

Горбатов В. М., Григорова-Беренда Л. І.

## ТЕОРЕТИКО-МЕТОДИЧНІ ЗАСАДИ ОЦІНКИ ЗОВНІШНЬОЕКОНОМІЧНОЇ БЕЗПЕКИ УКРАЇНИ

У статті розглядаються проблеми оцінки зовнішньоекономічної безпеки країни. Доведено, що у розв'язанні завдань аналізу, оцінки та моделювання економічної безпеки держави центральне місце посідає проблема вибору системи критеріїв, які б адекватно відображали існуючий стан економіки держави в конкретний момент часу. Розглянуто властивості таких критеріїв. Проаналізовано сутність критеріїв оцінки зовнішньоекономічної безпеки. Розроблено структурну схему оцінки зовнішньоекономічної безпеки держави, згідно з якою зовнішньоекономічну безпеку запропоновано розглядати у сукупності трьох складових: торговельної, фінансово-інвестиційної та банківсько-кредитної. Запропоновано методичний підхід до оцінки зовнішньоекономічної безпеки держави, який базується на розрахунку інтегрального показника безпеки як середньоарифметичного значення його компонент. На базі запропонованого підходу розраховано та проаналізовано рівень інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України в 2010 – 2011 роках та досліджено динаміку рівня часткових показників трьох його складових. Побудовано рівняння лінійної регресійної залежності інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки країни від часу та на базі нього розраховане прогнозне значення показника зовнішньоекономічної безпеки України на 2012 рік.

*Ключові слова:* зовнішньоекономічна безпека, оцінка, країна, критерій, інтегральний показник

*Рис.:* 6. *Табл.:* 1. *Формул.:* 1. *Бібл.:* 15.

**Горбатов Валерій Миронович** – доктор економічних наук, професор, Науково-дослідний центр індустріальних проблем розвитку НАН України (пл. Свободи, 5, Держпром, 7 під'їзд, 8 поверх, Харків, 61022, Україна)

**Григорова-Беренда Лариса Іванівна** – здобувач, Науково-дослідний центр індустріальних проблем розвитку НАН України (пл. Свободи, 5, Держпром, 7 під'їзд, 8 поверх, Харків, 61022, Україна)

УДК 330.341

Горбатов В. М., Григорова-Беренда Л. И.

## ТЕОРЕТИКО-МЕТОДИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ ОЦЕНКИ ВНЕШНЕЭКОНОМИЧЕСКОЙ БЕЗОПАСНОСТИ УКРАИНЫ

В статье рассматриваются проблемы оценки внешнеэкономической безопасности страны. Доказано, что при решении задач анализа, оценки и моделирования экономической безопасности государства центральное место занимает проблема выбора системы критериев, которые бы адекватно отражали существующее положение экономики государства в конкретный момент времени. Рассмотрены свойства таких критериев. Проанализирована сущность критериев оценки внешнеэкономической безопасности. Разработана структурная схема оценки внешнеэкономической безопасности государства, согласно которой внешнеэкономическую безопасность предложено рассматривать в совокупности трех составляющих: торговой, финансово-инвестиционной и банковско-кредитной. Предложен методический подход к оценке внешнеэкономической безопасности государства, который базируется на расчете интегрального показателя безопасности как среднеарифметического значения его компонент. На основе предложенного подхода рассчитан и проанализирован уровень интегрального показателя внешнеэкономической безопасности Украины в 2010 – 2011 годах и исследована динамика уровня частных показателей трех его составляющих. Построено уравнение линейной регрессионной зависимости интегрального показателя внешнеэкономической безопасности страны от времени и на его базе рассчитано прогнозное значение показателя внешнеэкономической безопасности Украины на 2012 год.

*Ключевые слова:* внешнеэкономическая безопасность, оценка, страна, критерий, интегральный показатель

*Рис.:* 6. *Табл.:* 1. *Формул.:* 1. *Библ.:* 15.

**Горбатов Валерий Миронович** – доктор экономических наук, профессор, Научно-исследовательский центр индустриальных проблем развития НАН Украины (пл. Свободы, 5, Госпром, 7 подъезд, 8 эт., Харьков, 61022, Украина)

**Григорова-Беренда Лариса Ивановна** – соискатель, Научно-исследовательский центр индустриальных проблем развития НАН Украины (пл. Свободы, 5, Госпром, 7 подъезд, 8 эт., Харьков, 61022, Украина)

UDC 330.341

Gorbатов V. M., Grigороva-Berenda L. I.

## THEORETICAL AND METHODICAL FOUNDATIONS OF ASSESSMENT OF FOREIGN ECONOMIC SECURITY OF UKRAINE

The article considers problems of assessment of foreign economic security of a country. It proves that when solving the task of analysis, assessment and modelling economic security of a state, the central place belongs to the problem of selection of the system of criteria, which would properly reflect the existing state of economy of states in a specific moment of time. It considers properties of such criteria. It analyses essence of criteria of assessment of foreign economic security. It develops a structural scheme of assessment of foreign economic security of the state, in accordance to which it is offered to consider foreign economic security as a set of three components: trade, financial and investment, and banking and credit ones. It offers a methodical approach to assessment of foreign economic security of the state, which is based on calculation of an integral indicator of security as an arithmetical mean of its components. The proposed approached is used for calculation and analysis of the level of integral indicator of foreign economic security of Ukraine in 2010 – 2011 and study of the dynamics of the level of private indicators of its three components. It builds an equation of linear regression dependence of the integral indicator of foreign economic security of a country on time and it is used as a basis for calculating forecast value of the indicator of foreign economic security of Ukraine for 2012.

*Keywords:* foreign economic security, assessment, country, criterion, integral indicator.

*Pic.:* 6. *Tabl.:* 1. *Formulae:* 1. *Bibl.:* 15.

