

УДК 658.15

**ЕКОНОМЕТРИЧНІ МЕТОДИ ДЛЯ ОЦІНЮВАННЯ ФІНАНСОВИХ  
ПОКАЗНИКІВ СОЦІАЛЬНО-ЕКОНОМІЧНИХ СИСТЕМ**

**ECONOMETRIC METHODS FOR EVALUATION OF FINANCIAL  
INDICATORS OF SOCIO-ECONOMIC SYSTEMS**

*канд. екон наук М.В. Бормотова, канд. екон наук Т.В. Машошина,  
канд. екон наук О.М. Тройнікова  
Український державний університет залізничного транспорту (Харків)*

*PhD(Econ.) M.V. Bormotova, PhD(Econ.) T.V. Mashoshyna,  
PhD(Econ.) O.M. Troinikova  
Ukrainian State University of Railway Transport (Kharkiv)*

Фінансова безпека є найважливішою частиною економічної безпеки. Вона відображає змогу соціально-економічної системи стабільно функціонувати, тобто відображає можливість забезпечення умови функціонування; забезпечення ресурсами; наявність стратегії розвитку з урахуванням інтересів всіх учасників.

Суцільне спостереження, дослідження та прогнозування відповідних фінансових показників соціально-економічної системи, дає можливість застосування дієвих заходів, що дозволяє не тільки спостерігати за поточною картиною процесу, але й випередити ризики, що виникають завдяки сучасних факторів [1,2,3].

Світова ситуація на даний час характеризується поширенням дестабілізаційних економічних процесів, які спричинені впливом негативних факторів зовнішнього та внутрішнього характеру.

Суб'єкти господарювання змушені пристосовуватись до умов середовища та швидкості зміни напрямку їх впливу, тому виникає потреба в забезпеченні необхідних заходів та створенні стійкої системи управління з метою надання можливості соціально-економічній системі якомога меншою мірою відчувати негативні результати дестабілізаційних факторів всіх рівнів на функціонування своєї господарської діяльності. [4]

Для оцінювання, управління та прогнозування фінансової безпеки соціально-економічної системи, доцільним є застосування системного підходу. Для таких цілей доречним є використання економетричних методів та моделей.

Для дослідження економічних процесів на перспективу будують економічні прогнози, які забезпечують визначення найвірогіднішого економічно ефективного варіанту проектів різного терміну виконання.

У багатьох випадках моделювання та прогнозування економічних залежностей на основі лінійних рівнянь дає задовільні результати. Однак через складність економічних процесів досить часто взаємозв'язки економічних явищ не є лінійними. У таких випадках застосовують нелінійні економетричні моделі.

Побудова такої економетричної моделі та її перевірка є більш складною задачею ніж побудова лінійної моделі. В таких випадках дійовим інструментом можуть стати криві зростання.

Основним принципом застосування економетричних моделей є збір достовірних незалежних емпіричних даних, на основі яких будується відповідна математична модель. Масив даних повинен містити десятки достовірних незалежних спостережень, що залежить від цілей дослідження.

Слід відмітити, що криві зростання охоплюють не тільки процеси зростання економічних показників, а також і їх зниження. На жаль, часто на практиці, в сучасних економічних умовах України, приходиться розглядати криві, які відображають зниження тих чи інших економічних показників, що обумовлено в значній мірі всесвітньою пандемією коронавірусу. Зараз особливістю використання економетричних методів для оцінювання фінансових показників соціально-економічних систем є відсутність стабільних тенденцій в динаміці цих показників.

[1] Левчук О.В. Економічна безпека України в контексті глобалізаційних викликів. *Економіка і суспільство*. 2017. №8. С. 59-64.

[2] Кириченко О.А. Вдосконалення управління фінансовою безпекою підприємств в умовах фінансової кризи. *Финансовые рынки и ценные бумаги*. 2009. №16. С. 22-28.

[3] Тройнікова О.М., Машошина Т.В., Фактори підвищення економічної безпеки соціально-економічних систем в умовах глобалізації. *Європейський вектор модернізації економіки: креативність, прозорість та сталий розвиток: матеріали XI міжнар. наук-практ. конф. м. Харків 28-29 травня 2019р.* Харків, 2019. С 325-326.

[4] Кудрицька Ж. В, Система управління фінансовою безпекою підприємства. *Ефективна економіка*. 2012. № 1 <http://www.economy.nauka.com.ua/?op=1&z=897>. (дата звернення 10.06.2019).]

[5] І.Г., Краснікова Л.І. Економетрика Підручник. – К.: Товариство “Знання”, КОО, 1998.

[6] Наконечний С.І., Терещенко Т.О., Романюк Т.П. Економетрія: Підручник. Вид.2-ге, допов. Та перероб.-К: КНЕУ, 2000.