

УДК 339.924

А.И. Соловьев

## ГЛОБАЛЬНЫЕ РИСКИ: СОВРЕМЕННОЕ СОСТОЯНИЕ И ПЕРСПЕКТИВЫ ПРОГНОЗИРОВАНИЯ

Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации,  
г. Москва

В России недостаточно внимания уделяется учету в процессе стратегического планирования влияния глобальных процессов и рисков на экономику страны и уровень её экономической безопасности. В статье представлен подход к решению этой задачи на основе комплексного исследования влияния глобальных рисков. Он основан на развитии методик количественной оценки глобальных рисков Всемирного экономического форума (ВЭФ) и дополнен методикой оценки влияния глобальных рисков на экономику России. Отмечены проблемы, связанные с прогнозированием глобальных рисков в целом и оценкой их влияния на национальные государства. Приведены глобальные риски 2020 года по данным отчета ВЭФ.

**Ключевые слова:** глобализация, глобальные риски, уязвимость, устойчивость, экономическая безопасность, риск-менеджмент.

### Предисловие

25 января 2016 года на 76 году жизни скоропостижно скончался научный руководитель Факультета анализа рисков и экономической безопасности Финансового университета при Правительстве Российской Федерации Вячеслав Константинович Сенчагов, д.э.н., профессор, Председатель комитета цен СССР, заместитель министра финансов СССР, академик РАЕН, вице-президент РАЕН, почетный академик ряда российских и зарубежных академий, член Экспертного совета при Правительстве Российской Федерации, заместитель председателя Экспертного совета при Комитете по экономической политике Совета Федерации Федерального Собрания РФ, член Научного совета при Совете Безопасности Российской Федерации.

Мне посчастливилось работать с этим замечательным человеком. Под руководством Вячеслава Константиновича было начато исследование глобальных рисков и оценки их влияния на экономику России.

### Введение

Одним из инструментов стратегического целеполагания и прогнозирования [1] является практика оценки влияния глобальных рисков. Методология оценки глобальных рисков находится в центре внимания экс-

пертов Всемирного экономического форума (ВЭФ). Однако методики оценки воздействия глобальных рисков на устойчивость национальных экономик находятся еще в стадии активной дискуссии.

В научных исследованиях Финансового университета предложен ряд подходов, направленных на решение этой задачи. Они основаны на применении индикативного метода оценки влияния глобальных рисков на экономику страны, в разработку которого внес большой вклад В.К. Сенчагов. Эти методики могут быть использованы в качестве инструмента при формировании экономической стратегии в части выявления, изучения и оценки влияния глобальных рисков на экономику и уровень её экономической безопасности.

### **Основы индикативного подхода к оценке влияния глобальных рисков**

В работе [2] изложены основы индикативного подхода к оценке влияния глобальных рисков (ГР) на экономику государства. Он включает оценку значимости ГР и их ранжирование, формирование перечня наиболее влияющих на экономику страны ГР, оценку уязвимости экономики государства к ГР и уровня их влияния на его экономическую безопасность, и, в частности, на экономику России включает:

- выполнение оценки значимости глобальных рисков и их ранжирование;
- формирование перечня глобальных рисков, которые могут иметь наибольшее влияние на национальную экономику;
- оценку уязвимости экономики России к глобальным рискам;
- оценка степени влияния глобальных рисков на уровень экономической безопасности России.

Исходными данными для реализации данного подхода являются экспертные оценки вероятности возникновения и степени влияния ГР, проводимые в рамках ВЭФ. Такие оценки регулярно публикуются в ежегодных Докладах о глобальных рисках ВЭФ. Вместе с тем, они не отражают особенностей российской экономики. Индикативный подход дополняет методики ВЭФ необходимыми элементами, конкретизирующими влияние ГР на экономику России. В частности, на примере данных ВЭФ о глобальных рисках 2014 года [3], не учитывающих изменения экономической ситуации в мире и России, возникших в связи с введением санкций и геополитических процессов в Украине, с использованием индикативного подхода, были проранжированы ГР по уровню их влияния на устойчивость экономики России [2]. В десятку наиболее значимых глобальных рисков вошли: высокое неравенство доходов; экстремальные природные явления, цунами, пожары; высокий уровень безработицы; неготовность к адаптации и смягчению последствий изменения климата; бюджетные кризисы в ве-

дущих экономиках; кризис водоснабжения; кибератаки; продовольственный кризис; нарушение основных финансовых механизмов; политическая и социальная нестабильность.