**Gorbатов Valeriy M.** – Doctor of Science (Economics), Professor, Research Centre of Industrial Problems of Development of NAS of Ukraine (pl. Svobody, 5, Derzhprom, 7 pidyizd, 8 poverkh, Kharkiv, 61022, Ukraine)

**Grigороva-Berenda Larisa I.** – Applicant, Research Centre of Industrial Problems of Development of NAS of Ukraine (pl. Svobody, 5, Derzhprom, 7 pidyizd, 8 poverkh, Kharkiv, 61022, Ukraine)

Інтеграція економіки України до світової економічної системи загострює питання зовнішньоекономічної безпеки, без гарантування якої країна не може бути повноправним учасником світогосподарських зв'язків, посісти належне місце в міжнародному поділі праці та мати належну систему захисту і протидії глобальним викликам її економічної безпеці зокрема та національній безпеці взагалі.

У цих умовах для розробки та впровадження зовнішньоекономічної політики, яка б, з одного боку, була спрямована на забезпечення зростання експорту та стимулювання вітчизняних товаровиробників, а з другого – на забезпечення зовнішньоекономічної безпеки країни, необхідна розробка відповідного інструментарію оцінки зовнішньоекономічної безпеки (ЗЕБ), що дозволяв би визначати загрози ЗЕБ та визначати пріоритетні напрями її підвищення.

Проблеми забезпечення економічної безпеки на різних рівнях ієрархії висвітлені у працях вітчизняних і зарубіжних вчених, таких як: Л. Абалкін, В. Барабін, О. Бельков, В. Богомолов, Н. Вавдіюк, М. Вавринчук, З. Варналій, О. Власюк, В. Геєць, З. Герасимчук, С. Глазьев, Б. Губський, Я. Жаліло, Т. Клебанова, Т. Ковальчук, В. Ліпкан, В. Лапін, В. Литвин, В. Мунтіян, В. Олуйко, Г. Пастернак-Таранушенко, С. Пирожков, В. Пономаренко, В. Предборський, В. Сенчагов, Г. Ситник, А. Сухоруков, О. Татаркін, Н. Фірюліна, А. Чесноков, В. Шлемко, Л. Яремко та інших. Однак, як показав проведений аналіз теорії та практики оцінки зовнішньоекономічної безпеки, сьогодні залишається не розробленою до кінця ціла низка питань, пов'язаних у першу чергу із механізмами оцінки та діагностики зовнішньоекономічної безпеки країни, визначення ступеня діючих та ймовірніших загроз, обґрунтування цілей та перспектив подальшого розвитку в даній сфері, а також прийняття дієвих науково обґрунтованих управлінських рішень.

Аналіз літературних джерел з проблем економічної безпеки країни та правил побудови понять дозволив визначити зовнішньоекономічну безпеку як здатність держави протистояти зовнішнім загрозам, адаптувати та реалізувати свої економічні інтереси на внутрішньому та зовнішніх ринках, створюючи конкурентні переваги, які забезпечують стає економічне зростання [1].

Підходячи до розроблення методики визначення зовнішньоекономічної безпеки країни, необхідно враховувати її системну сутність, оскільки зовнішньоекономічна безпека є частиною економічної безпеки й одночасно як самостійний зовнішній блок взаємодіє з усіма іншими підсистемами національної безпеки і невід'ємна від її внутрішньої сфери.

Як показало дослідження теорії і практики оцінки зовнішньоекономічної безпеки держави, сьогодні більшість науковців використовують методи спостереження основних макроекономічних показників, на основі яких розраховується загальний інтегральний та інтегральні показники її складових, що дає можливість провести комплексний аналіз поточного стану зовнішньоекономічної безпеки та визначити позитивні й негативні тенденції як окремих її складових, так і часткових показників [2].

Побудова системи показників має враховувати багато чинників, через що необхідно окреслити основоположні начала, згідно з якими вони можуть бути об'єднані в одну систему, тобто окреслити принципи побудови показників безпеки. Характеристика кожного компонента системи має спиратися на обмежену кількість показників. Вони можуть бути фізичними, економічними, технічними, інформаційними [3].

Розробка системи критеріїв та параметрів зовнішньоекономічної безпеки має базуватися на використанні наступних загальнометодичних ознак: по-перше, комплексності, необхідності аналізу та урахування всіх сторін об'єкта вивчення; по-друге, системності, урахування низки взаємозв'язків та взаємозалежностей; по-третє, варіантності (альтернативності), виявлення та обґрунтування декількох варіантів виходу з кризової ситуації; по-четверте, прийнятного ризику, тобто виявлення та реалізації доступних заходів по недопущенню виникнення порогових ситуацій [4].

У розв'язанні завдань аналізу, оцінки та моделювання економічної безпеки держави центральне місце посідає проблема вибору системи критеріїв, які б адекватно відображали існуючий стан економіки держави в даний конкретний момент часу, та на їх основі – визначення оцінки забезпечення економічної безпеки. Це дає можливість аналізувати, порівнювати і прогнозувати стан економічної безпеки в часовому просторі [5]. Таким чином, критеріальна оцінка безпеки має містити у собі оцінки: ресурсного потенціалу і можливостей його розвитку; рівня ефективності використання ресурсів, капіталу й праці і його відповідності рівню в найбільш розвинутих і передових країнах, а також рівню, при якому загрози зовнішнього та внутрішнього характеру зводяться до мінімуму; конкурентоспроможності економіки; цілісності території та економічного простору; суверенітету, незалежності і можливості протистояння зовнішнім загрозам [6].

Критерії економічної безпеки є нормативними характеристиками, що мають відповідати таким властивостям [7]:

- вони в кількісній формі відображають загрози економічної безпеки держави;
- мати високу чутливість та мінливість і тому більшу сигнальну здатність попереджувати суспільство, державу та суб'єктів ринку про можливі небезпеки у зв'язку зі зміною макроекономічної ситуації, заходів, які приймаються урядом у сфері економічної політики;
- виконувати функції індикаторів не окремо один від одного, а лише в сукупності, тобто вони взаємодіють між собою в достатньо сильному ступені.

