

**КИЇВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ІМЕНІ ТАРАСА ШЕВЧЕНКА**

**ЕКОНОМІЧНИЙ ФАКУЛЬТЕТ
КАФЕДРА СТАТИСТИКИ ТА ДЕМОГРАФІЇ**



**МІЖНАРОДНА
НАУКОВО-ПРАКТИЧНА КОНФЕРЕНЦІЯ**

**«СТАТИСТИКА ХХІ СТОЛІТТЯ:
НОВІ ВИКЛИКИ, НОВІ МОЖЛИВОСТІ»**

КИЇВ 2011

**КИЇВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ІМЕНІ ТАРАСА ШЕВЧЕНКА**

**ЕКОНОМІЧНИЙ ФАКУЛЬТЕТ
КАФЕДРА СТАТИСТИКИ ТА ДЕМОГРАФІЇ**

**Статистика ХХІ століття:
нові виклики,
нові можливості**

**збірник матеріалів
міжнародної
науково-практичної конференції**

КИЇВ 2011

Статистика XXI століття: нові виклики, нові можливості. збірник матеріалів міжнародної науково-практичної конференції. К.: КНУ ім. Тараса Шевченка, 2011 р. – 122 с.

За достовірність викладення матеріалу вся відповідальність покладена на авторів.

Рекомендовано до друку Вченою радою економічного факультету Київського національного університету імені Тараса Шевченка (протокол № 8 від 21 березня 2011 року).

Редакційна колегія

Базилевич Віктор Дмитрович

д.е.н., професор, член-кореспондент НАН України,
декан економічного факультету
Київського національного університету імені Тараса Шевченка

Ковтун Наталя Василівна

д.е.н., доцент, завідувач кафедри статистики та демографії
Київського національного університету імені Тараса Шевченка

Герасименко Сергій Сергійович

д.е.н., професор кафедри статистики та демографії
Київського національного університету імені Тараса Шевченка

Пальян Зінаїда Оганесівна

к.е.н., доцент кафедри статистики та демографії
Київського національного університету імені Тараса Шевченка

Гончар Ігор Анатолійович

к.е.н., доцент кафедри статистики та демографії
Київського національного університету імені Тараса Шевченка

© Київський національний університет
імені Тараса Шевченка, 2011

РЕГИОНАЛЬНАЯ ДИФФЕРЕНЦИАЦИЯ ПО УРОВНЮ ЧЕЛОВЕЧЕСКОГО РАЗВИТИЯ В РОССИИ И РЕАЛИЗАЦИЯ ЦЕЛЕЙ РАЗВИТИЯ ТЫСЯЧЕЛЕТИЯ: СТАТИСТИЧЕСКОЕ ИЗМЕРЕНИЕ

С.Г. Бычкова,

*д.э.н., доцент, профессор кафедры статистики
Государственного университета управления, г.Москва*

Поскольку Россия является страной с большим количеством субъектов, отличающихся как по уровню экономического, так и социального развития, адаптация ЦРТ для федеральных округов и отдельных регионов имеет особое значение. Кроме того, для регионального развития страны имеются определенные особенности как в самой адаптации ЦРТ, так и в информационном обеспечении статистического анализа их реализации.

В целом для России характерен рост неравенства в доходах: если в период с 2000 по 2003г. доля беднейшей 20-ти процентной группы населения составляла в пределах 6%, то в 2008г. она опустилась до 5,1% и в 2009г. осталась без изменений. За 2000-2009гг. неравенство по доходам возросло почти во всех регионах и практически нет никаких предпосылок для его снижения. Изучение взаимосвязей между индикаторами свидетельствует о том, что в России сложилась крайне неблагоприятная ситуация – «равенство в бедности».

Во всех регионах России существуют устойчивые гендерные различия в структуре занятых по видам экономической деятельности. Соответственно такой важнейший индикатор, как соотношение заработной платы женщин и мужчин свидетельствует о гендерных диспропорциях в распределении доходов от занятости. В среднем по стране этот показатель в 2009г. составил 65%. Учитывая, что в России заработная плата является основной составляющей доходов населения, такой дисбаланс не может не сказаться на моделях потребительского поведения семей и домохозяйств.

В целом уровень младенческой смертности в регионах снизился достаточно существенно. Однако, наблюдается достаточно сильная вариация коэффициента младенческой смертности в федеральных округах. Аналогичная ситуация

отмечается с детской и материнской смертностью, однако особенностью России является то, что практически во всех регионах наблюдаются существенные различия показателей в городской и сельской местности. Проблема снижения смертности населения в регионах страны далеко выходит за рамки проблем системы здравоохранения. В регионах и в стране в целом худшее положение имеют регионы, в которых более депрессивная экономика, низкие доходы, неразвитая инфраструктура и низкая доступность услуг здравоохранения, а также экологические проблемы.

В целом по регионам России отмечается рост заболеваемости «социальными» болезнями, что является своеобразными индикатором низкого уровня и качества жизни населения. Противодействовать распространению ВИЧ-инфекции только медицинскими или карательными мерами сложно, необходимы позитивные изменения образа жизни населения.

На основе рассмотрения уровня и динамики выбросов загрязняющих веществ по регионам можно сделать вывод, что объемы выбросов загрязняющих веществ остаются достаточно постоянными и практически не снижаются на протяжении всего рассматриваемого периода. В качестве очень тревожной тенденции необходимо отметить «остаточный» принцип решения экологических проблем на региональном уровне, который не способствует решению этой проблемы и выходу страны из затяжного экологического кризиса.

В заключение необходимо отметить, что реализация ЦРТ в контексте регионального развития требует продуманных и сбалансированных программ властей, как на федеральном, так и на региональном уровне, поскольку ЦРТ не являются в полном смысле только «социальными» целями, а охватывают различные аспекты человеческого развития.

— ◇ —

НАПРЯМИ ЗАСТОСУВАННЯ КЛАСТЕРНОГО АНАЛІЗУ В ПОРІВНЯЛЬНІЙ ХАРАКТЕРИСТИЦІ КРАЇН

С.С. Герасименко,

*д.е.н., професор, зав.кафедри
ВНЗ «Національна академія правління»*

О.А. Чуприна,

*к.е.н, доцент, доцент
Харківського національного університету ім. В. Каразіна*

О.О. Чуприна,

*к.е.н, доцент, доцент Національної юридичної академії
України ім. Ярослава Мудрого*

В умовах глобалізації та підвищення, внаслідок цього, конкурентної боротьби за ресурси та ринки збуту прийняття рішень щодо інвестування вимагає вичерпної, оперативної та надійної інформації з метою зменшення ризиків підприємницької діяльності на всіх рівнях. Багатогранність ризиків та відсутність, в багатьох випадках, можливості їх кількісного виміру обумовили потребу у розподілі країн або територій за рейтингами, при визначенні яких враховуються ті чи інші характеристики – економічні, соціальні, суспільні тощо. Набори показників, що застосовуються для таких рейтингових оцінок можна називати авторським, тому що пропонуються і використовуються вони виключно авторами певних рейтингових методик часто без суттєвого обґрунтування. Більше того, без доведення або перевірки об'єктивності отриманих за допомогою вказаних методик результатів.

Найчастіше автори вказаних методик не є статистиками, а тому з множини наявних методів багатовимірних оцінок обирають найпростіший – розрахунок багатомірної середньої. При цьому, в більшості випадків, зважування показників не здійснюється, а коли здійснюється - визначення ваг відбувається експертним шляхом щодо обґрунтованості якого важко знайти якісь аргументи. Ще більш складності виникають при використанні багатомірної середньої для порівняльної оцінки соціально-економічного розвитку, коли має бути використана велика кількість досить різномірних показників.

В роботі зроблена спроба підвищити надійність порівняльних оцінок соціально-економічного розвитку країн шляхом використання для цього кластерного аналізу. Він був застосований до порівняльної оцінки розвитку країн Європи в 2005-2009 рр. Використовувалася лише офіційна інформація Євростату, що обумовило об'єктивність отриманих оцінок з точки зору надійності, тому що показники всіх країн були обчислені за однаковою методологією. Враховувався часовий лаг дії показників, що характеризували вплив чинників на досягнуті результати в соціальній та економічній сферах. Кластерний аналіз був застосований до абсолютних рівнів показників і до темпових характеристик змін їх рівнів у часі.

В подальшому дослідженні кластерний аналіз був використаний для оптимізації набору показників з метою підвищення ефективності подібних оцінок. Як відомо, досить часто, при відборі показників для оцінок певних явищ і процесів не звертають уваги, що декілька показників характеризують ту ж саму складову. В такому разі, кластерний аналіз посилює вплив цієї складової на оцінку, враховуючи її стільки разів, скільки апріорно включено подібних показників до набору. Застосуванням кластерного аналізу до набору показників були сформовані окремі їх групи, де характер дій показників на оцінку був схожий між собою. Це дозволило, використавши таблицю коефіцієнтів парної кореляції, замінити в наборі декілька показників з кожної групи на один, зменшивши їх загальну кількість. На завершення, до оптимізованої таким чином системи показників знову був застосований кластерний аналіз для здійснення порівняльної оцінки соціально-економічного розвитку країн, результати якого суттєво не відрізнялися від отриманих за повного набору показників. Таким чином, кластерний аналіз, при його застосуванні в порівняльному аналізі країн, дозволяє об'єктивно врахувати відмінності між країнами та визначити оптимальний склад набору показників, що мають бути для цього використані.

— ◇ —

ВИКОРИСТАННЯ НЕКІЛЬКІСНИХ ДАНИХ У БАГАТОВИМІРНІЙ КЛАСИФІКАЦІЇ

О.М. Гладун,

*доктор економічних наук, старший науковий співробітник,
головний науковий співробітник Інституту демографії
та соціальних досліджень НАН України імені М.В. Птухи*

В.В. Хвалинська,

*молодший науковий співробітник Інституту демографії
та соціальних досліджень НАН України імені М.В. Птухи*

У статистиці виділяють два типи даних: кількісні та не кількісні. До кількісних належать дані, виміряні на таких шкалах як інтервальна, відношень, різниць, абсолютна, до не кількісних – виміряні за номінальною або ранговою шкалою. Іноді не кількісні дані ще називають даними нечислової природи. Залежно від типів даних застосовуються різні методи обробки інформації.

Більшість процедур статистичного аналізу розроблена для кількісних даних. Проте не кількісні дані достатньо широко використовуються для опису різних об'єктів. Крім того, у багатьох випадках вони психологічно сприймаються краще, ніж кількісні дані. Доволі часто не кількісні дані отримують при проведенні різних соціально-економічних чи соціологічних обстежень. Зараз не рідкість, коли обстеження охоплені тисячі об'єктів, характеристики яких описуються сотнями показників, більшість з яких виміряна за номінальною або ранговою шкалою.

Проведення поглибленого статистичного аналізу вимагає застосування складних моделей, переважна більшість яких розроблена за умови використання тільки кількісних ознак. Тому існує нагальна потреба у розробці підходів щодо використання не кількісних даних в різних моделях.

Одним із сучасних напрямків проведення поглибленого статистичного аналізу є багатовимірний статистичний аналіз, зокрема процедури класифікації – кластерний та дискримінантний аналіз. Вони вирішують різні проблеми класифікації об'єктів: кластерний аналіз – проблему формування груп однорідних об'єктів, а дискримінантний аналіз – проблему віднесення об'єкта в одну з наперед визначених груп. Такі задачі

мають місце при економічних, соціальних, психологічних, біологічних тощо дослідженнях.

Важливою умовою застосування методів класифікації є умова, щоб змінні були кількісними, що унеможливає безпосереднє застосування даних, виміряних за ранговою чи номінальною шкалою, у відповідних моделях.

Одним із підходів щодо вирішення цієї проблеми є застосування у моделях класифікації не кількісних змінних шляхом їх перетворення у структурні змінні. Структурна змінна являє собою набір (вектор), кількість елементів якого відповідає кількості значень, що має шкала вимірювання ознаки. При цьому тільки один елемент вектора має значення одиниця (якому відповідає значення змінної), а всі інші – нульове.

З метою перевірки можливості застосування цього підходу були використані реальні дані обстеження умов життя домогосподарств, яке проводиться Держкомстатом України.

Спочатку були побудовані класифікаційні моделі по змінних, виміряних за кількісною шкалою. Після цього по цих змінних були виділені певні інтервали (що означало перехід до рангової шкали) і сформовані структурні змінні. Затим були побудовані такі ж самі моделі з використанням структурних змінних. Адекватність моделей перевірялась шляхом співставлення результатів двох класифікацій. У підсумку були отримані майже однакові результати, що дозволяє зробити висновок щодо можливості використання структурних змінних у моделях класифікації. Одночасно це означає можливість використання у моделях не кількісних даних у вигляді структурних змінних.

Отримані результати надають можливість розширити сферу застосування методів багатовимірної класифікації шляхом використання у моделях змінних, виміряних за ранговою та номінальною шкалою, за умови їх попереднього перетворення у структурні змінні.

— ◇ —

ЕКОНОМЕТРИЧНИЙ АНАЛІЗ ЗОВНІШНЬОЇ ТОРГІВЛІ ТОВАРАМИ І ПОСЛУГАМИ УКРАЇНИ

В.І. Єлейко,

проф., д.е.н., завідувач кафедри економетрії та статистики,

Р.Д. Боднар,

к.ф.-м.н., доц. кафедри економетрії та статистики,

М.Я. Демчишин,

к.е.н., доц. кафедри економетрії та статистики

Львівська комерційна академія

Важливу роль в економіці країни відіграє її зовнішня торгівля. Ми розглянемо зовнішню торгівлю товарами України за 2000-2010 рр. На основі даних державного комітету статистики України бачимо, що в 2000-2004 рр. експорт товарів з України перевищував імпорт, а починаючи з 2005 року баланс зовнішньої торгівлі товарами України стає від'ємним, зменшуючись щороку до 2008 р. приблизно на 5 млрд. дол. США. Вплив світової економічної кризи проявився в тому, що цей баланс різко скоротився з -18,6 млрд. дол. США у 2008 році до -5,7 млрд. дол. США у 2009 році. У 2010 році баланс зовнішньої торгівлі товарами України знову зменшився до -9,3 млрд. дол. США. Річні баланси зовнішньої торгівлі послугами України за вказаний період були додатними. Вплив світової кризи на цей баланс є незначним. Так, у 2008 році він становив 5,0 млрд. дол. США, а у 2009р. – 4,4 млрд. дол. США.

Нашою метою є дослідити експорт товарів і послуг з України та імпорт товарів і послуг в Україну за допомогою методів економетричного аналізу. Для цього ми вибрали наступні показники:

- експорт товарів з України всього;
- експорт товарів з України в країни СНД;
- експорт послуг з України всього;
- експорт послуг з України в країни СНД;
- імпорт товарів в Україну всього;
- імпорт товарів в Україну з країн СНД;
- імпорт послуг в Україну всього;
- імпорт послуг в Україну з країн СНД.

Для кожного показника на основі даних за 2000-2010 рр. побудовані моделі трендів. Ці моделі за допомогою критерію

Фішера перевірено на адекватність емпіричним даним, а за допомогою критерію Дарбіна-Уотсона – на наявність явища автокореляції залишків.

Для адекватних моделей ми побудували точковий і інтервальний (з ймовірністю 0,95) прогнози досліджуваних показників на 2011 і 2012 роки.



МОДЕЛЬ ARIMA ЯК ІНСТРУМЕНТ ПРОГНОЗУВАННЯ ТЕНДЕНЦІЙ КОН'ЮНКТУРИ РИНКУ

А. М. Єріна,

*доктор економічних наук, професор, професор кафедри
статистики ДВНЗ «Київський національний економічний
університет імені Вадима Гетьмана»*

Кон'юнктура ринку – складне і швидкоплинне явище, якому властиві такі риси: варіабельність, динамічність, циклічність. Вона досить гнучка, чутливо реагує на вплив економічних, соціально-політичних і психологічних чинників. Прагнучи рівноважного попиту і пропозиції, ринковий механізм через свій стохастичний характер виявляє постійні коливання масштабів і пропорцій ринку, різного роду структурні зрушення, зміну обсягів продажу та цін. Водночас завдяки інерційності дії фундаментальних факторів ринкова ситуація на певний момент часу залежить від ситуації попереднього періоду, що уможливорює аналіз тенденцій ринкових процесів і прогнозування їх на близьку перспективу. Інформаційна база прогнозування – часові ряди основних параметрів ринкового процесу (попиту, пропозиції, ціни). Вони мають складну внутрішню структуру і виявляють нестационарний характер. Декомпозиція часових рядів на тренд-циклічну і випадкову складові відкриває широкий простір для використання статистичних моделей, які, абстрагуючись від причин формування ринкової ситуації, спроможні досить точно описати траєкторію її зміни.

Традиційно для згладжування хаотичних кон'юнктурних коливань застосовують ковзну середню з експоненційно розподіленими вагами. Надаючи більшу вагу новій інформації,

експоненційна середня адаптується до нових умов, що робить її досить ефективним і надійним методом короткострокового прогнозування. На використанні експоненційної середньої ґрунтується сезонно-декомпозиційна модель Холта-Вінтера, в якій поєднуються тренд і сезонні цикли.

Об'єднання різних моделей в єдину суттєво розширяє область практичного їх використання. Серед такого типу моделей чільне місце посідає інтегрована модель авторегресії і ковзної середньої – Arima. Практичне її використання пов'язується з іменами Г. Бокса і Г. Дженкінса; запропоновані ними процедури формування моделі, алгоритми розрахунку параметрів і визначення прогнозів реалізовані в системі Statistica. Вид моделі Arima, адекватність її реальному процесу і прогнозні властивості залежать від порядку авторегресії p і порядку ковзної середньої q . Тренд включається в модель за допомогою оператора кінцевих різниць часового ряду d . Модель Arima порядку (p, d, q) досить гнучка і описує широкий спектр складних за своєю природою і внутрішньою структурою процесів. Зокрема, модель порядку $(p, 0, 0)$ – це авторегресійна функція; $(0, 0, q)$ – ковзна середня; $(p, 0, q)$ – комбінована модель авторегресії і ковзної середньої; $(0, 1, q)$ – експоненційна середня. За наявності сезонних коливань в моделі враховується їх періодичність з лагом, який дорівнює сезонному циклу.

Об'єднуючи різні компоненти часових рядів, модель Arima адаптується до специфіки динамічного процесу будь-якого ринку (товарного, фондового, валютного) і забезпечує належну точність прогнозів стосовно ринкової кон'юнктури. Про високі прогнозні властивості моделі свідчать результати короткострокового прогнозування цін на вторинному ринку житлової нерухомості у м. Києві. Відносні похибки прогнозу для середньої ціни 1 кв. м житла не перевищують 2%. Інформаційно-попереджувальні оцінки ринкової кон'юнктури є необхідною умовою ефективної комерційної діяльності і мінімізації комерційного ризику.

— ◇ —

КЛАСИФІКАЦІЯ МЕТОДІВ ВИЯВЛЕННЯ І ПРОГНОЗУВАННЯ ФІНАНСОВИХ МАХІНАЦІЙ

Н. В. Ковтун,

*д.е.н., професор, завідувач кафедри статистики та демографії
Київського національного університету імені Тараса Шевченка*

В наслідок фінансового шахрайства підприємства несуть значні збитки, що наносить величезну шкоду як суспільству, так і державі. За даними експертів Steele, відмивання грошей щорічно коштує державам приблизно 500 млрд. дол. Боротися з явищами такого порядку і таких масштабів не проста задача але цілком реальна. Головним чинником організації ефективного контролю і прогнозування шахрайства є оперативність їх інформаційного забезпечення. В основу пошуку і підбору ефективної методики виявлення можливих фінансових зловживань повинен бути покладений системний підхід, який побудований на основі триєдності задачі: математична, економічна і психологічна. Враховуючи комплексність проблеми і використовуючи принцип триєдності задачі, всі існуючі методи виявлення можливого обману слід розділити на три групи: математичні; аналітичні або економіко-статистичні; психологічні.

В основі використання математичних методів лежить закон Бенфорда, згідно якого чисел, що розпочинаються з одиниці, значно більше, ніж чисел, які розпочинаються з будь-якої іншої цифри. Імовірність появи цифри може бути виражена математично. Ідея Бенфорда реалізується через систему тестів: аналіз "першої цифри" і "другої цифри"; аналіз "першої і другої цифри"; аналіз "з першої по третю цифру"; аналіз "округлення"; аналіз "дублікатів". Ідея всіх тестів одна: якщо в результаті дослідження і побудови послідовності цифр емпіричних даних виявлені значні розбіжності з еталонними значеннями, то це є сигналом на проведення спеціального дослідження, яке виявить причину появи таких розбіжностей.

Друга група методів – це економіко-статистичні методи, які можна розділити на дві групи: традиційні і автоматизовані методи. Традиційні методи засновані на обліку взаємозв'язку і взаємообумовленості різних економічних показників, які в

умовах нормальної економічної діяльності пов'язані між собою до них належать: метод пов'язаних зіставлень; метод спеціальних розрахункових показників; метод стереотипів; метод скорегованих показників.

Автоматизовані методи виявлення і запобігання шахрайству засновані на застосуванні комп'ютерних технологій. Вони дозволяють автоматизувати і ефективніше використовувати додаткові дані, отримані з детальних звітів для виявлення і прогнозування шахрайства шляхом застосування складного і статистично достовірного аналізу. На основі побудови моделей ситуацій виявляють підозрілі випадки імовірного шахрайства. Побудова моделей ситуацій базується на статистичних методах аналізу інформації таких як: аналіз викидів; виявлення незвичайних значень; виявлення незвичайних залежностей. Для оцінки специфічних даних що дозволяють підозрювати шахрайство, застосовуються прогностичні методи, які бувають чисельними або текстовими.

Не менш ефективним додатковим засобом є психофізіологічні методи виявлення обману, які діляться на дві групи: невербальні методи і вербальні методи. Невербальний рівень включає аналіз міміки, жестів, мікрорухів і зовнішніх проявів діяльності внутрішніх органів. Вербальний аналіз включає як логічний аналіз отриманої інформації, так і співвідношення вимовлених слів з сигналами невербального рівня.

Таким чином, на сьогодні існує цілий спектр методів і прийомів, які дозволяють виявити фінансові махінації. Однак лише комплексне їх застосування на принципах системного підходу забезпечує належний ефект і дає можливість не лише виявляти, а і прогнозувати шахрайство у фінансовій сфері. Так, Закон Бенфорда дозволяє не лише відшукати аномалії в статичних даних, але і організувати постійний моніторинг операційної діяльності як у вартісних, так і в натуральних величинах. Закон Бенфорда формальний, а тому усі перевірки можуть бути повністю автоматизовані. Це дозволяє перевіряти достовірність абсолютно усіх операційних даних без залучення додаткових людських ресурсів. Економіко-статистичні методи виявлення і запобігання шахрайству засновані на застосуванні комп'ютерних технологій, що дозволяє автоматизувати процедуру пошуку, а також ефективно використовувати

додаткові дані для виявлення і прогнозування шахрайства на базі методів статистичного аналізу. І врешті решт, психофізіологічні методи є додатковим ефективним засобом виявлення обману із застосування вербальних і невербальних технологій.



НАПРЯМКИ УДОСКОНАЛЕННЯ СТАТИСТИКИ ДЕРЖАВНИХ ФІНАНСІВ УКРАЇНИ

Р.М. Моторин,

д.е.н., професор,

завідувач кафедри обліку, аудиту і статистики

Українського державного університету

фінансів та міжнародної торгівлі

Статистика державних фінансів (система СДФ) є міжнародним стандартом та інформаційною базою для податково-бюджетного аналізу і відіграє життєво важливу роль як у розробці моніторингу обґрунтованих фінансових програм, так і в здійсненні нагляду за заходами економічної політики. Система СДФ передбачає ведення обліку за методом нарахування, розробку балансів активів і пасивів та повне охоплення державної економічної та фінансової діяльності. Хоча на сьогодні лише кілька країн у змозі забезпечити відповідність вимогам стандартам, встановленим у системі СДФ, але кількість таких країн постійно зростає.

Мета системи СДФ полягає в тому, щоб забезпечити комплексну концептуальну й облікову основу, придатну для аналізу й оцінки податково-бюджетної політики, та результатів діяльності сектору державного управління і більш широкого — державного сектору економіки країни.

Впровадження цілком інтегрованої системи СДФ в Україні вимагає певного часу, і темпи цієї роботи визначатимуться специфічними для України потребами й обставинами. Зокрема, необхідно переглянути базові системи обліку щодо дотримання принципу нарахування, відповідність українських класифікацій щодо міжнародних системи СДФ. Важливо пам'ятати, що

незважаючи на використання при описі системи СДФ стандартних термінів бухгалтерського обліку, вона є системою статистичної звітності, що може за багатьма важливими аспектами відрізнитися від базової системи фінансової звітності, на основі якої ґрунтуватиметься значна частина статистики СГФ.

На першому етапі переходу доцільно впровадити переглянуту класифікаційну структуру звіту про операції органів державного управління чи звіту про джерела і використання коштів і внести корегування в існуючу статистику побудовану за касовим методом, щоб урахувати відомі недоліки такої статистики, наприклад, включивши до неї інформацію про прострочену заборгованість по доходах чи витратах. Окремим напрямом повинно стати збирання балансової інформації про фінансові активи і зобов'язання, що дасть змогу оцінити інші економічні потоки в системі, пов'язані з цими фінансовими статтями. Складним етапом також є організація збору повної інформації про запаси нефінансових активів на певний момент часу, і їх оцінка у поточних ринкових цінах. На заключному етапі може бути введена повністю розроблена система обліку за методом нарахування, яка забезпечує можливість підготовки повних балансів активів і пасивів.

Наведена послідовність напрямів адаптації статистики національних державних фінансів до міжнародних вимог прискорить процес входження України у європейський статистичний простір.

— ◇ —

ОЦІНКА РОЗВИТКУ ПОПУЛЯЦІЇ ЗАХІДНОЇ ПОЛЬЩІ В СВІТЛІ ДРУГОГО ДЕМОГРАФІЧНОГО ПЕРЕХОДУ

Д-р. хаб., проф. Ян Парадиш, Кароліна Парадиш,

*Центр Регіональної Статистики
Економічний Університет в Познані*

Після Другої Світової Війни Польща суттєво змінила свої кордони. Окрім зміни кордонів на сході, Польща втратила частину Литви, а також західні території Білорусії і України. В склад Польщі в теперішніх кордонах увійшли східні і північні території передвоєнної Німеччини. В результаті зміщення кордонів відбулися переселення населення. Населення німецького походження виселили в декількох етапах в Німеччину. На понімецькі території, які називали в часи ПНР Поверненими Землями або Західними і Північними, переселили польське населення зі згаданих територій колишнього СРСР і з так званих Давніх Земель.

