

На правах рукописи

АРТЮШКИН ВИКТОР ФЕДОРОВИЧ

ПРОГНОЗНО-АНАЛИТИЧЕСКИЕ МЕТОДЫ
КАК ИНСТРУМЕНТ ФОРМИРОВАНИЯ
ВНЕШНЕЙ ГОСУДАРСТВЕННОЙ
ЭНЕРГЕТИЧЕСКОЙ ПОЛИТИКИ РОССИИ

Специальность 23.00.02 – политические институты, процессы и технологии
(политические науки)

АВТОРЕФЕРАТ

диссертации на соискание ученой степени
кандидата политических наук

МОСКВА

2014

Работа выполнена на кафедре политического анализа факультета государственного управления ФГОБУ ВПО «Московский государственный университет имени М.В.Ломоносова».

Научный руководитель: доктор исторических наук, профессор, директор Центра глобальных проблем Института международных исследований ФГОБУ ВПО «Московский государственный институт международных отношений (Университет) МИД России»
Сергеев Виктор Михайлович

Официальные оппоненты: доктор политических наук, кандидат экономических наук, профессор, заведующий кафедрой внешнеполитической деятельности России факультета национальной безопасности ФГОБУ ВПО «Российская академия народного хозяйства и государственной службы при Президенте Российской Федерации»
Абрамова Ольга Дмитриевна

кандидат политических наук, доцент, декан факультета социология и политология ФГОБУ ВПО «Финансовый университет при Правительстве Российской Федерации» (Финансовый университет)
Шатилов Александр Борисович

Ведущая организация: **Северо-Западный институт управления ФГОБУ ВПО «Российская академия народного хозяйства и государственной службы при Президенте Российской Федерации»**

Защита состоится «22» декабря 2014 г. в «16.20» часов на заседании Диссертационного совета Д.501.001.27 при Московском государственном университете имени М.В. Ломоносова по адресу: 119992, ГСП-2, Москва, Ломоносовский проспект, д. 27, корп. 4, учебный корпус №1, факультет государственного управления, аудитория А-619.

С диссертацией можно ознакомиться в Научной библиотеке Московского государственного университета имени М.В. Ломоносова.

Автореферат диссертации на соискание ученой степени кандидата политических наук размещен на сайте ФГУ МГУ 21 октября 2014 г.

Автореферат разослан «___» _____ 2014г.

Ученый секретарь
Диссертационного совета
кандидат политических наук, доцент



Е.В. Андрюшина

I. ОБЩАЯ ХАРАКТЕРИСТИКА РАБОТЫ

Актуальность проблемы. Одним из факторов, определяющих внешнюю государственную энергетическую политику России, является положение дел на мировых рынках углеводородов. Добыча и экспорт углеводородов — это не просто важные отрасли российской экономики. Государственный бюджет, его пополнение, а, следовательно, и состояние медицинского обслуживания, образования, науки и т.д., то есть само существование государства как эффективного политического субъекта, в случае России сильно зависит от конъюнктуры на мировых рынках углеводородов. Опасность такой зависимости давно осознана, однако не может быть быстро изменена. Для России переход к экономике иного типа, в силу целого ряда причин, оказывается процессом длительным, а, значит, проведение эффективной энергетической политики еще долгое время будет являться приоритетной государственной задачей.

Документом, интегрирующим все аспекты государственной энергетической политики, является «Энергетическая стратегия России». В действующем ныне варианте — «Энергетическая стратегия России на период до 2030 года»¹ - обозначены стратегические направления развития энергетического комплекса и сформулирована система долгосрочного отраслевого планирования. Главной целью стратегии объявлено содействие выводу страны на достойные позиции в современном мире. Комплексный характер задачи определяет необходимость целенаправленных действий как в экономической, так и в политической областях с учетом взаимосвязи мировых экономических и политических процессов.

До энергетического кризиса 70-х гг. исследованием мировых процессов в энергетике занимались в основном экономисты, что было обусловлено предметной принадлежностью возникающих задач. Однако, в связи с целым

¹ Министерство энергетики Российской Федерации. [Электронный ресурс]. Режим доступа: <http://minenergo.gov.ru/aboutminen/energostrategy/> (Дата обращения 05.10.11)

рядом глобальных изменений в политической, экономической и финансовой сферах состояние рынков углеводородов (спрос, предложение, цена) стало существенным образом определять содержание многих политических процессов и, следовательно, потребовало углубленного анализа со стороны представителей политической науки.

Применительно к обозначенной проблеме и задачам сегодняшнего дня, привлечение политологов видится необходимым для работы в системе мониторинга, охарактеризованной в Энергетической стратегии. Эта система должна выполнять функции слежения за состоянием дел и выявлять тенденции развития мировой энергетики. Задача обеспечения успешной совместной работы экономистов и политологов не только в рамках такой системы, но и по другим вопросам энергетической проблематики, определяет актуальность исследований, направленных на поиск нового междисциплинарного инструментария, который был бы способен усилить научную конкуренцию между экспертными заключениями, подготовленными для структур принятия решений. Нам представляется, что именно в этом заключается один из резервов повышения эффективности государственного управления в области внешней энергетической политики.