Але для економічної безпеки вирішальне значення мають не самі показники, а їхні граничні (порогові) значення. Граничні значення – це величини, недотримання значень яких перешкоджає нормальному ходу розвитку різних елементів відтворення, призводить до формування негативних та руйнівних тенденцій в області економічної безпеки [8; 9].

Найвищий ступінь безпеки досягається за умови, що весь комплекс показників знаходиться в межах припустимих граничних значень, а граничні значення одного показника досягаються не на шкоду іншим. Слід також зазначити, що граничні значення можуть змінюватися в часі залежно від міжнародної, політичної та військової ситуації, ступеня ймовірності тих або інших загроз, нових науково-технічних відкриттів, вимог людей, суспільства і держави.

Отже, можна зробити висновок, що за межами значень граничних показників національна економіка втрачає здатність до динамічного саморозвитку, конкурентоспроможність на зовнішніх і внутрішніх ринках.

З цього випливає, що ефективне функціонування системи економічної безпеки припускає:

- визначення базових загроз економічній безпеці держави;
- розробку критеріїв системи економічної безпеки держави в цілому;
- розробку спеціальної підсистеми критеріїв економічної безпеки держави, що включає їх граничні значення;
- формування базових складових системи в цілому, що включає перераховані вище критерії, їх граничні значення та коефіцієнти, які характеризують їх співвідношення;

- формування показника, що відображає стан економічної безпеки держави [10].

Перелік порогових значень показників зовнішньоекономічної безпеки має бути суттєво вужче, ніж перелік показників, що використовуються для моніторингу показників зовнішньоекономічної діяльності. З іншого боку, даний перелік має відображати головні сфери економіки країни й виявляти найбільш суттєві загрози її зовнішньоекономічній безпеці. Очевидно, що перелік порогових значень показників зовнішньоекономічної безпеки держави має уточнюватися в залежності від економічної ситуації [11].

Аналіз критеріїв оцінки зовнішньоекономічної безпеки, що використовуються у науковій літературі та нормативних документах вітчизняними та зарубіжними дослідниками, показав, що найбільш живими критеріями є показники, які характеризують зовнішню торгівлю держави та її структуру, інвестиційну діяльність, фінансово-кредитну сферу та науково-технічну діяльність країни.

Таким чином, критеріями зовнішньоекономічної безпеки держави доцільно обрати групу основних показників, які найбільш точно та повно серед наведених відображають стан безпеки держави в даній сфері. Розроблена схема оцінки зовнішньоекономічної безпеки держави подана на рис. 1.

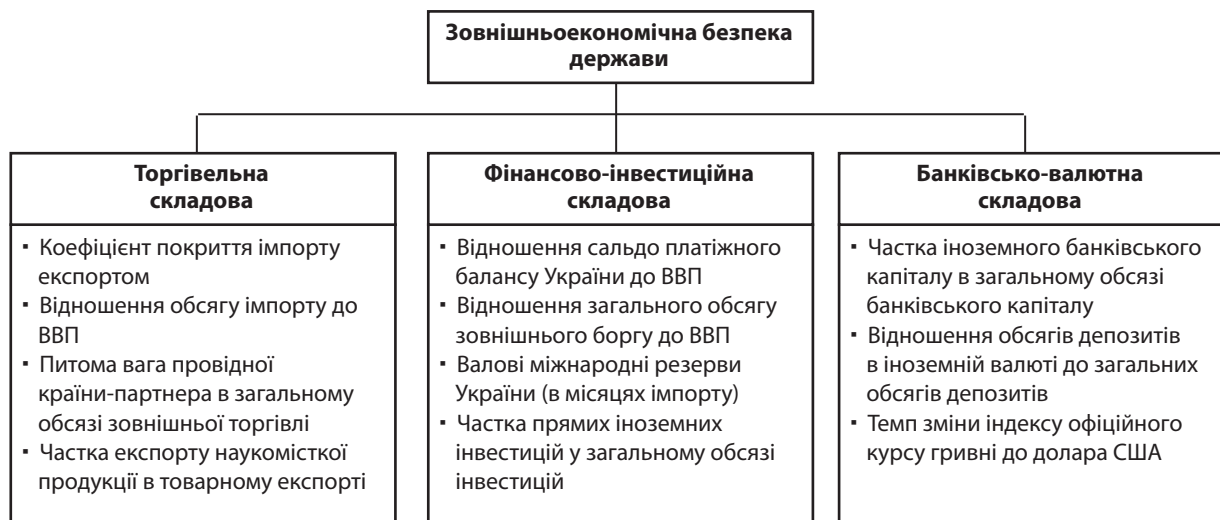


Рис. 1. Структурна схема оцінки зовнішньоекономічної безпеки держави

Оцінка зовнішньоекономічної безпеки держави, згідно зі схемою, складається із трьох складових: торгівельної, фінансово-інвестиційної та банківсько-кредитної безпеки держави.

До першої компоненти зовнішньоекономічної безпеки (торгівельної) увійшли показники макроекономічних характеристик ЗЕД та загальні показники, що відображають географічну спрямованість, науково-технічну сферу та експортну структуру.

До другої компоненти зовнішньоекономічної безпеки (фінансово-інвестиційної) увійшли показники, що характе-

ризують загальне фінансове становище держави та інвестиційну діяльність країни.

До третьої компоненти зовнішньоекономічної безпеки (банківсько-валютної) увійшли показники, що відображають становище банківської системи та валютного ринку держави.

Для більш докладного і системного дослідження зовнішньоекономічної безпеки держави оцінка здійснюється окремо за кожною з її складових шляхом визначення середнього арифметичного відношення часткових показників компонент до їх порогових значень. Загальна оцін-

ка зовнішньоекономічної безпеки держави здійснюється шляхом розрахунку інтегрального показника як середньоарифметичного значення його компонент.

Вихідні дані та розрахунок інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України в 2010 – 2011 роках наведено в табл. 2.

Як видно з табл. 2, у 2011 році рівень інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України становив 69,5%, що на 7,7% нижче за рівень попереднього року. Відбулося суттєве зниження «Фінансово-інвестиційної» складової – 16,9%, та незначне зниження «Торгівельної» – 4,1%, «Банківсько-валютна» складова залишилася на рівні попереднього року.

