Збірник наукових праць

Національного університету державної податкової служби України

Електронне наукове видання

№ 1

Ірпінь – 2013

УДК 33 + 657

Збірник наукових праць Національного університету державної податкової служби України: електронне наукове видання [Електронний ресурс] / Національний університет державної податкової служби України; гол. ред.: П.В. Мельник. – 2013. – № 1. – Режим доступу http://www.nbuv.gov.ua/e-journals/Znpnudps/index.html . – Заголовок з екрана.

Схвалено Вченою радою Національного університету державної податкової служби України,
протокол № 1 від 30 серпня 2013 року

Редакційна колегія не завжди поділяє позицію авторів.
За точність викладеного матеріалу відповідальність покладено на авторів.
Рукописи рецензуються редакційною колегією.
Зміни тексту та скорочення, що впливають на зміст матеріалів, а також їх перейменування вносяться редакцією за погодженням авторів.
При передруку матеріалів посилання на «Збірник наукових праць Національного університету державної податкової служби України» обов'язкове.

Адреса редакції: вул. Карла Маркса, 31, м. Ірпінь, Київська обл.,08201, Україна
E-mail: finmarkets07@gmail.com

© Національний університет державної податкової служби України, 2013

Редакційна колегія:

Тарангул Л.Л., доктор економічних наук, професор, заслужений діяч науки і техніки України (голова редакційної колегії);

Онишко С.В., доктор економічних наук, професор (заступник голови редакційної колегії);

Варналій З.С., доктор економічних наук, професор, заслужений діяч науки і техніки України;

Алексеєнко М.Д., доктор економічних наук, професор;

Андрущенко В.Л., доктор економічних наук, професор;

Внукова Н.М., доктор економічних наук, професор;

Дедекаєв В.А., доктор економічних наук, професор;

Корнєєв В.В., доктор економічних наук, професор;

Лісовий А.В., доктор економічних наук, професор;

Нейкова Л.І., доктор економічних наук, професор;

Опарін В.М., доктор економічних наук, професор;

Орланюк-Малицька Л.О., доктор економічних наук, професор;

Пасічник Ю.В., доктор економічних наук, професор;

Ріппа С.П., доктор економічних наук, професор;

Старостенко Г.Г., доктор економічних наук, професор;

Швабій К.І., доктор економічних наук, професор;

Шелудько Н.М., доктор економічних наук, професор;

Белінська Я.В., доктор економічних наук, професор;

Береславська О.І., доктор економічних наук, доцент;

Воронкова О.М., доктор економічних наук, доцент;

Кірілова Н.В., доктор економічних наук, доцент;

Заєць С.В., кандидат економічних наук, доцент;

Калач Г.М., кандидат економічних наук, доцент;

Клюско Л.А., кандидат економічних наук, доцент;

Коваленко Ю.М., кандидат економічних наук, доцент;

Мацелюх Н.П., кандидат економічних наук, доцент;

Мельник О.В., кандидат економічних наук, доцент;

Пернарівський О.В., кандидат економічних наук, доцент;

Позднякова Л.О., кандидат економічних наук, доцент;

Унинець-Ходаківська В.П., кандидат економічних наук, доцент (відповідальний секретар).

ЗБІРНИК НАУКОВИХ ПРАЦЬ
НАЦІОНАЛЬНОГО УНІВЕРСИТЕТУ
ДЕРЖАВНОЇ ПОДАТКОВОЇ СЛУЖБИ УКРАЇНИ
Галузь науки: економічні науки

Засновник та видавець Національний університет державної податкової служби України | **Електронне наукове видання** | **№ 1, 2013**

УДК 33 + 657

ЗМІСТ

Болдова А.А., Романова Г.І. Інвестиційна діяльність банків України……6

Брехов С.С. Напрями вдосконалення системи контролю за обігом спирту та алкогольних напоїв в Україні……..……..……..……14

Герус Ю.В., Чумак А.С. Фондовий ринок України та його роль в економіці……...22

Гусак Ю.Д. Механізм аналізу співставності операцій в системі контролю за трансфертними цінами.……....……...30

Гусятинський М.В., Стихун І.В. Необхідність та особливості здійснення енергоефективних заходів в житлово-комунальному господарстві…….41

Діденко Л.В., Катана О.С. Інноваційна політика як основа забезпечення економічного зростання……..……..…..……52

Євтушенко Г.І., Вітренко Л.О. Шляхи формування професійної компетентності майбутнього менеджера…..……..……..……...69

Жеревчук Ю.В., Янко О.І. Регіональні аспекти залучення прямих іноземних інвестицій.……..…….....79

Канцур І.Г. Основні тенденції формування податкового механізму як передумови розв'язання соціальних проблем (регіональний аспект).…….87

Лосіхін О.О. Проблеми взаємодії держави та страховиків щодо підвищення безпеки дорожнього руху……...101

Лотоцький М.Я. Оцінювання процесів формування та функціонування капіталу в аспекті фінансової безпеки підприємств…….……..……113

Мамонова А.В., Бугай Т.В. Інституційні деформації бюджетного процесу в Україні: моделювання методом ієрархій……..126

