

**Міжнародний центр наукових досліджень
(м. Київ)**

**МАТЕРІАЛИ II МІЖНАРОДНОЇ НАУКОВО-
ПРАКТИЧНОЇ КОНФЕРЕНЦІЇ**

«СУЧАСНІ ПЕРСПЕКТИВИ РОЗВИТКУ НАУКИ»

8-9 ВЕРЕСНЯ 2018 РОКУ

**Київ
МЦНД
2018**

УДК 005
ББК 66.3(0)

Сучасні перспективи розвитку науки: матеріали II Міжнародної науково-практичної конференції м. Київ, 8-9 вересня 2018 року. – Київ : МЦНД, 2018. – 64 с.

У даному збірнику представлені тези доповідей учасників Міжнародної науково-практичної конференції «Сучасні перспективи розвитку науки». Висвітлюються актуальні проблеми розвитку науки на сучасному етапі розвитку. Розглядаються актуальні механізми та інструменти забезпечення перспектив наукових досліджень.

Збірник призначений для студентів, здобувачів наукових ступенів, науковців та практиків.

Всі матеріали представлені в авторській редакції. За повноту та цілісність яких автори безпосередньо несуть відповідальність.

©МЦНД 2018

АНАЛІЗ БОРГОВОЇ СТІЙКОСТІ КРАЇНИ

Загальновідомо, що практично всі економічні явища пов'язані між собою. Нагромадження державного боргу країни не може не впливати на економічні показники. На нашу думку, процес управління борговою стійкістю країни може бути більш ефективним, якщо будуть отримані характеристики взаємозв'язків між показниками державного боргу та такими показниками як ВВП, сума експорту товарів та послуг, рівень безробіття, рівень інфляції тощо. Встановлення таких зв'язків дозволить проаналізувати результат взаємного впливу економічних явищ, а також спрогнозувати їх подальші зміни.

Між безлічі методів моделювання доречно, на наш погляд, для початку, обрати кореляційно-регресійний аналіз. Застосування даного методу дозволить підвищити точність розрахунків при вирішенні задач управління державним боргом як стратегічного, так і тактичного прогнозування.

Розумно припустити, що обсяг державного боргу країни буде залежати від обсягів сформованого валового внутрішнього продукту, а також сум імпорту, експорту товарів та послуг країни тощо, однак, можна чекати деяке відставання у подібних взаємовідносинах. Коли через економічні перетворення відбудеться зростання ВВП звичайно ж скоротиться обсяг державного боргу, однак потрібен час, для того щоб «здійснилися подібні економічні перетворення».

Враховуючи те, що значення показника державного боргу змінюється через певний проміжок часу після зміни значення факторів x (ВВП, Експорт та ін.), то в рівнянні регресії повинні бути присутні відповідні фактори з відповідним лагом (запізненням). Таку взаємозалежність проаналізуємо між даними показниками за допомогою методу розподілених лагів. Слід зазначити, що модель, яка включає поточні і попередні значення змінних, називається розподілено-лаговою моделлю.

Для здійснення аналізу було відібрано квартальні дані за 2005-2018 рр. в Україні. При цьому, суму державного боргу України було обрано як залежну змінну, а ВВП, експорт та імпорт товарів та послуг, рівень інфляції, рівень безробіття, золотовалютні резерви та ін. – незалежними або пояснювальними змінним.

Даний аналіз було здійснено за допомогою програмного пакету Statistica. Як уже зазначалося, для розрахунку було обрано квартальні дані, а довжину запізнювання – 8, щоб подивитися дворічне відставання.

Результати проведеного аналізу дають підставу зробити висновки, що розрахована кореляційно-регресійна модель взаємозалежності державного боргу від ВВП, сум експорту та імпорту товарів та послуг країни та ін. є адекватною, впливаючі фактори є статистично значущими (враховуючи показник P-value). Отриманий загальний коефіцієнт кореляції дає змогу стверджувати, що зміна державного боргу України на 80,4% залежить від зміни незалежних змінних; ця залежність проявляється із затримкою. Це той час, який необхідний системі, щоб відреагувати на трансформаційні зміни. Таким чином, дану модель можна використовувати для дослідження державного боргу та боргової стійкості в Україні.

Література:

1. Макаренко В.О. Аналіз динаміки, структури державного та гарантованого боргу та його взаємозв'язку з ВВП [Електронний ресурс] / В. О. Макаренко, В.П. Карбан // Науковий вісник Херсонського державного університету. – Режим доступу: http://www.ej.kherson.ua/journal/economic_11/82.pdf.
2. Сизова Т.М. Статистика [Текст]: навч. посібник / Т.М. Сизова. – СПб.: ГУИТМО, 2005. – 190 с.
3. Економіко-математичні методи та моделі (економетрика): навчальний посібник / О. В. Козьменко, О. В. Кузьменко. – Суми: Університетська книга, 2014. – 406 с. – ISBN 978-966-680-722-2