

**Економічна теорія**

Вікторія ДЕРГАЧОВА,
Олександр ЗГУРОВСЬКИЙ

**ПРОЦЕСИ ЕКОНОМІЧНОЇ ГЛОБАЛІЗАЦІЇ
В МІЖНАРОДНИХ ЗІСТАВЛЕННЯХ****Резюме**

Проаналізовано процеси економічної глобалізації, парадигми сучасної глобалістики. Розглянуто дві найбільш відомі методики кількісного і якісного вимірювання глобалізації: Швейцарського Інституту дослідження бізнесу (KOF) та Міжнародної організації Carnegie Endowment for International Peace (CEIP), на основі яких запропоновано методику кількісного аналізу рівня глобалізації країн світу (МКАГ), сутність якої полягає у встановленні якісних взаємозв'язків між різними індикаторами соціального, економічного та політичного вимірів глобалізації та індикаторами глобального економічного розвитку, якісного та кількісного аналізу глобалізації з урахуванням впливу кризових явищ на ці процеси. Виділено три групи вихідних індикаторів, які визначають різницю між країнами в контексті глобалізації. Виконаний порівняльний аналіз рівня глобалізації різних країн світу.

Ключові слова

Глобалізація, індекс глобалізації, індикатор, методика кількісного аналізу рівня глобалізації країн світу (МКАГ), економічний вимір глобалізації, соціальний вимір глобалізації, політичний вимір глобалізації, факторний аналіз.

© Вікторія Дергачова, Олександр Згуровський, 2011.

Дергачова Вікторія, докт. екон. наук, Національний технічний університет «Київський політехнічний інститут», Україна

Згуровський Олександр, аспірант, Національний технічний університет «Київський політехнічний інститут», Україна.

Класифікація за JEL: F01.

Глобальна економіка – це спосіб світового ведення господарства, який ґрунтується на підпорядкуванні як внутрішніх, так і міжнародних господарських процесів одним законам. Глобалізація – це результат інтернаціоналізації всіх сфер громадського життя, установлення безпосередніх стійких зв'язків між суб'єктами різних країн, унаслідок чого виробничий процес в одній країні стає складовою частиною процесу, який здійснюється у планетарному масштабі. Світова економіка стає єдиним ринком і виробничою зоною з національними та регіональними секторами, а не простою сукупністю національних економік, що розгортають взаємне економічне співробітництво.

Україна відчула вплив глобалізації вже з перших років незалежності, коли її економіка і суспільна сфера стали відкритими для світу. Нові явища принесли країні нові можливості та перспективи. Розширювався доступ до культурних, інтелектуальних і технологічних здобутків світового співтовариства. Твори світового кінематографу, літератури, музики дуже швидко стали звичним оточенням кожної людини. Ще такі престижні та дорогі вчора речі, як автомобілі, комп'ютери, Інтернет, системи комунікації із зовнішнім світом, мобільний зв'язок тощо, стали невід'ємними засобами використання сучасної людини, що зробило її значно функціональнішою і продуктивнішою. Стало дедалі простіше зв'язуватися з людьми в будь-яких куточках світу, швидше діставатися до іншого місця або отримувати свіжі новини одразу після тієї чи іншої події.

Але Україна також відчула на собі й усі суперечності глобалізації. З одного боку, її шанси скористатися перевагами глобалізації зросли, але з іншого – вона стала відкритішою для нових загроз. Вразливість України до них значно зросла з початком глобальної економічної кризи. До цих загроз Україна, як молода держава, не була підготовлена і, в більшості випадків, виявилася від них не захищеною.

Стратегія розвитку України не може бути сформована без повного урахування факторів глобалізації та глобальної конкуренції, які впливатимуть і вже впливають на життя націй. При цьому пріоритет неодмінно має бути відданий внутрішнім процесам, внутрішній адаптації економіки, тобто інтравертивному характеру політики, для того щоб Україна могла вписатися в нові історичні умови. Але внутрішня стратегія розвитку України має бути глобально орієнтованою, тобто, по-перше, ефективною, з точки зору протидії новим руйнуючим впливам глобалізації, і, по-друге – прагматичною, з точки зору використання нових можливостей і переваг, які вона приносить.

Дослідженню проблематики і розвитку процесів глобалізації присвячено роботи відомих вітчизняних і зарубіжних вчених: О. Г. Білоруса, Б. В. Губського, М. Г. Делягіна, Г. Колодка, Ю. В. Макогона, А. А. Пересади, А. С. Філіпенка, У. Шарпа. Разом з тим, у науковій літературі мало уваги приділено питанням якісного та кількісного аналізу глобалізації з урахуванням впливу кризових явищ на ці процеси, недостатньо обґрунтованими залишаються індекси динаміки глобалізації та відсутні дослідження щодо переривчастого характеру процесів глобалізації та впливу показників безпеки і соціо-економічного розвитку на процеси глобалізації. Таким чином, об'єктивна необхідність подальшого розвитку теоретичних і методико-прикладних основ дослідження процесів глобалізації зумовили актуальність теми даної роботи.

Сутність глобалізації, основна тенденція її розвитку – формування єдиного взаємозалежного світу, взаємодія та взаємовплив різних співтовариств, культур і цивілізацій. У широкому значенні та в ідеалі глобалізація перетворює нинішній світоустрій у планетарному масштабі, втілює ідею, що йде з давнини, прийдешньої *єдності людського співтовариства при збереженні своєрідності його складових*.

Але ідея єдності людського буття, світової гармонії, планетарного співтовариства, «глобальність» світу зовсім не нова. Вона висловлювалася понад дві тисячі років тому давніми грецькими філософами, її носіями були Христос, Магомет, Будда, генії культури, чия творчість подолала національні межі. Важко пояснити, чому людство виявилось роз'єднаним, причому за багатьма ознаками: расовими, етнічними, мовними, релігійними, цивілізаційними та ін. Ця несхожість «будівельників Вавилонської вежі», поділ за принципом «свій-чужий» була однією із причин конфліктів, воєн, світових катаклізмів. Однак люди різних племен і народів спілкувалися між собою, торгували, обмінювалися знаннями та культурою.

