

1. Monitoring parameters of the level of economic security of Ukraine/ I.P.Moiseenko, N.O. Ryvak //Actual Problems of Economics. Scientific economic journal. №11(137).-2012.- p. 95-103.

УДК 331.101.262

Мойсеєнко І.П., Ривак Н.О.

ПАРАМЕТРИ МОНІТОРИНГУ РІВНЯ ЕКОНОМІЧНОЇ БЕЗПЕКИ УКРАЇНИ

В статті здійснено опис підходів до вибору параметрів системи раннього попередження кризи. Проаналізовано стан впливу фінансових параметрів на рівень економічного розвитку України. Описано особливості вибору параметрів моніторингу рівня економічної безпеки в умовах технологічного глобалізму.

Ключові слова: економічна безпека, індекси сталого розвитку, індикатори вимірювання рівня економічної безпеки, параметри моніторингу.

Moiseenko I.P., Rivak N.O.

PARAMETERS OF MONITORING THE LEVEL OF ECONOMIC SECURITY OF UKRAINE

The article describes the approaches to the choice of parameters of the early warning system of the crisis. The state of influence of fiscal parameters on the level of economic development of Ukraine is analyzed. The peculiarities of the choice of parameters for monitoring the level of economic security in the conditions of technological globalism are described.

Key words: economic security, indices of sustainable development, indicators of measuring the level of economic security, monitoring parameters.

Мойсеенко И.П., Рывак Н.О.

ПАРАМЕТРЫ МОНИТОРИНГА УРОВНЯ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ БЕЗОПАСНОСТИ УКРАИНЫ

В статье описаны подходы к выбору параметров системы раннего предупреждения кризиса. Проанализировано состояние влияния финансовых параметров на уровень экономического развития Украины. Описаны особенности выбора параметров мониторинга уровня экономической безопасности в условиях технологического глобализма.

Ключевые слова: экономическая безопасность, индексы постоянного развития, индикаторы измерения уровня экономической безопасности, параметры мониторинга.

Постановка проблеми. Для мобілізації і реалізації економічного потенціалу

українського суспільства з ціллю успішного виходу з економічної та фінансової кризи доцільно формування моделі розвитку української економіки з використанням основ теорії потенціалів та теорії безпеки. Концепція економічної безпеки України повинна забезпечити перехід від забезпечення безпеки функціонування до забезпечення безпеки розвитку держави. Реалізація концепції економічної безпеки України потребує комплексного рішення питань організаційного, нормативно-правового, наукового, методологічного, аналітичного й інформаційного забезпечення діяльності в цій сфері. Державна стратегія реалізації економічної безпеки України повинна бути орієнтована на формування системи національних інтересів і цінностей стосовно стандартів життя, функціонування суб'єктів господарювання та розвиток суспільства[1,2].

Державна політика передбачає використання теоретико-методологічних основ концепції формування економічної безпеки: визначення характеристик та класифікації внутрішніх і зовнішніх загроз та ризиків; ідентифікація і моніторинг факторів, які загрожують соціально-економічній системі держави; визначення критеріїв і параметрів, які характеризують національні та державні економічні інтереси [3].

З погляду теорії систем економічна безпека — це властивість економічної системи, що характеризує її стан та має бути представленою за критеріальною оцінкою. Суть економічної безпеки розкривається в системі критеріїв і показників. Критерій — це кількісна або якісна ознака, на основі якої виконується оцінка стану, порівняння альтернатив, класифікація об'єктів, явищ. Критерії економічної безпеки виражаються показниками (індикаторами), а саме числовою характеристикою певної властивості економічного об'єкта, процесу або рішення. Критеріальна ознака економічної безпеки може бути виражена, як оцінка стану економіки щодо найважливіших процесів, що відображають її суть щодо реалізації національних економічних інтересів

Аналіз останніх публікацій і досліджень.Першим і найскладнішим кроком побудови національної системи раннього попередження кризи є вибір із множини економічних індикаторів тих, що дозволяють з великою вірогідністю завчасно виявити можливе настання фінансової нестабільності. Моніторинг таких показників сприяє нівелюванню загроз стабільного функціонування економіки та є основою прийняття рішень при коригуванні економічної політики [1-4,7].

Існує дуже багато різних методик оцінки ризику, проте спільною у них залишилась проблема вибору індикаторів.Досліджень у даному напрямку представлені в таблиці 1[3-4].

