

УДК 351.863 (477): 351.84

Копытко М.И.

доктор экономических наук, доцент, доцент кафедры менеджмента,
Львовский государственный университет внутренних дел, Украина
marta_kernytska@ukr.net

Левкив Г.Я.

доктор экономических наук, доцент, профессор кафедры менеджмента,
Львовский государственный университет внутренних дел, Украина
levguru81@yandex.ua

Виничук М.В.

кандидат экономических наук,
старший преподаватель кафедры финансов и учета,
Львовский государственный университет внутренних дел, Украина
vinichukm@i.ua

МАКРОЭКОНОМИЧЕСКАЯ БЕЗОПАСНОСТЬ УКРАИНЫ: ПРОБЛЕМНЫЕ АСПЕКТЫ ИССЛЕДОВАНИЯ И ПЕРСПЕКТИВЫ УКРЕПЛЕНИЯ

В статье определены основные проблемы макроэкономической безопасности Украины. С помощью программных пакетов MS Excel и Statistica 8,0 проведено исследование основных показателей макроэкономической безопасности страны. Для обеспечения экономической стабильности в Украине предложено осуществить стабилизационную политику, методом «магического четырехугольника» Парето, который целесообразно дополнить еще одной компонентой – объемом прямых иностранных инвестиций в экономику Украины, что позволяет осуществлять тактический и стратегический контроль и реализовывать оперативные решения в процессе обеспечения экономической безопасности государства.

Ключевые слова: экономическая безопасность, макроэкономическая безопасность государства, теневая экономика, четырехугольник Парето, экономическая стабилизация.

М. Копытко

Doctor Habilitatus of Economics, Assistant Professor,
Assistant Professor of Management Department,
Lviv State University of Internal Affairs
marta_kernytska@ukr.net

G. Levkiv

Doctor Habilitatus of Economics, Assistant Professor,
Professor of Management Department,

Lviv State University of Internal Affairs

levguru81@yandex.ua

M. Vinichuk

PhD, Senior lecturer of Accounting and Auditing,

Lviv State University of Internal Affairs Ukraine

vinichukm@i.ua

MACROECONOMIC SECURITY OF UKRAINE: CHALLENGES AND PROSPECTS ASPECTS OF RESEARCH STRENGTHENING

In the article describe problems of macroeconomic security of Ukraine. With software packages MS Excel 8.0 and Statistica studied the key indicators of macroeconomic security. Proposed to ensure economic stability in Ukraine implementation of stabilization policy, by "magic quadrangle" Pareto is advisable to add another component – the volume of direct foreign investments in Ukraine, which allows you to make tactical and strategic control and implement operational decisions in the course of economic security state.

Keywords: economic security, macroeconomic security, shadow economy, "Pareto quadrilateral", economic stabilization.

1. Постановка проблемы. Современный этап развития мировой экономики, глобализация экономических процессов и стремление Украины интегрироваться в европейское экономическое пространство обуславливают возникновение ряда угроз, которые оказывают непосредственное влияние на макроэкономическую стабильность страны и снижают уровень макроэкономической безопасности государства. Обострение военного конфликта на Востоке Украины, оккупация Автономной Республики Крым и рост численности вынужденно перемещенных лиц спровоцировали углубление процессов социального неравенства, бедности и безработицы населения, рост уровня теневой экономики, размер которой по официальным данным Министерства экономического развития и торговли Украины, только в 2015 составлял 41 % ВВП, а в 2016 г. – 38 % ВВП [1]. При таких негативных тенденциях снижается уровень как экономической, так макроэкономической безопасности государства, что, в свою очередь, приводит к повышенной чувствительности экономики к внутренним и внешним опасностям. Рост уровня макроэкономической стабильности становится действенным

приоритетом устойчивого социально-экономического развития страны и актуализирует тему исследования.

2. Анализ последних публикаций. Проблемы макроэкономической безопасности Украины рассматриваются в трудах таких ученых как Т. Васильцев, А. Власюк, В. Геец, Я. Гончарук, Я. Жалило, А. Иляш, Е. Крихтин, Э. Либанова, Г. Пастернак-Таранушенко, С. Пирожков, В. Сенчагов, А. Сухоруков, М. Флейчук. Однако, до сих пор существует немало ряд дискуссионных вопросов относительно методов исследования макроэкономической безопасности Украины.

