

МЕТОДИЧНІ ЗАСАДИ ІДЕНТИФІКАЦІЇ ЗАГРОЗ ЕКОНОМІЧНІЙ БЕЗПЕЦІ ДЕРЖАВИ

О.А. Маслій, кандидат економічних наук.

Полтавський національний технічний університет імені Юрія Кондратюка

© Маслій О.А., 2017.

Стаття отримана редакцією 09.12.2017 р.

Вступ. В умовах глобалізації пріоритетним завданням державної політики країн з відкритою економікою є формування надійної системи забезпечення економічної безпеки держави, основоположними компонентами якої є запобігання, нейтралізація та зниження негативного впливу загроз на рівень економічної безпеки держави. Пасивне забезпечення економічної безпеки України, побудоване на реагуванні на відхилення від безпечних рівнів і компенсації збитків від впливу загроз, а не на функціонуванні механізму забезпечення на основі випереджаючого управління, призвело до системної економічної кризи в державі та функціонування національної економіки лише завдяки значній інерції. Тому формування методичних положень до ідентифікації загроз економічній безпеці України на етапі їх виникнення набуває особливої актуальності в сучасних соціально-економічних умовах.

Огляд останніх джерел досліджень і публікацій. Проблеми забезпечення економічної безпеки держави досліджуються у працях українських та зарубіжних науковців у цій сфері, зокрема В. Гейця, О. Барановського, М. Єрмошенка, В. Сенчагова, Є. Олейникова, О. Власюка, В. Передборського, А. Сухорукова, З. Варналія, С. Онищенко й багатьох інших. Проте, незважаючи на актуалізацію проблем економічної безпеки, аналіз останніх джерел досліджень і публікацій дозволяє дійти висновку про відсутність системного підходу, фрагментарність теоретико-методичних засад забезпечення економічної безпеки та перебування методики ідентифікації загроз економічній безпеці держави на стадії формування.

Постановка завдання. У рамках формування системи забезпечення економічної безпеки держави метою дослідження є вдосконалення методичних засад ідентифікації загроз економічній безпеці України, які враховують критерії спрямованості, сфери та ймовірності виникнення загроз, із використанням порівняльного та кореляційно-регресійного аналізу індикаторів економічної безпеки держави.

Основний матеріал і результати. Формування конкурентоспроможної національної економіки є фундаментальною основою політики забезпечення економічної безпеки держави. У Стратегії сталого розвитку «Україна – 2020», схваленій Указом Президента України від 12 січня 2015 року № 5/2015 [1], забезпечення сталого розвитку держави визначено вектором розвитку України, для чого необхідно відновити макроекономічну стабільність, забезпечити стійке зростання економіки екологічно невиснажливим способом, створити сприятливі умови для ведення господарської діяльності та прозору податкову систему.

Проте реалізація реформ і програм розвитку держави в рамках названого вектора відбувається під впливом зовнішніх та внутрішніх викликів, ризиків і загроз. Виявлення реальних та потенційних загроз економічній безпеці національної економіки потребує системного моніторингу макроекономічних явищ і аналізу їх впливу на рівень економічної безпеки. У цьому контексті, як засвідчує зарубіжний досвід, значну роль відіграють так звані «незалежні мозкові центри» («think tank»). Зокрема, в США такими питаннями значною мірою займається корпорація RAND, у Нідерландах – Гаагський центр стратегічних досліджень, у Великобританії – аналітичний центр DEMOS. Такі мозкові центри, які існують у країнах з розвинутою економікою, на запит відповідних урядових структур, котрі приймають управлінські рішення, направлені на забезпечення економічної безпеки національної економіки, на початковому етапі аналізують та здійснюють моніторинг ситуації, що склалася в окремому секторі безпеки, і надають попередні рекомендації. На наступному етапі створюються робочі групи з розроблення сценаріїв загроз та генерування управлінських рішень.

