



Экономическая теория

Виктория ДЕРГАЧОВА,  
Александр ЗГУРОВСКИЙ

**ПРОЦЕССЫ  
ЭКОНОМИЧЕСКОЙ ГЛОБАЛИЗАЦИИ  
В МЕЖДУНАРОДНЫХ СОПОСТАВЛЕНИЯХ**

**Резюме**

Рассмотрены процессы экономической глобализации, парадигмы современной глобалистики. Проанализированы две наиболее известные методики количественного и качественного измерения глобализации: Швейцарского Института исследования бизнеса (КОФ) и Международной организации Carnegie Endowment for International Peace (CEIP), на их основе предложена методика количественного анализа уровня глобализации стран мира (МКАГ), сущность которой заключается в установлении качественных взаимосвязей между разными индикаторами социального, экономического и политического измерений глобализации и индикаторами глобального экономического развития, качественного и количественного анализа глобализации с учетом влияния кризисных явлений на эти процессы. Выделены три группы исходных индикаторов, определяющих разницу между странами в контексте глобализации. Сделан сравнительный анализ уровня глобализации разных стран мира.

---

© Виктория Дергачова, Александр Згуровский, 2011.

Дергачова Виктория, докт. экон. наук, Национальный технический университет «Киевский политехнический институт», Украины.

Згуровский Александр, аспирант, Национальный технический университет «Киевский политехнический институт», Украины.

### Ключевые слова

Глобализация, индекс глобализации, индикатор, методика количественного анализа уровня глобализации стран мира (МКАГ), Экономическое измерение глобализации, социальное измерение глобализации, политическое измерение глобализации, факторный анализ.

### Классификация по JEL: F01.

Глобальная экономика – это способ мирового ведения хозяйства, основанный на подчинении как внутренних, так и международных хозяйственных процессов единым законам. Глобализация – это результат интернационализации всех сфер общественной жизни, установление непосредственных устойчивых связей между субъектами разных стран, вследствие чего производственный процесс в одной стране становится составной частью процесса, который осуществляется в планетарном масштабе. Мировая экономика становится единым рынком и производственной зоной с национальными и региональными секторами, а не простой совокупностью национальных экономик, которые разворачивают взаимное экономическое сотрудничество.

Украина ощутила влияние глобализации уже с первых лет независимости, когда ее экономика и общественная сфера стали открытыми для мира. Новые явления принесли стране новые возможности и перспективы. Расширялся доступ к культурным, интеллектуальным и технологическим достижениям мирового сообщества. Произведения мирового кинематографа, литературы, музыки очень быстро стали обычным окружением каждого человека. Еще вчера такие престижные и дорогие вещи, как автомобили, компьютеры, Интернет, системы коммуникации с внешним миром, мобильная связь и т. д., сегодня стали неотъемлемыми средствами использования современного человека, сделав его более функциональным и продуктивным. Стало все проще связываться с людьми в любых уголках мира, быстрее добираться в другие места или получать свежие новости сразу с момента наступления того или иного события.

Однако Украина также ощутила на себе и все противоречия глобализации. С одной стороны, ее шансы воспользоваться преимуществами глобализации возросли, но с другой – она стала более открытой для новых угроз. Уязвимость Украины к ним значительно возросла с началом глобального экономического кризиса. К этим угрозам Украина, как молодое государст-

во, не была подготовлена и, в большинстве случаев, оказалась не защищенной от них.

Стратегия развития Украины не может быть сформирована без полного учета факторов глобализации и глобальной конкуренции, которые будут влиять и уже влияют на жизнь наций. При этом приоритет непременно должен быть отдан внутренним процессам, внутренней адаптации экономики, то есть интравертному характеру политики, для того чтобы Украина могла вписаться в новые исторические условия. Однако внутренняя стратегия развития Украины должна быть глобально ориентированной, то есть, во-первых, эффективной, с точки зрения противодействия новым разрушительным влияниям глобализации, и, во-вторых, прагматической, с точки зрения использования новых возможностей и преимуществ, которые она приносит.

Исследованию проблематики и развития процессов глобализации посвящены работы известных отечественных и зарубежных ученых: О. Г. Билоруса, Б. В. Губского, М. Г. Деягина, Г. Колодко, Ю. В. Макогона, А. А. Пересады, А. С. Филипенко, У. Шарпа. Вместе с тем, в научной литературе мало внимания уделено вопросам качественного и количественного анализа глобализации с учетом влияния кризисных явлений на эти процессы, недостаточно обоснованными остаются индексы динамики глобализации и отсутствуют исследования о прерывистом характере процессов глобализации и влиянии показателей безопасности и социо-экономического развития на процессы глобализации. Таким образом, объективная необходимость дальнейшего развития теоретических и методико-прикладных основ исследования процессов глобализации предопределила актуальность темы данной работы.

