

Фейзов В.Р.

**Управление экономической безопасностью на основе
сценарного анализа**

Аннотация: В постоянно меняющейся глобальной обстановке, характеризующейся активным противоборством и социально-политическими изменениями, обеспечение экономической безопасности становится все более сложной задачей. В данной работе рассматривается комплексный характер экономической безопасности, при этом особое внимание уделяется влиянию важных политических событий, таких как цветные революции, на экономическую стабильность стран. В работе особое внимание уделяется стабильности российского рубля в качестве основного индикатора экономического состояния и стабильности Российской Федерации. Используя имитационную модель, которая включает в себя факторы, имеющие особое значение, в работе подчеркивается взаимосвязь между социально-политическими потрясениями и экономической волатильностью.

Ключевые слова: сценарный анализ, анализ циклов, социально-экономические системы, экономическая безопасность, российский рубль

Экономическая стабильность занимает одно из главенствующих мест в обеспечении безопасности государства, ослабление экономики внешним воздействием зачастую является предвестником будущей открытой конфронтации. Ограничения, накладываемые иностранными государствами на страну-субъект воздействия, несут в себе конечную цель воздействия на ключевые функции государства, такие, как оплата внешних обязательств, обеспечение работы правительства, экспорт и импорт государства, а также бюджет в целом. Это лишь малая часть функций, воздействуя на которые существует возможность парализовать функционирование государства. Экономическими санкциями

существует возможность привести страну к замедлению экономического роста, сокращению рабочих мест и сокращению государственных услуг. Такие условия могут существенно повлиять на восприятие общественностью способности своего правительства управлять международными отношениями и экономикой, что потенциально может привести к социальным волнениям.

Основными инструментами для влияния на экономику других стран являются [1]:

- санкции;
- ограничение цен на экспортируемые товары;
- давление на компании;
- торговое эмбарго;
- блокировка активов.

Одним из ключевых индикаторов экономики страны является курс национальной валюты [2]. Сильная волатильность курса означает отсутствие экономической стабильности, к такого рода последствиям часто приводят значимые негативные события, одними из таких являются цветные революции. Для подтверждения этого представляется возможным исследование близких Российской Федерации с точки зрения расположения стран.

Оранжевая революция 2004 года в значительной степени изменила будущее Украины, несмотря на значительный рост ВВП страны в 2 раза в период с 2000 до 2004 год в стране существовала сильная разница в уровне дохода между различными слоями населения. Более того, существующая коррупция лишь усиливала неблагоприятные экономические условия. Во время Оранжевой революции существовала значительная политическая неопределенность, которая привела к обесцениванию украинской гривны. Как и в большинстве случаев, при нестабильности национальной валюты, центральный банк используя соответствующий инструментарий, предпринял попытки стабилизировать национальную валюту, когда политическая ситуация стабилизировалась, гривна также восстановилась [3].

Революция тюльпанов 2005 года в Кыргызстане имела те же причины, что и Оранжевая революция на Украине. Сильный разрыв в доходе населения, который выразился в экстремальном количестве граждан, живущих за чертой бедности (в сельской местности количество бедных составляло около 40%), граждане

также были недовольны nepoтизмом и коррупционными скандалами внутри правительства. Как итог, Тюльпановая революция вызвала временный экономический спад, что привело к обесцениванию кыргызского сома. Политическая неопределенность привела к оттоку иностранных инвестиций и снижению экономической активности. Как только политическая ситуация стабилизировалась и к власти пришло новое правительство, сом начал восстанавливаться [4].

Несмотря на то, что исследователи, зачастую используя термин «цветные революции», подразумевают именно события, происходящие на постсоветском пространстве, не стоит исключать тот факт, что значительные геополитические события схожего характера происходят и в других частях света, например на ближнем востоке. Характерным примерами в данном случае являются Тунис и Ливия.

Вторая Жасминовая революция 2010 года в Тунисе по большей части вызвана теми же экономическими проблемами. Высокий уровень безработицы, особенно среди молодежи, и рост инфляции были основными источниками недовольства. Несмотря на относительно высокие экономические показатели Туниса, богатство распределялось неравномерно, и преимущества экономического роста не доходили до большинства населения. Вторая Жасминовая революция в Тунисе привела к немедленному обесцениванию тунисского динара из-за политической неопределенности и снижения экономической активности. Центральному банку пришлось вмешаться, чтобы стабилизировать курс динара. В среднесрочной перспективе динар продолжил обесцениваться из-за экономических проблем и продолжающихся политических преобразований [5].