Прослідимо динаміку рівня інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України за період 2000 – 2011 роки (рис. 2).

Як видно з рис. 2, інтегральний показник зовнішньоекономічної безпеки України протягом періоду, що аналізувався, мав нестабільний рівень розвитку. З 2000 по 2004 роки відбувалося його зростання (максимальний рівень становив 100,36%), починаючи з 2005 року рівень

інтегрального показника знижувався до 2008 року (мінімальний рівень становив 77,71%), у 2009 році відбулося незначне зростання (майже на 4%) з подальшим зниженням у 2010 – 2011 роках до рівня 69,54%. Найбільше зростання інтегрального показника на 7,51% відбулося в 2001 році, а найбільше його зниження – 9,89% спостерігалось в 2005 році.

Для більш детального дослідження динаміки розвитку інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України проаналізуємо його складові. Динаміку рівня компонент інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України в 2000 – 2011 роках наведено на рис. 3.

Як видно з рис. 3, складові інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України в 2000 – 2011 роках мали нестійку динаміку розвитку: «Торгівельна» складова протягом періоду, що аналізувався, мала відносно стабільний рівень розвитку в межах 74 – 90%; «Фінансово-інвестиційна» складова до 2008 року мала зростаючу тенденцію розвитку, в 2011 році її рівень склав 56,67%, що на 25,67% нижче рівня 2008 року; «Банківсько-валютна» складова до 2004 року мала тенденцію до зростання, а після –

Таблиця 2

Фактичні дані та рівень інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України в 2010 – 2011 роках

Компонента/Показник	Порогове значення	Фактичні дані		Рівень безпеки, %	
		2010 р.	2011 р.	2010 р.	2011 р.
Торгівельна складова				78,04	74,02
Коефіцієнт покриття імпорту експортом, разів	≥ 1	0,95	0,93	95,43	92,51
Відношення обсягу імпорту до ВВП, %	≤ 50	48,52	53,76	103,05	93,00
Питома вага провідної країни-партнера в загальному обсязі зовнішньої торгівлі, %	≤ 30	32,14	32,48	93,33	92,38
Частка експорту наукомісткої продукції в товарному експорті, %	≥ 18	3,66	3,28	20,33	18,21
Фінансово-інвестиційна складова				73,58	56,67
Відношення сальдо платіжного балансу України до ВВП, %	-1 – 1	-2,2	-5,5	45,45	18,18
Відношення загального обсягу зовнішнього боргу до ВВП, %	≤ 25	86,0	76,6	29,07	32,64
Валові міжнародні резерви України, в місяцях імпорту	5 – 10	4,2	3,6	140,00	120,00
Частка прямих іноземних інвестицій у загальному обсязі інвестицій, %	20 – 30	19,95	13,97	79,80	55,86
Банківсько-валютна складова				78,80	77,92
Частка іноземного банківського капіталу в загальному обсязі банківського капіталу, %	≤ 30	40,6	41,9	73,89	71,60
Відношення обсягів депозитів в іноземній валюті до загальних обсягів депозитів, %	≤ 25	44,48	44,22	56,20	56,53
Темп зміни індексу офіційного курсу гривні до долара США до показників попереднього періоду, %	≤ 106	99,7	100,4	106,31	105,63
<b>Інтегральний показник зовнішньоекономічної безпеки України</b>				76,81	69,54

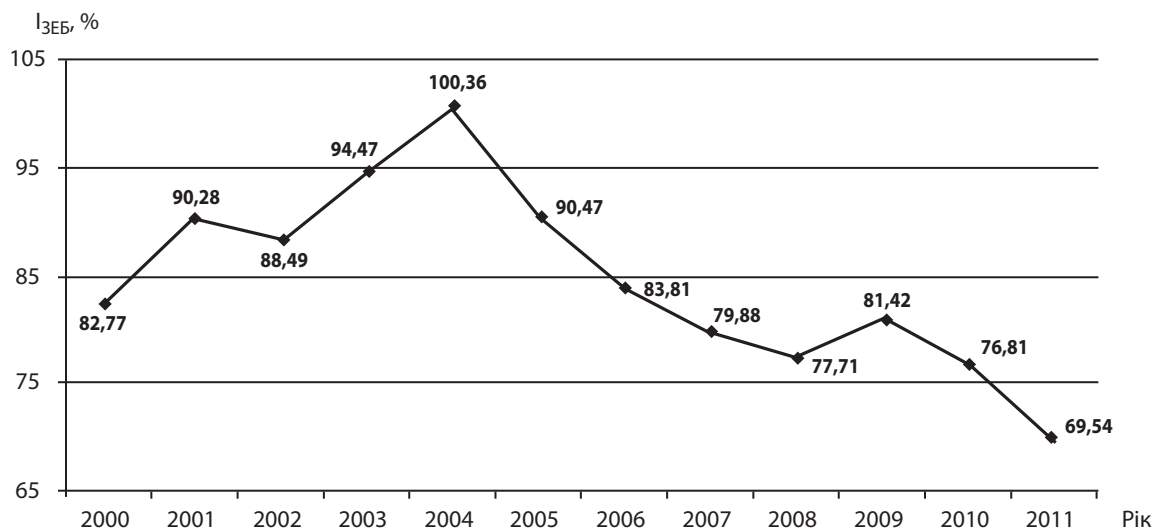


Рис. 2. Динаміка рівня інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України в 2000 – 2011 роках

