

DOI: <https://doi.org/10.30525/978-9934-26-191-6-10>

Olga Polyakova

*Candidate of Economic Sciences, Associate Professor,
Chief of the Department of Macroeconomic Analysis and Forecasting
Research Center for Industrial Problems of Development
of the National Academy of Sciences of Ukraine*

Viktoriia Shlykova

*Candidate of Economic Sciences,
Senior Researcher
of the Department of Macroeconomic Analysis and Forecasting
Research Center for Industrial Problems of Development
of the National Academy of Sciences of Ukraine*

Olga Ivanova

*Doctor of Economic Sciences, Associate Professor,
Chief of the Department of Regional Development
and Decentralization Problems
Research Center for Industrial Problems of Development
of the National Academy of Sciences of Ukraine*

MACROECONOMICAL AND SOCIAL STABILITY: INTERACTION PROBLEMS

Summary

The importance of ensuring macroeconomic and social stability in the crisis is substantiated. The methodical approach to determining the mutual influence of factors of social and macroeconomic stability is proposed. The conceptual scheme of building an impact model is based on four hypotheses formulated by the authors as a result of generalizing the practice of implementing social standards in Ukraine and existing theoretical research. The comparative analysis of the dynamics of normative and actual parameters of social policy showed an increase in the gap between them. There is a significant gap between the parameters of social policy and the rate of change and the actual value and dynamics of GDP, which led to the conclusion that social and macroeconomic

policies are inconsistent. Cross-correlation analysis has shown that poverty and inequality are closely linked to standards and employment. The cognitive map of the interconnection between threats to macroeconomic and social stability has been developed, which can be used to build a simulation model.

Вступ

Соціальна та макроекономічна стабільність є запорукою економічної і національної безпеки держави, особливо в кризових умовах, зокрема спричинених пандемією COVID-19. Серед глобальних Цілей сталого розвитку до 2030 р., проголошених ООН та підтриманих Україною, поряд із переважно соціально спрямованими – ліквідація бідності, зменшення нерівності, якісне здоров'я і благополуччя, якісна освіта – включено цілі переважно економічного характеру – достойна праця та економічне зростання. Одночасне забезпечення всіх цілей для України являє собою завдання з прихованими протиріччями через обмеженість ресурсів для їх розв'язання. Як зазначають вітчизняні дослідники, саме бідність, зокрема серед зайнятого населення, створює основну загрозу соціальній стабільності та соціальній безпеці країни [1].

Незважаючи на те що за показником Індексу людського розвитку Україна посідає 88-е місце зі 189 країн світу і поки що утримується у групі країн «із високим розвитком», рівень доходів населення в Україні є незадовільним. Це обмежує досягнення вищих кількісного рівня та якості життя населення. У структурі доходів населення до третини становлять соціальні трансферти, що найбільшою мірою залежать від існуючої у державі системи соціальних стандартів, яка впливає на рівень соціальної стабільності.

Макроекономічна нестабільність обмежує заходи щодо досягнення соціальної стабільності. Видатки зведеного бюджету України у 2020 р. перевищили доходи на 218 млрд грн, причому видатки на соціальний захист та соціальне забезпечення становили 21,7%. На покриття дефіциту пенсійного фонду як одного з головних елементів соціального захисту населення у 2020 р. було витрачено з державного бюджету 34,4 млрд грн. Державний борг на кінець 2020 р. становив 2 259,23 млн грн. Отже, макроекономічна ситуація така, що додаткові витрати на убезпечення соціальної системи не можуть здійснюватися одночасно, у повному обсязі та швидкими темпами. Тому необхідність розроблення науково-методичного підґрунтя для оцінки взаємного впливу чинників соціальної та макроекономічної стабільності, а також можливих інструментів їх досягнення є актуальним питанням. Найбільш доцільним шляхом є застосування засобів математичного моделювання для оцінки можливих наслідків у розрізі показників макроекономічної стабільності із включенням зворотних зв'язків позитивного впливу на економічне зростання.

Основою соціальної політики є система соціальних стандартів, зміни у якій відбуваються під впливом двох протилежних тенденцій: актуалізації

відповідно до вимог сучасності та відповідності можливостям їх забезпечити. Остання тенденція превалює, через що зміни у стандартах стосовно споживчого кошику відбуваються у бік його здешевлення, а не зміни структури на користь більш здорового життя, підвищення якості життя для різних категорій населення [2; 3].

Вплив соціальної стабільності на макроекономічні процеси не був предметом ретельного цілеспрямованого розгляду ні українських, ні зарубіжних учених. Основна увага досліджень концентрується, навпаки, на впливі економічного розвитку на показники рівня та якості життя і можливості забезпечення певних соціальних стандартів. Водночас показники рівня та якості життя явно чи опосередковано відбивають рівень розвитку економіки, стабільність макроекономічних процесів у країні та ефективність державної економічної і соціальної політики, соціальну стабільність суспільства. Тому метою дослідження було розробити інструмент та здійснити оцінку взаємного впливу чинників соціальної стабільності та основних параметрів системи соціального захисту і чинників макроекономічної стабільності.

Розділ 1. Методичний підхід до виявлення ризиків макроекономічної і соціальної стабільності

В основу розроблення було покладено гіпотези про взаємний вплив соціальної та макроекономічної стабільності в Україні:

- упровадження нових стандартів життя як елемента соціальної політики впливає на макроекономічні процеси в країні у декількох напрямках, створюючи ризики для макроекономічної стабільності, з одного боку, але з іншого – розширює можливості споживання населення;

- збільшення вартісних параметрів соціальної політики, спрямоване на подолання бідності та нерівності, створює додатковий тиск на фонди соціального забезпечення, бюджети різних рівнів і ризик збільшення безробіття;

- підвищення соціальних стандартів розширює можливості населення до споживання товарів та послуг, що може спонукати до підвищення ділової активності вітчизняних виробників, але в умовах загальмованого економічного розвитку та відсутності інвестицій може призвести до розширення імпорту, останнє погіршує платіжний баланс країни та рівень її боргової безпеки;

- негативним наслідком змін у соціальній політиці можна запобігти, використовуючи поетапний принцип їх упровадження з одночасним стимулюванням розвитку вітчизняного реального сектору.

Основною причиною заниження соціальних стандартів, повільної їх модернізації й актуалізації є ризики, які можуть виникнути за невідповідності соціальних стандартів рівню та темпу розвитку економіки. Тому головну увагу було приділено виявленню та оцінці

макроекономічних ризиків у процесі впровадження стандартів нової якості життя, можливої реструктуризації системи соціального захисту.