Таким чином, можна стверджувати, що глобалізація в її первинних проявах, названа деякими авторами «протоглобалізацією», об'єктивно супроводжувала всю людську історію, хоч і проходила нерівномірно, у «пульсуючому» режимі, концентруючись у тому чи іншому регіоні, в ареалі тієї чи іншої цивілізації Стародавнього світу і наступних часів. Тобто сучасна глобалізація світової економіки – це не якийсь несподіваний феномен, а еволюція процесу освоєння і перетворення нашої планети.

Протоглобалізація відбувалася в різних сферах: релігійній, коли місце багатобожжя і язичництва зайняли світові монорелігії [1]; політичній, коли племена перетворювались на народи, створювалися держави, формувалися нації, регіональні співтовариства [2]; геополітичній, коли освоювалися нові простори й утворювалися імперії [3]; ідеологічній, коли ті чи інші соціальні ідеї поширювалися на багато територій і країн [4]; у сфері освіти, коли, завдяки мережі Інтернет, доступ до освіти одержали всі території та верстви населення [5].

Усе це дає підстави стверджувати, що глобалізація – це процес, що споконвіку властивий людству. З глибини віків взаємне проникнення культур і економік різних країн світу відкривало для людства нові можливості для подальшого розвитку. «Великий шовковий шлях» як торгівельна і культурна магістраль між Сходом і Заходом виник у III столітті до нашої ери і проіснував до XVI. Він виявився одним з найвидатніших досягнень в історії світової цивілізації. Розгалужені мережі караванних доріг перетинали Європу та Азію від Середземномор'я до Китаю і слугували в давні часи та в епоху Середньовіччя важливим засобом торгівельних зв'язків і діалогу між культурами багатьох народів. Без перебільшення, це була *перша потужна хвиля глобалізації*. Її надовго перервали кровопролитні війни XVII–XVIII віків.

Друга хвиля глобалізації пов'язана з періодом, що розпочався в 1880-х роках і перервався майже на 60 років Першою, Другою та холодною світовими війнами. Він розглядається як єдине ціле, у складному взаємозв'язку не лише розквіту мистецтва «срібної доби» й всіх явищ економічного і культурного життя цього періоду (економіки, торгівлі, науки, філософії, мистецтва, релігійних і політичних течій). Бурхливий розвиток залізниць і великого водного транспорту об'єднали в культурному й економічному обміні країни п'яти континентів.

Закінчення XX і початок XXI століття можна пов'язати з *третьою хвилею глобалізації*. Вона стрімко наростала з початку 80-х років минулого століття аж до 2008 р. і принесла людству нові, небачені раніше можливості. Але водночас виникла і низка нових глобальних загроз, які з великою вірогідністю можуть суттєво уповільнити або навіть тимчасово перервати третю хвилю глобалізації. До цих загроз, передусім, належать: девальвація багатьох фундаментальних людських цінностей, наростання нерівності між людьми і країнами світу, поширення регіональних конфліктів, зростання корупції, тероризму, наростання глобальних хвороб, зменшення запасів органічних видів палива, порушення важливих біологічних балансів та накопичення парникових газів у природі тощо. Клубок цих проблем, і насамперед ціннісна криза людства, дали поштовх до початку обвалу у 2008 році глобальної фінансової системи, що потягне за собою економічну стагнацію і соціальний занепад багатьох країн світу.

Схоже, що зазначені негативні тенденції матимуть затяжний характер. Вони спричинять фундаментальні економічні перетворення, глобальний перерозподіл власності та подальшу переконафігурацію світу з виникненням нових центрів влади і, найголовніше, – стануть каталізатором до переосмислення системи людських цінностей, що мають домінувати на нашій планеті, принаймні в першій половині XXI віку.

Таким чином, глобалізація – це змінне, переривчасте явище. За таких тенденцій актуальним є питання про вивчення кількісних залежностей між явищем глобалізації та соціальними вимірами глобального економічного розвитку. Розглянемо проблему кількісного оцінювання позитивного і негатив-

вного впливу глобалізації на країни, які в неї занурюються. На першому етапі дослідження застосуємо дві найбільш відомі методики кількісного і якісного вимірювання глобалізації. *Першу* розробив Швейцарський Інститут дослідження бізнесу Konjunkturforschungsstelle der ETH Zurich (KOF) [6], *другу* – Міжнародна організація Carnegie Endowment for International Peace (CEIP) [7].

Індекс глобалізації за методикою KOF визначається трьома вимірами: економічним (I_{ge}); соціальним (I_{gs}); політичним (I_{gp}) – й обчислюється як сума своїх складових $I_g = 0,34 * I_{ge} + 0,37 * I_{gs} + 0,29 * I_{gp}$ з відповідними ваговими коефіцієнтами. За методикою CEIP цей індекс визначається чотирма вимірами: економічним (I_{ge}); персональним (I_{gp}); технологічним (I_{gt}) та політичним (I_{gp}) – й обчислюється як сума зазначених складових із рівними ваговими коефіцієнтами.

Порівнюючи зміст вимірів індексу глобалізації за обома методиками, легко побачити, що персональний та технологічний вимір за системою CEIP практично зводиться до соціального виміру за системою KOF. Тому далі, для зручності порівняння, у системі CEIP об'єднаємо соціальний і технологічний виміри в соціальний вимір.

Економічний вимір глобалізації (I_{ge}) відображає постійне зростання взаємозв'язку між потребами людей, з одного боку, та можливостями виробництва і розповсюдження товарів та послуг за допомогою міжнародної торгівлі, надходження іноземних інвестицій та розвитку процесів транснаціоналізації – з іншого. В обох методиках він визначається такими спільними індикаторами: рівень торгівлі у вигляді суми всіх видів експорту та імпорту; прями іноземні інвестиції як сума їх припливу та відтоку. У методиці KOF використовують додаткові індикатори: портфельні інвестиції у вигляді суми абсолютної вартості їх припливу та відтоку та доходи нерезидентів у формі заробітної плати чи прибутку від інвестицій. Економічний вимір глобалізації будь-якої країни є дуже залежним від її політичної стабільності, рівня розвитку законодавчої системи. Цей вимір є дуже чутливим до рівня довіри інвесторів.