Характер і форма прояву сучасних викликів та загроз потребує міжнародного співробітництва у сфері протидії їм, оскільки ефективне реагування на нові загрози, виклики і небезпеки в умовах тісного співробітництва, взаємозв'язку та взаємозалежності країн у глобалізованому економічному середовищі стало неможливим у межах однієї, навіть надзвичайно потужної держави. Тому в кінці 2011 року на тлі економічної та фінансової кризи у Європейському Союзі було введено процедуру виявлення макроекономічних дисбалансів (Macroeconomic Imbalance Procedure – MIP), що є інструментом оперативного виявлення загроз економічній безпеці країн-членів ЄС. Із цією метою було обрано невеликий перелік (з одинадцяти показників) релевантних, практичних, простих, вимірних і доступних індикаторів, який періодично переглядається, зважаючи на наявні та прогнозні

тенденції в розвитку економіки. Були встановлені порогові значення індикаторів, котрі підлягають періодичному коригуванню (табл. 1) [6].

На основі нової наглядової процедури із запобігання й усунення макроекономічних дисбалансів відбувається виявлення раптових порушень макроекономічних пропорцій у короткостроковому періоді, а також здійснюється виявлення поступового виникнення й поширення диспропорцій у довгостроковій перспективі.

На основі такого методичного підходу до раннього виявлення макроекономічних диспропорцій у країнах ЄС здійснюється запобігання реалізації загроз економічній безпеці.

Таблиця 1

Перелік установлених Європейським Союзом у 2011 році показників, що охоплюють основні джерела макроекономічних дисбалансів, та порядок їх розрахунку

№ зп	Індикатор	Indicators	Порядок розрахунку	Порогове значення
1	Сальдо поточного рахунку платіжного балансу, відсоток до ВВП (середня зміна за 3 роки)	3 year backward moving average of CURRENT ACCOUNT BALANCE as % of GDP	$\frac{\left(\frac{CA}{GDP}\right)_t + \left(\frac{CA}{GDP}\right)_{t-1} + \left(\frac{CA}{GDP}\right)_{t-2}}{3} * 100$	-4 – 6%
2	Чиста міжнародна інвестиційна позиція, відсоток до ВВП	NET INTERNATIONAL INVESTMENT POSITION as % of GDP	$\frac{NIIP_t}{GDP_t} * 100$	-35%
3	Реальний ефективний обмінний курс на основі ІСЦ стосовно 42 інших промислово розвинених країн (зміна у відсотках за 3 роки)	% change (3 years) of REAL EFFECTIVE EXCHANGE RATE with HICP deflators relative to 42 other industrial countries	$\frac{(REER_HICP_35)_t - (REER_HICP_35)_{t-3}}{(REER_HICP_35)_{t-3}} * 100$	+/-5% (країни-члени ЄС) та +/-11% (інші країни)
4	Частка експорту (зміна у відсотках за 5 років)	% change (5 years) in EXPORT MARKET SHARES	$\frac{\left(\frac{EXP_c}{EXP_{world}}\right)_t - \left(\frac{EXP_c}{EXP_{world}}\right)_{t-5}}{\left(\frac{EXP_c}{EXP_{world}}\right)_{t-5}} * 100$	-6%
5	Номинальна вартість одиниці праці (зміна у відсотках за 3 роки)	% change (3 years) in NOMINAL UNIT LABOUR COST	$\frac{(ULC)_t - (ULC)_{t-3}}{(ULC)_{t-3}} * 100$	9% (країни-члени ЄС) 12% (інші країни)
6	Щорічна процентна зміна індексу цін на житло	y-o-y % change in DEFLATED HOUSE PRICES INDEX	$\left(\frac{\frac{HPI_t}{DEFL_t} - \frac{HPI_{t-1}}{DEFL_{t-1}}}{\frac{HPI_{t-1}}{DEFL_{t-1}}} \right) * 100$	6%
7	Кредитування приватного сектора, відсоток до ВВП	PRIVATE SECTOR CREDIT FLOW as % of GDP	$\frac{PSCF_t}{GDP_t} * 100$	14%
8	Борг приватного сектора, відсоток до ВВП	PRIVATE SECTOR DEBT as % of GDP	$\frac{PSDL_t}{GDP_t} * 100$	133%
9	Борг державного сектора, відсоток до ВВП	GENERAL GOVERNMENT DEBT as % of GDP	$\frac{GGDL_t}{GDP_t} * 100$	60%
10	Рівень безробіття, середній за 3 роки	3 year backward moving average of UNEMPLOYMENT RATE	$\frac{(UR)_t + (UR)_{t-1} + (UR)_{t-2}}{3}$	10%
11	Щорічна процентна зміна загального обсягу фінансових зобов'язань фінансового сектора	% y-o-y change in TOTAL FINANCIAL SECTOR LIABILITIES	$\left(\frac{\frac{HPI_t}{DEFL_t} - \frac{HPI_{t-1}}{DEFL_{t-1}}}{\frac{HPI_{t-1}}{DEFL_{t-1}}} \right) * 100$	16,5%