Сущность глобализации, основная тенденция ее развития – формирование единого взаимосвязанного мира, взаимодействие и взаимовлияние разных сообществ, культур и цивилизаций. В широком значении и в идеале глобализация изменяет нынешнее мироустройство в планетарном масштабе, воплощая идущую из древности идею грядущего *единства человеческого сообщества при сохранении своеобразия его составляющих*.

Однако идея единства человеческого бытия, мировой гармонии, планетарного сообщества, «глобальность» мира совсем не нова. Она высказывалась больше двух тысяч лет назад древнегреческими философами, ее носителями были Христос, Магомет, Будда, гении культуры, чье творчество перешагнуло национальные границы. Трудно объяснить, почему человечество оказалось разъединенным, причем по многим признакам: расовым, этническим, языковым, религиозным, цивилизационным и др. Эта несхожесть «строителей Вавилонской башни», разделение по принципу «свой–чужой» было одной из причин конфликтов, войн, мировых катаклизмов. Однако люди разных племен и народов общались между собой, торговали, обменивались знаниями и культурой.

Таким образом, можно утверждать, что глобализация в ее первичных проявлениях, названная некоторыми авторами «протоглобализацией», объективно сопровождала всю человеческую историю, хотя и проходила неравномерно, в «пульсирующем» режиме, концентрируясь в том или ином регионе, в ареале той или иной цивилизации Древнего мира и последующих времен. Это значит, что современная глобализация мировой экономики – не какой-то неожиданный феномен, а эволюция процесса освоения и превращения нашей планеты.

Протоглобализация происходит в разных сферах: религиозной, когда место многобожия и язычества заняли мировые монорелигии [1]; политической, когда племена превращались в народы, создавались государства, формировались нации, региональные сообщества [2]; геополитической, когда осваивались новые пространства и образовывались империи [3]; идеологической, когда те или иные социальные идеи распространялись на многие территории и страны [4]; в сфере образования, когда, благодаря сети Интернет, доступ к образованию получили все территории и слои населения [5].

Все это дает основания утверждать, что глобализация – процесс, который испокон веков присущ человечеству. Из глубины веков взаимное проникновение культур и экономик разных стран мира открывало человечеству новые возможности для дальнейшего развития. «Великий шелковый путь», как культурная магистраль между Востоком и Западом, возник в III веке до нашей эры и просуществовал до XV века. Он оказался одним из наиболее выдающихся достижений в истории мировой цивилизации. Разветвленные сети караванных путей пересекали Европу и Азию от Средиземноморья до Китая и служили в древние времена и в эпоху Средневековья важным средством связей и диалога между культурами многих народов. Без преувеличения, это была *первая мощная волна глобализации*. Ее надолго прервали кровопролитные войны XVII–XVIII веков.

*Вторая волна глобализации* связана с периодом, начавшимся в 1880-х годах и прервавшимся почти на 60 лет Первой, Второй и холодной мировыми войнами. Он рассматривается как единое целое, в сложной взаимосвязи расцвета искусства «серебряного века» и всех явлений экономической и культурной жизни этого периода (экономики, торговли, науки, философии, искусства, религиозных и политических течений). Бурное развитие железной дороги и большого водного транспорта объединили в культурном и экономическом обмене страны пяти континентов.

Конец XX и начало XXI века можно связать с *третьей волной глобализации*. Она стремительно нарастала с начала 80-х годов прошлого века вплоть до 2008 и принесла человечеству новые, невиданные ранее, возможности. Однако в то же время возник и ряд новых глобальных угроз, которые с большой вероятностью могут существенно замедлить или даже временно прервать третью волну глобализации. К этим угрозам, прежде

всего, относятся: девальвация многих фундаментальных человеческих ценностей, нарастание неравенства между людьми и странами мира, распространение региональных конфликтов, рост коррупции, терроризма, нарастание глобальных болезней, уменьшение запасов органических видов топлива, нарушение важных биологических балансов, накопление парниковых газов в природе и другое. Клубок этих проблем и, в первую очередь, ценностный кризис человечества, дали толчок началу обвала в 2008 году глобальной финансовой системы, что повлекло за собой экономическую стагнацию и социальный упадок многих стран мира.