В настоящее время важным экономическим фактором, влияющим на политическую обстановку как в отдельных регионах, так и в мире в целом, является динамика цен на углеводороды. Известно, что цена отражает состояние и изменение рыночной конъюнктуры, а динамику конъюнктуры, в свою очередь, определяет множество факторов. Их анализ осложняется не только тем, что они имеют различную природу и характер поведения, но и тем, что эти факторы взаимодействуют друг с другом. Поэтому исследования того, как экономические события порождают политические реакции и, наоборот, как действия политического характера приводят к экономическим подвижкам, должны дополнять друг друга, а их выводы согласовываться между собой. Узко дисциплинарный подход при анализе и прогнозировании состояния мировой системы не раз приводил к ошибкам, ставящим вопрос о состо-

тельности прикладной науки, бравшейся решать сложную междисциплинарную задачу в одиночку. Однако для решения междисциплинарных задач требуется не только согласованная работа специалистов разных областей науки, но и методы, помогающие проводить анализ перекрестных взаимодействий разноплановых факторов и процессов.

Степень разработанности темы. Две мировые войны двадцатого века актуализировали развитие политической науки и ее использование для предотвращения и разрешения возникающих конфликтов между ведущими мировыми державами. Одним из первых институтов, созданных для научно-исследовательской поддержки государственных политических решений, стал центр RAND Corporation в США. Новизна и результативность его работ стимулировали тиражирование использованных в них подходов и методов в других институтах и странах, что же касается США, то сегодня там насчитывается несколько десятков подобных исследовательских центров.

Первые успехи прогностической деятельности в военной сфере породили надежды на возможность переноса новых методов и в исследования по политическому анализу и прогнозированию. При этом сложный математический аппарат использовать не предполагалось. Все начиналось с разработки скорее организационных процедур выработки согласованных суждений: «Дельфи», «Форсайт», имитационные игры.

Важным подтверждением прогностических возможностей научно обоснованных сценариев стали работы по моделированию мировой динамики. Основы для такого рода исследований были заложены Дж. Форрестером в конце 1960-х. В его докладах Римскому клубу были описаны результаты долгосрочного эколого-экономического прогнозирования, которые вызвали большой отклик как в научной среде, так и в широких политических кругах¹.

Популярным подходом также стало выявление циклов развития, из которых первыми обнаруженными и наиболее известными являются большие

¹ Форрестер Дж. Мировая динамика. М: Наука. 1978.

циклы экономической конъюнктуры (циклы Кондратьева). Связь циклов Кондратьева с социально-политическими изменениями была подтверждена в целом ряде работ, выполненных в разные годы.¹

Один из способов получения научных знаний из обобщения эмпирических фактов (бихевиоризм) был связан с прогрессом в естественных науках и математике. Его адепты предлагали заимствовать методы, приемы, концепции из физики, математики, социологии, социальной психологии, науки об управлении и создать, таким образом, комплекс междисциплинарных методов. Мощный импульс их развитию дала компьютеризация науки. У исследователей появилась возможность анализировать большие объемы информации, создавать сложные системы индикаторов, рассчитывать модели с множеством факторов и использовать тем самым ранее недоступные методы для политического анализа и прогнозирования.

За несколько десятилетий методологическая база практикующих политологов была обогащена методами статистики, социологии, математики, лингвистики [Дж.Д. Арнольд; К. Бейли; Д. Веймер и А. Вининг; С.М. Вишнеv; К. Сёрф и В. Наваски; Д. Гупта; У. Данн; А.А. Дегтярев; Дж. Джонсон, Р. Джослин и Х.Т. Рейнольдс; Д. Дилман; Б.Г. Литвак; Дж. Мангейм и Р. Рич; Д. Миллер; Д. Несбери; К.В. Патон и Д. Сависки; В.М. Сергеев; У. Райкер; Ю.Н. Толстова; О. Хелмер]².

¹ Полетаев А.В., Савельева И.М. Циклы Кондратьева и развитие капитализма (Опыт междисциплинарного исследования). М.: Наука, 1993. Пантин В.И., Лапкин В.В. Философия исторического прогнозирования: ритмы истории и перспективы мирового развития в первой половине XXI века. Дубна: Феникс+, 2006; Гринин Л.Е., Коротаев А.В. Циклы, кризисы, ловушки современной Мир-Системы: Исследование кондратьевских, жюглярвских и вековых циклов, глобальных кризисов, мальтузианских и постмальтузианских ловушек. – М.: URSS, 2012.

² Arnold J.D. The Art of Decision Making. N.Y.: AMACOM. 1980; Bailey K. Methods of Social Research. 2nd ed. N.Y.. 1982; Weimer D. & Vining A. Policy Analysis. Concepts and Practice. 2nd ed. Prentice Hall, Englewood Cliffs. 1992; Вишнеv С. М. Основы комплексного прогнозирования. М.: Наука. 1977; Cerf C. and Navasky V. The Experts Speak. N.Y.. 1984; Gupta D. Analysing Public Policy: Concepts, Tools and Techniques. CQ Press. 2001; Dunn W. Public Policy Analysis: An Introduction. Prentice-Hall. 1981; Дегтярев А. А. Методы политологических исследований // Вестник Московского Университета. 1996. №6; Johnson J., Joslyn R. Reynolds H.T. Political Science Research Methods. 4th ed.. CQ Press. 2001; Dillman D. Mail and Electronic Surveys. N.Y. 1999; Литвак Б. Г. Экспертные оценки и принятие решений. М.: Патент. 1996; Мангейм Дж. Б., Рич Р. К. Политология. Методы исследования. М.: Весь мир. 1997; Miller D. Handbook of Research Design and Measurement. Beverly Hills. CA. 1991; Nesbary D. Survey Research and the World Wide Web. Needham Heights, MA. 1999; Patton C.V. and Sawicki D. Basic Methods of Policy Anaysis and Planning. Englewood Clifts. Prentice Hall. 1986; Sergeev V., Belyaev A., Biryukov N. et al. Voting in the Russian Parliament (1990-

Однако адаптация и использование любого из междисциплинарных методов, наряду с успехами, давала и понимание ограниченности их возможностей в зависимости от «технических» особенностей каждого метода. Осознание принципиальных трудностей еще в 60-х годах породило направление комбинированных методик. Так родились, например, методики «перекрестной корреляции» [Т. Гордон]¹ и «прогнозирование альтернативных вариантов рельефного будущего» [У. Уилкокс²].