Запропонований методичний підхід до оцінки взаємодії соціальної та макроекономічної стабільності включає два етапи. На першому етапі здійснюється аналіз за декількома напрямками:

- аналіз законодавства та нормативно-правового поля соціальної політики, а саме встановлення, зміни, використання та впровадження соціальних стандартів в Україні. Результатом цього блоку аналізу є виявлення зв'язку між соціальними стандартами та похідними від них витратами держави на соціальне забезпечення населення [2; 3];

- порівняльний аналіз динаміки соціальних стандартів, похідних показників соціального забезпечення та макроекономічних показників. Призначенням цього блоку є виявлення кореляційних зв'язків між двома групами показників, можливих лагових ефектів, відповідності темпів зміни соціальних стандартів та показників соціального забезпечення темпам економічного розвитку (у т. ч. у періоди економічних криз);

- аналіз теоретичних засад взаємодії соціальної та макроекономічної стабільності призначений для виявлення потенційних ризиків зміни соціальної політики, обґрунтування можливих попереджувальних механізмів [4].

Перший, аналітичний, етап методичного підходу завершується побудовою когнітивної карти макроекономічних ризиків переходу до нових соціальних стандартів, яка буде основою загальної моделі. Етап моделювання включає два кроки: власне побудову моделі та її застосування для розроблення і перевірки різних сценаріїв переходу до стандартів нової якості життя.

Останнім кроком методичного підходу є розроблення і перевірка різних сценаріїв удосконалення соціальної політики, призначенням якого є виявлення можливих негативних наслідків різних варіантів, а також визначення доцільних напрямів їх попередження та формування запобіжних механізмів. Для формування пропозицій щодо запобіжних механізмів необхідним є аналіз світової практики функціонування систем соціального забезпечення, що дасть змогу виявити доцільні для України заходи щодо впровадження стандартів та модернізації системи соціального захисту.

У рамках даного дослідження реалізовано побудову когнітивної карти взаємодії параметрів і чинників соціальної та макроекономічної стабільності.

Розділ 2. Аналіз взаємозалежностей у системі соціальних стандартів

Відповідно до розробленого методичного підходу, на етапі аналізу здійснюється порівняльний аналіз динаміки основних показників соціальних стандартів, а саме: встановлений (ПМ) та фактичний

прожитковий мінімум (ФПМ) для працездатних осіб та тих, які втратили працездатність; мінімальна заробітна плата; мінімальна пенсія; середня заробітна плата; середня пенсія.

Аналіз здійснювався за період 2010–2020 рр. за даними Держкомстату України [5], що визначалося такими вимогами: період має бути достатнім для виявлення наявних тенденцій, має включати як періоди стабільності, так і макроекономічної нестабільності, має включати моменти зміни соціальних стандартів. Зважаючи на те, що протягом тривалого часу у структурі соціальних стандартів змін не відбувалося за винятком щорічної переоцінки, а також на структурні зрушення в економіці країни у 2014 р., період аналізу було обмежено 2010–2020 рр. Період світової фінансової кризи (2008–2009 рр.) здебільшого не включався до розгляду, оскільки він не супроводжувався змінами у системі соціального забезпечення.

Для попереднього аналізу було вибрано річну періодичність, зважаючи на те, що окремі показники соціально-економічної стабільності доступні лише за такої періодичності (рівень бідності, рівень розшарування, кількість пенсіонерів за категоріями тощо). Для більш докладного аналізу використовувалися квартальні або щомісячні дані, зважаючи на те, що вартісні показники соціальних стандартів змінюються декілька разів протягом року, але їхній вплив може бути відкладеним на деякий час. Оскільки соціальні стандарти в Україні (на відміну від деяких інших країн) установлюються на національному рівні та є однаковими для всіх регіонів, то аналіз здійснювався лише на національному рівні.

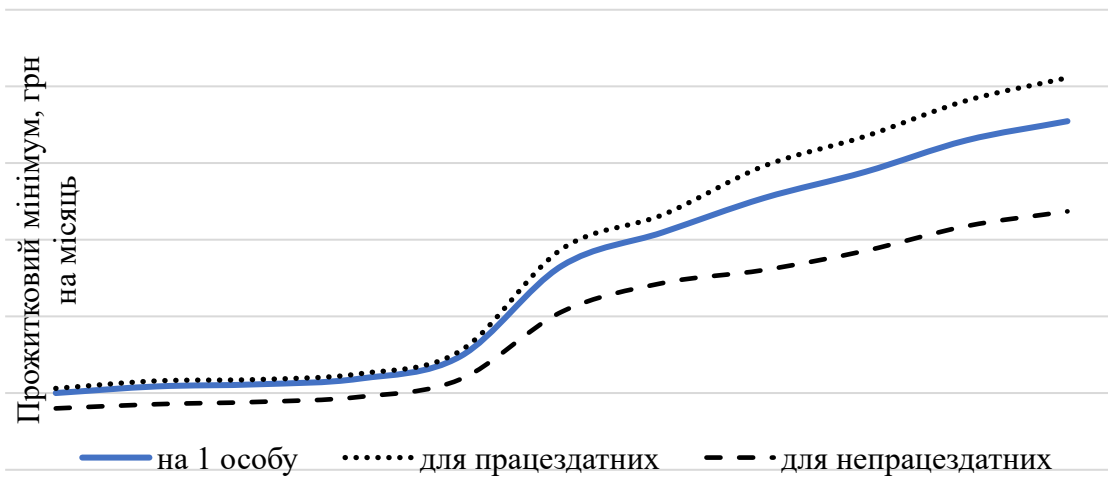
Динаміка показників розглядалася у грошовому вимірі – для виявлення узгодженості тенденцій та кореляцій та у вигляді темпів зміни – для виявлення відповідності та розривів між соціальним та економічним розвитком.

Динаміка встановленого та фактичного прожиткового мінімуму в Україні за досліджуваний період демонструє тенденцію до неперервного зростання. При цьому зростання встановленого прожиткового мінімуму (ПМ) має поступовий характер без стрибків та прискорення, які притаманні фактичному прожитковому мінімуму (ФПМ) (рис. 1а). Спостерігається помітне збільшення різниці між фактичним прожитковим мінімумом для працездатних та непрацездатних категорій населення (рис. 1б).