Підходи до вибору макропоказників вимірювання нестабільності

	Системи показників	Показники вимірювання
1	Показники валютних криз	Для ідентифікації були поділені на чотири групи: внутрішні змінні, міжнародні змінні, показники, які

		характеризують зовнішній борг та зовнішній світ
2	Індикатори передвісники банківської кризи	показники: внутрішньої макроекономічної політики, зовнішніх економічних умов, внутрішньої фінансової структури, режим обмінного курсу та показники, що характеризували проблеми нагляду та управління
3	Показники валютної та банківської кризи	рівень фінансової лібералізації в країнах, розвитку монетарної сфери, рахунки поточних операцій та капіталу з платіжного балансу, змінні реального сектора, фіскальні змінні
4	Макропоказники фінансової безпеки	валютний курс, експорт, умови торгівлі, інфляція, монетарні агрегати, світові відсоткові ставки
5	Макропоказники економічного розвитку	темп зростання ВВП, золотовалютні резерви, реальний обмінний курс, сальдо рахунку поточних операцій, експорт, зовнішній борг, внутрішній кредит, реальна відсоткова ставка, інфляція, відтік капіталу, пропозиція грошей, умови торгівлі.
6	Система моніторингу оцінки загроз стабільності економічного розвитку	групи: реальний сектор; платіжний баланс; фінансовий сектор; банківський сектор
7	Система моніторингу фінансової стабільності	Темп зростання ВВП, динаміка промислового виробництва, сальдо поточного рахунку платіжного балансу, золотовалютні резерви, зовнішній борг, параметри грошового та валютного ринку

Складено за даними [4,5]

Моніторинг Інституту економіки та прогнозування призначений для проведення якісного аналізу основних макроекономічних показників з метою оцінки ризику виникнення стабільності загроз економічного розвитку України.

Моніторингова система реалізує якісний підхід до визначення змінних, за динамікою яких можна передбачити кризу. Якісний (аналітичний) підхід базується на *графічному порівнянні динаміки фундаментальних економічних показників у період кризи, перед та після кризи і у спокійному стані.*

Ускладнює проблему ідентифікації загроз наступної кризи велика кількість факторів, що характеризує причини та джерела кризових явищ, і тому в кінцевому рахунку це є стримуючим чинником формування чіткого переліку показників системи раннього попередження. Особливі труднощі викликає включення детермінант, які характеризують вразливість економіки, але не завжди можуть бути виміряні кількісно. Це й інституційні фактори, політична ситуація, показники світового/глобального розвитку (природні катаклізми, конфлікти, війни) й т. ін. Серед таких детермінант також і характеристики, які описують поведінку суб'єктів ринку - виробників, споживачів, а також його регуляторів.

У міжнародній практиці для оцінки такого суб'єктивного фактора використовуються різного роду індекси очікувань (наприклад, індикатор чутливості споживачів чи показник рівня ділової активності в країні), що базуються на результатах соціологічних опитувань[9,10].

В практиці США активно використовуються аналогічні індекси, зокрема: Індекс ділової активності Національної Асоціації Менеджерів, індекс ділової активності Федерального резервного банку в Атланті, індекс довіри споживачів[4,5,9,10].

У країнах Єврозони широко відомим є індекс рівня ділової активності в країні. В Японії найважливішими індикаторами є: 1) умови ведення бізнесу, 2) виробництво та збут, 3) попит/пропозиція, рівень цін; 4) доходи; 5) прямі інвестиції; 6) зайнятість; 7) податкові умови[4].

Для адекватного і вчасного виявлення загроз в Україні у контексті врахування суб'єктивного фактора очікувань кількісну та якісну його характеристику у період кризи найкраще показують результати двох соціологічних опитувань:

- *"Ділові очікування підприємств України"*, яке проводить Національний банк України і що містить узагальнену інформацію про оцінки керівників підприємств України щодо їх поточної та майбутньої ділової активності, інфляційних та курсових очікувань, змін економічної ситуації в країні;

- *"Індекс споживчих настроїв"*, що проводить українська дослідницька компанія *GfK Ukraine* та Міжнародний центр перспективних досліджень, які на підставі вибіркового обстеження домашніх господарств країни дають характеристику споживчих настроїв, поточного становища та економічних й інфляційних очікувань населення[6,8,9].

Отже, суперечливість багатьох теоретико-методологічних аспектів потребує теоретичного обґрунтування і розробки цілої низки нових категорій, критеріїв та індикаторів, що дадуть змогу описати і проаналізувати базисні тенденції зміни параметрів економічної безпеки. Лише поєднання теоретичних засад і концепцій з практичними діями дасть можливість створити надійний механізм забезпечення економічної безпеки.