Джерело: складено автором за даними European Commission [6].

Так, за результатами 2015–2016 років усі країни-члени ЄС згруповано за рівнем впливу загроз, на основі чого надано обов'язкові для виконання рекомендації щодо усунення виявлених макроекономічних дисбалансів у рамках забезпечення економічної стабільності єврозони.

Використовуючи Методичні рекомендації щодо розрахунку рівня економічної безпеки України, затверджені наказом Міністерства економічного розвитку і торгівлі України 29.10.2013 № 1277 [2], було запропоновано методичний підхід до виявлення та оцінювання динаміки загроз економічній безпеці національної економіки (рис. 1).

Виявлення загроз економічній безпеці України й оцінювання їх впливу на стан економічної безпеки держави здійснюється за кожною складовою системи економічної безпеки шляхом

зіставлення індикаторів безпеки, визначених в офіційних методичних рекомендаціях щодо розрахунку рівня економічної безпеки України (фактори прямого впливу), з їх характеристичними значеннями – кількісними величинами, порушення яких викликає несприятливі або загрозливі тенденції в економіці.

Наявність значного відхилення від критичного значення свідчить про позитивний чи негативний вплив на значення субіндексу певної складової економічної безпеки (не відповідає задовільному значенню – небезпечна зона, відповідає – безпечна зона). За наявності відхилення фактичного значення індикатора від його критичного значення формується абсолютно небезпечна зона безпеки.

Водночас ступінь впливу залежить від динаміки його зміни, яка може бути однією з таких видів: позитивна, негативна або незмінна. Таким чином, невідповідність величини індикатора його граничному значенню є негативним внеском в інтегральний рівень, водночас позитивна динаміка в цілому може бути позитивним фактором впливу на нього.