Похоже, указанные негативные тенденции будут иметь затяжной характер. Они вызовут фундаментальные экономические преобразования, глобальное перераспределение собственности и дальнейшую переконфигурацию мира с возникновением новых центров власти, и самое главное – станут катализатором к переосмыслению системы человеческих ценностей, которые должны доминировать на Планете, по крайней мере, в первой половине XXI века.

Таким образом, глобализация – это переменное, прерывистое явление. При таких тенденциях актуальным становится вопрос об изучении количественных зависимостей между явлением глобализации и социальными измерениями глобального экономического развития. Рассмотрим проблему количественного оценивания положительного и отрицательного влияния глобализации на страны, которые в нее погружаются. На первом этапе исследования хотелось бы применить две наиболее известные методики количественного и качественного измерения глобализации. *Первую* разработал Швейцарский Институт исследования бизнеса Konjunkturforschungsstelle der ETH Zurich (KOF) [6], *вторую* – Международная организация Carnegie Endowment for International Peace (CEIP) [7].

Индекс глобализации по методике KOF определяется тремя измерениями: экономическим ( $I_{ge}$ ); социальным ( $I_{gs}$ ); политическим ( $I_{gp}$ ) – и вычисляется как сумма своих составляющих  $I_g = 0.34 * I_{ge} + 0.37 * I_{gs} + 0.29 * I_{gp}$  с соответствующими весовыми коэффициентами. По методике CEIP этот индекс определяется четырьмя измерениями: экономическим ( $I_{ge}$ ); персональным ( $I_{gp}$ ); технологическим ( $I_{gt}$ ) и политическим ( $I_{gp}$ ) – и вычисляется как сумма указанных составляющих с равными весовыми коэффициентами.

Сопоставляя содержание измерений индекса глобализации по обеим методикам, легко увидеть, что персональное и технологическое измерение по системе CEIP практически сводится к социальному измерению по системе KOF. Поэтому далее, для удобства сопоставления, в системе CEIP объединим социальное и технологическое измерения в социальное измерение.

*Экономическое измерение глобализации ( $I_{ge}$ )* отражает постоянно возрастающую взаимосвязь между потребностями людей, с одной стороны, и возможностями производства и распространения товаров и услуг с по-

мощью международной торговли, поступления иностранных инвестиций и развития процессов транснационализации – с другой. В обеих методиках оно определяется следующими совместными индикаторами: уровень торговли в виде суммы всех видов экспорта и импорта; прямые иностранные инвестиции как сумма их притока и оттока. В методике КОФ используются дополнительные индикаторы: портфельные инвестиции в виде суммы абсолютной стоимости их притока и оттока и доходы нерезидентов в форме заработной платы или прибыли от инвестиций. Экономическое измерение глобализации любой страны очень сильно зависит от ее политической стабильности, уровня развития законодательной системы. Это измерение является весьма чувствительным к уровню доверия инвесторов.

*Социальное измерение глобализации (Isc)* является фактором, который отражает меру интегрированности рядового человека, его семьи, его жизни и труда в международные общественные институты. Формально это измерение в обеих методиках оценивается такими индикаторами, как интенсивность персональных контактов человека в банковской, телекоммуникационной и туристической сферах с другими странами, уровень развития международного туризма, уровень охвата человека средствами массовой информации и телекоммуникации. При этом методика КОФ дополнительно учитывает два следующих индикатора: процент иностранных граждан в стране и уровень охвата страны сетями международной торговли.

*Политическое измерение глобализации (Igp)* отражает политический вес и влияние любой страны на мировые процессы и изменения и позволяет оценить масштабы расширения ее участия в этих процессах и изменениях. В обеих методиках указанное измерение количественно оценивается с использованием таких общих индикаторов, как членство страны в международных организациях и участие страны в миссиях Совета Безопасности ООН. При этом в методике КОФ дополнительно применяется как индикатор «количество иностранных посольств в стране», а в методике СЕИР – «количество ратифицированных международных соглашений».

С целью изучения количественных зависимостей между явлением глобализации и приведенными выше социальными измерениями глобального экономического развития предложена методика количественного анализа уровня глобализации стран мира (названная методикой МКАГ), сущность которой заключается в установлении качественных взаимосвязей между разными индикаторами социального, экономического и политического измерений глобализации и индикаторами глобального экономического развития, приведения их к единой вычислительной платформе и системному обоснованию целостной модели глобального экономического развития. С применением известных методик КОФ, СЕИР и предложенной методики МКАГ [8] выполнен сравнительный анализ уровня глобализации разных стран мира [9].