Від самого початку Північні і Західні Землі суттєво відрізнялися від Давніх Земель демографічними процесами: коротша тривалість життя, вищий показник народжуваності, а також вдвічі вищий відсоток позашлюбних народжень.

Після 1990 р. з'явилися такі нові тенденції в демографічному розвитку Польщі, як: значне зростання тривалості життя, спадання сумарних коефіцієнтів шлюбності, довготривале зменшення кількості дітей, зростання середнього віку укладення шлюбів і народжування дітей, зростання відсотка позашлюбних народжень і розлучень. На основі цього оцінюється поширення нових форм шлюбного і сімейного життя. Польські демографи (І. Котовська, Й. Куркевич) вважають це початком другого демографічного переходу. Оцінка нових явищ демографічного розвитку Західних Земель Польщі буде предметом нашого паперу.

— ◇ —

NEW DIRECTIONS OF BUSINESS STATISTICS IN FINANCE AND AUDITING

*Dr. hab., prof. Józef Pocięcha,
Cracow University of Economics*

The paper presents a review of some contemporary directions in business statistics applied in financial and auditing investigations. The purpose of the paper is to inspire a new approach to business statistics, especially in area of finance and auditing.

Traditionally understood course of business statistics contains a regular course of statistics with applications to the analysis of business and managerial problems. In fact, statistical methods are universal with possible applications in natural sciences, social sciences, economics . business, psychology, humanities.

All traditional handbooks of business statistics are methodologically oriented according logical sequence of statistics. This type of presentation is not useful for users, because on the first place put statistical methods, but not problems which could be solved using statistical methods. This is the first, among many other reasons, that statistical methods are not enough frequently used as a tool for business and management analysis. The proper approach is first to define a real economic or managerial problem and then, look for an appropriate statistical techniques for solving the problem. This is problem oriented approach in statistical investigations. It ought to be preferred, when we want propagate statistical methods in business analysis.

A new, contemporary important directions of business statistics, are applications of business statistics methods in auditing and bankruptcy prediction. These, problem oriented approaches are presented in the paper.

Risk management approach is very important in searching and solving many accounting problems. A risk-based audit approach can detect errors and irregularities at the financial statement. Audit risk model is the useful tool for risk management in auditing. It can be used to determine the nature, timing and extend of audit procedures. Statistical inference methods are useful for estimation of such model. But in practice there are arising serious problems, which are discussed in the paper. Audit sampling for tests of controls could asses control risk to the objectives and elements of the internal

control structure. Audit sampling for substantive tests gives the possibility of describing achieved allowance for sampling risk at the level of account balance or financial statement disclosure. Applications of modified statistical tests are one of a new directions of business statistics in auditing.

The classical approach to bankruptcy prediction represents various rating procedures and forecasting models. The predictions of financial distress usually employ various techniques of multivariate statistical analysis. General classification of bankruptcy prediction methods and models distinguish: univariate ratio models, multiple discriminant analysis, linear probability models, multivariate conditional probability models such as Logit and Probit, recursive partitioning models, survival analysis (proportional hazard model), expert systems, mathematical programming, neural networks, rough sets approach. In all this methods we employee a various business statistics methods. More popular methods and their world and Polish applications for bankruptcy prediction are discussing in the paper. It discusses also the problem of corporate bankruptcy predictions in changing business cycles. Bankruptcy prediction is dependent on the quality of corporate management, the company's efficient operations as well as other internal microeconomic and external macroeconomic factors reflected in a given business cycle. In all this methods we employee a various business statistics methods.



ПРОБЛЕМИ СТАТИСТИЧНОГО ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ МОДЕЛЮВАННЯ ПРИ РОЗРОБЦІ СОЦІАЛЬНОЇ ПОЛІТИКИ В УКРАЇНІ

В.Г. Саріогло,

*д.е.н., с.н.с, зав. відділом соціально-демографічної статистики
Інституту демографії та соціальних досліджень
імені М.В. Птухи НАН України*

За останні два десятиріччя у світі відбулися помітні зміни у визначенні пріоритетів суспільного розвитку - акценти все більш зміщуються у бік соціальних проблем у порівнянні з проблемами економіки, вимоги до дієвості та ефективності соціальної політики підвищуються, а завдання, які необхідно

вирішувати при розробці та реалізації політики, неухильно ускладнюється. Це призвело до того, що суттєво змінилися потреби в інформаційному забезпеченні соціальної політики. Інструменти вимірювання актуальних соціальних, соціально-демографічних і соціально-економічних явищ і процесів, які ефективно використовувались у розвинених країнах протягом другої половини двадцятого століття, і які були для пострадянських країн достатньо новими і прогресивними, у сучасному глобальному світі виявилися застарілими і недостатньо ефективними.

Одним з ефективних методологічних підходів, який, певною мірою, забезпечує можливість покращання інформаційного забезпечення розробки, реалізації та оцінки впливу соціальної політики, є моделювання основних процесів з використанням даних з різних джерел та рівнів агрегації, включаючи мікрорівень. Розроблені та використовуються при розробці офіційної (державної) політики декілька статичних та динамічних моделей. Яскравим прикладом такої моделі є EUROMOD, яка дозволяє достатньо адекватно аналізувати цілий спектр процесів у системі «податки - витрати» і впроваджена практично у всіх країнах ЄС та впроваджується ще у декількох країнах іншого звіту, зокрема у ПАР. Статистичними службами Канади та Австралії розроблені та удосконалюються декілька моделей для аналізу та прогнозу демографічних процесів, які необхідно відслідковувати для забезпечення ефективності пенсійної системи, системи соціальної допомоги, системи охорони здоров'я та ін.

У доповіді зазначається, що основою зазначених моделей є репрезентативні синтетичні сукупності населення (домогосподарств) з набором необхідних характеристик. Таким чином, хоча моделі, які застосовуються при розробці соціальної політики, є фактично моделями змішаного типу (макро- і макрорівня), основні результати моделювання отримуються у вигляді досліджуваних характеристик на рівні домогосподарств або осіб. Це дозволяє здійснювати детальний аналіз процесів або прогнозувати наслідки політики фактично для будь-яких груп одиниць сукупності та безпосередньо аналізувати розподільчі ефекти від заходів політики або кризових явищ чи економічного розвитку за тим чи іншим сценарієм.

Особливу увагу в доповіді приділено ролі статистичного забезпечення моделювання. Хоча моделі соціальних систем не є чисто статистичними, а є, певною мірою, імітаційними, якість даних, що використовуються при побудові моделей та моделюванні, відіграє вирішальну роль при їх застосуванні. Чим більшою є роль статистичного інструментарію при моделюванні, тим більш надійними та контрольованими є отримані результати.

Певна увага приділена питанням визначення переваг та недоліків підходу на основі мікромоделювання у порівнянні з класичними підходом до оцінювання показників. Зокрема визначено, що при використанні методів мікромоделювання доцільно враховувати, що класичний підхід, за яким, наприклад, розподіл доходів, показники бідності та диференціації доходів оцінюються на основі мікроданих обстежень домогосподарств (коли дані зафіксовані зі слів респондентів) призводить, як правило, до недооцінки доходів навіть бідніших верств населення. Водночас, підхід на основі мікромоделювання податків-виплат має тенденцію до переоцінки доходів.



МЕТОДОЛОГІЧНІ ПІДХОДИ ДО ПІДВИЩЕННЯ НАДІЙНОСТІ ОЦІНЮВАННЯ ІНДЕКСУ СПОЖИВЧИХ ЦІН В УКРАЇНІ

В.Г. Саріогло,

*д.е.н., с.н.с, зав. відділом
соціально-демографічної статистики,*

М.Ю. Огай,

*к.е.н., старший науковий співробітник
відділу соціально-демографічної статистики,
Інститут демографії та соціальних досліджень
імені М.В. Птухи НАН України*

Індекс споживчих цін (ІСЦ) є одним з основних макроекономічних показників, що характеризують стан економіки будь-якої країни сучасного світу. Він використовується як показник інфляції і як один з основних показників вартості життя. З урахуванням ІСЦ здійснюється індексація заробітних плат і соціальних виплат, визначаються

кредитні ставки, аналізуються та прогнозуються найбільш актуальні економічні процеси тощо. Це означає, що наявність у оцінці ІСЦ похибки у будь-який бік призводить до викривлення уявлень щодо реального економічного стану держав, призводить до прямих втрат коштів державними бюджетами або населенням і багатьма державними і недержавними організаціями, знижують загальну ефективність функціонування економік та суттєво погіршують прогнозованість економічного розвитку. Саме тому проблемам надійного визначення та підвищення якості оцінювання ІСЦ протягом останніх п'ятнадцяти років приділяється значна увага у багатьох країнах світу.

Як відомо, оцінка ІСЦ, як і будь-якого іншого показника, характеризується двома типами похибок: випадковою та систематичною. Виникнення випадкових похибок зумовлено, головним чином, тим, що ІСЦ розраховується за даними вибірових обстежень (обстеження споживчих витрат населення та цін). Систематична похибка (зміщення), виникає через особливості методології розрахунку ІСЦ, зміщення оцінок показників за результатами вибірових обстежень, що використовуються при розрахунках ІСЦ тощо. Зокрема, вагома складова зміщення оцінки ІСЦ є основним наслідком недоохоплення заможних верств населення внаслідок невідповідей в національних обстеженнях доходів та витрат домогосподарств.

В доповіді представлено оцінки похибок розрахунку ІСЦ в Україні. Наведено рекомендації щодо підходів до зменшення похибок оцінювання ІСЦ. При цьому запропоновано три основні підходи, які можна застосовувати як одночасно, так і окремо один від одного. Ефективність підходів апробовано на реальних даних.

Перший підхід, це застосування процедур калібрації статистичних ваг державного вибірового обстеження умов життя домогосподарств (ОУЖД) з урахуванням адміністративних даних, зокрема даних енергопостачаючих компаній щодо обсягів середньомісячної сплати домогосподарствами за спожиту електроенергію. Доведено, що на даному етапі таке коригування доцільно здійснювати лише з метою підвищення адекватності структури споживчих витрат домогосподарств для розрахунку ІСЦ.

Другий підхід, це калібрація вагової структури ІСЦ, розрахованої за результатами ОУЖД, з урахуванням даних національних рахунків щодо кінцевого споживання домогосподарств. Це забезпечує мінімальні відхилення вагових структур ІСЦ до та після калібрації та відповідність ваг окремих товарів (послуг) - представників (або ваг груп товарів та послуг) обмеженням, встановленим на основі додаткових даних.

Третій підхід, це урахування при розрахунках ІСЦ рівня надійності показників споживчих витрат домогосподарств, які використовуються при визначенні вагової структури ІСЦ, та визначення характеристик надійності оцінювання ІСЦ. Застосований метод узагальнених функцій дисперсії уможливив отримання характеристик надійності для показників груп споживчих витрат домогосподарств, які використовуються при визначенні вагової структури ІСЦ. Слід зазначити, що цей підхід в цілому не дозволяє зменшити похибки оцінювання ІСЦ, але забезпечує можливість їх контролю.



СТАТИСТИЧНА ОЦІНКА ЗБАЛАНСОВАНOSTІ ЗОВНІШНЬОЇ ТОРГІВЛІ УКРАЇНИ

А.В. Сидорова,

*д.е.н., професор, зав.кафедри економічної статистики
Донецького національного університета*

Актуальною для України є проблема збалансованості зовнішньої торгівлі через оптимізацію структури експорту і імпорту. Починаючи з 2006 р. спостерігається негативне сальдо торгового балансу, яке збільшилося від -2,97 (у 2006 р.) до -13,31 млрд.грн. (у 2008). Навіть у кризовому 2009 р. імпорт перевищував експорт на 1,38 млрд.грн. Негативні тенденції збільшення імпорту і уповільнення темпів зростання експорту викликають загострення дефіциту торгового і платіжного балансів, не стимулюють соціально-економічні процеси в країні за рахунок зовнішньоекономічної діяльності.

Структура експорту характеризується сировинною спрямованістю, в ньому переважає продукція невисоких переділів. У імпорті велика частка аналогічної продукції. Якщо

розвинені країни експортують високотехнологічну продукцію, то Україна в 2009 р. експортувала 32,3% (12,82 млрд. дол.) металопродукції і в той же час імпортувала 32,8% мінеральних продуктів; продукції тваринного походження на експорт поставлено на 596 млн. дол. (1,2%), а отримано по імпорту – 1267,7 млн.долл. (2,5%); експорт готових продуктів харчування (2088,1 млн. дол.) трохи перевищував імпорт (2034,3); продуктів рослинного походження в експорті - 12,7%, в імпорті – 2,8%; механічне устаткування, машини і механізми відповідно - 12,6%, і близько 14%. Україна імпортує як енергетичні, так і неенергетичні товари.

Впродовж 2001-09 рр. енергетичний імпорт (ввезення кам'яного вугілля, сирої нафти і природного газу) займає практично третину всієї продукції, що імпортується, не маючи альтернативи усередині країни, тому зростання цін на нього автоматично означає підвищення цін усередині країни. Відмовитися від ввезення енергетичного імпорту Україна не може. Неенергетичний імпорт – це решта товарів, які можуть бути замінені аналогічними, які Україна не тільки ввозить, але і експортує. Отже, завданням є заміна частині імпорту вітчизняними товарами при підвищенні їх якості.

Залежність імпорту під впливом соціально-економічних чинників досліджено на основі кореляційно-регресійного аналізу. Оцінена залежність енергетичного імпорту від ВВП, цін на нафту і валютного курсу; залежність неенергетичного імпорту – від ВВП, індексу споживчих цін і курсу валют. Побудовані степеневі моделі показали: зростання енергетичного імпорту на 0,83% при збільшенні ВВП на 1%, що свідчить про його високу енергоємність. Зростання цін на нафту (яку країна ввозить, а ціна є базою для розрахунку ціни на газ) на 1% приводить до зростання енергетичного імпорту на 0,264%.

Ще більша залежність встановлена для неенергетичного імпорту: при зростанні ВВП на 1% неенергетичний імпорт збільшується на 1,809%. Це викликає необхідність імпортозаміщення за рахунок виробництва аналогічних товарів усередині країни. Вплив споживчих цін на 1% викликає зростання неенергетичного імпорту на 2,435%, тобто знецінення національної валюти вимагає більших витрат на оплату імпорту. Виявлені взаємозв'язки можуть бути використані при

збалансуванні зовнішньої торгівлі. Це свого роду «важелі», на які може впливати держава від час формування політики ЗЕД.

Розраховані моделі дозволили виконати прогнози: енергетичний імпорт в 2011-14рр. зростатиме. Для його зменшення необхідна зміна структури виробництва і зниження енергоємності промисловості. Зростання неенергетичного імпорту буде в 2010-11рр., тому що для заміщення імпорту розвиток видів економічної діяльності (сільського господарства, харчової і легкої промисловості, автомобілебудування і ін.) не може різко збільшитися найближчими роками у зв'язку з наслідками кризи, дорогим і невигідним кредитуванням, нестачею інвестицій. Отже, більш якісні і дешеві товари будуть як і раніше, імпортуватися. Зниження неенергетичного імпорту може початися з 2012 р., це дозволить розширити внутрішній ринок, збільшити кількість робочих місць, забезпечити імпортозаміщення, зменшити витрати валюти на імпорт, скоротити негативне зовнішньоторговельне сальдо країни.



СТАТИСТИЧЕСКАЯ ОЦЕНКА ПРОДОЛЖИТЕЛЬНОСТИ ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПЕРИОДОВ В ЖИЗНЕДЕЯТЕЛЬНОСТИ ЧЕЛОВЕКА

Н.В. Агабекова,

*канд. экон. наук, доцент, заведующая кафедрой статистики
Белорусского государственного экономического университета*

Глубокая и масштабная трансформация человеческого потенциала Республики Беларусь, прошедшая за последние 20 лет, поставила проблему его адекватности задачам переориентации современной экономика страны на инновационный путь развития, а также соответствия его количественных и качественных характеристик современному этапу развития общества. К настоящему времени по многим ключевым параметрам накопления и использования человеческого потенциала в Республике Беларусь отсутствуют надежные количественные оценки. Вместе с тем, очевидно, что наличие аналитической информации по данному кругу проблем имеет принципиально важное значение для формирования как

политики в области занятости, так и социально-демографической политики. Сохраняющийся информационный вакуум во многом связан с отсутствием представительных баз данных об изменениях в трудовом поведении населения республики на протяжении длительных периодов времени.

Между двумя главными событиями в жизни человека: моментом рождения и моментом смерти, с индивидуумом происходит огромное количество самых разнообразных событий. Начало и конец таких дат можно ограничить двумя промежуточными точками, расстояние между которыми будет характеризовать продолжительность данного состояния, в котором находится человек. По характеру нашего исследования – это длительность на линии жизни тех периодов, которые имеют отношение к его хозяйственной деятельности. Самой важной при этом является оценка продолжительности периодов жизнедеятельности человека по отношению к процессу производства и определении места того или иного периода с точки зрения производства и потребления. Такая оценка основана на использовании показателей, отражающих длительность пребывания условного поколения в состоянии рабочей силы с универсальной единицей измерения – число человеко–лет экономически активной жизни. В условиях инновационного подхода к развитию экономики, когда требуется более объективная информация о состоянии трудового потенциала республики, разработка и анализ таких показателей представляет несомненный интерес.

Изучение продолжительности периода трудовой активности с помощью модели типа «включение-выпадение» основано на оценке мобильности рабочей силы. Ключевой статистической величиной, лежащей в основе таблиц, является вероятность перехода, определенная из наблюдаемого распределения «включения – выпадения» из состава рабочей силы для каждого возраста. Мультистатусная таблица продолжительности периодов труда и иждивенчества представляет собой таблицу смертности по состоянию и в отличие от традиционных таблиц относится к двумерной.

Результаты построения таблиц продолжительности периодов труда и иждивенчества демонстрируют достаточно широкие и интересные возможности интегрированного анализа экономико-демографических взаимосвязей. Рассчитанные показатели

характеризуют соотношение между трудовым и жизненным потенциалом поколений, служат представительными оценками при измерении эффективности функционирования человеческого потенциала в Республике Беларусь, являются ключевыми при решении проблем формирования и использования трудовых ресурсов, а также расширяют аналитические возможности в определении механизмов рационализации трудовой занятости населения.



ПОДХОДЫ К СТАТИСТИЧЕСКОЙ ОЦЕНКЕ КОНКУРЕНТОСПОСОБНОСТИ БРЕНДОВ

А.В. Анисимова,

*к.э.н., кафедра экономической статистики
Донецкий национальный университет*

В настоящее время развитие предприятий во многом обусловлено успешным менеджментом, маркетинговой политикой, в частности, качественным позиционированием товаров и услуг, а также их брендингом. В научной литературе существует множество вариаций понятия брендинг, однако в основе они включают процессы разработки, продвижения и развития бренда, под которым понимается, с одной стороны, известная торговая марка, с другой стороны, технология завоевания и удержания потребителя.

В связи с этим в процессе брендинга возникают закономерные вопросы правильного определения и оценки таких категорий, как лояльность потребителя, известность бренда, качество бренд-имиджа и т.д. Зарубежные и отечественные исследователи в сфере брендинга рассматривают данные понятия преимущественно с позиций маркетинговых исследований, в результате чего в литературе указанные категории определяются лишь качественными признаками, что приводит к неопределенности в процессе оценки таких категорий. Так, на практике, отсутствует единый подход к оценке лояльности потребителей и известности бренда, их уровень определяется локально на выборке респондентов или

фокус-группах, при этом выборка не всегда является репрезентативной.

Учитывая вышесказанное, в работе понятия лояльности потребителя, известности бренда, качество бренд-имиджа синтезированы в единое понятие конкурентоспособности бренда, что позволяет выделить основные подходы к его статистической оценке.

Так, одним из наиболее распространенных подходов к статистической оценке конкурентоспособности объекта является метод многомерной средней, который позволяет оценить и объединить различные его признаки. Следовательно, данный метод с определенными ограничениями и допущениями может использоваться и для оценки конкурентоспособности брендов, при этом он будет оценивать фактические свойства бренда в конкретный момент времени.

Конкурентоспособность брендов в условиях высокой динамичности процессов экономического развития может изменяться во времени под действием множества факторов, как основных, так и случайных. В таких условиях возникает необходимость выделения основных факторов прямого и опосредованного воздействия на конкурентоспособность бренда, что осуществляется с помощью метода главных компонент и факторного анализа.

При этом уровень конкурентоспособности бренда является конечным результатом моделирования воздействия факторов, отражая, таким образом, не только свойства самого бренда, но и степень их изменчивости под влиянием внешних воздействий.

Предложенные подходы могут быть использованы в маркетинге и бизнес-статистике как технология практической оценки брендов, при этом единство подходов при оценке ряда брендов обуславливает возможность их сопоставления, что является основой для принятия дальнейших управленческих решений по развитию бренда.

— ◇ —

СТАТИСТИЧНІ МЕТОДИ ОЦІНКИ СХИЛЬНОСТІ ПІДПРИЄМСТВА ДО БАНКРУТСТВА

В.В. Вірченко,

*к.е.н., доцент кафедри економічної теорії Київського
національного університету імені Тараса Шевченка*

Боротьба із наслідками світової фінансової кризи вимагає стабілізації національної економіки, активного стимулювання економічного зростання і переорієнтації суб'єктів господарювання на використання новітніх досягнень у галузі управління бізнес-процесами. Важливим фактором конкурентоспроможності підприємства на сучасному етапі розвитку економічних відносин є ефективний фінансовий менеджмент, принциповою складовою якого є система антикризового управління. Особливою ваги антикризове управління набуває в умовах вітчизняної економіки. Адже протягом 2009 р. в Україні було розпочато провадження у справах про банкрутство 15,64 тис. підприємств. Водночас, важливим елементом антикризового управління є прогнозування банкрутства, що ґрунтується на методах оцінки ймовірності втрати платоспроможності суб'єктами господарювання.

Одними з перших досліджень у галузі оцінки схильності підприємства до банкрутства є праці А. Вінакора та Р. Сміта, які проаналізували результати діяльності 183 підприємств з 1921 р. по 1930 р.; П. Фіцпатріка, який провів аналіз результатів діяльності 39 підприємств по 13 коефіцієнтам за 1920-1929 рр.; К. Мервіна, який дослідив звітність 939 компаній за період з 1926 р. по 1936 р. Усі дослідники намагалися розробити методику прогнозування банкрутства на основі аналізу окремих фінансових коефіцієнтів (поточної ліквідності, фінансової незалежності, забезпеченості власними оборотним капіталом, тощо).

Аналізуючи досягнення сучасної економіки та статистики, на нашу думку слід виділити з групи методів оцінки схильності підприємства до банкрутства: 1. Методи, що ґрунтуються на рейтинговій оцінці переважно якісних ознак та параметрів діяльності компаній (метод А-рахунку Аргенті, метод Скоуна, метод Ковальова, тощо); 2. Методи, що ґрунтуються на рейтинговому аналізі фінансових коефіцієнтів (метод Бівера,

метод Дюрана, методика Казанського державного університету, методика Л.В. Донцової та Н.А. Нікіфорової, тощо); 3. Методи, що базуються на лінійному дискримінантному аналізі і побудові регресійних моделей (моделі Альтмана, Дж. Блісса, Р.С. Сайфуліна та Г.Г. Кадикова, Г.В. Давидової та А.Ю. Белікова, Р. Тафлера та Г. Тішоу, Дж. Фулмера та Г. Спрінгейта, тощо).

Ілюстрацією методів третьої групи може слугувати модель Г. Спрінгейта. Модель була розроблена у 1978 р. на основі аналізу показників діяльності 40 компаній і з використанням розробок Е. Альтмана. Під час розробки моделі Г. Спрінгейтом було проаналізовано 19 фінансових коефіцієнтів, з яких у підсумку він обрав 4: А – відношення оборотних активів до валюти балансу; В – відношення прибутку до сплати податків і відсотків до валюти балансу; С – відношення прибутку до оподаткування до короткострокових (поточних) зобов'язань підприємства; D – відношення чистого доходу до валюти балансу. На основі дискримінантного аналізу було побудовано наступну регресійну модель Z-рахунку:

$$Z = 1,03*A + 3,07*B + 0,66*C + 0,4*D$$

Автором було визначено, що: якщо Z менше або дорівняє 0,862 – ймовірність банкрутства підприємства є високою; якщо Z більше 0,862 – ймовірність банкрутства підприємства у майбутньому є мінімальною. Модель дозволяє прогнозувати банкрутство протягом 1 року з точністю 93%.

Підсумовуючи слід зазначити, що застосування методів прогнозування банкрутства, заснованих на лінійному дискримінантному аналізі, в рамках системи антикризового управління підприємства дозволяє ефективно оцінити ймовірність неплатоспроможності у майбутньому і вжити відповідних заходів. Водночас, застосування подібних методик, розроблених західними економістами, на вітчизняних підприємствах вимагає їх удосконалення з метою адаптації до особливостей національної економіки та галузевої специфіки.

— ◇ —

СУЧАСНІ ТЕНДЕНЦІЇ РОЗВИТКУ СТРАХОВОГО РИНКУ В УКРАЇНІ

Л.Ф. Волохова,

*к.е.н., доцент кафедри статистики та демографії
Київського національного університету імені Тараса Шевченка*

Стратегією розвитку сучасного страхового ринку є впровадження нових сучасних технологій бізнес-процесів, підвищення інноваційних можливостей виробництва, виведення на якісно новий рівень страхових продуктів та обслуговування клієнтів. Страхові компанії України прагнуть до високого професійного рівня, динамічного розвитку та активної співпраці як в Україні так і за її межами.

Такі компанії–лідери як НАСК „Оранта”, СК „Кредо-Класік” сприяють розвитку авіаційного, морського та автомобільного транспорту, ядерної промисловості, страхують сільськогосподарські ризики, антитерористичну діяльність тощо. Прикладом інтегрованості у глобальний страховий ринок є українська страхова компанія „Лемма” (м.Харків), яка активізує роботу в галузі аерокосмічного страхування, приймаючи на перестраховування ризики як з Росії, так і з інших країн.

Аналіз сучасного стану, тенденцій і проблем розвитку вітчизняного страхового ринку свідчить про певні здобутки та численні недоліки, притаманні функціонуванню як окремих страхових компаній, так і всієї системи страхування. Так, загальна кількість страхових компаній станом на 31.12.09 становила 469, з них 72 компанії - зі страхування життя (СК “Life”) та 397, що здійснювали інші види страхування, ніж страхування життя (СК “non-Life”).