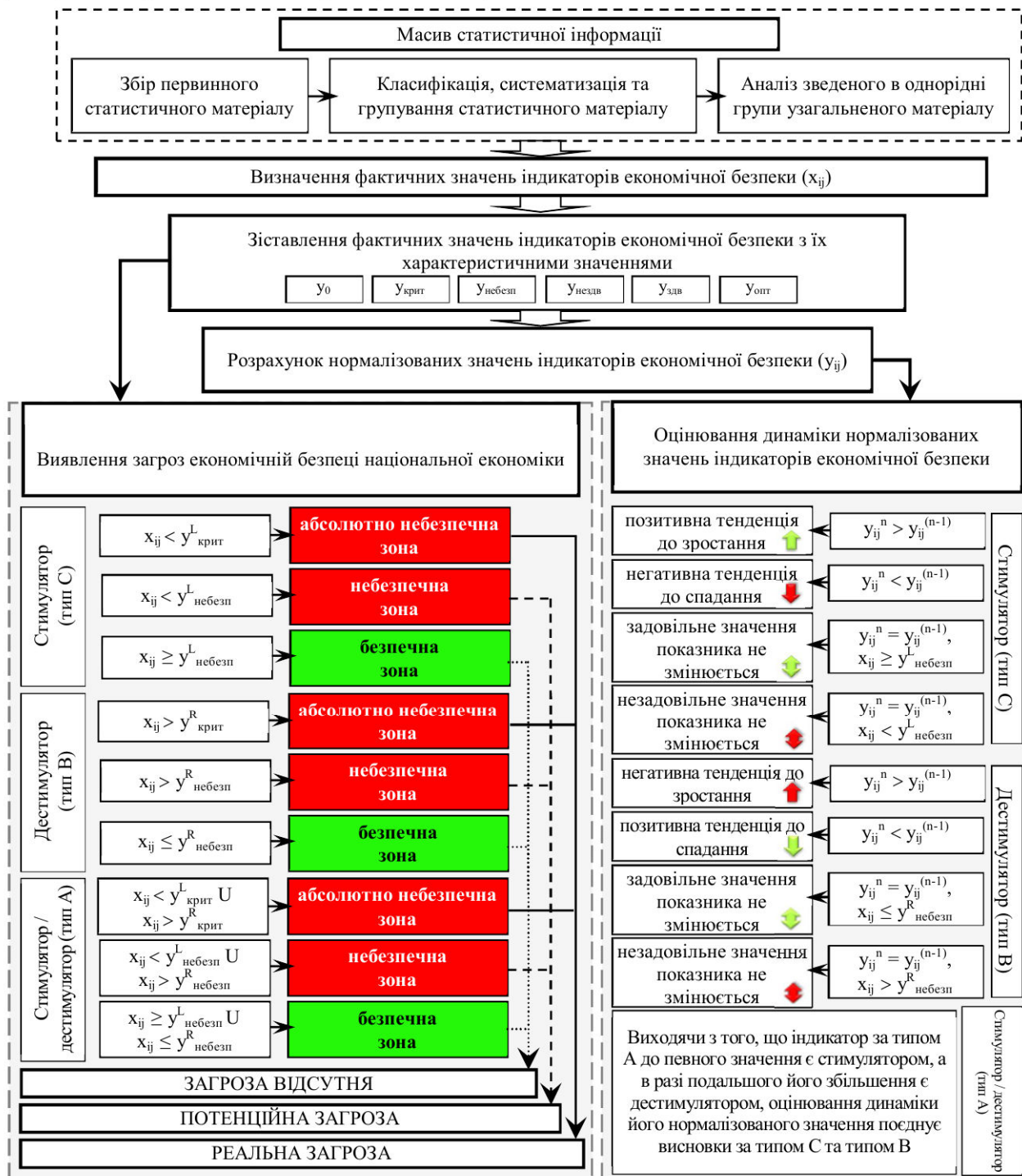


Рис. 1. Методичний підхід до ідентифікації та оцінювання загроз економічній безпеці держави

Джерело: розроблено автором

Відповідно до запропонованого автором методичного підходу для раннього виявлення потенційних та реальних загроз економічній безпеці України було використано їх характеристичні значення. У процесі ідентифікації загроз економічній безпеці України було виявлено проблему відсутності зон безпеки й небезпеки для кожного з індикаторів, а також некоректного визначення меж, у яких перебувають нормалізовані значення індикаторів економічної безпеки, що не дозволяє здійснити розмежування загроз на реальні та потенційні. Для прикладу, якщо обсяг валового зовнішнього боргу становить 59,9% ВВП або менше, то за цим параметром має місце безпечна зона, проте при збільшенні такого показника лише на 0,17 в.п. (до 60% ВВП) виникає загроза економічній безпеці національної економіки.

З метою усунення цього недоліку пропонується здійснити розмежування зон, у яких перебувають фактичні значення індикаторів економічної безпеки, на основі системи критичних обмежень з метою виявлення й розмежування реальних і потенційних загроз економічній безпеці національної економіки.

Зона безпеки за кожним індикатором формується при перебуванні його фактичного значення в межах 80 – 100% оптимального (при перевищенні задовільного значення $x_{здов}$) й характеризується стійкістю, рівновагою та розвитком системи економічної безпеки національної економіки, високим рівнем захисту національних економічних інтересів, відсутністю загроз.

На межі між станом безпеки й небезпеки слід виділити потенційно небезпечну зону, яка за кожним індикатором формується при перебуванні його фактичного значення в межах 40 – 80% оптимального значення, тобто в діапазоні $(x_{небезп}, x_{здов}]$. Перебування індикатора в потенційно небезпечній зоні сигналізує про наявність потенційної загрози, при цьому система економічної безпеки починає відчувати наявність змін, проте в цілому рівень захисту національних економічних інтересів вважається задовільним.