В качестве индикаторов глобального экономического развития по методике МКАГ определены главные измерения глобального экономического развития: индекс государственной нестабильности (Isf – State Fragility Index), индекс демократизации (Id – Democracy Index), индекс миролюбивости страны (Igp – Global Peace Index), индекс неравенства получения прибыли (Ig – Gini Index), валовой внутренний продукт на душу населения (GDP per capita), индекс устойчивого развития (Isd – Index of sustainable development), индекс глобальной безопасности (Igs – Index of global security), индекс восприятия коррупции (Icp – Index of corruption perception), индекс потенциальной склонности к совершению террористических актов в стране (Ita – Index of potential terrorist acts), индекс борьбы с преступностью (Icc – Crsme Control Index).

Очевидно, индекс глобализации KOF/CEIP и его экономическая, социальная и политическая составляющие находятся в определенной зависимости от приведенных десяти индикаторов глобального экономического развития и их социального, экономического и политико-стабилизационного измерений. Для выявления этой зависимости проведен качественный и количественный анализ индексов глобализации KOF/CEIP десяти индикаторов глобального экономического развития и их совокупности для двух фаз развития глобального общества: для докризисного периода (вплоть до второй половины 2008 года), что освещено в данной работе, и для кризисного периода (после августа-сентября 2008 года), что будет освещено в следующей работе.

Анализируя табл. 1, построенную для докризисного периода, видим, что первыми двадцатью странами по *социальному измерению* являются: Дания, Словения, Швеция, Норвегия, Финляндия, Сингапур, Канада, Голландия, Австрия, Япония, Новая Зеландия, Исландия, Великобритания, Швейцария, Соединенные Штаты Америки, Германия, Австралия, Франция, Люксембург, Ирландия и Эстония. Россия и Украина находятся соответственно на 51 и 69 местах (из 123 мест).

По измерению *политической стабильности* в первую двадцатку вошли следующие страны: Исландия, Швеция, Норвегия, Мальта, Ирландия, Швейцария, Япония, Дания, Финляндия, Канада, Словения, Новая Зеландия, Люксембург, Голландия, Австрия, Уругвай, Костарика, Германия, Венгрия и Кипр. Украина, Соединенные Штаты Америки и Россия соответственно занимают 48, 56 и 87 места.

Первыми двадцатью странами по *экономическому показателю* (ВВП на душу населения по паритету покупательной способности) являются: Люксембург, Соединенные Штаты Америки, Норвегия, Ирландия, Исландия, Швейцария, Дания, Австрия, Канада, Великобритания, Голландия, Швеция, Финляндия, Австралия, Япония, Франция, Сингапур, Германия, Италия и Испания. Россия и Украина находятся соответственно на 51 и 69 местах.

Таблица 1

Нормированные значения главных измерений глобального  
экономического развития стран мира для докризисного периода

Страна	Индекс глобализации KOF/ CEIP					Измерение политической стабильности					Социальное измерение				Экономическое измерение ВВП на душу населения	
	Общий индекс	Рейтинг	Экономический индекс	Социальный индекс	Политический индекс	Общий индекс	Индекс государственной нестабильности	Индекс демократизации	Глобальный индекс миролюбия	Потенциальная возможность террористических актов	Индекс глобальной безопасности	Общий индекс	Индекс ботбы с преступностью	Индекс чувствительности к коррупции		GINI-индекс
1. Бельгия	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. Австрия	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. Швеция	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. Швейцария	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. Дания	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. Нидерланды	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. Великобритания	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. Чешская Республика	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. Франция	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. Финляндия	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. Германия	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. Испания	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. Венгрия	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. Португалия	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. Ирландия	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. Норвегия	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. Италия	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. Польша	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. Сингапур	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. Австралия	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. Соединенные Штаты Америки	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. Словакия	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. Малайзия	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. Греция	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
26. Новая Зеландия	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. Эстония	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. Израиль	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



Страна	Индекс глобализации KOF/ CEIP					Измерение политической стабильности						Социальное измерение				Экономическое измерение ВВП на душу населения
	Общий индекс	Рейтинг	Экономический индекс	Социальный индекс	Политический индекс	Общий индекс	Индекс государственной нестабильности	Индекс демократизации	Глобальный индекс миролюбия	Потенциальная возможность террористических актов	Индекс глобальной безопасности	Общий индекс	Индекс борьбы с преступностью	Индекс чувствительности к коррупции	GINI-индекс	
30. Словения	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. Хорватия	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. Турция	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. Россия	0,698	33	0,579	0,644	0,960	0,509	0,723	0,379	0,252	0,761	0,428	0,443	0,512	0,115	0,703	10,845
34. Чили	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. ОАЭ	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. Исландия	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. Иордания	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. Кипр	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. Румыния	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. Украина	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. Болгария	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. Южная 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. Латвия	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. ЮАР	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

14 стран входят одновременно в двадцатку лучших стран мира по трем указанным измерениям. К ним относятся: Дания, Швеция, Норвегия, Финляндия, Канада, Голландия, Австрия, Япония, Исландия, Швейцария, США, Германия, Люксембург, Ирландия. Десять из них входят в 20 наиболее глобализованных стран мира по индексу KOF/ CEIP. Исключением из этого списка стали Япония, Исландия, США и Люксембург.