3. Цель исследования. Исследование тенденций макроэкономической безопасности Украины в контексте укрепления экономической безопасности государства.

4. Основные результаты исследования. Обеспечение европейских стандартов качества жизни населения и достижение достаточного уровня национальной безопасности является приоритетной задачей каждой страны мира независимо от ее экономического, социального и политического развития. В социально-ориентированном демократическом обществе существенные изменения социально-экономического характера формируются внешними и внутренними факторами, оказывающими существенное влияние на возникновение угроз национальным интересам страны. Достижения государством высоких значений макроэкономических показателей с помощью продуманной и действенной фискальной и монетарной политики в условиях непосредственного влияния на экономические процессы обострения военного конфликта на Востоке Украины, аннексии АРК и углубление чрезвычайно жесткого экономического кризиса остается ключевой задачей государственного регулирования. Негативное влияние на уровень экономической безопасности в среднесрочной перспективе имеет углубление прецессионных процессов в экономике Украины, обострение угроз нарушения территориальной целостности и неприкосновенности Украины из-за непредсказуемости развития событий. При таких условиях в стране нерешенной остается проблема

мобилизации в бюджет средств для выполнения функций и обязательств государства. С целью обеспечения развития рыночной экономики и преодоления деформаций в ее структуре Украине необходимо преодолеть несовершенство государственной денежно-кредитной политики в части:

- сбалансированности сбережений и инвестиций, контроля непрерывности процесс потери одних источников финансовых поступлений в бюджет и поиск других;

- пересмотра неэффективной политики стабилизации национальной денежной единицы и ограничения ее зависимости от политики Национального банка Украины и правительства;

- повышения финансовой и управленческой дисциплины;

- снижения уровня теневизации экономики;

- минимизации нецелевых расходов, расточительства, хищения государственных средств манипулирования политическими группами в сфере денежно-кредитных отношений;

- повышения объемов иностранного инвестирования в экономику страны и правильного распределения привлеченных финансовых инвестиций [2].

Отмеченные выше проблемные аспекты национальной экономики создают предпосылки для разбалансированности совокупного спроса и предложения и способствуют развитию макроэкономического неравновесия, что требует поиска новых подходов в принятии неотложных мер по укреплению макроэкономической безопасности Украины и актуализирует задачу исследования современных проблем макроэкономической безопасности государства.

Проведенные исследования макроэкономических явлений и процессов показывают, что макроэкономическая безопасность является качественно новым и малоисследованным направлением научного поиска. Национальная экономика способна сохранять и поддерживать достаточный уровень сбалансированности под воздействием как внутренних, так и внешних угроз. Общее рыночное равновесие достигается при условии сбалансированности

отдельных взаимосвязанных рынков как составляющих социально-экономической системы страны. В данном контексте социально-экономическое равновесие определяется таким состоянием страны, при котором достигается высокий уровень благосостояния (с учетом рациональной дифференциации по доходным группам населения), сохраняются и улучшаются экологические условия жизни, становятся доступными культура, образование, медицина и др. Для достижения основных стратегических социальных целей макроэкономическая система должна обладать собственным равновесием и внутренней устойчивостью, которые достигаются лишь тогда, когда ограниченные ресурсы используются полностью и эффективно, а их распределение по сферам и отраслям экономики соответствует достижению как стратегических, так и тактических социально-экономических целей страны [3].

Таким образом, можна констатировать, что для отечественной экономики принципиально важно обеспечение достаточного уровня макроэкономической безопасности государства (под которой, согласно Методическим рекомендациям по расчету уровня экономической безопасности Украины № 1277 от 29 октября 2013 г. [4], понимается состояние экономики, при котором достигается сбалансированность макроэкономических воспроизводимых пропорций). Оценку состояния и прогнозирования интегрального показателя уровня макроэкономической безопасности в Украине, мы предлагаем проводить на основе трендовой модели (аппроксимации) с использованием пакета Excel (рис. 1).

