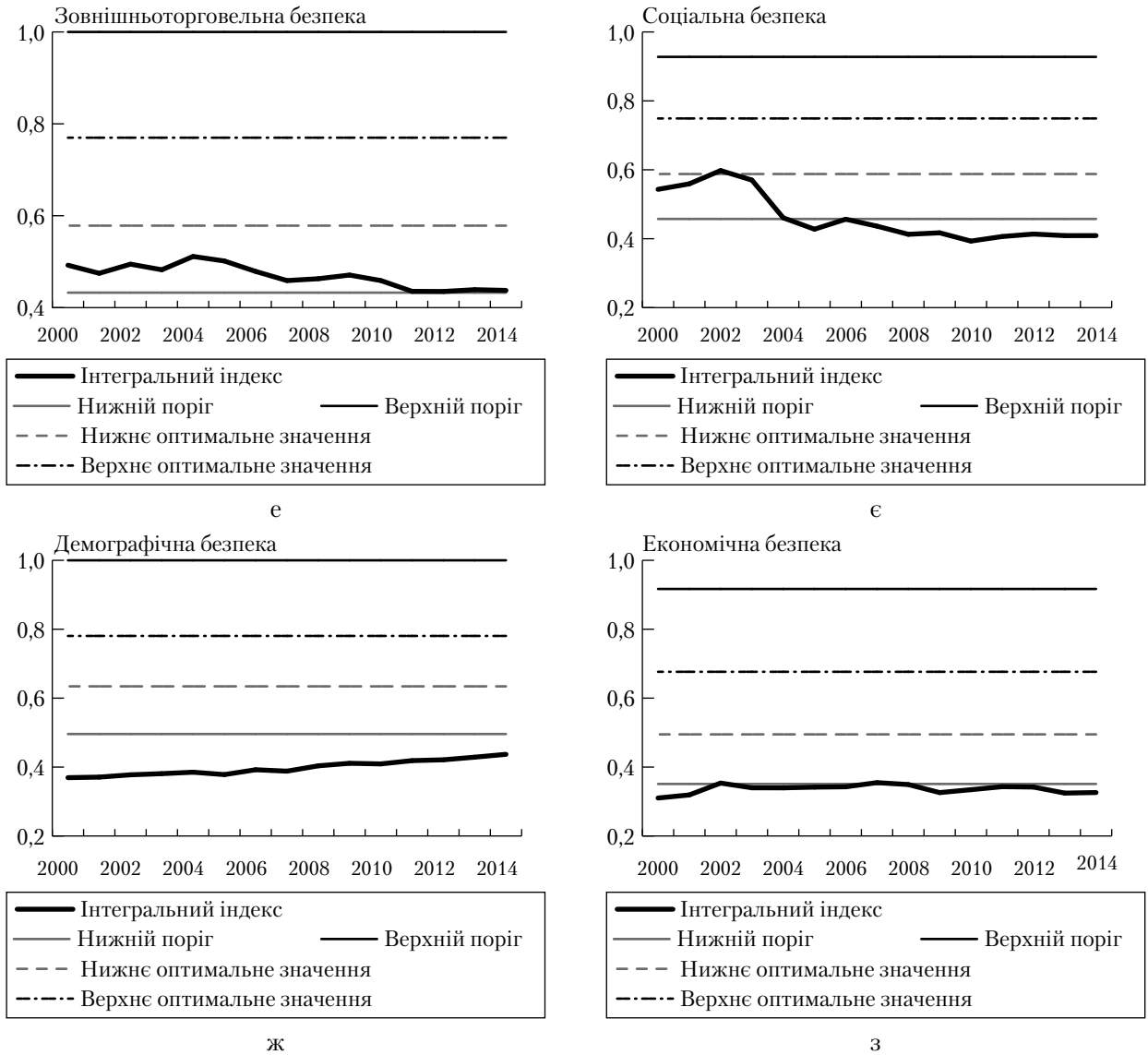


Рис. Динаміка інтегральних індексів складників економічної безпеки України

у двох прогнозних роках перебуває нижче нижнього порогового значення. Побуте думка, що при оцінюванні рівня безпеки важливу роль відіграють не самі індикатори, а їх граничні значення. Це досить одностороннє твердження. Насправді важливу роль при оцінюванні рівня економічної безпеки однаково відіграють склад індикаторів, методологія їх нормування та інтегрального оцінювання, методи визначення порогових значень і самі порогові значення, які можуть змінюватися залежно від ситуації.