Мартиненко В.В. Прогнозування тенденцій розвитку економічної безпеки України з урахуванням впливу глобалізаційних факторів……..…138

Матвейчук Л.О., Соловйов О.В. Електронна держава Росія. Онлайн-послуги федеральної податкової служби…….……150

Новицька Н.В. Обмін інформацією між податковими та іншими державними

органами як напрямок підвищення ефективності адміністрування екологічних податків……..…..……..….166

Резніченко К.Г., Баранюк Р.Ю. Сучасний стан та перспективи розвитку інститутів спільного інвестування в Україні…….……...176

Романенко О.О. Інтегровані маркетингові комунікації: сутність, характеристика та особливості формування……187

Ручкіна В.М. Податкова культура в інституціональному аспекті розвитку податкової системи України…….…..……....197

Томчук В.В. Бюджет грошових потоків як складова процесу бюджетування на сільськогосподарських підприємствах…..……..……...206

Тофан І.М. Особливості застосування електронної звітності в оподаткуванні……..…222

Унинець О.М. Роль банківського кредитування підприємницької діяльності в процесі взаємодії фінансового та реального секторів економіки……...230

Чирва А.А. Організаційні аспекти обліку виробничих затрат на хлібопекарних підприємствах Україні…..……...…….……..…246

Щербина А.Г. Інновації законодавства України щодо торгівлі на фондовому ринку…….255

Яцишина І.В. Соціальні наслідки інноваційного розвитку економіки: проблеми та оцінки…….....269

УДК 005.4:330.3:338.27

Мартиненко В.В.

ПРОГНОЗУВАННЯ ТЕНДЕНЦІЙ РОЗВИТКУ ЕКОНОМІЧНОЇ БЕЗПЕКИ УКРАЇНИ З УРАХУВАННЯМ ВПЛИВУ ГЛОБАЛІЗАЦІЙНИХ ФАКТОРІВ

У статті використано багатофакторну кореляційно-регресійну модель для прогнозування впливу глобалізаційних факторів на рівень економічної безпеки держави. Автором розроблено та реалізовано алгоритм прогнозування тенденцій розвитку економічної безпеки держави з урахуванням впливу глобалізаційних факторів. Обґрунтовано доцільність застосування результатів прогнозування при розробці державної стратегії забезпечення економічної безпеки на період до 2022 рр.

Ключові слова: *прогнозування, глобалізація, економічна безпека держави, фактор, рівень, період, трендовий аналіз, сценарій.*

Постановка проблеми. Прогнозування впливу глобалізаційних факторів на рівень економічної безпеки держави є складним аналітичним процесом, що пов'язаний із дослідженням закономірностей глобального розвитку світової економіки та місця України в ньому. Забезпечення економічної безпеки держави в умовах глобалізації на стратегічному рівні потребує детального дослідження тенденцій розвитку національної економіки і, відповідно, прогнозування впливу глобалізаційних факторів на рівень економічної безпеки України. Це закладе основи для формування і вибору пріоритетів економічного розвитку держави в рамках концепції національної безпеки в умовах глобалізації.

Аналіз останніх досліджень і публікацій, виділення невирішених раніше частин загальної проблеми. Серед учених-економістів, чиї публікації, присвячені вирішенню проблем прогнозування макроекономічних показників та розвитку національної економіки в умовах глобалізації, варто виокремити наступних: С.Е. Сардак досліджує сучасні глобальні загрози та економічний розвиток у контексті визначення і запобігання реалізації негативних наслідків [1]; колектив авторів на чолі з Т.А. Тищук досліджує можливості прогнозування і сценарного аналізу стійкості національної економіки до зовнішніх шоків із урахуванням рівня економічної безпеки держави та ризиків глобалізації [2]; В.О. Луцков досліджує вплив глобалізаційних тенденцій на циклічність розвитку національних економічних систем [3]. Проте поза увагою вказаних авторів залишається питання прогнозування економічної безпеки держави з точки зору впливу глобалізаційних факторів.

Мета. Метою статті є розробка алгоритму методичного забезпечення процесу прогнозування рівня економічної безпеки держави під дією глобалізаційних чинників із застосуванням багатофакторних економіко-математичних моделей.

Виклад основного матеріалу. Результати оцінки впливу глобалізації на стан економічної безпеки протягом 1996–2011 рр., попередньо проведеної автором, дали змогу отримати наступну багатофакторну кореляційно-регресійну модель:

$$ESIU_L = 0{,}4064\ (-1157{,}43 - 6{,}15\ DR_L - 25{,}19\ E_L + 30{,}89\ I_L + 9{,}95\ IER_L + 206{,}24\ MG_L + 12{,}03\ DUIA_L + 0{,}006\ FTSE_L)^{0{,}0850}, (1)$$

де ESIU – Economic Security Index of Ukraine – інтегральний показник (індекс) економічної безпеки України, %;

DR – U.S. dollar rate – курс долара США, грн.;

E – Export (% of GDP) – експорт у % до ВВП

I – Imports (% of GDP) – імпорт у % до ВВП

IER – Import-export ratio – коефіцієнт покриття імпорту експортом

MG – Migratory growth (% of actual population) – міграційний приріст у % до наявного населення;

DUIA – Direct Ukrainian Investment Abroad (% of GDP) – прямі інвестиції з України у % до ВВП;

FTSE – Index FTSE 100 – індекс Лондонської фондової біржі FTSE 100;

L – порядковий номер прогнозного року, при чому L = 17, 18, …, 26, що відповідає 2012, 2013, …, 2021 рокам.