Соціальний вимір глобалізації (I_{gs}) є фактором, який відображає міру інтегрованості пересічної людини, її родини, її життя та праці в міжнародні суспільні інститути. Формально цей вимір в обох методиках оцінюється такими індикаторами, як інтенсивність персональних контактів людини в банківській, телекомунікаційній та туристичній сферах з іншими країнами, рівень розвитку міжнародного туризму, рівень охоплення людини засобами масової інформації та телекомунікації. При цьому методика KOF додатково враховує два наступні індикатори: відсоток іноземних громадян у країні та рівень охоплення країни мережами міжнародної торгівлі.

Політичний вимір глобалізації (I_{gp}) відображає політичну вагу і вплив будь-якої країни на світові процеси і зміни та дає змогу оцінити масштаби розширення її участі в цих процесах і змінах. В обох методиках вказаний вимір кількісно оцінюється з використанням таких спільних індикаторів, як

членство країни в міжнародних організаціях та участь країни у місіях Ради Безпеки ООН. При цьому в методиці KOF додатково використовується індикатор «кількість іноземних посольств у країні», а в методиці CEIP – «кількість ратифікованих міжнародних угод».

З метою вивчення кількісних залежностей між явищем глобалізації та наведеними вище соціальними вимірами глобального економічного розвитку запропоновано методику кількісного аналізу рівня глобалізації країн світу (яку названо методикою МКАГ), сутність якої полягає у встановленні якісних взаємозв'язків між різними індикаторами соціального, економічного та політичного вимірів глобалізації та індикаторами глобального економічного розвитку, приведенні їх до єдиної обчислювальної платформи та системного обґрунтування цілісної моделі глобального економічного розвитку. З використанням відомих методик KOF, CEIP та запропонованої методики МКАГ [8] виконано порівняльний аналіз рівня глобалізації різних країн світу [9].

Як індикатори глобального економічного розвитку за методикою МКАГ визначено головні виміри глобального економічного розвитку: індекс державної нестабільності (Isf – State Fragility Index), індекс демократизації (Id – Democracy Index), індекс миролюбності країни (Igp – Global Peace Index), індекс нерівності отримання прибутків (Ig – Gini Index), валовий внутрішній продукт на душу населення (GDP per capita), індекс сталого розвитку (Isd – Index of sustainable development), індекс глобальної безпеки (Igs – Index of global security), індекс сприйняття корупції (Icp – Index of corruption perception), індекс потенційної схильності до скоєння терористичних актів у країні (Ita – Index of potential terrorist acts), індекс боротьби зі злочинністю (Icc – Crsme Control Index).

Очевидно, що індекс глобалізації KOF/CEIP та його економічна, соціальна і політична складові перебувають у певній залежності від наведених десяти індикаторів глобального економічного розвитку та їх соціального, економічного і політико-стабілізаційного вимірів. Для виявлення цієї залежності проведено якісний і кількісний аналіз індексів глобалізації KOF/CEIP від десяти індикаторів глобального економічного розвитку та від їх сукупності для двох фаз розвитку глобального суспільства: для докризового періоду (впритул до другої половини 2008 року), що висвітлено в даній роботі, та для кризового періоду (після серпня-вересня 2008 року), що буде висвітлено в наступній роботі.

Аналізуючи табл. 1, побудовану для докризового періоду, бачимо, що першими двадцятьма країнами за *соціальним виміром* є: Данія, Словенія, Швеція, Норвегія, Фінляндія, Сінгапур, Канада, Голландія, Австрія, Японія, Нова Зеландія, Ісландія, Великобританія, Швейцарія, Сполучені Штати Америки, Німеччина, Австралія, Франція, Люксембург, Ірландія та Естонія. Росія і Україна перебувають відповідно на 51 та 69 місцях (зі 123 місць).