Детальний аналіз дозволяє стверджувати про актуалізацію конкретних загроз у розрізі всіх складників економічної безпеки держави.

Серед загрозливих значень показників макроекономічної безпеки спостерігається надвисокий рівень тінізації економіки, тіньового

завантаження капіталу та тіньового проміжного споживання, що знижує ВВП і доходи зведеного бюджету.

На рівень інвестиційної безпеки найбільше впливають порушення норми загального інвестування економіки, низьке відношення приросту прямих іноземних інвестицій до ВВП, низький рівень інвестицій в оновлення основних засобів.

Незадовільний рівень інноваційної безпеки зумовлений низкою проблем: низьким рівнем витрат на науково-технічні роботи; від'ємними темпами науково-технологічного прогресу; низькою часткою спеціалістів, що виконують науково-технічні роботи; низькою часткою підприємств, що займаються інноваційною діяльністю чи впроваджують інновації та реалізують інноваційну продукцію; незначною часткою реалізованої інноваційної про-

Стратегічні пріоритети, №3 (28), 2013 р.

дукції у загальному обсязі реалізованої промислової продукції.

На рівень фінансової безпеки найбільше впливають незбалансованість бюджетної системи, втрата бюджетних надходжень внаслідок високого рівня тіньової економіки; висока вартість банківських кредитів; низька частка кредитів у переробну промисловість в обсязі загального кредитування економіки. Вплив зазначених загроз посилюється такими факторами, як обмеженість доступу до міжнародних фінансових ринків; погіршення стану зовнішньої торгівлі; дефіцит платіжного балансу; відплив капіталу за кордон; низький рівень бюджетної дисципліни; збільшення обсягу державного боргу; коливання обмінного курсу національної валюти, недостатній рівень капіталізації фінансової системи.

Рівень енергетичної безпеки виявляється незадовільним внаслідок високого рівня енергоємності економіки в цілому; великої частки енергії, що споживається в тіньовому секторі; надмірної частки імпорту газу і нафти з однієї країни.

Продовольча безпека, перебуваючи загалом у задовільному стані, водночас характеризується недостатнім забезпеченням населення молочними продуктами.

Зовнішньоторговельна безпека погіршується, зокрема, вкрай низьким є частка інноваційної продукції у товарному експорті; рівень імпоротної залежності перевищує порогове значення; значною є частка імпорту товарів у внутрішньому споживанні.

Стан соціальної безпеки характеризується низьким рівнем оплати праці у випуску товарів і послуг, високим рівнем тіньової зайнятості та тіньової заробітної плати; низьким рівнем прожиткового мінімуму по відношенню до заробітної плати; високим рівнем дефіциту Пенсійного фонду до ВВП.

Стан демографічної безпеки характеризується тим, що коефіцієнт депопуляції, коефіцієнт смертності населення, смертність не-

мовлят, захворюваність населення та демографічне навантаження непрацездатного населення до працездатного перевищують порогові значення. Демографічна криза створює такі загрози, як нестача і деформація структури трудових ресурсів, зменшення продуктивності праці, скорочення національного доходу, збільшення коефіцієнта утримання. Додатковим демографічним чинником, що обмежує обсяг трудових ресурсів, є міграція населення.

Орієнтиром для керованого впливу на стан економічної безпеки України є рейтинг вагових коефіцієнтів по складниках. Зазначені коефіцієнти водночас є коефіцієнтами еластичності, котрі визначають процентне відхилення інтегрального індексу при зміні на один відсоток значення часткового індексу, отже визначають вплив кожного складника на економічну безпеку країни в цілому (таблиця).

Зазначені вагові коефіцієнти дорівнюють коефіцієнтам еластичності, які дають уявлення про процентне відхилення інтегрального індексу в разі зміні на 1 % окремого складника або індикатора, тому визначають пріоритети впливу на економічну безпеку держави.

Єдиний методологічний підхід до оцінки рівня економічної безпеки держави створить можливість коректної оцінки стану кожного складника економічної безпеки та рівня економічної безпеки загалом, визначити пріоритетні заходи щодо упередження загроз чи усунення наслідків їх вияву.

Водночас виникає задача наукового обґрунтування і своєчасного уточнення порогових та оптимальних значень індикаторів, наукового супроводження моніторингу індикаторів та ідентифікації основних загроз, прогнозування їх значень на перспективу, а також розробки програмних заходів щодо забезпечення прийняттого рівня економічної безпеки держави у розрізі її складників.