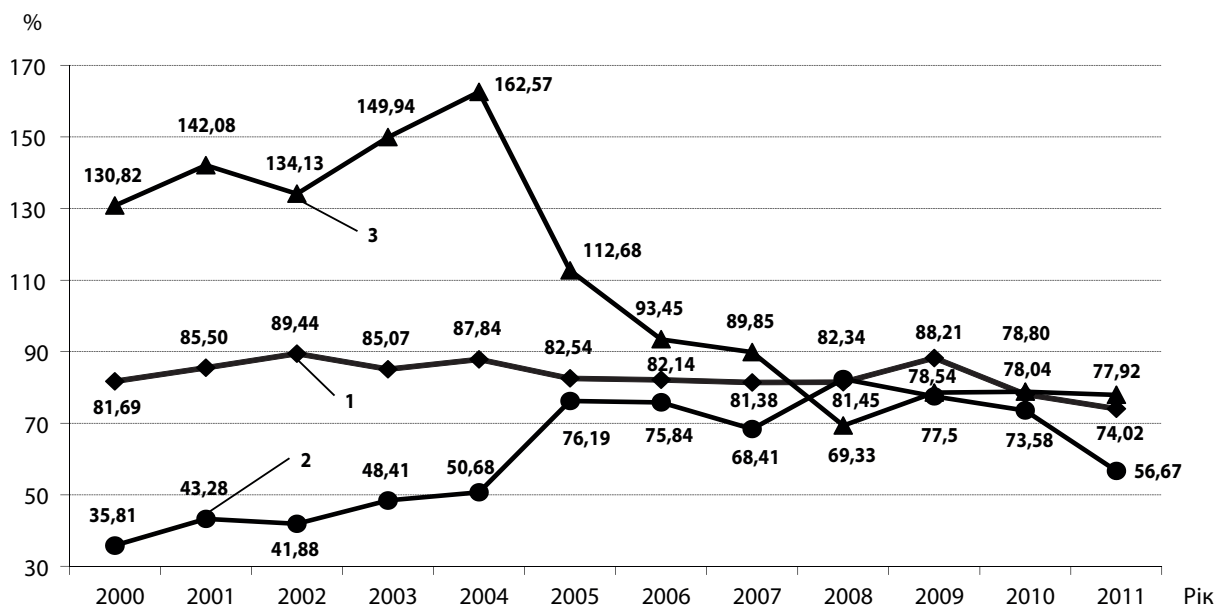


Рис. 3. Динаміка рівня складових інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України в 2000 – 2011 роках:

1 – торговельна складова; 2 – фінансово-інвестиційна складова; 3 – банківсько-валютна складова

до зниження й відносної стабілізації в 2009 – 2011 роках на рівні 78%, різниця між її максимальним та мінімальним рівнями за період, що аналізувався, становила 93,24%. Таким чином, до 2004 року зростання рівня інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України відбувалося за рахунок суттєвого підвищення рівня «Фінансово-інвестиційної» та «Банківсько-валютної» складової. Починаючи з 2005 по 2008 рік, на зниження рівня інтегрального показника впливало падіння рівня «Банківсько-валютної»

складової, в 2011 році зниження інтегрального показника було наслідком суттєвого падіння рівня безпеки «Фінансово-інвестиційної» складової та незначного падіння «Торговельної» складової зовнішньоекономічної безпеки.

Для виявлення факторів зростання (зниження) інтегрального показника за період, що аналізувався, дослідимо динаміку розвитку часткових показників його компонент.

На рис. 4 наведена динаміка рівнів часткових показників «Торговельної» складової інтегрального показ-

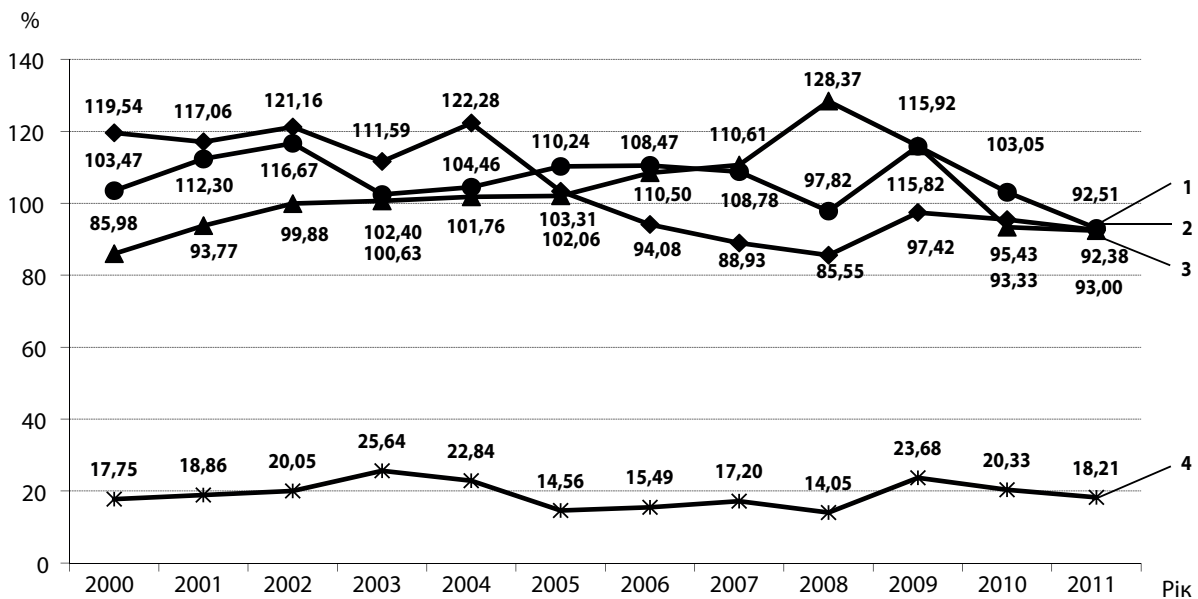


Рис. 4. Динаміка рівня часткових показників «Торгівельної» складової інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України в 2000 – 2011 роках:

1 – коефіцієнт покриття імпорту експортом; 2 – відношення обсягу імпорту до ВВП; 3 – питома вага провідної країни-партнера в загальному обсязі зовнішньої торгівлі; 4 – частка експорту наукомісткої продукції в товарному експорті

ника зовнішньоекономічної безпеки України в 2000 – 2011 роках.