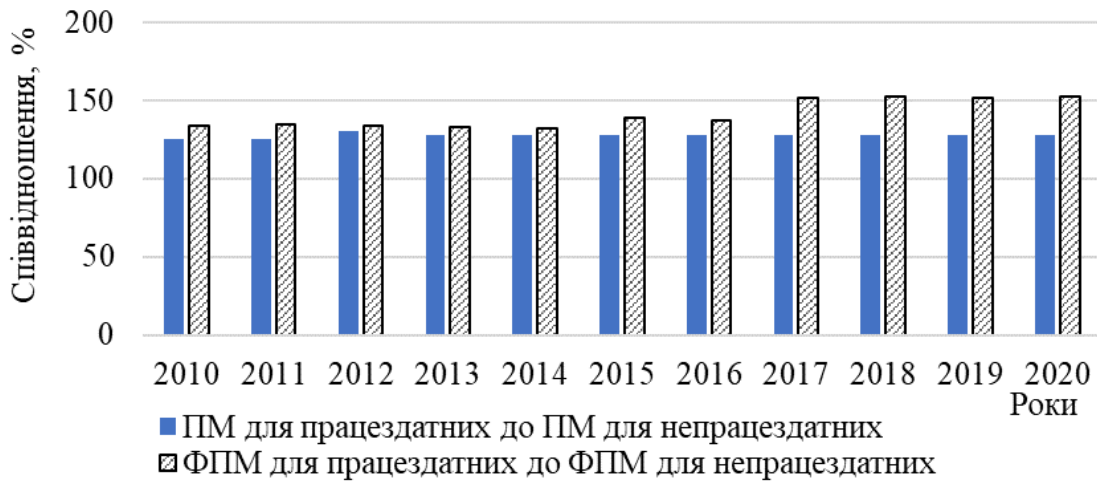
Починаючи з 2017 р. фактичний прожитковий мінімум для працездатних осіб у 1,5 рази перевищує цей показник для непрацездатних, тоді як у 2010–2014 рр. це співвідношення становило 1,3 рази, а в 2015–2016 рр. – 1,4 рази.

У 2015 р. відбулося різке збільшення розриву між установленим та фактичним мінімумами як для працездатного, так і для непрацездатного населення. У розрахунку на одну особу встановлений прожитковий мінімум становить від 45,3% до 51,1% від фактичного у період

2015–2020 рр., натомість у 2010–2014 рр. цей показник знаходився у межах від 84,5% до 96,4% (рис. 2).



а)



б)

Рис. 1. Динаміка фактичного прожиткового мінімуму (а) та його співвідношення до встановленого мінімуму (б) за категоріями населення

Джерело: авторська розробка за даними [5]

Окрім того, у 2015 р. темпи зростання фактичного прожиткового мінімуму продемонстрували рекордні значення і становили 181,1% та 171,3% відповідно для працевздатних та непрацевздатних осіб, однак темпи зміни встановленого законодавчо прожиткового мінімуму виявилися навіть дещо нижчими, ніж у попередній період (рис. 3).

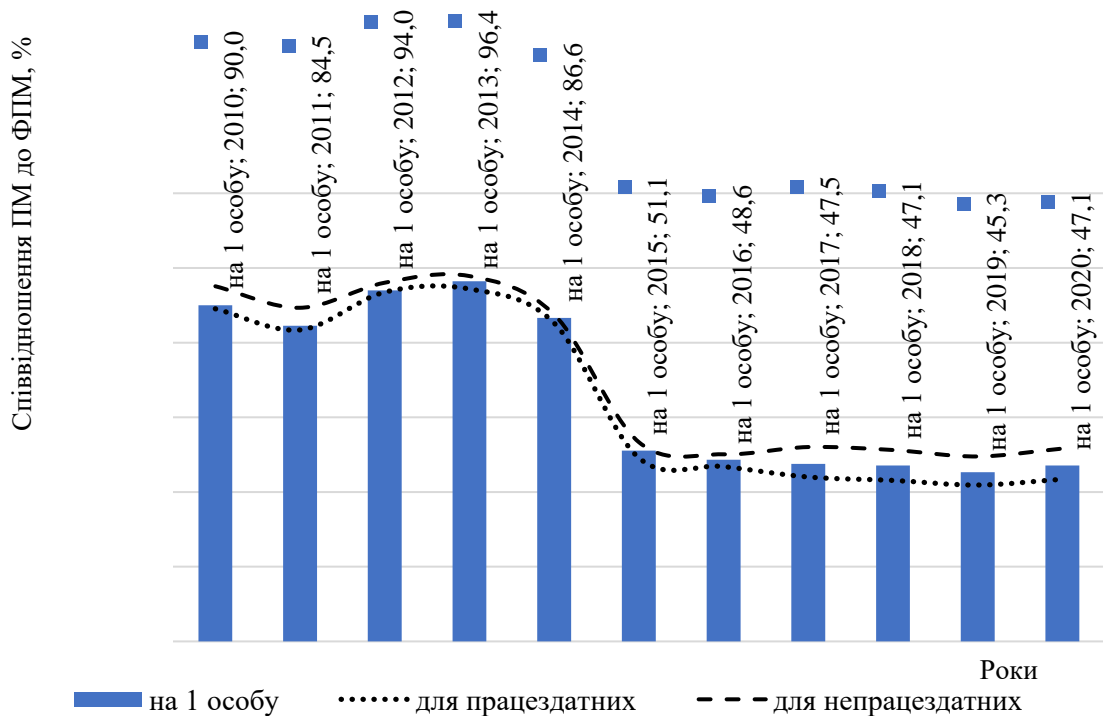


Рис. 2. Динаміка співвідношень установлених прожиткових мінімумів до фактичних за категоріями населення

Джерело: авторська розробка за [5]

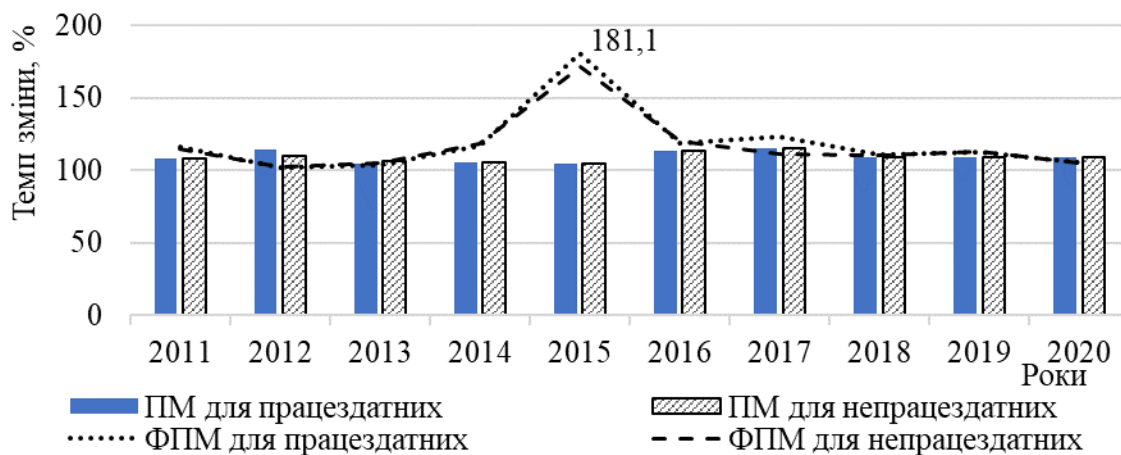


Рис. 3. Темпи зміни встановленого прожиткового мінімуму та фактичного прожиткового мінімуму за категоріями населення

Джерело: авторська розробка за даними [5]

Стрибок у темпах зміни фактичного прожиткового мінімуму відбувся через девальвацію гривні у 2015 р. та зростання споживчих цін на 48,7% порівняно з 2014 р. [5].