Таблиця 1

**Нормовані значення головних вимірів
глобального економічного розвитку країн світу
для докризового періоду**

Країна	Індекс глобалізації KOF/ CEIP					Вимір політичної стабільності						Соціальний вимір				Еко- но- міч- ний вимір ВВП на душу населення
	Загальний індекс	Рейтинг	Економічний індекс	Соціальний індекс	Політичний індекс	Загальний індекс	Індекс державної нестійкості	Індекс демократизації	Глобальний індекс миролюбності	Потенційна можливість терористичних актів	Індекс глобальної безпеки	Загальний індекс	Індекс боротьби з злочинністю	Індекс чутливості до корупції	GINI-індекс	
1. Бельгія	0,921	1	0,919	0,908	0,942	0,779	1,000	0,711	0,814	0,761	0,610	0,703	0,604	0,687	0,819	32,119
2. Австрія	0,914	2	0,885	0,925	0,939	0,802	1,000	0,769	0,830	0,761	0,649	0,774	0,684	0,753	0,885	33,7
3. Швеція	0,900	3	0,895	0,874	0,947	0,884	1,000	0,895	0,822	0,978	0,724	0,813	0,600	0,885	0,953	32,525
4. Швейцарія	0,886	4	0,831	0,954	0,862	0,847	0,960	0,804	0,822	0,978	0,671	0,753	0,600	0,852	0,807	35,633
5. Данія	0,884	5	0,880	0,886	0,887	0,834	1,000	0,857	0,881	0,761	0,671	0,845	0,680	0,896	0,958	33,973
6. Нідерланди	0,884	6	0,880	0,894	0,874	0,810	1,000	0,872	0,761	0,761	0,658	0,776	0,620	0,852	0,854	32,684
7. Великобританія	0,867	7	0,792	0,879	0,955	0,690	0,921	0,704	0,677	0,543	0,606	0,755	0,711	0,786	0,769	33,238
8. Чеська Республіка	0,855	8	0,877	0,849	0,833	0,761	0,960	0,714	0,807	0,761	0,561	0,676	0,647	0,434	0,947	20,538
9. Франція	0,854	9	0,774	0,842	0,986	0,755	0,960	0,703	0,718	0,761	0,632	0,724	0,683	0,665	0,824	30,386
10. Фінляндія	0,847	10	0,889	0,837	0,801	0,830	1,000	0,857	0,837	0,761	0,696	0,805	0,596	0,896	0,922	32,153
11. Німеччина	0,830	11	0,742	0,833	0,952	0,798	1,000	0,783	0,819	0,761	0,628	0,747	0,622	0,720	0,898	29,461
12. Іспанія	0,824	12	0,822	0,775	0,915	0,736	0,960	0,732	0,728	0,652	0,605	0,672	0,628	0,599	0,790	27,169
13. Угорщина	0,825	13	0,888	0,770	0,819	0,798	1,000	0,646	0,775	0,978	0,590	0,653	0,592	0,445	0,922	17,886
14. Португалія	0,816	14	0,838	0,763	0,865	0,786	1,000	0,712	0,846	0,761	0,610	0,668	0,699	0,577	0,727	20,41
15. Канада	0,812	15	0,808	0,869	0,732	0,827	1,000	0,809	0,829	0,761	0,736	0,780	0,694	0,819	0,826	33,375
16. Ірландія	0,798	16	0,855	0,777	0,749	0,854	1,000	0,803	0,847	0,978	0,643	0,693	0,595	0,687	0,797	38,505
17. Норвегія	0,794	17	0,758	0,845	0,782	0,871	0,921	0,860	0,876	0,978	0,720	0,811	0,675	0,819	0,940	41,42
18. Італія	0,794	18	0,761	0,719	0,956	0,753	1,000	0,667	0,741	0,761	0,596	0,576	0,527	0,434	0,769	28,529
19. Польща	0,784	19	0,735	0,747	0,911	0,777	1,000	0,621	0,727	0,978	0,561	0,595	0,667	0,324	0,794	13,847
20. Сінгапур	0,784	20	0,959	0,923	0,321	0,721	0,921	0,471	0,733	0,761	-	0,783	0,805	0,885	0,659	29,663
21. Австралія	0,774	21	0,677	0,815	0,848	0,766	0,921	0,811	0,742	0,652	0,705	0,737	0,619	0,808	0,782	31,794
22. США	0,768	22	0,632	0,765	0,967	0,622	0,921	0,719	0,492	0,435	0,546	0,748	0,901	0,654	0,688	41,89
23. Словаччина	0,758	23	0,793	0,796	0,651	0,783	0,960	0,632	0,775	0,978	0,572	0,631	0,552	0,401	0,940	15,871
24. Малайзія	0,756	24	0,772	0,661	0,879	0,659	0,842	0,481	0,712	0,761	0,499	0,504	0,543	0,423	0,547	10,882
25. Греція	0,734	25	0,736	0,665	0,839	0,739	1,000	0,709	0,648	0,761	0,576	0,589	0,603	0,368	0,797	23,381

Країна	Індекс глобалізації KOF/ CEIP					Вимір політичної стабільності						Соціальний вимір				Еко- но- міч- ний вимір ВВП на душу населення
	Загальний індекс	Рейтинг	Економічний індекс	Соціальний індекс	Політичний індекс	Загальний індекс	Індекс державної нестійкості	Індекс демократизації	Глобальний індекс миролюбності	Потенційна можливість терористичних актів	Індекс глобальної безпеки	Загальний індекс	Індекс боротьби з злочинністю	Індекс чутливості до корупції	GINI-індекс	
26. Нова Зеландія	0,734	26	0,797	0,724	0,659	0,818	0,960	0,803	0,873	0,761	0,692	0,770	0,647	0,896	0,765	24,996
27. Люксембург	0,729	27	0,951	0,781	0,330	0,811	1,000	0,812	0,831	0,761	0,648	0,712	0,638	0,786	N/A	60,228
28. Естонія	0,722	28	0,908	0,744	0,421	0,772	0,960	0,668	0,720	0,978	0,533	0,688	0,714	0,577	0,772	15,478
29. Ізраїль	0,718	29	0,862	0,772	0,431	0,445	0,644	0,619	0,133	0,326	0,503	0,608	0,575	0,533	0,715	25,864
30. Словенія	0,703	30	0,801	0,714	0,545	0,818	1,000	0,691	0,812	0,978	0,610	0,815	0,674	0,874	0,896	22,273
31. Хорватія	0,702	31	0,772	0,637	0,699	0,713	0,802	0,632	0,623	0,978	0,532	0,599	0,599	0,313	0,886	13,042
32. Туреччина	0,700	32	0,699	0,582	0,879	0,543	0,644	0,451	0,415	0,761	0,443	0,462	0,431	0,313	0,641	8,407
33. Росія	0,698	33	0,579	0,644	0,960	0,509	0,723	0,379	0,252	0,761	0,428		0,512	0,115	0,703	10,845
34. Чилі	0,696	34	0,851	0,518	0,744	0,786	0,921	0,684	0,775	0,978	0,573	0,585	0,672	0,632	0,451	12,027
35. ОАЕ	0,691	35	N/A	0,755	0,382	0,612	0,881	0,103	0,701	0,761	-	0,591	0,694	0,489	N/A	25,514
36. Ісландія	0,670	36	0,813	0,832	0,219	0,951	1,000	0,877	0,949	0,978	-	0,768	0,662	0,874	N/A	36,51
37. Мальта	0,670	37	0,919	0,760	0,183	0,868	1,000	0,737	N/A	N/A	-	#####	N/A	N/A	N/A	19,089
38. Йорданія	0,659	38	0,673	0,558	0,794	0,582	1,000	0,262	0,604	0,543	0,501	0,570	0,609	0,379	0,722	5,53
39. Кіпр	0,659	39	0,864	0,693	0,314	0,792	0,881	0,653	0,657	0,978	-	0,521	0,596	0,445	N/A	22,699
40. Кувейт	0,655	40	0,676	0,769	0,451	0,561	0,842	0,174	0,683	0,543	-	0,519	0,704	0,335	N/A	26,321
41. Румунія	0,653	41	0,697	0,484	0,848	0,736	0,842	0,653	0,760	0,978	0,447	0,586	0,637	0,269	0,853	9,06
42. Україна	0,646	42	0,624	0,577	0,782	0,676	0,802	0,583	0,549	0,978	0,466	0,512	0,477	0,159	0,901	6,848
43. Китай	0,646	43	0,615	0,491	0,924	0,545	0,605	0,161	0,599	0,978	0,382	0,483	0,616	0,247	0,585	6,757
44. Болгарія	0,644	44	0,698	0,549	0,709	0,749	1,000	0,600	0,633	0,978	0,536	0,553	0,464	0,313	0,883	9,032
45. Литва	0,639	45	0,790	0,614	0,461	0,728	0,960	0,635	0,711	0,761	0,571	0,555	0,507	0,390	0,769	14,494
46. Південна Корея	0,636	46	0,594	0,526	0,863	0,769	1,000	0,683	0,725	0,978	0,461	0,624	0,606	0,423	0,843	22,029
47. Латвія	0,632	47	0,814	0,699	0,271	0,736	1,000	0,629	0,711	0,761	0,579	0,554	0,531	0,390	0,740	13,646
48. ПАР	0,630	48	0,694	0,440	0,828	0,584	0,565	0,686	0,411	0,978	0,277	0,321	0,138	0,423	0,402	11,11
49. Аргентина	0,622	49	0,550	0,525	0,874	0,723	0,921	0,550	0,636	0,978	0,528	0,357	0,378	0,181	0,511	14,28
50. Уругвай	0,622	50	0,685	0,503	0,710	0,800	0,960	0,691	0,762	0,978	0,609	0,595	0,567	0,599	0,619	9,962