За даними аналітичної фінансової групи "Кредо" загальна (валова) сума страхових премій, отриманих страховиками при страхуванні та перестраховуванні ризиків від страхувальників та перестраховувальників за 2010 рік, становила 20573,5 млн. грн., з них 5983,0 млн. грн. (29,1%) - премії, що надійшли від фізичних осіб; 8742,3 млн. грн. (42,5%) - премії, що надійшли від юридичних осіб; решта 5848,2 млн. грн. (28,4%) - премії, що надійшли від перестраховувальників. За 2010 рік сума отриманих страховиками премій з видів страхування, інших, ніж

страхування життя становила 19 872,4млн. грн. (або 96,5% від загальної суми страхових премій), а зі страхування життя - 701,1 млн. грн. (або 3,5% від загальної суми страхових премій). Сума чистих страхових премій (валові премії за мінусом коштів з внутрішнього перестрахування) становила 12748,0 млн. грн. , що складає 62% від валових страхових премій. Це менше у порівнянні з аналогічним періодом 2009 року (відповідно на 14,9% та на 20,8%).

Розмір валових страхових виплат за 2010 рік становив 7258,7 млн. грн., в тому числі з видів страхування, інших, ніж страхування життя — 7202,4 млн. грн. (або 99,2%), зі страхування життя — 56,3 млн. грн. (або 0,8%). Рівень страхових виплат за результатами 2010 року мав позитивну динаміку зростання: рівень валових виплат склав 35% (за результатами 2009 року — 33%), рівень чистих виплат — 51,0% (за результатами 2008 — 50%).

Разом з тим, основною проблемою для страховиків залишається недостатність ліквідних фінансових інструментів для проведення ефективної політики інвестування коштів. У зв'язку з призначенням тимчасової адміністрації в банківських установах, у яких відкриті депозити страховиків, зростають ризики невиконання зобов'язань перестраховиками - резидентами.

Таким чином розвиток страхового ринку України стримує дія наступних факторів: відсутність державної політики розвитку як економіки в цілому, так і програми державної політики розвитку ринків фінансових послуг, неузгодженість господарського і страхового законодавства, недосконалість податкового законодавства, нестабільність фінансового середовища господарюючих суб'єктів і населення, слабкість стимулів у розвитку страхування. Актуальність питання розвитку страхового ринку України обумовлює необхідність розробки державної політики ефективного розвитку страхування у поєднанні з загальнонаціональними економічними пріоритетами.

— ◇ —

РОЛЬ ВИКЛАДАЧІВ І ВИПУСКНИКІВ КИЇВСЬКОГО УНІВЕРСИТЕТУ СВ. ВОЛОДИМИРА У ГЕНЕЗИСІ ВІТЧИЗНЯНОЇ СТАТИСТИЧНОЇ НАУКИ

Е.В. Галицька,

*к.е.н., професор кафедри фінансів
Національного університету «Києво-Могилянська академія»*

О.К. Прімерова,

*к.е.н., доцент кафедри фінансів
Національного університету «Києво-Могилянська академія»*

Дослідження історії формування та розвитку науки є надзвичайно важливим як з погляду ретроспективи, так і для глибокого розуміння її сучасного стану. Без статистичних даних неможливі управління державою, розвиток окремих напрямів її життєдіяльності, розробка програм соціально-економічного розвитку тощо. Статистика як наука покликана відображати реалії суспільного життя, вона дає можливість розвивати сферу практичної діяльності, сприяє вдосконаленню методології та процедур укладання статистики.

Особливе місце в історії формування та розвитку вітчизняної статистичної науки належить викладачам і випускникам Київського університету Св. Володимира. Виокреслено внесок у розробку теоретико-методологічних засад та історію розвитку статистики таких вчених, як Д.П. Журавський – секретар Комісії для опису губерній Київського навчального округу; І.В. Вернадський – екстраординарний професор кафедри політичної економії та статистики Київського університету; М.Х. Бунге – ординарний професор, ректор КУ; М.І. Зібер – доцент КУ; Ю.Е. Янсон – випускник історико-філологічного факультету КУ; Є.Є. Слуцький – випускник фізико-математичного факультету КУ; О.О. Русов – випускник історико-філологічного факультету КУ; К.Г. Воблій – доцент КУ. На основі огляду монографій, статей, посібників та підручників визначено роль вчених у розробці таких питань як:

1. Формування статистичних понять і категорій. Статистичні категорії розглядаються в світлі філософських категорій, зокрема таких як «окреме», «поодинокі» та «загальне», «необхідне» та «випадкове», «кількість і якість». Визначались та заново осмислювались специфічні статистичні

категорії – одиниця статистичної сукупності, варіююча ознака, статистичний показник, статистична закономірність тощо.

2. Дослідження історії зародження, формування та розвитку статистики. Історія статистичної науки розглядалась у монографіях та статтях вчених, причому як правило, була обов'язковим розділом навчальних посібників і підручників. Узагальнення історичного досвіду сприяло ствердженню власних поглядів вчених на основні питання статистичної науки.

3. Визначення сутності статистичної науки, її структури та місця серед інших наук, її ролі, значення та задач. В XIX ст. сформувались різні підходи відносно статистики як науки, які виокремлено в три групи: 1) статистика – суспільна наука; 2) статистика – методологічна наука; 3) статистика – універсальна наука.

4. Розробка теоретико-методологічних основ статистичного спостереження, групувань, узагальнюючих показників (відносних і середніх величин), статистико-математичних методів, табличного та інших методів і прийомів статистичного узагальнення та аналізу; програмно-методологічних питань та організації проведення переписів населення.

5. Розробка структури навчальних посібників і підручників. Виявлено особливості побудови методичного забезпечення навчального процесу на різних етапах еволюції статистичної науки.

Статистична наука постійно розвивається завдяки науковим пошукам сучасних діячів статистики, але теоретико-методологічні засади науки були закладені вченими попередніх поколінь, серед яких: Д.П. Журавський, І.В. Вернадський, М.Х. Бунге, М.І. Зібер, Ю.Е. Янсон, Є.Є. Слуцький, О.О. Русов та К.Г. Воблий.



БАЛАНСОВИЙ МЕТОД СТАТИСТИЧНОГО ВИВЧЕННЯ СТРУКТУРИ ВИТРАТ НАСЕЛЕННЯ

Н.А. Головач,

канд. екон. наук, доцент

Київського торговельно-економічного університету

Макроекономіка досліджує національну економіку як результат спільної діяльності усіх економічних суб'єктів. Визначальним чинником доцільності цієї діяльності є потреба у підтримці життєдіяльності і розвитку людини, колективу, нації, суспільства в цілому

Важливим інструментом інформаційного забезпечення аналізу і прогнозу потреб населення є балансний метод статистичного аналізу структури витрат населення на основі даних вибірових обстежень умов життя домогосподарств .

Використання балансового методу дозволяє вивчити взаємозв'язок витрат з основними чинниками, які впливають на їх структуру і знаходяться в певному співвідношенні між собою. Відповідно до різних розподілів групування структури витрат будуються за рівнем доходу, регіонами, складом сім'ї тощо.

Має місце наявність загальних принципів побудови системи балансів витрат, а саме – системи розрахунків, аналогічність аналітичних характеристик, зокрема коефіцієнтів тощо. Це дозволяє висвітлити методику побудови та аналізу змісту, структури і основних залежностей на прикладі матричних моделей одного балансу – в розподілі домогосподарств за рівнем доходу.

Характеристику окремих розподілів можна отримати як на основі середніх значень витрат, так і системи коефіцієнтів. Останні – двох видів: коефіцієнти структури витрат по окремих групах домогосподарств та їх сукупності (α_{ij}) – горизонтальний розріз та коефіцієнти розподілу окремих видів витрат по групах домогосподарств (β_{ij}) – вертикальний розріз.

Інформаційна база аналізу на основі вибірових обстежень суттєво розширюється при наявності даних про загальний обсяг витрат всієї сукупності домогосподарств. Його величина може

бути отримана як добуток середнього рівня витрат на загальну кількість домогосподарств, а не тільки обстежених.

У результаті отримуємо два види балансів витрат: середнього рівня витрат $\{A\}$ та загального обсягу витрат $\{B\}$ та побудованих на їх основі матриць коефіцієнтів $\{\alpha_s^A\}$, $\{\beta_j^A\}$, $\{\alpha_i^B\}$ та $\{\beta_j^B\}$.

Вони є базою здійснення аналізу механізму формування витрат домогосподарств за такими напрямками:

- порівняльний аналіз рівня витрат по різних групах домогосподарств;
- аналіз диференціації середнього рівня витрат по групах домогосподарств;
- аналіз динаміки середнього рівня витрат по сукупності домогосподарств на основі індексів середніх величин;
- аналіз динаміки обсягу витрат за рахунок їх рівня та числа домогосподарств;
- аналіз пропорційності та концентрація розподілу по групах домогосподарств структури витрат та доходів;
- оцінка динаміки рівня витрат в окремих групах домогосподарств на основі рівнянь тренду $q = f(t)$ і залежності рівня витрат від рівня доходів населення $q = f(x)$ та наступний прогноз цього рівня як бази прогнозування загального обсягу попиту населення на товари та послуги.

Наведені методичні положення по аналізу балансових зв'язків на основі розподілу домогосподарств за рівнем доходу повною мірою можуть бути використані до розподілів за іншими ознаками – регіонами, складом сім'ї, джерелами надходження доходів тощо.

Це є важливою складовою інформаційно-аналітичного забезпечення економічної політики держави стосовно людського розвитку та ринкової економіки.

— ◇ —

СТАТИСТИЧНИЙ АНАЛІЗ ДЕСТРУКТИВНИХ ЗМІН У ВІКОВОМУ СКЛАДІ НАСЕЛЕННЯ УКРАЇНИ: ОЦІНКА ТА ПЕРСПЕКТИВИ

І.А. Гончар,

*канд. екон. наук, доцент кафедри статистики та демографії
Київського національного університету імені Тараса Шевченка*

Історичний розвиток України у ХХ сторіччі був насиченим багатьма руйнівними світовими та локальними подіями: світові війни, голодомор, аварія на Чорнобильській АЕС, економічна криза. Кожна з них істотно вплинула на статеву – вікову структуру населення України.

Вагомий негативний вплив мали голодомор та Світова війна, проте позитивні тенденції соціально-демографічних процесів державної розбудови СРСР у 50-60х роках минулого сторіччя все ж дозволили здійснити демографічний перехід до сучасного типу відтворення і досягнути Україні високого рівня соціально – демографічного розвитку на початку 80х років. Головними демографічними досягненнями нашого населення було: значне подовження тривалості життя населення та зменшення смертності, особливо серед немовлят.

Чорнобильська катастрофа була першим негативним фактором, який порушив позитивні демографічні тенденції, проте його вплив на зміну чисельності та складу населення України не можна порівняти з катастрофічним впливом економічної кризи початку 90х років, яка «кинула» нашу країну в першу довготривалої демографічної кризи.

Надаючи загальну характеристику соціально-економічній кризі 90х років слід зазначити, що вона зачепила усі верстви населення України, проте головним негативним наслідком є створений істотний дисбаланс у віковому складі населення.

Можливості відтворювальної функції населення країни залежать від типу вікової структури, який визначається співвідношенням демографічних поколінь: дітей, батьків та прабабків. Падіння народжуваності не лише призвело до щорічного скорочення чисельності населення країни, а й зменшило демографічний потенціал відтворення населення у майбутньому. Зменшення частки людей середнього віку (дітородного віку) не дозволяє істотно збільшити поточну

кількість народжених. Тим самим Україна опинилась у ситуації, коли один з головних факторів зростання чисельності населення – народжуваність має недостатній рівень для забезпечення простого відтворення, а потенціал його підвищення значно скорочений.

На фоні неприємної для країни ситуації з народжуваністю ускладнює демографічне, а відповідно і соціально – економічне становище, вагома частка людей літнього віку. На теперішній час співвідношення між чисельністю працюючого та не працюючої категорій населення стрімко скорочується.

Складне демографічне становище в країні вимагає кардинальних змін в демографічній та соціальній політиці країни. Проте обґрунтування потрібних змін не можливе без статистичного оцінювання наслідків причин для пошуку ефективного варіанту розвитку населення України, яким і присвячена робота.

В роботі надана статистична оцінка вагомості впливу основних демографічних чинників, що формують вікову структуру населення України: виявлений та оцінений комплекс факторів, що формує існуючі демографічні тенденції, окреслений напрям їх подальшого розвитку, визначений потенціал їх покращення. Для визначення перспектив розвитку населення України були окреслені різні варіанти перебігу демографічних процесів, спираючись на які було здійснено порівняння очікуваного складу населення з еталонним (необхідним для забезпечення простого режиму відтворення).

Проведений порівняльний аналіз структур разом з оцінкою ефектів впливу демографічних чинників дозволив сформулювати пропозиції з поліпшення демографічної політики в Україні. Запропоновані заходи з оптимізації демографічної політики країни дозволять ефективніше використовувати наявні, на теперішній час, ресурси в державі.

— ◇ —

УМОВИ АДЕКВАТНОСТІ СТАТИСТИЧНОЇ ОЦІНКИ СПОЖИВЧОГО КОШИКУ ІСЦ

І.А. Гончар,

*канд. екон. наук, доцент кафедри статистики та демографії
Київського національного університету імені Тараса Шевченка*

В.В. Качалай,

*магістрант Київського національного університету імені
Тараса Шевченка*

На початку останньої декади ХХ століття, проголосивши свою незалежність, Україна пішла шляхом інтеграції національної економіки в міжнародний простір. Такі рішучі кроки вимагали часткового переосмислення основних ідеологічних засад застарілої радянської системи статистики та якнайшвидшого впровадження міжнародних статистичних стандартів.

Українська влада, взявши курс на побудову потужної капіталістичної країни з розвинутою ринковою економікою, зобов'язалася переглянути методологію розрахунку основних макроіндикаторів: з 1991 року, прийнявши за основу декілька статей Конвенції Міжнародної організації праці, Україна після майже 70 – річної перерви почала проводити розрахунки другого за значимістю у світі макроекономічного параметра – індексу споживчих цін (ІСЦ). Значення цього показника важко переоцінити, оскільки він характеризує зміну умов життя населення, оцінюючи зміни цін (тарифів) на споживчі товари та послуги.

Вітчизняні статистичні органи, заручившись підтримкою експертів МВФ, провели досить складну методичну та організаційну роботу, результатом якої став споживчий набір для розрахунку ІСЦ, до складу якого після третьої зміни з 1 січня 2007 року входять 296 товарів та послуг для невиробничого споживання. Та варто зазначити, що не усі національні особливості української економіки були враховані. В наслідок цього споживчий набір та питома вага витрат кожного товару та послуги у загальній сумі грошових витрат населення є не зовсім адекватними та обґрунтованими. Раз на 5 років відбувається перегляд цього загальноприйнятого кошика,

на даний момент актуальним стає питання його чергового уточнення:

- розширення чи об'єднання позицій найменувань товарів;
- проведення корегування ваги деяких товарів (послуг) – представників на кінцевому етапі дослідження.

Індекс споживчих цін відіграє важливу роль у визначенні та прогнозуванні діяльності багатьох державних органів влади, зокрема для Нацбанку – це основний чинник, що формує курс, а для Міністерства економіки та торгівлі – один із стовпів, на яких базуються макроекономічні параметри. Враховуючи те, що соціально – економічний стан України надзвичайно мінливий та непрогнозований, конче необхідно підвищити адекватність оцінки споживчих цін реальному стану економіки, щоб мати змогу вчасно реагувати на мінливі економічні тенденції.

Перш за все варто звернутися до найменувань товарів (послуг) – представників вище згадуваного споживчого набору, у структурі яких більше 53% займають продовольчі товари. Легко помітити значну вагу (1,5% і більше) деяких основних українських продуктів: хліб 4,8%, свинина 3 %, риба 2,7%, молоко 1,87%, олія 1,85% тощо. Та якщо перші три поділяються ще на декілька позицій, що дає змогу реєстраторам більш точно фіксувати зміну цін та їх вплив на загальний ІСЦ, то останні два (молоко та олія) терміново необхідно розширити. Наприклад, позиція побутова техніка, що важить лише 0,67%, має 8 піднайменувань. Можна наводити такі ж приклади по взуттю та одягу. Таким чином, для покращення методології розрахунку індексу споживчих цін варто здійснити поділ декількох найменувань на види, а також врахувати суб'єктивний підхід респондентів при заповненні анкет про свої грошові витрати, на основі яких вираховується питома вага кожного товару чи послуги.

Отже, перегляд у 2012 році споживчого набору товарів (послуг) – представників з урахуванням вище зазначених пропозицій надасть змогу не тільки адекватно впливати на інфляційні процеси, але й допоможе стабілізувати курс національної грошової одиниці, коректно індексувати доходи українських громадян та забезпечити добробут наших співвітчизників.

— ◇ —

СТАТИСТИЧНЕ ОЦІНЮВАННЯ ЯКОСТІ ІНФОРМАЦІЇ В СНР

О.В. Гончар,

к.е.н., доцент НАСООА,

завідувач відділу НТК статистичних досліджень

Система національних рахунків (далі – СНР) є основним джерелом інформаційного забезпечення управління національною економікою. Особлива роль інформації, відображеної в СНР, у процесах трансформації економічної системи, становлення та розвитку ринкової економіки, висуває надзвичайно строгі вимоги до якості представленої в ній інформації.

Якість інформації, відображеної в СНР, – це сукупність рис та характеристик інформації, що надає можливість задовольняти наявні або передбачені потреби користувачів цієї інформації, у першу чергу – владних структур.

Під критеріями якості статистичної інформації ми розуміємо не тільки її надійність (точність), але й такі елементи, як релевантність, своєчасність, пунктуальність, доступність, ясність, порівнянність, узгодженість тощо.

Для забезпечення якості інформації в СНР поодиноких, безсистемних, різнонаправлених підходів недостатньо. Виникає потреба у всезагальному, системному підході до управління якістю статистичної інформації. Здійснити це можна лише за умови впровадження системи управління якістю інформації (СУЯ) в системі державної статистики. Підсистемою СУЯ буде система управління якістю інформації СНР.

Система управління якістю вимагає постійного відслідковування (оцінювання) якості як вихідної статистичної інформації (інформації СНР), так і процесів її виробництва. Виконання систематичних робіт з оцінювання якості є необхідною умовою забезпечення контролю якості процесів виробництва інформації СНР, а з іншого – передумовою для інформування користувачів про якість інформації.

Результати виконання процедур оцінювання якості документуються у вигляді звітів з якості. Звіти з якості, які охоплюють сферу оцінювання якості процесів виробництва, є орієнтованими на виробників, тоді як звіти з якості, що містять

опис якості статистичної інформації СНР, призначені передусім для користувачів цієї інформації. Це дозволить останнім приймати науково обґрунтовані управлінські рішення.

Методи оцінювання якості залежать від типу статистичного процесу, результатом якого є інформація, якість якої оцінюється. Розрізняють шість типів статистичних процесів: 1) вибіркове обстеження; 2) суцільне обстеження; 3) статистичний процес отримання адміністративної інформації; 4) статистичний процес, в якому об'єднуються дані з різних джерел; 5) розрахунок економічних індексів; 6) статистичне копіїювання.

Очевидно, що найбільш складною, з точки зору оцінювання якості, є інформація, яка є результатом статистичного копіїювання. Статистичне копіїювання – це поєднання даних із різноманітних джерел, включаючи дані, які є результатом інших зазначених статистичних процесів, для отримання агрегату з особливим концептуальним значенням (копіїюції). Саме до такого типу статистичного процесу належить складання СНР.

Особливістю статистичної копіїюції є те, що вимоги до якості є високими як в цілому, так і для окремих її сегментів. Оскільки дані щодо окремих сегментів СНР збираються із різних джерел, то для оцінки якості необхідно мати детальну інформацію про усі виконувані процедури та застосовані методи на етапах збирання, оброблення, зведення даних, обчислення узагальнюючих статистичних показників для усіх сегментів СНР.

Для оцінювання якості статистичних копіїюцій Євростат рекомендує застосовувати такі критерії як релевантність, надійність, своєчасність, пунктуальність, доступність та ясність, порівнянність та узгодженість. Для СНР найскладнішим є оцінювання останніх двох критеріїв. Зазначимо, що в СНР має бути оцінена якість як копіїюції в цілому, так і окремих її сегментів. Автором була розроблена система індикаторів та характеристик, що відображають наведені вище критерії якості для інформації СНР.

— ◇ —

ОСНОВНІ ДЕМОГРАФІЧНІ ЧИННИКИ ВПЛИВУ НА МІГРАЦІЙНІ ПРОЦЕСИ СЕРЕД МОЛОДІ В УКРАЇНІ

О.Ф. Євсєєнко,

*к.е.н., доцент кафедри статистики та демографії
Київського національного університету імені Тараса Шевченка*

Вивчення міграційних процесів серед молоді на сучасному етапі дозволяє не лише оцінити стан міграції в Україні, але й визначити рушійні сили майбутніх міграційних процесів; створити соціально-демографічні моделі міграційних потоків на перспективу, дати оцінку впливу міграції на окремі параметр демографічного розвитку (зокрема, сімейні відносини, стан здоров'я нації, соціальні наслідки), прогнозувати міграційні процеси з метою визначення тенденцій економічного та соціально-демографічного розвитку.

На сучасному етапі в Україні склалися наступні демографічні чинники, які суттєво впливають на міграційні процеси: освітньо-професійна орієнтація молоді; становище на ринку праці економічно-активної молоді; ціннісні орієнтири молоді в питаннях сім'ї та шлюбу тощо.

У загальному міграційному обороті частка молоді у віці 15-34 роки в Україні в 2009 р. становила 65,8% . Статеві-вікова піраміда показує два піки міграційної активності молоді: у 17-річних осіб, які закінчили середню школу і поповнюють навчальну міграцію, та у 22-х річних осіб, які намагаються працевлаштуватися після закінчення ВУЗів.

За останні роки показники безробіття в Україні серед молоді найбільш істотно зросли у групах 25-29 - річних та 30-34-річних осіб. Усього чисельність безробітної молоді у 2009 році становила більш 1 млн. осіб (54% від загальної кількості безробітних). Враховуючи те, що молодь найбільш здатна до сприйняття нових ідей і є провідником інноваційних перетворень, зниження рівня молодіжного безробіття є особливо важливим для забезпечення інноваційного розвитку країни.

Серед життєвих пріоритетів молоді України освітня та професійна зайнятість посідають досить високе місце. Так, за даними опитувань ("Молодь України", квітень 2010р.) на це вказали 70% опитаних молодих людей. Крім того планують поїхати на навчання за кордон за наявної можливості 61,7 %

респондентів, які також зазначали, що навчання за кордоном підвищує можливість їх майбутнього працевлаштування. 18,7% опитаних відмічають свої прагнення у такий спосіб познайомитись з іншими країнами та їхньою культурою, а 7% респондентів вказали на намір послухати окремі навчальні курси та лекції відомих науковців.

У повіковому розподілі серед бажаючих виїхати на навчання у найближчі 3 роки - найбільша частка осіб у віці до 20 років (37,0%). Це майже 10% серед усіх респондентів у цьому віці. Крім того 58,7% опитаних повідомили про намір тимчасової роботи за кордоном, а 23% планують не лише поїхати на навчання, але й змінити місце постійного проживання. Таким чином з країни виїжджає найбільш талановита “золота” молодь, що призводить до втрати інтелектуального потенціалу країни.

Аналізуючи сімейно-шлюбні відносини та міграційні процеси, слід відмітити, що вони мають взаємопов'язаний характер. З одного боку, переважно жінки мають намір вирішити шлюбні питання за кордоном, з іншого – вплив міграційних процесів на стосунки в уже створених сім'ях зумовлюються комплексом різноманітних факторів, що потребує спеціального дослідження.

Отже, міграційні процеси серед молоді та їх соціально-економічні наслідки для країни повинні бути в центрі уваги відповідних державних органів. Насамперед, це стосується реалізації принципово нової молодіжної політики на засадах системного дотримання стратегічних напрямів, визначених нормативно правовими документами, а також врахування міжнародного досвіду щодо сприяння розвитку здібностей, розширення інформаційного простору з метою стимулювання прийняття вірних рішень та нарощування людського капіталу в ім'я майбутнього; здійснення державної молодіжної політики для осіб 15-24 років, наблизившись цим до кращих світових стандартів.

— ◇ —

РЕГИОНАЛЬНЫЕ ФАКТОРЫ СОЦИОЛОГИЧЕСКОГО ДЕМОГРАФИЧЕСКОГО МОНИТОРИНГА

А.Г. Злотников,

*к.э.н., доц., зав. кафедрой теории кооперации и социологии
Белорусского торгово-экономического университета
потребительской кооперации*

С 2005 по 2010 годы университетом по Государственной комплексной программе научных исследований «Экономика и общество» ежегодно проводится анкетный опрос в рамках демографического мониторинга. При статистической обработке результатов исследования учитывались такие социально-образующие характеристики респондентов: социально-экономические, социально-политические, культурные, территориальные, статусные, демографические и иные факторы, имеющие существенное значение для понимания сущности демографических процессов. Они, во-первых, дают возможность отразить и обеспечить степень репрезентативности исследования, и, во-вторых, на их основе осуществить анализ результатов исследования, позволивший выявить сущностные корреляции изучаемых явлений и процессов с теми или иными факторами.

Каждый из перечисленных параметров дает свой взгляд на исследуемое, а в совокупности позволяет осуществить всестороннее проникновение в содержание и социальные механизмы той или иной стороны действительности. В исследовании значительное место уделяется региональным параметрам, ибо по ним всегда имеется устойчивая статистическая информация, позволяющая обеспечить репрезентативность социологического исследования в каждый конкретный промежуток времени. Региональная выборка учитывает, во-первых, территориально-административное деление; во-вторых, представительство населения городской и сельской местности; в-третьих, социально-экономические и бытовые характеристики регионов проживания респондентов – деление населенных пунктов не только (и даже не столько) по их величине, а по социальной значимости, их роли в сложившейся управленческой территориально-

административной структуре. Именно этот аспект является естественной основой расчета региональной выборки.

В частности по Гомельской области это: а) областной центр, б) крупные города области или бывшие города областного подчинения, в) города, являющиеся центрами районов, но не являющиеся городами областного подчинения, г) поселки городского типа, являющиеся районными центрами и д) поселки городского типа, а также малые города.

Существенным фактором является и дифференциация сельских районов в зависимости от уровня социально-экономического развития района и районного центра: а) районы с высоким уровнем социально-экономического развития, расположенные вокруг областного центра и бывших городов областного подчинения, б) районы со средним уровнем социально-экономического развития – вокруг районных центров, являющихся городами и в) районы с низким уровнем социально-экономического развития, где районными центрами являются поселки городского типа.