Зона небезпеки за кожним індикатором формується при перебуванні його фактичного значення в межах 20 – 40% оптимального значення, тобто в діапазоні $(x_{крит}, x_{небезп}]$. Перебування індикатора в небезпечній зоні сигналізує про наявність реальної загрози, низький рівень захисту національних економічних інтересів, при цьому система економічної безпеки починає розбалансовуватися, тобто зазнає змін, що ведуть до її знищення.

Абсолютно небезпечна зона за кожним індикатором формується при перебуванні його фактичного значення в межах 0 – 20% оптимального значення (нижче критичного значення $x_{крит}$). Перебування індикатора в абсолютно небезпечній зоні сигналізує про наявність реальної загрози, яка за тривалістю деструктивного впливу є системною, відсутність захисту національних економічних інтересів, при цьому система економічної безпеки зазнає руйнування внаслідок нищівних структурних змін.

Проте цей розподіл є умовним, оскільки ідентифікація та раннє виявлення загроз економічній безпеці за її індикаторами здійснюються в динаміці, й наближення фактичного значення індикатора до потенційно небезпечної зони сигналізує про зростання ймовірності виникнення потенційної загрози та потребує відповідних заходів з її запобігання в системі забезпечення економічної безпеки держави.

Проте динамічність, взаємозв'язок і залежність системи економічної безпеки від вхідних впливів зовнішнього середовища, а також внутрішніх структурних змін створює необхідність оцінювання динаміки виявлених загроз економічній безпеці національної економіки з метою запобігання реалізації потенційних загроз, адже ситуативне перебування фактичних значень окремих індикаторів у межах допустимих значень не гарантує формування безпечної зони в кожному із наступних періодів. Відповідно динаміка нормалізованих значень індикаторів економічної безпеки сигналізує про можливість виникнення загроз.

Оцінювання тенденцій негативних факторів впливу на систему економічної безпеки дозволяє спрогнозувати розвиток реальних і потенційних загроз економічній безпеці, що є основою формування пріоритетних напрямів забезпечення економічної безпеки національної економіки на основі раннього виявлення та запобігання реалізації загроз.

Результати виявлення й оцінювання динаміки загроз економічній безпеці національної економіки на основі авторського методичного підходу засвідчують, що 66 із 128 індикаторів економічної безпеки України, що становить 51,6% від загальної їх кількості, мають у 2016 році фактичні значення, нижчі за граничне значення ($u_{небезп}$), тобто вказують на наявність потенційних та реальних загроз під впливом яких формується небезпечна зона безпеки (нижче 0,4, або 40 % оптимального значення).

Відхилення від критичної межі ($u_{крит}$) фактичних значень 40 (чи 50,6 %) із зазначених індикаторів указує на наявність відповідних реальних загроз економічній безпеці національної економіки та впливає на формування мінімального або абсолютно небезпечного рівня економічної безпеки.

Визначені загрози можна класифікувати не лише за сферами виникнення та ймовірністю реалізації (реальні чи потенційні), а й за місцем виникнення (зовнішні чи внутрішні), терміном дії, тривалістю деструктивного впливу, ступенем небезпеки та іншими ознаками.

Погоджуючись із твердженням, що «...загроза економічній безпеці у суспільній свідомості проходить три стадії: усвідомлення загрози, реакція на усвідомлену загрозу і відповідь на загрозу» [8, с. 25–26], маємо переконання, що моделювання загроз економічній безпеці національної

економіки є ключовим елементом стратегічного планування у сфері забезпечення економічної безпеки національної економіки. Усвідомлення загрози залежить від пріоритетних національних економічних інтересів та цінностей суспільства, а реакція на усвідомлену загрозу – від вірогідності її виникнення й рівня впливу на систему економічної безпеки національної економіки. Виходячи із цього має бути вдосконалена система оцінювання рівня економічної безпеки України, що базується на своєчасному виявленні та передбаченні загроз.