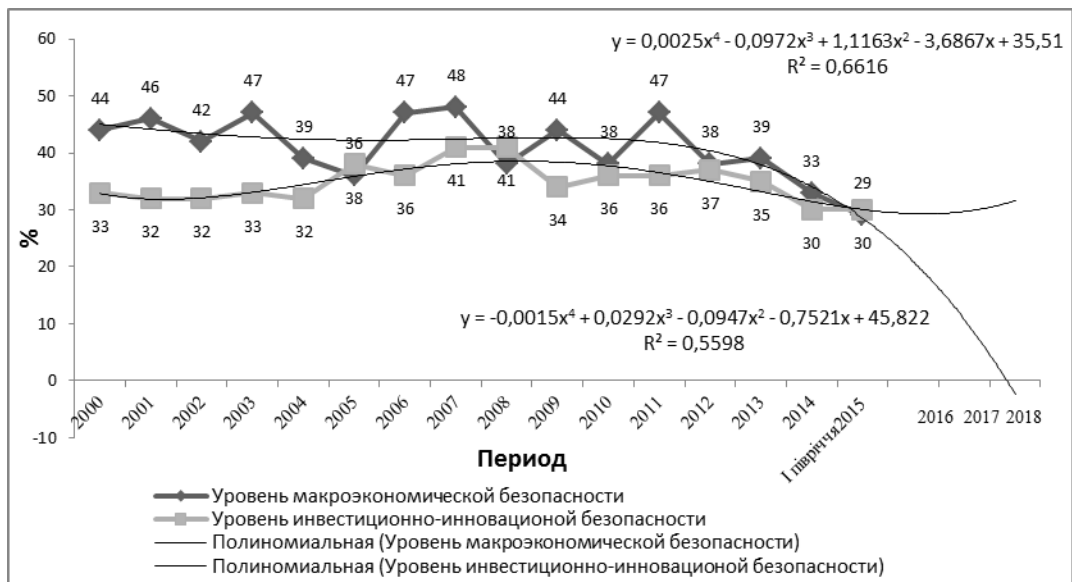


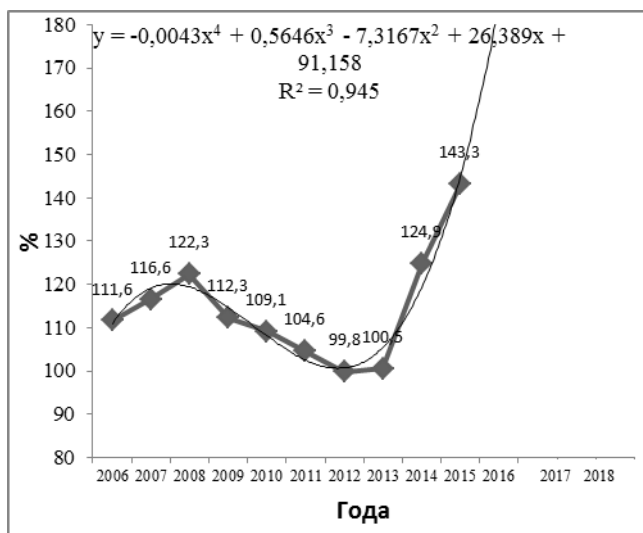
Рис. 1. Динамика уровней макроэкономической и инвестиционно-инновационной безопасности в Украине, 2000-2018 гг. (2017-2018 гг. - прогнозируемые оценки)

Рассчитано по: [5]

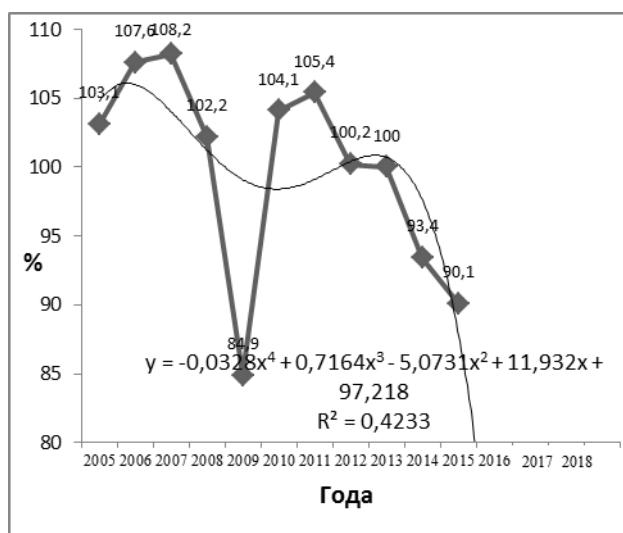
В результате проведенного прогнозирования на основе трендовой модели (аппроксимации) установлено достоверное снижение уровня макроэкономической безопасности до 12 % в 2018 г., что обусловлено значительным влиянием экономического кризиса, истощением финансовых ресурсов государства и существенным снижением уровня жизни населения.