Названные лучшие 10 стран характеризуются очень высокими показателями глобального индекса миролюбивости, индекса демократизации, индекса глобальной безопасности, индекса борьбы с преступностью и, в то же время, низкими значениями коррупции и неравенства населения. В эту группу входят преимущественно страны – не члены Большой восьмерки, за исключением Германии и Канады. Они не имеют доминирующих экономик

и не пытаются навязывать свою волю другим странам на геополитической карте мира.

Интересно, что, в соответствии с индексом глобализации KOF/CEIP, США (22 место) и Япония (51 место) имеют очень высокие значения политической составляющей глобализации, в то же время, по экономической и социальной составляющей они уступают странам первой двадцатки. Люксембург (27 место), имея очень высокую экономическую составляющую глобализации, характеризуется посредственным значением социальной составляющей и очень низким значением политической. При этом 22 место по рейтингу KOF/CEIP для США является полностью обоснованным. Эта страна имеет очень низкие значения глобального индекса миролюбивости (0,492) и индекса глобальной безопасности (0,546), высокую потенциальную возможность к террористическим актам (0,435) и высокое неравенство населения страны (0,688). В то время как 51 место по рейтингу KOF/CEIP для Японии и 27 для Люксембурга не соответствуют их весьма высоким показателям, практически по всем индикаторам методики МКАГ.

Отдельно анализируя Украину, укажем на ее особенности в контексте глобализационных процессов. Страна имеет мощный человеческий капитал – 46-миллионное высокообразованное население (по данным ООН, индекс образованности в Украине равен 0,94). Ее географический и ресурсный потенциал дают большие возможности в экономической и культурной кооперации как с Россией, так и со странами Центральной и Западной Европы. Она расположена на берегах Черного и Азовского морей, имеет плодородную землю для сельскохозяйственных целей, мощную газотранспортную сеть. В транзитном отношении она представляет собой современный «Великий шелковый путь» для энергетического, культурного и товарного обмена между Востоком и Западом. Стратегически важно для Украины поддерживать стабильность этого коридора. Его дестабилизация в начале 2009 года, в связи с приостановлением транзита газа, привела почти к 40%-му спаду украинской экономики, многомиллиардным затратам для экономики России и стран Западной Европы.

По методике KOF/CEIP в докризисный период Украина занимала 42 позицию в рейтинге глобализации. Анализируя состояние Украины по методике МКАГ, видим, что она имеет очень высокий уровень коррупции, низкий уровень борьбы с преступностью, нарастающее неравенство между самыми бедными и самыми богатыми слоями населения, высокую государственную нестабильность, усложняющую ее дальнейшую интеграцию в глобальное экономическое и культурное пространство.

Дальнейший анализ по методике МКАГ предусматривает кластеризацию (на основе использования метода К-средних) и вычисление математического ожидания значений каждого из индикаторов, приведенных в табл. 1. Значение средней погрешности оценивания отсутствующих данных, согласно предложенной методике, сведено в таблицу 2.

Таблица 2

**Значение средней погрешности оценивания отсутствующих данных**

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

Обобщенная средняя погрешность на один индикатор составляет 0,039, по сравнению с 0,073 для вычислений согласно методике [6].

Применение корреляционного анализа для установления факта наличия статистически значимой связи между составляющими общего индекса глобализации (индикаторами социального, экономического и политического измерений глобализации) и индикаторами глобального экономического развития является важной задачей, от результата решения которой зависит возможность применения тех или иных методов моделирования. Поскольку предполагается, что все показатели выражены в интервальных шкалах, то степень линейной связи между отдельными показателями можно оценить с помощью коэффициента корреляции Пирсона. Для этого вычислим коэффициенты парной корреляции между индексами и исходными индикаторами (табл. 3).

Таблица 3

**Матрица коэффициентов парной корреляции  
для экономического, социального и политического индексов  
и исходных индикаторов**

	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

Как видим, экономический и социальный индексы глобализации имеют сильную или среднюю связь почти со всеми исходными индикаторами (кроме потенциальной склонности к совершению террористических актов и индекса неравенства для экономического индекса). Выясним также зависимость между самими исходными индикаторами (табл. 4).