В советский период прикладные политические исследования были частью работ по аналитическому сопровождению партийно-государственной деятельности. Поэтому в большинстве своем они проводились в аналитических подразделениях специальных служб и имели статус ограниченного доступа. Специальные исследования по анализу внешней политики и международных отношений, осуществлялись и в больших академических институтах (ИСКАН, ИМЭМО, ИНИОН).

Критическое осмысление зарубежных и отечественных работ помогло появлению нового направления в прогнозировании — постклассической прогностики³. В рамках этого направления считается, что, в силу нелинейности процессов, происходящих в обществе, классическое прогнозирование, базирующееся на определении жесткой связи причин и следствий, имеет весьма ограниченное применение. А значит, и ориентация на все более точное и полное описание исходных данных и стремление к построению масштабных моделей являются неэффективными. Поэтому основной акцент предлагается делать не на повышении точности прогнозирования через усложнение моде-

93): The Spectrum of Political Forces and the Conflict between the Executive and the Legislative // Journal of Behavioral and Social Sciences. 1995. №2; Sergeyev V., Biryukov N. Russia's Road to Democracy. Parliament Communism and Traditional Culture: Aldershot. Edward Elgar. 1993, Ch. II.; Riker W. The Art of Political Manipulation. New Haven. 1986; Толстова Ю. Н. Измерение в социологии: курс лекций. М.: ИНФРА-М 1998; Хелмер О. Анализ будущего: метод Делфи. Научно-техническое прогнозирование для промышленности и правительственных учреждений. М.: Прогресс. 1972.

¹ Gordon T. and Hayward, Initial Experiments with the Gross Impact Matrix Methods of Forecasting. «Futures». Dec. 1968.

² Wilcox W., Forecasting Asian Strategic Environments for National Security Decision Making: A Report and A Method. RM-6154-PR. The RAND Corporation. June 1970.

³ Панарин А. С. Глобальное политическое прогнозирование: учебник для студентов вузов. М.: Алгоритм. 2000.

ли, а на определении условий и средств достижения желаемого будущего.

Схожую точку зрения на цели прогнозирования высказывают Н.П. Шмелев с В.П. Федоровым. Они тоже подчеркивают невозможность учета всего множества факторов, описывающих жизнь общества и расчета на их основе вероятности прогноза, поэтому предлагают методологию прогнозирования, которую называют программно-целевой: «... мы выдвигаем на первый план необходимость выявления критических опасностей для страны, что должно служить исходным пунктом для дальнейших действий. ... Преодоление роковых угроз должно быть главной целью при вычислении будущего».¹

В последние годы количество работ по геополитическому и социально-экономическому прогнозированию возросло. Среди них выделяется масштабное исследование корпорации «Прайс Уотерхаус Куперс» – «Мир в 2050 году»². Основными объектами социально-экономического прогнозирования в нем являются демография, экономика, социальная сфера, экология и научно-технический прогресс.

Поводом к началу исследований в сфере международной энергетической политики и энергетической дипломатии стал мировой энергетический кризис 70-х годов. К 90-м годам это была уже вполне оформившаяся сфера научной деятельности, опиравшаяся на работы признанных зарубежных экспертов Д. Ергина, П. Кауэя, Дж. Митчела, и продолженная в работах Ги Каррона де ла Каррьер, Дж. Грейса, Ли Сянго, Б. Подобника.³

В СССР крупными работами, посвященными энергетической пробле-

¹ Шмелев Н., Федоров В. Угрозы и прогнозы. // Современная Европа. №1(33) январь-март. 2008. С. 7.

² PricewaterhouseCoopers The World in 2050. The perspectives of development of the economics of the counties with developing markets in process and competition of OECD. London: PricewaterhouseCoopers. 2006.

³ Ергин Д. Добыча. Всемирная история борьбы за нефть, деньги и власть. М.: Де Ново, 1999; Mitchel J. The New Geopolitics of Energy / The Royal Inst of International Affaires. London, 1996; Venn F. The Oil Crisis/London: Pearson Education, 2002; Ги Каррон де ла Каррьер. Экономическая дипломатия. Дипломатия и рынок. М. – РОССПЭН. – 2003; Grace J. Russian Oil Supplies: Performance and Prospects. Oxford: OUP (for the Oxford Institute for Energy), 2005; Li Xianguo. Diversification and localization of energy systems for sustainable development and energy security // Energy policy. – Guildford, 2005; Podobnik B. Global energy shift: fostering sustainability in a turbulent age. / Philadelphia: Temple University Press. 2006. – VII;

матике, были коллективные монографии под редакциями Н.Н. Иноземцева и Е.М. Примакова и книга С.З. Жизнина. Новые постсоветские реалии анализировались в работах А.А. Арбатова, М.А. Беловой и В.И. Фейгина, Г. Домхоф, А. Коэна, Э. Монагана, В.С. Милова, С.З. Жизнина.¹

Среди исследований российского периода, рассматривающих теоретические основы государственной политики и принятия государственных решений, можно отметить работы А.П. Бойко и К.А. Спиридонова, А.А. Дегтярева, В.Н. Козлова, В.С. Комаровского и Л.В. Сморгунова, Г.Л. Купряшина и А. И.Соловьева, В.В. Миронова и А.Т. Зуб, Б.Г. Литвак, А.В. Мендель, А.Б. Петровского, Г.В. Пушкаревой, Ю.К. Прохорова и В.В. Фролова, С.Г. Туронок, В.И. Ширяева и Е.В. Ширяева.²

Цель и задачи исследования. Цель диссертационной работы — разработка методологического инструментария, позволяющего повысить эффективность процесса принятия решений в области внешней государственной энергетической политики России. Для этого инструментарий должен обладать функцией прогноза кризисных экономическо-политических ситуаций в стране и мире, базирующемся на знаниях о закономерностях и особенностях поведения мировых экономических и политических процессов.

