

працюють у добувній галузі України, практику та звітність суб'єктів господарювання на засадах довіри із громадянським суспільством, прозорості діяльності, включення цілей сталого розвитку до показників ефективності бізнесу.

## **5.2. Оцінка впливу зовнішньоторговельного співробітництва України з країнами ЄС на рівень зовнішньоекономічної безпеки.**

В умовах глобалізації господарської діяльності актуальним як з теоретичної, так і з практичної точки зору є дослідження і наукове обґрунтування перспективних напрямків розвитку зовнішньоекономічних зв'язків. На сьогоднішній день головною стратегічною метою соціально-економічного розвитку України є отримання гідної позиції в міжнародному поділі праці, зокрема, в сфері зовнішньої торгівлі товарами та послугами. Європейська інтеграція і членство в Європейському Союзі є стратегічною метою України, адже це означає формування соціально-орієнтованої ринкової економіки, побудову розвинутої демократичної держави, зміцнення позиції країни на міжнародній арені, а також можливість отримати істотні техніко-технологічні досягнення, які сприятимуть економічному зростанню і взаємовигідній співпраці України з країнами ЄС, що займають провідні позиції в світовому господарстві. У зв'язку з цим, доцільно оцінити рівень інтенсивності зовнішньоторговельного співробітництва України та ЄС, а також дати оцінку його впливу на рівень зовнішньоекономічної безпеки країни, оскільки інтеграція України в європейський простір супроводжується цілою низкою як позитивних, так і негативних факторів.

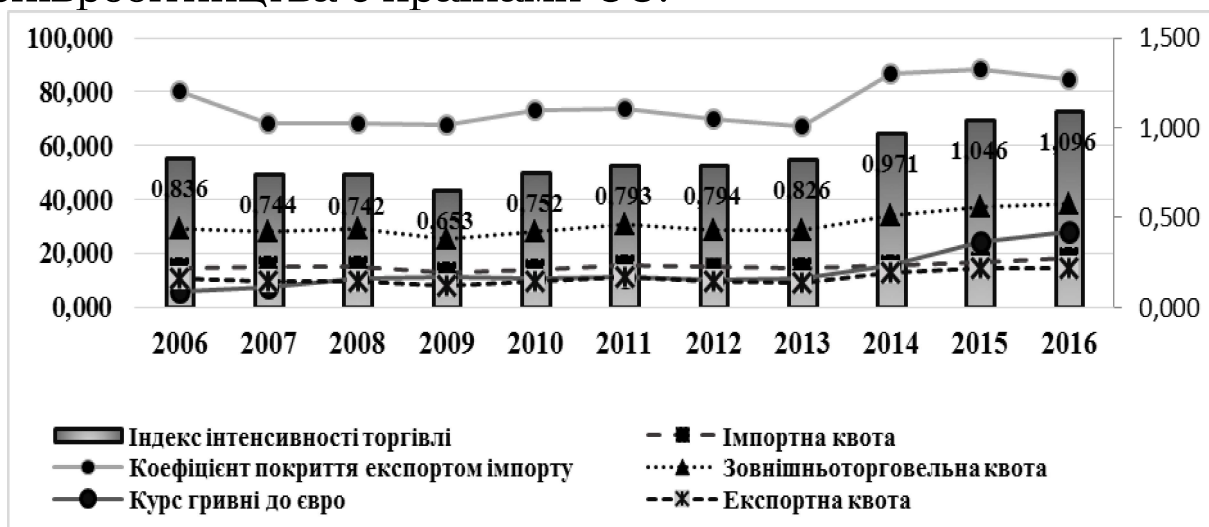
За останні роки значно змінилися умови ведення експортно-імпоротної діяльності через підписання Україною цілого ряду міжнародних угод. Так, в 2014

році було підписано Угоду про Асоціацію між Україною та ЄС (яке вступило в силу лише 1 січня 2016 р.). В основі цієї угоди лежить зона вільної торгівлі, яка передбачає створення сприятливого бізнес-середовища, в якій вигоду отримають не тільки європейські, але і вітчизняні підприємства та пересічні громадяни. Ці події істотно розширили експортні та імпорتنі можливості України, одночасно створивши і певні перешкоди. Крім того, особливістю останніх років стало зменшення території України, яка враховується при розрахунку обсягів зовнішньої торгівлі, в результаті окупації Криму та частини Донецької та Луганської областей. Усе це робить зміни умов експорту та імпорту надзвичайно динамічними і вимагає оперативної оцінки ситуації для своєчасної реакції на нові реалії.