Таблица 4

**Матрица коэффициентов парной корреляции  
 для исходных индикаторов**

	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

Как свидетельствуют результаты (табл. 4), наблюдается средняя и сильная связь не только в пределах групп индикаторов, в соответствии с расчетом экономического, социального и политического индексов глобализации, но также и между группами индикаторов.

Таким образом, установлено, что показатели по тем или иным причинам являются корреляционно зависимыми. Для того чтобы лишиться такой зависимости, применим факторный анализ и перейдем к системе синтетических независимых показателей (характерных факторов). Целью применения факторного анализа является поиск и интерпретация характерных факторов с одновременной минимизацией как их количества, так и степени их зависимости от своих остаточных случайных компонентов.

Матрица факторных нагрузок (табл. 5) задает отображение базиса исходного пространства в пространство главных компонентов, в котором можно оценить значимость и взаимозависимость между исходными индикаторами.

Таблица 5

**Матрица факторных нагрузок**

Показатель	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

Из таблицы 5 следует, что наибольшие нагрузки на первый фактор имеет индекс государственной нестабильности, индекс демократизации, индекс глобальной безопасности, индекс уязвимости к коррупции и ВВП на душу населения. На второй фактор – индекс потенциальной возможности террористических актов. На третий фактор – индекс борьбы с преступностью и GINI-индекс. Следует отметить, что глобальный индекс миролюбивости имеет практически равные нагрузки на все три фактора.

Таким образом, можно выделить три группы исходных индикаторов, определяющих разницу между странами в контексте глобализации. К первой группе относятся индекс государственной нестабильности, индекс демократизации, индекс глобальной безопасности, индекс уязвимости к коррупции и ВВП на душу населения. Во вторую группу входит только индекс потенциальной возможности террористических актов. Третья группа показателей объединяет индекс борьбы с преступностью и GINI-индекс. Особое место занимает глобальный индекс миролюбивости.

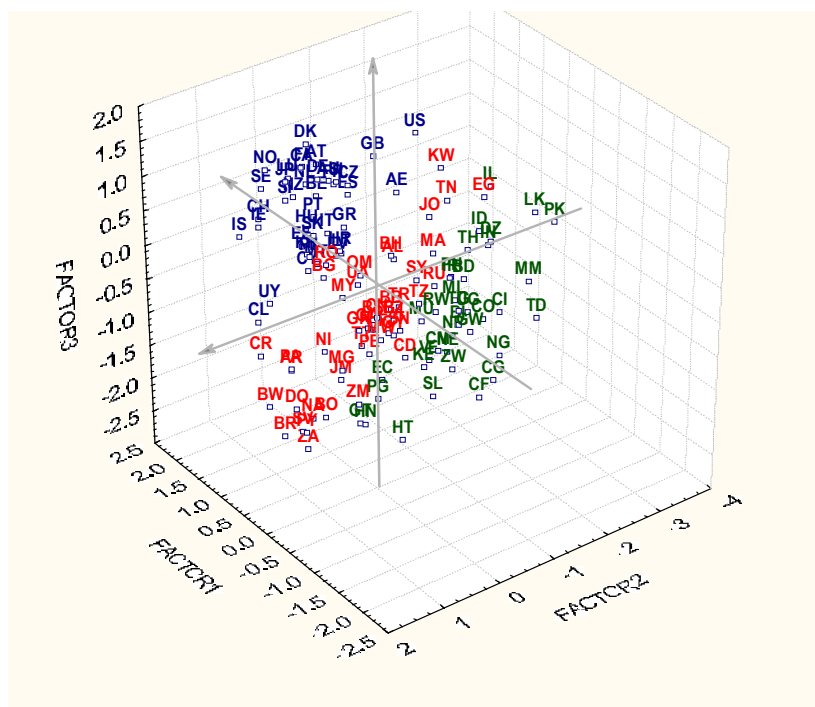
Далее, по методике МКАГ, необходимо провести кластеризацию стран в факторном пространстве. Для решения этой задачи воспользуемся быстрым методом кластерного анализа, который имеет название «метод К-средних». Идея метода заключается в том, что заданное фиксированное число  $k$  кластеров ставится в соответствие со странами таким образом, чтобы максимизировать междукластерные расстояния (рис. 1).