Наиболее интересным для исследования является атипичная цветная революция в Ливии, так как в сравнении с Тунисом и Египтом, Ливия находилась под значительными международными санкциями во время правления Муаммара Каддафи. События в Ливии происходили в рамках большого блока под названием «Арабская весна». Многие из этих санкций, в том числе введенные ООН и США, были сняты после 2000 года в связи с решением Каддафи отказаться от программ создания оружия массового уничтожения. Однако санкции были быстро восстановлены во

время восстания против Каддафи в 2011 году. Ливийская экономика сильно пострадала от конфликта. Произошли повсеместные перебои в добыче нефти в стране, которая являлись важнейшим компонентом ливийской экономики. Это привело к значительному сокращению государственных доходов и валютных резервов, что оказало давление на ливийский динар. Санкции, которые были восстановлены в начале Арабской весны, включали замораживание ливийских активов, находящихся за границей, что еще больше сократило валютные резервы страны. Санкции и неопределенность вокруг конфликта привели к сокращению иностранных инвестиций, что также оказало давление на валюту. Во время конфликта также поступали сообщения о нехватке банкнот в Ливии, вероятно, из-за сбоев в финансовой системе [6].

Каждое из вышеперечисленных событий сильно влияло на стабильность национальной валюты государства, что приводило к значительным колебаниям курса и в целом, к обесцениванию валюты. Обесценивание национальной валюты имеет смешанные последствия, но если оценивать последствия для всего населения, то в первую очередь это крайне негативный сигнал. Обесценивание валюты ведет к позитивным последствиям в экспорте продукции государства, так как продукция становится более конкурентоспособной для внешнего покупателя в связи с дешевизной, но этот позитивный аспект легко нивелируется внешними санкциями, что зачастую может привести к патовой ситуации. В первую очередь из негативных последствий для населения представляется возможным выделить удорожание импорта, так как обесценивание валюты не позволяет закупать тот же объем товара за те же деньги. Более того, более дорогой импорт ведет к массовой инфляции, если экономика внутри страны не ориентирована на внутренний рынок и не является частично или полностью независимой от внешнего сырья или инструментария. Проблема обесценивания валюты сказывается не только на населении, но и на государстве и его функциях, так как если государство имеет внешние долги, номинированные в иностранной валюте, то этот долг становится сложнее обслуживать. Дополнительно ко всему перечисленному, в случаях, когда центральные банки пытаются стабилизировать национальную валюту, повышая процентные ставки, это тоже является

негативным фактором. Это приводит к замедлению экономического роста через уменьшение доступности кредитов [7].

Для исследования возможностей эффективного управления экономической безопасностью на примере Российской Федерации сформирована сценарная модель анализа стабильности национальной валюты (рисунок 1). Данная модель относится к классу сценарных моделей поведения сложных социально-экономических систем, анализ полученных сценариев доказал свою эффективность во многих работах в сфере управления [8, 9]. Целью моделирования является оценка стабильности российского рубля в условиях внешнего деструктивного воздействия иностранных государств, а также зависимости от факторов внутренней и внешней политики в сфере экономики и торговли.

Структура модели разделена на 3 блока. Первый блок состоит из внешних организаций и акторов мировой экономики, наиболее весомыми в этом блоке являются страны Европы, Соединенные Штаты Америки и Китай. Также, в первом блоке учитываются и факторы экономической деятельности некоторых стран, в частности, США.