Другим фактором региональной выборки социологических исследований был учет «чернобыльской» специфики Гомельской области – в зависимости от степени радиоактивного загрязнения выделяются зоны: а) с высокой плотностью радиоактивного загрязнения от 15 до 40 Ки/км² – первоочередного отселения; б) со средней плотностью радиоактивного загрязнения от 5 до 15 Ки/км² – с правом на отселение; в) с низкой плотностью радиоактивного загрязнения от 1 до 5 Ки/км² – периодического радиационного контроля и г) условно «чистую» зону – с плотностью радиоактивного загрязнения менее 1 Ки/км². Хотя здесь имеются определенные сложности – в каждом населенном пункте, имеются территории с различным уровнем радиоактивного загрязнения. Для обеспечения репрезентативности социологического исследования в связи с этим факторам осуществляется представительство не в целом по тем или иным административно-территориальным районам, а в разрезе отдельных населенных пунктов в соответствии с «Каталогом доз облучения жителей населенных пунктов Республики Беларусь».

— ◇ —

ЭКОНОМИКО-СТАТИСТИЧЕСКОЕ ОТРАЖЕНИЕ НАЧАЛЬНОГО ЭТАПА ПРИВАТИЗАЦИИ В РОССИИ

С.А. Кожанова,

*проректор НОУ ВПО «Институт моды,
дизайна и технологий»*

В XX веке в России произошли две масштабные трансформации отношения собственности: национализация, как создание материально-технической базы социализма, и денационализация, как создание материальной базы рыночного капитализма.

Статистический учет и отчетность хозяйствующих субъектов до 1990 года основывался на отраслевом принципе. В стране действовал общесоюзный классификатор «Отрасли народного хозяйства» (ОКОНХ), который являясь статистическим стандартом, обеспечивал достаточно полное системное представление о состоянии народного хозяйства

В 1986 г. Госкомстатом СССР была проведена инвентаризация и оценка состояния производственных фондов по состоянию на 1 апреля. Она была далеко не полной по охвату, принятые в методологии группировки носили крайне размытый характер, и полученные результаты значительно отличались от ожидаемых. В результате к началу 1990-х годов балансовая стоимость основных фондов оказалась заниженной, а амортизационный фонд крайне недостаточен для восстановления производственной базы.

Поскольку компьютерной сети накопления, хранения и распространения информации в СССР еще не было создано, опытные кадры с их документацией были главными элементами системы. Когда эти люди были уволены, а их тетради и картотеки свалены в кладовки, потоки информации оказались блокированы.

Вследствие распада СССР, в 1991-93 годах государственная статистика практически не функционировала: государственный учет заменился «неучтенкой».

Основные показатели статистики и формы отчетности определялись по заказу органов, осуществлявших приватизацию, - Госкомимуществом, преобразованным затем в

Минимущества РФ. В ней преобладали количественные показатели, характеризующие масштабы и структуру приватизации: число приватизированных государственных предприятий в целом и по формам собственности, а также в разрезе субъектов Федерации, структура приватизированного государственного и муниципального имущества по способам приватизации и отраслям экономики (включая территориальный разрез), ход приватизации по основным отраслям экономики, поступление средств от приватизации, характеристика созданных акционерных обществ.

При отсутствии четкого юридически закрепленного понятийного аппарата по хозяйствующим объектам и по их отраслевой принадлежности, Указы Президента России, издаваемые по вопросам приватизации не имели однозначного трактования. Статистические критерии финансово-экономической оценки предприятий не были четко определены, что автоматически приводило к искажению данных в пользу заинтересованных лиц.

Законсервированные объекты, такие как нефтяные и газовые скважины подлежали обязательной приватизации без реальной оценки их стоимости.

В связи с отсутствием недостаточным правовым обеспечением приватизации и отсутствием на начальном этапе контролирующих органов невозможно было получить объективные данные об ее эффективности и ее полезности для экономического развития страны. Данное обстоятельство трудно признать случайным упущением: это прямое следствие принятой правительственной программой методов и способов приватизации, как и понимания ее стратегических задач.



МОДЕЛЬ А. РОУЗА В АНАЛІЗІ ЗОВНІШНЬОЇ ТОГІВЛІ УКРАЇНИ

Я.В. Кулішова,

*к.е.н., ст.викладач кафедри економічної статистики
Донецький національний університет*

Зовнішня торгівля на сучасному етапі розвитку дуже динамічна. Її роль, як системи переміщення товарів і послуг за кордон, в економіці кожної країни зростає, разом зі збільшенням її впливу на світовий економічний розвиток. Проте, на сьогодні, міжнародні торгові зв'язки нестійкі, внаслідок чого в структурі товарообігу і в напрямках зовнішньоторговельних потоків постійно відбуваються зміни. Усе це пояснюється коливаннями в міжнародній торгівлі, які обумовлені економічними кризами, загостренням енергетичної кризи, нестачею сировини і іншими проблемами.

Для вивчення чинників зовнішньої торгівлі України використана гравітаційна модель А. Роуза, яка заснована на припущенні, що об'єм двосторонніх торгових потоків прямо пропорційний розміру економік (їх "масам"), і обернено пропорційний до відстані між ними і іншим торговими бар'єрами.

Для виявлення закономірностей розвитку зовнішньої торгівлі підприємств України виконано кореляційно-регресійний аналіз і побудовано модель залежності експорту (y) від таких чинників: x_1 – валовий внутрішній продукт країн-партнерів; x_2 – відстань до цих країн, що характеризує витрати на транспорт; x_3 – імпорт товарів України з країн-партнерів; x_4 – наявність загального кордону.

В результаті виконаного аналізу між чинниками, що вивчаються, встановлено, що існує тісна пряма залежність Зміна об'єму експорту товарів України в 2009р. на 89,8% пояснювалася впливом чинників, що вивчалися, за статистичними критеріями модель є статистично достовірною.

Згідно побудованої моделі вплив чинників був різним: при збільшенні ВВП зарубіжних країн на 1 млн. дол. США об'єм експорту України скорочується на 4,461 млн. дол. США; збільшення відстані до цих країн на 1 км. призводить до

скорочення об'єму експорту України по країнах на 0,014 млн. дол. США; при збільшенні імпорту товарів України із зарубіжних країн на

1 млн. дол. США об'єм експорту України по країнах збільшується на 0,596 млн. дол. США; наявність спільного кордону збільшується експорту на 136,1 млн. дол. США.

Від'ємний зв'язок між експортом і ВВП пояснюється структурою зовнішньої торгівлі тому що в умовах, коли більш ніж 60% експорту товарів мають сировинне походження, то про конкурентоздатність на інноваційній основі говорити не можна. Позитивний зв'язок між експортом і імпортом свідчить про те, що взаємні торгові відносини поживляють експорт. Найбільше збільшення експорту спостерігається при наявності спільного кордону. Це пояснюється тим, що ринки розвинутих країн більш закриті і українські товари не конкурентоздатні.

Таким чином, слід зазначити, що розвиток зовнішньої торгівлі - один з пріоритетних напрямів управлінсько-регулюючої діяльності держави. Для його ефективної реалізації необхідно, передусім, постійно удосконалювати господарський механізм у сфері зовнішньоекономічної діяльності по усіх його напрямках. На сьогодні головним завданням держави в сучасних умовах є вироблення зовнішньоекономічної політики, адекватної ринковим принципам функціонування української економіки і її послідовної інтеграції у світове господарство.



АКТУАЛЬНЫЕ ВОПРОСЫ СТАТИСТИЧЕСКОЙ НАУКИ И ПРАКТИКИ В РЕСПУБЛИКЕ БЕЛАРУСЬ

Н.В. Лацкевич,

канд.экон.наук., доцент,

заведующий кафедрой статистики,

Белорусский торгово-экономический

университет потребительской кооперации

Социально-экономические преобразования, происходящие в Республике Беларусь и мире, ставят перед статистической наукой и практикой задачи по их дальнейшему развитию. В настоящее время одинаковы актуальные вопросы, которые

решаются в статистике – науке и в статистической деятельности органов государственной статистики.

Продолжаются научные дискуссии по обоснованию сущности статистики и предмета её изучения на современном этапе. Некоторые ученые ставят под сомнение существование статистики как науки. Одни считают, что статистика является не наукой, а специфическим методом, пригодным для изучения различных объектов социума. Другие объявляют специфическим предметом статистической науки только общественные явления и процессы. Третьи настаивают на признании её предметом не только общество, но и природу, т.е. весь мир явлений, что, в сущности, при наличии столь всеобъемлющей универсальной науки делает излишней обузой все остальные. Но важность статистики как науки бесспорна. Одним из обязательных этапов любого научного исследования является статистический анализ данных. С появлением и совершенствованием современных программных средств обработки данных статистический анализ поднялся на новый качественный уровень.

В научных кругах ведется дискуссия по проблемам эффективности различных форм организации статистического наблюдения и его видах. Прежде всего, это касается выборочного наблюдения, его места, роли, а также отличительных особенностей по сравнению с другими видами сплошного наблюдения, не имеющими вероятностный характер.

В отдельных отраслях статистики актуальными направлениями развития являются следующие. В совершенствовании системы национальных счетов стоит задача внедрения в статистическую практику обновленной международной методологии СНС – 2008, внедрение в практику и опубликование данных о валовом региональном продукте.

В статистике сельского хозяйства продолжают работы по совершенствованию методологии построения продовольственных балансов, отвечающей требованиям международных стандартов, а также организация выборочных обследований производства сельскохозяйственной продукции в личных подсобных хозяйствах граждан.

В области статистики торговли приоритетными направлениями остаются развитие системы и методологии

формирования сводных показателей состояния отрасли, учитывающих объемы деятельности субъектов малого предпринимательства, неформальной деятельности.

В области статистики доходов и уровня жизни населения актуально совершенствование бюджетных обследований домашних хозяйств, мониторинг и анализ бедности в стране, состояния здоровья населения, уровня образования.

В 2011 году завершается реализация мероприятий Государственной программы создания Единой информационной системы государственной статистики Республики Беларусь, суть которой однократный ввод информации и многократное её использование.

К актуальным вопросам статистической науки и практики в Республике Беларусь можно отнести следующее: разработка и совершенствование методик измерения и прогнозирования экономических, социальных и демографических процессов; статистическая оценка результатов экономической деятельности на микро - и макроуровнях; статистические исследования проблем теневой экономики; статистическая оценка эффективности научной и инновационной деятельности; исследование проблем статистического отражения природоохранной деятельности.

— ◇ —

МЕТОДОЛОГІЧНІ АСПЕКТИ СТАТИСТИЧНОГО ВИВЧЕННЯ ЯКОСТІ ЕКОНОМІЧНОГО ЗРОСТАННЯ

***Н.П. Лутчин,**
к.е.н., доцент*

Львівський національний університет імені Івана Франка

Однією з найважливіших проблем, що протягом останніх років вважається першочерговою в усьому світі, є проблема економічного зростання, від вирішення якої у сучасному глобальному суспільстві залежить не тільки доля тієї чи іншої країни, але й темпи та пропорції розвитку великих регіонів та світової спільноти в цілому .

Економічне зростання є необхідною складовою і передумовою сталого розвитку національної економіки в цілому та її регіонів. На сучасному етапі трансформації економічної системи України, забезпечення умов та можливостей довгострокового економічного зростання є завданням стратегічного значення.

В концепціях наукових шкіл, в практиці державного управління особлива увага надається економічному зростанню як кількісній характеристиці динаміки сукупних результатів виробничої діяльності. Проте останніми роками виникають проблемні питання стосовно розуміння змісту економічного зростання як якісної характеристики. Отже, в економічних досліджень виникло поняття «якість економічного зростання». Якість економічного зростання – сукупність властивостей і ознак, що характеризують процес зростання, тобто тенденцію збільшення загального обсягу виробництва, і результати цього процесу з позиції задоволення інтересів суб'єктів, які забезпечують економічне зростання і сприймають його наслідки. Основним показником при вивченні якості економічного зростання є також індекс фізичного обсягу ВВП, однак він є не єдиним показником економічного розвитку. Окрім нього потрібно враховувати показники, що виявляють якість життя і є складовими індексу людського розвитку.

Оцінка складових якості економічного зростання має здійснюватися з позиції інтересів суб'єктів мікроекономіки і суб'єктів макроекономіки. З цього слідує, що дослідження закономірностей якості економічного зростання на рівні регіонів повинно включати два взаємопов'язані етапи: перший – вимірювання і оцінка якості процесу зростання; другий – дослідження якості результатів зростання на території регіонів за визначений період з позицій задоволення позицій суб'єктів макrorівня.

У контексті забезпечення довгострокового економічного зростання країни та її регіонів важливим моментом є формування методики оцінки його результатів на основі концепції якості зростання регіональної економіки.

Аналіз якості зростання передбачає вивчення двох завдань:

- вивчення стійкості рівнів динамічного ряду;
- оцінка стійкості тенденції.

Вирішення першого завдання можливе на основі розрахунку індексів

стійкості динамічних рядів. Чим ближчий показник до одиниці, тим менші коливання і відповідно вища стійкість.

Оцінка стійкості тенденції зростання може бути отримана на основі коефіцієнта Спірмена. Інтерпретація коефіцієнта Спірмена в даному випадку наступна: якщо кожен наступний ланцюговий темп росту більший чим попередній, то ранги цих темпів і номери років співпадають. Це означає не тільки повну стійкість самого росту рівнів ряду, але і також прискорену стійкість зростання.

Отже, економічне зростання відіграє важливу роль в державному розвитку та сприяє міжнародному поділу праці. Зростання ж економіки регіону як предмету статистичного вивчення має на меті комплексне дослідження усіх процесів та явищ, що є передумовами та наслідками економічного зростання, їх статистичного вимірювання та оцінки. Вивчення цього явища є дуже актуальним в наш час та потребує глибокого розуміння та комплексного дослідження.



ИСТОКИ ЭНЕРГЕТИЧЕСКОЙ СТАТИСТИКИ В ДОРЕВОЛЮЦИОННОЙ РОССИИ

И.П. Мамий,

*канд. экон. наук, доцент кафедры статистики
экономического факультета*

Московского Государственного Университета им.

М.В.Ломоносова

С развитием промышленного производства в России сведениями о размерах добычи полезных ископаемых: угля, нефти, торфа, различного рода руд интересовались многие организации, в частности, собственники иностранных концессий. Крупнейшим концессионером нефтяной промышленности в России стала компания Ротшильдов в Баку.

Важнейшую статистическую информацию о ведущих промышленных и горнодобывающих производствах с

первых лет их возникновения собирал, анализировал и опубликовывал Горный департамент Министерства финансов.

Публикация сведений о горной и горнозаводской промышленности производилась достаточно полно, о чем свидетельствует краткий перечень материалов, помещенных, например, в «Ежегоднике Министерства финансов» (в первом издании 1869 г.).

Добыча каменного угля, показана как по губерниям, так и по отдельным заведениям. Добыча нефти показана по губерниям, имеющим нефтеносные районы.

В 1900 и 1908 гг. в России были проведены по специальным программам две первые крупные переписи русской промышленности.

Объектом регистрации переписи 1900 были предприятия тех отраслей промышленности и территорий, которые подчинялись в то время надзору фабричных инспекторов, поэтому распространялась лишь на губернии европейской России и частично на Кавказ. Для этой переписи был установлен ценз промышленного предприятия - годовая производительность не менее 1 тыс. рублей.

Анкета переписи 1908 г. была аналогична анкете переписи 1900 г., но менее подробная. В ней отсутствовали детальные сведения о сырье и техническом оборудовании. В 1908 г. в обследовании учитывались только издержки на сырье в денежном выражении, сведения же о материалах и полуфабрикатах, переработанных в течение года, в натуральном выражении не регистрировались.

Перепись 1908 г. уже охватывала почти всю территорию Российской империи, а также была расширена и номенклатура производств. Данные обследования промышленности за 1900 г. и в особенности за 1908 г. дали четкое представление о следующих главнейших показателях промышленного производства: число заведений, число рабочих, мощность силовых установок, выработка главнейших изделий, размеры годового производства (продукция) и характеристика производственного оборудования некоторых отраслей.

В целом методика проведения переписей 1900 и 1908 гг. базировалась на единых принципах, что дает возможность сопоставлять их результаты.

Систему учета горнозаводского производства определял «Устав о горных заводах».

В конце XIX - начале XX в. помимо государственной статистики появилась и начала быстро развиваться статистика предпринимательских организаций российских промышленников. В нее включались сведения о технической структуре производства, о его технологических особенностях, объеме выпускаемой продукции и ее сбыте, обеспеченности предприятий топливом, сырьем, емкости рынка, а также о положении рабочих. Эта статистика чаще всего была отраслевой или региональной - например, организация нефтепромышленников Баку с 1894 г. издавала «Обзор бакинской нефтяной промышленности».

В 1910—1913 гг. Министерство торговли и промышленности провело еще одно, третье по счету анкетное обследование промышленности.

Оно было произведено в связи с пересмотром таможенного тарифа и коснулось промышленных заведений, лишь подчиненных надзору фабричной и горной инспекции.

Обследование охватило лишь предприятия, производившие товары, могущие быть предметом международной торговли, поэтому совсем не собирались сведения об электростанциях, газовых заводах и о предприятиях добывающей промышленности, например по добыче нефти, и т. п. Топливо-энергетические ресурсы ещё не были основным источником доходов государственной казны.

Исторический анализ появления и совершенствования элементов энергетической статистики наглядно демонстрирует взаимосвязь развития экономического потенциала страны и его энергетической обеспеченности. Доказывает влияние господствующих экономических парадигм на структуру добычи и потребления энергетических ресурсов страны. Показывает этапы зарождения «нефтедолларов» и роль иностранного капитала в освоении природных ресурсов страны.

— ◇ —

ОСНОВНІ НАПРЯМКИ СТАТИСТИЧНИХ ДОСЛІДЖЕНЬ ПРЯМИХ ІНОЗЕМНИХ ІНВЕСТИЦІЙ В КОНТЕКСТІ ЕВОЛЮЦІЇ ФІНАНСОВОЇ ГЛОБАЛІЗАЦІЇ

В.В. Маслій,

*к.е.н., доц., заступник декана факультету обліку і аудиту
Тернопільського національного економічного університету*

Нові напрямки статистичних досліджень прямих іноземних інвестицій пов'язані з етапами економічної глобалізації, важливою складовою якої є фінансова глобалізація. Її перша хвиля, пов'язана з другим етапом глобалізації, протягом якого з 1920 по 1970 рр. експорт капіталу у формі прямих іноземних інвестицій був спрямований на захоплення ринку збуту товарів і послуг країн, що розвиваються.

Перше статистичне дослідження прямих іноземних інвестицій було здійснене Міністерством торгівлі США в 1929 р. в огляді на тему «Американські прямі інвестиції в іноземних державах». Предметом дослідження була «комерційна та промислова власність, яка перебуває за кордоном, належить резидентам США та від якої за нормальних економічних умов очікується надходження прибутку». Під терміном «прямі інвестиції» в іноземні підприємства розумілись вкладення резидентів без посередництва фінансових ринків. Дана категорія застосовувалась для розмежування прямих і портфельних інвестицій. Це дослідження базувалось на концепції контролю над підприємством, яка пізніше відіграла важливу роль в розвитку методології статистики прямих інвестицій. В наступних оглядах Міністерства торгівлі США значна увага приділялась визначенню кількісного критерію стосовно контролю над підприємством:

в огляді 1936р. поняття контролю було ключовим, його кількісним критерієм була питома вага іноземного інвестора в капіталі підприємства, яка становила не менше як 50% голосуючих акцій;

в оглядах за 1950 – 1959 рр. до категорії прямих відносились інвестиції на які припадало 25 або більше відсотків голосуючих акцій;

в огляді за 1966 р. іноземною вважалась інвестиція з питомою вагою 10%, за умови що її обсяг становить не менше 50 тис. дол. США.

В другій половині XX сторіччя концепція прямих іноземних інвестицій була визнана на міжнародному рівні та виділена в якості окремої статистичної категорії в платіжному балансі.

Стрімке зростання кількості транснаціональних корпорацій, їх філій у вигляді афілійованих підприємств та динаміки обсягів прямих іноземних інвестицій, які забезпечують контроль і механізми володіння закордонними виробничими об'єктами призвело до появи та розвитку нових напрямків статистики прямих інвестицій – статистики транснаціональних корпорацій (Transnational Corporations (TNC) Statistics), статистики афілійованих підприємств (Foreign Affiliate Trade (FATS) Statistics) та статистики злиття та поглинань (Mergers and Acquisitions (M&A) Statistics).

Вищезазначені напрямки статистичних обстежень прямих іноземних інвестицій на сучасному етапі дещо обмежені колом країн-учасників, що ускладнює проведення міжнародних співставлень. На нашу думку, основні зусилля в подальшому розвитку статистики прямих іноземних інвестицій повинні бути спрямовані на гармонізацію методологічних принципів з метою досягнення співставності показників для проведення міжнародних порівнянь.



РОЛЬ СТАТИСТИКИ У ФУНКЦІОНУВАННІ ФІНАНСОВОЇ СИСТЕМИ

Л.Є. Момотюк,

кандидат економічних наук, доцент

декан фінансового факультету

Національної академії статистики,

обліку та аудиту

Можливість статистичного вивчення функціонування фінансової системи обумовлена тим, що практичні всі процеси, пов'язані з розвитком фінансових відносин, можна відобразити у вигляді кількісних характеристик. Саме статистика, яка має

відповідний апарат методів та прийомів, спроможна відобразити стан фінансової системи, охарактеризувати її структуру і динаміку, оцінити її розвиток, виявити та змодельовати вплив комплексу ринкових факторів на розвиток усіх сфер та ланок фінансової системи. Статистика забезпечує кількісну оцінку соціально-економічних явищ і процесів, властивих фінансовій сфері, та виявляє закономірності у функціонуванні державних фінансів, грошового обігу, банківської системи, у страхуванні, на ринку цінних паперів тощо.

В останні роки кожна сфера фінансової системи України знаходиться в стадії постійного розвитку та реформ. Зазнають реформ державні фінанси, в першу чергу, бюджетна система держави, оскільки в умовах ринкової економіки бюджет не тільки не втрачає своєї ролі, а він є основним інструментом регулювання соціально-економічних процесів. Разом з тим, в бюджетній сфері накопичилось багато проблем: бюджетний дефіцит, державний борг, повнота мобілізації коштів до бюджету, ефективність їх витрачання. Актуальним також є реформування управління фінансами підприємств, які функціонують в умовах вільного ринку, коли власникам підприємств необхідно приймати рішення щодо емісії цінних паперів, збільшення статутного капіталу підприємства, розподілу прибутку, вміти управляти інвестиційними вкладеннями. Окремо заслуговує на увагу функціонування фінансового ринку в Україні, оскільки він є запорукою стабільного зростання економіки держави. Діяльність установ фінансового ринку покликана забезпечити економіку держави фінансовими ресурсами. На сьогоднішній день зростає роль міжнародних фінансів і їх вплив на економіку держави: поживається міжнародна інвестиційна діяльність, розвивається зовнішня торгівля, функціонують міжнародні фінансові організації.

Тому, виходячи з ролі, яку відіграє фінансова система в економічному розвитку країни, зростає важливість використання економіко-статистичних методів її аналізу. Сьогодні у фінансовій сфері особливого значення набувають такі методи обґрунтування прийняття рішень, що забезпечують найбільш ефективний розвиток економіки. Щоб впливати на функціонування фінансової системи на макро- і мікрорівнях, здійснювати цілеспрямоване прогнозування її розвитку

необхідне якісне інформаційне забезпечення економічного аналізу. Повнота і достовірність аналітичної інформації залежать від методології здійснення статистичних розрахунків, вимоги до яких зростають в умовах ринкової економіки. Саме за допомогою статистичного дослідження функціонування фінансової системи, можливо сформулювати пропозиції щодо розв'язання існуючих проблем у фінансовій сфері, спрогнозувати її подальший розвиток з метою стабільного зростання економіки держави. Крім того, за допомогою статистичних досліджень державні фінансові органи здійснюють прямий чи опосередкований контроль основних параметрів розвитку всіх сфер та ланок фінансової системи, розробляють та реалізують фінансову політику в державі.



МЕТОДИЧНІ ПІДХОДИ ДО РОЗРАХУНКУ ВАЛОВОГО РЕГІОНАЛЬНОГО ПРОДУКТУ

Т.М. Моторина,

*к.е.н., доцент кафедри статистики та демографії
Київського національного університету імені Тараса Шевченка*

Розрахунки регіональних узагальнюючих показників системи національних рахунків стимулюють розвиток регіональної статистичної системи шляхом розширення відповідної інформаційної бази як інструмента вивчення економічної ситуації в регіоні, формулювання і аналізу регіональної політики.

Валовий регіональний продукт (ВРП) ідентичний за своїм економічним змістом загальновідомому ВВП. Це є вартістю кінцевих товарів і послуг, вироблених інституційними одиницями, що є резидентами певного регіону.

Сума ВРП регіонів повинна дорівнювати ВВП. Проте, на практиці при розрахунку ВРП виникають проблеми з віднесенням до конкретних регіонів деяких інституційних одиниць і їх операцій. Ці проблеми носять виключно практичний, а не концептуальний характер і виникають з причин існування екстрарегіональної території та відсутності

інформації про деякі операції на регіональному рівні.

У разі відсутності інформації про операції на регіональному рівні дані про операції, що є тільки для країни в цілому, розподіляються між регіонами відповідно до яких-небудь показників, наявних в розрізі регіонів.

Наявність практичних труднощів приводить до певних обмежень при використанні різних методів розрахунку ВРП.

Так, якщо ВВП розраховується трьома методами, з яких основним вважається або виробничий метод, або метод кінцевого використання, то ВРП в повному обсязі в даний час може розраховуватися двома методами: виробничим і розподільним, основним з яких є виробничий метод.

Розрахунки ВВП виробничим і розподільним методами проводяться як в розрізі галузей так і секторів економіки. Розрахунки ВРП цими методами можуть бути здійснені тільки в розрізі галузей, оскільки діяльність інституційних одиниць, може розповсюджуватися на ряд регіонів і повинна розподілятися між ними на основі даних про заклади.

Найбільші труднощі пов'язані із розрахунками окремих елементів ВРП методом кінцевого використання. Вони можуть здійснюватися з певними обмеженнями тільки в аналітичних і довідкових цілях, оскільки відсутня інформаційна база для здійснення повноцінних розрахунків на рівні регіонів всіх компонентів кінцевого використання ВРП. Зокрема, для регіональних розрахунків витрат на кінцеве споживання домогосподарств цей показник треба корегувати на розподіл по регіонах сальдо покупок товарів і послуг резидентами за кордоном і нерезидентами в країні, а також резидентами даного регіону на території інших регіонів. При регіональних розрахунках валового нагромадження проблема полягає у визначенні його для закладів мультирегіональних одиниць. Відсутня також методика що дозволяє оцінити потоки експорту і імпорту на регіональному рівні які включають товари і послуги зовнішньої торгівлі і міжрегіональної.