За виміром *політичної стабільності* до першої двадцятки ввійшли такі країни: Ісландія, Швеція, Норвегія, Мальта, Ірландія, Швейцарія, Японія, Данія, Фінляндія, Канада, Словенія, Нова Зеландія, Люксембург, Голландія, Австрія, Уругвай, Коста-Ріка, Німеччина, Угорщина та Кіпр. Україна, США і Росія відповідно займають 48, 56 та 87 місця.

Першими двадцятьма країнами за *економічним показником* (ВВП на душу населення за паритетом купівельної спроможності) є: Люксембург, США, Норвегія, Ірландія, Ісландія, Швейцарія, Данія, Австрія, Канада, Великобританія, Голландія, Швеція, Фінляндія, Австралія, Японія, Франція, Сінгапур, Німеччина, Італія та Іспанія. Росія і Україна перебувають відповідно на 51 та 69 місцях.

14 країн входять одночасно до 20 кращих країн світу за *трьома вказаними вимірами*. До них належать: Данія, Швеція, Норвегія, Фінляндія, Канада, Голландія, Австрія, Японія, Ісландія, Швейцарія, США, Німеччина, Люксембург, Ірландія. Десять з них входять до 20 найбільш глобалізованих країн світу за індексом KOF/ CEIP. Винятками з цього списку стали Японія, Ісландія, США і Люксембург.

Названі кращі 10 країн характеризуються дуже високими показниками глобального індексу миролюбності, індексу демократизації, індексу глобальної безпеки, індексу боротьби зі злочинністю і водночас низькими значеннями корупції та нерівності населення. До цієї групи входять переважно країни – не члени Великої вісімки, за винятком Німеччини і Канади. Вони не мають домінуючих економік і не намагаються нав'язувати свою волю іншим країнам на геополітичній карті світу.

Цікаво, що, відповідно до індексу глобалізації KOF/CEIP, США (22 місце) і Японія (51 місце) мають дуже високі значення політичної складової глобалізації, водночас за економічною і соціальною складовими вони поступаються країнам першої двадцятки. Люксембург (27 місце), маючи дуже високу економічну складову глобалізації, характеризується посереднім значенням соціальної складової і дуже низьким значенням політичної. При цьому 22 місце за рейтингом KOF/ CEIP для США є повністю обґрунтованим. Ця країна має дуже низькі значення глобального індексу миролюбності (0,492) та індексу глобальної безпеки (0,546), високу потенційну можливість до терористичних актів (0,435) і високу нерівність населення країни (0,688). Водночас, 51 місце за рейтингом KOF/CEIP для Японії і 27 для Люксембургу не відповідають їх дуже високим показникам практично за всіма індикаторами методики МКАГ.

Окремо аналізуючи Україну, вкажемо на її особливості в контексті глобалізаційних процесів. Країна має потужний людський капітал – 46-мільйонне високоосвічене населення (за даними ООН, індекс освіченості в Україні дорівнює 0,94). Її географічне положення і ресурсний потенціал дають великі можливості в економічній і культурній кооперації як з Росією, так і з країнами Центральної та Західної Європи. Вона розташована на берегах Чорного й Азовського морів, має високородючу землю для сільськогосподарських застосувань, потужну газотранспортну мережу. У транзитному відношенні вона являє собою сучасний «Великий шовковий шлях» для енергетичного, культурного і товарного обміну між Сходом і Заходом. Стратегічно важливо для України підтримувати стабільність цього коридору. Його дестабілі-

зація на початку 2009 року, у зв'язку з призупиненням транзиту газу, призвела майже до 40 %-го падіння української економіки, багатомільярдних втрат для економік Росії та країн Західної Європи.

За методикою KOF/CEIP, у докризовий період Україна займала 42 позицію в рейтингу глобалізації. Аналізуючи стан України за методикою МКАГ, бачимо, що вона має дуже високий рівень корупції, низький рівень боротьби зі злочинністю, наростаючу нерівність між найбіднішими і найбагатшими прошарками населення, високу державну нестабільність, що ускладнює її подальшу інтеграцію в глобальний економічний і культурний простір.

Подальший аналіз за методикою МКАГ передбачає кластеризацію (на основі використання методу К-середніх) та обчислення математичного очікування значень кожного з індикаторів, наведених у табл. 1. Значення середньої похибки оцінювання відсутніх даних, згідно із запропонованою методикою, зведено в таблицю 2.

Таблиця 2

Значення середньої похибки оцінювання відсутніх даних

Кластер	SF	DI	GP	PTA	GS	CC	CP	GINI	GDP
1	0,002	0,013	0,007	0,021	0,004	0,007	0,034	0,011	0,020
2	0,019	0,041	0,033	0,030	0,007	0,015	0,048	0,018	0,038
3	0,040	0,026	0,016	0,065	0,005	0,037	0,007	0,020	0,006
4	0,081	0,030	0,013	0,019	0,003	0,012	0,007	0,011	0,005
5	0,014	0,017	0,015	0,015	0,002	0,036	0,003	0,013	0,001
Максимум	0,081	0,041	0,033	0,065	0,007	0,037	0,048	0,020	0,038

Узагальнена середня похибка на один індикатор становить 0,039, порівняно з 0,073 для обчислень згідно з методикою [6].