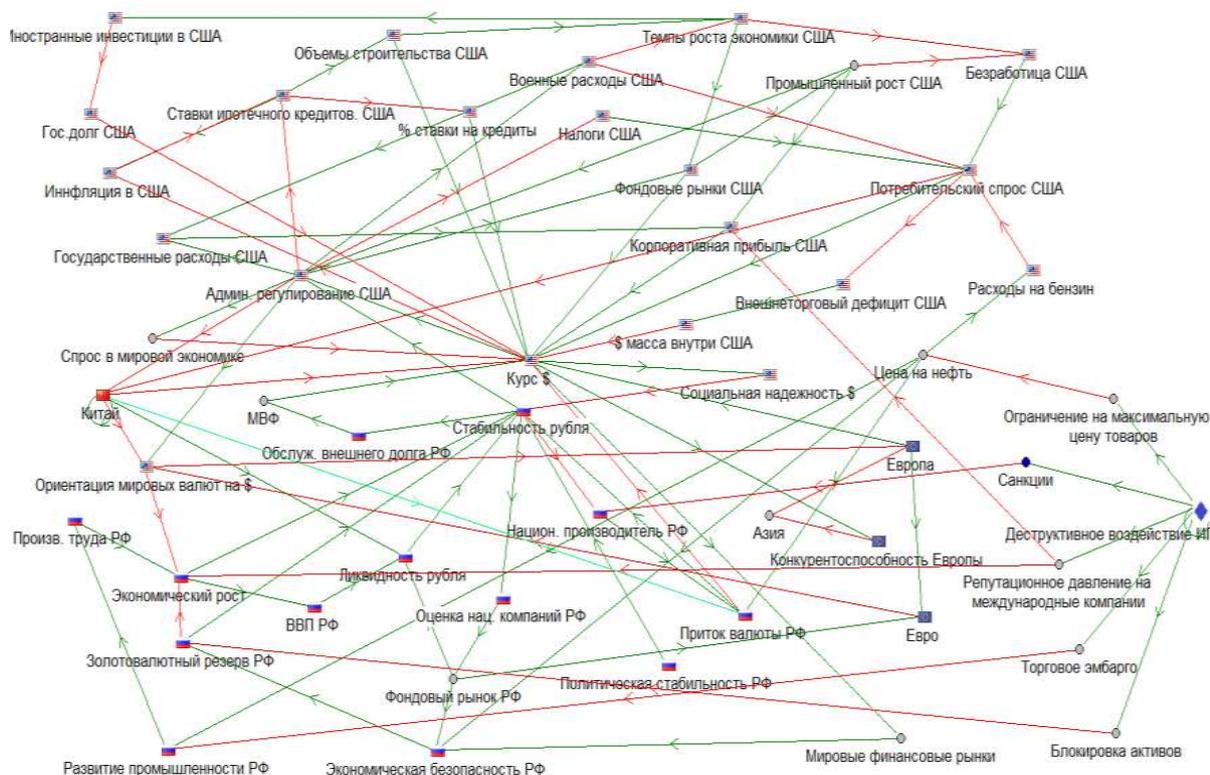


Рисунок 1 – Сценарная модель

Второй блок представляет собой внешнюю и внутреннюю политику Российской Федерации в сфере экономики, а также наиболее значимые сферы экономики. Третий блок описывает внешние деструктивные воздействия иностранных государств без привязки к конкретным странам.

На рисунке 2 представлены результаты сценарного исследования поведения системы в двух разных сценариях. Первый сценарий отражает попытку уйти от доллара без использования дополнительных мер поддержки торговой деятельности и позитивного внешнего воздействия стран-партнеров. Стабильность рубля, в том числе в связи с активным внешним противоборством, быстро стремится к негативному состоянию, что не удовлетворяет никакие из возможных критериев стабильности экономики. Второй сценарий, учитывающий активное влияние фактора «Китай», которое отображается в первую очередь в расчетах во внешнеторговых операциях в национальных валютах.

На первом этапе, как видно из рисунка 2, осуществления данной политики может показаться успешной, система стабильна, но на долгосрочном временном отрезке нарастающие колебательные процессы приводят к дестабилизации.

Такое развитие событий говорит о том, что в структуре модели имеются «длинные» колебательные циклы, которые постепенно начинают доминировать в сценарии.