Аналогічні розрахунки по кожному індикатору для кожного складника економічної

Таблиця

Вагові коефіцієнти складників інтегрального індексу економічної безпеки*

Складники економічної безпеки держави	Вагові коефіцієнти	Складники ЕкБ	Вагові коефіцієнти
1. Демографічний	0,141277	6. Зовнішньоекономічний	0,127362
2. Енергетичний	0,138078	7. Фінансовий	0,089897
3. Продовольчий	0,137415	8. Інвестиційний	0,057207
4. Соціальний	0,134131	9. Макроекономічний	0,040908
5. Інноваційний	0,133725		

* Розрахунки авторів

безпеки дають змогу з урахуванням їх чутливості й вагових коефіцієнтів впливу визначити необхідні значення індикаторів, що забезпечують знаходження рівня економічної безпеки у сприятливій зоні. Спочатку така процедура здійснюється на рівні складників економічної безпеки, а потім на рівні індикаторів кожного складника, тобто здійснюється декомпозиція аналізу інтегрального індексу економічної безпеки.

Визначення необхідних значень індикаторів, що забезпечують знаходження інтегрального індексу економічної безпеки в сприятливій зоні, є передумовою для розроблення заходів щодо зміни економічної політики для досягнення бажаних значень макропоказників, які обумовлюють необхідні значення індикаторів економічної безпеки.

Висновки

1. Глобалізація світової економіки, ринкова лібералізація та збільшення ступеня відкритості національної економіки актуалізують необхідність вдосконалення методології комплексної оцінки рівня економічної безпеки держави з метою забезпечення адекватного реагування державних органів управління економікою на внутрішні і зовнішні дестабілюючі чинники.

2. Аналіз офіційних підходів до комплексного оцінювання рівня економічної безпеки держави та її складників виявив низку недоліків, які звужують можливості їх використання та зумовлюють необхідність удосконалення методологічних підходів. Визначені недоліки, які стосуються складу індикаторів і самої методології інтегрального оцінювання, негативно впливають на достовірність результатів оцінювання.

3. Запропоновані методологічні підходи до комплексного оцінювання рівня економічної безпеки України містять пропозиції щодо чіткого структурування змісту поняття економічної безпеки держави; передбачають обґрунтування нормативних значень індикаторів та використання додаткових індикаторів; забезпечують використання мультиплікатив-

ної форми інтегрального індексу й коректне нормування індикаторів.

4. Авторські методологічні підходи створюють можливість порівнювати в одному масштабі динаміку інтегрального індексу з інтегральними пороговими значеннями, оцінити рівень економічної безпеки України як кінцевий результат соціально-економічного розвитку, коректно ідентифікувати стан економічної безпеки, розгорнути інтегральний індекс у систему складників та індикаторів економічної безпеки з їх ваговими коефіцієнтами для визначення «вузьких місць», напряму поліпшення та розроблення відповідних заходів внаслідок впливу на структурні елементи, визначити і впровадити адекватні заходи щодо забезпечення економічної безпеки на певному етапі розвитку національної економіки.

5. Апробація запропонованих методологічних підходів на прикладі оцінювання рівня економічної безпеки України свідчить про несприятливий стан її економічної безпеки – низка індикаторів економічної безпеки перебуває в небезпечній зоні. Саме на покращання стану цих складників економічної безпеки насамперед має бути спрямована стратегія забезпечення економічної безпеки України.

Подальші наукові дослідження щодо обґрунтування політики забезпечення економічної безпеки держави мають бути зосереджені на вивченні загроз і можливостей, що пов'язані із структурними змінами в національній економіці та інтеграційними прагненнями України, а також на вдосконаленні методології вибору індикаторів економічної безпеки. Важливим завданням майбутніх досліджень у рамках теорії економічної безпеки держави є теоретико-методологічне обґрунтування комплексного оцінювання економічної безпеки регіонів країни, а також узгодження методологічних положень теорії економічної безпеки держави й теорії сталого розвитку держави. Необхідно також поглиблювати прикладні дослідження і розробки щодо імплементації програмно-цільового підходу та проектного менеджменту у практику забезпечення економічної безпеки держави.

Список використаних джерел

1. Лист Ф. Национальная система политической экономии; Витте С. Ю. По поводу национализма. Национальная экономика и Фридрих Лист; Менделеев Д. И. Толковый тариф или исследование о развитии промышленности России в связи с ее общим таможенным тарифом / Д. И. Менделеев; сост. и пред. В. А. Фадеева. – М.: Изд-во «Европа», 2005. – 382 с.