Розрахунки ВРП здійснюються на тій самій концептуальній основі що і ВВП, але регіональна локалізація економічних операцій вимагає розробки нових методичних підходів та розширення інформаційної бази в практичній статистичній діяльності для використання різних методів розрахунку регіонального продукту.

ВИКОРИСТАННЯ ІНТЕГРАЛЬНОГО ПОКАЗНИКА ДЛЯ ОЦІНКИ ФІНАНСОВОГО СТАНУ ПІДПРИЄМСТВ

Є.А. Носова,

к.е.н., асистент кафедри фінансів

Київського національного університету імені Тараса Шевченка

Існування підприємств за умов ринкової економіки вимагає постійного контролю їх фінансового стану, що обумовлено необхідністю залучення коштів з внутрішніх та зовнішніх джерел, а також забезпечення прибутковості діяльності, оскільки він визначає конкурентоспроможність та потенціал підприємства, а також дозволяє забезпечити ефективність його діяльності та надійність для контрагентів.

Оцінка фінансового стану підприємства передбачає розрахунок великої кількості показників, які можна об'єднати у п'ять груп, а саме ліквідності, платоспроможності, рентабельності, ділової активності та показники оцінки позицій підприємства на ринку капіталів. Кожен показник має самостійне значення та вагомість, яка визначає його внесок у формування фінансового стану підприємства в цілому. Саме тому необхідно аналізувати систему показників, а не кожен з них окремо, оскільки їх індивідуальне дослідження не дозволить зробити висновок щодо загального стану підприємства. Це, в свою чергу, вимагає використання формалізованих методів зведення всієї сукупності досліджуваних показників до невеликої кількості узагальнюючих, або, навіть, побудови інтегрального показника. Підтвердженням цього є те, що через «поріг складності» об'єктивну оцінку можна отримати аналізуючи не більше ніж від 3 до 7 параметрів одночасно. Крім того, аналіз надлишкових показників призводить до додаткових витрат часу на їх розрахунок та аналітичне дослідження, в тому числі з метою визначення взаємозалежних показників.

Для побудови інтегрального показника можна використовувати бальні рейтингові або індексні оцінки.

Бальні оцінки передбачають визначення вагомості кожного з досліджуваних показників та, відповідно до цього, присвоювання йому певного балу за визначеною шкалою. Оцінка при цьому здійснюється за сумою балів, одержаною за кожною підсистемою показників, а проміжні інтегральні оцінки

дозволяють визначити негативні та позитивні факторні ознаки, що впливають на фінансовий стан підприємства. Бальні оцінки присвоюються на основі шкали діапазонів всіх можливих значень інтегральної оцінки (від мінімального до максимального). Кожному рівню фінансового стану відповідає певна кількість балів в межах побудованого інтервалу. При використанні цього методу охарактеризувати фінансовий стан підприємства можна тільки на основі порівняльного аналізу та побудови рейтингів, оскільки отримана оцінка не має встановлених нормативів. Крім того, вона є суб'єктивно, але дозволяє визначити надійність підприємства у порівнянні з конкурентами, що може бути корисним при визначенні можливостей зростання для власників та при виборі об'єкта вкладення коштів для інвесторів.

Індексна побудова інтегрального показника передбачає використання багатовимірної аналізу, в першу чергу факторного та кореляційно-регресійного аналізу, що дозволяє подати інтегральний показник у вигляді функції, але для їх застосування необхідно проаналізувати велику сукупність підприємств, що ускладнює аналіз. Крім того, такі моделі необхідно будувати окремо для підприємств, що працюють у одній галузі та є схожими за своїми характеристиками, що не дозволяє зробити їх універсальними.

Отже, використання інтегрального показника дозволяє оцінити фінансовий стан на основі одного узагальнюючого показника, що полегшує проведення його аналізу у динаміці та в порівнянні з іншими підприємствами, а також зменшує витрати часу на аналіз великої кількості показників. Але їх використання, незважаючи на застосування статистичної методології, не дозволяє повністю усунути суб'єктивізму при виборі показників, що входять до моделі та забезпечити 100-відсоткову достовірність оцінки через недоліки у вхідних даних.

— ◇ —

ПРЕДПРИНИМАТЕЛЬСКИЙ СТАРТ В МЕЖДУНАРОДНЫХ СОПОСТАВЛЕНИЯХ: ВЛИЯНИЕ БАЗИСНЫХ ИНСТИТУЦИОНАЛЬНЫХ И ИСТОРИЧЕСКИХ ФАКТОРОВ

О.И. Образцова,

*к. э. н., доц., зам. зав. кафедрой статистики
Национального исследовательского университета
Высшей школы экономики (НИУ ВШЭ)
(Москва, Россия)*

Среди финансируемых Правительством РФ антикризисных мер приоритет отдается поддержке уже действующих на рынке организаций, потому оказывают лишь стабилизирующий эффект в рамках уже сложившихся условий, но не способствуют вовлечению всё новых индивидов в предпринимательский процесс. Реальные тенденции в этой сфере отражают статистические данные о ранней предпринимательской активности населения (Early-Stage Entrepreneurial Activity of Adult Population – EA), собираемые в ходе Глобального мониторинга предпринимательства (Global Entrepreneurship Monitor – GEM) о численности ранних предпринимателей. Лонгитюдный характер проекта GEM и международная сопоставимость данных, позволили нам провести компаративный анализ влияния национальных институтов на развитие предпринимательства в послекризисный период. Теоретической основой анализа стала трактовка институтов как совокупности правил, норм и обычаев хозяйствования, сложившихся в обществе, включая механизмы, регулирующие общие условия экономического порядка со стороны государства. Каждый взрослый трудоспособный индивид может выбрать один из вариантов экономического поведения: сначала экономическую неактивность или активность, затем наёмный труд или предпринимательство. «Выбор экономического поведения ... в определённое время и в определённом месте, зависит, прежде всего, от правил игры, то есть от структуры выплат в экономике». «Варьирование правил игры ... создаёт существенные различия между экономическими системами», в результате многие теоретические модели не дают значимых

результатов в объяснении ЕА в развивающихся странах и странах с переходной экономикой.

Кроме того, статистический анализ данных о динамике ЕА в странах – участницах GEM показал, что в условиях глобального экономического кризиса в большинстве стран не наблюдалось значимых изменений соответствующего индекса. Логично предположить, что не текущая экономическая ситуация, а упомянутые выше базисные институциональные факторы, обусловили различия ЕА в условиях каждого национального рынка.

Мы использовали модель дискриминантного анализа (LDA) для построения предикторных переменных, объясняющих уровень индекса ЕА. База независимых переменных LDA включала как количественные, так и качественные (ординальные и номинальные) переменные и была построена с использованием базы данных GEM и официальной статистики Всемирного Банка. Построенная модель позволила объяснить параболическую зависимость между уровнем ЕА и уровнем экономического развития, а также предсказать уровень ЕА не только в рамках проекта GEM, но и для других стран мира.



СУЧАСНИЙ РЕЖИМ НАРОДЖУВАНOSTІ В УКРАЇНІ: СТАТИСТИЧНЕ ОЦІНЮВАННЯ СТАНУ ТА ПЕРСПЕКТИВ

З.О. Пальян,

*канд. екон. наук, доцент кафедри статистики та демографії
Київського національного університету імені Тараса Шевченка*

Кожен тип відтворення населення має свої особливості перебігу демографічних процесів. Незважаючи на те, що українське населення більш як пів століття живе за сучасним режимом відтворення, тенденція народжуваності та модель репродуктивної поведінки з часом набували різного характеру. Довготривалий спад рівнів народжуваності в Україні (1965-2001pp) супроводжувався переходом від моделі дводітності (1965 -1989pp.) з доволі молодим середнім віком матерів (25,4 років у 1989 р.) до моделі одностітності із збереженням ранніх

перших народжень (22,8 років у 2000 році), коли кожна жінка умовного покоління могла народити за усе діторodne життя одну дитину. Лише на другому році нового тисячоліття в Україні з'явилися ознаки поступового виходу із стану “репродуктивного колапсу”.

За останніх дев'ять років напрям тенденції народжуваності кардинально змінився, зокрема протягом 2002-2010 рр. рівень загального коефіцієнта народжуваності зріс на 8,8% або щорічно в середньому на 1,1%, з незначним уповільненням у 2010 році. Водночас змінилась модель народжуваності, ознаками якої є суттєве зменшення частки первістків (з 60,3% у 2001р. до 53,1% у 2009р.) за рахунок появи дітей переважно другої і частково третьої черговості, а також постаріння материнського контингенту внаслідок відкладання терміну народження первістків. Так, середній вік матерів при народженні першої дитини зріс з 22,8 років у 2001р. до 23,8 років у 2009р. Відбувається істотне зростання плідності серед жінок віком 30-34 (на 30% порівняно з 1990р.) та 35-39 років відповідно на 42,4% або щорічно в середньому на 1,9%. Втім, природно, що найактивнішими репродуктивним контингентом залишається молодь у віці 20-29 років. Які ознаки сучасної репродуктивної поведінки молоді і, як вона в подальшому визначатиме інтенсивність дітонародження в Україні? Статистичну відповідь на ці запитання дають результати пропонованого дослідження.

В роботі здійснено аналіз показників репродуктивної активності молоді, зміни характеру вікової плідності, середньої фактичної та запланованої кількості дітей. Оцінювалась залежність числа запланованих дітей від кількості наявних дітей, а також від стану здоров'я молодих потенційних батьків та характеру їхньої зайнятості.

В дослідженні використовувались офіційні дані Держкомстату України за 1989-2009рр. та результати спеціально організованого обстеження «Молодь України: спосіб життя та ціннісні орієнтації, проведеного центром «Соціальний моніторинг» у 2010р. Аналізувались також дітородні наміри з урахуванням певних чинників. Так, за свідченням респондентів визначальним у прийнятті рішення щодо народження дитини є, в першу чергу, стан здоров'я потенційних батьків, любов до дітей, стабілізація доходів та наявність належних житлових

умов. Цікаво, що переважна більшість респондентів (84%), схвалюючи запровадження пронаталістських заходів, зокрема виплату щомісячної грошової допомоги при народженні дитини, не вважають їх впливовими на прийняття рішення щодо появи на світ дитини.

Беручи до уваги сучасну модель повікової плідності жінок України, в роботі виконано імітаційне моделювання очікуваної в 2015р чисельності народжених та перспективної чисельності і статеві-вікового складу населення. Результати дослідження слугуватимуть науковим підґрунтям удосконаленням діючої державної стратегії демографічного розвитку України.



ПРОБЛЕМИ ФУНКЦІОНУВАННЯ ПІДПРИЄМСТВ ЖКК ТА НАПРЯМКИ ЇХ ПОДОЛАННЯ

І. В. Панасенко,

*к.е.н., асистент кафедри економічної статистики
Донецький національний університет*

Житлово-комунальний комплекс є важливою складовою суспільного життя. Через виробництво житлово-комунальних послуг відбувається задоволення життєво важливих потреб населення у забезпеченні благами й послугами, що необхідні для життєдіяльності населення і безперебійного процесу виробництва товарів і послуг підприємствами, – водопостачання і водовідведення, опалення, забезпечення газом, електрифікація, обслуговування ліфтами і т.п. Сучасний стан житлово-комунального комплексу можна охарактеризувати як нестабільний через використання застарілого обладнання, брак фінансових коштів, недосканалість нормативно-правової бази, невідповідність якості та вартості послуг ЖКК і т.ін. Зношена матеріально-технічна база підприємств ЖКК обумовлює виникнення розходжень між обсягами вироблених та наданих послуг споживачам за рахунок неврахованих втрат ресурсів. З метою усунення такої ситуації необхідними є заміна комунікацій на технологічно нові, підвищення коефіцієнту корисної дії обладнання, що вимагає великих інвестиційних вкладень.

Оцінка інвестування підприємств ЖКК говорить про збільшення як державних, регіональних, так місцевих вкладень у модернізацію та розвиток житлово-комунальних підприємств. Виникає протиріччя - збільшення втрат ресурсів при одночасному збільшенні інвестицій в основний капітал на підприємствах ЖКК. Це пояснюється тим, що обсягів інвестиційних коштів недостатньо для модернізації матеріально-технічної бази, вони «розпорошуються» та витрачаються на поточні потреби підприємств.

З метою оцінки ефективності залучення інвестицій в основний капітал на підприємствах ЖКК нами пропонується використання модифікованої регресійної моделі, яка дозволяє визначити період часу, протягом якого відбудеться накопичення інвестицій, достатніх для модернізації мереж. Модифікація класичної парної регресійної моделі витікає з гіпотези, що параметри рівняння регресії також змінюються у часі за лінійним трендом.

У якості факторної ознаки виступає обсяг інвестицій в основний капітал (x), у якості результативної – величина інвестицій в основний капітал (y). Через те, що модель є динамічною, то додатково вводиться фактор часу (t). Шляхом математичних перетворень отримується нове рівняння регресії, яке містить чотири параметри: перший – не несе змістового навантаження (a_0), другий – показує зміну втрат ресурсів при збільшенні обсягів інвестицій в основний капітал (a_1), третій – оцінює зміну обсягів втрати у часі (a_2), а четвертий – характеризує зміну факторної ознаки, тобто інвестицій, у часі та їх вплив на втрати ресурсів (a_3). Для сучасних підприємств ЖКК характерно додатне значення коефіцієнту a_1 , та від’ємне значення a_3 . Це свідчить, що втрати ресурсів збільшуються при зростанні інвестицій в основний капітал, а вплив зміни інвестицій у часі на величину втрат зменшується. Співвідношення параметрів a_1 та a_3 дає можливість визначити період часу, необхідний для накопичення інвестицій, яких буде достатньо для заміни застарілого обладнання житлово-комунальних підприємств.

Таким чином, сучасні підприємства ЖКК потребують заміни застарілого обладнання, що надасть їм можливість виробляти послуги відповідної якості. Проте, це неможливо без інвестування підприємств у великих обсягах, державного

цільового фінансуванні, ліквідації «тіньових» схем реалізації інвестиційних проєктів, розробці механізмів контролю за інвестиційними коштами. Приріст інвестиційних коштів підприємств у кризових умовах економічного розвитку обумовлює необхідність пошуку альтернативних джерел фінансування - залучення приватного бізнесу до управління об'єктами комунальної інфраструктури у рамках державно-приватного партнерства.



ПРОГНОЗУВАННЯ ВАЛОВОГО ВНУТРІШНЬОГО ПРОДУКТА ЗА ДОПОМОГОЮ АВТОРЕГРЕСІЙНИХ МОДЕЛЕЙ

К.Р. Приходько,

*к.е.н., асистент кафедри статистики та демографії
Київського національного університету імені Тараса Шевченка*

На сьогоднішній день є величезна кількість досліджень присвячених розробленню методів та підходів по прогнозуванню макроекономічних показників, зокрема, ВВП. Їх можна поділити на ті, що досліджують причинно – наслідкові зв'язки, і моделі часових рядів, які роблять прогноз спираючись тільки на поведінку показника в минулому. В рамках цього підходу спостережений ряд приймається, як деяка реалізація певного випадкового процесу. При цьому передбачається, що часовий ряд має структуру, яка відрізняє його від послідовності незалежних випадкових величин. З принципу економності припускають, що структуру ряду можна описати моделлю, яка містить незначну кількість параметрів, в порівнянні, з кількістю спостережень. Прикладами моделей, які відповідають даному підходу, є моделі: авторегресії, ковзаного середнього, та їх комбінації – моделі $AR(p)$, $MA(q)$, $ARMA(p,q)$, $ARIMA(p,d,q)$.

Останні методи набули широко розповсюдження завдяки низці переваг: відносній простоті та легкій автоматизації пошуку моделі, що є надзвичайно суттєвим при роботі з великою кількістю показників. Проте основною перевагою цих моделей є те, що вони потребують даних лише досліджуваного ряду. Слід зауважити, що точність прогнозування у великій мірі

залежить від стабільності економічної ситуації в цілому в державі, а також від якості даних, на основі яких будується прогноз. Тому основним критерієм для вибору є можливості наявної інформаційної бази, чим вона більш повна та точна, тим більш складні методи можна використовувати. В умовах України, як правило, важко отримати достатньо повну та достовірну інформаційну базу. Крім того якість даних багатьох показників є неоднозначною, це пов'язано як з методологією збору інформації, так і з наявністю тіньової економіки, вплив якої не відображається у багатьох показниках. За таких умов авторегресійні методи мають суттєву перевагу, завдяки тому, що використовують лише попередні значення прогнозованого процесу. Як наслідок, питання можливості використання авторегресійних моделей для побудови прогнозів макроекономічних показників економічного зростання України є надзвичайно важливим.

За останні роки проблемі можливості прогнозування ВВП, за допомогою авторегресійних моделей та точності отриманих прогнозів, було присвячено чимало досліджень. Основну увагу приділялось дослідженню двох питань: порівнянню точності прогнозів отриманих за допомогою багатофакторних та однофакторних моделей, та вибору найкращої форми моделі серед однофакторних.

Отже, існує проблема побудови авторегресійних моделей для отримання прогнозних значень ВВП України, та оцінювання точності цих прогнозів, з метою можливості їх застосування при прийнятті рішень.

— ◇ —

МЕТОДОЛОГИЧЕСКИЕ ОСНОВЫ ПОСТРОЕНИЯ МОДИФИЦИРОВАННОГО МЕЖОТРАСЛЕВОГО БАЛАНСА С УЧЕТОМ ЭКОЛОГО-ЭКОНОМИЧЕСКИХ ПРОЦЕССОВ

Л.А. Сошникова,

*д.э.н, доцент, доцент кафедры статистики
Белорусского государственного экономического университета*

Возрастающее внимание к экологическим проблемам обусловило необходимость совершенствования теории и методологии таких наук, как экономическая статистика. Одним из его направлений является дальнейшее развитие системы национальных счетов с целью увязки показателей экономической и природоохранной деятельности и состояния окружающей среды. Разработанная и опубликованная Департаментом статистики ООН Система комплексного экологического и экономического учета (СЭЭУ) содержит рекомендации, включающие основные методологические подходы к формированию интегрированной системы эколого-экономического учета. Проектирование такой системы для конкретной национальной экономики с учетом наработок и рекомендаций международных организаций является актуальной задачей, поскольку она позволит более объективно оценивать на основе модифицированных макроэкономических показателей устойчивость развития социально-экономических систем.

Важная роль в интегрированной системе эколого-экономического учета, как и в действующей системе национальных счетов (СНС), должна принадлежать межотраслевому балансу как инструменту моделирования и анализа процессов формирования и использования валового внутреннего продукта в отраслевом разрезе. В действующей СНС при определении стоимости промежуточного потребления использование ресурсов окружающей природной среды с экономическими целями учитывается частично, поэтому оно не находит отражения в важнейших агрегированных показателях национальных счетов, например, величине валового внутреннего продукта (ВВП). В этой связи актуальным становится рассмотрение проблемы интегрирования экологических и экономических показателей в таких

статистических моделях, как национальные счета и межотраслевой баланс. Для решения названной проблемы требуется прежде всего изменить методологические подходы к определению затрат на охрану окружающей среды, модифицировать саму симметричную таблицу «Затраты-Выпуск», выделив в ней экологические составляющие, и дополнить систему счетов внутренней экономики расширенными счетами производства и накопления с четким представлением в них природоохранного компонента. Это явится важным шагом в создании национальной системы комплексного эколого-экономического учета, которая существенно расширит аналитические возможности при оценке взаимосвязи экономики и окружающей природной среды и будет ориентирована на улучшение качества моделирования и прогнозирования макроэкономических показателей на основе межотраслевого баланса с учетом экологических аспектов.

Поскольку устойчивое развитие социально-экономических систем предполагает обязательный учет экологического фактора во всех видах экономической деятельности, вряд ли можно сразу создать всеобъемлющую систему необходимых статистических показателей, позволяющих оценивать степень этой устойчивости. Скорее всего, эта система будет складываться постепенно в процессе изменения самого бухгалтерского и статистического учета данного фактора. То, что последний недостаточно принимается во внимание при принятии решений, во многом связано с отсутствием в традиционных системах статистических показателей полного стоимостного отражения потребления ресурсов окружающей среды, ущерба от ее загрязнения.

Дальнейшее совершенствование отражения экологических аспектов в составе статистического учета существенно расширит возможности планирования, контроля, анализа, прогнозирования природоохранных затрат, позволит объективно оценивать экономическую эффективность природоохранных мероприятий и обеспечивать заинтересованных пользователей достоверной информацией об экологической составляющей деятельности хозяйствующих субъектов.

Целью данной работы является разработка теоретических и методологических основ построения и анализа модифицированного межотраслевого баланса с учетом эколого-

економических процессов для расчета экологически скорректированных макроэкономических показателей.

Выполненный автором анализ существующей информационной системы государственной статистики Республики Беларусь на предмет отражения в ней экологических факторов позволил определить основные направления совершенствования статистического учета и отчетности, предложить принципиально новую структуру межотраслевого баланса.

Предложенные методики могут быть применены органами государственной статистики при выполнении работ по модификации системы таблиц «Затраты-Выпуск», а также при совершенствовании методологических основ статистики окружающей среды.

— ◇ —

СТАТИСТИЧНА ОЦІНКА РІВНЯ ЗАБЕЗПЕЧЕНОСТІ ТА ЯКОСТІ НАДАННЯ ОФТАЛЬМОЛОГІЧНОЇ СТАЦІОНАРНОЇ ДОПОМОГИ СІЛЬСЬКИМ МЕШКАНЦЯМ УКРАЇНИ: РЕГІОНАЛЬНИЙ АСПЕКТ

О.М. Черемухіна,

к.мед.н., лікар вищої категорії

Київської Міської клінічної лікарні «Центр мікрохірургії ока»

Однією з найбільш гострих проблем сучасної офтальмологічної галузі у системі охорони здоров'я в Україні є забезпечення медичною допомогою сільського населення. До теперішнього часу в Україні комплексні статистичні дослідження рівня та якості забезпеченості сільського населення офтальмологічною стаціонарною допомогою на вторинному та третинному рівнях медико-санітарної допомоги практично не проводилися. І це в умовах, коли офтальмологічні патології складають 5% від загальної кількості захворювань і посідають шосте місце, що дозволяє віднести її до однієї з найпоширеніших груп у структурі загальної захворюваності в Україні.

В Україні спеціалізована та кваліфікована офтальмологічна допомога надається в стаціонарах центральних районних лікарень та в обласних лікарнях потужністю від 40 до 120 ліжок. Вторинна та третинна стаціонарна допомога сільським мешканцям надається в 23 обласних та у 115 відділеннях центральних районних лікарень. Незважаючи на зростання кількості хворих і рівня захворюваності в цілому за період 2002-2008 рр. по Україні кількість ліжок в обласних і центральних районних лікарнях зменшилось з 1566 і 1791 до 1208 і 1494 на вторинному і третинному рівнях відповідно. Такі процеси призвели до серйозного зниження рівня забезпеченості хворих сільських мешканців очними ліжками. Так, в цілому по Україні кількість ліжок скоротилася на 20%, а кількість хворих зросла на 15,8%, що в решті решт призвело до того, що рівень забезпеченості хворих очними ліжками знизився на 30%. Небезпечною можна назвати ситуацію, що склалася в Миколаївській і Дніпропетровській областях, де повністю відсутня необхідна допомога на вторинному рівні, а в Миколаївській області і на третинному рівні. В Харківській області рівень забезпеченості знизився на 75% і замість 19 ліжок на 1000 хворих у 2002 р. залишилось тільки 5 і це на тлі зростання кількості хворих за цей період на 91%. Аналогічна ситуація в Херсонській області, де кількість хворих зросла практично на 68%, а кількість ліжок не змінилася, що призвело до зниження рівня забезпеченості на 40%. Таким чином, за період 2002-2008 рр. забезпеченість дорослого сільського населення стаціонарною офтальмологічною допомогою на вторинному та третинному рівнях змінювались зі скороченням стаціонарних очних відділень і ліжок, при цьому відмічається тенденція приросту поширеності хвороб ока та його придатків.

Встановлена тенденція до зростання амбулаторної хірургічної допомоги мешканцям села, що вказує на більш якісну хірургічну підготовку і стандартизацію лікувальних процесів у диспансерних і розвантаження стаціонарних ліжок. Уведення хірургічних технологій не можливо без коштовного діагностичного та операційного обладнання, інструментарію, тому у регіонах дуже складно стрімко покращити амбулаторну офтальмохірургію.

З введенням мікрохірургічних високотехнологічних оперативних втручань на очах в деяких областях спостерігається

тенденція підвищення хірургічної активності завдяки застосуванню більш низької за рівнем хірургічної кваліфікації операційної техніки та проведення операцій, наприклад, енукеація. Виявлено, що рівень хірургічної активності не пов'язаний з питомою вагою атестованих лікарів та їх кількістю, й також не пов'язаний з кількістю ліжок у стаціонарі. Доведено, що питома вага атестованих лікарів ще не означає рівень кваліфікації хірургів очних відділень на вторинному та третинному рівнях і відповідно не свідчить про якість лікування в умовах стаціонарної допомоги. Кількість не означає якість, і тому збільшення кількості операційних втручань – оборотна сторона медалі, тобто погані екологічні умови життя сільських мешканців, несвоєчасна первинна діагностика захворювань ока, недостатня первинна профілактика очних захворювань, а у більшості випадків – її цілковита відсутність і невчасне взяття на диспансерний облік, небажання пацієнтів дотримуватись довгострокового коштовного фармакологічного лікування.



МОДЕЛЮВАННЯ ЛАТЕНТНИХ ЗМІННИХ: РОЗВИТОК, СУЧАСНИЙ СТАН ТА ПЕРСПЕКТИВИ

А.Ю. Чорний,

*к.е.н., доцент кафедри статистики та економетрії
Київський національний торговельно-економічний університет*

Протягом останніх 60 років набула значного розвитку методологія моделювання латентних змінних як складова частина багатовимірною статистичного аналізу. Її поширення у соціально-економічних науках пояснюється можливістю концептуалізації, розроблення і дослідження складних багатовимірних моделей, що представляють теоретично і практично рушійні сили та структурні зв'язки, які є основою для суспільних явищ і процесів.

Історія розвитку даної методології, визначення її сучасного місця у статистичній науці, розкриття поточних проблем та окреслення перспектив подальшого розвитку становить мету даного дослідження.

Походження моделей латентних ознак має два джерела – психологію та економетрію.

