

8. ECONOMIC SECURITY OF BUSINESS ENTITIES

Verhun A.M.

Ph.D., Art. Lecturer

Kyiv National University of Technology and Design

BASIS OF INTEGRAL EVALUATION OF THE STATE OF ECONOMIC SECURITY

Вергун А. М.

к.е.н., старший викладач

Київський національний університет технологій та дизайну

ОСНОВИ ІНТЕГРАЛЬНОГО ОЦІНЮВАННЯ РІВНЯ ЕКОНОМІЧНОЇ БЕЗПЕКИ ДЕРЖАВИ

Економічна безпека держави є інтегральною характеристикою стану економічної системи, оскільки характеризує ефективність функціонування таких взаємопов'язаних складових як інноваційна, інвестиційна, фінансова, соціальна, енергетична, продовольча, демографічна, зовнішньоекономічна та ін. В той же час, економічна безпека є складовою національної безпеки та керуючою ланкою економічного розвитку та захищеності держави.

Аналіз наукової літератури дав змогу виокремити більше 100 індикаторів для розрахунку рівня економічної безпеки країни, що суттєво ускладнює процес оцінки реального рівня безпеки. З огляду на зазначене, застосування інтегральних індексів, дослідження їх в динаміці та порівняння індикаторів з пороговими значеннями є основним завданням аналізу, що визначає поточний стан соціально-економічного розвитку.

Дослідження наукових робіт таких видатних вчених як О.І. Барановський, О.С. Власюк, З.С. Варналій, А.І. Іларіонов, В.М. Геєць, Б.В. Губський, Я.А. Жаліло, Т.Т. Ковальчук, В.В. Кузьменко, В.І. Мунтіян, С.І. Пирожков, А.І. Сухоруков В.Т. Шлемко та ін. дало можливість прийти до висновку, що для оцінювання рівня економічної безпеки як узагальнюючої характеристики використовуються методи індикативного аналізу, оптимізаційні моделі, теорія нечітких множин, методи дискримінативного аналізу, експертних оцінок, метод скаляризації.

В багатьох працях вітчизняних та зарубіжних науковців розглянуто методичні та методологічні основи аналізу економічної безпеки держави в сучасних умовах, концепції та моделі забезпечення найважливіших складових; проаналізовані загрози та розроблені заходи щодо підвищення рівня економічної безпеки. Однак, з урахуванням важливості досліджень, недостатньо уваги приділяється саме визначенню динаміки інтегрального індексу економічної безпеки та порівняння його з інтегральними пороговими значеннями. Існуючі офіційні методики визначення рівня економічної безпеки не позбавлені недоліків та звужують можливість їх використання. Поряд з окремими перевагами (наприклад, задання вектору порогових значень) співіснує неспроможність їх використання для ідентифікації стану економічної безпеки, що обумовлює розробку відповідних заходів повернення його в діапазон порогових, а краще – оптимальних значень.

Виключенням є тіньові індикатори, які неможливо оцінити в повній мірі через складність, прихованість та наслідки для економіки держави. Але в той же час слід відмітити, що без їх врахування оцінка рівня безпеки держави є неадекватною реальній економіці.

В результаті ґрунтовного аналізу та узагальнення існуючих підходів Міністерством економічного розвитку і торгівлі України та Держстатом України було започатковано методичні підходи до інтегральної оцінки рівня економічної безпеки держави та регіонів. На даний час вказана методика скасована, але вона стала рушійною силою подальшого розвитку діючих Методичних рекомендацій щодо розрахунку рівня економічної безпеки України, затверджених наказом Президента України №1277 від 29.10.2013 р.

Незважаючи на інформаційний, рекомендаційний та роз'яснювальний характер Методичних рекомендацій, детальний аналіз та практичне застосування дало можливість виявити певні недоліки, а саме:

- запропоновано п'ять діапазонів економічної безпеки, що є певною мірою суб'єктивним і необґрунтованим;
- індикатори економічної безпеки визначаються відносно певного оптимального значення, що виключає можливість існування певного діапазону оптимальних значень;
- у разі перевищення фактичних значень індикаторів за оптимальні (для показників-стимуляторів і навпаки – для дестимуляторів), відбувається їх фактичне прирівнювання до 1, що фактично призводить до втрати інформації;
- вагові коефіцієнти індикаторів економічної безпеки визначаються шляхом експертного опитування; у разі істотної парної кореляції найважливішим індикаторам пропонується занижувати питому вагу, що суттєво знижує практичну цінність отриманих результатів.

Для вирішення питання щодо оцінки рівня економічної безпеки держави пропонується використання інтегрального показника рівня економічної безпеки, який би характеризував розвиток в динаміці. Зазвичай, для розрахунку інтегрального показника формується деяка скалярна функція, від окремих індикаторів. Для розрахунку інтегрального показника рівня економічної безпеки держави вказана задача ускладнюється тим, що серед численної кількості показників є як стимулятори, так і дестимулятори.

Для вирішення питання багатокритеріальної оптимізації необхідно вирішити такі основні задачі: нормування індикаторів, обґрунтування вагових коефіцієнтів та визначення їх порогових значень.

Процедура нормування є важливим і необхідним етапом при розрахунку інтегрального показника, яка використовується з метою приведення численної кількості показників до єдиної розмірності. Окрім того, що всі показники мають різні одиниці виміру, що ще й різну спрямованість. Нормування дозволяє привести індикатори різних розмірностей у безрозмірні величини до діапазону від 0 до 1. На практиці використовуються різні методи нормування, але їх суть полягає у тому, що фактичне значення показника порівнюється із еталонною величиною (нормуючим коефіцієнтом). В якості нормуючого коефіцієнта може використовуватись максимальне, мінімальне, середнє чи еталонне значення сукупності. Кожному із зазначених методів нормування притаманні певні недоліки чи переваги, тому доцільно приймати той варіант розрахунку, який дає найменшу помилку (середній квадрат відхилення).