Досить інформативним показником, який виступає і як індикатор ступеня зовнішньої торговельної інтеграції країни, і як показник, що характеризує рівень орієнтації країни на торгівлю з певною країною або групою країн в порівнянні з рештою країн світу, на наш погляд, є індикатор інтенсивності торгівлі, який, у нашому випадку, розраховується як відношення частки ЄС в експорті України (%) до частки ЄС в світовому експорті (%) (рис. 5.4).

Отже, на основі отриманих значень індексу інтенсивності зовнішньої торгівлі України з країнами ЄС, можна констатувати загальну тенденцію до зростання інтенсивності зовнішньоторговельного співробітництва починаючи з 2010 р. При цьому, якщо протягом аналізованих 2006-2014 рр. зовнішня торгівля України з ЄС відігравала менш важливу роль – відповідні індекси були нижче 1, то протягом 2015-2016 рр. зовнішньоторговельне співробітництво можна розглядати як відносно інтенсивне, адже отримані коефіцієнти перевищують 1. Поясненням (частковим) такої ситуації є і більша орієнтація України у зовнішньоторговельній сфері протягом тривалого часу на країни колишнього СРСР (особливо до середини 2000-х років), і значне зниження, і

у абсолютному, і у відносному вираженні, обсягів зовнішньої торгівлі України з Російською Федерацією, на фоні деякого зростання зовнішньоторговельного співробітництва з країнами ЄС.



**Рис. 5.4. Динаміка окремих показників, що характеризують зовнішню торгівлю України з країнами ЄС, 2006-2016 рр.**

В цілому інтенсивність зовнішньої торгівлі України і ЄС характеризується високою мінливістю і постійно змінюється під впливом великої сукупності різних факторів. У зв'язку з цим, необхідним є виявлення цих факторів та оцінка їх впливу на рівень інтенсивності торгівлі. Для цього було використано метод кореляційно-регресійного аналізу, в рамках якого було здійснено парний кореляційно-регресійний аналіз та на його основі виявлено ступінь та характер взаємозв'язків між показником інтенсивності зовнішньої торгівлі України з країнами ЄС та системою факторних ознак. У якості останніх обрано наступні: експортна квота, зовнішньоторговельна квота, імпортна квота, курс гривні до євро, коефіцієнт покриття експортом імпорту, індекс відкритості економіки, індекс умов торгівлі.

Результати проведеного парного кореляційно-регресійного аналізу представлено у таблиці 5.8.

Проведений аналіз свідчить, що найбільш значимими факторами, які значною мірою можуть впливати на рівень інтенсивності зовнішньої торгівлі України і ЄС, є:

експортна квота ( $r_{xy} = 0,96$ ), коефіцієнт покриття експортом імпорту ( $r_{xy} = 0,87$ ), зовнішньоторговельна квота ( $r_{xy} = 0,96$ ), імпортна квота ( $r_{xy} = 0,88$ ) і курс гривні до євро ( $r_{xy} = 0,85$ ). Між зазначеними показниками існує тісний та прямий зв'язок, отже, можна відзначити, що саме зростання цих факторів сприяє підвищенню рівня інтенсивності торгівлі України з країнами ЄС. Такі показники, як індекс відкритості економіки і індекс умови торгівлі через їх слабкий зв'язок з результативною ознакою (індексом інтенсивності торгівлі) не були взяті до уваги та виключені для подальшого аналізу.