Походження факторного аналізу може бути прослідковане від творів Гальтона і Пірсона, який математизував та істотно розвинув статистичні ідеї Гальтона. Пірсону належить перша робота, присвячена методу головних компонент. Того ж часу починає свої дослідження Ч. Е. Спірмен. Фактично, сам термін „факторний аналіз” як і названа галузь статистики, з’явився в роботі Спірмена при дослідженні структури розумових здібностей. Праці Спірмена та інших утворили так звану британську школу факторного аналізу. У 30 році XX-сторіччя увага приділялася до робіт Терстоуна, який визначив основні проблеми даної галузі і ввів принцип простої факторної структури. В роки перед Другою світовою війною важливі роботи були виконані Г. Хотеллінгом, який запропонував сучасне трактування методу головних компонент.

Існування латентних змінних в економетрії розглядалося з самого початку. Подальший розвиток розпочався із запровадженням складних моделей, побудова яких вимагає створення систем рівнянь. Об’єднання таких моделей із моделями факторного аналізу дозволило К.Йореско, розробити модель лінійних структурних рівнянь з латентними змінними. За основу було покладено коваріаційну матрицю між спостережуваними ознаками, за якою визначається система структурних рівнянь, що дозволяє відтворити структуру зв’язків у матриці. Причині моделі з латентними змінними починають активно розвиватися з кінця 60-х років і знаходять широке використання.

В останні 15 років відбувається розвиток "другого покоління" цієї методології, яке власне і надало узагальнюючу назву "моделювання латентних змінних" (англ. *latent variable modeling (LVM)*). Ця теорія містить моделювання структурними рівняннями в свою чергу, як складову, і ґрунтується на концептуальному визначенні латентної змінної як такої, вплив якої знаходить своє відображення через інші спостережувані ознаки-індиктори. Це дозволяє узагальнити ряд методів статистичного аналізу, що істотно поглиблює рівень розуміння соціально-економічних явищ.

На сучасному етапі розвитку до моделей латентних змінних відносять наступні: моделі головних компонент; моделі

факторного аналізу; моделі багатовимірних залежних латентних змінних; моделювання структурними рівняннями з латентними змінними; розширені моделі з взаємодією екзогенних ознак і латентні моделі динаміки.

Практична побудова моделей з латентними змінними реальних соціально-економічних процесів визначила основні проблеми, що потребують вирішення. Основними є наступні: нелінійність зв'язків між змінними; розгляд латентних змінних як якісних ознак; адекватність методів оцінювання показникам досліджуваних процесів; вибір виду причинно-наслідкових зв'язків між латентними і спостережуваними змінними; неоднорідність сукупностей, на основі яких оцінюються параметри моделі; особливості застосування при дослідженні конкретних соціально-економічних процесів.



СОЦІАЛЬНО-ТРУДОВІ ВІДНОСИНИ, ЯК ОСНОВА ДЛЯ РОЗВИТКУ ПІДПРИЄМСТВА ТА РОСТУ ЇХ КОНКУРЕНТОСПРОМОЖНОСТІ

Н.М. Васильєва,

*аспірантка НТК– статистичних досліджень,
головний спеціаліст-економіст*

Головного управління статистики у Житомирській області.

Для досягнення високого рівня конкурентоспроможності національної економіки необхідно сформувати ефективні соціально-трудові відносини. Це пов'язано з тим, що в умовах ринкової трансформації економіки найсуттєвіші зміни відбуваються у соціально-трудовій сфері. Демократизація суспільного життя, становлення державності, створення нового правового поля – всі ці економічні та соціально-політичні процеси суттєво впливають на соціально-трудові відносини в Україні.

Сучасне бачення ролі соціально-трудових відносин функціонування певної сфери економічної та соціальної діяльності зумовлює необхідність оцінити соціально-трудові

відносини на підприємстві, розробку і застосування оптимальних механізмів їх розвитку та регулювання.

Соціально-трудові відносини — це комплекс взаємовідносин між найманими працівниками і роботодавцями за участі держави, які пов'язані з наймом працівників, використанням та оплатою їхньої праці, відтворенням робочої сили і спрямовані на забезпечення соціальної злагоди, високого рівня та якості життя працівників, високої ефективності роботи підприємств.

Ці відносини є необхідним елементом будь-якої суспільної праці чи виробництва. Вони охоплюють широке коло питань — техніко-економічні, соціально-економічні, правові, соціально-психологічні, морально-етичні та інші. Вищезазначені аспекти соціально-трудових відносин пов'язані з вирішенням наступних питань:

- проведенням переговорів у колективах та безпосередньо з роботодавцем або найманим працівником;
- укладання договорів і угод та підвищення соціальної відповідальності сторін за їх виконання;
- застосування мотиваційних важелів соціально-трудових відносин, повернення оплаті праці регулюючої, відтворювальної та стимулюючої функцій;
- державне регулювання якості робочої сили шляхом підготовки та перепідготовки кадрів;
- формування кадрів інноваційного типу;
- вирішення трудових конфліктів;
- підвищення корпоративної культури в установах та підприємствах (рівні права суб'єктів стосовно участі в управлінні виробництвом);
- вдосконалення змісту та умов праці на кожному робочому місці та на підприємстві, насамперед за рахунок скорочення важкої фізичної, шкідливої та небезпечної для здоров'я праці, а також некваліфікованої та непривабливої;
- посилення ролі держави у забезпеченні соціальних гарантій зайнятості;
- створення гідних умов для соціалізації соціально-трудових відносин (розвиток соціальної інфраструктури, пом'якшення диференціації у соціальних умовах праці, інвестиції у людський капітал) тощо.

При формуванні соціально-трудових відносин в Україні необхідно орієнтуватися на цінності країн, які мають розвинену

ринкову економіку: висока мотивація до ефективності праці, визнання надзвичайної ролі людського фактору та знань, у взаємовідносинах керівництва і підлеглих – заохочення ініціативи, солідарності та партнерства.



IMPLEMENTATION OF MONTE CARLO METHOD IN OPTION VALUATION USING STATISTICAL PROGRAMMING LANGUAGE R

I.I. Vasylichenko

*Taras Shevchenko National University of Kyiv
Postgraduate student, “Economic cybernetics” department*

Recent decades global financial markets were followed by rapid growth of credit derivatives' turnover. A vast variety of products are present at the market, giving private and institutional investors ability to flexibly hedge their operations against different types of risks, which may contain interest rate and exchange rate exposures, uncertainty in future levels of underlying asset's (stocks, commodities) prices etc.

Although, trading derivatives should be carried out carefully, while it can bring together with incomes considerably big losses, especially if a highly leveraged capital was used. In order to minimize operational losses and to prevent possible arbitrage opportunities, precise and adequate tools for pricing derivatives are in need.

Considerable amounts of research were dedicated to this question, which led to development of diverse methodologies. Some of them, based on financial theories and relatively strict assumptions, give closed-form solutions (e.g. Black-Scholes model), while others are rather numerical methods like binomial option pricing model (Cox, Ross-Rubinstein), neural networks algorithm or Monte Carlo method.

Last one proved itself to be a good approach in valuation of derivative securities, in case there is no closed-form solution present.

Monte Carlo method is a simulation technique that, with the use of random numbers and probability, can give solutions to a problem in case it is infeasible or impossible to compute an exact result with a

deterministic algorithm. This method was devised by Stanislaw Ulam and John von Neumann in 1940s during their work in nuclear weapon projects and was primarily intended to help them with their experiments in physics. Later on it became widely used in mathematics (e.g. evaluation of definitive integrals) and in variety of fields where modeled phenomena have significant uncertainty of inputs (such as risk modeling in business).

One of the first applications of this idea to derivatives pricing was done by Phelim Boyle in 1977. In that particular case these were European options, however later on Monte Carlo method appeared to be especially useful in valuation of exotic options (e.g. Asian options, Barrier options, American options).

This simulation is classified as a sampling method because the inputs are randomly generated from probability distributions to simulate the process of sampling from an actual population.

In terms of derivative pricing problem, this procedure looks quite straight-forward: we randomly generate some quantity of price paths for underlying asset in order to calculate execution payoffs for each given path and then by averaging and discounting them to find adequate derivative's price.

Throughout our paper we would like to briefly discuss theoretical part of this method, its improvements (e.g. use of quasi-random low-discrepancy sequences) and focus especially on practical application. Latter we would conduct with the help of R statistical programming language, while it is light and free-to-use environment, which coupled with fOptions library, gives intuitive procedures for implementation of Monte Carlo method in option valuation.

— ◇ —

ПРОБЛЕМИ ІНФОРМАЦІЙНОГО ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ АНАЛІЗУ ТРАНСКОРДОННОГО СПІВРОБІТНИЦТВА ПОЛЬСЬКО–УКРАЇНСЬКО–БІЛОРУСЬКОГО ПРИКОРДОННЯ

С.Ф. Васьків,

*асистент кафедри статистики,
Львівський національний університет імені Івана Франка*

Одним з основних пріоритетів Програми транскордонного співробітництва Польща–Білорусь–Україна на 2007-2013 роки є інституційна співпраця та підтримка ініціатив місцевих громад, в рамках розвитку можливостей транскордонного співробітництва на регіональному та місцевому рівні, з метою покращення можливостей транскордонного співробітництва; створення нових інституційних форм транскордонних зв'язків; співпраці державних установ, насамперед, органів місцевого самоврядування, зокрема в галузі стратегічного та територіального планування; а також підтримка розвитку інформаційних та комунікаційних технологій для транскордонного співробітництва.

Створення інформаційної бази транскордонної співпраці передбачає підготовку системи статистичних показників, адресованих міністерствам, відомствам, обласним державним адміністраціям, підприємствам, науковим та навчальним закладам тощо.

Брак інформації є однією із найважливіших перешкод у розвитку транскордонного співробітництва польсько-українсько-білоруського прикордоння.

Програма транскордонного співробітництва вимагає визначення необхідних орієнтирів, показників оцінки поступу на шляху одержання кінцевого результату. Для таких цілей повинен слугувати моніторинг.

При проведенні моніторингу транскордонних програм для прикордонних регіонів Польщі, України та Білорусі, важливою проблемою є порівнянність статистичних даних, для інтерпретації та аналізу масових явищ і процесів на прикордонних територіях. Крім цього частина проблем пов'язана з порівнянністю понять, термінології, статистичної методології та класифікаціями. Так, польські статистики,

спостереження проводять з вимогами ЄС, на основі політики згуртованості. Інформація статистичних управлінь транскордонних територій України та Білорусі показує, що для деяких явищ та процесів взагалі не проводяться статистичні спостереження, а в деяких випадках дані агрегуються для іншого часового проміжку або територіального розташування.

Однак при діагностиці стратегії спостерігаємо що лише біля 30% показників можна порівняти.

Найменше проблем з пошуку якісних і порівняльних статистичних даних є в таких напрямках, як природно-географічне розташування та територіальний устрій, демографія та умови життя мешканців, ринок праці (але тільки в економічній активності населення), макроекономічній статистиці, статистиці сільського господарства.

Найбільше прогалин спостерігаємо в таких областях як ступінь економічного розвитку регіону, продуктивність економіки, конкурентоспроможності регіональної економіки, інноваційності економіки регіону, транспортної інфраструктури, виробництва та споживання електроенергії, доступу до мереж зв'язку з високою ефективністю, ринку праці, соціального відчуження, доступу до соціальної інфраструктури.

Для вирішення вище зазначених проблем, слід ефективно використати можливості залучення коштів стратегічного планування для проведення спільних статистичних досліджень згідно програми транскордонного співробітництва Польща-Білорусь-Україна; відданості та тісної співпраці органів національної та регіональної влади по обидва боки кордону; використання європейського досвіду транскордонних досліджень; а також ключової ролі офіційної статистики України та Білорусі, і їх адаптація до вимог ЄС.

— ◇ —

ПОДАТКОВІ НАДХОДЖЕННЯ, ЯК ОБ'ЄКТ СТАТИСТИЧНОГО ДОСЛІДЖЕННЯ

Л.В. Виятинська,

*асистент кафедри обліку, аудиту і економічного аналізу
Буковинської державної фінансової академії,
м. Чернівці*

Становлення та поступовий розвиток України, створення умов ефективного та раціонального використання ресурсних можливостей території, реформування системи державного управління відповідно до європейських стандартів підтверджує потребу загальної державної стабільності та виходу з кризи. Звідси слідує, що питання формування бюджету є головним для країни, який показує суспільно – економічний стан, як регіонів, так і держави. За допомогою державних коштів забезпечується фінансування соціального-економічного добробуту і розвитку, поряд з тим статистика аналізує надходження та використання коштів відповідних регіонів.

Бюджет є основною ланкою державних фінансів та важливою складовою фінансової системи в цілому. Бюджет держави – це сукупність законодавчо регламентованих відносин між державою, юридичними та фізичними особами з приводу розподілу і перерозподілу ВВП, а за певних умов – і національного багатства з метою формування і використання централізованого фонду грошових коштів, призначеного для забезпечення виконання державою її функцій. Важливою складовою бюджету є доходи та видатки бюджету. Відповідно до Бюджетного кодексу статті 2, доходи бюджету – податкові, неподаткові та інші надходження на безповоротній основі, справляння яких передбачено законодавством України (включаючи трансферти, плату за адміністративні послуги, власні надходження бюджетних установ).

Своєчасне наповнення дохідної частини Державного бюджету України є базою розбудови економіки держави та гарантією соціального забезпечення населення. Матеріальні ресурси, що наповнюють державні та місцеві бюджети отримуються переважно у вигляді податкових надходжень – головного джерела, можна зазначити, що поповнення доходів бюджетів здійснюється шляхом збільшення податкових

надходжень. Поряд з тим необхідно враховувати, що надмірне податкове навантаження є негативним чинником державної податкової політики, що несе відповідні наслідки.

Проблеми оподаткування є однією з найактуальніших на сьогодні (особливо з прийняттям Податкового кодексу). Історично склалося так, що податки були, є і мають тенденцію на майбутнє залишатися невід’ємним атрибутом держави, поряд з тим використання статистичних методів дає можливість оптимізувати податки і збори, оцінити податкові ризики, визначити фактори, що впливають, тощо.

Статистичне дослідження податкових надходжень є необхідною умовою ефективного функціонування та наповнення бюджетів різних рівнів в Україні, оскільки потрібно збирати інформацію (за допомогою податкової звітності), зводити, класифікувати та групувати її, аналізувати динаміку, структуру податкових надходжень, визначити частку податкових платежів у ВВП, використовувати міжнародний досвід, щодо оптимізації податкових надходжень в цілому по країні, прогнозувати їх розміри використовуючи кількісний та якісний потенціал регіону в майбутні періоди.

Варто відмітити, що незважаючи на те, оподаткування в Україні перебуває на початковому етапі розвитку, не є пристосованим до ринкових умов господарювання, не забезпечує достатнього обсягу податкових надходжень, його сучасний стан не відповідає принципам економічної ефективності, соціальної справедливості, адміністративної простоти, стабільності та гнучкості необхідно статистично досліджувати податкові надходження до бюджетів різних рівнів, оскільки тільки при їх застосуванні можна виявити недоліки та запропонувати рекомендацій, щодо виходу із ситуації.

— ◇ —

АНАЛИТИЧЕСКИЕ ВОЗМОЖНОСТИ АНКЕТЫ ГЛОБАЛЬНОГО МОНИТОРИНГА ПРЕДПРИНИМАТЕЛЬСТВА (GEM)

М. В. Габелко,

ст. преп. кафедры статистики НИУ-ВШЭ

Формат и методология Глобального мониторинга предпринимательства (GEM) обеспечивает сбор данных, характеризующих как предпринимательство и предпринимательскую среду, так и рамочные условия предпринимательской деятельности (РУПД - Entrepreneurial Framework Conditions, EFC): социальную среду и государственную политику в области поддержки предпринимательства. В качестве методов наблюдения за РУПД используются опрос населения в режиме интервью face-to-face, а также экспертные интервью с представителями бизнеса и власти, проводимые по установленному сценарию. Полученные по результатам опроса ответы населения на вопрос о перспективах развития бизнеса в течение ближайших 6 месяцев принято считать своеобразными номинальными индикаторами предпринимательского климата в стране и оценки населением всей совокупности мер поддержки предпринимательства.

Анкета Глобального Мониторинга предпринимательства содержит от 45 до 60 основных вопросов, и около 20-25 скрининговых вопросов. Все вопросы логически увязаны в несколько тематических блоков: общих (социально-демографические) и специальных (относящиеся к выделению предпринимательских страт в разрезе экономических и мотивационных признаков или тестирующие уровень и структуру источников финансирования). Отдельный блок посвящён фиксации в процессе наблюдения характеристик восприятия обществом предпринимательства и рамочных условий предпринимательской деятельности. Анкета сочетает открытые и закрытые вопросы, причём кодировка ответов на открытые вопросы в обязательном порядке предусматривает использование международных статистических классификаторов (таких, например, как Международная стандартная Классификация видов экономической деятельности – ISIC).

На основе данных GEM мы провели статистический анализ факторов оценки населением собственных компетенций к предпринимательству и перспектив развития предпринимательства. Статистическая структура базы данных обусловила преимущественную роль в анализе непараметрических методов исследования вариации и статистических связей.

Сравнительный анализ параметров моделей регрессионного анализа самооценки населением компетенций к началу бизнеса позволяет говорить о некоторой инертности российского предпринимательского потенциала в отношении глобальных процессов. Тем не менее, нельзя в полной мере отрицать значимость наблюдаемого во всех странах GEM эффекта взаимодействия для предпринимательского потенциала населения РФ. Поэтому мы предполагаем продолжить исследование выявленного комплексного эффекта в направлении статистического моделирования влияния комбинации рассмотренных параметров на уровень ранней предпринимательской активности. На данном этапе исследования хотелось бы подчеркнуть важность учёта эффекта взаимодействия оценок внутренних и внешних условий предпринимательства при разработке мероприятий по поддержке развития российского предпринимательства, особенно на ранних стадиях его существования.



СТАТИСТИЧНА ХАРАКТЕРИСТИКА ОСОБЛИВОСТЕЙ СУЧАСНОГО ЕТАПУ ВІДТВОРЕННЯ НАСЕЛЕННЯ АВТОНОМНОЇ РЕСПУБЛІКИ КРИМ

О.В. Горобець,

*ст. викладач Феодосійської фінансово-економічної академії
Київського університету ринкових відносин*

Автономна Республіка Крим належить до регіону, який характеризується народжуваністю з позитивною динамікою, середнім рівнем смертності, швидким природним скороченням населення, з уповільненою динамікою скорочення. Всі перераховані характеристики належать до Криму.

Статистичний аналіз показника відтворення материнського покоління в Автономній Республіці Крим показав, що його значення можна вважати оптимальним і має незначне відхилення від значення 1,02 протягом 2003 -2009 рр.

За період 2000 – 2009 рр. значення бруutto- та нетто- коефіцієнтів народжуваності зросло майже у 1,5 рази. Це дозволило зробити висновки про характер відтворення населення. Так з початку XXI сторіччя до 2007 р. мало місце звужене відтворення населення АРК, яке у 2007-2009 рр. змінилося на розширене, що характеризується перевищенням дітей над чисельністю батьківського покоління. Такі зміни відбулися тільки за рахунок зростання рівня народжуваності в республіці. Ці висновки підтверджуються додатним значенням істинного коефіцієнта природного приросту. Поступово зростає кількість жінок, які замінюють попередніх, в розрахунку на одну народжену дівчину (рівень потенційного відтворення), та зменшується кількість дівчаток, які забезпечують просте відтворення населення. До позитивних тенденцій відтворення населення Криму можна віднести збільшення середнього віку матері при народженні дівчат та доньок. Збільшення довжини жіночого покоління пояснюється тенденцією народження жінками другої, третьої та четвертої дитини. Така тенденція обумовлена етнічною строкатістю населення Автономної Республіки, для якого притаманна багатодітність. Що стосується України, то зростання народжуваності забезпечується тільки народженням першої дитини в родині. Слід зазначити, що водночас на народження третьої дитини наважилися тільки 7% жінок. На нашу думку резервом оптимізації режиму відтворення материнського покоління і населення Криму є подальше підвищення дітородної активності.

Стан природного відтворення населення також залежить від очікуваної тривалості життя при народженні. Результати дослідження природного відтворення показало, що в Криму очікувана тривалість життя нижче, ніж в Україні, окрім осіб, які народилися в період 1998–2001 рр., ймовірно, проживуть довше тих, що були народжені в після 2001 року. Таку ситуацію можна пояснити значними міграційними процесами у період повернення депортованих народів, оскільки народжені саме в Криму мають більшу очікувану тривалість життя. В цілому ж населення Криму живе на 0,3 роки менше, ніж населення

України.

При дослідженні статевовікової структури населення Криму встановлено, що на початок 1990 р. населення АРК мало стаціонарний тип (населення, що старіє), у наступні періоди структура населення змінилась і вже є регресивною (дуже старе населення), це пояснюється зростанням смертності всього населення. Нижня частина піраміди починаючи з 1992 р. показує різке падіння народжуваності, а основа піраміди постійно звужується.



ОЦЕНКА ЭФФЕКТИВНОСТИ СБЫТА ПОСРЕДСТВОМ ЭЛЕКТРОННЫХ ТОРГОВЫХ ПЛОЩАДОК

Н.В. Дутова,

*ассистент кафедры «Учет, анализ и аудит»
Донецкий национальный университет*

Эффективность сбыта предприятий через ЭТП в большой степени зависит от качества и объемов информации о результатах деятельности посредством ЭТП. Оценку эффективности сбыта через ЭТП предлагается осуществлять с помощью модифицированной системы сбалансированных показателей ССП (Balanced Scorecard (BSC)). На уровне бизнес-процессов контроль стратегической деятельности осуществляется через ключевые показатели эффективности (КПЭ) Key Performance Indicator (KPI). В этом контексте, ССП является инструментом не только стратегического, но и оперативного управления.

Выбор показателей предложено производить по подсистемам «Клиенты», «Финансы», «Рост и развитие», которые базируются на следующих логических гипотезах:

– функционирование ЭТП должно быть направлено на повышение качества обслуживания клиентов и привлечение новых клиентов за счет предоставления таких потребительских ценностей как простота, удобство в формировании и

размещении заказа, скорость выполнения заказа, учет индивидуальных потребностей заказчика;

- функционирование ЭТП должно быть экономически эффективным для предприятия, т.е. обеспечивать устойчивый рост прибыли за счет сбыта продукции через ЭТП;

- функционирование ЭТП должно обеспечивать предприятию дальнейшие возможности инновационного развития, расширения рынков сбыта и т.д.

Основными характеристиками и требованиями к показателям по каждой подсистеме являются:

Подсистема «Клиенты» – показатели должны отражать степень удовлетворенности клиентов предприятия от осуществления сделок через ЭТП, а также уровень привлекательности такого способа взаимодействия для потенциальных клиентов и выражаться качественными и количественными характеристиками удобства, простоты, скорости обслуживания клиентов.

Подсистема «Финансы» – показатели должны отражать финансовые результаты сбытовой деятельности предприятия через ЭТП, при этом сопоставляются показатели дохода и затрат на обслуживание ЭТП, анализируется оборачиваемость оборотных средств через ЭТП и т.д.

Подсистема «Рост и развитие» – показатели должны характеризовать возможности инновационного развития предприятия в связи с использованием новых Internet-технологий сбыта, а также потенциальных возможностей построения интегрированных сетей на предприятии, учитывать возможности выхода на новые внешние и внутренние рынки сбыта и т.д.

В связи с изложенными требованиями в качестве наиболее репрезентативных предложено использовать следующие показатели для оценки эффективности сбыта через ЭТП:

1. Подсистема «Клиенты»: простота формирования заказа online; удобство интерфейса ЭТП в использовании для клиента; скорость обработки заказа; полнота информации о продукции и услугах предприятия.

2. Подсистема «Финансы»: рентабельность ЭТП (доход от продаж через ЭТП по отношению к затратам на обслуживание ЭТП); эффективность привлечения клиентов (число заключенных договоров по отношению к числу поданных заявок

через ЭТП); оборачиваемость оборотных средств через ЭТП (доход от продаж через ЭТП по отношению к среднему остатку запасов готовой продукции).

3. Подсистема «Рост и развитие»: количество инновационных технологий, связанных с функционированием ЭТП; количество нововведений в сфере обслуживания клиентов on-line; затраты на рекламу через ЭТП.



СТАТИСТИЧНА ОЦІНКА РИНКУ СПОЖИВЧОГО КРЕДИТУВАННЯ В УКРАЇНІ

М.А. Жмайло,

*аспірантка кафедри «Економічна статистика»
Донецький національний університет*

З переходом України до ринкових умов господарювання намітилася тенденція зростання споживчого кредитування, для якого об'єктом надання послуг виступають фізичні особи. Від розвитку споживчого кредитування значною мірою залежить не лише прибутковість банків, але і розвиток тих видів економічної діяльності, кінцева продукція яких є об'єктом кредитування (промислова діяльність, автомобілебудування, будівництво та ін.).

Незважаючи на те, що кредитна діяльність здійснювалася практично з перших днів утворення української банківської системи, населення країни не мало доступу до банківських кредитів. Споживче кредитування стало розвиватися лише з початку 2000 рр., тобто фактично воно існує не більше 10 років.

Обсяги споживчого кредитування в Україні щорік зростають, оскільки цей банківський продукт, з одного боку, дозволяє фізичним особам досить швидко задовольняти виникаючі потреби в товарах і послугах, а з іншого боку – приносить банкам чималий прибуток. У структурі кредитування відбувається поступове збільшення питомої ваги кредитування домогосподарств, яка на кінець 2008 р. складала 35,4%, тобто практично третю частину від загального обсягу виданих банками кредитів. У свою чергу розвиток споживчого

кредитування супроводжується низкою серйозних проблем, які в більшості своїй обумовлені неспівпаданням інтересів кредиторів і позичальників. Крім того, споживчому кредитуванню властива значна диференціація за обсягами, термінами надання позик, об'єктами кредитування, але особливо – в регіональному аспекті, що зумовлено особливостями розвитку промислового виробництва і інших видів економічної діяльності, різним обсягом попиту на банківські послуги, рівнем банківської культури, варіацією заробітної плати та ін.

Економічна система України певною мірою інтегрована в світове господарство. Світова фінансова криза, що виникла в 2008 р., безумовно, негативно відбилася на українській економіці. Так, за даними Держкомстату ВВП у 2009 р. в порівнянні з 2008 р. знизився на 15,9%, обсяг реалізованої промислової продукції (робіт, послуг) – на 17,7%, обсяг роздрібного товарообігу підприємств – на 16,6%, чисельність зайнятого населення – на 3,7%. Криза спричинила низку соціальних та економічних проблем, що, у свою чергу, відбилися на споживчому кредитуванні. Нездатність потенційних клієнтів сплачувати витрати за кредитом, зростання невчасних виплат змусили банки переглянути свою кредитну політику і посилити заходи відбору позичальників. В результаті цього сталося значне скорочення обсягів споживчого кредитування – з 186,1 млрд. грн. у 2008 р. до 137,1 млрд. грн. у 2009 р. і 122,9 млрд. грн. у 2010 р.