У 2016 р. мінімальна заробітна плата (МЗП) становила 24,7% від розміру середньої заробітної плати (СЗП) у країні, і це є найменшим значенням цього відносного показника за весь досліджуваний період, хоча амплітуда його коливань не виходила за межі інтервалу від 26,3% у 2015 р. до 36,5% у 2017 р. (рис. 4).

Рекордно низькими у 2015–2016 рр. були значення мінімальної заробітної плати порівняно з фактичним прожитковим мінімумом. Більше ніж удвічі фактичний прожитковий мінімум перевищував розмір установленої мінімальної заробітної плати. Із 2017 р. у зв'язку з прийняттям відповідних рішень на законодавчому рівні відбулося підвищення мінімальної заробітної плати, і вона сягнула 80,8% фактичного прожиткового мінімуму.

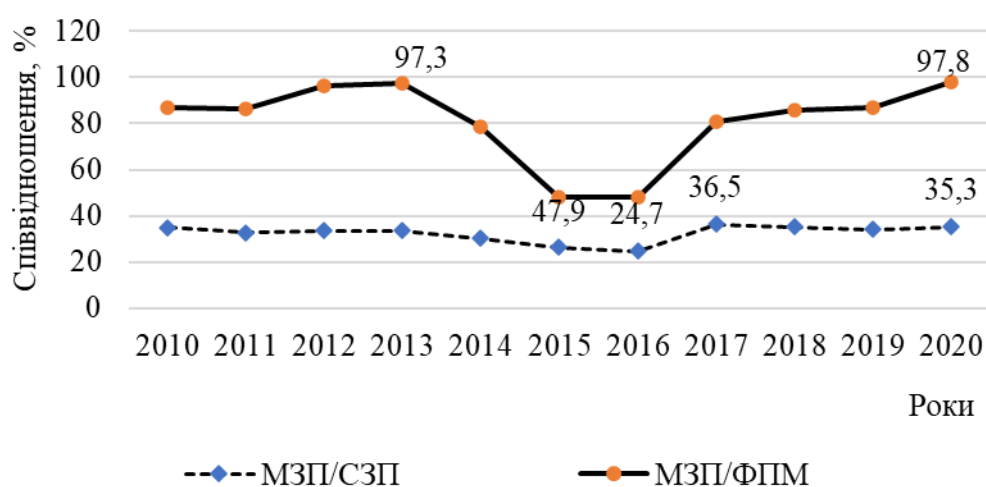


Рис. 4. Співвідношення мінімальної заробітної плати до фактичного соціального стандарту (МЗП/ФПМ) та середньої заробітної плати (МЗП/СЗП)

Джерело: авторська розробка за даними [5]

За розміром мінімальна пенсія в Україні в 2020 р. становила 32,8% від розміру мінімальної заробітної плати, і це є найнижчим значенням за весь досліджуваний період. Стрімке збільшення розриву між двома соціальними стандартами відбулося у 2017 р., коли після підвищення лише мінімальної заробітної плати величина мінімальної пенсії становила 39,0%, тоді як у 2016 р. мінімальна пенсія становила 67,1% від мінімальної заробітної плати (рис. 5).

Різниця між величиною мінімальної пенсії та фактичного прожиткового мінімуму для непрацевдатних стрімко зростала протягом 2014–2016 рр. Так, якщо у 2013 р. розмір мінімальної пенсії становив 97,3% від фактичного прожиткового мінімуму, то в 2016 р. – лише 48,0%.

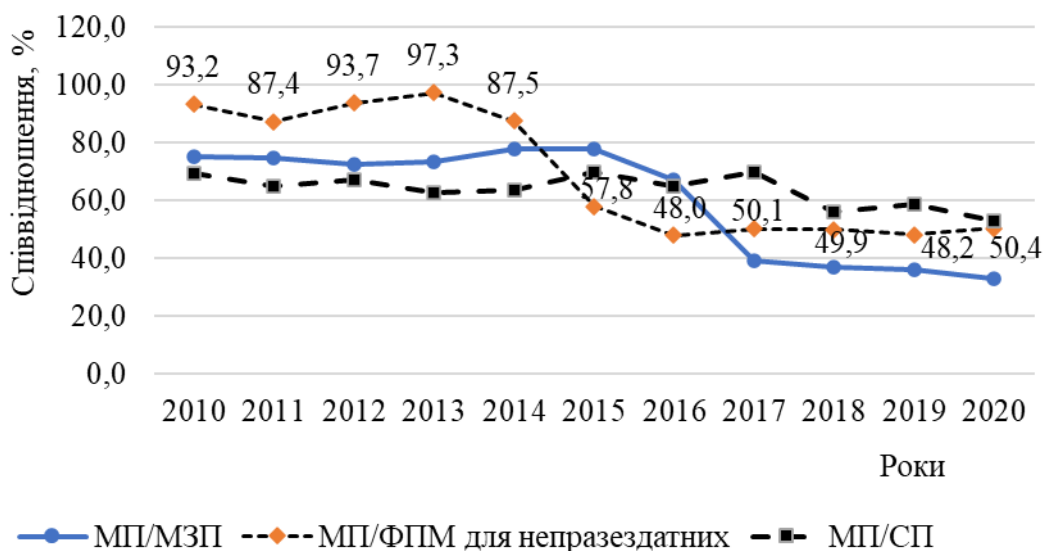


Рис. 5. Співвідношення мінімальної пенсії до фактичного соціального стандарту (МП/ФПМ), мінімальної заробітної плати (МП/МЗП) та середньої нарахованої пенсії (МП/СП)

Джерело: авторська розробка за даними [5]

Щодо співвідношення розмірів мінімальної та середньої нарахованої пенсій, то його амплітуда коливань була порівняно незначною. Із 2018 р. можна говорити про появу тенденції до повільного збільшення розриву у величині цих показників. У 2020 р. мінімальна пенсія була вже вдвічі меншою за середню нараховану.

Водночас середня нарахована пенсія порівняно із середньою заробітною платою поступово зменшувалася протягом усього періоду 2010–2020 рр.. На початок 2010 р. середня нарахована пенсія становила за розміром 52,1% від розміру середньої заробітної плати, а в 2020 р. – 28,7%. Протягом 2010–2016 рр. середня пенсія перевищувала мінімальну заробітну плату, і ця різниця становила від 3,5% у 2016 р. до 22,1% у 2014 р. Однак уже в 2017 р. порівняний розмір середньої пенсії зменшився і становив 55,8% від розміру мінімальної заробітної плати, після чого відбулося незначне скорочення розриву.