Система оцінювання рівня економічної безпеки національної економіки має бути чітко структурована на організаційну, інформаційну, аналітичну й управлінську підсистеми, які у свою чергу складаються з окремих елементів (рис. 2).

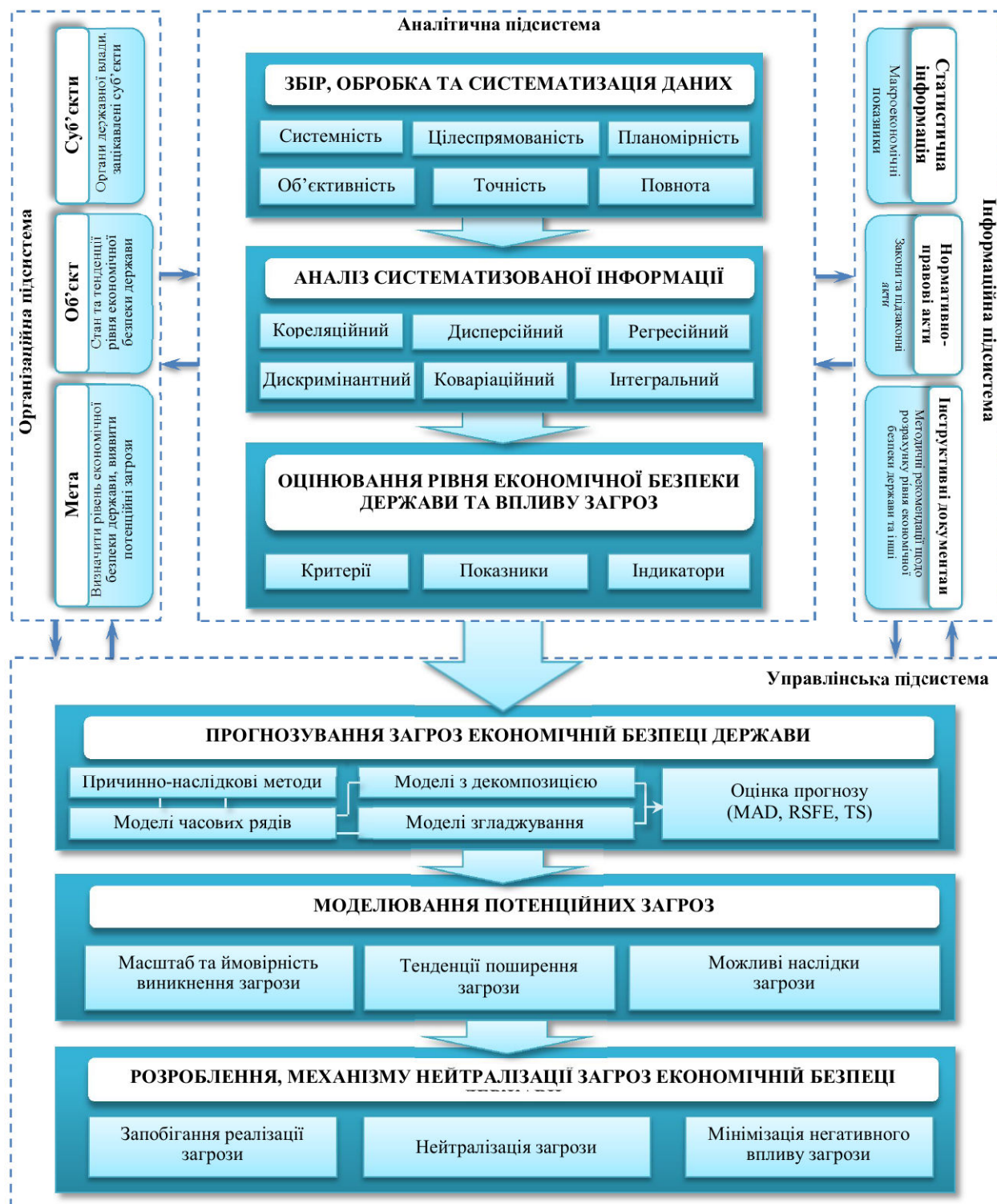


Рис. 2. Система оцінювання рівня економічної безпеки держави, що базується на своєчасному виявленні та передбаченні загроз

Джерело: розроблено автором.