Використаємо визначені в кореляційно-регресивній моделі фактори глобалізації для прогнозування тенденцій розвитку рівня економічної безпеки, оскільки прогнозування є найбільш ефективним і водночас складним аналітичним інструментом дослідження тенденцій та перспектив розвитку економічних явищ. Для цілей дослідження, зазначимо, що найбільш точними вважаються якісні методи (експертні процедури), але за відсутності експертів, актуальності набувають кількісні методи (аналіз динамічних рядів, трендовий аналіз, екстраполяція), каузальне (причинно-наслідкове) моделювання, економіко-математичне моделювання, сценарний аналіз тощо. Також у прогнозуванні іноді використовуються методи імітаційного моделювання, що полягають у імітації значної кількості варіантів розвитку подій та відбору найбільш реалістичних. При цьому точність прогнозу підвищується, якщо комбінувати декілька методів.

Для деталізації процесу та окреслення процедур застосуємо алгоритм прогнозування тенденцій розвитку економічної безпеки держави з урахуванням впливу глобалізаційних факторів (рис. 1).



Рис. 1.Алгоритм прогнозування тенденцій розвитку економічної безпеки держави з урахуванням впливу глобалізаційних факторів

Джерело: розроблено автором.

Із даних рис. 1 видно, що процес прогнозування тенденцій розвитку економічної безпеки держави з урахуванням впливу глобалізаційних факторів передбачає реалізацію 8 послідовних кроків:

1) формування вихідної бази – рядів динаміки глобалізаційних факторів, що прогнозуються;

2) вирівнювання рядів динаміки, тобто аналіз тенденції розвитку за базисними і середніми показниками динаміки;

3) побудова рівнянь тренду для кожного глобалізаційного фактору, якими описується тенденція розвитку;

4) статистична оцінка рівняння тренду за показником рівня апроксимації, що показує достовірність встановленої закономірності розвитку;

5) визначення періоду прогнозу, тобто кількість прогнозних років, як правило, їх має бути не більше, ніж звітних, за які зведено статистичні дані;

6) екстраполяція даних по кожному фактору згідно з рівнянням тренду на майбутні періоди, тобто перенесення тенденції розвитку на майбутні роки за умови, що вона не змінюватиметься, а також встановлення верхнього і

нижнього довірчих інтервалів (або ж інтервалів довіри), які утворюють площу, до якої входитимуть усі можливі значення факторних ознак у разі будь-яких змін в економіці;

7) визначення прогнозних рівнів економічної безпеки держави згідно з семифакторною моделлю впливу глобалізації;

8) розробка сценаріїв розвитку економічної безпеки національної економіки шляхом встановлення довірчих інтервалів та формування її пріоритетів розвитку.

Реалізація першого кроку передбачає формування бази дослідження у вигляді рядів динаміки глобалізаційних факторів економічної безпеки держави за 1996–2011 рр. (Табл.1).

Таблиця 1

Зведені ряди динаміки глобалізаційних факторів економічної безпеки держави [10]

Роки	Порядковий номер року	Найменування глобалізаційного фактору						
		1. Курс долара США, грн.	2. Експорт у % до ВВП	3. Імпорт у % до ВВП	4. Коефіцієнт покриття імпорту експортом, %	5. Міграційний приріст у % до наявного населення	6. Прямі інвестиції з України у % до ВВП	7. Індекс FTSE 100
1996	1	1,8295	42,97	42,21	101,81	-0,33	0,22	4089,5
1997	2	1,8617	37,83	36,98	102,29	-0,27	0,25	5193,5
1998	3	2,4495	39,29	38,46	102,18	-0,3	0,23	5882,6
1999	4	4,1304	48,12	41,04	117,26	-0,28	0,31	6930,2
2000	5	5,4402	57,77	48,32	119,54	-0,27	0,54	6222,5
2001	6	5,3721	52,12	44,52	117,06	-0,31	0,41	5242,4
2002	7	5,3266	51,92	42,86	121,16	-0,07	0,34	4004,9
2003	8	5,3327	54,48	48,83	111,59	-0,05	0,33	4510,2
2004	9	5,3192	58,53	47,87	122,28	-0,02	0,31	4814,3
2005	10	5,1247	46,86	45,36	103,31	0,01	0,25	5618,8
2006	11	5,0500	42,57	45,25	94,08	0,03	0,23	6220,8
2007	12	5,0500	40,87	45,96	88,93	0,04	4,34	6348,5
2008	13	5,2672	43,73	51,12	85,55	0,03	3,45	4561,8
2009	14	7,7912	42,05	43,17	97,41	0,03	5,31	5412,9
2010	15	7,9356	46,30	48,52	95,43	0,04	5,03	5899,9
2011	16	7,9676	50,29	54,36	92,51	0,04	4,22	5572,3
Відхилення (+, -) 2011 р. від 1996 р.		+6,1381	+7,32	+12,15	-9,3	+0,37	+4,00	+1482,8
Відхилення (+, -) 2011 р. від 2007 р.		+2,9176	+9,42	+8,40	+3,58	-	-0,12	-776,20
У середньому за 16 років		5,0780	47,23	45,30	104,52	-0,11	1,61	5407,82

Джерело: сформовано та проведено розрахунки на основі даних Державної служби статистики України [4], Національного банку України [5], Лондонської фондової біржі [6].