Таблиця 5.8

**Кореляційно-регресійний аналіз взаємозв'язку  
рівня інтенсивності торгівлі України і ЄС з різними  
показниками (на основі динаміки змін за 2006-  
2016 рр.)**

| № моделі | Фактори впливу                                     | Коефіцієнт кореляції Пірсона ( $r_{xy}$ ) | Коефіцієнт детермінації $R^2$ | Коефіцієнт еластичності E | Рівняння регресії    |
|----------|----------------------------------------------------|-------------------------------------------|-------------------------------|---------------------------|----------------------|
| 1        | Для зв'язку з експортною квотою                    | 0,961                                     | 0,924                         | 0,792                     | $Y = 6,164x + 17,48$ |
| 2        | Для зв'язку з імпортною квотою                     | 0,876                                     | 0,768                         | 1,44                      | $Y = 7,911x - 36,95$ |
| 3        | Для зв'язку з зовнішньоторговельною квотою         | 0,963                                     | 0,927                         | 1,181                     | $Y = 3,226x - 15,2$  |
| 4        | Для зв'язку з курсом гривні до євро                | 0,851                                     | 0,724                         | 0,27                      | $Y = 1,707x + 61,36$ |
| 5        | Для зв'язку коефіцієнта покриття експортом імпорту | 0,874                                     | 0,765                         | 1,334                     | $Y = 1,49x - 28,08$  |

Таким чином, рівняння парної лінійної регресії свідчать про наступний вплив факторів на індикатор інтенсивності торгівлі:

1) При зростанні експортної квоти країни на 1%, рівень інтенсивності торгівлі між Україною та ЄС збільшиться на 6,2%;

2) Зі збільшенням імпоротної квоти на 1%, рівень інтенсивності торгівлі зросте на 7,9%;

3) Зростання зовнішньоторговельної квоти на 1% зумовить збільшення індикатора інтенсивності торгівлі на 3,2%;

4) Збільшення темпів зростання курсу гривні до євро на 1%, призведе до зростання рівня інтенсивності торгівлі на 1,7%;

5) При зростанні значення коефіцієнта покриття експортом імпорту на 1%, рівень інтенсивності торгівлі зросте на 1,5%.

Також відзначимо, що найбільш адекватними моделями є перша і друга моделі, згідно з якими 92% варіації рівня інтенсивності торгівлі пов'язано зі зміною експортної та зовнішньоторговельної квот. Меншу апроксимацію підтверджує четверта модель, яка свідчить про те, що лише 72% варіації рівня інтенсивності торгівлі України з ЄС викликано зміною курсу гривні до євро.

Таким чином, можна зробити висновки про позитивний вплив зазначених чинників на рівень інтенсивності зовнішньоторговельного співробітництва України з країнами ЄС.

Слід зазначити, що інтеграція України в систему європейського простору, одним з проявів якої є зростання інтенсивності торгівлі між країнами, супроводжується цілою низкою як позитивних, так і негативних явищ, які слід враховувати та мінімізувати (за необхідності) в контексті забезпечення економічної безпеки України.

Економічна безпека виступає важливою характеристикою національної економіки. З огляду на умови глобалізації, а саме поглиблення взаємозалежності економік різних країн, можемо сказати, що прийняття важливих політичних рішень неможливе без урахування факторів економічної безпеки країни. Так, за визначенням Т. Сака, економічна безпека – це стан держави, який забезпечує можливість створення і розвитку умов для плідного життя її населення, перспективного розвитку її економіки в майбутньому і

зростання добробуту її громадян [112, с.336]. Однією з найважливіших складових економічної безпеки є зовнішньоекономічна безпека, яка на думку З. Варналія, полягає в мінімізації збитків держави від впливу негативних зовнішніх чинників, створенні сприятливих умов для розвитку економіки шляхом її активної участі у світовому розподілі праці, відповідності зовнішньоекономічної діяльності національним економічним інтересам [18, с.50-51]. Подібне визначення можна зустріти і в Методиці розрахунку рівня економічної безпеки [95].