Проте прагнення населення задовольняти зростаючі потреби в матеріальних благах викликає необхідність розширення сфери споживчого кредиту. Ухвалення управлінських рішень, направлених на регулювання кредитних стосунків, вимагає перспективної оцінки обсягів споживчого кредитування. Згідно з виконаними прогностичними розрахунками, втрачені споживчим кредитуванням позиції будуть відновлені досить швидко. У найближчому майбутньому вітчизняний ринок споживчого кредитування матиме позитивні тенденції розвитку, що дозволить не лише розширити попит на нього в регіональному аспекті, але і по напрямках використання кредиту на різні споживчі цілі.



КІЛЬКІСНІ МЕТОДИ АНАЛІЗУ ВПЛИВУ ТРУДОВОЇ МІГРАЦІЇ НА СОЦІАЛЬНО-ЕКОНОМІЧНИЙ РОЗВИТОК РЕГІОНУ

Н.В. Звірід,

викладач ПВНЗ «Буковинський університет»

Трудова міграція відіграє провідну роль у розвитку сучасних міжнародних відносин. Як будь-яке економічне явище, міграція робочої сили, є детермінованим, тобто має різноманітні наслідки, що проявляються як у країнах-експортерах, так і в країнах-імпортерах.

Переміщуючись із однієї країни в іншу, трудові мігранти насамперед змінюють чисельність та структуру населення. Оцінка впливу міграцій на динаміку цих показників визначається за міжпереписний період, при цьому побудова моделі ґрунтується на використанні інформації про чисельність населення на моменти переписів та кількість народжених і померлих протягом міжпереписних періодів без урахування даних поточного обліку міграцій.

Для виявлення впливу міграції на чисельність окремих статеві-вікових груп застосовують метод коефіцієнтів дожиття. Суть цього методу полягає у зіставленні фактичної чисельності певної статеві-вікової групи населення віком x на момент перепису та її очікуваної чисельності, розрахованої на основі даних про кількість осіб, молодших на тривалість міжпереписного періоду t , на час проведення попереднього перепису (тобто осіб віком $x - t$ та коефіцієнтів їх дожиття до віку x). Останні розраховуються на основі рівнів смертності у міжпереписний період. Цей метод менш точний ніж балансовий.

Для визначення впливу міграцій на динаміку чисельності населення в цілому або певної вікової групи слід співвіднести зміну чисельності населення (відповідної групи) в результаті міграцій за зіставити проміжок часу та очікувану чисельність (при відсутності міграційних переміщень) на кінець досліджуваного періоду.

Трудова міграція є одним із чинників, що зумовлюють зміну освітнього рівня населення. Для визначення кількісних параметрів впливу міграцій на трансформацію освітнього потенціалу можна використати запропонований О.

Малиновською коефіцієнт інтенсивності зміни рівня освіти населення внаслідок міграційного руху, який характеризує зміну освітнього потенціалу в результаті міграційного руху.

Трудові міграції є важливим чинником реалізації трудового потенціалу населення. Для країн масової трудової еміграції, до яких належить і Україна, великого значення набуває оцінка потенціальних показників трудової міграції. Для цього в науковий обіг було введено поняття зовнішньотрудовий потенціал, що тлумачиться як частина потенціалу населення, реалізована за межами країни. Кількісне визначення зовнішньотрудового потенціалу базується на принципах потенційної демографії.

Для кількісного визначення впливу трудової міграції на ринок праці відділом міграційних досліджень Інститут демографії і соціальних досліджень Національної академії наук України була розроблена методика кількісної оцінки впливу трудових міграцій на розвиток ринку праці.

Трудова міграція здійснюється, в основному для поповнення бюджетів окремих сімей. Для визначення впливу трудової міграції на економіку регіону (країни), ми пропонуємо розраховувати втрати ВВП, оскільки частина працездатного населення не бере участі у формуванні ВВП через виїзд за межі своєї країни.

Аналізуючи вище викладене, можна стверджувати, що інструментарій для дослідження впливу на соціально-демографічний та економічний розвиток потребує вдосконалення та розробки нових показників, з допомогою яких можна було б кількісно визначати вплив трудової міграції на розвиток як окремого регіону, так і країни в цілому.



ОРГАНІЗАЦІЯ ТА ПРОБЛЕМИ ФІНАНСОВОГО МОНІТОРИНГУ В КРЕДИТНИХ СПІЛКАХ

О.І. Іваненко,

*асистент кафедри статистики та демографії
Київського національного університету імені Тараса Шевченка*

Забезпечення ефективності та надійності здійснення кредитних операцій вимагає від кредитних спілок організації постійного моніторингу всіх стадій реалізації кредитного процесу. Проведення моніторингу кредиту починається відразу після надання позики клієнту (отримання ним позики). Основною метою моніторингу є здійснення контролю за ходом кредитних операцій, що полягає у налагодженні ефективної організації кредитного процесу і пошуку досконаліших механізмів кредитування.

Контроль та управління кредитним процесом — необхідна передумова оптимізації системи організації кредитування в кредитних спілках.

У процесі контролю за кредитними операціями особливу увагу приділяють таким проблемам: дотримання принципів кредитування (цільової спрямованості, забезпеченості, терміновості); виявлення проблемних кредитів і розробка заходів з ліквідації заборгованості; аналіз якості та структури кредитного портфеля спілки в цілому; контроль кредитного ризику; моніторинг кредитного ринку і розробка заходів щодо розширення участі в ньому кредитної спілки тощо. Вимога щодо своєчасності і повноти погашення кредиту невіддільна від питання постійного контролю за розміром і якістю отриманого забезпечення. Кредитна спілка здійснює контроль за цільовим використанням позики, адже кредит надається тільки для цільового фінансування конкретного господарського проекту чи комерційної операції.

Контроль за кредитними операціями — надзвичайно важливий, адже кредитна діяльність кредитних спілок не є централізовано регламентованою. Вони самостійно визначають порядок залучення та використання коштів, проведення кредитних операцій, встановлення рівня відсоткових ставок і комісійних винагород. Кредитні спілки відповідають за своїми

зобов'язаннями перед своїми членами всім належним їм майном і коштами.

Лише суворий контроль за кредитним процесом в цілому дозволить забезпечити безпеку, надійність і прибутковість кредитних операцій кредитних спілок. Звідси випливають два правила, які є важливими для успішної кредитної діяльності спілки: 1) кожна кредитна спілка повинна мати свою систему моніторингу кредитних операцій; 2) кредитний контроль мають здійснювати найбільш кваліфіковані й досвідчені працівники кредитної спілки.

Як в економічному, так і в юридичному аспектах на перше місце виходить завдання забезпечення внутрішнього контролю за дотриманням інструкцій і положень щодо проведення кредитних операцій.

Важливе економічне значення моніторингу кредитних операцій в сучасній практиці кредитних спілок пов'язане зі зловживаннями, що часто мають місце при видачі позик. Кредитні відносини стали в умовах кризової економіки одним з найбільш уразливих місць для кримінальних посягань. Найпоширенішим способом отримання незаконних кредитів є створення фіктивних фірм без наміру займатися господарською діяльністю. Такі організації "самоліквідуються" після одержання кредиту. Мають місце також випадки отримання кредитів незаконним шляхом за допомогою злочинного зговору недобросовісних позичальників з представниками кредитних спілок. Зрозуміло, що ці кредити з самого початку зорієнтовані на неповернення.

Таким чином, професійним обов'язком кредитних працівників є виявлення на ранніх етапах кредитного процесу ознак зародження фінансових труднощів у позичальників і вжиття відповідних заходів щодо захисту економічних інтересів спілки. Результатом посилення контролю за кредитними операціями є позитивні зміни в цільовій спрямованості позик, оптимізація сфер вкладення кредитних ресурсів, отримання додаткових гарантій щодо забезпечення погашення кредитів, поліпшення окремих компонентів і в цілому системи організації кредитного процесу.



СТАТИСТИЧНА ОЦІНКА РОЗВИТКУ МАЛОГО БІЗНЕСУ В АР КРИМ У 2000-2009 РР.

Т.М. Іванова,

аспірант

Київського національного університету імені Тараса Шевченка

Статистичний аналіз розвитку малого бізнесу за даними офіційних статистичних спостережень дозволив визначити основні тенденції його розвитку в Криму за період 2000-2009 рр.

1. За період 2000-2009 роки зростав рівень поширення малого бізнесу в АР Крим. У 2009 році він становив 88 проміле. Це вище за значення по Україні на 17,3%. Найвища інтенсивність поширення малого бізнесу в Автономній Республіці Крим має місце в: Сімферополі (199), Ялті (146), Алушті (115) та Судаку (109). Найнижчий показник розповсюдження малого бізнесу - в Джанкойському районі – 13.

2. Третина від загальної кількості зайнятих в Криму – це зайняті в малому бізнесі. Відносно всього населення цей показник складав майже 7%.

3. Середня кількість працюючих на малому підприємстві становить 5 осіб, яка коливається залежно від адміністративно-територіальних одиниць. За видами економічної діяльності найбільша кількість працюючих – в сільському господарстві (8 осіб), в промисловості та освіті (по 7 осіб). У сфері фінансової діяльності на одному підприємстві працює в середньому 3 особи.

4. Внесок малих підприємств у загальний обсяг реалізованої підприємницьким сектором Криму продукції становить 25%, який останніми роками перевищує аналогічний показник по Україні на 50%.

5. Найбільше розповсюдження малий бізнес має у фінансовій діяльності, серед операцій з нерухомим майном, оренди, інжинірингу; в освіті, будівництві, наданні комунальних послуг; діяльності у сфері культури та спорту. Внесок малого бізнесу в цих сферах діяльності відповідно коливається від 100% до 35,4%.

6. Дуже дивним є той факт, що фінансовий результат діяльності малих підприємств у 2009 році був від'ємним і склав 763,8 млн. грн. збитку (сальдо), у 2008 році – 956,5 млн. грн.

збитку, що у порівнянні з 2007 р. збільшилось майже у 4 рази (231,9 млн. грн. збитку). Сума прибутку малих підприємств становить 25,5% загальної суми прибутку, отриманого всіма підприємствами регіону, збитків – 53,3% загальної суми збитків. Протягом ряду років збитковими залишаються підприємства більшості видів економічної діяльності. Значне збільшення суми збитків (сальдо) відбулося на підприємствах будівництва, промисловості, охорони здоров'я та надання соціальної допомоги, діяльності готелів та ресторанів.



СТАТИСТИЧНЕ ДОСЛІДЖЕННЯ ПРОЦЕСІВ НАРОЩУВАННЯ БАНКІВСЬКОГО КАПІТАЛУ

Я. В. Колеснік,

аспірантка НАСОА,

економіст апарату Національного банку України

Ефективність діяльності банківських установ України суттєво залежить від їх рівня капіталізації. Найважливішим показником, що характеризує фінансову стійкість окремого банку і банківської системи взагалі, є банківський капітал. Передумовами накопичення банківського капіталу фахівці вважають економічну незалежність господарських суб'єктів, рівноправність форм власності, інтенсифікацію виробництва, стабільність інституціонального середовища бізнесу та якість інформаційних потоків. Багатофункціональне призначення власного капіталу робить його неоднорідним за складом.

Найважливішою часткою власного капіталу банку є статутний капітал. Закон України «Про банки і банківську діяльність» детермінує мінімальний розмір статутного капіталу на момент реєстрації, який залежить від організаційно-правової форми банку. НБУ надано право диференційовано встановлювати мінімальний статутний капітал на момент реєстрації. Водночас у фаховій літературі відмічається, що «...питання удосконалення формування власного капіталу банку та такого його складника, як статутний капітал, належить до найскладніших». У зв'язку з цим набуває актуальності проблема

вдосконалення статистичного дослідження формування власного капіталу. В наукових розробках учених розглядаються проблеми вибору джерел нарощування та структури власного капіталу банків з метою забезпечення його достатності.

У банківській практиці при формуванні власного капіталу використовують два напрями управління: залучення зовнішніх та внутрішніх джерел нарощування капіталу. Водночас доцільно розглядати такі напрями досягнення головної мети – формування достатнього обсягу власного капіталу: перший – збільшення прибутковості активних операцій; другий – оптимальна дивідендна політика.

На думку автора, важливе місце у процесі обґрунтування управлінських рішень належить використанню результатів статистичного аналізу зіставлення системи показників, що відображають взаємозв'язки елементів джерел формування ресурсної бази. Побудована для цього матриця відображає зв'язки між джерелами формування власного капіталу та конкретними банківськими установами.

Сучасні чинники накопичення банківського капіталу розмежовано на екзогенні (що відбивають макроекономічний рівень розвитку національної економіки й на які банківська система та окремі банки практично не впливають: зовнішньо- і внутрішньоекономічні, політичні, правові, соціокультурні), та ендогенні (на які банківський менеджмент здатний впливати). Останні, у свою чергу, групуються за двома аспектами: а) чинники на рівні окремих банків; б) чинники на рівні банківської системи у цілому.

Проаналізувати напрями руху коштів за рахунок різних джерел нарощування капіталу можливо також за допомогою α -коефіцієнта, що визначає участь певної банківської установи у використанні капіталу окремих джерел.

Частку i -го зовнішнього джерела в нарощуванні капіталу j -ї банківської установи характеризує коефіцієнт β_{ij} . Аналізуючи показники матриці β -коефіцієнтів за 2008 та 2009 роки, можна зробити висновок, що в обох періодах, які підлягали аналізу, по кожній банківській установі спостерігається значна кількісна перевага зовнішніх джерел нарощування капіталу перед внутрішніми. Це пов'язано з недостатністю забезпечення банків грошовими коштами через низьку прибутковість діяльності банківських установ.

МІЖНАРОДНА ТЕХНІЧНА ДОПОМОГА: ІНФОРМАЦІЙНІ РЕСУРСИ ТА АНАЛІЗ

О.М. Мотузка

начальник відділу, Держкомстат

Достатній рівень фінансових ресурсів країн є безперечно одним з вирішальних факторів досягнення сталого розвитку. Міжнародна технічна допомога (далі - МТД) поряд з прямими іноземними інвестиціями є на сьогодні важливим джерелом фінансування розвитку багатьох країн перехідного до ринкової економіки періоду. За допомогою МТД, з одного боку, світова спільнота стимулює структурні перетворення і на базі статистики МТД здійснює моніторинг фінансових ресурсів, спрямованих у країни, що розвиваються, для планування подальших заходів (або коригування раніше розроблених), а з іншого – уряд країни-одержувача має можливість суттєво поліпшити фінансування найбільш критичних секторів і свідомо планувати загальний рівень витрат і їх структуру на економічний розвиток і добробут. Щоб забезпечити дієвість технічної допомоги і довгострокові вигоди від її надання, вона повинна відслідковуватися на кожному етапі процесу: від визначення потреб, через обговорення і узгодження технічного завдання і цілей проекту, до реалізації і подальшого поточного нагляду за ходом робіт. Ступінь власної зацікавленості країни-одержувача безпосередньо позначається на дієвості технічної допомоги. Створення системи статистики МТД є очевидною передумовою інформаційного забезпечення процесу управління МТД. Відсутність на сьогодні єдиного методологічного підходу до формування статистики МТД як на національному, так і на міжнародному рівнях практично унеможлиблює пряму оцінку її ефективності. Подібна ситуація викликає численні дебати щодо можливих підходів до можливості визначення ефекту від МТД. Монопольне становище міжнародних організацій у питанні розповсюдження інформації і самореклами в питанні ефективності МТД на самих верхніх щаблях політичних кіл створює підґрунтя для асиметрії статистик МТД.

Тобто, можна визначити два рівня проблем щодо інформаційного забезпечення управління МТД. Передусім - це створення регулярної і комплексної статистики МТД. І поряд з

цим - емпіричні дослідження щодо можливих підходів з визначення ефективності МТД в цілому та за різними напрямками та її видами. Щодо статистики МТД, то тут, як і в будь-якій іншій підсистемі офіційної статистики, виникає ціла низка питань методологічно-організаційного характеру, починаючи з одиниці спостереження і типологізації МТД, і закінчуючи власне статистичним спостереженням. Підходи до оцінки ефективності МТД залежать від розробленості відповідної статистичної бази.

Оскільки виявлення закономірностей доцільно визначати на міжнародному рівні, або хоча б для гомогенної групи країн, то такі підходи мають спиратись на припущення і гіпотези, що є загальними для обраної групи країн.

Очевидні перспективи, в цьому плані, є для моделювання ефективності МТД. І якщо раніше офіційній статистиці традиційно відводилась лише роль збирання та агрегування інформації, то зараз це бачення суттєво зрушилось в сторону розвитку і застосування статистичними офісами сучасних економетричних засобів. Це зумовлено неоднорідністю законодавчої бази країн щодо статистики і доступу до певних типів первинних даних, а також намаганням, наприклад, Євростату, впровадити нові засоби аналізу, які б сприяли суттєвому зниженню звітного навантаження на респондентів.

У зв'язку з цим доцільним, на наш, погляд, є застосування різного типу панельних моделей для динамічної оцінки ефективності МТД.

Значна увага, при цьому, має бути приділена вибору цільової та пояснюючих змінних моделі.

— ◇ —

ТЕОРИТИЧНО-МЕТОДОЛОГІЧНІ ЗАСАДИ СТАТИСТИЧНОГО МОНІТОРИНГУ РИНКУ СТРАХОВИХ ПОСЛУГ УКРАЇНИ

Т.В. Нагорна,

*аспірант кафедри статистики та демографії
Київського національного університету імені Тараса Шевченка*

Останніми роками український ринок страхових послуг характеризується швидкими й стійкими темпами зростання. Таким чином постійно зростає частка страхових послуг у ВВП, що свідчить про зростання ролі страхових компаній у національній економіці, і вимагає підвищення якості розвитку ринку страхових послуг, рівень якого необхідно оцінювати.

Основна проблема оцінювання ринку страхових послуг України - відсутність системи аналітичного забезпечення його комплексної оцінки, яка не можлива без побудови системи статистичного забезпечення. Існуючі підходи до створення такої системи є недосконалими, вони є обмеженими та мають низку недоліків. На нашу думку, організаційною основою побудови системи інформаційного забезпечення оцінювання повинна бути система моніторингу ринку страхових послуг.

Під моніторингом розуміється спеціально організована і постійно діюча система збору і аналізу соціально-економічної інформації, проведення додаткових інформативно-аналітичних досліджень і оцінки стану, тенденцій розвитку и конкретних проблем ринку страхових послуг. Основною метою моніторингу є забезпечення якісного аналізу стану, структури та темпів розвитку ринку страхових послуг України, результати якого є підґрунтям для прийняття стратегічних рішень щодо можливих напрямків розвитку страхового ринку як вцілому так і можливості розвитку страхових компаній як організаторів і постачальників страхових послуг.

До основних завдань статистичного моніторингу ринку страхових послуг відносяться: побудова системи збору інформації; уніфікація системи звітності; організація оперативної обробки та аналізу отриманою інформації. Основними джерелами статистичної інформації може слугувати звітність, яку страхові компанії надають Державній комісії з регулювання ринків фінансових послуг України та Державний

статистичній службі України. Але для забезпечення порівнянності показників ринку страхових послуг інформаційні потоки потребують упорядкування і систематизації.

Однак враховуючи недосконалість українського законодавства більшість інформаційних потоків приховуються страховими компаніями з метою уникнути сплати податків за деякими напрямками діяльності. Крім того, здійснюючи діяльність на всій території України страхові компанії практично не надають інформацію, яка б дала можливість оцінити розвиток ринку страхових послуг у регіонах, оскільки для них це є економічно не вигідним. А тому аналіз розвитку ринку страхових послуг побудований лише на даних існуючої системи збирання інформації не відображає реальних пропорцій і тенденцій на ринку страхових послуг.

В цілому система організації статистичного моніторингу дозволить забезпечити цілеспрямованість, повноту, системність, оперативність, репрезентативність зібраних даних. Крім того, потребує удосконалення існуюча звітність за такими напрямками:

- 1) уніфікованість;
- 2) спрощення;
- 3) вилучення показників, що дублюються.

Водночас добровільним об'єднання страховиків необхідно впровадити

постійно діючу систему анкетування, яка б охоплювала питання, які не можуть бути представлені в офіційній звітності, або не знайшли в ній відповідного відображення. Насамкінець результати такого моніторингу повинні бути регулярно представлені у вигляді інформаційних повідомлень, оглядів або бюлетенів. Це дасть можливість учасникам ринку страхових послуг формувати свою поведінку і розробити стратегію розвитку страхового бізнесу.

— ◇ —

ПРІОРИТЕТНІ НАПРЯМИ УДОСКОНАЛЕННЯ ВІДОБРАЖЕННЯ ОБСЯГІВ ТІНЬОВОЇ ЕКОНОМІКИ У СИСТЕМІ НАЦІОНАЛЬНИХ РАХУНКІВ

С.В. Озребя,

*аспірант кафедри статистики та демографії
Київського національного університету імені Тараса Шевченка*

Проблема відображення тіньової економіки в даних офіційної статистики останніми роками знаходиться в центрі уваги світової статистичної науки. З одного боку, це викликано активізацією тіньової економіки. З іншого боку, навіть в країнах з налагодженою системою відображення діяльності та доходів економічних одиниць частина їх залишається за межами статистичного обліку. До основних причин слід віднести: 1) тіньовий характер економічних операцій; 2) обмеження можливостей статистичного спостереження. Саме тому методологічні проблеми та проблеми методичного забезпечення оцінювання масштабів тіньової економіки та їх порівнянності з міжнародною системою національних рахунків набувають особливої актуальності в сучасних умовах розширеного відтворення. Основна мета побудови такої системи оцінювання — це розроблення заходів, спрямованих на зменшення тіньової діяльності.

Не дивлячись на певні досягнення статистики в оцінюванні розмірів і масштабів тіньової економіки, методологічні засади та методичне та інформаційне забезпечення розрахунків обсягів діяльності у тіньовому секторі потребує суттєвого удосконалення. Так, серед основних недоліків слід виділити відсутність системного підходу при формуванні досліджуваної сфери економічної діяльності. Також, на нашу думку, більшу увагу слід приділити розробці інструментарію дослідження всіх сторін виробничого процесу в тій частині економіки, яка відноситься до її тіньової складової. Крім того, необхідно розширити статистику тіньової економіки, доповнивши її розділами, які б відображали перерозподільні процеси, пов'язані у першу чергу з тіньовою діяльністю (як в економічній, так і неекономічній сферах).

До найбільших проблем в оцінках тіньової економіки, з якими стикається українська статистична служба відносяться:

по-перше, проблеми інформаційного забезпечення, пов'язані з відсутністю реєстрації окремих економічних одиниць, а також з викривленням або ненаданням даних зареєстрованих суб'єктів; по-друге, організаційні проблеми підготовки та проведення статистичного спостереження.

Саме тому для вирішення проблем реформування забезпечення оцінювання розмірів тіньової економіки у системі національних рахунків, необхідна система заходів, яка буде спрямована на:

- удосконалення інформаційної бази: проведення спеціальних вибірових спостережень, покращення методики досліджень домашніх господарств, формування інформаційної бази для використання непрямих методів кількісної оцінки тіньової економіки;

- розроблення системи розрахунків, яка включає метод товарних потоків, систему натуральних і вартісних балансів сільськогосподарської продукції у господарствах населення, які забезпечують узгодження даних про ресурси та використання продукції, комбінування різноманітних методів розрахунку, розширення альтернативних оцінок, використання математичних моделей з додаванням «італійського підходу»;

- підвищення аналітичних можливостей розрахунків: оцінювання тіньової економіки у розрізах тіньової економічної діяльності некорпоративних підприємств у секторі домашніх господарств, ринкових виробників, неринкових виробників, тіньової економічної діяльності юридичних осіб.

Таким чином, розвиток статистики тіньової економіки повинен бути спрямований на рішення організаційних проблем, які можуть бути як статистичного, так і нестатистичного характеру. До перших слід віднести забезпечення конфіденційності даних та проведення роз'яснювальної роботи серед респондентів щодо мети спостереження та можливих напрямів використання інформації, а також обстеження підприємств і домашніх господарств на засадах міжнародних стандартів. До другої групи проблем слід віднести економічні та законодавчі механізми: забезпечення сталого економічного зростання та розроблення ефективного податкового механізму.

— ◇ —

ІНФОРМАЦІЙНЕ ЗАБЕЗПЕЧЕННЯ СТАТИСТИКИ ЕНЕРГЕТИЧНИХ РЕСУРСІВ

Л. Л. Полтавець,

*аспірант НТК статистичних досліджень ДССУ,
спеціаліст I категорії-економіст відділу статистики у
Кременчуцькому районі*

Повні, своєчасні і надійні статистичні дані необхідні для моніторингу енергетичної ситуації в країні. А тому статистика енергетичних ресурсів повинна стати основою для прийняття зважених стратегічних рішень у галузі енергетики.

У світі за останні роки зріс обсяг даних, які статистичні організації різних країн збирають у респондентів. Вони являють собою широке коло інформації, починаючи від даних про відновлювані природні ресурси і закінчуючи показниками ефективності використання палива та даними про обсяги викидів парникових газів в атмосферу.

Метою даного дослідження є вивчення факторів, які впливають на повне та своєчасне забезпечення інформацією статистичного вивчення енергетичних ресурсів.

Виходячи із вищевикладеного, можемо сказати, що ціллю даного дослідження є:

- визначення рівнів інформаційного забезпечення статистики енергетичних ресурсів;
- визначення ролі і місця нормативно-правової бази у процесі статистичного дослідження енергетичної галузі.

Згідно з проведеним дослідженням нами було встановлено, що інформація відіграє ключову роль у визначенні основних методів і задач статистики енергетики, оскільки з її допомогою приймаються правильні управлінські рішення у енергетичній сфері, робляться висновки щодо доцільності проведення політики у галузі енергетики.

Ми дійшли висновку, що джерела інформації про енергетичні ресурси можна поділити на 3 рівні: міжнародний, європейський та національний.

Що стосується нормативно-правового забезпечення статистики енергетичних ресурсів, то можемо сказати, що вона керується певними законами, указами, розпорядженнями, інструкціями, які регламентують і визначають порядок обліку,

оцінки, статистичного дослідження паливно-енергетичних ресурсів.

Таким чином, можемо зробити висновок, що інформаційна база у забезпеченні сталого розвитку статистики енергетичних ресурсів повинна відігравати ключову роль.