Із даних табл. 1 видно, що всі досліджувані глобалізаційні фактори, крім коефіцієнту покриття імпорту експортом, протягом 1996–2011 рр.

демонструють тенденцію до зростання. При цьому тенденція зростання середньорічного курсу долара США та відсоткового відношення річного обсягу експорту до обсягу ВВП, а також спадна тенденція коефіцієнта покриття імпорту експортом чинили опір зростанню рівня економічної безпеки України, оскільки, згідно з отриманими результатами дослідження, перших два фактори є дестимуляторами економічної безпеки, а четвертий – стимулятором. Динаміка показників наступна: курс долара США за період аналізу зріс у 4,4 рази, а за 2008–2011 (світова фінансова криза) – у 1,6 рази, що, відповідно мало негативний вплив на рівень економічної безпеки держави; показники, що взяті як відношення до обсягу ВВП (експорт, імпорт і прямі інвестиції з України), демонструють позитивну динаміку перше за все через випереджаючі темпи зростання, порівняно з ВВП; зниження коефіцієнту покриття імпорту експортом відбувалося внаслідок випереджаючих темпів зростання першого показника; зростання міграційного приросту населення пов'язане з тим, що, починаючи з 2005 року, кількість осіб, які в'їхали в Україну перевищувала тих, що виїхали, проте вести мову про повернення трудових емігрантів додому не варто, оскільки доступу до такої статистики немає; динаміка біржового індексу FTSE 100 є типовою для переважної більшості національних біржових індексів – стрімке зростання до 2007 року, обвал станом на кінець 2008 року та поступове відновлення у 2009–2011 роках.

Наступний крок послідовності процесу прогнозування тенденцій розвитку економічної безпеки держави з урахуванням впливу глобалізаційних факторів полягає у побудові рівнянь трендів показників, що прогнозуються. У статистичній практиці побудова трендів носить назву трендового аналізу. Трендовий аналіз – популярний прикладний інструмент дослідження макроекономічних явищ, який полягає у визначенні тенденцій розвитку національної економіки потягом значного періоду часу (як правило, понад 10 років) та їх опис за допомогою рівнянь з однією змінною – змінною часу. На практиці це виглядає так, як на рис. 2. Автором отримано рис. 2 шляхом побудови графіку функції середньорічного курсу долара США за 1996–2011 рр. де незалежною змінною взято порядковий номер року, а при використанні опції «добавить линию тренда» в MS Excel, отримано рівняння та значення рівня апроксимації лінійного тренду R^2.