Как видно из рис. 1, в первый кластер вошли следующие страны: Бельгия, Австрия, Швеция, Швейцария, Дания, Нидерланды, Великобритания, Чешская Республика, Франция, Финляндия, Германия, Испания, Венгрия, Португалия, Канада, Ирландия, Норвегия, Италия, Польша, Сингапур,

Австралия, Соединенные Штаты Америки, Словакия, Греция, Новая Зеландия, Люксембург, Эстония, Словения, Хорватия, Чили, Объединенные Арабские Эмираты, Исландия, Мальта, Кипр, Литва, Южная Корея, Латвия, Уругвай, Япония.

Рисунок 1

Визуализация результатов кластеризации в факторном пространстве



Для этих стран характерным является то, что значения для первого кластера находятся в диапазоне от выше средних к наивысшим. В основном эти страны имеют значение второго фактора в пределах стандартного отклонения. Однако следует обратить внимание на Соединенные Штаты Америки и Великобританию, для которых индекс защищенности от террористических актов имеет низкие значения. По третьему фактору эти страны занимают положение в диапазоне выше среднего.

Второй кластер составляют Малайзия, Турция, Россия, Иордания, Кувейт, Румыния, Украина, Китай, Болгария, Южная Африка, Аргентина, Бразилия, Эль Сальвадор, Бахрейн, Перу, Ямайка, Панама, Мексика, Марокко, Коста-Рика, Египет, Оман, Тунис, Намибия, Гана, Парагвай, Гайана, Доминиканская Республика, Боливия, Габон, Тринидад и Тобаго, Замбия, Фиджи, Багамы, Никарагуа, Белиз, Барбадос, Сенегал, Малави, Ботсвана, Албания, Танзания, Бенин, Сирия, Конголезская Республика, Мадагаскар. Важным для этих стран является то, что значение второго фактора выше среднего. По первому фактору страны второго кластера занимают положение в диапазоне от очень низких до средних значений. По третьему фактору наблюдается весь возможный диапазон значений.

В отличие от второго кластера, страны третьего кластера: Израиль, Филиппины, Таиланд, Нигерия, Эквадор, Индонезия, Гондурас, Венесуэла, Колумбия, Маврикий, Пакистан, Гватемала, Индия, Шри-Ланка, Зимбабве, Кот-д'Ивуар, Алжир, Кения, Того, Уганда, Мали, Чад, Камерун, Бангладеш, Папуа Нова Гвинея, Непал, Сьерра-Леоне, Иран, Конго, Гвинея Бисау, Нигер, Гаити, Центральная Африканская Республика, Руанда, Мьянма, Бурунди – имеют низкую защиту от угрозы терроризма. По характеристике первого и третьего факторов эти страны похожи на те, которые входят во второй кластер.

Исследования показали:

- Наименее уязвимой страной мира к экономическому кризису с точки зрения утраты глобализационных свойств, оказалась Канада. Она, претерпев снижение ВВП на 6,14 %, даже на семь пунктов поднялась в рейтинге наиболее глобализованных стран мира по индексу КОФ, сохранив на уровне предыдущих лет свой экспортно-импортный баланс, объемы внутреннего и внешнего рынков, уровень зарубежной собственности, внутренний валовой продукт. Падение в рейтинге КОФ от пяти до семи пунктов на начальном этапе экономического кризиса претерпели Австралия (-5), Мексика (-5), Украина (-5), Южно-Африканская республика (-6), Франция (-7). При этом Австралия, потеряв ВВП на 10,3 %, существенно улучшила свой экспортно-импортный баланс, в то время как другие страны этой группы сохранили его на предыдущем уровне, за исключением Украины, для которой он заметно ухудшился. В Украине также наблюдается существенное (на 19,3 %) ограничение капиталопотоков. С другой стороны, наибольшую утечку мозгов (*Draine Raine*) претерпели Канада (-3,9 %), Австралия (-12,1 %) преимущественно в США, в то время, как Украина имела прирост интеллектуального потенциала на 6,6 %. Потери ВВП для Франции составляли 8,27 %. Другие показатели для стран этой группы остались без особых изменений на начальном этапе экономического кризиса.

