

Федеральное государственное бюджетное образовательное учреждение
высшего образования
РОССИЙСКАЯ АКАДЕМИЯ НАРОДНОГО ХОЗЯЙСТВА
И ГОСУДАРСТВЕННОЙ СЛУЖБЫ
ПРИ ПРЕЗИДЕНТЕ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ

На правах рукописи

ПЕТРОВ Филипп Владимирович

**ОЦЕНКА УРОВНЯ ОБЕСПЕЧЕННОСТИ ЭКОНОМИЧЕСКОЙ
БЕЗОПАСНОСТИ РОССИЙСКОЙ ФЕДЕРАЦИИ НА ОСНОВЕ
НЕПАРАМЕТРИЧЕСКОГО МЕТОДА**

Специальность: 5.2.3. «Региональная и отраслевая экономика»

Аннотация

диссертации на соискание ученой степени кандидата
экономических наук

Научный руководитель – **А.С. Аброскин,**
доктор экономических наук, доцент

Москва – 2023

Актуальность темы исследования. На сегодняшний день, в условиях финансовой и экономической нестабильности, выражающейся в ряде негативных последствий ограничительных мер, сформировалась необходимость концентрации внимания на обеспечении экономической безопасности. Высокая зависимость российского бюджета от конъюнктуры сырьевого рынка и волатильности валютного курса подрывает устойчивость российской экономики и создает, тем самым, угрозу экономической безопасности, которая проявляется в снижении уровня жизни населения, падении располагаемых доходов, росте количества банкротств предприятий, в особенности малых, снижении доступности кредитов и многих других неблагоприятных последствиях. Подобное влияние экономического кризиса отражается на всех участниках экономических отношений, как на отдельных людях, коммерческих предприятиях в частности, так и на обществе в целом.

Учитывая, что в соответствии со Стратегией экономической безопасности Российской Федерации на период до 2030 года¹ (далее – Стратегия) повышение уровня общественного благосостояния населения и создание благоприятных условий для ведения бизнеса являются одними из задач государственной политики в сфере обеспечения экономической безопасности, эффективная реализация данной политики Правительства Российской Федерации должна способствовать стабилизации социально-экономической обстановки в обществе.

Все это требует своевременного, эффективного и надлежащего подхода со стороны государства в области обеспечения экономической безопасности. Как и в любой управленческой деятельности, так и в деятельности государства по обеспечению экономической безопасности важным этапом, предшествующим разработке мер по обеспечению экономической безопасности, является этап оценки.

¹ Указ Президента РФ от 13 мая 2017 г. № 208 «О Стратегии экономической безопасности Российской Федерации на период до 2030 года» // Собрание законодательства РФ, 15.05.2017. № 20. ст. 2902.

Несмотря на наличие в принятой в 2017 году Стратегии экономической безопасности широкого перечня показателей экономической безопасности, острым является вопрос о методах ее оценки. Имеющиеся на сегодняшний день методы оценки, неоднократно подвергаемые критике за высокую степень субъективности, нуждаются в дополнительном исследовании, а также обуславливают поиск новых методов. Научная актуальность исследования методов оценки экономической безопасности имеет и высокую практическую значимость, так как применение новых подходов и методов оценки, будет способствовать формированию адекватной информационной базы для прогнозирования и разработки будущих мер по обеспечению экономической безопасности.

Существующие методы оценки экономической безопасности, в частности, один из наиболее распространенных методов - индикативный метод оценки, не способны сформировать целевые значения показателей экономической безопасности. Целевые значения позволили бы в количественной форме определить, к чему следует стремиться, чтобы повысить уровень обеспеченности экономической безопасности России.

Необходимость формирования целевых значений показателей экономической безопасности подтверждается соответствующим заключением ФГБУ ВолНЦ РАН на Стратегию экономической безопасности России на период до 2030 года и результатами исследований отечественных ученых в области обеспечения экономической безопасности². Отсутствие в Стратегии каких-либо пороговых и целевых значений показателей не позволяет осуществить достоверную оценку экономической безопасности России.

Предлагаемый непараметрический метод оценки (data envelopment analysis) обладает возможностями необходимыми для формирования целевых значений показателей экономической безопасности России, а также позволяет

² Серебрянников С.С., Моргунов Е.В., Мамаев С.М., Шерварли И.А. О стратегии экономической безопасности Российской Федерации на период до 2030 года // Вестник Томского государственного университета. Экономика. 2018. № 41. С. 20 – 28.

сформировать значение интегрального показателя экономической безопасности и определить уровень обеспеченности экономической безопасности.

Уточнение методики оценки экономической безопасности России, основывающейся на новых методах оценки, позволяющих сформировать целевые значения показателей, имеет существенное значение для народного хозяйства, что обуславливает актуальность диссертационного исследования.