¹ Арбатов А.А., Белова М.А., Фейгин В.И. Российские углеводороды и мировые рынки // Россия в глобальной политике. №5. 2005; Domhoff. G. W. Who Rules America: power and politics. McGraw-Hill Companies, Inc. 4th ed., 2002; Коэн А. Мировая энергетика – взгляд из США // Экономическое обозрение. №4. 2006; Монаган Эндрю Дилемма энергетической безопасности // Pro et Contra. 2006 том 10. №2-3 (32); Милов В. Может ли Россия стать энергетической сверхдержавой // Вопросы экономики. 2006. №9; Жизнин С. З. Энергетическая дипломатия. Россия и страны мира на рубеже XXI века: баланс и конфликт интересов. М.: Научная книга. 1999;

² Бойко А.П., Спиридонов К.А. Особенности принятия политических решений в условиях глобализации // Современные гуманитарные исследования. – 2007. - №4. С.302-313; Дегтярев А.А. Принятие политических решений. М.: КДУ, 2004; Козлов В.Н. Системный анализ и принятие решений. СПб.: Изд-во Политехнического университета, 2009; Комаровский В.С., Сморгунов Л.В. Политико-административное управление. М.: Издательство РАГС, 2004; Купряшин Г.Л., Соловьев А.И. Теория и механизмы современного государственного управления. М.: МГУ, 2013; Миронов В.В., Зуб. А.Т. Принципы принятия управленческих решений в системе федеральных органов исполнительной власти. М.: Современные тетради, 2003; Соловьев А.И. Принятие и исполнение государственных решений. М.: Аспект-пресс, 2013; Литвак Б.Г. Разработка управленческого решения. М.: Дело, 2000; Литвак Б.Г. Экспертные оценки и принятие решений. М.: Патент, 1996; Мендель А.В. Модели принятия решений. М.: Юнити, 2010; Петровский А.Б. Теория принятия решений. М.: Академия, 2009; Пушкарева Г.В. Информационные технологии в принятии государственных решений: современные тенденции // Проблемный анализ и государственно-управленческое проектирование. 2009. Т. 2. № 2. С. 128–139; Прохоров Ю.К., Фролов В.В. Управленческие решения. СПб.: СПбГУ ИТМО, 2011; Туронок С.Г. Государственная гражданская служба в условиях реформ // Общественные науки и современность. 2006. № 4. С. 32-38; Ширяев В.И., Ширяев Е.В. Принятие решений: прогнозирование в глобальных системах. М.: Либроком, 2010;.

Для достижения цели исследования в диссертационной работе решаются следующие задачи:

- рассмотрение роли энергетической политики в международных отношениях и становление государственной энергетической политики России;
- разработка подхода, упрощающего анализ динамики мировой экономической конъюнктуры и тенденций развития мировой энергетической ситуации;
- определение особенностей поведения мировой экономической конъюнктуры и их обусловленности экономическими и политическими процессами;
- построение модели, позволяющей разделять экономически и политически обусловленные части динамики мировой экономической конъюнктуры и обладающей при этом хорошими прогностическими свойствами.
- разработка процедуры построения сценариев возможных кризисов в развитии мировой экономической и политической ситуации.

Объектом исследования является взаимодействие политических и экономических процессов, определяющих мировую энергетическую ситуацию (в сегменте углеводородов).

Предметом исследования являются инструменты анализа, моделирования и прогнозирования взаимодействия мировых экономических и политических процессов.

Теоретическая и методологическая база исследования. При написании диссертации были использованы общенаучные методы исследования – такие, как системный подход, статистический и сравнительный анализ, метод анализа и синтеза, исторический подход. Количественный анализ проведен с использованием методов графического, факторного, корреляционного, регрессионного анализов и ивент-анализа.

Информационную базу работы составили исследования по политическим и экономическим аспектам энергетической политики, поведению мировых товарных рынков в периоды мировых и региональных кризисов, методам политического и экономического прогнозирования.

В работе также были использованы данные Международного энергетического агентства (International Energy Agency), периодические публикации и статистические данные Управления энергетической информации Министерства энергетики США (Energy Information Administration, United States Department of Energy).

Ряд положений работы основан на результатах коллективных научных исследований, в которых соискатель принимал непосредственное участие.

Обоснованность результатов проведенного исследования определяется применением современных научных методов, сопоставлением результатов моделирования с фактическим описанием событий истории, апробацией ряда положений диссертации на всероссийских и международных конференциях.

Наиболее существенные результаты, обладающие научной новизной и выносимые на защиту.