Для оценки уязвимости России к влиянию ГР разработана методика [2], которая основана на сравнительной оценке ГР с целевыми индикаторами экономической политики, а также с пороговыми индикаторами экономической безопасности России [4]. Шкала оценки уязвимости национальной экономики при сопоставлении интегральной оценки риска с целевыми показателями социально-экономической политики и пороговыми значениями индикаторов экономической безопасности включает три оценки: высокую, среднюю и низкую уязвимость в зависимости от текущего расположения соответствующего индикатора относительно порогового значения.

Результаты оценки влияния ГР 2014 г. на экономику России [2]: высокая уязвимость: риск высокого неравенства доходов, риск структурного дисбаланса; средняя уязвимость: риск безработицы; низкая уязвимость: риск бюджетных кризисов ведущих экономик мира, риск нарушения функционирования основных финансовых механизмов и институтов.

В 2015 году произошли кардинальные изменения в геополитической обстановке вокруг России, что отразилось на «ландшафте» глобальных рисков. В связи с этим была выполнена индикативная оценка уязвимости экономики страны к ГР. При этом были учтены не только экономические, но и другие типы рисков, приведенные в Докладе ВЭФ 2015 года [5]. Было выявлено, что для объективной оценки влияния ГР на социально-экономическое положение России отсутствует ряд данных, необходимых для анализа рассматриваемых явлений. В этой связи было предложено для оценки ряда рисков использовать дихотомический метод (да/нет) по признаку наличия/отсутствия явлений, свидетельствующих о влиянии этих рисков.

Результаты оценки влияния ГР 2015 г. на экономику России [2]: высокая уязвимость: межгосударственные конфликты, падение цен на энергоносители, нарушение финансовых механизмов и институтов, неуправляемая инфляция; средняя уязвимость: отказ от адаптации к климатическим изменениям, нарушение государственного управления, экстремальные погодные явления, снижение биологического разнообразия и экологические кризисы, нарушение критической информационной инфраструктуры, рукотворные природные катастрофы, инфраструктурные нарушения; низкая уязвимость: водный кризис, полная и частичная безработица, кибератаки, пузыри активов, кризисы налоговых систем, террористические атаки, рост социальной нестабильности, рост инфекционных заболеваний, нарушение и утрата данных, природные катастрофы, крупномасштабная неконтролируемая миграция, оружие массового поражения, злоупотребление технологиями, дефляция, кризис урбанизации.

В настоящее время необходимо ставить вопрос о целесообразности существенного пересмотра подходов, которые используются при оценке ГР специалистами ВЭФ [6]. Это связано с несоответствиями, возникающими при сравнении оценок ГР с реальными явлениями. Например, состав и оценка глобальных рисков в 2006-2007 гг. не указывали на возможность Мирового финансового кризиса 2008 г. А в январе 2018 г. ландшафт глобальных рисков не указывал на такие угрозы, как разворачивание торговых войн, рост протекционизма, усиление санкционного давления на экономические процессы.

Одним из направлений корректировки оценки ГР является применение подходов, основанных на сопоставлении субъективных экспертных данных с количественной оценкой рассматриваемых явлений на основе обработки больших данных и использования методов «искусственного интеллекта» [6].

