
ТРАНЗИЦІЙНІ ПРОЦЕСИ: ПРОБЛЕМИ ЕКОНОМЕТРИЧНОГО МОДЕЛЮВАННЯ

В перехідний до ринкової економіки період в Україні досить відчутно проявилися негативні соціальні зрушення. Це об'єктивна закономірність, яку необхідно всебічно досліджувати і робити відповідні висновки.

Монографія П.О. Іващенко¹ являє собою розвиток економетричної теорії в двох напрямках: методологічному і модельному.

Перший напрямок представлений науково обгрунтованою загально-методичною позицією автора в оцінюванні фактору випадковості впливу дії одного чинника на інший, а також у взаємодії системи чинників. Цей крок реалізується при якісному аналізі зв'язків, перевірках гіпотез про розподіл випадкового вектору, в аналізі мультиколінеарності пояснюючих змінних і структури зв'язків, моделюванні системи одночасових рядів та ін.

Розроблена П.О. Іващенкою теорія непараметричного оцінювання рівня випадковості у взаємодії соціально-економічних процесів передбачає синтез критерію рівня випадковості (с. 9), виявлення і дослідження властивостей екстремальних точок (с. 10-20), обгрунтування критеріїв випадковості факторних зв'язків і взаємозв'язків, а також розробку рекомендацій про їх застосування і перевірку дієздатності. Вказаний матеріал викладено в першому розділі.

Другому напрямку – розробці і дослідженню економетричних моделей транзиційних процесів – присвячено подальші розділи монографії.

З розвитком бізнес-процесів на перші місця виходять технології торгівельних відносин і, насамперед, процеси спекулятивної діяльності. З одного боку, це класичні проблеми економіки, але в умовах України вони набувають специфічних особливостей, що викликає необхідність економетричного моделювання процесів спекуляції². В другому розділі монографії П.О. Іващенко узагальнює в економетричному аспекті статичну і динамічну моделі спекуляції відомого київського вченого-економіста А.А. Алексеева і приходять до висновку, що до узагальнених моделей спекулятивної діяльності класичні економетричні методи вже непридатні. Автор пропонує новий підхід, пов'язаний з імітаційним моделюванням.

Специфіка ринкових перетворень проявляється в значній диференціації рівня життя населення. Тому для його основної маси важливими є засоби забезпечення безпеки життєдіяльності.

Третій розділ містить економетричну інтерпретацію моделей поведінки особи – моделей, що люблять досліджувати багато економістів. Українська специфіка моделі поведінки Робінзона Крузо полягає в адекватній формалізації процесу збирання врожаю картоплі, який досліджений досить глибоко.

Наступний, четвертий розділ охоплює таку сферу транзиційних процесів, як мережевий маркетинг. Це досить нове для українського ринку явище, і наукових напрацювань проблематики мережевого маркетингу у вітчизняній літературі ще замало. Відсутні вітчизняні економетричні моделі. Ефективне просування товарів за сучасними принципами мережевого

¹ П.О. Іващенко. Економетричне моделювання транзиційних процесів // Харків: Видавничий центр Харківського національного університету ім. В.Н.Каразіна, 2002. – 188 с.: табл., граф.

² Спекуляція (спекулятивний) у цій редакції та у рецензованому творі розуміється дещо в радянській традиції (прим. ред.).

маркетингу потребує створення відповідної теорії. Остання, як здається, повинна розглядатися з позицій економічної теорії, статистики і математики, тобто – класичної економетрики. Те, що пропонується в цьому розділі, можна визначити як вдалу спробу імітаційного моделювання поведінки фірми, яка працює за принципами мережевого маркетингу. Особливість дослідження полягає в тому, що акцент робиться на фінансово-економічних аспектах діяльності фірми і, зокрема, на економічній безпеці.

Теоретичні напрацювання розділу мають практичний вихід, пов'язаний з розробленням методики економічного обґрунтування маркетинг-плану фірми.

Найбільш цікавим можна вважати п'ятий розділ, який присвячено теорії фінансових пірамід.

Відомі інфляційні струси 1994-96 років в Україні призвели до появи фінансових пірамід. Офіційною метою їх діяльності був захист заощаджень населення від інфляції. А неофіційною і переважно головною ціллю – незаконне збагачення за рахунок ошукання вкладників. Теорія фінансових пірамід повинна бути побудована і застосована до сучасного стану фінансової діяльності. Важливим в цьому напрямку є економетричний підхід, який поряд з теоретичним економічним обґрунтуванням закономірностей функціонування фінансових пірамід дозволяє визначити кількісну характеристику рівнів обмеження їх діяльності. Взагалі вплив системи суттєвих чинників на інфляцію і економічну безпеку не може бути охарактеризований на чисто теоретичному рівні. Тому важливо знайти кількісні співвідношення, що висвітлюють такий вплив. Вказане складає основний зміст монографії, її червону лінію.