Одновременно целесообразно отметить, высокий уровень тенизации и криминализации национальной экономики, уголовно-клановая система распределения общественных благ, коррумпированность всех ветвей власти, чрезмерная зависимость от внешних рынков и неэффективное управление государственным долгом препятствуют достижению макроэкономического равновесия в стране. Одним из рациональных способов решения проблемных аспектов экономической стабильности в Украине может стать эффективное осуществление стабилизационной политики методом «магического четырехугольника» Парето, сущность которого заключается в повышении ответственности власти за умеренный и стабильный рост ВВП (3-4 %); за высокий уровень занятости (уровень безработицы – 3-7 %); за стабильность цен и денежного обращения (1 % в год); за внешнеэкономическое равновесие

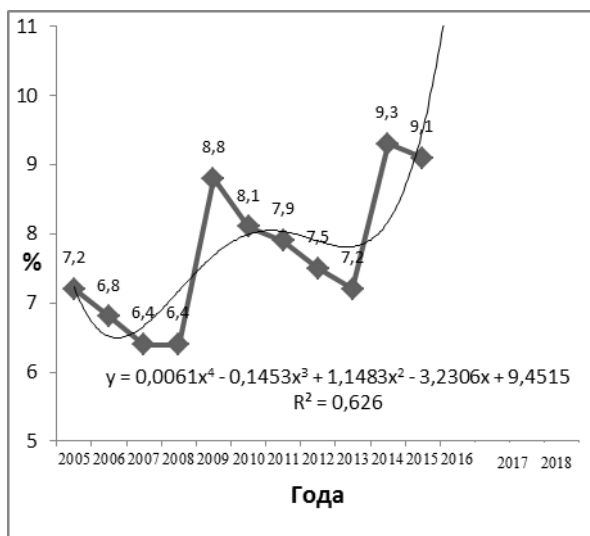
(положительное сальдо) [6, с. 23]. Разработка эффективной стабилизационной политики позволит повысить жизненный уровень населения и достичь желаемого уровня социально-экономического развития. Мы предлагаем рассматривать макроэкономическую безопасность государства, дополнив «четыреугольник Парето» еще одной компонентой – объемом прямых иностранных инвестиций в экономику Украины (рис. 2).