Темпи зміни реального валового внутрішнього продукту та номінальної мінімальної пенсії є достатньо близькими протягом дослідженого періоду, чого не можна сказати про номінальну мінімальну заробітну плату. Значне її зростання відбувалося у 2010 р. (на 23,9%) та 2020 р. (на 19,8%), а в 2017 р. відбулося її збільшення вдвічі. Однак зростання реального валового внутрішнього продукту в тому ж 2017 р. становило лише 2,5%, що говорить про відсутність реального втілення заробітної плати у структурі ВВП.

У динаміці зміни середньої номінальної заробітної плати можна виділити три періоди: 2010–2014 рр. – уповільнення зростання; 2015–2017 рр. – стрімке прискорення зростання з максимальним темпом у 2017 р. порівняно з 2016 р.; 2018–2020 рр. – стрімке уповільнення зростання (рис. 6).

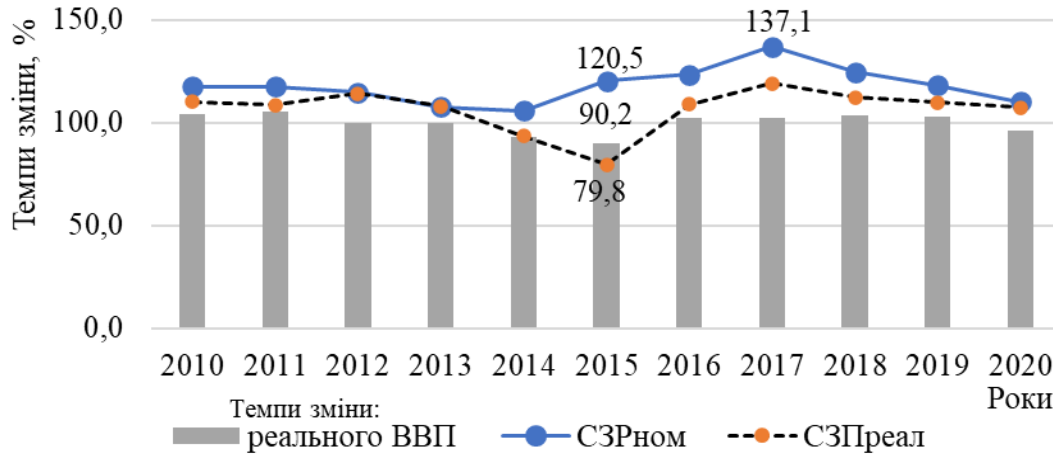


Рис. 6. Співвідношення темпів зміни реального ВВП, номінальної (СЗРном) та реальної (СЗПреал) середньої заробітної плати

Джерело: авторська розробка за даними [5]

Темпи зміни величини середньої реальної заробітної плати певним чином повторюють тенденції середньої номінальної заробітної плати, однак уже в 2014 р. відбувається скорочення середньої реальної заробітної плати на 6,5%, а в 2015 р. скорочення сягає 20,2% порівняно з 2014 р., тоді як середня номінальна заробітна плата зростає у 2015 р. на 20,5%. Окрім того, у 2015 р. має місце найбільше скорочення реального валового внутрішнього продукту (на 9,8%). Отже, зростання номінальної заробітної плати виявляється тісно пов'язаним не з економічним розвитком, а лише з інфляційними процесами, які прискорюються також і завдяки номінальному зростанню трудових доходів населення.

Деяко схожими були тенденції і темпів зміни пенсії. Індекс реальної пенсії за віком зменшується протягом 2014–2016 рр. до 75,0% у 2016 р., тоді як темп зростання номінальної пенсії зменшується лише у 2014 р., однак навіть тоді перевищує 100%. Найвищі темпи зростання зазначених показників мали місце в 2018 р. і становили відповідно 124,3% та 137,7%.

Максимальні темпи зростання фактичного прожиткового мінімуму для працездатного та непрацездатного населення були в 2015 р., коли сягнули відповідно значень 185,4% та 174,4%. При цьому темп зростання встановленого прожиткового мінімуму в 2015 р. становив 113,1%. Найбільший розрив між розмірами мінімальної заробітної плати і фактичним прожитковим мінімумом спостерігався із середини 2015 р. до кінця 2016 р. (56–60%), після чого відбулося його стрімке скорочення.

Разом із тим розрив між мінімальною та середньою заробітною платою залишався без суттєвих коливань, хоча і набував дещо менших значень від початку 2017 р.

Розміри встановленого прожиткового мінімуму порівняно з фактичним стрімко зменшилися у середині 2015 р. до 46,2%, після чого коливання величини цього співвідношення були незначними. Співвідношення встановленого та фактичного прожиткового мінімуму для непрацездатних набуло більших значень, аніж для працездатних, із 2017 р. Так, для категорії непрацездатних установлений прожитковий мінімум становить близько 50,0% від фактичного, а для категорії працездатних – близько 40,0%.

Попри всі розбіжності та розриви між основними параметрами системи соціального забезпечення існують тісні кореляційні зв'язки, які показано в табл. 1. Показовим є той факт, що найменшим, хоча також дуже тісним, є зв'язок між середньою пенсією та фактичним прожитковим мінімумом для непрацездатної особи, що опосередковано підтверджує думку про зниження соціальних стандартів.

Таблиця 1

Коефіцієнти кореляції між соціальними стандартами

Показники	Прожитковий мінімум (встановлений)			Фактичний прожитковий мінімум			Заробітна плата		Пенсія	
	на 1 особу	для працездатної особи	для непрацездатної особи	на 1 особу	для працездатної особи	для непрацездатної особи	мінімальна	середня	мінімальна	середня
	ПМ1	ПМпр	ПМнп	ФПМ1	ФПМпр	ФПМнп	МЗП	СЗП	МП	СП
ПМ1	1,00			0,98	0,98	0,97	0,96	0,98	0,99	0,97
ПМпр				0,98	0,98	0,97	0,96	0,98	0,99	0,97
ПМнп				0,98	0,98	0,97	0,96	0,99	0,99	0,97
ФПМ1	0,98	0,98	0,98	1,00	1,00	1,00	0,92	0,95	0,97	0,92
ФПМпр	0,98	0,98	0,98	1,00	1,00	1,00	0,93	0,96	0,97	0,92
ФПМнп	0,97	0,97	0,97	1,00	1,00	1,00	0,91	0,94	0,96	0,91
МЗП	0,96	0,96	0,96	0,92	0,93	0,91	1,00	0,99	0,96	0,96
СЗП	0,98	0,98	0,99	0,95	0,96	0,94	0,99	1,00	0,98	0,98
МП	0,99	0,99	0,99	0,97	0,97	0,96	0,96	0,98	1,00	0,98
СП	0,97	0,97	0,97	0,92	0,92	0,91	0,96	0,98	0,98	1,00

Джерело: авторські розрахунки

Додатні коефіцієнти кореляції визначають однозначний вплив соціальних стандартів на показники загальних доходів населення (середні заробітна плата і пенсія) у когнітивній карті.

