

МОДЕЛЮВАННЯ ПОЛІТИЧНИХ РИЗИКІВ

Вінницький національний технічний університет

Анотація

Проаналізовано методи і математичні моделі політичних ризиків. Акцентовано увагу, що вагомими є експертні оцінки фахівців, які містять суб'єктивізм.

Ключові слова: моделювання, математичне моделювання, політичний ризик.

Abstract

Methods and mathematical models of political risks are analyzed. It is emphasized that expert opinions of subjectivists are important.

Keywords: modeling, mathematical modeling, political risk.

Вступ

Політичні ризики, за своєю суттю, є складними феноменами, які мають як раціональну, так й ірраціональну складові. Актуальним є звернення у нашому дослідженні до методик математичного моделювання, що рідко використовуються у вивченні політичних процесів, зокрема, ризиків. Саме раціональне у політичних ризиках можна досить чітко змоделювати і спрогнозувати, тому проаналізуємо моделі та методи їх оцінки.

Результати дослідження

Загалом сучасні методи політичного аналізу і прогнозування роблять спробу кількісно і якісно охарактеризувати ймовірність отримання запланованого політичного результату, а також описати варіанти відхилення від плану в певний бік. Почнемо з тлумачення поняття «політичний ризик». Це можуть бути дії національного уряду, які заважають веденню бізнесу; непередбачувані обставини, які виникають у політичному середовищі й набувають форми різноманітних обмежень; події, здатні творити несприятливі умови як для певних соціальних груп, так і для держави загалом; вірогідність виникнення небажаних політичних наслідків тощо [1].

Щоб провести ефективний аналіз існуючих моделей оцінки політичних ризиків, їх слід класифікувати за типовими параметрами. Найзручніший варіант у цьому випадку – це їх поділ на якісні та кількісні моделі оцінки. Очевидно, що такий поділ є досить умовним, але дає зрозуміти, що деякі моделі спочатку розраховані тільки на кількісний вимір певних змінних, а інші націлені на опис політичної ситуації з якісного боку. Альтернативою дихотомічного поділу моделей виступає джерело одержуваної інформації і його суб'єктивність (використовуються фактичні первинні дані або експертні оцінки). Ті методи, в основі яких лежать оцінки експертів, анкетування, опитувальні листи тощо, можуть бути класифіковані за ступенем їх структурованості та систематизації [2].

Неструктуровані моделі, в свою чергу, мають більш суб'єктивний характер, так як побудова системи взаємозв'язків відбувається інтуїтивно, процедури оцінки часто неможливо відтворити. Крім того, якщо навіть систематизувати різні моделі за рівнем формалізації їх прогностичних методів, то повністю відійти від суб'єктивізму не можливо. Відомим методом вивчення якісних оцінок виступає метод Дельфі, при якому аналітики складають систему показників для кожної окремої ситуації, а далі вже група експертів-професіоналів, виходячи зі своїх знань, визначає вагу кожної змінної для певної компанії, країни. В якості альтернативного методу можна використати агреговані статистичні дані, з їх допомогою можна будувати елементарні прогнози щодо позитивних або несприятливих ситуацій в країні. Дотримуючись цієї концепції, в 70-і роки ХХ ст. було створено й апробовано кілька моделей, які будують прогнози на причинно-наслідкових зв'язках, у розрахунку використовувалися економетричні та параметричні інструменти обробки великого масиву кількісної інформації [3].

Якщо подивитися на світові фондові ринки, то побічно можна оцінити рівень політичних ризиків тієї чи іншої країни через прибутковість боргових зобов'язань. Чим дорожче забезпечення по державному боргу, тим вище ризики тому, що рівень прибутковості включає в себе і плату за ризики, в тому числі, політичні. У спрощеному варіанті можна співставити ринкову вартість зобов'язань (наприклад, державних облігацій) і аналогічних безризикових зобов'язань.

Розглянемо модель Європейського Банку Реконструкції та Розвитку (ЄБРР). Запропоновані

концепції ЄБРР у сфері дослідження політичних ризиків мають для нас певний інтерес, так як в них спочатку закладався аналіз специфічних процесів перехідного періоду в країнах Східної Європи і СНД. ЄБРР щорічно публікує свій аналітичний огляд, в першу чергу, присвячений процесам політичної та економічної трансформації (Transition Report), а також питанням, що відбуваються стосовно правових реформ (Survey of Legal Reforms). У звіті виділяються «індикатори модернізації», які відображають динаміку переходу від планової / державної економіки до ринкової. Розробники доповіді використовують експертні опитування в огляді правових реформ в країнах з перехідною економікою, а макроекономічні показники служать статистичним матеріалом для звіту про перехідні економіки [4].