Застосування кореляційного аналізу для встановлення факту наявності статистично значущого зв'язку між складовими загального індексу глобалізації (індикаторами соціального, економічного та політичного вимірів глобалізації) та індикаторами глобального економічного розвитку є важливою задачею, від результату розв'язування якої залежить можливість застосування тих чи інших методів моделювання. Оскільки припускається, що всі показники виражені в інтервальних шкалах, то ступінь лінійного зв'язку між окремими показниками можна оцінити за допомогою коефіцієнта кореляції Пірсона. Для цього обчислимо коефіцієнти парної кореляції між індексами та вихідними індикаторами (табл. 3).

Таблиця 3

Матриця коефіцієнтів парної кореляції для економічного, соціального і політичного індексів та вихідних індикаторів

	SF	DI	GP	PTA	GS	CC	CP	GINI	GDP
le	0,72	0,66	0,62	0,26	0,76	0,51	0,76	0,38	0,73
ls	0,75	0,71	0,67	0,25	0,85	0,61	0,84	0,50	0,86
lp	0,18	0,35	0,26	-0,01	0,37	0,30	0,33	0,42	0,27

Як видно, економічний та соціальний індекси глобалізації мають сильний або середній зв'язок майже з усіма вихідними індикаторами (окрім потенційної схильності до скоєння терористичних актів та індексу нерівності для економічного індексу). З'ясуємо також залежність між самими вихідними індикаторами (табл. 4).

Таблиця 4

Матриця коефіцієнтів парної кореляції для вихідних індикаторів

	SF	DI	GP	PTA	GS	CC	CP	GINI	GDP
SF	1,00	0,65	0,68	0,34	0,74	0,50	0,65	0,44	0,66
DI	0,65	1,00	0,62	0,27	0,73	0,34	0,72	0,40	0,67
GP	0,68	0,62	1,00	0,57	0,71	0,68	0,75	0,48	0,65
PTA	0,34	0,27	0,57	1,00	0,20	0,18	0,25	0,04	0,17
GS	0,74	0,73	0,71	0,20	1,00	0,64	0,86	0,54	0,82
CC	0,50	0,34	0,68	0,18	0,64	1,00	0,67	0,55	0,64
CP	0,65	0,72	0,75	0,25	0,86	0,67	1,00	0,49	0,88
GINI	0,44	0,40	0,48	0,04	0,54	0,55	0,49	1,00	0,50
GDP	0,66	0,67	0,65	0,17	0,82	0,64	0,88	0,50	1,00

Як свідчать результати (табл. 4), спостерігається середній та сильний зв'язок не лише в межах груп індикаторів відповідно до розрахунку економічного, соціального та політичного індексів глобалізації, а й також між групами індикаторів.

Таким чином, встановлено, що показники, з тих чи інших причин, є кореляційно залежними. Для того щоб позбутися такої залежності, застосуємо

факторний аналіз та перейдемо до системи синтетичних незалежних показників (характерних факторів). Метою застосування факторного аналізу є пошук та інтерпретація характерних факторів з одночасною мінімізацією як їх кількості, так і ступеня їх залежності від своїх залишкових випадкових компонентів.

Матриця факторних навантажень (табл. 5) задає відображення базису вихідного простору у простір головних компонент, в якому можна оцінити значущість та взаємозалежність між вихідними індикаторами.

Таблиця 5

Матриця факторних навантажень

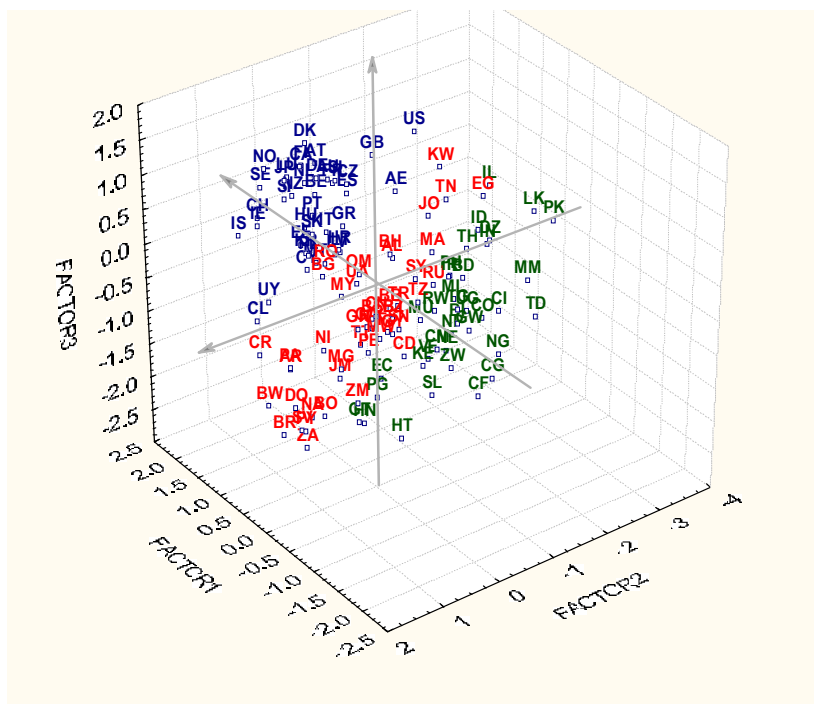
Показник	Фактор 1	Фактор 2	Фактор 3
SF	0,725	0,306	0,285
DI	0,896	0,171	0,051
GP	0,538	0,586	0,502
PTA	0,100	0,968	0,017
GS	0,821	0,110	0,439
CC	0,302	0,180	0,844
CP	0,799	0,158	0,448
GINI	0,287	-0,062	0,781
GDP	0,791	0,049	0,451

З таблиці 5 випливає, що найбільші навантаження на перший фактор мають індекс державної нестабільності, індекс демократизації, індекс глобальної безпеки, індекс чутливості до корупції та ВВП на душу населення. На другий фактор – індекс потенційної можливості терористичних актів. На третій фактор – індекс боротьби із злочинністю та GINI-індекс. Слід зазначити, що глобальний індекс миролюбності має практично рівні навантаження на всі три фактори.