З рис. 4 видно, що всі часткові показники «Торгівельної» компоненти мали циклічну динаміку, причому такі показники як «Коефіцієнт покриття імпорту експортом», «Відношення обсягу імпорту до ВВП» та «Питома вага провідної країни-партнера в загальному обсязі зовнішньої торгівлі» за період, що аналізувався, мали рівень вищий за 85%, а показник «Частки експорту наукомісткої продукції в товарному експорті» не перевищував рівня 30% за відповідний період. Зниження рівня безпеки «Торгівельної» компоненти в 2011 році порівняно з 2010 роком відбулося за рахунок зниження всіх її часткових показників, найбільше зниження (10,05%) відбулося у показника «Відношення обсягу імпорту до ВВП».

На рис. 5 наведена динаміка рівнів часткових показників «Фінансово-інвестиційної» складової інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України в 2000 – 2011 роках.

Як видно з рис. 5, часткові показники «Фінансово-інвестиційної» складової інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України в 2000 – 2011 роках мали нестійкий рівень розвитку з циклічною динамікою. Найбільш нестійку, хоча й зростаючу динаміку мав показник «Валові міжнародні резерви України»: максимальний його рівень (223,33%) спостерігався в 2008 році, мінімальний (30,0%) – у 2000 році, різниця між початковим його рівнем та на кінець періоду, що аналізувався, становить 90,0%. Також суттєве коливання рівня спостерігалось у показника

«Відношення сальдо платіжного балансу України до ВВП», до того ж він мав найнижчий рівень серед інших показників компоненти з 2000 по 2008 роки, мінімальне його значення (9,43%) було в 2004 році, а максимальне (66,67%) – у 2006 та 2009 роках. У 2011 році зниження рівня даного показника на 27,27% негативно вплинуло на зміну рівня «Фінансово-інвестиційної» складової, призвело до її зниження на 16,21% порівняно з 2010 роком.

На рис. 6 наведено динаміку рівнів часткових показників «Банківсько-валютної» складової інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України в 2000 – 2011 роках.

Як видно з рис. 6, часткові показники «Банківсько-валютної» складової інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України за період, що аналізувався, мали циклічний рівень розвитку, з суттєвою різницею рівнів з 2000 по 2006 рік. Так, показник «Частки іноземного банківського капіталу в загальному обсязі банківського капіталу» до 2004 року мав зростаючу тенденцію, а з 2005 року – тенденцію до зниження, найбільше падіння його рівня відбулося в 2005 році – більше ніж у 2 рази, різниця між максимальним (312,50%) його рівнем у 2004 та мінімальним (71,60%) на кінець періоду, що аналізувався, становить 240,9%, або більше ніж 4 рази. Досить стійкою була динаміка показника «Темпи зміни індексу офіційного курсу гривні до долара США», який протягом періоду, що аналізувався, мав рівень безпеки вище за 100%, крім 2008 року. Найнижчий рівень безпеки серед часткових показників даної компоненти протягом 2000 – 2011 років мав

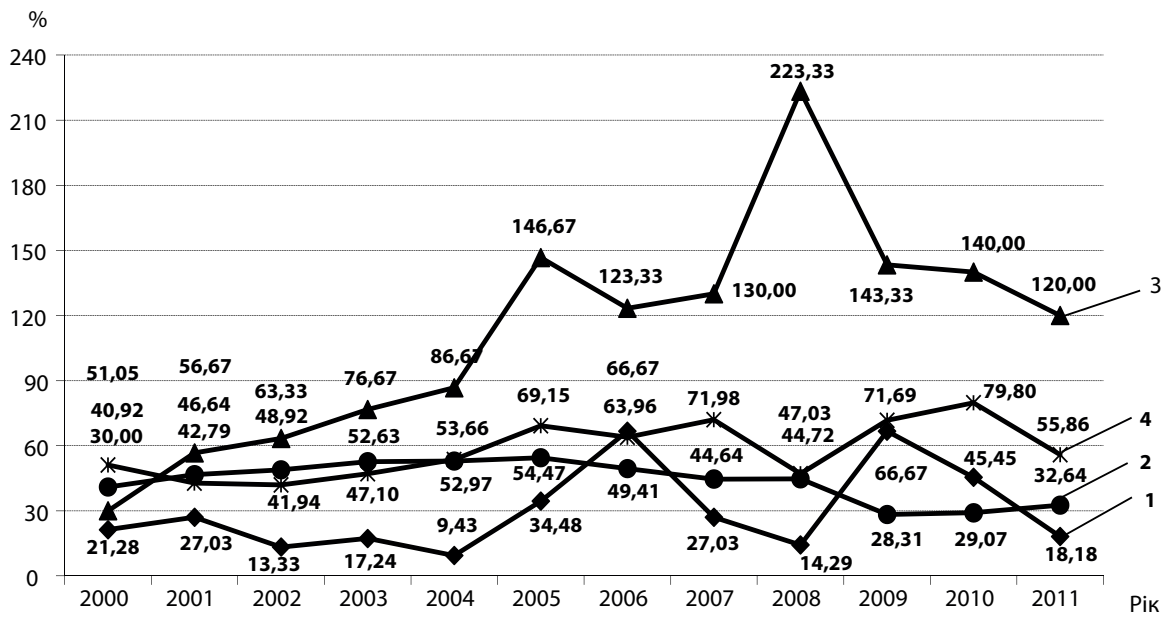


Рис. 5. Динаміка рівня часткових показників «Фінансово-інвестиційної» складової інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України в 2000 – 2011 роках:

1 – відношення сальдо платіжного балансу України до ВВП; 2 – відношення загального обсягу зовнішнього боргу до ВВП; 3 – валові міжнародні резерви України; 4 – відношення чистого приросту прямих іноземних інвестицій до ВВП