Цель и задачи исследования. Цель диссертационного исследования заключается в адаптации непараметрического метода к оценке уровня обеспеченности экономической безопасности России.

Для достижения цели поставлены следующие задачи:

1. Раскрыть теоретико-методологические основы экономической безопасности, а также проанализировать зарубежные концепции экономической безопасности.
2. Произвести анализ методов оценки экономической безопасности России и сформировать эмпирическую базу оценки.
3. Осуществить процедуру оценки уровня обеспеченности экономической безопасности России на основе непараметрического метода оценки (data envelopment analysis) с использованием показателей Стратегии, предложить на этой основе варианты повышения уровня обеспеченности экономической безопасности.
4. Обосновать достоверность предлагаемого метода оценки уровня обеспеченности экономической безопасности России и сформированных целевых значений показателей.

Объектом исследования выступает совокупность организационно-экономических отношений, возникающих в связи с обеспечением экономической безопасности Российской Федерации.

Предметом исследования являются методы оценки уровня обеспеченности экономической безопасности России.

Теоретическая и методологическая основа исследования.

Теоретическую базу диссертационного исследования составили научные труды отечественных и зарубежных ученых в области экономической безопасности и по вопросам мониторинга и моделирования экономических процессов.

Методологическая основа исследования представлена рядом общенаучных методов, таких как анализ, синтез и моделирование, а также статистическими методами: факторный и кластерный анализ.

Научная новизна исследования заключается в следующем:

- обосновано понятие «уровень обеспеченности экономической безопасности России»;
- разработана система репрезентативных показателей экономической безопасности России;
- предложена методика расчета количественной составляющей критерия обеспеченности экономической безопасности, учитывающая изменение ситуации в экономике;
- выработан методический подход к оценке уровня обеспеченности экономической безопасности, включающий в себя алгоритм факторного и кластерного анализов, а также непараметрического метода, основывающегося на решении задачи линейного программирования.

Основные научные результаты, полученные автором:

1. «Уровень обеспеченности экономической безопасности России» развивает категориально-методологический аппарат оценки уровня экономической безопасности в части отражения результативности деятельности субъектов обеспечения экономической безопасности, выраженной в интегральном показателе, позволяющим судить о защищенности интересов от угроз. Интегральный показатель экономической безопасности, значение которого соответствует шкале от нуля до единицы, носит количественный характер, и определяется расчетным способом на

основе репрезентативных показателей по методу data envelopment analysis (DEA).

2. Система критериев (качественный и количественный) определения уровня обеспеченности экономической безопасности основывается на характере применяемых субъектами обеспечения экономической безопасности мер по нейтрализации угроз защищенности национальным интересам.

В основе качественного критерия лежит характер принимаемых субъектами обеспечения экономической безопасности тех или иных управленческих решений по недопущению ухудшения ситуации, а также структурные и институциональные меры.

Количественный критерий уровня обеспеченности экономической безопасности является индивидуальным по каждой сфере экономической безопасности и рассчитывается на основе значения интегрального показателя экономической безопасности, соответствующего интервалу по шкале от нуля до единицы. Интервалы носят динамический характер и вычисляются по каждой сфере экономической безопасности, основываясь на правиле Стерджесса. Уровни обеспеченности экономической безопасности классифицированы на нормальный, предкризисный и кризисный.

3. Оптимизирована структура показателей экономической безопасности. В целях избежания необходимости оценки уровня обеспеченности экономической безопасности по всей совокупности показателей, на основе применения метода факторного анализа определены репрезентативные показатели экономической безопасности (внутренний долг Российской Федерации, доля высокотехнологичной продукции в экспорте, доля машин, оборудования и транспортных средств в объеме сырьевого экспорта, доля населения с денежными доходами ниже величины прожиточного минимума, индекс производительности труда, выбросы парниковых газов, суммарный коэффициент рождаемости). В качестве репрезентативного показателя отбирался показатель, имеющий наиболее сильную взаимосвязь с

компонентом, на который приходится наибольшая доля объясненной дисперсии. Это свидетельствует о его большей информативности по сравнению с другими показателями.