Таким чином, можна виділити три групи вихідних індикаторів, які визначають різницю між країнами в контексті глобалізації. До першої групи належать індекс державної нестабільності, індекс демократизації, індекс глобальної безпеки, індекс чутливості до корупції та ВВП на душу населення. До другої групи входить лише індекс потенційної можливості терористичних актів. Третя група показників об'єднує індекс боротьби зі злочинністю та GINI-індекс. Особливе місце посідає глобальний індекс миролюбності.

Далі, за методикою МКАГ, необхідно провести кластеризацію країн у факторному просторі. Для вирішення цієї задачі скористаємося швидким методом кластерного аналізу, який має назву «метод К-середніх». Ідея методу полягає в тому, що задане фіксоване число k кластерів ставиться у відповідність країнам таким чином, щоб максимізувати міжкластерні відстані (рис. 1).

Рисунок 1

Візуалізація результатів кластеризації у факторному просторі

Як видно з рис. 1, до першого кластеру увійшли такі країни: Бельгія, Австрія, Швеція, Швейцарія, Данія, Нідерланди, Великобританія, Чеська Республіка, Франція, Фінляндія, Німеччина, Іспанія, Угорщина, Португалія, Канада, Ірландія, Норвегія, Італія, Польща, Сінгапур, Австралія, Сполучені штати, Словаччина, Греція, Нова Зеландія, Люксембург, Естонія, Словенія,

Хорватія, Чилі, Об'єднані Арабські Емірати, Ісландія, Мальта, Кіпр, Литва, Південна Корея, Латвія, Уругвай, Японія.

Для цих країн характерним є те, що значення для першого кластера перебувають у діапазоні від вище середніх до найвищих. Переважно ці країни мають значення другого фактора в межах стандартного відхилення. Однак слід звернути увагу на Сполучені Штати Америки та Великобританія, для яких індекс захищеності від терористичних актів має низькі значення. За третім фактором ці країни займають положення в діапазоні, вищому від середнього.

Другий кластер (червоний колір) становлять Малайзія, Туреччина, Росія, Йорданія, Кувейт, Румунія, Україна, Китай, Болгарія, Південна Африка, Аргентина, Бразилія, Ель Сальвадор, Бахрейн, Перу, Ямайка, Панама, Мексика, Марокко, Коста-Рика, Єгипет, Оман, Туніс, Намібія, Гана, Парагвай, Гайана Домініканська Республіка, Болівія, Габон, Тринідад і Тобаго, Замбія, Фіджі, Багами, Нікарагуа, Беліз, Барбадос, Сенегал, Малаві, Ботсвана, Албанія, Танзанія, Бенін, Сирія, Конголезька Республіка, Мадагаскар. Визначним для цих країн є те, що значення другого фактору є вищим за середнє. За першим фактором країни другого кластера займають положення в діапазоні від дуже низьких до середніх значень. За третім фактором спостерігається весь можливий діапазон значень.

На відміну від другого кластера, країни третього кластера (зелений колір): Ізраїль, Філіппіни, Таїланд, Нігерія, Еквадор, Індонезія, Гондурас, Венесуела, Колумбія, Маврикій, Пакистан, Гватемала, Індія, Шрі-Ланка, Зімбабве, Кот д'Івуар, Алжир, Кенія, Того, Уганда, Малі, Чад, Камерун, Бангладеш, Папуа Нова Гвінея, Непал, Сьєрра-Леоне, Іран, Конго, Гвінея Бісау, Нігер, Гаїті, Центральна Африканська Республіка, Руанда, М'янма, Бурунді – мають низький захист від загрози тероризму. За характеристикою першого і третього факторів ці країни схожі на ті, що входять до другого кластеру.

Дослідження показали:

- Найменш вразливою країною світу до економічної кризи, з точки зору втрати глобалізаційних властивостей, виявилася Канада. Вона, зазнавши зниження ВВП на 6,14 % навіть на сім пунктів піднялася в рейтингу найбільш глобалізованих країн світу за індексом КОФ, зберігши на рівні попередніх років свій експортно-імпортерний баланс, об'єми внутрішнього і зовнішнього ринків, рівень іноземної власності, внутрішній валовий продукт. Падіння в рейтингу КОФ від п'яти до семи пунктів на початковому етапі економічної кризи зазнали Австралія (-5), Мексика (-5), Україна (-5), Південно-Африканська республіка (-6), Франція (-7). При цьому Австралія, втративши ВВП на 10,3 %, суттєво покращила свій експортно-імпортерний баланс, тоді як інші країни цієї групи зберегли його на попередньому рівні, за винятком України, для якої він помітно погі-

ршився. Для України також спостерігається суттєве (на 19,3 %) обмеження капіталопотоку. З іншого боку, найбільшого впливу мізків (Draine Raine) зазнали Канада (-3,9 %), Австралія (-12,1 %), переважно в США, в той час, як Україна мала приріст інтелектуального потенціалу на 6,6 %. Втрати ВВП для Франції становлять 8,27%. Інші показники для країн цієї групи залишилися без особливих змін на початковому етапі економічної кризи.