### **Перспективы дальнейшего использования результатов исследования**

Мониторинг глобальных рисков в 2017-2019 года позволил поставить вопрос о необходимости пересмотра методик изучения глобальных рисков. Инфографика на рис. 1, обобщающая оценки глобальных рисков по методике ВЭФ за период с 2007 по 2020, свидетельствует о значительных расхождениях прогнозных оценок с текущими реалиями. Это проявилось в 2014-2015 годах, когда присоединение Крыма к России и введение санкций не были предсказаны как события, оказавшие влияние на прогнозные оценки глобальных рисков. Но тогда эти изменения не были столь заметны и не стали поводом для широкого обсуждения.

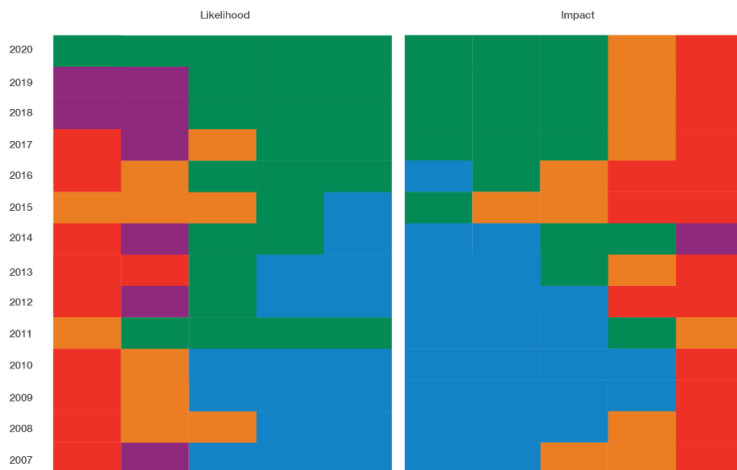
Ландшафт глобальных рисков начала 2020 года полностью отличается от прогнозов Всемирного Экономического форума. В Докладе о глобальных рисках-2020 [7] основными рисками признаны риски окружающей среды, к которым относятся природные катастрофы, экстремальные погодные явления, климатические изменения, воздействие человека на окружающую среду и утрата биологического разнообразия. Среди них только с большой натяжкой можно сослаться на то, что санитарно-эпидемиологическая ситуация с распространением эпидемии коронавируса относится к глобальным рискам, связанным с окружающей средой. Но социально-экономические последствия пандемии во всех сторонах общественной жизни в сотнях стран столь значительны, что парализовали социально-экономическую жизнь в них, потребовали пересмотра большинства политических решений по вопросам свободы передвижения в мире. В Европейском Союзе в частности, это привело к пересмотру бюджетных ограничений, панике на фондовых рынках, падению цен на энергоресурсы,

снижению экономической активности вплоть до остановки работы предприятий.



### TOP GLOBAL RISKS

From economic to environmental. Climate now tops the risks agenda, while the economy has disappeared from the top five.



#### Economic

- Asset bubble
- Critical infrastructure failure
- Deflation
- Energy price shock
- Financial failure
- Fiscal crises
- Illicit trade
- Unemployment
- Unmanageable inflation

#### Environmental

- Biodiversity loss
- Climate action failure
- Extreme weather
- Human-made environmental disaster
- Natural disasters

#### Geopolitical

- Global governance failure
- Interstate conflict
- National governance failure
- State collapse
- Terrorist attacks
- Weapons of mass destruction

#### Societal

- Failure of urban planning
- Food crises
- Infectious diseases
- Involuntary migration
- Social instability
- Water crises

#### Technological

- Adverse technological advances
- Cyberattacks
- Data fraud or theft
- Information infrastructure breakdown

Source: World Economic Forum 2007-2020, *Global Risks Reports*.

Рис. 1. Динамика изменения взглядов на ТОП-10 глобальных рисков (2007-2020)

Всего за три месяца с момента появления информации о коронавирусе в китайском Ухане мир оказался на грани экономического кризиса соразмерного, а может и более масштабного, чем мировой экономический кризис. Глобальный риск такого масштаба не нашел своего прогноза ни в одном предсказании, кроме, может быть, предсказания Нострадамуса.