2. Кейнс Дж. М. Общая теория занятости, процента и денег / Дж. М. Кейнс; пер. с англ. В. Г. Гребенникова, А. Ф. Кунделя, Р. И. Капелюшниковой, Т. А. Колосовой, Р. М. Энтова; под общ. ред. и пред. А. Г. Милейковского, И. М. Осадчей. – М.: Прогресс, 1978. – 494 с.

3. *Friedman M.* The Quantity Theory of Money: A Restatement in Studies in the Quantity Theory of Money / edited by M. Friedman // The Optimum Quantity of Money. – Reprinted in M. Friedman. – 2005. – P. 51–67.
4. *Luciani G.* The economic content of security / G. Luciani // Journal of Public policy. – 1989. – Vol. 8, № 2. – P. 151–173.
5. *Cable V.* What is International Economic Security? / V. Cable // International Affairs. – 1995. – Vol. 71, № 2. – P. 305–324.
6. *Kahler M.* Economic security in an Era of Globalization: Definition and Provision. (Presentation to the Conference on Globalization and Economic Security in Asia) / Miles Kahler ; Governance and Institutions. Institute of Defence and Strategic Studies. – Singapore, 11 Sep., 2003.
7. *Greer B.* European economic security / B. Greer // Securing Europe's future / ed. by St. Flanagan, F. Hampson – L., 1986. – P. 221–241.
8. *Buzan B.* People, states and Fear / B. Buzan. – Brighton, 1983. – P. 13–14.
9. *Coto Э.* Иной путь : Невидимая революция в третьем мире / Эрнандо де Сото ; пер. с англ. Б. Пинскер ; авт. введ. М. В. Льюса. – М. : Catallaху, 1995. – 320 с.
10. *Савин В.* Некоторые аспекты экономической безопасности России / В. Савин // Международный бизнес России. – 1995. – № 9. – С. 14–16; *Экономическая безопасность России* / под ред. В. К. Сенчагова. – 2-е изд. – М. : Дело, 2005. – С. 110–111.
11. *Мунтіян В. І.* Економічна безпека України / В. І. Мунтіян. – К., 1999. – 464 с.; *Концепція економічної безпеки України* // Економіст. – 1998. – № 7/9. – С. 63–82; *Павловський М. А.* Стратегія розвитку суспільства : Україна і світ (економіка, політологія, соціологія) / М. А. Павловський. – К. : Техніка, 2001. – 312 с.
12. *Методика* розрахунку рівня економічної безпеки України : затверджена наказом Мініекономіки України від 2.03.2007 р. № 60 [Електронний ресурс]. – Режим доступу: [uazakon.com/documents/date_1a/pg_ibcnog/](http://me.kmu.gov.ua/control/uk/publish/article?art_id; Про затвердження Методики розрахунку інтегральних регіональних індексів економічного розвитку : наказ Державного комітету статистики України від 15.04.2003 р. № 114 [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <a href=)
13. *Сухоруков А. І.* Нормативний підхід до оцінювання рівня економічної безпеки держави / А. І. Сухоруков // Економічна безпека держави: міждисциплінарний підхід : монографія / за наук. ред. д. е. н., проф. Є. В. Хлобистова. – Черкаси : видавець Ю. А. Чабаненко, 2013. – С. 26–40.
14. *Сухоруков А. І.* Теоретико-методологічний підхід до інтегральної оцінки та регулювання економічної безпеки держави / А. І. Сухоруков, Ю. М. Харазішвілі // Банківська справа. – 2011. – № 4. – С. 13–32.
15. *Система* економічної безпеки держави / за заг. ред. А. І. Сухорукова / Нац. ін-т проблем міжнар. безпеки. РНБО України. – К. : Стилос, 2009. – 685 с.
16. *Система* економічної безпеки держави / за заг. ред. д. е. н., проф. А. І. Сухорукова / Нац. ін-т проблем міжнар. безпеки. РНБО України. – К. : Стилос, 2010. – С. 366–394.
17. *Методичні* рекомендації щодо оцінки рівня економічної безпеки України / за ред. А. І. Сухорукова ; Нац. ін-т проблем міжнар. безпеки. – К, 2003. – 63 с.
18. *Харазішвілі Ю. М.* Теоретичні основи системного моделювання соціально-економічного розвитку України : монографія / Ю. М. Харазішвілі. – К. : ТОВ «Поліграф-Консалтинг», 2007. – 324 с.