Розглянемо ще одну модель PSSI – Political System Stability Index. Її можна віднести до розряду багатокомпонентних і є досить складною у побудові і розрахунку індексу політичного ризику, в порівнянні з вищеописаним способом оцінки стану соціально-політичної ситуації в країні у цифрах. Модель з'явилася в середині 70-х рр. ХХ ст. [5]. Розробники цієї моделі на перше місце ставлять принцип незалежності суджень від уможливлених висновків експертів і суб'єктивних спотворень при інтерпретації даних, так як вимірюють набір дискретних показників політичної і соціальної компоненти економічної діяльності країни. Для цього у модель вводяться додаткові індексні оцінки, що розраховуються по кожному компоненту. Сам алгоритм розрахунку є комерційною таємницею компанії. Але, в цілому, модель PSSI включає три групи індексів, які визначаються за допомогою декількох змінних величин.

Соціально-економічний індекс включає в себе такі показники, як ВВП в розрахунку на душу населення, рівень споживання енергетичних ресурсів на одну людину, етнолінгвістична фрагментація. Індекс соціальної конфліктності складається з трьох частин: громадська нестабільність (заколоти, демонстрації, урядові кризи), внутрішні загрози (ризик державного перевороту, нелегітимної зміни влади, збройних нападів на об'єкти іноземних компаній, політичних вбивств), примусовий потенціал держави (чисельність співробітників спецслужб на 1000 громадян).

Далі розраховується індекс політичного процесу, який включає в себе ефективність законодавчої, виконавчої та судової систем, рівень політичної конкуренції, частота внесення змін до Конституції країни протягом року, безсистемна зміна еліти політичного керівництва. Необхідно підкреслити, що показники, що розраховуються в цій моделі, більш реалістично відображають політико-соціальну і політико-економічну ситуацію в країні, ніж більшість розглянутих моделей. Так, наприклад, додавання в модель такої величини, як примусовий потенціал уряду країни, має практичний інтерес.

Висновки

У наведеному вище огляді підходів і моделей до аналізу й оцінки політичних ризиків акцентується увага на експертній складовій моделей. Така ситуація склалася на основі об'єктивних причин, так як дати кількісну і точну оцінку політичних ризиків і їх прогнозів на майбутнє досить важко. З одного боку, це є одним з недоліків вищенаведених моделей, але повністю відійти від суб'єктивних оцінок експертів і аналітиків також не представляється можливим. Тому при моделюванні політичних ризиків потрібно поєднувати математичні методи і моделі для отримання максимально об'єктивних результатів.

СПИСОК ВИКОРИСТАНОЇ ЛІТЕРАТУРИ

1. Корнієнко В.О. Моделювання процесів в політико-комунікативному просторі: монографія / Корнієнко В.О., Денисюк С. Г., Шиян А.А. – Вінниця : ВНТУ, 2010. – 260 с.
2. Banks E. Alternative Risk Transfer: Integrated Risk Management through Insurance, Reinsurance and the Capital Markets. Wiley Finance Series, 2004.
3. Brink, Charlotte H. Measuring political risk: risks to foreign investment. Published by Ashgate Publishing Ltd., 2012. 200p.
4. Haendel D., West G., Meadow R. Overseas Investment and Political Risk. Philadelphia, 1975.
5. Денисюк С. Г. Математичне моделювання та побудова проведення майбутніх президентських виборів в Україні. / С.Г.Денисюк С. Г. // Нова парадигма: журнал наукових праць [голов. ред. В.П.Бех]. Київ: Вид-во НПУ імені М. П. Драгоманова, 2008. – Вип. 78. – С. 107–115.

Дерун Віталіна Гарольдівна – викладач кафедри іноземних мов, Вінницький національний технічний університет, derun@vntu.edu

Derun Vitalina H. – teacher of the Department of Foreign Languages, Vinnytsia National Technical University, Vinnytsia, e-mail: derun@vntu.edu