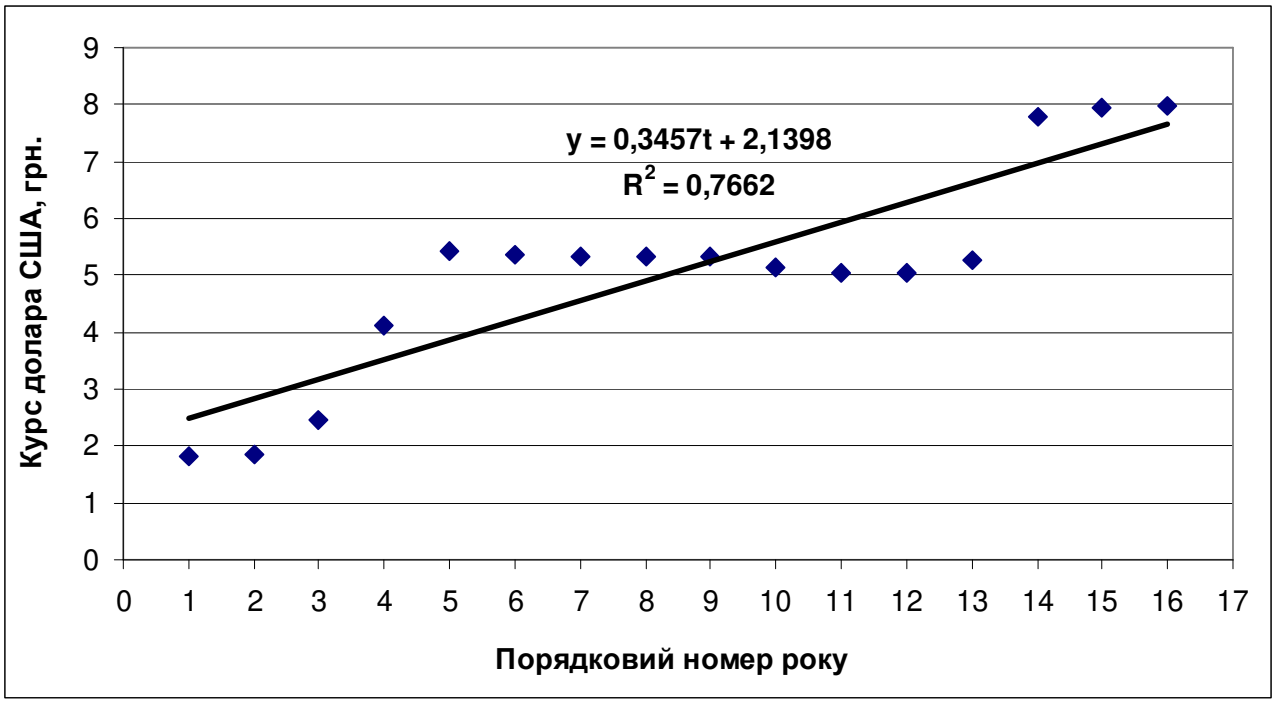


Рис. 2. Графік і рівняння тренду динамічного ряду курсу долара США
Джерело: сформовано та проведено розрахунки автором засобами MS Excel.
Примітка: t – порядковий номер року.

Дані рис. 2 підтверджують раніше зроблений висновок про тенденцію до зростання середньорічного курсу долара США і надають цій тенденції статистичного забарвлення у вигляді рівняння трендової лінії. Згідно з отриманим рівнянням тренду видно, що середньорічний приріст курсу долара США склав 0,35 грн. і, якщо тенденція зберігатиметься, то такий же приріст буде наявний і в майбутньому. Рівень апроксимації свідчить, що лінія тренду на 76,6% наближена до достовірних даних. Рівняння тренду вважається прийнятним для подальшого застосування, якщо рівень апроксимації не буде не менше 0,5.

Трендовий аналіз застосовується у двох випадках – для інтраполяції та екстраполяції статистичних даних. Інтраполяція – це ретроспективний аналіз, який полягає у наближеному визначенні відсутніх статистичних даних динамічного ряду або даних в минулих періодах. Екстраполяція – це перспективний аналіз, який найбільш широко застосовується у прогнозуванні, базується на припущенні про сталість тенденції розвитку відповідного економічного показника і полягає у перенесенні тенденції за лінією тренду на майбутні періоди. Практично таке перенесення тенденції проводиться шляхом підстановки у рівняння тренду порядкового номера відповідного року періоду прогнозу. У нашому випадку перший прогнозний рік буде 2012, а його порядковий номер – 17. Тоді курс долара США може скласти у 2012 році 8,0167 грн.

Аналогічно побудовано трендові моделі решти глобалізаційних факторів. У табл. 2 зведемо рівняння трендів та рівні їх апроксимації для усіх досліджуваних глобалізаційних факторів економічної безпеки України.

Таблиця 2

Рівняння трендів глобалізаційних факторів економічної безпеки держави

Найменування показника	Рівняння тренду	Рівень апроксимації
1. Курс долара США, грн.	$y = 0{,}3457\ t + 2{,}1398$	0,766
2. Експорт у % до ВВП	$y = 0{,}9413\ t + 37{,}0$	0,564
3. Імпорт у % до ВВП	$y = 0{,}6889\ t + 39{,}446$	0,521
4. Коефіцієнт покриття імпорту експортом, %	$y = 0{,}6431\ t + 94{,}0$	0,525
5. Міграційний приріст у % до наявного населення	$y = -0{,}0014\ t^2 + 0{,}0543\ t - 0{,}4307$	0,866
6. Прямі інвестиції з України у % до ВВП	$y = 0{,}3407\ t - 1{,}2855$	0,640
7. Індекс FTSE 100	$y = 137{,}83\ t + 3950{,}0$	0,521

Джерело: сформовано та проведено розрахунки автором на основі даних, наведених у табл. 1 із застосуванням MS Excel

Із даних табл. 2 видно, що рівні апроксимації трендових рівнянь 7 глобалізаційних факторів впливу на економічну безпеку держави перевищують 0,5 і свідчать про цілком задовільні достовірності трендових моделей, а тому отримані рівняння можуть бути застосовані у прогнозуванні. Також варто відзначити, що автором отримано одне квадратичне рівняння тренду для міграційного приросту у відсотках до наявного населення (найвищий рівень достовірності 86,6%) та шість лінійних рівнянь для решти факторів. При цьому найнижчий рівень достовірності у лінійного рівняння тренду індексу FTSE 100, який склав 52,1%.

Трендовий аналіз глобалізаційних факторів було проведено на основі зведених статистичних даних за 16 років аналізованого періоду (1996–2011 рр.), що дозволяє розробити прогнози вперед на 10 років (2012–2021 рр.), оскільки максимальний період прогнозу складає таку ж кількість років, як і у звітному періоді. Зрозуміло, що при прогнозуванні економічних явищ на 10 років вперед суттєво зростає ризик неточності прогнозу та значного відхилення прогнозних значень даних від фактичних у майбутньому. Для того, щоб знизити цей ризик, слід застосувати у прогнозуванні сценарний підхід, зміст якого полягає у розробці сценаріїв прогнозу у ході екстраполяції тренду. На практиці сценарний аналіз реалізується через визначення інтервалів довіри або довірчих інтервалів тренду.