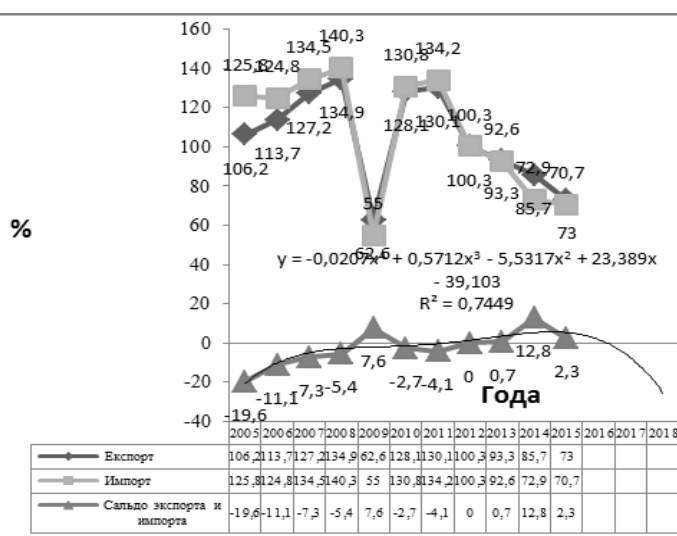
а) Индекс потребительских цен



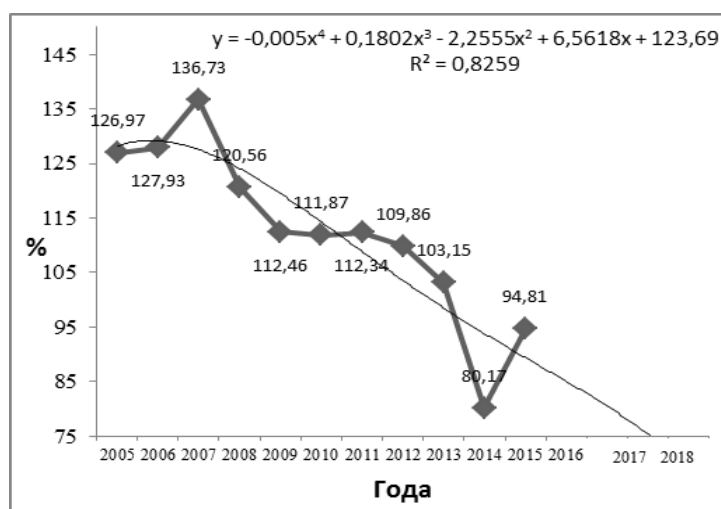
б) Валовой внутренний продукт



в) Уровень безработицы населения (по методологии МОТ)



г) Внешнеэкономическая равновесие



д) Прямые иностранные инвестиции (акционерный капитал) в экономике Украины

Рис. 2. Четырехугольник Парето для Украины, 2005-2018 гг. (2017-2018 гг. - прогнозируемые оценки), дополненный пятой компонентой

Рассчитано по: [7; 8]

Для исследования влияния факторов на уровень макроэкономической безопасности Украины мы предлагаем использовать экономико-логические методы, одним из которых является факторный анализ, осуществляемый с помощью программного пакета Statistica 8,0.

Факторный анализ – один из методов элиминирования, который включает: метод цепных подстановок; метод абсолютных разниц; метод относительных разниц, метод долевого участия и др. Элиминирование – означает устранение, исключение влияния всех, кроме одного, факторов на величину результирующего показателя. Этот прием базируется на условии из условного признания того, что все факторы изменяются независимо друг от друга: сначала изменяется один, а все остальные остаются без изменения; затем меняются два; затем три и т.д. при неизменных других. Это позволяет определить влияние каждого фактора в отдельности на величину исследуемого показателя в отдельности. Один из самых распространенных приемов элиминирования – способ цепных подстановок, который заключается в определении влияния отдельных факторов на изменение величины результирующего показателя с помощью постепенной замены базисной величины каждого факторного показателя в факторной модели на фактическую величину за отчетный период.

Необходимо и целесообразно проанализировать проследить влияние на уровень макроэкономической безопасности таких факторов как: индекс потребительских цен, валовой внутренний продукт, уровень безработицы населения и внешнеэкономическое равновесие.

Для расчета влияния первого фактора (количественного) на результирующий показатель необходимо абсолютный прирост этого фактора ($\Delta y' = y_i - y_{i-1}$) умножить на базисный уровень второго фактора (и всех остальных, которые включает модель). Влияние второго фактора на результирующий показатель рассчитывается умножением фактического значения первого фактора на абсолютный прирост второго фактора (т.е. того фактора, влияние которого исследуется); а если в модели есть другие факторы, то умножать следует на базисное значение тех факторов, влияние которых еще не изучали. Влияние третьего фактора (и всех последующих) определяется как произведение фактического значения первого и второго факторов на абсолютный прирост исследуемого третьего фактора. Количество таких подстановок определяют количеством анализируемых факторов.

Описанный выше прием основывается на функциональной зависимости между изучаемым показателем (y) и факторами, влияющими на его уровень ($x_1, x_2, x_3, \dots, x_n$). Расчет значения результирующего показателя проводится за базисный и отчетный периоды по формулам:

$$y_0 = a_0 \cdot b_0 \cdot c_0 \cdot d_0; \quad (1)$$

$$y_1 = a_1 \cdot b_1 \cdot c_1 \cdot d_1 \quad (2)$$

Общее отклонение этого показателя за отчетный период по сравнению с базисным определяется по формуле

$$\Delta y = y_1 - y_0, \quad (3)$$

а влияние изменения отдельных факторов описывается следующими зависимостями:

$$\Delta y_a = (a_1 - a_0) \cdot b_0 \cdot c_0 \cdot d_0; \quad (4)$$

$$\Delta y_b = a_1 (b_1 - b_0) \cdot c_0 \cdot d_0; \quad (5)$$

$$\Delta y_c = a_1 b_1 (c_1 - c_0) \cdot d_0; \quad (6)$$

$$\Delta y_d = a_1 b_1 c_1 \cdot (d_1 - d_0). \quad (7)$$

На завершающем этапе необходимо осуществить балансовую проверку результатов проведенных расчетов по формуле:

$$\Delta y = \Delta y_a + \Delta y_b + \Delta y_c + \Delta y_d. \quad (8)$$

Результаты проведенного анализа влияния изменения различных факторов на уровень макроэкономической безопасности дают основания для вывода, что индекс потребительских цен, валовой внутренний продукт, уровень безработицы населения и внешнеэкономическое равновесие в 2014 г. по сравнению с 2013 г. повысили уровень макроэкономической безопасности на 0,089%, а в 2015 г. по сравнению с 2014 г. – на 0,074 %. Увеличение уровня макроэкономической безопасности в этом периоде было вызвано влиянием других факторов, в частности, разницей между индексами производительности труда в Украине и реальной среднемесячной заработной платой; соотношением реальных доходов населения к ВВП; соотношением объема заработной платы к объему социальной помощи и других полученных текущих трансфертов.

Существенное влияние на уровень макроэкономической безопасности обусловлено также противоречивыми изменениями отдельных индикаторов, а именно: индекса потребительских цен, уровня безработицы, сокращение реальной заработной платы, уменьшение социальных выплат и беспрецедентный рост уровня теневой экономики. Наряду с этим, система международных экономических отношений находится в состоянии глубокого, самого масштабного со времен окончания Второй мировой войны, кризиса. Агрессия против Украины возбудила правовые вопросы и вопросы безопасности с целью разработки механизмов поддержания стабильности и равновесия на мировой политической арене [9, с. 403; 10].

5. Выводы. Систематизация результатов проведенного исследования позволяет сделать вывод, что современное состояние макроэкономической безопасности Украины остается критическим, несмотря на перманентное

реформирование экономической политики в контексте обеспечения устойчивого макроэкономического развития. Финансовая глобализация и обострение вопросов последовательной интеграции экономики Украины (динамика которой в 2013-2016 гг. в значительной мере определялась европейскими экономическими тенденциями и приоритетами отечественной внешнеэкономической и интеграционной политики) в мировое экономическое сообщество имеет первостепенное значение при определении уровня макроэкономической безопасности Украины. Первоочередной задачей власти является разработка действенного механизма укрепления макроэкономической безопасности государства.

Литература

1. Тенденції тіньової економіки в Україні I квартал 2016 р. Офіційна веб-сторінка Міністерства економіки і економічного розвитку і торгівлі. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <http://www.me.gov.ua>.
2. Круш П.В. Гроші та кредит: навч. посібник / П.В. Круш, В.О. Клименко. К.: ЦУЛ, 2010. – 215 с.
3. Небава М.І. Макроекономічна рівновага в моделі сукупного попиту і сукупної пропозиції. Стабілізаційна політика. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: http://posibnyku.vntu.edu.ua/makro_ek/43.htm.
4. Наказ Міністерства економічного розвитку і торгівлі України «Про затвердження Методичних рекомендацій щодо розрахунку рівня економічної безпеки України» № 1277 від 29.10.2013. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <http://www.me.gov.ua>.
5. Офіційна веб-сторінка Міністерства економіки, економічного розвитку і торгівлі. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <http://www.me.gov.ua>.
6. Вінчук М.В. Роль стабілізаційної політики держави у зміцненні соціальної безпеки на посттрансформаційному етапі розвитку економіки / М. В. Вінчук // Науковий вісник Львівського державного університету внутрішніх справ. Серія економічна: збірник наукових праць. – Львів: ЛьВДУВС, 2013. – Вип. 2. – С. 18–28.
7. Офіційна веб-сторінка Государственной службы статистики Украины. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <http://www.ukrstat.gov.ua>.
8. Офіційна веб-сторінка Всемирного Банка. [Електронний ресурс]. – Режим доступу: <http://www.worldbank.org>.

9. Аналітична доповідь до Щорічного Послання Президента України до Верховної Ради України «Про внутрішнє та зовнішнє становище України в 2015 році». – К. : НІСД, 2015. – 684 с.

10. Копитко М.І. Економічна безпека підприємств з виробництва транспортних засобів: монографія / М.І. Копитко. – К.: «Ліга-Прес», 2015. – 556 с.