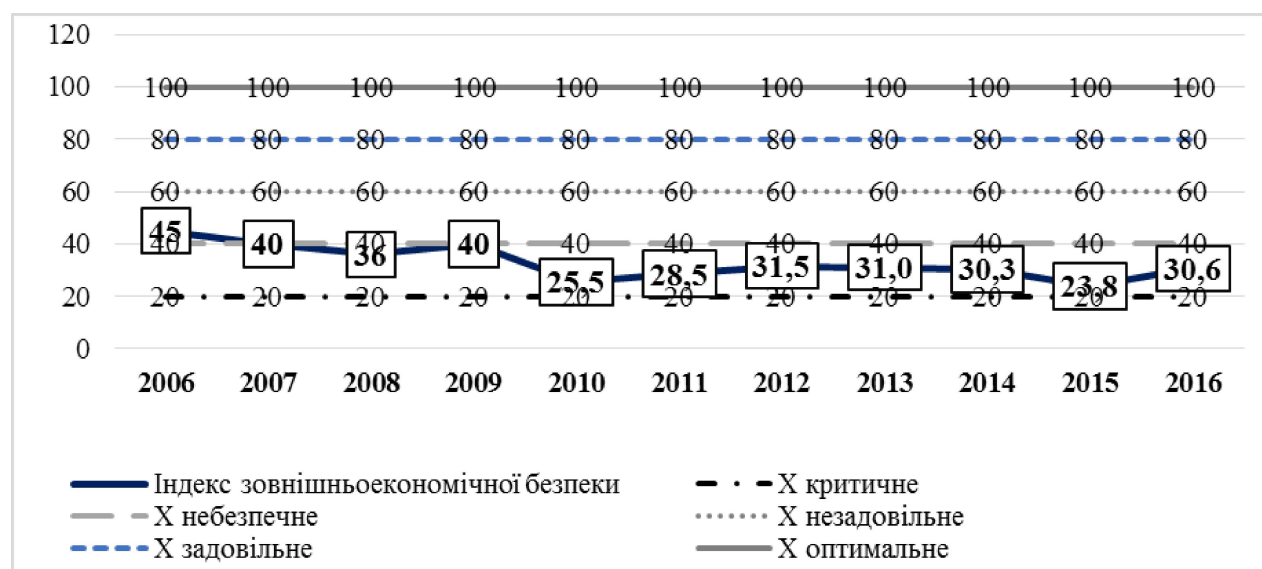
Основними показниками для аналізу загального стану зовнішньоекономічної безпеки є обсяги експорту та імпорту, структура експорту та імпорту, обсяг ВВП, рівень доларизації національної валюти, частка експорту в ВВП тощо. Ці показники використовуються в подальшому для розрахунку індикаторів зовнішньоекономічної безпеки відповідно до методики і їх подальшої оцінки [83, с.151].

Методика розрахунку рівня економічної безпеки, затверджена Наказом Міністерства економічного розвитку і торгівлі України від 29 жовтня 2013 № 127, має на меті визначення рівня економічної безпеки України як однієї з основних складових національної безпеки держави. Методика та визначає перелік основних індикаторів економічної безпеки України, їх порогові значення, а також алгоритм розрахунку інтегрального індексу економічної безпеки.

Так, в 2006 р. рівень зовнішньоекономічної безпеки України складав лише 45% від оптимального, що відповідало незадовільному стану зовнішньоекономічної безпеки. Більш того, зниження рівня зовнішньоекономічної безпеки протягом наступних 1 років склало ще 15% і на сучасному етапі він характеризується як «небезпечний» (30,6% за результатами 2016 р.) (рис. 5.5).

Таке положення було викликано внаслідок істотного погіршення значень усіх індикаторів, включаючи індикатор відкритості національної економіки. Вирішальний вплив на динаміку рівня зовнішньоеконо-

мічної безпеки мало зменшення коефіцієнта покриття експортом імпорту, що знижується вже другий рік поспіль внаслідок випереджаючого зростання обсягів імпорту товарів і послуг над обсягами експортних операцій. Також значно погіршилися показники ефективності використання транзитних потужностей магістральної системи України.



**Рис. 5.5. Динаміка індексу зовнішньоекономічної безпеки України, 2006-2016 рр.**

Необхідно відзначити, що на рівень зовнішньоекономічної безпеки впливає багато внутрішніх і зовнішніх факторів. З метою оцінки впливу подальшого поглиблення співпраці України з країнами ЄС та підвищення її інтенсивності у сфері зовнішньої торгівлі на рівень зовнішньоекономічної безпеки країни (результативна ознака) та виявлення умов, необхідних для зростання економічної безпеки держави застосовано багатофакторний кореляційно-регресійний аналіз. В якості факторних ознак була обрана система показників, що характеризує товарні структури експорту і імпорту України та ЄС за їх найбільшою питомою вагою у загальних обсягах експортно-імпортних операціях між країнами та наведена у таблиці 5.9.