За думкою рецензента, автор досить сміливо пропонує називати процеси, пов'язані з інфраструктурними аномаліями, що мають місце в економіках перехідного типу, теорією фінансових пірамід.

Розробки фінансово-економічних і на їх основі економетричних моделей фінансових пірамід слід віднести до відповідного розділу фінансової математики і економетрики.

Необхідно зауважити, що напрацювання розділу мають практичне значення, яке полягає в з'ясуванні умов існування фінансових пірамід. Наприклад, встановлення відповідних ставок відсотка дозволяє фінансовій піраміді існувати наперед заданий час. Останнє наближає її до банківської установи. Актуальність виконання таких досліджень очевидна. Вона може дати практичні рекомендації щодо поведінки окремих трейдерів на ринку цінних паперів.

Особливе місце в монографії займає останній шостий розділ. Він присвячений актуальним питанням економетричного моделювання економічної безпеки і тіньової економіки.

Пов'язуючи економічну безпеку з економічним ризиком, автор розглядає сутність транзиторних процесів, що відбуваються в Україні. В результаті дослідження законів розвитку та ерозії ринку він проголошує і обґрунтовує, що раціональна структура економіки і механізми саморегуляції ринку встановлюють рівновагу у взаємодії чорного і білого ринків. Цей результат характерний для економік перехідного типу.

В підрозділі 6.3 порушена гостра дискусійна проблема оцінювання впливу тіньових чинників на інфляцію. Моделюючи наявність тіньового сектору економіки, на основі балансової тотожності Фішера П.О. Іващенко отримує вираз індексу інфляційних змін в тіньовому секторі через коефіцієнти тіньовизації (див. формулу (6.13) на стор. 157).

Дискутуючи з М.А. Павловським, автор пропонує економетричний підхід до моделювання впливу на приріст грошової маси тих чинників, що зумовлюють інфляцію.

Особливість підходу полягає в урахуванні факту відсутності інформації про чинники в необхідному обсязі, що потребує розробки відповідних економетричних методів.

Висвітливши позитивні сторони монографії не можна не вказати на її недоліки, які, на думку рецензента, мають місце.

В кожному розділі наведені регресійні співвідношення, отримані за допомогою тих чи інших програмних засобів. При цьому слід було б вказати процедури або ж алгоритми, за допомогою яких вони отримані.

Замало сказано про застосування методу імітаційного моделювання для економетричного аналізу моделей спекуляції.

Матеріал, зв'язаний з аналізом чинності закону залежності насичення процесу нагромадження від комерційної діяльності (стор. 45-47), відбиває аналіз моделі процесу нагромадження з позицій математичної економіки. Його логічніше розмістити наприкінці розділу, супроводивши коментарями економетричного характеру.

Цілий підрозділ 4.5 займає одна таблиця 4.5 «Робочі аркуші фінансово-економічного аналізу мережевої фірми». Необхідно було її супроводити хоча б короткими коментарями.

Позитивною особливістю монографії є рівномірність у наповненні етапів економетричного моделювання. Ретельний аналіз об'єкта дослідження з позицій економічної теорії; формування системи ознак, що адекватно описують його поведінку; проведення статистичного спостереження (де це можливо і необхідно); синтез економетричної моделі (лінійної чи нелінійної); оцінювання її параметрів; економічна інтерпретація результатів – от ті моменти, що мають місце в кожному розділі.

Слід зазначити, що всі результати економетричного моделювання, представлені в монографії, є новими і математично обґрунтованими.

Автор широко використовує можливості комп'ютерного моделювання. Так наприклад, з метою виявлення фінансово-економічних особливостей поведіння мережі дистриб'юторів ним була розроблена імітаційна модель діяльності мережевої фірми. В ній істотно використовуються можливості Microsoft Office і мови програмування Visual Basic for Application.

Актуальність проблем, які висвітлені в монографії, очевидна.

Тема монографії відповідає її змісту.

Узагальнюючи, скажу, що монографія П.О. Іваценка «Економетричне моделювання транзиційних процесів» являє собою значний вклад в економічну науку, зокрема в розвиток її економетричного розділу.

*В.Я.Заруба,
доктор економічних наук, професор,
завідувач кафедри економічної кібернетики
та маркетингового менеджменту
Національного технічного університету
«Харківський політехнічний інститут»*