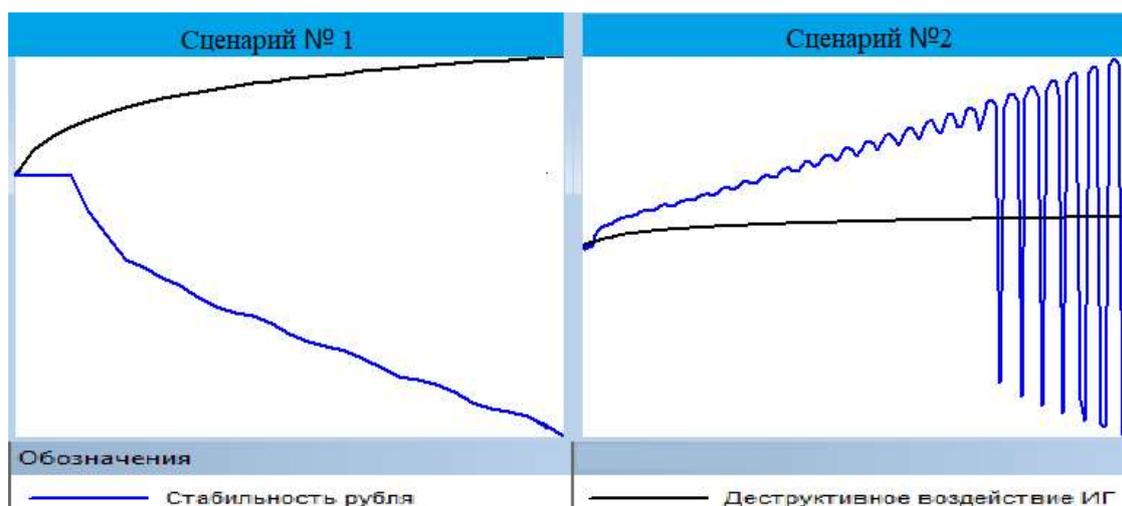


Рисунок 2 – Возможные сценарии поведения системы

В связи с этим корректным решением в данной ситуации является оценка циклов (рисунок 3), так как длинные циклы имеют неявные и трудно анализируемые последствия, особенно если учитывать стратегический уровень планирования, соответственно, количество вводимых перемен стремительно возрастает.

Вершины		Дуги	
	Начальная Вершина	Конечная Вершина	Количество
▶	Стабильность рубля	Оценка нац. компаний РФ	6
	Оценка нац. компаний РФ	Фондовый рынок РФ	6
	Фондовый рынок РФ	Экономическая безопасность РФ	3
	Экономическая безопасность РФ	Золотовалютный резерв РФ	3
	Ликвидность рубля	Курс рубля	3
	Фондовый рынок РФ	Евро	2
	Экономический рост	Курс рубля	2
	Экономический рост	ВВП РФ	2
	Евро	Ориентация мировых валют на \$	2
	Ориентация мировых валют на \$	Экономический рост	2
	Золотовалютный резерв РФ	Экономический рост	2
	ВВП РФ	Ликвидность рубля	2
	Курс рубля	Национ. производитель РФ	1
	Национ. производитель РФ	Приток валюты РФ	1
	Фондовый рынок РФ	Ликвидность рубля	1
	Приток валюты РФ	Курс рубля	1
	Золотовалютный резерв РФ	Курс рубля	1

Количество циклов: 7

Выход

Рисунок 3 – Подсчет циклов для вершины «Стабильность рубля»

Фактор «Стабильности рубля» в представленной имитационной модели входит в 6 циклов, наиболее значимым фактором в которых без учета рубля является «Оценка национальных компаний». Для выявления причин неэффективности второго сценария предлагается более детально проанализировать циклы, связанные с вышеперечисленными факторами. Анализ выявленных шести циклов показал, что стабильность рубля в представленной системе имеет некоторое количество уязвимых мест, например, евро входит в два цикла, но все они являются четными и не влияют на дестабилизацию (колебательные процессы) во втором сценарии. Данный факт обуславливается спецификой взаимодействия на международной арене, так как большинство сделок в сфере торговли нефтью и газа на данный момент осуществляется именно в национальной валюте США. Анализ показал, что из 6 циклов только один является нечетным (рисунок 4). Нечетность этого

цикла обусловлена связью между факторами «Экономический рост» и «Золотовалютный резерв РФ».



Рисунок 4 – Нечетный цикл длиной в 8 вершин

Изменение знака этой взаимосвязи, т.е. при поддержке экономического роста золотовалютными резервами, на долгосрочном временном отрезке представляется возможным стабилизировать сценарий ухода от валюты недружественных стран. На рисунке 5 последний этап сценария связан именно с этим структурным управляющим воздействием. Использование национальной валюты дружественных государств, при корректной поддержке процессов, приведет к долгосрочным положительным показателям в сфере экономики, несмотря на достаточно сильную неопределенность и дестабилизацию в среднесрочном временном периоде.

