

Секція 3. Економіко-математичне моделювання та вимірювання ефективності діджиталізації суспільства

УДК 338

О.С Башуцька, канд.екон.наук,доц.

С. Какалюк

Західноукраїнський національний університет

ПРОБЛЕМАТИКА МОДЕЛЮВАННЯ ВАЛЮТНО-КУРСОВОЇ ПОЛІТИКИ В УМОВАХ РИНКУ

Oksana Bashutska Ph.D., Assoc. Prof

Svitlana Kakaliuk

SOME MODELING PROBLEMS OF FOREIGN EXCHANGE RATE POLICY IN MARKET CONDITION

В умовах ринкової економіки кожна країна обирає свій шлях регулювання валютного курсу в країні. Валютно-курсову політику в Україні здійснює Національний банк України. Загалом останніми роками в Україні закріпилася плаваюча форма регулювання валютного курсу за якої курс валют варіюється відповідно до умов ринку. В свою чергу Національний банк України за допомогою інструмента валютних інтервенцій може певною мірою впливати на валютний курс держави, що дозволяє призупинити високу волатильність на валютному ринку. Проте це не є гарантом фіксування курсу на певному рівні, тому для успішної життєдіяльності ринку суб'єктам валютного ринку необхідно прогнозувати валютний курс. Є безліч підходів та моделей для прогнозування валютного курсу, серед яких в світовій практиці основними моделями визначають такі як:

- моделювання на основі динамічних рядів;
- моделювання на основі експертної думки;
- моделювання на основі показникових та степеневих функцій;
- моделювання на основі аналітичних залежностей;
- моделювання на основі паритету купівельної спроможності національних валют;

- моделювання на основі новинного ресурсу, тощо.

«Методи, які базуються на припущенні, що на базі думок спеціалістів у певній галузі знань можна побудувати адекватну картину майбутнього розвитку з урахуванням всіх можливих зсувів і стрибків отримали назву методів експертиз або методів експертних оцінок» [1]. Метод експертних оцінок полягає в обробці інформації, отриманої шляхом опитування експертів. Використання експертів як джерел інформації про майбутній розвиток досліджуваного процесу (явища, об'єкта), ґрунтується на гіпотезі наявності бодай у частини провідних спеціалістів конкретної області глибоких і достатніх знань про шляхи розв'язання досліджуваних проблем.

Методи експертних оцінок в прогнозуванні використовуються в таких випадках:

- в умовах відсутності достатньої за обсягом та достовірної інформації про прогнозовані явища (процеси, об'єкти);
- в умовах значної невизначеності середовища, де функціонує об'єкт;
- в умовах дефіциту часу або екстремальних ситуаціях;

- при розробці середньо- та довгострокових прогнозів об'єктів, які підпадають під вплив корінних змін, наприклад, наукові відкриття.

Окреме місце займають статистичні методики, вони включають величезну кількість методів, таких як методи теорії оцінювання, факторного аналізу, регресійного та кореляційного аналізу. За допомогою зазначених методів інвестори можуть здійснювати всебічні статистичні дослідження фінансового ринку, здійснювати прогнозування ринкових процесів і на основі цього можуть приймати більш обґрунтовані інвестиційні рішення.

В наукових колах пропонується використовувати комбіновані методи та моделі прогнозування валютних курсів, оскільки в умовах функціонування ринкової економіки жодна з моделей не може повною мірою спрогнозувати достовірний валютний курс. Виникає проблема визначення основних критеріїв впливу на ціну валюти як в короткостроковому так і в довгостроковому періоді для здійснення планування.

Деякі науковці вітчизняного та світового масштабу пропонують застосовувати теорію нечіткої логіки для прогнозування валютного курсу, оскільки вона передбачає собою використання «нечітких» змінних. Концепція нечітких множин була вперше викладена Лотфі вона дозволяє описувати поняття природної мови (лінгвістичні конструкції) та властиву їм невизначеність. Фактично, нечіткі множини утворюють важливу зв'язку ланку між символічними та чисельними обчисленнями, будучи ключовим інструментом обчислень зі словами (computingwithwords), орієнтованих на використання слів та речень мови людського спілкування. Це дозволяє прогнозувати валютний курс за певних умов невизначеності.

Література:

1. Экспертные оценки в научно-техническом прогнозировании / [Г. М. Добров, Ю. В. Ершов, Е. И. Левин, Л. П. Смирнов]. – К. : Наукова думка, 1974. – 160 с.
2. Показники валютного ринку України – 09'2021. URL: https://bank.gov.ua/files/rates_final.xlsx
3. Козловський С.В. Макроекономічне моделювання та прогнозування валютного курсу в Україні / С.В. Козловський, В.О. Козловський. – Вінниця: "КнигаВега" ВАТ "Вінницька обласна друкарня", 2005. — 240 с.
4. Косова Т. Д., Терещенко О. В. Поведінковий підхід до регулювання економічних процесів на валютному ринку та їх моделювання //Економіка та держава. – 2021. – №. 8. – С. 47-52.