Проведений аналіз підтверджує наявність суттєвого розриву між параметрами соціальної політики і темпами їх зміни та фактичною вартістю і динамікою ВВП, що дає змогу дійти висновку про неузгодженість соціальної та макроекономічної політики, оскільки остання не забезпечує фактичну реалізацію першої.

Розділ 3. Когнітивна карта взаємодії загроз соціальній і макроекономічній стабільності

Для побудови когнітивної карти взаємного впливу макроекономічних процесів та функціонування соціальної системи здійснено порівняльний аналіз динаміки згаданих вище показників соціальної політики та показників макроекономічної стабільності, які є найбільш узагальнюючими та використовуються у міжнародній практиці: рівень зайнятості та безробіття, індекс реальної заробітної плати, індекс реального ВВП, індекс споживчих цін, дефіцит державного бюджету [6]. Окрім того, як результуючі показники ефективності економічної і соціальної політик до розгляду включено також показники бідності та нерівності.

Виміром рівня зайнятості було вибрано зайняте населення у віці 15–70 років, у середньому за період у відсотках до усього населення відповідного віку як найбільш загальну характеристику. Рівень безробіття характеризувався відсотком безробітного населення у тій самій віковій групі.

За неперервного стрімкого зростання розміру фактичного прожиткового мінімуму (з 2015 р.) та мінімальної заробітної плати (з 2017 р.) спостерігається тенденція до скорочення рівня зайнятості, яка стала особливо виразною у 2019–2020 рр. (рис. 7). У 2020 р. рівень зайнятості набув найменшого значення – 49,9% – за весь досліджуваний період 2010–2020 рр., а рівень безробіття досяг найбільшого значення – 9,5%. 2020 р. не є повністю показовим із погляду зайнятості, оскільки ринок праці відчував значний тиск, спричинений пандемією та відповідними карантинними заходами, але така ситуація тією чи іншою мірою спостерігалася в усьому світі.

Водночас слід відзначити, що взаємозалежність між зайнятістю та безробіттям не є однозначною. Так, коефіцієнт кореляції між цими показниками ринку праці за період 2010–2020 рр. у річному розрізі дорівнює -0,57, а у квартальному -0,97. Отже, сезонні чинники справляють більший вплив на динаміку зайнятості, ніж на економічний розвиток країни у цілому.

Зайнятість та безробіття є одночасно і показниками інтенсивності економічного розвитку, і показниками якості життя та причинами таких негативних явищ, як бідність та нерівність. Бідність населення

вимірюється по-різному. Існуючі підходи, по-перше, розрізняються за змістом (абсолютна та відносна бідність) та за базою порівняння (50–70% медіани, середнього, фактичний чи встановлений прожитковий мінімум) [5]. Характеристикою бідності населення було вибрано найбільш загальний показник – відсоток населення, чії доходи менше фактичного прожиткового мінімуму. Оцінки бідності, визначені Держстатом України, порівняно з даними міжнародних організації є дещо заниженими, тому для аналізу були використані дані UNICEF щодо бідності населення, які відображують частку населення, загальні доходи якого нижче фактичного прожиткового мінімуму [7].

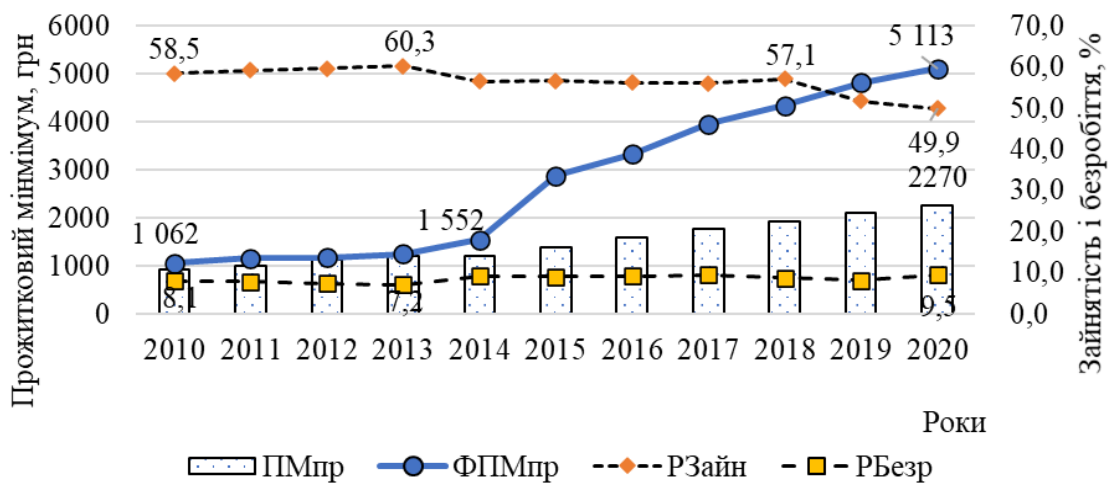


Рис. 7. Співвідношення рівнів зайнятості (РЗайн) та безробіття (РБезр) і встановленого (PMпр) і фактичного (FPMпр) прожиткових мінімумів

Джерело: авторська розробка за даними [5]

Статистична інформація щодо нерівності доходів населення в Україні включає децильний (або квінтільний) коефіцієнт диференціації загальних (або грошових) доходів населення, індекс Джині (коефіцієнт концентрації), який також може вимірюватися за грошовими чи загальними еквівалентними доходами населення [5]. Індекс Джині є визнаним показником нерівності у світовій практиці, його перевага у тому, що він вимірює нерівність по всьому діапазону доходів, тому саме його було вибрано для аналізу впливу соціальних стандартів на нерівність. Для отримання більш точних результатів період аналізу було розширено – з 2005 по 2020 р.

Результати крос-кореляційного аналізу показали, що динаміка рівня бідності випереджає ступінь нерівності за загальними еквівалентними середньодушовими доходами населення на чотири роки (коефіцієнт кореляції дорівнює 0,67).

Водночас результати крос-кореляційного аналізу зв'язку рівнів бідності та нерівності з показниками зайнятості та безробіття є посередніми. Єдиним тісним є зв'язок між рівнем безробіття та рівнем бідності (табл. 2). Решта зв'язків може характеризуватися як слабкий негативний. Характерною особливістю є наявність лагової залежності, що свідчить про інерційність процесів перерозподілу доходів населення.