Это еще раз подчеркивает, что проблема прогнозирования глобальных рисков требует дальнейшего изучения и методологического обеспечения. В настоящее время существующие методики выявления глобальных рисков и оценки их влияния оставляют желать лучшего. Поэтому работа начатая при участии и под руководством Вячеслава Константиновича Сенчагова будет продолжена. Необходимо сосредоточить усилия на разработке отечественных методик выявления и оценки глобальных рисков и на их основе совершенствовать подходы к оценке влияния глобальных рисков на социально-экономическое положение в России.

© Соловьев А.И., 2020.

#### Библиографический список

- [1] Федеральный закон от 28 июня 2014 г. № 172-ФЗ «О стратегическом планировании в Российской Федерации». [Электронный ресурс]. – URL: <https://base.garant.ru/70684666/>
- [2] Сенчагов, В.К. Оценка влияния глобальных рисков как инструмент формирования экономической стратегии России: индикативный подход / В.К. Сенчагов, С.А. Побываев, А.И. Соловьев // Экономические стратегии. – 2016. – №8. – С. 24-31.
- [3] Доклад ВЭФ по глобальной повестке дня – 2015. [Электронный ресурс]. – URL: <http://www.weforum.org/reports/outlookglobal-agenda-2015>
- [4] Экономическая безопасность России: Общий курс: учебник / Под ред. В.К. Сенчагова. – М.: Дело, 2009. – 806 с.
- [5] Всемирный экономический форум опубликовал доклад «Глобальные риски 2015». [Электронный ресурс]. – URL: <https://gtmarket.ru/news/2015/01/15/7042>
- [6] Соловьев, А.И. Всемирный экономический форум и подходы к оценке глобальных рисков // Экономическая безопасность России: проблемы и перспективы: матер. VI Междунар. научно-практ. конф. – НГТУ. – Н. Новгород, 2018. – С. 242-246.
- [7] Доклад о глобальных рисках – 2020. [Электронный ресурс]. – URL: <https://roscongress.org/materials/doklad-o-globalnykh-riskakh-2020/>

A.I. Soloviev

## GLOBAL RISKS: PRESENT STATUS AND PROSPECTS FOR FORECASTING

Financial University under the Government of the Russian Federation, Moscow

**Abstract.** In Russia insufficient attention is paid to consideration of the influence of global processes and risks on the country's economy and its level of economic security in the strategic planning process. The article presents the approach to solving this problem based on the comprehensive study of the impact of global risks. It is based on development of methods for quantitative assessment of global risks of the World Economic Forum (WEF) and is supplemented by the methodology for assessing the impact of global risks on the Russian economy. The problems associated with the forecasting of global risks in general and the assessment of their impact on national states are noted. Global risks of 2020 are given according to WEF report.

**Keywords:** globalization, global risks, vulnerability, sustainability, economic security, risk management

### References

- [1] Federal Law of June 28, 2014 No. 172-ФЗ "On Strategic Planning in the Russian Federation". [Electronic resource]. Available at: <https://base.garant.ru/70684666/>
- [2] Senchagov, V.K. (2016). [Assessing the impact of global risks as the tool for shaping the economic strategy of Russia: the indicative approach]. *Ekonomicheskie strategii* [Economic strategies]. No 8, pp. 24-31. (In Russ).
- [3] WEF Global Agenda Report 2015. [Electronic resource]. Available at: <http://www.weforum.org/reports/outlookglobal-agenda-2015>
- [4] Senchagov, V.K. (2009). [Economic Security of Russia: General Course: Textbook]. *M.: Delo* [M.: Business]. 806 p. (In Russ).
- [5] The World Economic Forum has published the Global Risks 2015 report. [Electronic resource]. Available at: <https://gtmarket.ru/news/2015/01/15/7042>
- [6] Soloviev, A.I. (2018). [World Economic Forum and approaches to assessing global risks // Economic Security of Russia: Problems and Prospects. *N.Novgorod* [N.Novgorod]. pp. 242-246. (In Russ).
- [7] Global Risk Report - 2020. [Electronic resource]. Available at: <https://roscongress.org/materials/doklad-o-globalnykh-riskakh-2020>