Встановлення довірчих інтервалів служить дієвим засобом убезпечення прогнозу від недостовірності. При цьому визначається максимальний розмах варіації прогнозного показника з урахуванням рівняння тренду і коливання спостережуваних значень динамічного ряду. Для обчислення меж коливання спостережуваного прогнозного значення від тренду обчислюється виправлена середня квадратична похибка прогнозного значення функції тренду (S_p):

$$S_p = \sqrt{\frac{\sum (y_t - \bar{y}_t)^2}{n-2}} \cdot \sqrt{1 + \frac{1}{n} + \frac{3(n+2L-1)^2}{n(n^2-1)}}, \quad (2)$$

де y_t і $\bar{y}_t$ – відповідно значення членів ряду фактичного і розрахованого за рівнянням тренду;

n – кількість членів динамічного ряду;

L – порядковий номер прогнозного року [7, с.39-40].

У сценарному аналізі довірчі інтервали встановлюються з урахуванням виправленої середньої квадратичної похибки відповідного прогнозного значення. Так, нижній довірчий інтервал відповідного прогнозного значення досліджуваного показника буде обчислено за формулою:

$$\bar{y}_{t+L} - t_a \cdot S_p, \quad (3)$$

де $\bar{y}_{t+L}$ – прогнозне значення показника, розраховане за формулою тренду у кожному з L періодів прогнозу;

t_a – табличне значення t-критерію Стьюдента з n – 1 ступенями свободи [8, с.530], $t_a = 2{,}131$.

Верхній довірчий інтервал прогнозу розраховуватиметься за формулою:

$$\bar{y}_{t+L} + t_a \cdot S_p. \quad (4)$$

У сценарному аналізі робиться припущення, що за будь-яких умов прогнозне значення аналізованого показника буде не меншим значення нижнього довірчого інтервалу і не більшим значення верхнього довірчого інтервалу. Якщо з'єднати на графіку всі значення верхнього і нижнього довірчих інтервалів, отримується площа, обмежена зверху лінією верхнього, а знизу – нижнього довірчих інтервалів, на якій розміщено всі можливі варіанти прогнозу і, відповідно, сценарії. Традиційно формують три сценарії прогнозу:

1) песимістичний – найгірший із усіх можливих сценаріїв, який формують точки нижнього довірчого інтервалу, якщо показник є стимулятором економічної безпеки, а якщо дестимулятором, то песимістичним сценарієм будуть точки верхнього довірчого інтервалу; при цьому для песимістичного прогнозу робиться припущення щодо максимального негативного впливу глобалізаційних факторів на стан економічної безпеки національної економіки;

2) найбільш імовірний – сценарій, сформований екстрапольованими точками графіку тренду, за яким робиться припущення про збереження існуючої тенденції розвитку впливу глобалізаційних факторів на стан економічної безпеки національної економіки;

3) оптимістичний – найкращий з усіх можливих сценаріїв, сформований точками верхнього довірчого інтервалу для стимулятора і нижнього для дестимулятора, та для щодо якого робиться припущення про максимально сприятливий вплив глобалізаційних факторів на стан економічної безпеки національної економіки.

Результати прогнозування факторів глобалізації економічної безпеки держави, що отримані на основі рівнянь трендів (див. табл. 2), зведено у табл. 3.

Таблиця 3

Прогнози глобалізаційних факторів на 2012-2021 рр.

Роки	Найменування глобалізаційного фактору						
	1. Курс долара США, грн.	2. Експорт у % до ВВП	3. Імпорт у % до ВВП	4. Коефіцієнт покриття імпорту експортом, %	5. Міграційний приріст у % до наявного населення	6. Прямі інвестиції з України у % до ВВП	7. Індекс FTSE 100
2011	7,9676	50,29	54,36	92,51	0,04	4,22	5572,3
2012	8,0167	53,00	51,16	104,93	0,09	4,51	6293,1
2013	8,3624	53,94	51,85	105,58	0,09	4,85	6430,9
2014	8,7081	54,88	52,54	106,22	0,10	5,19	6568,8
2015	9,0538	55,83	53,22	106,86	0,10	5,53	6706,6
2016	9,3995	56,77	53,91	107,51	0,09	5,87	6844,4
2017	9,7452	57,71	54,6	108,15	0,09	6,21	6982,3
2018	10,0910	58,65	55,29	108,79	0,08	6,55	7120,1
2019	10,4370	59,59	55,98	109,43	0,07	6,89	7257,9
2020	10,7820	60,53	56,67	110,08	0,05	7,23	7395,8
2021	11,1280	61,47	57,36	110,72	0,03	7,57	7533,6
Зміни (+, -) у 2021 р., порівняно з 2011 р.	+3,1604	+11,18	+3,00	+18,21	-0,01	+3,35	+1961,3

Джерело: сформовано та проведено розрахунки автором.