Таблиця 2

Коефіцієнти кореляції між показниками зайнятості, бідності та нерівності з урахуванням лагових ефектів

Показники	Зайнятість – бідність	Зайнятість – нерівність	Безробіття – бідність	Безробіття – нерівність
Лаг	1	4	1	0
Коефіцієнти кореляції	-0,62	-0,65	0,71	-0,58

Примітка. Лаг означає кількість років, на які показники зайнятості та безробіття випереджають показники бідності та нерівності.

Джерело: авторські розрахунки

Мінімальна заробітна плата у світі є інструментом подолання бідності працюючого населення, тому її збільшення (зменшення) має відбиватися на динаміці бідності. Результати крос-кореляційного аналізу показали, що у соціально-економічній системі України цей зв'язок є доволі слабким. Середньорічний темп зростання номінальної мінімальної заробітної плати корелює з темпом зменшення бідності (вимірюваним у відсоткових пунктах) без лагу з коефіцієнтом -0,43. Відтермінованих або пролонгованих ефектів не спостерігається.

Тісний кореляційний зв'язок природним чином існує між індексом реальної заробітної плати та індексом споживчих цін, коефіцієнт кореляції, розрахований у річному розрізі, становить -0,85. Темпи зростання номінальної та реальної заробітної плати також пов'язані кореляційним зв'язком із лагом в один рік: зростання номінальної заробітної плати випереджає зростання реальної заробітної плати (коефіцієнт кореляції становить 0,73).

Індекс реальної пенсії за віком корелює з темпом зростання номінальної пенсії без лагу (0,71), відстає від темпу зростання номінальної заробітної плати на кінець року на три роки (0,77), а від реальної заробітної плати – на один рік (0,88), так само, як і від індексу споживчих цін (-0,74).

Випереджаюче зростання номінальної заробітної плати та пенсій може створювати ризик пришвидшення інфляції (збільшення індексу споживчих цін, ІСЦ). Але результати крос-кореляційного аналізу не дали змоги виявити тісний зв'язок. Так, спостерігається відставання ІСЦ від темпу зростання номінальної заробітної плати на один рік із кореляцією

0,53. Що ж стосується впливу номінальної середньої пенсії, то її вплив є незначним і незначущим.

Падіння зайнятості одночасно зі збільшенням середньої заробітної плати корелює з погіршенням дефіциту державного бюджету протягом 2010–2013 рр. до 4,6% ВВП. Стабілізація дефіциту в 2015–2018 рр. супроводжувалася значним погіршенням показників забезпечення соціальної стабільності, а саме співвідношень між прожитковими мінімумами та трудовими доходами. Але водночас погіршилися й показники державного боргу, який у 2016 р. сягнув 81% ВВП. Це ще раз підтверджує наявність дилеми між двома напрямками стабільності.

Особливістю розповсюдження ризиків на макроекономічні процеси в Україні є слабкий зв'язок процесів зайнятості з макроекономічною динамікою. Суттєвим чинником цього є високий рівень тінзації економіки [8]. Так, кореляція між рівнем тінзації (у % ВВП за методом витрат населення) та рівнем зайнятості становить 0,72, а з рівнем безробіття – 0,77 із лагом у три роки (збільшення безробіття сприяє розширенню тіншового сектору, але, своєю чергою, сприяє зменшенню диференціації (коефіцієнт кореляції –0,5)).

Узагальнення результатів проведеного порівняльного аналізу дало змогу запропонувати когнітивну карту ризиків для складників двох видів стабільності (рис. 8). Представлена когнітивна карта може стати основою для побудови імітаційної моделі взаємного впливу соціальної та макроекономічної стабільності.

Висновки

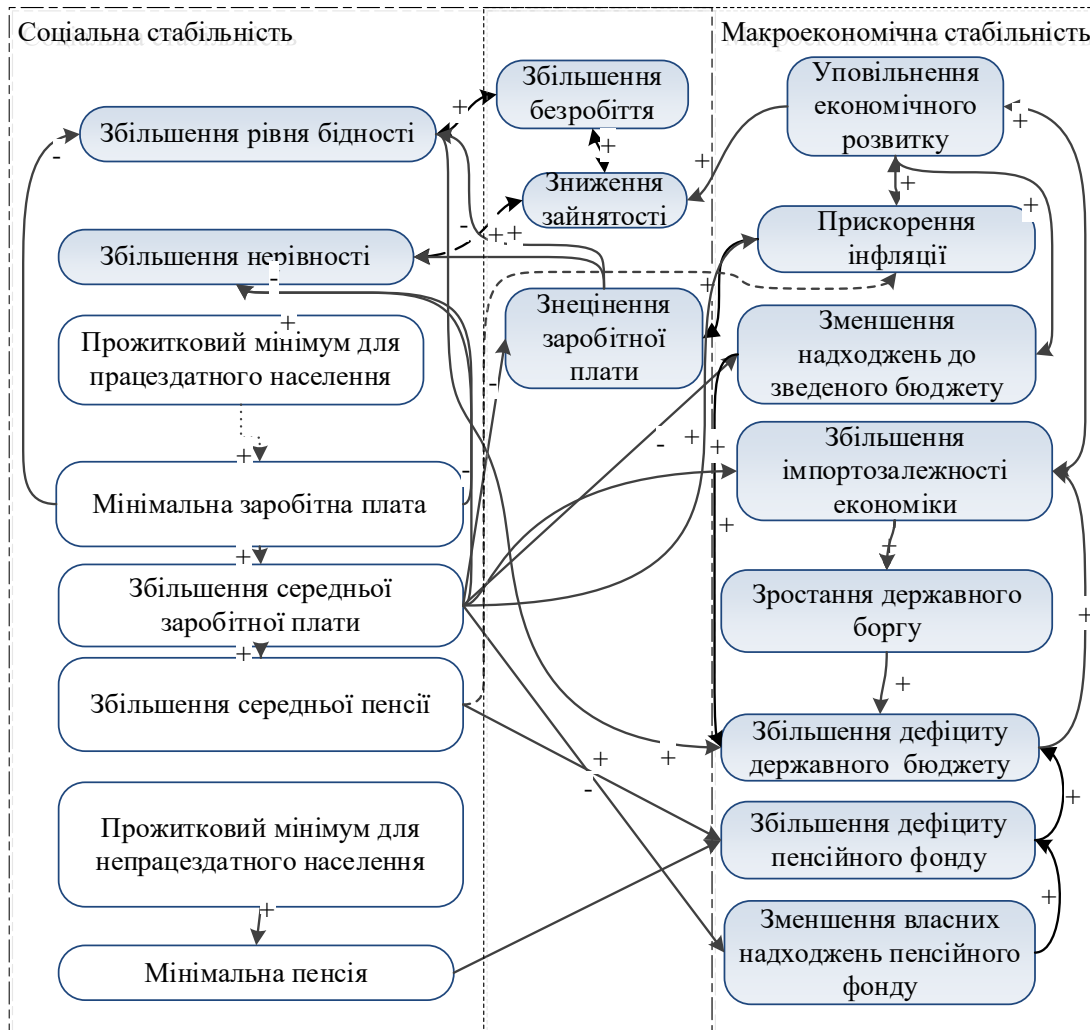
Забезпечення соціальної та макроекономічної стабільності набуває особливої важливості в умовах кризи, але породжує протиріччя через обмеженість ресурсів економіки. Криза, спровокована пандемією, призвела до необхідності здійснення масштабних заходів соціальної політики, що водночас посилює негативні макроекономічні тенденції.