При визначенні вагових коефіцієнтів переважна більшість науковців використовує експертні оцінки, які значною мірою є суб'єктивними, не виключають принципових помилок, що знижує наукову та практичну цінність отриманих результатів. Експертні оцінки зазначених вагових коефіцієнтів обробляються принципами статистики. Результати обробки, зрозуміло, носять суб'єктивний характер, а розраховані експертним шляхом вагові коефіцієнти вважаються постійними, що не завжди відповідає дійсності. Вплив зовнішніх факторів впливає на зміну політичної та економічної ситуації, здійснюються структурні зміни в економіці, тому вагові коефіцієнти теж є динамічними величинами. Для відповідності існуючій ситуації потрібно якомога частіше переглядати експертні оцінки.

Отже, оскільки експертні оцінки не вирішують проблеми, тому потрібно використовувати методи, які можуть бути позбавлені суб'єктивізму чи мінімалізувати його.

Наступним важливим етапом моніторингу є визначення порогових значень індикаторів економічної безпеки, що дозволяє шляхом їх порівняння виявити потенційні "зони небезпеки" та рівні небезпеки (прийнятний ризик – передкризовий стан – кризовий стан), а також визначити умови, необхідні для посилення економічного імунітету держави. Отже, визначення порогових значень тісно пов'язане з поняттям динамічної стійкості системи економічної безпеки і окремих її складових, або з механізмом гомеостазу [1].

Якщо система нездатна відновити свій баланс, вона може перестати функціонувати.

Основним механізмом гомеостазу є зворотній зв'язок: негативний та позитивний.

Гомеостаз у системі економічної безпеки може бути загальносистемним, що забезпечується утриманням інтегрального індексу системи у визначених межах, і частковим, що забезпечується утриманням у визначених межах часткових індексів по кожній складовій системи [2].

Слід зазначити, що трактування гомеостазу як здатність системи до динамічної рівноваги для технічних систем дещо відрізняється для економічних систем. Якщо ми прагнемо забезпечити знаходження інтегрального індексу економічної безпеки у межах порогових або оптимальних значень, то це супроводжується порушенням рівноваги і виникненням нових економічних відносин, які назавжди змінюють попередній стан рівноваги. При цьому економічна система переходить у новий стан, що володіє кращими якісними характеристиками. Тобто, в процесі розвитку змінюється не лише структура системи (склад елементів і зв'язку), але і взаємовідносини між елементами системи і механізми функціонування.

Отже, гомеостаз в економічній системі визначає не тільки здатність до динамічної стійкості для існуючого режиму функціонування, а і здатність до керування – переходу у новий стан економічної рівноваги, тобто керованість економічної системи.

Оптимальні значення індикаторів (нижнє оптимальне, верхнє оптимальне) характеризують допустимий інтервал величин, у межах якого створюються найсприятливіші умови для функціонування держави. Порогові значення індикаторів (нижній поріг, верхній поріг) – це кількісні величини, порушення яких спричинює несприятливі тенденції в економіці держави. Без знання границь безпечних умов життєдіяльності є неможливим захист життєво важливих інтересів об'єктів безпеки [3].

Найчастіше для визначення порогових значень використовуються такі методи: функціональних залежностей (макро/мікроекономічні аналітичні або статистичні рівняння; Ахієзера-Гольца; теорії інформації; “золотого перетину”); макроекономічних моделей нелінійної динаміки (Вейвлет-аналізу); евристичні (“снігової кулі”; аналоговий підхід - орієнтація на показники країн-аналогів; “калібрування”); стохастичні (діагностування: кластерний аналіз, нечітких множин; t – критерію; логістичної регресії; законодавчий підхід (встановлення порогових значень на законодавчому рівні); методи експертних оцінок; врахування оцінок міжнародних організацій. Перевагу варто надавати першим двом методам, і тільки в разі неможливості їхнього застосування – іншим методам.

Отже, для кожного індикатора економічної безпеки задається вектор порогових значень, а саме: нижній поріг, нижнє оптимальне, верхнє оптимальне, верхній поріг. Відмінністю запропонованого підходу є одночасне нормування як індикаторів економічної безпеки, так і їхніх порогових значень. Це дає можливість порівнювати в одному масштабі динаміку інтегрального показника та інтегральних порогових значень, тобто ідентифікувати стан економічної безпеки України, що обумовлює розроблення відповідних заходів повернення його в діапазон порогових, а краще, оптимальних значень. Порогові значення необхідно переглядати залежно від стану економіки й тих завдань, які стоять на певному етапі її розвитку. Інтегральний показник розраховується спочатку для кожного складника економічної безпеки (згортка першого рівня), а потім для економічної безпеки вцілому (згортка другого рівня)

Визначені недоліки існуючих підходів інтегрального оцінювання рівня економічної безпеки України свідчать про необхідність удосконалення офіційних та інших методичних підходів.

Література:

1. Качинський А.Б. Індикатори національної безпеки: визначення та застосування їх граничних значень: монографія / А.Б. Качинський. – К.: НІСД, 2013. – 104 с
2. Прогнозування індикаторів, порогових значень та рівня економічної безпеки України у середньостроковій перспективі; аналіт. доп./ Ю.М. Харазішвілі, Є.В. Дронь. – К.: НІСД, 2014. – 117 с.
3. Качинський А. Б. Засади системного аналізу безпеки складних систем / А. Б. Качинський. – К. : ДП «НВЦ «Євроатлантик- інформ», 2006. – 336 с.