ОЦІНКА ЯКОСТІ СОЦІАЛЬНО-ЕКОНОМІЧНИХ ПРОЦЕСІВ

М.К. Сидоренко,

*аспірант кафедри статистики та демографії
Київського національного університету імені Тараса Шевченка*

Досліджуючи динаміку макроекономічних показників можна зробити висновки про рівень розвитку соціально-економічної системи. Розглядаючи спотворені ринкові умови розвитку нашої країни та акцентуючи свою увагу на соціально-економічних процесах, особливо цікавим для розгляду постає якісна оцінка показників соціально-економічного розвитку. Гострота проблеми оцінювання якості соціально-економічних процесів в Україні полягає у макроекономічному протиріччі в господарській системі, коли темпи економічного розвитку не супроводжуються аналогічним зростанням рівня і якості життя населення.

Природа соціально-економічних взаємозв'язків криється у взаємовідносинах між суспільством та окремим індивідумом. Якісна взаємодія визначає рівень соціально-економічного розвитку.

Якщо розглядати соціально-економічний процес у часі, то можна говорити про покращення або погіршення добробуту суспільства. На першому етапі необхідно визначити критерії за якими буде проводитися оцінка добробуту. Індикатором добробуту в країні може слугувати якість соціально-економічних перетворень, які можна виразити через якісну оцінку соціально-економічних процесів.

Складним у підході до даної проблеми є визначення економіки країни як повністю відкритої чи замкненої системи.

Розглядаючи більш простий випадок, тобто характеризуючи економіку країни як закриту систему, поняття якості визначається суспільством у межах країни. У протилежному випадку, визначаючи економіку країни відкритою системою, критерії якості визначаються глобалізованими системами.

Пропонуємо трактувати перехідну економіку України як відкриту, але з низкою обмежень, що обумовлені умовами її функціонування.

На перший погляд поняття «якість» є простим. Складність, полягає у його оцінюванні, адже не є очевидним, якими показниками воно може бути виміряне і якими характеристиками описане.

Оцінювання якості соціально-економічних процесів є суб'єктивною категорією, що визначається цілою низкою факторів та умовами функціонування соціально-економічної системи.

Таким чином, щоб оцінити якість соціально-економічних процесів необхідно визначити складові соціально-економічної системи та характеристики соціально-економічного процесу.

Пропонуємо виділити наступні складові соціально-економічної системи: суспільство; капітал, що генерує суспільство; природні ресурси, якими воно володіє або має доступ до них; сільськогосподарські ресурси; умови навколишнього середовища, у якому функціонує суспільство.

Для оцінювання якості нами пропонуються наступні характеристики соціально-економічного процесу: взаємозалежність; дублювання; глобалізованість; паралельність; трансформація; причиннонаслідковість існування; стадійність розвитку; стартові умови розвитку; циклічність.

З нашої точки зору, якість соціально-економічних процесів можна оцінити лише за допомогою їх відповідного прояву у суспільстві. Охарактеризувати ступінь якості соціально-економічних процесів можна лише через індивідуальну оцінку, що потребує типологізації соціально-економічних систем за рівнем розвитку. Відповідний рівень розвитку, має характеризувати відповідний якісний рівень суспільного добробуту.



СТАТИСТИКА ОРГАНІЧНОГО ВИРОБНИЦТВА: МІЖНАРОДНИЙ ДОСВІД ТА УКРАЇНА

Н.Ю. Скачек,

*учений секретар, державне підприємство
“Науково-технічний комплекс статистичних досліджень”*

Загальновідомо, що органічне виробництво та споживання органічних продуктів є основою повноцінного, якісного життя людини. Сьогодні завдяки активній позиції прихильників здорового харчування та збереження природних ресурсів ми спостерігаємо стрімкі тенденції розвитку органічного виробництва у світі. Так, органічна продукція виробляється у понад 160 країнах світу. Загальна площа угідь, сертифікованих для органічного виробництва в усьому світі, перевищує 37 мільйонів гектарів. За результатами даних за 2009 рік лідерами за площами сертифікованих угідь є Австралія (12,0 млн. га), Аргентина (4,4 млн. га) і США (1,9 млн. га). З декількох мільйонів виробників і переробників 1,8 млн. пройшли сертифікацію в одній з 488 установ, акредитованих Міжнародною федерацією органічного сільськогосподарського руху (IFOAM). Ця федерація координує процедури стандартизації, акредитації та сертифікації в різних країнах і представляє органічний рух в міжнародних організаціях. Всі законодавчі стандарти, норми та принципи, що затверджуються окремими країнами на національному рівні, розробляються з урахуванням багаторічного досвіду та напрацювань IFOAM.

В Україні різним аспектам поширення органічного виробництва присвячені роботи таких вчених як Артиш В.І., Боровик Т.В., Вовк В.І., Дудар О.Т., Завадська Ю.С., Кобець М.І., Корніцька О.І., Легеза Д.Г., Мациборко О., Рудницька О.В., Яценко О.М. та ін.

Органічне виробництво в Україні протягом останніх років розвивається досить швидко. Воно все ще не регулюється на законодавчому рівні, проте за допомогою міжнародних організацій і компаній українські виробники органічної продукції намагаються знайти шляхи до поширення органічного руху в нашій країні. Завдяки ініціативності послідовників здорового способу життя, готових реалізовувати стандарти якісного та безпечного життя навіть без підтримки уряду, наразі

в Україні функціонують більше 100 виробників органічної продукції. Загальна площа сертифікованих для органічного виробництва земель становить більше 260 тис. га.

Наразі процедури сертифікації вітчизняного виробництва органічної продукції здійснюються переважно іноземними компаніями, яких налічується близько дванадцяти. Це представники Нідерландів, Швейцарії, Італії, Німеччини, Угорщини, Польщі тощо. Лише одна українська структура – “Органік Стандарт” – пройшла міжнародну акредитацію і з 2009 року отримала право проводити сертифікацію органічного виробництва та видавати відповідні документи. Всі етапи сертифікації, вимоги до підприємств і виробничих процесів регулюються за нормами і стандартами, дійсними для ЄС, США і тих країн, органічне виробництво яких є законодавчо врегульованим.

На жаль, про ефективне функціонування вітчизняного ринку органічної продукції говорити ще рано. Насамперед тому, що досі немає законодавчого забезпечення: Закон України “Про органічне виробництво”, який має визначати основи ведення органічного сільського господарства, вимоги щодо вирощування, виробництва, перероблення, сертифікації, маркування, перевезення, зберігання та реалізації органічної продукції та сировини, пройшов лише перше читання.

Тим часом органічна продукція вітчизняного виробництва користується попитом за кордоном. Щоправда, достовірних статистичних даних щодо обсягів виробництва та експорту такої продукції наразі немає, в основному переважають експертні оцінки. При цьому експерти одноголосно погоджуються, що ні глибокого аналізу вітчизняного ринку, ні достовірних джерел інформації в Україні поки що немає. Формуванню ж статистичного забезпечення органічного виробництва має передувати створення правового забезпечення у цій сфері діяльності.

— ◇ —

ОСОБЕННОСТИ ФОРМИРОВАНИЯ ОБЪЕМА ПРОМЫШЛЕННОЙ ПРОДУКЦИИ В РЕСПУБЛИКЕ БЕЛАРУСЬ

*Д.А. Степаненко,
старший преподаватель,
Белорусский торгово-экономический университет
потребительской кооперации*

Объем производства промышленной продукции (работ, услуг) в соответствии представляет собой совокупность произведенной продукции, выполненных работ, оказанных услуг силами персонала организации, классифицируемых по общегосударственному классификатору ОКРБ 005-2006 «Виды экономической деятельности», утвержденному постановлением Государственного комитета по стандартизации Республики Беларусь от 28.12.2006 г. № 65.

Статистический показатель «Объем производства промышленной продукции (работ, услуг) в фактических отпускных ценах без налога на добавленную стоимость, акцизов и других налогов и платежей из выручки» отражается в формах государственной статистической отчетности в фактических отпускных ценах (ценах отгрузки) на продукцию без налога на добавленную стоимость, акцизов и других налогов и платежей из выручки с учетом возмещения разницы между закупочными и расчетными ценами на товары, убытков организаций, возникающих при продаже товаров, покрываемых за счет средств республиканского бюджета.

Для оценки динамики развития организации, ее обособленных подразделений необходимо рассчитывать показатель объема производства промышленной продукции в сопоставимых ценах. Оценка объема производства в сопоставимых ценах производится непосредственно в организациях. В качестве сопоставимых цен принимаются цены на продукцию, сложившиеся в организации после первого их изменения в январе отчетного года. Если в январе отчетного года не было изменения цены на производимую продукцию, то в качестве сопоставимой принимается цена, фактически действовавшая на конец предыдущего года.

При определении объемов производства промышленной

продукции в сопоставимых ценах продукция, изготовленная из давальческого сырья, включается в объем производства по ценам января отчетного года на аналогичную продукцию, изготавливаемую из собственного сырья. В тех случаях, если изготавливаемая из давальческого сырья продукция в организации-изготовителе из собственного сырья не производилась, цены на эту продукцию определяются, исходя из стоимости давальческого сырья, числящегося на забалансовом счете «Материалы, принятые в переработку» Типового плана счетов бухгалтерского учета и стоимости услуг организации-изготовителя в ценах января отчетного года.

Для оценки выпуска сезонной продукции принимается первая сложившаяся отпускная цена отчетного года. В случае отсутствия отгрузки принимается цена производства данного вида продукции. Для новой продукции в качестве сопоставимой отпускной цены применяется цена, действовавшая в отчетном периоде, с корректировкой на средний индекс роста цен на данную группу (вид) продукции или в целом по организации (если продукция данной группы (вида) не производилась). Для оценки выполненных работ и оказанных услуг промышленного характера при определении объема производства промышленной продукции в сопоставимых ценах также производится корректировка на средний индекс роста цен.

Продукция, поставляемая на экспорт в соответствии с заключенными контрактами, при определении ее объема за отчетный период и соответствующий период предыдущего года оценивается по контрактным ценам отчетного года, пересчитанным в белорусские рубли по курсу Национального банка Республики Беларусь в сопоставимых ценах – по курсу на начало января текущего года. При этом этот порядок распространяется только на продукцию, произведенную по экспортному заказу в соответствии с ранее заключенным контрактом. Если организацией изготавливается продукция, не имеющая различий в технологии ее производства, то независимо от ее дальнейшей реализации на экспорт (даже по ранее заключенным контрактам) или на внутренний рынок, объем производства продукции в сопоставимых отпускных ценах исчисляется исходя из отпускной цены внутреннего рынка.

Полуфабрикаты собственного производства, предназначенные для реализации другим организациям, а также

для потребления на непромышленные нужды организации, включаются в объем производства продукции в сопоставимых ценах по отпускным ценам, сложившимся в январе отчетного года.



МІЖНАРОДНА ТРУДОВА МІГРАЦІЯ, ЯК ОБ'ЄКТ ЕКОНОМІКО-СТАТИСТИЧНОГО ДОСЛІДЖЕННЯ

С.Г. Халак,

викладач-стажист

кафедри обліку, аудиту і економічного аналізу

Буковинської державної фінансової академії,

м. Чернівці

Україна є однією з найбільших країн-донорів робочої сили в Європі. Зовнішня трудова міграція стала об'єктивною реальністю сьогодення. Формування міграційних потоків відбувалося в кризових умовах перехідного періоду, пов'язаних з низькою заробітною платою в зареєстрованому секторі економіки, зростанням безробіття та вимушеної неповної зайнятості, поширенням бідності та високим рівнем майнового розшарування населення.

За кордоном перебуває три мільйони заробітчан, які пропрацювали за межами України менше року. Хоча таку статистику можна навести після найскромніших розрахунків, констатує директор Інституту демографії й соціальних досліджень НАНУ Елла Лібанова. Якщо ж брати до уваги всіх «гастарбайтерів», їхня кількість може сягати семи мільйонів.

Трудова міграція є багатоаспектною, тобто має як позитивні, так і негативні сторони. Так, наприклад, для країни-донора позитивним є те, що під впливом досліджуваного процесу знижується рівень безробіття і соціального напруження; колишні мігранти після закінчення контракту і поверненні на батьківщину стають джерелами нових знань та навичок; розширюється місткість внутрішнього ринку за рахунок валютної допомоги емігрантів своїм близьким. Проте існують і значні негативні ефекти: «витік інтелекту» і кваліфікованих

кадрів; погіршення демографічної ситуації в країні; виникає поняття «дитячого сирітства» при живих батьках. Для приймаючої країни позитивом є те, що іммігранти збільшують пропозицію на ринку праці, тим самим роботодавці можуть обирати працівника, який буде виконувати роботу за меншу заробітну плату; приймаюча країна використовує готову робочу силу, не витрачаючись на її навчання; також виникає можливість використання досягнень чужої культури. Проте в даній ситуації є й ряд негативних факторів: зростає диференціація прибутків населення і соціальна напруга; з'являється основа для загострення національних і релігійних конфліктів; відтік коштів з країни та ін.

Державні органи, що регулюють процес зовнішньої трудової міграції:

1. На національному рівні: Міністерством праці; Міністерством юстиції; Міністерством закордонних справ; національними міграційними службами.

2. Також існують міжнародні організації: Міжнародна організація міграції (МОМ); Міжнародна організація праці (МОП).

Для обліку та регулювання процесів зовнішньої трудової міграції Міністерство праці України затвердило форми державної статистичної звітності про зовнішню трудову міграцію та Інструкції по їх складанню, що були введені в дію з січня 1996 року: N 1-ТМ «Звіт про чисельність та склад громадян України, які тимчасово працюють за кордоном»; N 2-ТМ «Звіт підприємств, організацій, установ про чисельність та склад іноземців, які тимчасово працюють в Україні» та ін.

Основні статистичні методи, що використовуються для дослідження та аналізу зовнішньої трудової міграції наступні: вибірковий метод, табличний та графічний методи, абсолютні, відносні та середні величини та ін.

У висновку можна зазначити, що держава має забезпечити зростання інвестицій у розвиток власного людського потенціалу, у підготовку і збереження наукових кадрів, використовуючи різні форми стимулювання, зокрема бюджетне фінансування, пільгове кредитування та ін.

— ◇ —

ОРГАНІЗАЦІЙНІ ЗАСАДИ СТАТИСТИЧНОГО МОНІТОРИНГУ КОНКУРЕНТНОГО СЕРЕДОВИЩА

О.А. Хвостенко,

*аспірантка кафедри статистики та демографії,
Київський національний університет імені Тараса Шевченка*

Статистичний моніторинг є необхідним елементом інформаційного забезпечення статистичного вивчення конкурентного середовища, який має стати інформаційно-аналітичним підґрунтям прийняття стратегічних рішень і розроблення тактики ринкової поведінки.

Під статистичним моніторингом конкурентного середовища слід розуміти неперервне спостереження за розвитком підприємств та відносинами між ними, станом та впливом факторів конкурентного середовища зі змінною періодичністю, організоване для забезпечення контролю над процесами з метою виявлення тенденцій і закономірностей їх розвитку.

Метою проведення статистичного моніторингу конкурентного середовища є оптимізація процесів статистичного спостереження, аналізу та прогнозування основних показників, що характеризують стан конкурентного середовища за допомогою економіко-математичних та статистичних методів із використанням обчислювальної техніки та інформаційних технологій.

Досягнення поставленої мети статистичного моніторингу конкурентного середовища дозволить вирішити наступні завдання:

- забезпечити на постійній основі інформацією про конкурентне середовище;
- забезпечити своєчасне надходження достовірної та повної інформації про можливості та переваги конкурентів;
- визначити якою мірою дії конкурентів можуть впливати на спільні інтереси;
- уникнути дублювання при зборі, аналізі та поширенні інформації про конкурентне середовище.

Послідовність заходів зі статистичного моніторингу конкурентного середовища можна представити у такий спосіб:

1. Формування системи інформаційного забезпечення статистичного моніторингу конкурентного середовища.

2. Розробка системи індикаторів, які відображають стан конкурентного середовища.
3. Оцінювання конкурентного середовища.
4. Аналітичне забезпечення статистичного спостереження.
5. Коротко та середньострокове прогнозування можливих напрямів розвитку конкурентного середовища.
6. Візуалізація та інтерпретація одержаних результатів, підготовка узагальнюючих висновків та рекомендацій щодо розробки стратегії конкурентної боротьби.

Таким чином, створення системи статистичного моніторингу конкурентного середовища дозволить отримати необхідну статистичну інформацію про конкурентне середовище, провести на її основі аналіз та спрогнозувати зміни щодо стану та розвитку конкурентного середовища.



КЛАСИФІКАЦІЇ ТА ГРУПУВАННЯ ОБ'ЄКТІВ РИНКУ НЕРУХОМОГО МАЙНА

С.О. Шибіріна,

*аспірант кафедри статистики та демографії,
Київський національний університет імені Тараса Шевченка*

З метою ефективного управління функціонуванням ринку нерухомого майна постає необхідність у побудові єдиної системи класифікації об'єктів ринку нерухомості, яка є необхідною умовою розроблення системи аналітичного забезпечення вивчення ринкових процесів в сфері об'єктів нерухомого майна.

На сьогодні не розроблена система, яка дозволяє вивчати склад та структуру об'єктів нерухомого майна. Фактично при групуванні об'єктів нерухомого майна керуються тільки нормативними актами та документами, які не повною мірою відтворюють процеси, що відбуваються на ринку нерухомого майна, а також не дозволяють надати цілісну характеристику ринку. Всі існуючі підходи до класифікації об'єктів нерухомого майна дозволяють тільки систематизувати їх за фізичним статусом, призначенням, якістю, місцем розташуванням, розміром. Водночас не інституційні учасники ринку (професійні

учасники, до яких відносять агентства оцінювачів та ріелторів) використовують класифікацію наближену до класифікації об'єктів нерухомого майна країн Європи. Однак вона носить характер рекомендацій і має на меті упорядкування існуючих об'єктів ринку нерухомого майна, і, по суті, є доповненням до групувань, що зазначені в державних нормативних документах.

У зв'язку з цим постає проблема розроблення такої класифікації, яка б об'єднувала системи класифікації об'єктів нерухомого майна на законодавчому рівні та рівні професійних учасників ринку. Побудована на таких принципах класифікація надасть можливість комплексно вивчати властивості об'єктів нерухомого майна, а також дозволить систематизувати аналіз цінкових характеристик об'єктів нерухомості, спрямованих на вирішення завдань, пов'язаних з проблемами розвитку ринку нерухомого майна та ефективного регулювання ринкових процесів.

На першому етапі зведення і групування даних необхідно мати чітке уявлення про склад об'єктів нерухомості та операцій з ними, яке дозволить сегментувати ринок нерухомості у розрізі його елементів. У зв'язку з цим, ринок нерухомого майна слід розглядати як об'єкт статистичного вивчення, а об'єкти нерухомості – як елементи статистичної сукупності. Ринок нерухомого майна можна сегментувати за різними ознаками залежно від походження та призначення об'єктів нерухомості. Таким чином, об'єкти нерухомості можна представити у вигляді груп, кожна з яких може мати вкладену структуру залежно від економічної природи, рівня, функціонального призначення об'єктів нерухомого майна, а саме:

1. За рівнем функціонування ринку нерухомого майна: первинний ринок об'єктів нерухомості та вторинний ринок.
2. За рівнем організації ринку нерухомого майна: об'єкти організованого ринку та неорганізованого (стихийного) ринку.
3. За призначенням об'єктів нерухомого майна: ринок об'єктів житлової нерухомості та нежитлової нерухомості.
4. За будівельною готовністю об'єктів нерухомого майна: незавершені об'єкти нерухомості та готові об'єкти, які здані в експлуатацію.
5. За операціями з об'єктами нерухомого майна: купівля-продаж власного нерухомого майна; надання в оренду й

експлуатацію власного чи орендованого нерухомого майна; діяльність агентств нерухомості; управління нерухомим майном.

6. За формами власності на об'єкти нерухомого майна: державні, комунальні та приватні об'єкти.

7. За територіальною ознакою розміщення об'єктів нерухомого майна: внутрішній ринок об'єктів нерухомості, який, у свою чергу, ділиться на – локальний і національний; зовнішній ринок об'єктів нерухомості.

— ◇ —

ЗМІСТ

Бычкова С.Г.

Региональная дифференциация по уровню человеческого развития в России и реализация целей развития тысячелетия: статистическое измерение	3
---	---

Герасименко С.С., Чуприна О.А., Чуприна О.О.

Напрями застосування кластерного аналізу в порівняльній характеристиці країн	5
--	---

Гладун О.М., Хвалинська В.В.

Використання не кількісних даних у багатовимірній класифікації	7
--	---

Єлейко В.І., Боднар Р.Д., Демчишин М.Я.

Економетричний аналіз зовнішньої торгівлі товарами і послугами України	9
--	---

Єріна А.М.

Модель ARIMA як інструмент прогнозування тенденцій кон'юнктури ринку	10
--	----

Ковтун Н.В.

Класифікація методів виявлення і прогнозування фінансових махінацій	12
---	----

Моторин Р.М.

Напрямки удосконалення статистики державних фінансів України	14
--	----

Парадиш Ян, Парадиш Кароліна

Оцінка розвитку популяції західної Польщі в світлі другого демографічного переходу	16
--	----

Pociecha Józef

New directions of business statistics in finance and auditing ..	17
--	----

Саріогло В.Г.

Проблеми статистичного забезпечення моделювання при розробці соціальної політики в Україні	18
--	----

Саріогло В.Г., Огай М.Ю.

Методологічні підходи до підвищення надійності оцінювання індексу споживчих цін в Україні	20
---	----

Сидорова А.В.

Статистична оцінка збалансованості зовнішньої торгівлі України	22
--	----

Агабекова Н.В.

Статистическая оценка продолжительности экономических периодов в жизнедеятельности человека	24
---	----

Анисимова А.В.

Подходы к статистической оценке конкурентоспособности брендов	26
---	----

Вірченко В.В.

Статистичні методи оцінки схильності підприємства до банкрутства	28
--	----

Волохова Л.Ф.

Сучасні тенденції розвитку страхового ринку в Україні	30
--	----

Галицька Е.В., Прімерова О.К.

Роль викладачів і випускників Київського університету св. Володимира у генезисі вітчизняної статистичної науки	32
--	----

Головач Н.А.

Балансовий метод статистичного вивчення структури витрат населення	34
--	----

Гончар І.А.

Статистичний аналіз деструктивних змін у віковому складі населення України: оцінка та перспективи	36
---	----

Гончар І.А., Качалай В.В.

Умови адекватності статистичної оцінки споживчого кошику	38
--	----

Гончар О.В.

Статистичне оцінювання якості інформації в СНР	40
--	----

Євсеєнко О.Ф.

Основні демографічні чинники впливу на міграційні процеси серед молоді в Україні	42
--	----

Злотников А.Г.

Региональные факторы социологического демографического мониторинга	44
--	----

Кожанова С.А.

Экономико-статистическое отражение начального этапа приватизации в России	46
---	----

Кулішова Я.В.

Модель А. Роуза в аналізі зовнішньої торгівлі України	48
---	----

Лацкевич Н.В.

Актуальные вопросы статистической науки и практики в республике Беларусь	49
--	----

Лутчин Н.П.

Методологічні аспекти статистичного вивчення якості економічного зростання	51
--	----

Мамий И.П.

Истоки энергетической статистики в дореволюционной России	53
---	----

Маслій В.В.

Основні напрямки статистичних досліджень прямих іноземних інвестицій в контексті еволюції фінансової глобалізації	56
---	----

Момотюк Л.Є.

Роль статистики у функціонуванні фінансової системи	57
---	----

Моторина Т.М.

Методичні підходи до розрахунку валового регіонального продукту	59
---	----

Носова Є.А.

Використання інтегрального показника для оцінки фінансового стану підприємств	61
---	----

Образцова О.И.

Предпринимательский старт в международных сопоставлениях: влияние базисных институциональных и исторических факторов	63
--	----

Пальян З.О.

Сучасний режим народжуваності в Україні: статистичне оцінювання стану та перспектив	64
---	----

Панасенко І. В.

Проблеми функціонування підприємств ЖКК та напрямки їх подолання	66
--	----

Приходько К.Р.

Прогнозування валового внутрішнього продукта за допомогою авторегресійних моделей	68
---	----

Сошникова Л.А.

Методологические основы построения модифицированного межотраслевого баланса с учетом эколого-экономических процессов	70
--	----

Черемухіна О.М.

Статистична оцінка рівня забезпеченості та якості надання офтальмологічної стаціонарної допомоги сільським мешканцям України: регіональний аспект	72
---	----

Чорний А.Ю.

Моделювання латентних змінних: розвиток, сучасний стан та перспективи 74

Васильєва Н.М.

Соціально–трудові відносини, як основа для розвитку підприємства та росту їх конкурентоспроможності 76

Vasylchenko I.I.

Implementation of Monte Carlo method in option valuation using statistical programming language R 78

Васьків С.Ф.

Проблеми інформаційного забезпечення аналізу транскордонного співробітництва Польсько–Українсько–Білоруського прикордоння 80

Винятинська Л.В.

Податкові надходження, як об’єкт статистичного дослідження 82

Габелко М. В.

Аналитические возможности анкеты глобального мониторинга предпринимательства (GEM) 84

Горобець О.В.

Статистична характеристика особливостей сучасного етапу відтворення населення Автономної Республіки Крим 85

Дутова Н.В.

Оценка эффективности сбыта посредством электронных торговых площадок 87

Жмайло М.А.

Статистична оцінка ринку споживчого кредитування в Україні 89

Звірід Н.В.

Кількісні методи аналізу впливу трудової міграції на соціально-економічний розвиток регіону 91

Іваненко О.І.

Організація та проблеми фінансового моніторингу в кредитних спілках 93

Іванова Т.М.

Статистична оцінка розвитку малого бізнесу в АР Крим у 2000-2009 рр. 95

Колеснік Я.В.

Статистичне дослідження процесів нарощування банківського капіталу 96

Мотузка О.М. Міжнародна технічна допомога: інформаційні ресурси та аналіз	98
Нагорна Т.В. Теоритично-методологічні засади статистичного моніторингу ринку страхових послуг України	100
Огреба С.В. Пріоритетні напрями удосконалення відображення обсягів тіньової економіки у системі національних рахунків	102
Полтавець Л. Л. Інформаційне забезпечення статистики енергетичних ресурсів	104
Сидоренко М.К. Оцінка якості соціально-економічних процесів	105
Скачек Н.Ю. Статистика органічного виробництва: міжнародний досвід та Україна	107
Степаненко Д.А. Особенности формирования объема промышленной продукции в Республике Беларусь	109
Халак С.Г. Міжнародна трудова міграція, як об'єкт економіко- статистичного дослідження	111
Хвостенко О.А. Організаційні засади статистичного моніторингу конкурентного середовища	113
Шибіріна С.О. Класифікації та групування об'єктів ринку нерухомого майна	114