Таблиця 5.9

**Система результативної та факторних ознак  
кореляційно-регресійного аналізу**

| Роки | Індекс зовнішньоекономічної безпеки (Y) | Індекс інтенсивності експорту зернових культур (x1) | Індекс інтенсивності експорту олійного насіння (x2) | Індекс інтенсивності експорту тваринної та рослинної олії (x3) | Індекс інтенсивності експорту заліза і сталі (x4) | Індекс інтенсивності експорту машин та транспорту (x5) | Індекс інтенсивності імпорту палива і ПММ (x6) | Індекс інтенсивності імпорту хімічної продукції (x7) | Індекс інтенсивності імпорту машинобудування та транспорту (x8) |
|------|-----------------------------------------|-----------------------------------------------------|-----------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------|--------------------------------------------------------|------------------------------------------------|------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------|
| 2002 | 45,00                                   | 10,09                                               | 1,17                                                | 5,12                                                           | 6,74                                              | 0,27                                                   | 0,67                                           | 1,22                                                 | 0,87                                                            |
| 2003 | 47,00                                   | 1,49                                                | 7,02                                                | 5,25                                                           | 7,14                                              | 0,36                                                   | 1,03                                           | 1,17                                                 | 0,93                                                            |
| 2004 | 48,00                                   | 2,78                                                | 3,7                                                 | 5,19                                                           | 7,72                                              | 0,31                                                   | 0,37                                           | 1,25                                                 | 1,07                                                            |
| 2005 | 48,00                                   | 5,1                                                 | 4,45                                                | 6,08                                                           | 8,17                                              | 0,22                                                   | 0,39                                           | 1,26                                                 | 1,04                                                            |
| 2006 | 45,00                                   | 3,1                                                 | 10,68                                               | 10,17                                                          | 8,8                                               | 0,24                                                   | 0,67                                           | 1,24                                                 | 1,07                                                            |
| 2007 | 40,00                                   | 0,83                                                | 11,52                                               | 14,57                                                          | 7,17                                              | 0,35                                                   | 0,83                                           | 1,23                                                 | 1,15                                                            |
| 2008 | 36,00                                   | 7,24                                                | 25,32                                               | 7,25                                                           | 8,07                                              | 0,36                                                   | 1,05                                           | 1,17                                                 | 1,09                                                            |
| 2009 | 40                                      | 6,11                                                | 29,28                                               | 10,61                                                          | 7,61                                              | 0,56                                                   | 0,93                                           | 1,47                                                 | 0,8                                                             |
| 2010 | 40                                      | 1,87                                                | 20,43                                               | 10,48                                                          | 10,41                                             | 0,46                                                   | 1,02                                           | 1,45                                                 | 0,8                                                             |
| 2011 | 35                                      | 7,54                                                | 17,46                                               | 6,71                                                           | 9,61                                              | 0,39                                                   | 0,94                                           | 1,33                                                 | 0,96                                                            |
| 2012 | 30                                      | 14,29                                               | 21,33                                               | 8,64                                                           | 7,93                                              | 0,52                                                   | 0,93                                           | 1,37                                                 | 0,96                                                            |
| 2013 | 31,04                                   | 12,28                                               | 22,19                                               | 5,57                                                           | 9,74                                              | 0,43                                                   | 1,47                                           | 1,38                                                 | 0,86                                                            |
| 2014 | 30,25                                   | 13,07                                               | 18,31                                               | 9,1                                                            | 9,27                                              | 0,42                                                   | 2,69                                           | 1,38                                                 | 0,64                                                            |
| 2015 | 23,75                                   | 15,36                                               | 16,83                                               | 9,99                                                           | 8,58                                              | 0,46                                                   | 4,4                                            | 1,3                                                  | 0,61                                                            |
| 2016 | 30,6                                    | 13,5                                                | 17,93                                               | 8,64                                                           | 9,54                                              | 0,44                                                   | 2,45                                           | 1,38                                                 | 0,78                                                            |

