УДК 330.34

**_Мазняк М. Г._**

Студент 5 курсу
факультету економічної інформатики ХНЕУ

# МОДЕЛІ ОЦІНКИ, АНАЛІЗУ ТА ПРОГНОЗУВАННЯ КОНКУРЕНТОСПРОМОЖНОСТІ ДЕРЖАВИ

*Анотація. Розроблено комплекс моделей оцінки та аналізу конкурентоспроможності держави, реалізація якого дозволить дослідити поточний стан рівня конкурентоспроможності та інвестиційної привабливості держав і побудувати прогнози динаміки розвитку з використанням сучасних методів багатовимірного аналізу.*

*Аннотация. Разработан комплекс моделей оценки и анализа конкурентоспособности государства, реализация котрого позволит исследовать текущее состояние уровня конкурентоспособности и инвестиционной привлекательности государств и построить прогнозы динамики развития с использованием современных методов многомерного анализа.*

*Annotation. Complex of state competitiveness assessment and analysis models, realization of which will make it possible to investigate the current level of competitiveness and states investment attractiveness and make development dynamics forecast using modern methods of multimeasure analysis has been elaborated.*

*Ключові слова: індикатори, рейтинг, модель, прогнозування, конкурентоспроможність, методи кластерного, дискримінантного та дисперсійного аналізу.*

Визначення місця держави у світовій системі координат є основним завданням науковців і владних структур. Аналіз місця України, рівня її конкурентоспроможності як молодої держави, що активно інтегрується у світовий економічний простір, є особливо важливим для економічної безпеки держави. Оскільки лише з'ясувавши місце і роль нашої держави на світовому ринку, можна розробити чітку стратегію розвитку та забезпечення економічної безпеки [1].

Рейтингові оцінки виступають своєрідним орієнтиром як для ТНК та інвестиційних фондів, які мають намір вкладати кошти за кордоном, так і для урядів держав, адже рейтинги індексів є важливим інструментом, який може використиватися для формулювання досконалішої економічної політики, забезпечення економічної безпеки та інституціональних реформ в економіці, підвищення конкурентоспроможності держави та її інвестиційної привабливості [2].

Тому виникає необхідність розробки комплексу економіко-математичних моделей дослідження конкурентоспроможності держави на основі оцінки та аналізу основних індексів провідних міжнародних рейтингових компаній, що дозволить поліпшити якість управлінських рішень щодо забезпечення економічної безпеки держави, сформувати обґрунтовані управлінські рішення, направлені на підтримку належного її рівня. Тому метою роботи є побудова комплексу моделей оцінки та аналізу конкурентоспроможності держави на основі принципів системного аналізу на основі інструментарію методів багатовимірного статистичного аналізу.

Об´єктом роботи є стан інвестиційної привабливості держави, її конкурентоспроможності та основних макроекономічних показників.

Предмет – методи і моделі, що при цьому використовуються.

Нижче наведено опис задач та моделей кожного етапу запропонованого комплексу моделей.

Етап 1. Формування системи показників. За допомогою методів експертного аналізу [3] формується обґрунтований комплекс економічних показників-індикаторів оцінки конкурентоспроможності держави з урахуванням специфіки функціонування на основі міжнародних рейтингів та даних статистичних відділів, що відбивають стан системи в цілому та її локальних процесів. Задача даного етапу – відбір показників, що найбільш повно, з точки зору практики, дозволяють судити про ступінь неблагоприємної ситуації в державі, її інвестиційної привабливості, та можливостях відносної локалізації існуючих загроз. Основні економічні рейтинг-показники для 139 країн світу, які використовуються у роботі та дозволяють з'ясувати роль України на світовому ринку і його вплив на конкурентоспроможність держави, наведено у табл. 1.

Таблиця 1

**Україна в системі міжнародних індексів і рангів** [1]

| № п/п | Назва | Сфера, яку визначає рейтинг | Організатор дослідження | Профіль | Місце України у 2010 р. |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | Індекс глобальної конкурентоспроможності (Global Competitiveness Index GCI та Business Competitiveness Index BCI) | Економічний стан держав світу | Всесвітній економічний форум (Женева) | Широкий | 73 зі 131 |
| 2 | Індекс економічної свободи | 10 категорій економічної свободи, торгову політику, податкове навантаження та ін. | | Широкий | 133 зі 157 |

© Мазняк М. Г., 2011

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 3 | Індекс розвитку людського потенціалу (ІРЛП) | Бідність, грамотність, освіта, рівень життя населення держави | ООН | Широкий | 76 зі 155 |
| 4 | Індекс сприйняття корупції | Стадії розвитку корупції | Міжнародна неурядова організація Трансперенсі Інтернешнл | Спеціальний | 74 з 96 |
| 5 | Індекс внутрішніх та зовнішніх загроз | Економічна безпека | Московський державний інститут міжнародних відносин (МДІМВ) | Спеціальний | 140 із 192 |
| 6 | Індекс потенціалу міжнародного впливу | Економічний та політичний потенціал | МДІМВ | Широкий | 29 із 192 |

Етап 2. Моделі оцінки, аналізу та прогнозування індикаторів конкурентоспроможності держави. Даний етап передбачає реалізацію наступних моделей:

- Кластерні моделі оцінки та аналізу індикаторів конкурентоспроможності держави. Метою даного дослідження є формування однорідних класів (кластерів) стану конкурентоспроможності держав та розробка унікальних для держави, що аналізується, діапазонів виділених індикаторів стану і дослідження стійкості та однорідності отриманих кластерних груп.