4. Подход к оценке уровня обеспеченности экономической безопасности, основывающийся на непараметрическом методе data envelopment analysis (DEA), включает в себя:

- замену части репрезентативных показателей на их международные аналоги в случае расхождения российских статистических показателей и зарубежных или их неактуальное состояние. Оценка уровня обеспеченности экономической безопасности России методом DEA носит сравнительный характер. Объектами оценки выступают страны, что требует наличия сопоставимых российских и зарубежных показателей. Это обусловило необходимость корректировки набора репрезентативных показателей экономической безопасности;

- формирование выборки объектов оценки с учетом особенности метода DEA, заключающейся в максимизации значений показателей: осуществлены необходимые математические преобразования над значениями показателей, повышение которых свидетельствует об отрицательной динамике в экономике (общий государственный долг к ВВП, коэффициент Джини, выбросы парниковых газов);

- группировку объектов оценки методом кластерного анализа по каждому репрезентативному показателю с учетом специфики сферы экономической безопасности. Сопоставимые группы объектов (кластеры) определялись методом k-средних, а их оптимальное количество выявлялось в соответствии с информационным критерием Акаике, а также было доказано результатами самостоятельных расчетов;

- осуществление оценки методом DEA уровня обеспеченности экономической безопасности отдельно по каждой группе объектов. Доказано снижение влияния случайных колебаний выборки на конечный результат

оценки вследствие оценки уровня обеспеченности экономической безопасности в рамках сопоставимых групп объектов.

В результате реализации предложенного подхода к оценке уровня обеспеченности экономической безопасности получены целевые значения репрезентативных показателей экономической безопасности России.

Информационную базу диссертации составили исследования отечественных и зарубежных авторов, нормативные правовые акты, диссертации и монографии ученых в области изучения экономической безопасности, статистические данные о социально-экономическом и финансовом положении России – данные Федеральной службы государственной статистики, Министерства финансов Российской Федерации, Казначейства России, Центрального банка Российской Федерации, данные зарубежных статистических баз – Организации экономического сотрудничества и развития (ОЭСР), Всемирного банка, ООН; научные статьи, обзоры, интернет ресурсы и результаты расчетов.

Теоретическая значимость диссертационного исследования заключается в выявлении на основе Стратегии экономической безопасности России на период до 2030 года ключевых сфер экономической безопасности, интеграция разработанного и обоснованного понятия «уровень обеспеченности экономической безопасности России» в систему теоретической оценки экономической безопасности.

Практическая значимость диссертационного исследования заключается в обосновании метода оценки уровня обеспеченности экономической безопасности, применимость которого способствует повышению достоверности получаемых результатов, а также позволяет сформировать целевые значения показателей экономической безопасности России. Разработанные целевые значения показателей экономической безопасности могут быть использованы при уточнении содержания Стратегии экономической безопасности России на период до 2030 года.

Также с целью расширения перечня показателей экономической безопасности предложен ряд дополнительных показателей, характеризующий уровень обеспеченности экономической безопасности России.

Выбранный в ходе диссертационного исследования метод оценки может быть успешно применен не только на федеральном, но и на региональном уровне, а также на уровне экономической безопасности предприятий. Результаты диссертационного исследования могут быть применены в практической деятельности Министерства экономического развития Российской Федерации, Министерства финансов Российской Федерации, Федеральной службы государственной статистики при разработке прогнозов и стратегий социально-экономического развития, а также при составлении аналитических обзоров.

Соответствие диссертации паспорту научной специальности. Исследование выполнено в рамках следующих пунктов паспорта специальности 5.2.3 «Региональная и отраслевая экономика»: п. 13.1 «Теоретико-методологические вопросы исследования проблем экономической безопасности», п. 13.5 «Критерии экономической безопасности. Пороговые значения критериев экономической безопасности и методы их определения».

Апробация и внедрение результатов исследования. Основные результаты диссертационного исследования докладывались и обсуждались на следующих конференциях:

- X Международная научно-практическая конференция. «Государство и бизнес. Современные проблемы экономики» (г. Санкт-Петербург, РАНХиГС при Президенте Российской Федерации, Северо-Западный институт управления, 25 – 27 апреля 2018 г.).

- X Международная научно-практическая конференция. «Государство и бизнес. Экосистема цифровой экономики» (г. Санкт-Петербург, РАНХиГС при Президенте Российской Федерации, Северо-Западный институт управления, 24 – 26 апреля 2019 г.).

- I Международная научно-практическая конференция «Актуальные теоретические и прикладные вопросы управления социально-экономическими системами» (г. Санкт-Петербург 20 декабря 2019 г.).

Публикации. По результатам работы опубликовано 11 статей, среди которых 4 работы в рецензируемых научных изданиях, рекомендованных Высшей аттестационной комиссией при Министерстве образования и науки Российской Федерации, а одна публикация в издании, индексируемом в международной базе цитирования Web of Science.

Структура и объем работы. Диссертация состоит из введения, трех глав, заключения, списка литературы и приложений. Содержание работы изложено на 165 страницах основного текста, проиллюстрировано 12 рисунками и 47 таблицами. В приложении представлены материалы, свидетельствующие о практической реализации результатов исследований и разработок автора. Список литературы содержит 142 источника литературы, из них 76 отечественных и 32 зарубежных авторов.