1. Предложен подход, упрощающий, в нашем случае, исследование макроэкономических процессов. Он заключается в замене задачи анализа мировой энергетической ситуации задачей анализа динамики мирового спроса на нефть. Обоснованием такого перехода является ориентация не на количественный, а на качественный аспект, согласующийся со степенью неопределенности политического описания ситуаций. К тому же, при этом не нарушаются условия построения адекватной модели, а именно: наличие продолжительной и надежной статистики и показателя, являющегося комплексным индикатором состояния мирового хозяйства.
2. Определена особенность динамики мирового спроса на нефть, заключающаяся в наличии циклической составляющей, совпадающей с периодами мировых экономических кризисов. Нарушения же цикличности хорошо объясняются воздействием политических событий соответствующего времени.
3. Построена модель, которая позволяет разделять динамику мирового спроса на два разнородных процесса. А именно — составляющую, описывающую базовое циклическое развитие мировой экономики и составляющую, отражающую взаимодействие и взаимовлияние экономических и политических

процессов. Модель, описывающая макроэкономическую динамику, состоит из двух периодических функций. Благодаря тому, что они имеют изменяющиеся частоты и амплитуды, их наложение со смещением позволяет получить аппроксимацию спроса хорошего качества. Параметры модели легко оптимизируются стандартной процедурой популярной компьютерной программы Microsoft Excel. Модель обладает требуемыми прогностическими возможностями.

4. Разработана процедура сценарного прогнозирования, учитывающая модельную динамику и типологию встречавшихся сочетаний экономических и политических факторов. В такой компоновке процедура является новым сценарным методом, названным методом конъюнктурно-политической пролонгации.

5. Сделан прогноз ближайшего периода дестабилизации экономической и политической ситуации в мире, в котором произойдет понижение уровня цен, спроса и объемов экспорта энергоресурсов. Неготовность инфраструктуры к маневру экспортными потоками для компенсации финансовых потерь создаст серьезные проблемы для государственной системы управления по стабилизации внутренней и ответам на вызовы внешней политической ситуации.

Практическая значимость исследования. В дополнение к приведенным результатам диссертационное исследование позволило сделать еще несколько заключений, также имеющих практическую значимость:

1. Наблюдения многих экспертов, отмечающих происходящее ускорение экономических и политических процессов, не только подтвердились выполненным моделированием, но в результате его удалось получить и их численные оценки.

2. Процесс глобализации повышает устойчивость мировой системы к проблемам локального характера, однако при кризисах большего масштаба, когда порог устойчивости преодолевается, глобализация становится катализатором цепочек из негативных последствий. Поэтому остается актуальным поиск ответа на вопрос, как в условиях глобализации должна быть устроена

система международных экономических и политических отношений, чтобы она могла эффективно преодолевать кризисные этапы своего развития, не допуская разрушительных процессов для отдельных её частей.

3. Для практикующего политика процесс принятия решения должен включать в себя не только генезис политической ситуации, но и построение некоторого количества сценариев будущего развития. Решению этой задачи могут помочь предлагаемые прогнозно-аналитические инструменты. Компактность и удобство реализации модели в стандартной компьютерной программе позволяют использовать ее как инструмент для индивидуального междисциплинарного анализа и прогнозирования.

4. Предлагаемые в работе подходы, методы и прогнозы могут использоваться в преподавании общих и специальных курсов, например, по такому направлению подготовки политологов, как «экономическая политология».

Апробация работы и внедрение результатов исследования. Участие соискателя в исследованиях по политическому анализу с использованием математических методов началось в 1980-х годах. В нескольких коллективных публикациях были представлены результаты по: моделированию переходов рынка в различные тренды развития; описанию политических конфликтов с помощью теории игр; исследованию феноменов коллективного поведения. В 2000-х годах предметом исследований стали проблемы взаимодействия экономических и политических процессов в энергетической области. Основные положения исследований по теме диссертации нашли отражение в монографии, журнальных статьях, ведомственных аналитических записках и докладах на конференциях.

Публикации. Основные результаты работы опубликованы в 6 статьях и 1 монографии.

Структура диссертации определяется последовательностью решаемых задач. Работа состоит из введения, трех глав, заключения и приложения. Ее основной текст изложен на 151 страницах, содержит 3 таблицы и 8 рисунков. Список использованных работ насчитывает 208 наименования.

II. ОСНОВНОЕ СОДЕРЖАНИЕ РАБОТЫ

В **Введении** обосновывается актуальность предложенной темы, обозначаются объект и предмет исследования, определяются цели и задачи исследования, раскрываются научная новизна, теоретическая и практическая значимость работы, формулируются положения, выносимые на защиту.

Глава 1 «Основания энергетической политики» посвящена анализу причин появления и становления энергетической политики как самостоятельного компонента внешней и внутренней политики современных государств.

Подчеркивается, что на формирование энергетической политики оказывают влияние множество разноплановых факторов. Наиболее весомыми из них считаются: состояние национальных экономик, вопросы государственной безопасности и внешнеэкономического сотрудничества, состояние мировой экономики и конъюнктуры на рынках энергоносителей, проблемы связанные с экологией. При этом сами факторы подвержены обратному влиянию ситуации в энергетике. Такая взаимообусловленность придает энергетической политике роль системообразующего элемента, диктует необходимость административного контроля её со стороны государства и участия чиновников высокого ранга в разрешении энергетических проблем.

Путь выхода из ситуации жесткого противостояния между поставщиками и потребителями энергоресурсов времен энергетических кризисов определял необходимость в международном энергетическом сотрудничестве. Это привело к созданию специализированных многофункциональных международных институтов, таких как ОПЕК и Международное энергетическое агентство. Исторический анализ их деятельности показывает, как энергетическая политика помогает реализовывать не только различные экономические, но и сугубо политические цели и задачи. Во внешнеполитическом инструментарии появляются рычаги влияния, использующие энергетическую проблематику, а энергетическая политика становится отдельной, очень важной

частью внешней и внутренней политики государств.