Таким чином, у табл. 3 зведено результати сценарного аналізу глобалізаційних факторів економічної безпеки національної економіки, що чинять найбільший вплив на її рівень і були введені у багатофакторну економіко-математичну модель (див. формулу 1). Найбільш імовірний сценарій прогнозу акумулює в собі прогнозні значення факторів, отримані на основі рівнянь трендів та трендового аналізу. Для визначення прогнозних значень та розробки найбільш імовірного сценарію прогнозу рівня економічної безпеки національної економіки необхідно застосувати формулу 1.

Отже, розробка найбільш імовірного сценарію прогнозу рівня економічної безпеки національної економіки полягає у підстановці прогнозних значень глобалізаційних факторів найбільш імовірних сценаріїв, що отримані шляхом використання рівнянь трендів, у формулу 1 за відповідний рік прогнозу. Песимістичний і оптимістичний сценарії прогнозу рівня економічної безпеки розробляються з використанням формул 2–4, як було раніше. Тоді результати прогнозування рівня економічної безпеки національної економіки будуть наступними (табл. 4).

Таблиця 4

Сценарії прогнозу рівня економічної безпеки України на 2012–2021 р.р., %

Прогноз показника за роками	Сценарій прогнозу		
	Песимістичний	Найбільш імовірний	Оптимістичний
2011	х	57,9	х
2012	57,81	63,55	69,30

2013	57,88	63,77	69,67
2014	57,92	63,96	70,01
2015	57,94	64,14	70,33
2016	57,94	64,29	70,64
2017	57,92	64,43	70,93
2018	57,88	64,55	71,21
2019	57,83	64,65	71,47
2020	57,76	64,74	71,72
2021	57,67	64,81	71,95
Зміни (+, -) у 2021 р., порівняно з 2011 р.	-0,23	+6,91	+14,05

Джерело: сформовано та проведено розрахунки автором

Із даних табл. 4 видно, що за умови збереження тенденцій розвитку глобалізаційних факторів найбільш імовірно, що рівень економічної безпеки національної економіки найближчих 10 років складе 64,8%, що відповідає значенню 2006 року і на 1,2% нижче історичного максимуму 66%, зафіксованого у 2007 році. Згідно з песимістичним сценарєм прогнозу, якщо негативний вплив глобалізаційних факторів буде критичним, рівень економічної безпеки залишатиметься незмінним і близьким до значення 2011 року. За оптимістичним сценарієм рівень економічної безпеки досягне 72% на кінець 2012 року, що на 8% перевищує історичний максимум, але для цього позитивний вплив глобалізаційних факторів має бути значним. Зобразимо результати сценарного аналізу результатів прогнозування рівня економічної безпеки національної економіки графічно (рис. 3).