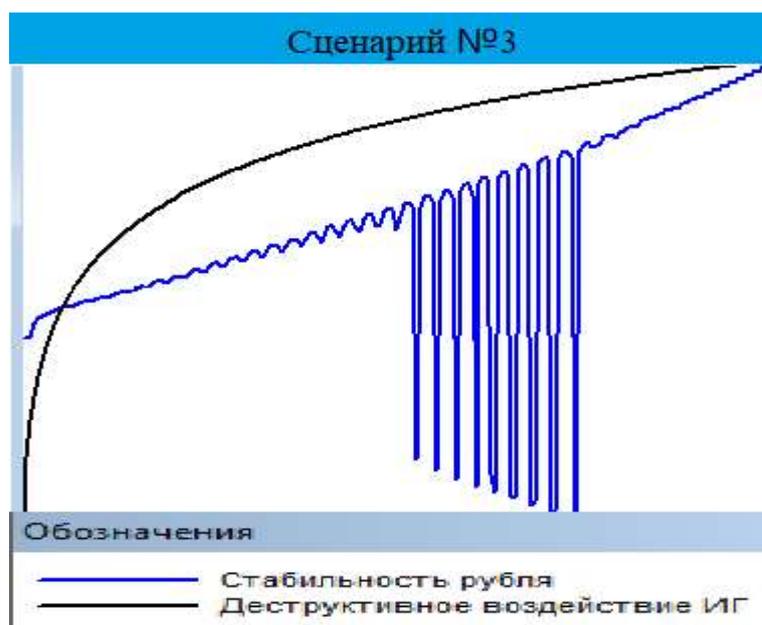


Рисунок 5 – Итоговый сценарий

В заключении стоит отметить, что корректное использование золотовалютных запасов может позитивно повлиять на стабильность экономических процессов. Так, например, если рассматривать экономический блок БРИКС, то наиболее эффективным сценарием для стран является создание объединенной валюты, основанной на золотом стандарте. Исходя из результатов моделирования, эффективное использование ЗВР на долгосрочном временном интервале улучшит показатели экономик, несмотря на внешнее деструктивное воздействие.

Литература:

1. *Eaton J., Engers M.* Sanctions // *Journal of political economy.* – 1992. – Vol. 100. № 5. – P. 899-928.
2. *Auboin M., Ruta M.* The relationship between exchange rates and international trade: a literature review // *World Trade Review.* – 2013. – Vol. 12. Issue 3. – P. 577-605.
3. *Stepanenko V.* How Ukrainians View Their Orange Revolution: Public Opinion and the National Peculiarities of Citizenry Political Activities // *Demokratizatsiya.* – 2005. – Vol. 13. № 4. – P. 595-615.
4. *Ivanov Y.* Revolutions in Kyrgyzstan // *Handbook of revolutions in the 21st century: The new waves of revolutions, and the causes and*

effects of disruptive political change. – Cham: Springer International Publishing, 2022. – P. 517-547.

5. *Beissinger M.R., Jamal A.A., Mazur K.* Explaining divergent revolutionary coalitions: Regime strategies and the structuring of participation in the Tunisian and Egyptian revolutions // *Comparative Politics*. – 2015. – Vol. 48. № 1. – P. 1-24.

6. *Barmin Y.* Revolution in Libya // *Handbook of revolutions in the 21st century: The new waves of revolutions, and the causes and effects of disruptive political change*. – Cham: Springer International Publishing, 2022. – P. 725-738.

7. *Mankiw N.G., Taylor M.P.* Economics. – South-Western Cengage Learning, 2014. – 812 p.

8. *Chernov I.V.* Scenario Analysis of the Impact of Rocket and Space Activities on the State of the Environment // *IFAC-PapersOnLine*. – 2021. – Vol. 54. № 13. – P. 145-149.

9. *Чернов И.В.* Сценарные методы повышения эффективности реализации жизненного цикла программно-целевого управления (анализ концепции) // *Проблемы управления*. – 2021. – № 5. – С. 88-93.

DOI: 10.25728/iccss.2023.91.54.014

Володина Н.Н., Комков Н.И., Сутягин В.В.

Проблемы социальной гармонизации российской экономической системы

Аннотация: Социальная и экономическая компоненты образуют общую систему взаимоотношений экономики и общества, где каждая из них является основой и одновременно потребителем благ и услуг, создаваемых и обменивающихся между собой компонент. В процессе их развития каждая из них старается достичь своих целей, что невозможно без учета состояния и целей развития смежной компоненты. Однако достижение целей социальной компоненты во многом зависит от уровня достижения целей экономики.