- В группу стран с мощными экономиками, которые претерпели падения индекса глобализации от 10 до 20 пунктов, относятся: Италия (–10), Германия (–11), Южная Корея (–13), Аргентина (–14), США (–16), Япония (–19), Великобритания (–20). Среди них США и Великобритания сохраняют достаточно высокий положительный баланс экспорта-импорта, в то время как Япония и Южная Корея его существенно ухудшили. Достаточно большой спад ВВП (–16,1 %) и существенное ограничение капиталопотоков (–16,2 %) продемонстрировала Южная Корея. Значительный спад ВВП произошел в Германии (–12,9 %) и Аргентине (–8,96%). Все страны этой группы сохранили на уровне предыдущих лет свои внутренние и внешние рынки и уровни зарубежной собственности. Великобритания претерпела почти 5 %-й отток мозгов, преимущественно в США.
- Существенные изменения в начале экономического кризиса произошли в странах БРИК-группы, Турции и Индонезии. Эти страны не имели существенного падения ВВП (за исключением Турции и России), но они претерпели падение индекса глобализации КОФ от 25 до 48 пунктов (Турция (–19), Бразилия (–27), Россия (–28), Индонезия (–34), Индия (–41), Китай (–48)). Они в основном сохранили свои внутренние и внешние рынки, но, за исключением Турции и России, существенно ухудшили свой экспортно-импортный баланс. При этом Турция и Индонезия значительно увеличили присутствие иностранного капитала в своих странах. Рекордно высокий отток мозгов продемонстрировала Индия (–13,5 %), тогда как Россия за это время смогла улучшить условия для сохранения интеллектуального капитала на 12,5 %.
- В результате применения метода многомерного статистического анализа осуществлено исследование взаимных зависимостей социо-экономических индикаторов и индекса глобализации и его составляющих для стран Большой двадцатки. Была установлена общая тенденция падения рейтинга индекса глобализации (в среднем на 17 пунктов), обусловленного прежде всего ограничением социального измерения глобализации. Также установлено, что степень статистической связи между изменениями социальной и экономической составляющих близка к среднему уровню (коэффициент корреляции – 0,36), а изменение политической составляющей является независимым от изменения социальной и экономической составляющих (соответствующие коэффициенты корреляции – 0,06 и 0,11). В отношении исходных социо-экономических индикаторов заметна статистическая значительная зависимость между изменениями импорта и экспорта, а измене-



ния объема внешнего рынка и экспорта имеют статистическую связь среднего уровня.

- Применение метода факторного анализа позволило установить три независимых фактора, по которым различаются страны Большой двадцатки с точки зрения изменения исходных показателей, влияющих на изменение индекса глобализации. В первый фактор входят изменения импорта, экспорта и объема внешнего рынка, второй фактор составляют изменения оттока мозгов и ВВП, третьим фактором является изменение объемов иностранной собственности. В факторном пространстве по признакам близости изменений исходных показателей выделены четыре кластера стран. В отношении стран первого кластера, Китая и Мексики, можно сказать, что, несмотря на достаточно значительную разницу в изменении ВВП и показателе оттока мозгов, наблюдается наибольшее сокращение внешних рынков и объемов импорта и экспорта, но по изменениям уровня иностранной собственности эти страны имеют средние и выше средних показатели. Для второго кластера, который составляют наиболее развитые страны (Великобритания, США, Канада, Германия, Франция, Япония, Индия и Индонезия), характерным является изменение всех показателей в пределах стандартного отклонения, что свидетельствует об устойчивой тенденции глобализации для этих стран. Для третьего кластера (Аргентина, Австралия, Бразилия, Италия, Россия, ЮАР), несмотря на значительные различия в уровнях изменений ВВП, наблюдается тенденция, связанная с ростом уровня зарубежной собственности, объемов внешних рынков и импорта-экспорта (перенесения в эти страны больших производств в связи с дешевой рабочей силой и благоприятными условиями для бизнеса). Для Украины, как и для Турции и Кореи, которые входят в четвертый кластер, характерно увеличение объемов внешних рынков и импорта-экспорта на фоне существенного снижения ВВП и объемов иностранной собственности (необоснованная приватизация национальных активов, искусственное создание внешних рынков в офшорных зонах и другое).
- В своем кластере Украина по первому и третьему фактору имеет наибольшие значения, а по второму фактору – наиболее низкие. В результате анализа влияния исходных показателей на составляющие индекса глобализации установлено, что на рост экономической составляющей индекса КОФ Украины влияет рост объемов экспорта, уменьшение объема внутреннего рынка и рост показателя вытекания мозгов. На рост социальной составляющей – рост ограничения капиталопотоков и уменьшение объемов зарубежной собственности, влияющей на интенсивность временной миграции

населения. Рост политической составляющей связан с ростом объемов внешнего рынка и собственного ВВП страны.

### Литература

1. Мовсесян А. Г., Огневцев 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>, свободный. – Загол. с экрана. – Язык англ.
7. Carnegie Endowment for International Peace (CEIP) / Фонд Карнеги за міжнародний мир – Электрон. дан. – Carnegie Endowment for International Peace, 2009. Режим доступа: <http://www.carnegieendowment.org/>, свободный. – Загол. с экрана. – Язык 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.

Статья поступила в редакцию 19 мая 2011 г.