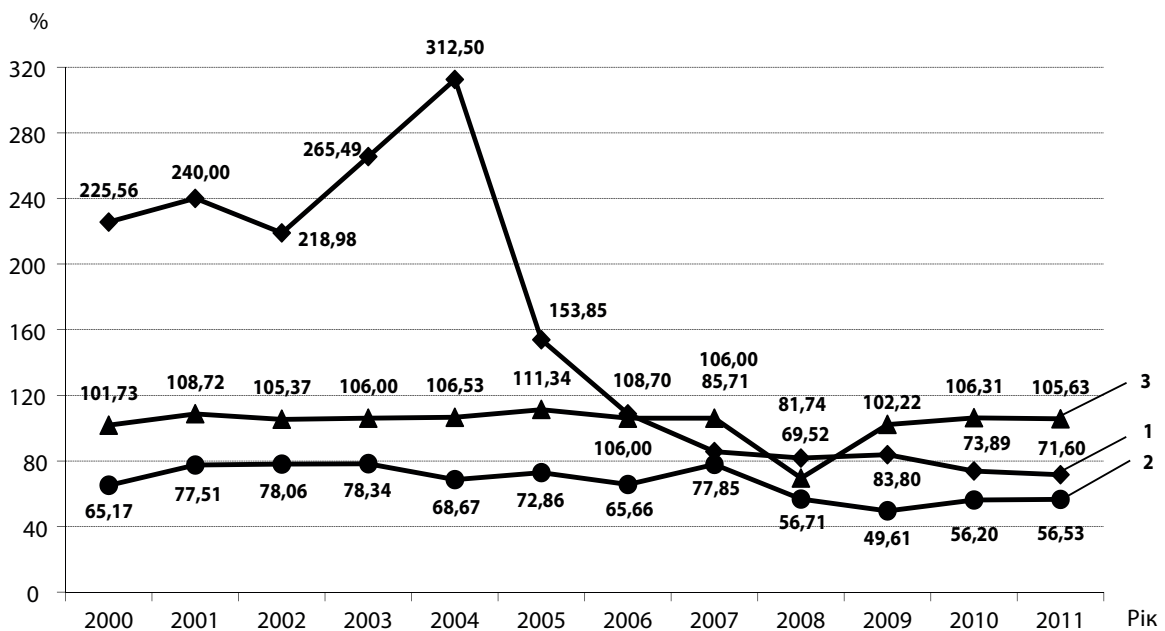


Рис. 6. Динаміка рівня часткових показників «Банківсько-валютної» складової інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України в 2000 – 2011 роках:

1 – частка іноземного банківського капіталу в загальному обсязі банківського капіталу; 2 – відношення обсягів депозитів в іноземній валюті до загальних обсягів депозитів; 3 – темп зміни індексу офіційного курсу гривні до долара США

показник «Відношення обсягів депозитів в іноземній валюті до загальних обсягів депозитів», максимальний його рівень (78,34%) спостерігався в 2003 році, мінімальний (49,61%) – у 2009 році.

Таким чином, дослідивши динаміку рівнів компонент та часткових показників інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України в 2000–2011 рр. та характер їх зміни за останній рік можна зробити такі висновки: на зниження рівня інтегрального показника в 2011 році вплинуло падіння рівня його «Фінансово-інвестиційної» та «Торгівельної» складових, як наслідок зниження рівнів її часткових показників; серед часткових показників найбільший вплив на рівень інтегрального показника в 2011 році мали «Валові міжнародні резерви України» (120,0%), «Темп зміни індексу офіційного курсу гривні до долара США» (105,63%) та «Відношення обсягу імпорту до ВВП» (93,0%); найменший вплив на рівень інтегрального показника в 2011 році мали «Відношення сальдо платіжного балансу України до ВВП» (18,18%), «Частка експорту наукомісткої продукції в товарному експорті» (18,21%) та «Відношення загального обсягу зовнішнього боргу до ВВП» (32,64%).

На завершальному етапі аналізу динаміки розвитку інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України необхідно спрогнозувати його значення в часі. Як видно з рис. 2, до 2004 року динаміка інтегрального показника характеризувалася зростаючою тенденцією, а після і до 2011 року – спадаючою з незначним зростанням у 2009 році. Тому для його прогнозування було вибрано період за 2004–2011, на якому чітко простежується від'ємний лінійний взаємозв'язок.

З використанням пакету прикладних програм STATISTICA 6.0 було оцінено рівняння лінійної регресійної

залежності інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки країни від часу [12]:

$$I_{зЕБ} = -3,49 \times T + 98,22. \quad (1)$$

Коефіцієнт детермінації ( $R^2 = 0,8325$ ), що характеризує частку варіації залежної змінної ( $I_{зЕБ}$ ), яка пояснена за допомогою даного рівняння, має досить високе значення. За значенням  $F$ -критерію оціненого рівняння лінійної регресійної визначено його статистичну значущість: розраховане значення  $F$ -критерію ( $F_{роз} = 29,81$ ) значно перевищує його критичне значення ( $F_{крит} = 5,99$ ). Розраховані значення  $t$ -критерію для визначення значущості коефіцієнтів рівняння лінійної регресійної за модулем перевищують їх стандартні помилки більше ніж у три рази, що вказує на їх високу статистичну значущість [12–15].

Розраховане прогнозне значення показника зовнішньоекономічної безпеки України на 2012 рік за моделлю (1) склало 66,78%, а довірчий інтервал прогнозного значення – 58,87%–74,68%.

Таким чином, проведена оцінка стану зовнішньоекономічної безпеки України показала, що її рівень є недостатньо високим, а в деяких сферах навіть критичний. Отримане прогнозне значення інтегрального показника зовнішньоекономічної безпеки України вказує на подальше її зниження в майбутньому. При найкращому варіанті розвитку у сфері зовнішньоекономічної безпеки країни значення її інтегрального показника не перевищить 75%, а при найгіршому – 60%. Тому необхідно провести комплексне системне дослідження факторів зовнішньоекономічної безпеки країни з метою виявлення проблем та причин, що на них впливають, й виробити науково обґрунтовані заходи щодо подолання останніх.