Значимым измерением экономической безопасности, а, следовательно, и энергетической политики, становится технология. Ярким примером тому является рекордное наращивания добычи сланцевых нефти и газа в США, достигнутом благодаря передовым технологическим разработкам.

Россия драматически пережила десятилетие перехода к новой политической системе и рыночной экономике. В этот период незрелость новой системы управления энергетической отраслью компенсировалась чрезмерным влиянием на неё политики.

Серьезным испытанием для страны стал мировой финансовый кризис 1997-1998 гг. Экономика России, находившаяся в неустойчивом равновесии и в сильной зависимости от мировой конъюнктуры, была полностью вовлечена в него, следствием чего стал внутренний политический кризис.

С 2000 г. страна начала возвращать утраченные позиции в мировой энергетике. Весьма способствовало такому развитию неожиданное улучшение мировой конъюнктуры на рынках энергоносителей. В это время начинается целенаправленный процесс формирования национальной энергетической политики. Все аспекты основ энергетической политики и дипломатии России оформляются в документе названном «Энергетическая стратегия России на период до 2020 года», утвержденном правительством 28 августа 2003 года.

Составной частью следующего мирового кризиса 2008 г. стал энергетический кризис, нанесший по экономике России серьезный удар. Возникла необходимость переосмысления энергетической политики, чтобы на вызовы времени ответить ускорением перевода страны на интенсивный путь развития. Одним из направлений интенсификации стало введение в правительстве трехзвенного принципа формирования ведомств, который должен был сократить сроки реализации ключевых экономических проектов. Новый вариант стратегии — «Энергетическая стратегия России на период до 2030 года» утверждается 13 ноября 2009 г.

В контексте цели диссертационного исследования следует отметить, что среди положений стратегии есть указание на важность задачи, которая сформулирована как «создание российской системы мониторинга и анализа мировых процессов в энергетике и критических угроз на пути обеспечения стабильных условий на экспортных рынках российских энергоресурсов».¹

Российская концепция энергетической политики успешно претворяется в жизнь через: концентрацию внимания на региональной энергетической политике, внешнеэкономическое сотрудничество и энергетическую дипломатию; модернизацию ТЭК; эффективную реализацию экспортного потенциала; обеспечение доступа российских энергетических компаний на рынки зарубежных стран, привлечение иностранных инвестиций в российский энергетический сектор.

В Главе 2 «Принятие политических решений и политическое прогнозирование» рассмотрены аспекты политического прогнозирования, связанные с его использованием в процессе принятия политических решений. Анализируется теория и практика принятия политических решений, соотношение политического анализа и политического прогнозирования и проявление в них междисциплинарного подхода.

Административно-политическое решение может выражать индивидуальное или коллективное мнение и, принимая форму задач для органов государственной власти, оно воспринимается обществом как административно-политическая деятельность того или иного государственного деятеля или государственного органа. Поэтому из неудач и успехов политических решений, из их обоснованности и актуальности формируются репутации политиков, политических институтов и самих политических режимов.

Принятие политического решения – это, прежде всего, выбор какого-то одного или комбинации из нескольких доступных вариантов. Он зависит не только от профессионализма и честности лица принимающего решение, но и

¹ Министерство энергетики Российской Федерации. Энергетическая стратегия России на период до 2030 года. URL: <http://minenergo.gov.ru/aboutminen/energostategy/>. (Дата обращения 05.10.11)

от обоснованности предложенных ему оценок и правильного расчета рисков. Кроме того, надо учитывать, что, поскольку политическое решение – это рефлексия реальных процессов, оно может быть и неудачным в случае неадекватного понимания происходящих событий.

Стремление к повышению эффективности политико-административных решений диктует необходимость повышения профессионализма экспертиз и консультаций, а также усиления роли рационального подхода в государственном управлении, поэтому процедуры политического прогнозирования должны учитывать количественные прогнозы экономических и социальных показателей и позволять рассчитывать или хотя бы качественно оценивать вероятности реализации сценариев будущего.

Современные политологические исследования объединяют качественный и количественный методы анализа, поскольку их взаимопроникновение позволяет получать модели, наиболее адекватные изучаемым объектам.

В силу ряда особенностей стремление приблизить модель к реальности через учет большого количества факторов является неэффективным. Одним из вариантов решения проблемы полноты и точности модели является выделение наиболее значимых параметров и индикаторов, ориентация на качественно-количественный аспект оценок и переход к предсказанию потенциальных опасностей или кризисов.

В **Главе 3 «Основания исследовательской модели»** определен подход к построению прогнозов кризисных ситуаций, которые способны нарушить планы реализации положений энергетической политики. Представлена компактная макроэкономическая модель и построенные на ее основе процедуры анализа и прогнозирования взаимодействия экономических и политических процессов в секторе энергоресурсов. Приведен среднесрочный прогноз мировой энергетической ситуации и возможных последствий для проведения энергетической политики России.

В настоящее время одним из важных показателей дел в мировой экономике является состояние рыночной конъюнктуры энергоносителей. Анализ

мировых энергетических рынков показывает, что взаимосвязь их политического и экономического контекста – это не случайно возникающие совпадения, а важная особенность функционирования рынков.

Главными рынками энергоносителей являются рынки нефти и газа. А из них, в силу наличия развитой системы биржевой торговли, выделяется рынок нефти. Биржевая торговля нефтью является основополагающим элементом для механизмов ценообразования на всех других рынках энергоносителей, а биржевая торговля контрактами на будущие поставки (фьючерсами) является механизмом трансформации политических и экономических ожиданий в конкретные значения текущих цен. Благодаря этому нефть обладает уникальным статусом. Заключается он в том, что ее можно рассматривать как глобальный товар, мировую цену на нефть как глобальный фактор, а конъюнктуру на мировом рынке нефти как глобальный индикатор.