Функціонування аналітичної підсистеми моніторингу економічної безпеки національної економіки, яка включає збір, обробку та систематизацію вихідних макроекономічних показників, з метою оцінювання рівня економічної безпеки національної економіки шляхом узагальнення систематизованої інформації методами регресійного, кореляційного, дисперсійного, дискримінантного, коваріаційного й інтегрального аналізу, забезпечується організаційною підсистемою, яка визначає мету, об'єкт і суб'єкти моніторингу економічної безпеки національної економіки, а також інформаційною підсистемою з чітким переліком статистичної інформації, нормативно-правових актів та інструктивних документів діагностики.

При цьому особливого значення набуває визначення рівня впливу загроз на інтегральний показник економічної безпеки держави, виходячи з чого відбувається розроблення механізму нейтралізації загроз шляхом їх моделювання й прогнозування. З практичної точки зору рівень загрози має пряму кореляційну залежність із збитком від неї та обсягом ресурсів, необхідних для її нейтралізації в рамках визначеного механізму.

Тенденції поширення загрози в рамках їх моделювання будуються на основі динаміки явищ, подій чи процесів, що є джерелами загроз, починаючи з виникнення суперечностей у ході реалізації національних економічних інтересів, етапу їх загострення, врегулювання й ліквідації негативних наслідків. При цьому принципово важливим є виявлення моменту переростання загрози з потенційної в реальну з метою запобігання цьому явищу.

Перевагами запропонованої системи оцінювання рівня економічної безпеки держави є такі:

- 1) можливість своєчасного оперативного виявлення й ідентифікації загроз за результатами комплексного проблемного аналізу та всебічного моніторингу макроекономічних явищ і процесів;
- 2) упровадження стратегічного планування у сфері забезпечення економічної безпеки держави шляхом прогнозування тенденцій поширення та впливу загроз на рівень економічної безпеки держави;
- 3) перехід від орієнтовного переліку гіпотетично можливих загроз у нормативно-правових актах з питань економічної безпеки держави до пріоритетних напрямів її забезпечення в рамках реалізації превентивного підходу.

Висновки. В умовах зовнішніх і внутрішніх викликів державна політика в економічній сфері має бути спрямована на запобігання реалізації загроз економічній безпеці держави та недопущення їх негативного впливу шляхом своєчасного виявлення й передбачення загроз.

Застосування процесу ідентифікації та оцінювання тенденцій загроз через динаміку нормалізованих значень індикаторів економічної безпеки держави дозволяє виявити тенденції реальних і потенційних загроз економічній безпеці на макrorівні, здійснити прогнозування їх подальшого розвитку на коротко- та середньострокову перспективу, що є основою формування пріоритетних напрямів забезпечення економічної безпеки держави.

ЛІТЕРАТУРА:

1. Про Стратегію сталого розвитку «Україна – 2020» [Електронний ресурс] / Указ Президента України від 12 січня 2015 року № 5/2015 // Верховна Рада України. – Режим доступу: <http://zakon5.rada.gov.ua/laws/show/5/2015>.
2. Методичні рекомендації щодо розрахунку рівня економічної безпеки України [Електронний ресурс] / Наказ Мінекономрозвитку України від 29.10.2013 № 1277 // Міністерство економічного розвитку і торгівлі України. – Режим доступу: <http://me.kmu.gov.ua/>
3. Варналій З.С. Економічна безпека України: проблеми та пріоритети зміцнення: монографія / З.С. Варналій, Д.Д. Буркальцева, О.С. Саєнко. – К.: Знання України, 2011. – 299 с.
4. Система економічної безпеки держави / за заг. ред. А.І. Сухорукова // Нац. ін-т проблем міжнар. безпеки РНБО України. – К.: ВД «Стилос», 2010. – 685 с.
5. Барановський О. І. Фінансова безпека в Україні (Методологія оцінки та механізм забезпечення): автореф. дис. на здобуття наук. ступеня докт. екон. наук: 08.04.01 / О.І. Барановський; Інститут економічного прогнозування НАН України. – К., 2000. – 36 с.
6. Scoreboard For The Surveillance of Macroeconomic Imbalances [Електронний ресурс] / European Commission. – Режим доступу: http://ec.europa.eu/economy_finance/publications/occasional_paper/2012/pdf/ocp92_en.pdf
7. Онищенко С.В. Загрози економічній безпеці України: сутність, оцінювання та механізм упередження: монографія / С.В. Онищенко, О.А. Пугач. – Полтава: ПолтНТУ, 2015. – 337 с.
8. Обґрунтування концептуальних та організаційно-правових засад розробки паспортів загроз національній безпеці України: навч.-метод. посіб. / авт. кол.: Г.П. Ситник, В.І. Абрамов, В.А. Мандрагеля та ін.; за заг. ред. Г.П. Ситника. – К.: НАДУ, 2012. – 52 с.
9. Економічна безпека держави: оцінювання та стратегічні орієнтири забезпечення [монографія] / О.В. Комеліна, С.В. Онищенко, А.В. Матковський, О.А. Пугач. – Полтава: ПолтНТУ, 2013. – 202 с.