Проведений кореляційний аналіз засвідчив, що між такими показниками як: індекс інтенсивності експорту зернових культур, індекс інтенсивності імпорту палива та ПММ і індексом зовнішньоекономічної безпеки України існує сильний та зворотній зв'язок ( $0,7 < r_{xy} < 0,9$ ). Також зазначимо, що між рівнем зовнішньоекономічної безпеки та інтенсивністю експорту олійного насіння і інтенсивністю імпорту продукції машинобудування спостерігається помірний та зворотній зв'язок, що вимірюється кореляцією  $r = -0,65$  та  $r = -0,67$  відповідно. Прямим та помірним зв'язком вимірюється тільки залежність між індексом інтенсивності імпорту продукції машинобудування та рівнем зовнішньоекономічної безпеки ( $r=0,61$ ). Інші показники для подальшого аналізу вилучено, адже результати кореляційного аналізу



зазначили їх слабкий вплив ( $r < -0,5$ ) на рівень зовнішньоекономічної безпеки.

Таким чином, виходячи з рівняння багатofакторної регресії  $Y = 74.38 - 0.71 \cdot x_1 - 0.24 \cdot x_2 - 0.16 \cdot x_3 - 4.27 \cdot x_4 - 17.05 \cdot x_5$  можна зробити наступні висновки про характер впливу зазначених факторів на індикатор зовнішньоекономічної безпеки:

1) При зростанні індексу інтенсивності експорту зернових культур з України до країн ЄС на 1% рівень зовнішньоекономічної безпеки може знизитися на 0,71%;

2) Зі збільшенням інтенсивності експорту олійного насіння на 1% з України до ЄС на рівень зовнішньоекономічної безпеки знизиться на 0,24%;

3) Зростання показника інтенсивності експорту продукції машинобудування на 1% зумовить падіння рівня зовнішньоекономічної безпеки на 0,16%;

4) Зростання індексу інтенсивності імпорту палива і ПММ на 1% в свою чергу зумовить падіння рівня зовнішньоекономічної безпеки на 4,27%;

5) Зі збільшенням індексу інтенсивності імпорту машинобудування та транспорту на 1% рівень зовнішньоекономічної безпеки зменшиться на 17,05%.

Також відзначимо, що всі представлені моделі є адекватними, тому що коефіцієнт апроксимації  $> 0,8$  ( $R^2 = 0,94$ ). Це означає, що 94% всіх змін рівня зовнішньоекономічної безпеки викликано впливом вищевказаних чинників, а решта 6% - неврахованими факторами.

Звичайно, отримані результати на основі виявлення залежностей між обраними факторами є дещо несподіваними. Адже інтеграція України до системи світового господарства, зокрема до європейського простору розглядається як фактор позитивних зрушень у економіці країни. Проте пояснення виявлених закономірностей криється в недосконалій товарній структурі експорту та імпорту між Україною та ЄС: протягом останніх років ще більшою мірою

деформується структура українського товарного експорту в бік зростання в ній частки товарів з низьким рівнем доданої вартості і, навпаки, зростає питома вага імпорту європейських товарів з більш високою високотехнологічною часткою. Звичайно, така ситуація не може розглядатися у якості позитивних зрушень в економіці та може бути загрозливою щодо економічної безпеки країни, за умови збереження зазначених вище тенденцій.

Таким чином, одним з найвагоміших напрямків подальшої інтеграції України в європейський простір у сфері зовнішньоторговельного співробітництва є забезпечення відповідного рівня її зовнішньоекономічної безпеки. Збереження зазначених вище негативних тенденцій, послаблює не тільки рівень зовнішньоекономічної сфери, а й здатність забезпечити сталий розвиток національної економіки в умовах євроінтеграції та глобалізації. У зв'язку з цим доцільно розробити концепцію зовнішньоекономічної безпеки держави. Перш за все необхідно стабілізувати курс національної валюти; зробити акцент на інноваційному розвитку, наростити експорт інноваційної продукції, підвищити науково-технологічний рівень вітчизняних підприємств; створити сприятливі умови для залучення інвестицій; оптимізувати торговельний баланс за рахунок розвитку внутрішнього ринку і виробництва; розробити заходи з підтримки тих підприємств, які орієнтовані на експорт та зменшити рівень імпортової залежності за рахунок стимулювання розвитку внутрішнього ринку. Це дасть можливість не тільки налагодити взаємовигідні зовнішньоторговельні зв'язки з ЄС, а й також збільшити рівень зовнішньоекономічної безпеки країни.