- До групи країн з потужними економіками, які зазнали падіння індексу глобалізації з 10 до 20 пунктів, належать: Італія (-10), Німеччина (-11), Південна Корея (-13), Аргентина (-14), США (-16), Японія (-19), Великобританія (-20). Серед них США і Великобританія зберігають доволі високий позитивний баланс експорту-імпорту, тоді як Японія і Південна Корея його суттєво погіршили. Доволі велике падіння ВВП (-16,1 %) і суттєве обмеження капіталопотоку (-16,2 %) продемонструвала Південна Корея. Значне падіння ВВП відбулося в Німеччині (-12,9 %) й Аргентині (-8,96 %). Усі країни цієї групи зберегли на рівні попередніх років свої внутрішні та зовнішні ринки і рівні іноземної власності. Великобританія зазнала майже 5%-го впливу мізків, переважно в США.
- Суттєві зміни на початку економічної кризи відбулися в країнах БРІК групи, Туреччині та Індонезії. Ці країни не мали суттєвого падіння ВВП (за винятком Туреччини і Росії), але вони зазнали падіння індексу глобалізації КОФ з 25 до 48 пунктів (Туреччина (-19), Бразилія (-27), Росія (-28), Індонезія (-34), Індія (-41), Китай (-48)). Вони переважно зберегли свої внутрішні та зовнішні ринки, але, за винятком Туреччини і Росії, суттєво погіршили свій експортно-імпортний баланс. При цьому Туреччина та Індонезія значно збільшили присутність іноземного капіталу у своїх країнах. Рекордно високий відтік мізків продемонструвала Індія (-13,5 %), тоді як Росія за цей час змогла покращити умови для збереження інтелектуального капіталу на 12,5 %.
- У результаті застосування методу багатовимірного статистичного аналізу виконано дослідження взаємних залежностей соціо-економічних індикаторів та індексу глобалізації і його складових для країн Великої двадцятки. Було встановлено загальну тенденцію падіння рейтингу індексу глобалізації (у середньому на 17 пунктів), яке зумовлене передусім обмеженням соціального виміру глобалізації. Також встановлено, що ступінь статистичного зв'язку між змінами соціальної та економічної складових близький до середнього рівня (коефіцієнт кореляції – 0,36), а зміна політичної складової є незалежною від змін соціальної та економічної складових (відповідні коефіцієнти кореляції – 0,06 та 0,11). Відносно вихідних соціо-економічних індикаторів помітна статистична значна залеж-

ність між змінами імпорту та експорту, а зміни обсягів зовнішнього ринку та експорту мають статистичний зв'язок середнього рівня.

- Застосування методу факторного аналізу дозволило встановити три незалежних фактора, за якими різняться країни Великої двадцятки з точки зору змін вихідних показників, що впливають на зміну індексу глобалізації. До першого фактору належать зміни імпорту, експорту та об'єму зовнішнього ринку, другий фактор складають зміни впливу мізків та ВВП, третім фактором є зміна обсягів іноземної власності. У факторному просторі за ознаками близькості змін вихідних показників виділено чотири кластери країн. Відносно країн першого кластера, Китаю та Мексики, можна сказати, що, незважаючи на доволі значну різницю у зміні ВВП та показника впливу мізків, спостерігається найбільше скорочення зовнішніх ринків та обсягів імпорту й експорту, але за змінами рівня іноземної власності ці країни мають середні та вищі від середніх показники. Для другого кластера, який становлять найбільш розвинені країни (Великобританія, США, Канада, Німеччина, Франція, Японія, Індія та Індонезія), характерним є зміна всіх показників у межах стандартного відхилення, що свідчить про сталу тенденцію глобалізації для цих країн. Для третього кластера (Аргентина, Австралія, Бразилія, Італія, Росія, ПАР), незважаючи на значні відмінності в рівнях зміни ВВП, спостерігається тенденція, пов'язана зі зростанням рівня іноземної власності, обсягів зовнішніх ринків та імпорту-експорту (перенесення в ці країни великих виробництв у зв'язку з дешевою робочою силою і сприятливими умовами для бізнесу). Для України, як і для Туреччини та Кореї, що входять до четвертого кластера, є характерним збільшення обсягів зовнішніх ринків та імпорту-експорту на фоні суттєвого зниження ВВП та об'ємів іноземної власності (необґрунтована приватизація національних активів, штучне створення зовнішніх ринків в офшорних зонах тощо).
- У своєму кластері Україна за першим і третім фактором має найбільші значення, а за другим фактором – найнижчі. У результаті аналізу впливу вихідних показників на складові індексу глобалізації встановлено, що на зростання економічної складової індексу КОФ України впливають зростання обсягів експорту, зменшення обсягу внутрішнього ринку та зростання показника витікання мізків. На зростання соціальної складової – зростання обмеження капіталопотоку та зменшення обсягів іноземної власності, що впливає на інтенсивність тимчасової міграції населення. Зростання політичної складової пов'язане зі зростанням обсягів зовнішнього ринку та власного ВВП країни.

Література

1. Мовсесян А. Г., Огнивцев С.Б. Мировая экономика. – М.: Финансы и статистика, 2001. – 656 с.
2. Гумилев Л. Н. Этносфера: история людей и история природы. – СПб.: ООО «Издательский дом «Кристалл», 2002. – 576 с.
3. Дергачев В. А. Геоэкономика (Современная геополитика). – К.: ВИРА-Р, 2002. – 512 с.
4. Перская В. В. Глобализация мировой экономики // Глобализация: многостороннее измерение / Под общ. ред. В. А. Михайлова, В. С. Буянова. – М.: Книга и бизнес, 2004. – 320 с. (С. 52–79).
5. Барабанов О. Н., Лебедева М. М. Глобализация и образование в современном мире // Глобализация: человеческое измерение / Ред. коллегия: А. В. Торкунов (отв. ред.), А. Ю. Мельвиль, М. М. Наринский. – М.: МГИМО, РОССПЭП, 2003. – 112 с. (С. 54–77).
6. KOF Index of Globalization / KOF Индекс глобалізації. – Электрон. дан. – KOF, 2008. Режим доступа: <http://globalization.kof.ethz.ch>, вільний. – Загол. з екрану. – Мова англ.
7. Carnegie Endowment for International Peace (CEIP) / Фонд Карнегі за міжнародний мир. – Электрон. дан. – Carnegie Endowment for International Peace, 2009. Режим доступа: <http://www.carnegieendowment.org/>, вільний. – Загол. з екрану. – Мова англ.
8. Zgurovsky O. Research of globalization's interrupted character in context of social development and global security. Part 1 // System Research and Information Technologies. – 2009. – №2. – P. 121–132.
9. Згуровський О. М. Дослідження переривистого характеру глобалізації в контексті суспільного розвитку та безпеки країн світу. Частина 2 // Системні дослідження та інформаційні технології // 2010. – №3. – С. 89–107.

Стаття надійшла до редакції 19 травня 2011 р.