Задача моделирования и прогноза нефтяных цен пока не решена, а прогнозирование конъюнктуры, её определяющей, осложняется тем, что она не имеет какой-либо одной числовой характеристики и описывается через другие показатели, например, через цену или через соотношение спроса и предложения. Поэтому в диссертационном исследовании предлагается совершить переход к задаче анализа спроса, руководствуясь следующей цепочкой гипотез: 1) о состоянии мировой системы мы можем судить по состоянию мировой экономики; 2) положение дел в мировой экономике отражается в динамике конъюнктуры на энергетических рынках; 3) определяющим энергетическим рынком является мировой рынок нефти; 4) цена на рынках нефти зависит от соотношения спроса и предложения, главным в этой паре является спрос; 5) динамика спроса соответствует поведению биржевой конъюнктуры.

Мировой спрос (точнее, изменения спроса) на нефть рассматривается в диссертационной работе в качестве интегрального макропоказателя состояния мировой системы. Обоснованием этого является принятие предложенной цепочки гипотез и постановка акцента на качественно-количественном аспекте прогноза. При этом модель спроса строится только на основе анализа

динамики его временного ряда без построения регрессии по каким либо факторам. Весьма ценным обстоятельством для моделирования является доступность разнообразной биржевой статистики мирового рынка нефти.

Поиск модели базировался еще на нескольких гипотезах. Первая гипотеза состоит в предположении того, что в динамике изменения спроса должна присутствовать плавная циклическая компонента. О цикличности динамики экономических показателей говорят многие эксперты.¹ Циклы различаются своими характеристиками (периодом, амплитудой и т.п.) и природой происхождения, но отражают главную особенность поведения показателя — периодическую повторяемость характера развития.

Вторая гипотеза состоит в предположении, согласно которому частота и амплитуда колебаний, описывающих цикличность экономики, не являются постоянными. Специальных методов выбора аппроксимирующей функции для нестационарного временного ряда (каковым является спрос) нет. Наше исследование выявило хорошие аппроксимирующие результаты у подобранной дискретной функции в виде суммы двух периодик с параметрами, определяющими амплитуду, частоту и смещение периодических колебаний.

$$f_i(c, \alpha_1, \alpha_2, \alpha_3, \alpha_4, \beta_1, \beta_2, \beta_3, \beta_4) = \frac{\alpha_1}{i+c} \cos \left(\frac{i^{\alpha_3}}{\alpha_2} + \alpha_4 \right) + \frac{\beta_1}{i+c} \sin \left(\frac{i^{\beta_3}}{\beta_2} + \beta_4 \right)$$

Если полагать, что представленная гладкая кривая (**Рис. 1**) описывает цикличность мировой экономической конъюнктуры, то сильные отклонения от этой кривой должны быть обусловлены влиянием неэкономических факторов. Они могут по-разному искажать экономически predetermined циклическую динамику, порождая тем самым ощущение непредсказуемости поведения конъюнктуры.

¹ См., напр., Глазьев С. Ю., Микерин Г. И., Тесля П. Н. и др. Длинные волны: Научно-технический прогресс и социально-экономическое развитие. Новосибирск: Наука. 1991. С. 27-28.

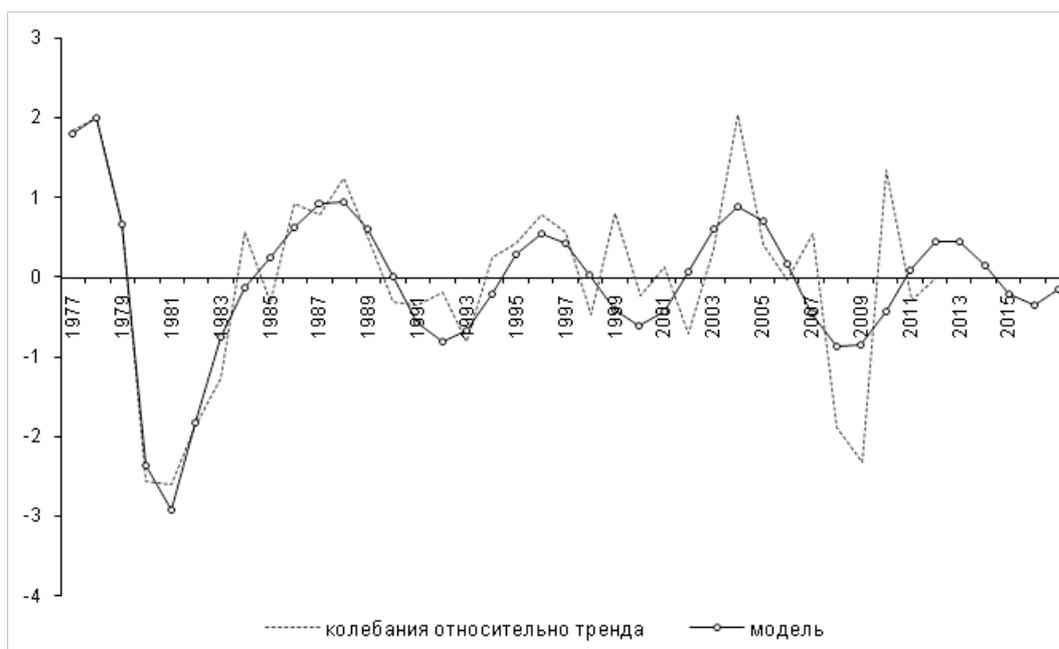


Рис. 1. Фактические и модельные (с пролонгированной частью) значения изменений мирового спроса на нефть (млн. баррелей в сутки)

На интервале 1977-1998 гг. точность аппроксимации очень хорошая, а после 1999 г. отклонения от модельной кривой возрастают. Тем не менее, на основе этой модели можно строить предположения о грядущей динамике спроса и ценовых реакциях, которые будут возникать на рынке. Подтверждением сохранения качества модели после 1999 г. является адекватное описание провала мировой экономики в кризисное состояние в 2008-2009 гг.