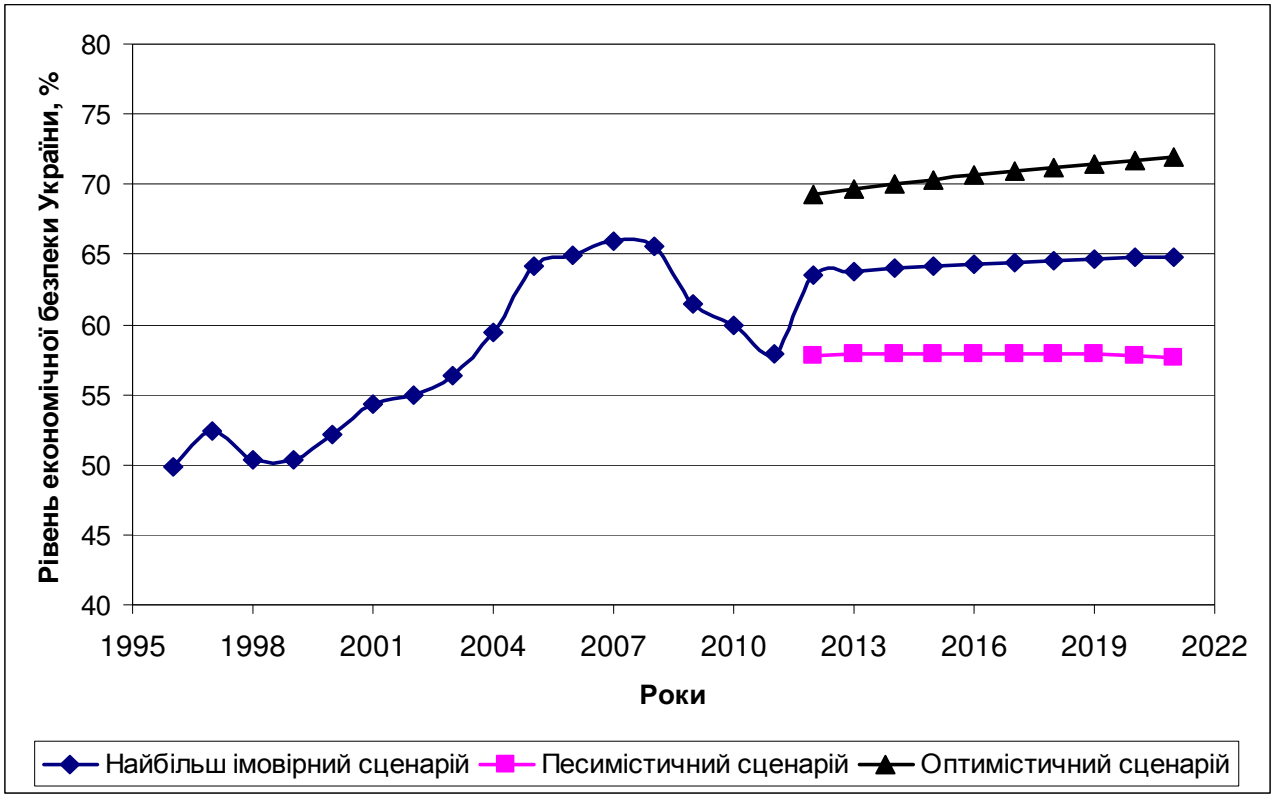


Рис. 3. Результати прогнозування рівня економічної безпеки України на 2012-2021 р.р.

Джерело: сформовано та проведено розрахунки автором на основі даних, наведених у [9] і т. 4.

Отже, в будь-якому разі, виявлені перспективи розвитку рівня економічної безпеки національної економіки дають підстави вважати, що українська економіка має необхідний потенціал до відтворення, протистояння загрозам глобалізації для управління наслідками дії глобалізаційних факторів, що дозволить забезпечити підвищення рівня економічної безпеки протягом найближчих 10 років.

Висновок. Таким чином, результати прогнозування тенденцій впливу глобалізаційних факторів на рівень економічної безпеки держави дозволили отримати три сценарії прогнозу, що будуть використані в наших подальших дослідженнях, для розробки державної стратегії забезпечення економічної безпеки національної економіки України на період до 2022 року.

Список використаних джерел

1. Сардак С.Е. Сучасні глобальні загрози та економічний розвиток / С.Е. Сардак // Науковий журнал «Бізнес Інформ». – 2010. – № 11’2010. – С. 84-86.
2. Тищук Т.А. Прогнозування зовнішньої стійкості економіки України : [аналітична доповідь] / Т.А. Тищук (кер. автор. колективу), Д.С. Покришка, Д.О. Махортих, О.В. Іванов ; за ред. Я.А. Жаліла. – К.: Національний інститут стратегічних досліджень, 2013. – 30 с.
3. Луцков В.О. Циклічність розвитку національних економічних систем в умовах глобалізації / В.О. Луцков // Науковий журнал «Вісник Чернівецького торгово-економічного інституту КНТЕУ». – 2009. – Випуск 4. – С. 50–56.
4. Офіційний сайт Державної служби статистики України. – [Електронний ресурс]. – Режим доступу: http://ukrstat.gov.ua.
5. Офіційний сайт Національного банку України. – [Електронний ресурс]. – Режим доступу : http://bank.gov.ua.
6. Офіційний сайт Лондонської фондової біржі. – [Електронний ресурс]. – Режим доступу : http://www.londonstockexchange.com.
7. Тхейл Г. Экономические прогнозы и принятие решений / Г. Тхейл ; перевод с англ. – М.: «Статистика», 1971. – 488 с.
8. Економетрія: [навч. посіб.] / [В.І. Жлуктенко, Н.К. Водзянова, С.С. Савіна, О.В. Колодінська]; за загальною редакцією С.І. Наконечного. – К. : Вид-во Європ. ун-ту, 2005. – 552 с.
9. Стан економічної безпеки України у 2011 році // Офіційний сайт Міністерства економічного розвитку і торгівлі України. – [Електронний ресурс].

Подано до редакції *28 серпня 2013 року*

Мартыненко В.В.

Прогнозирование тенденций развития экономической безопасности Украины с учетом влияния глобализационных факторов

В статье использовано многофакторная корреляционно-регрессионную модель для прогнозирования влияния глобализационных факторов на уровень

экономической безопасности государства. Автором разработан и реализован алгоритм прогнозирования тенденций развития экономической безопасности государства с учетом влияния глобализационных факторов. Обоснована целесообразность применения результатов прогнозирования при разработке государственной стратегии обеспечения экономической безопасности на период до 2022 года.

Ключевые слова: *прогнозирование, глобализация, экономическая безопасность государства, фактор, уровень, период, трендовый анализ, сценарий.*

Marynenko V.V.

Prediction of the development trends of economic security of Ukraine considering the Impact of globalization factors

In this article is used multi-factor correlation-regression model to predict the impact of globalization factors on the level of economic security of the State. The author has developed and implemented an algorithm of predicting trends of the development of the economic security of the State, considering the impact of globalization factors. The expediency of using of the results of prediction during the development of the State strategy of ensuring economic security for the period to 2022.

Key words: *prediction, globalization, economic security of the State, factor, level, period, trend analysis, scenario.*

Мартиненко Валентина Віталіївна – старший викладач кафедри економічної теорії Національного університету ДПС України.