На основі кластерного аналізу було виділено 7 груп країн за рівнем глобальної конкурентоспроможності. Дані наведено в табл. 2 [2; 4].

Таблиця 2

**Групи країн за рівнем глобальної конкурентоспроможності**

| № групи | Назва групи | Показники індексів | Кількість країн, що увійшла до групи | Приклади країн, що входять до групи |
|---|---|---|---|---|
| 1 | Країни з найвищим рівнем глобальної конкурентоспроможності | Від 5,00 | 20 | Швейцарія, Швеція, Сингапур, США, Німеччина, Японія |
| 2 | Країни з високим рівнем глобальної конкурентоспроможності | 4,50 – 5,00 | 18 | Бельгія, Люксембург, Китай |
| 3 | Країни з середньовисоким рівнем глобальної конкурентоспроможності | 4,25 – 4,50 | 19 | Іспанія, Португалія, Бразилія |
| 4 | Країни з середнім рівнем глобальної конкурентоспроможності | 4,00 – 4,25 | 19 | Туреччина, Російська Федерація |
| 5 | Країни з низьким рівнем глобальної конкурентоспроможності | 3,75 – 4,00 | 19 | Єгипет, Україна, Грузія |
| 6 | Країни з незначним рівнем глобальної конкурентоспроможності | 3,50 – 3,75 | 19 | Лівія, Еквадор, Кенія |
| 7 | Глобально-неконкурентноспроможні країни | 2,73 – 3,50 | 19 | Бурунді, Ангола, Чад |

Україна, за даним дослідженням, опинилася в групі країн з низьким рівнем глобальної конкурентоспроможності і в динаміці дана ситуація погіршується.

- Моделі розпізнавання та ідентифікації стану конкурентоспроможності держави. Результатом є побудова дискримінантних функцій розпізнавання приналежності досліджуваної держави до одного з кластерів, що характеризує рівень держави за рівнем глобальної конкурентоспроможності.

Дискримінантні функції (фрагмент) для відповідних кластерів мають такий вигляд:

$$У1 = - 3,22 - 2,36 \times x1 - 0,14 \times x2 - 3,07 \times x3;$$
$$У2 = - 2,44 + 2,17 \times x1 - 0,39 \times x2 - 1,28 \times x3;$$
$$У3 = - 5,09 + 3,09 \times x1 + 4,53 \times x2 + 3,22 \times x3;$$
$$У4 = - 23,5 + 7,03 \times x1 + 11,64 \times x2 + 9,18 \times x3;$$
$$У5 = - 8,07 - 2,89 \times x1 - 7,77 \times x2 - 4,26 \times x3;$$
$$У6 = - 8,91 - 7,40 \times x1 - 2,53 \times x2 - 2,40 \times x3;$$
$$У7 = - 24,78 - 9,82 \times x1 - 12,67 \times x2 - 4,36 \times x3,$$

де x1 – індекс економічної свободи (ІЕС);

x2– індекс глобальної конкурентоспроможності (ІГК);

x3 – валовий внутрішній продукт (ВВП).

Етап 3. Моделі дослідження ступеня взаємозв'язку індексів конкурентоспроможності держави та макроекономічних показників за допомогою методів кореляційно-регресійного аналізу та методів дисперсійного аналізу. За результатами дослідження встановлено, що чим вище рівень індексу глобальної конкурентоспроможності країни та рівень індексу глобальної конкуренто-спроможності, тим вище інвестиційна привабливість держави. Чим нижче індекс внутрішніх та зовнішніх загроз, тобто менший вплив загроз, тим більш конкурентоспроможною є держава. Чим вище значення індексу внутрішніх та зовнішніх загроз, тим нижче якість життя, слабка державність, звідси низький рівень у рейтингу країн за рівнем глобальної конкурентоспроможності.

Етап 4. Формування управлінських рішень, направлених на підтримку належного рівня конкурентоспроможності та інвестиційної привабливості держави.

Упровадження даного інструментарію дослідження в практику управління і його реалізація дозволить:

проаналізувати позиції України в міжнародних рейтингах у динаміці та з'ясувати місце України у світовій системі координат;

визначити проблеми та основні чинники розвитку української економіки в міжнародних вимірах та їх вплив на економічну безпеку;

дослідити динаміку розвитку економічної безпеки України у порівнянні з провідними державами світу.

оцінити наявну ситуацію рівня конкурентоспроможності та інвестиційної привабливості держав світу.

*Наук. керівн. Сергієнко О. А.*

---

**Література:** 1. Аналітичний огляд "Результат України у світових рейтингах" / Департамент економічного аналізу та прогнозування. – К., 2010. 2. http://dt.ua/articles/51822. 3. Моделювання економічної безпеки: держава, регіон, підприємство : монографія / В. М. Геєць, М. О. Кизим, Т. С. Клебанова, О. І. Черняк та ін. ; за ред. Гейця В. М. – Х. : ВД "ІНЖЕК", 2006. – 240 с. 4. Многомерный статистический анализ в экономике : учеб. пособие для вузов / Л. А. Сошникова, В. Н. Тамашевич, Г. Уебе, М. Шефер ; под ред. проф. В. Н. Тамашевича. – М. : ЮНИТИ – ДАНА, 1999. – 598 с.