Еще одним аргументом адекватности модели можно считать ее схожесть со среднесрочными циклами Жюгляра (циклы модификации оборудования и технологий с периодом 7-10 лет), которые сочетаются с большими циклами Кондратьева (40-50 лет) и краткосрочными циклами Китчина (3-4 года)¹.

Для решения вопроса о том, какую реакцию цены можно ожидать при тех или иных значениях спроса, были проанализированы встречавшиеся сочетания трех величин: циклической (экономической) составляющей, остаточной (политической) составляющей и колебаний цены. Были определены

¹ Шумпетер Й. Теория экономического развития. М.: Прогресс. 1982.

13 вариантов таких сочетаний, которые затем были классифицированы по признаку преобладающего влияния (экономического или политического).

Правильность классификации была проверена историческим и ситуационным анализом, а результаты ретроспективного её применения позволили получить следующую хронологию преобладающих влияний на динамику конъюнктуры в среднем за год (Табл. 1).

П	П	Э	П	П	Э	Э	П	П	П	Э	П	Э	П	Э	П	П
1977	1978	1979	1980	1981	1982	1983	1984	1985	1986	1987	1988	1989	1990	1991	1992	1993
П	П	Э	П	П	П	П	Э	П	Э	Э	Э	П	П	П	Э	П
1994	1995	1996	1997	1998	1999	2000	2001	2002	2003	2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010

Табл. 1. Хронология преобладающих влияний

Представляется, что хронология преобладающих влияний может быть полезной при проведении исторических системных исследований, учитывающих анализ взаимодействий экономических и политических процессов. Главной же целью классификации было её использование в построении по имеющимся прогнозам экономической составляющей наиболее вероятных политических и ценовых реакций, которые определяют возможные сценарии развития ситуации.

Циклическая модель экономической составляющей спроса позволяет пролонгировать её на любой интервал времени. В нашем случае корректным является краткосрочный прогноз (3-5 лет). Согласно наиболее вероятному сценарию до следующего мирового кризиса осталось совсем немного времени (2015-2016 гг.).

Если отнестись к нему как к реализующемуся, то необходимо добиваться решения нескольких задач. Во-первых, помочь сформировать в обществе конструктивное ожидание грядущей кризисной экономико-политической ситуации и в мире в целом, и в стране в частности. Во-вторых,

мобилизовать структуры государственного управления на кардинальное улучшение текущего состояния в уязвимых областях народного хозяйства. В-третьих, учитывать негативный прогноз при любом политическом планировании и, особенно, при выработке политических решений в области энергетической политики.

Предлагаемый в диссертационном исследовании метод конъюнктурно-политической пролонгации, основанный на оригинальной экономико-математической модели, помогает решению трех важных задач: 1) представить динамику конъюнктуры в виде суммы двух составляющих, одна из которых моделируется математически и трактуется как составляющая, описывающая циклическую закономерность мирового экономического развития, другая--- как составляющая, отражающая взаимодействие процессов экономических с политическими; 2) получить интегральную оценку, показывающую тип преобладающего влияния на динамику рыночной конъюнктуры (экономического или политического) и 3) построить краткосрочные сценарии развития мировой экономической и политической ситуации, помогающие увеличить объективность экспертных оценок для выработки государственных политических решений в области энергетической политики.

В **Заключении** обобщены результаты, представлены сделанные выводы и намечены направления для продолжения исследования.

III Список работ, опубликованных автором по теме диссертации:

Основные положения диссертации отражены в следующих публикациях автора.

В журналах из списка, рекомендованного ВАК России:

1. Артюшкин В. Ф. Перспективы второй волны глобального финансово-экономического кризиса. Вестник МГИМО-Университета, №4, 2013. С. 38-42. (0,4 п. л.)

2. Артюшкин В. Ф. Прогнозирование энергетической политики. Обозреватель – Observer. №12(251). 2010. С. 72-81 (0,65 п. л.)
3. Артюшкин В. Ф. Региональные конфликты и процесс ценообразования на мировом рынке нефти. Полис, №5, 2007. С. 129-139. (0,68 п. л.)

Другие публикации:

4. Петров В.В., Артюшкин В.Ф. Поведение цен на мировом рынке нефти. Стратегические тренды, биржевые игры, макросценарии. М.: ФАЗИС. 2004.
5. Артюшкин В.Ф. Комплексный метод анализа взаимовлияний политических и экономических процессов в сфере энергетической политики (сегмент мирового рынка нефти). Аналитический доклад по научно-исследовательскому проекту МГИМО. Октябрь. 2008.
6. Артюшкин В.Ф., Полякова Т.В. Влияние мировых цен на углеводороды на экономику и политику стран СНГ. Аналитическая записка. ЦПП ИМИ МГИМО МИД России. Декабрь. 2012.
7. Артюшкин В.Ф. Следующий мировой кризис – когда его ждать? / Сборник трудов научно-практической конференции «Эконометрические методы в исследовании глобальных экономических процессов». МГИМО. – М.: Изд-во Анкил, 2013. С. 13-22.