Цілі дослідження: обґрунтування вибору параметрів моніторингу економічного розвитку та безпеки держави.

Невирішені проблеми. Вибір та оновлення множини показників, що свідчить про настання періоду фінансової нестабільності в економічному розвитку країни, а також значний обсяг операцій з їхнього постійного моніторингу вимагають методологічного та методичного опрацювання підходів до вибору параметрів системи раннього попередження кризи та ідентифікації загроз економічної безпеки держави

Основні результати дослідження. Необхідність побудови системи раннього попередження для України в принципі є доцільною, оскільки зменшує часовий лаг між самою оцінкою ризиків та можливістю прийняття

рішень. Розроблення власної національної системи дає перевагу порівняно із використанням інформації, отриманої від аналогічних систем з інших країн, оскільки враховує особливості розвитку національної економіки та базується на показниках, що реагують на "чутливі" для України проблеми.

Аналіз показників, що характеризують економічний розвиток України та динаміка параметрів економічної безпеки може свідчити про ймовірність розгортання кризи. Тобто система моніторингу параметрів раннього попередження кризи повинна передбачати розрахунки впливу макропоказників економічного розвитку на параметри економічної безпеки.

Особливості побудови систем раннього попередження кризи такого типу в Україні можуть бути визначені таким чином:

відсутність (та неточність) інформації для ідентифікації великої кількості факторів ризику, що приводить до виключення із розгляду значущих чинників (для опису яких недостатньо інформації);

ірраціональність поведінки економічних агентів у період кризи(інформація про зростання ризиків може сама стати додатковим фактором нестабільності);

можливість різної інтерпретації змін показників в прямій залежності від загального економічного і/чи політичного контексту (зміни можуть трактуватись і як негативна тенденція, і як необхідні позитивні зміни);

неможливість передбачити та оцінити велику кількість ризиків внаслідок того, що з ними не зустрічались раніше;

неповторність криз та параметрів, що їх характеризують через особливості та рівні розвитку країн [1,3,7].

Індикатори економічної безпеки — реальні статистичні показники розвитку економіки країни, які найбільш повно характеризують явища і тенденції в економічній сфері[6,7,8]. Особливу увагу в умовах техноглобалізму слід зосередити на таких загальних індикаторах економічної безпеки: валовий внутрішній продукт (ВВП); темп інфляції; дефіцит бюджету; рівень безробіття; зростання індексів використання освітнього, наукового та інноваційного потенціалу; рівень та якість життя; енергетична залежність; рівень тінізації економіки; рівень податкового навантаження та їх вплив на макропоказники економічного розвитку та параметри економічної безпеки (див. таблицю2, рис.1 та рис.2)тощо.

Таблиця 2

Показники аналізу динаміки непрямих податків та індикаторів економічної безпеки в Україні за 2006-2010 рр.

Показник	Роки					Середньо-річний абсолютний приріст / середньо-річний темп
	2005/2006	2006/2007	2007/2008	2008/2009	2009/2010	

						зростання
Податки на міжнародну торгівлю та зовнішні операції, млрд грн						
Абсолютний приріст	0,24	1,06	0,14	-3,93	0,79	-0,341
Темп зростання/спаду	1,039	1,169	1,019	0,473	1,223	0,936
Акцизний збір, млрд грн						
Абсолютний приріст	-0,21	0,38	-0,04	3,91	1,26	1,059
Темп зростання/спаду	0,973	1,050	0,995	1,487	1,106	1,108
ПДВ, млрд грн						
Абсолютний приріст	11,28	0,52	12,18	-10,49	1,82	3,062
Темп зростання/спаду	1,333	1,012	1,267	0,819	1,038	1,077
Податок на прибуток підприємств, млрд грн						
Абсолютний приріст	-0,11	2,90	3,78	-11,58	0,93	-0,816
Темп зростання/спаду	0,995	1,125	1,145	0,612	1,051	0,962
Непрямі податки, млрд грн						
Абсолютний приріст	11,19	4,87	16,05	-22,08	4,80	2,965
Темп зростання/спаду	1,157	1,059	1,184	0,786	1,059	1,039
Валовий внутрішній продукт, млрд грн						
Абсолютний приріст	46140,29	66281,04	41850,24	-84670,63	45889,25	23098,04
Темп зростання/спаду	1,105	1,136	1,076	0,858	1,090	1,048
Валовий внутрішній продукт на 1 особу, грн						
Абсолютний приріст	1049,15	1487,35	969,81	-1781,51	1058,20	556,598
Темп зростання/спаду	1,112	1,143	1,081	0,862	1,095	1,053
Капітальні інвестиції, млн грн						
Абсолютний приріст	22313,46	37638,75	-164,89	-63038,38	-10959,44	-2842,1
Темп зростання/спаду	1,201	1,282	0,999	0,631	0,898	0,973
Процентні ставки банків у національній валюті (за кредитами), %						
Абсолютний приріст	-1,00	-1,00	3,40	-0,60	-0,20	0,12
Темп зростання/спаду	0,939	0,935	1,236	0,966	0,988	1,007