10. Качинський А.Б. Індикатори національної безпеки: визначення та застосування їх граничних значень: монографія / А. Б. Качинський. – К. : НІСД, 2013. – 104 с.

11. Varnaliy Z. Preventing threats as a precondition to increase the level of Economic Security of the State / Z. Varnaliy, S. Onyshchenko, O. Masliy // ScienceRise : Scientific Journal. – 2016. – № 7/1(24). – P. 41–46.

UDC 339.9

Masliy Alexandra, PhD (Economics), Senior lecturer of Finance and Banking, Poltava National Technical Y.Kondratyuk University. **Methodical principles of identifying threats to economic security of the state.** The basic principles of threats identification and prediction have been defined to ensuring the economic security of the state. Ensuring economic security of the state based on situational respond to threats that have already arisen involves their elimination and neutralization of negative influence on them. However, in terms of a significant number of challenges, risks and threats, such an approach is inefficient, and this raises necessity to prevent threats to the state economic security by early threats identification.

The tools of operational detection the threats to state economic security have been considered. It was proposed to implement disengagement zones for actual values of the economic security indicators on the basis of the critical constraints to identify and differentiation of real and potential threats.

The system of assessing the state economic security level, based on timely detection and anticipation of threats, has been improved. Operational leveling threats and the principle of precaution provides for early detection of threats using internal and external information environment of economic security of the state. Using such conceptual approach to the economic security of Ukraine has several advantages, in particular the possibility to prevent the conversion of potential threats into real ones by means of early detection at the stage of their formation and to minimize their negative influence on the system of economic security of the state.

Keywords: economic security of the state, threat, threats identification, evaluation of state economic security, threats, preventing threats.

УДК 339.9

Маслій Олександра Анатоліївна, кандидат економічних наук. Полтавський національний технічний університет імені Юрія Кондратюка. **Методичні засади ідентифікації загроз економічній безпеці держави.** Розглянуто інструментарій оперативного виявлення загроз економічній безпеці. Обґрунтовано методичний підхід до ідентифікації й оцінювання загроз економічній безпеці держави. Удосконалено систему оцінювання рівня економічної безпеки держави, що базується на своєчасному виявленні та передбаченні загроз.

Ключові слова: економічна безпека держави, загроза, ідентифікація загроз, оцінювання рівня економічної безпеки держави, запобігання реалізації загроз.

УДК 339.9

Маслий Александра Анатольевна, кандидат экономических наук. Полтавский национальный технический университет имени Юрия Кондратюка. **Методические основы идентификации угроз экономической безопасности государства.** Рассмотрен инструментарий оперативного выявления угроз экономической безопасности. Обоснован методический подход к идентификации и оценке угроз экономической безопасности государства. Усовершенствована система оценки уровня экономической безопасности государства, которая базируется на своевременном выявлении и предвидении реализации угроз.

Ключевые слова: экономическая безопасность государства, угроза, идентификация угроз, оценивание уровня экономической безопасности государства, предотвращение угроз.