## ЛІТЕРАТУРА

1. Григорова-Беренда Л. І. Визначення сутності поняття зовнішньоекономічна безпека // Конурентоспоможність та інновації: проблеми науки та практики: Тези доповідей міжнародної науково-практичної конференції 11–12 листопада 2010 р. – Х.: ФОП Павленко О. Г., ВД «ІНЖЕК», 2010. – С. 23–25.
2. Хаустова В. Є., Григорова-Беренда Л. І. Теорія та практика оцінки зовнішньоекономічної безпеки держави // Проблеми економіки. – № 3. – 2011. – С. 28–34.
3. Лапін В. А. Теорія національної безпеки: Підручник / Лапін В. А. – К.: КНТ, 2009. – 631 с.
4. Дронов Р. В. Подходы к обеспечению экономической безопасности / Р. В. Дронов // Экономист. – 2001. – № 2. – С. 43–54.
5. Баженова О. В. Методика визначення оцінки економічної безпеки держави / О. В. Баженова // Актуальні проблеми розвитку підприємницької діяльності в Україні. [Збірник наукових праць]. – Київ, 2003. – № 3 – С. 4–9.
6. Швайка Л. А. Державне регулювання економіки: Навч. посіб. / Л. А. Швайка. – К.: Знання, 2006. – 435 с.
7. Экономическая безопасность хозяйственных систем / Учебник / под. ред. А. В. Колосова. – М.: Изд-во РАГС, 2001. – 446 с.

## REFERENCES

- Bazhenova, O. V. «Metodyka vyznachennia otsinky ekonomichnoi bezpeky derzhavy» [Methods for the measurement of economic security]. *Aktualni problemy rozvytku pidpriyemnytskoi diialnosti v Ukraini*, no. 3 (2003): 4–9.
- Borovikov, V. P. *Programma STATISTICA dlia studentov i inzhenerov* [STATISTICA program for students and engineers]. Moscow: KompiuterPress, 2001.
- Dronov, R. V. «Podkhody k obespecheniiu ekonomicheskoy bezopasnosti» [Approaches to economic security]. *Ekonomist*, no. 2 (2001): 43–5.
- Ekonomicheskaiia bezopasnost khoziaystvennykh sistem* [Economic security and economic systems]. Moscow: Izd-vo RAGS, 2001.
- Ekonomicheskaiia bezopasnost: Proizvodstvo – Finansy – Banki* [Economic security: Production – Finance – Banks]. Moscow: Finstatinform, 1998.
- Hryhorova-Berenda, L. I. «Vyznachennia sutnosti poniattia zovnishnyoekonomichna bezpeka» [Defining the essence of the concept of foreign security]. *Konurentospomozhnist ta innovatsii: problemy nauky ta praktyky*. Kharkiv: INZHEK, 2010. 23–25.
- Khaustova, V. IE., and Hryhorova-Berenda, L. I. «Teoriia ta praktyka otsinky zovnishnyoekonomichnoi bezpeky derzhavy» [Theory



8. Сенчагов В. К. О сущности и основах стратегии экономической безопасности России / В. К. Сенчагов // Вопросы экономики. – 1995. – № 1. – С. 97–106.
  9. Экономическая безопасность: Производство – Финансы – Банки / Под ред. В. К. Сенчагова. – М.: ЗАО «Финстатинформ», 1998. – 621 с.
  10. Моделювання економічної безпеки : держава, регіон, підприємство : [Монографія] / За ред. В. М. Гейця. – Х. : ВД «ІНЖЕК», 2006. – 240 с.
  11. Васнев С. А. Статистика : Учеб. пособ. / Васнев С. А. – М: МГУП, 2001. – 170 с.
  12. Боровиков В. П. Программа STATISTICA для студентов и инженеров / Боровиков В. П. – М. : КомпьютерПресс, 2001. – 302 с.
  13. Замков О. О. Математические методы в экономике : Учеб. / Замков О. О., Толстопятенко А. В., Черемных Ю. Н. – М. : МГУ им. М. В. Ломоносова, Изд-во «ДИС», 1997. – 368 с.
  14. Садовникова Н. А. Анализ временных рядов и прогнозирование : Учеб. пособ. / Н. А. Садовникова, Р. А. Шмойлова. – М. : Изд-во МГУЭСИИ, 2004. – 200 с.
  15. Светульников С. Г. Методы социально-экономического прогнозирования : учебник для вузов. Том II / С. Г. Светульников, И. С. Светульков. – СПб. : Изд-во СПбГУЭФ, 2010. – 103 с.
- and Practice of foreign security]. *Problemy ekonomiky*, no. 3 (2011): 28–34.
- Lapin, V. A. *Teoriia natsionalnoi bezpeky* [Theory of National Security]. Kyiv: KNT, 2009.
- Modeliuvannia ekonomichnoi bezpeky: derzhava, rehion, pidpriemstvo* [Simulation of economic security: state, region, enterprise]. Kharkiv: Inzhrek, 2006.
- Shvaika, L. A. *Derzhavne rehuliuвання ekonomiky* [State Regulation of Economy]. Kyiv: Znannia, 2006.
- Senchagov, V. K. «O sushchnosti i osnovakh strategii ekonomicheskoy bezopasnosti Rossii» [On the basis of the nature and strategy of Russia's economic security]. *Voprosy ekonomiki*, no. 1 (1995): 97–106.
- Sadovnikova, N. A., and Shmoylova, R. A. *Analiz vremennykh riadov i prognozirovanie* [Time Series Analysis and Forecasting]. Moscow: Izd-vo MGUESII, 2004.
- Svetunkov, S. G., and Svetunkov, I. S. *Metody sotsialno-ekonomicheskogo prognozirovaniia* [Methods of social and economic forecasting]. St. Petersburg: Izd-vo SPbGUEF, 2010.
- Vasnev, S. A. *Statistika* [statistics]. M: MGUP, 2001.
- Zamkov, O. O., Tolstopiatenko, A. V., and Cheremnykh, Yu. N. *Matematicheskie metody v ekonomike* [Mathematical Methods in Economics]. Moscow: DIS, 1997.