Складено на основі даних [8,9]

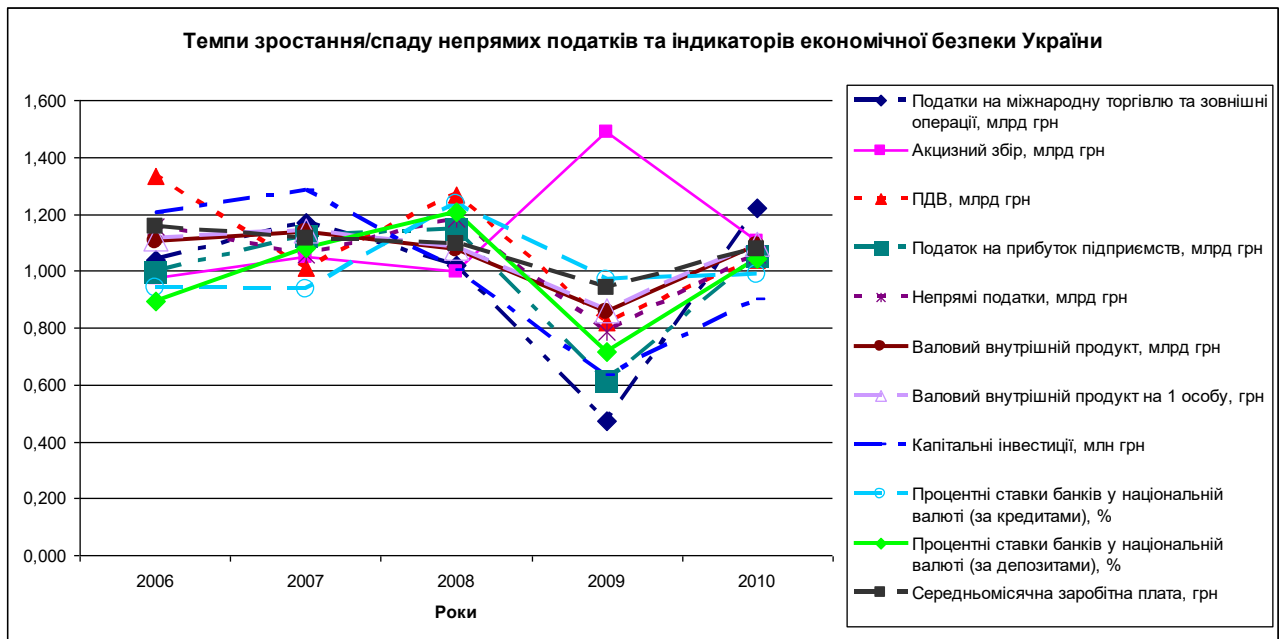


Рис.1 Динаміка фіскальних показників та показників економічної безпеки

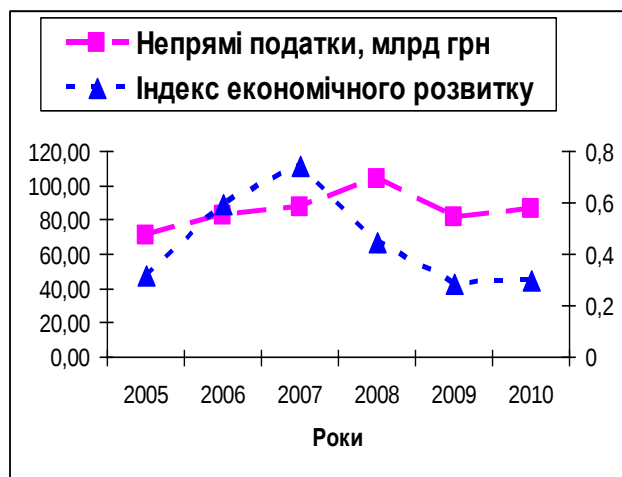


Рис.2 Вплив непрямих податків на індекси економічного розвитку

Головні економічні критерії реалізації заходів стратегії економічної безпеки при ефективному використанні інтелектуального потенціалу держави, на думку авторів, передбачають:

- збільшення частки ВВП, розподіленої на наукоємні галузі та сферу інтелектуальних послуг (динаміка витрат з бюджету);
- випереджаючі темпи зростання сектору інтелектуальних послуг в економіці (динаміка структурних змін);
- зростання фінансування наукових та науко-дослідних робіт за видами діяльності (динаміка витрат);
- зростання обсягів інноваційної діяльності за напрямками, питома вага інноваційного виробництва у ВВП (динаміка);
- постійне збільшення чисельності дослідницького потенціалу;

- постійне збільшення питомої ваги працівників високотехнологічних галузей промисловості;
- зростання середнього рівня освіченості економічно активного населення України;
- зростання мобільності працівників інтелектуальної праці;
- темпи зростання середніх доходів працівників інтелектуальної діяльності у порівнянні з іншими галузями тощо.

Висновки. Серед показників, що були відібрані зарубіжними вченими та які показали високу ефективність як індикатори-передвісники фінансової нестабільності 2008-2009 рр. в Україні, варто назвати: *спред між внутрішньою та зовнішньою ставками відсотка, внутрішній кредит, сальдо поточного рахунку платіжного балансу, інфляція (ІСЦ), золотовалютні резерви.*

До переліку показників, що протестовані за допомогою якісного (аналітичного) методу та які варто включити, окрім вищеназваних, у систему індикаторів моніторингу раннього попередження кризи в Україні, оскільки вони показали реакцію на період фінансової нестабільності і можуть спрацювати як сигнальні (упереджувальні) в наступні кризові епізоди, можна віднести: *темп зростання ВВП і промислового виробництва, валовий зовнішній борг, притік/відтік капіталу, умови торгівлі, грошовий мультиплікатор, реальний ефективний валютний курс, індекс фондового ринку.*

Моніторинг індикаторів доцільно проводити з врахуванням умов техноглобалізму, а значить доповнити індикаторами вимірювання економічної безпеки на основі використання інтелектуального потенціалу держави. Індикатори економічної безпеки не тільки дають можливість кількісно визначити параметри необхідного розвитку економічної системи, а й сформулювати якісні вимоги щодо цілей економічної безпеки та використання різновидів потенціалу розвитку.

1. Основи економічної безпеки України. Колективна наукова монографія за заг. ред. Мойсеєнко І.П.; ЛьвДУВС.-Львів: «СПОЛОМ», 2011.-208с.
2. Барановський О.І. Фінансові кризи: передумови, наслідки і шляхи запобігання: Монографія. - К. : Київ. нац. торг.-екон. ун-т, 2009. - С. 675-715.
3. Мойсеєнко І.П. Особливості формування економічної безпеки України в умовах кризи/ І.П. Мойсеєнко // Збірник наукових праць НУДПСУ, 2011.- №1.-С.345-355.Електронне наукове фахове видання. <http://www.nbuuv.gov.ua>
4. Шумська С.С. Індикатори попередження фінансової кризи 2008-2009 рр. // Сучасна економічна теорія та пошук ефективних механізмів господарювання: III міжнар. наук.-практ. конф., 11-12 березня 2010 р. : матеріали конф. / Тавр. нац. ун-т. ім. В.І.Вернадського. - Сімферополь, 2010. - С. 43-47.
5. Мониторинг финансовой стабильности в развивающихся экономиках (на примере России) / [Трунин П.В., Каменских М.В.]. - М. : ИЭПП, 2007. - 106 с.
6. Єрмошенко, М.М., Горячева К.С. Фінансова складова економічної безпеки:

- Наукова монографія. - К.: Національна академія управління, 2010. - 232 с.
7. Економічна політика: Навч. посіб. / О. О. Беляєв, А. С. Бебело, М. І. Дибба та ін. — К.: КНЕУ, 2004. — 287 с.
 8. Аналіз сталого розвитку глобальний і регіональний контексти: У 2 ч. / Міжнар. рада з науки (ICSU) Наук. кер. М. З. Згуровський.— К.: НТУУ «КПІ», Ч.2 Україна в індикаторах сталого розвитку.-2010.- с.356.
 9. Світовий центр даних з геоінформатики та сталого розвитку (СЦД-Україна). [Електронний ресурс]. – Режим доступу до ресурсу : wdc.org.ua/uk
 10. General report on the Activities of the European Union [Електронний ресурс]. – <http://ec.europa.eu/documents/index>