Проведений порівняльний аналіз показав наявність суттєвого розриву між законодавчо встановленими параметрами соціальної політики та їх фактичною реалізацією, що призводить до погіршення таких показників соціальної стабільності, як рівень бідності та нерівності. Окрім того, темпи зростання цих параметрів суттєво випереджають темпи зростання економіки, що погіршує показники макроекономічної стабільності.

Особливістю взаємодії соціальної та макроекономічної стабільності в Україні є низька залежність обох від процесів зайнятості, що значним чином пояснюється великим обсягом тіншового сектору економіки, а також намаганням роботодавців штучно занижувати розміри заробітної плати.

Побудована когнітивна карта дає змогу зауважити, що підвищення соціальних стандартів для соціальної стабілізації має як позитивні наслідки, так і може спровокувати посилення ризиків для макро-

економічної стабільності. Окрім того, окремі макроекономічні ризики підсилюють один одного.



Примітка. Пунктиром показані слабкі зв'язки, +/- означає тип зв'язку.

Рис. 8. Когнітивна карта взаємозв'язків загроз макроекономічній та соціальній стабільності

Джерело: авторська розробка

Виявлені контури впливу дають визначити можливості уникнення та попередження ризиків та вибору найбільш прийнятних шляхів забезпечення соціальної і макроекономічної стабільності. Існують засоби компенсації зростання ризиків, основними з яких є зростання середньої заробітної плати більш швидкими темпами, ніж мінімальної, та прискорення економічного розвитку. Останнє є необхідною умовою забезпечення економіки країни, підвищення рівня зайнятості та зменшення бідності. Окрім того, для забезпечення соціальної системи та підвищення макроекономічної стабільності необхідним є суттєве зниження рівня тінізації економіки.

Список використаних джерел:

1. Сидорчук О.Г. Соціальна безпека: державне регулювання та організаційно-економічне забезпечення : монографія. Львів : ЛРІДУ НАДУ, 2018. 492 с.
2. Леванда О.М. Порівняльний аналіз підходів до стандартів життя: Україна і Польща. *Проблеми економіки*. 2019. № 2. С. 15–24.
3. Леванда О.М., Шликова В.О. Роль соціальних стандартів у соціальній політиці країни. *Бізнес Інформ*. 2020. № 11. С. 146–151.
4. Михайленко Д.Г. Визначення факторів формування соціальних стандартів нової якості життя населення регіонів України. *Професійний менеджмент в сучасних умовах розвитку ринку* : матеріали доповідей X науково-практичної конференції з міжнародною участю, 1 листопада 2021 р. Харків : Видавництво Іванченка І.С., 2021. С. 311–313.
5. Офіційний сайт Державної служби статистики України. URL: <http://www.ukrstat.gov.ua> (дата звернення: 03.12.2021).
6. The Macroeconomic Imbalance Procedure. European Commission. Institutional paper 039. November 2016. URL: https://ec.europa.eu/eurostat/documents/16624/0/ip039_en_2.pdf (дата звернення: 07.12.2021).
7. UNISEF Ukraine. URL: <https://www.unicef.org/ukraine> (дата звернення: 03.11.2021).
8. Загальні тенденції тіньової економіки (січень-червень 2021 р.) / Міністерство економіки України. Департамент стратегічного планування та макроекономічного прогнозування. URL: <https://www.me.gov.ua/Documents/Download?id=78b79266-3a86-4be0-a528-ef8bb1551809> (дата звернення: 22.12.2021).

References:

1. Sydoruk O.H. (2018) Sotsialna bezpeka: derzhavne rehuliuвання ta orhanizatsiino-ekonomichne zabezpechennia [Social security: state regulation and organizational and economic support]: monohrafiia. Lviv: LRIDU NADU. (in Ukrainian)
2. Levanda O.M. (2019) Porivnialnyi analiz pidkhodiv do standartiv zhyttia: Ukraina i Polshcha [Comparative Analysis of the Approaches to Living Standards: Ukraine and Poland]. *Problemy ekonomiky*, no. 2, pp. 15–24. (in Ukrainian)
3. Levanda O.M., Shlykova V.O. (2020) Rol sotsialnykh standartiv u sotsialnii politytsi krainy [The Role of Social Standards in Social Policy of the Country]. *Biznes Inform*, no. 11, pp. 146–151. (in Ukrainian)
4. Mykhailenko D.H. (2021) Vyznachennia faktoriv formuvannia sotsialnykh standartiv novoi yakosti zhyttia naseleennia rehioniv Ukrainy [Determining the factors of formation of social standards of the new quality of life of the population of the regions of Ukraine]. *Profesiinyi menedzhment v suchasnykh umovakh rozvytku rynku: Materialy dopovidei X naukovo-praktychnoi konferentsii z mizhnarodnoiu uchastiu*, 1 lystopada 2021 r. Kh.: Vydavnytstvo Ivanchenka I., pp. 311–313. (in Ukrainian)
5. Ofitsiinyi sait derzhavnoi sluzhby statystyky Ukrainy [Official site of the State Statistics Service of Ukraine]. Available at: <http://www.ukrstat.gov.ua> (accessed 03 December 2021). (in Ukrainian)
6. The Macroeconomic Imbalance Procedure. European Commission. Institutional paper 039. November 2016. Available at: <https://ec.europa.eu/eurostat/documents/16624/0/ip039en2.pdf> (accessed 07 December 2021).
7. UNISEF Ukraine. Available at: <https://www.unicef.org/ukraine> (accessed 03 November 2021).
8. Zahalni tendentsii tinovoi ekonomiky (sichen-cherven 2021) [General trends in the shadow economy (January-June 2021)]. Ministerstvo ekonomiky Ukrainy. Departament stratehichnoho planuvannia ta makroekonomichnoho prohnozuvannia. Available at: <https://www.me.gov.ua/Documents/Download?id=78b79266-3a86-4be0-a528-ef8bb1551809>. (accessed 22 December 2021). (in Ukrainian)