**Маханець Любов Леонідівна. Моделювання ризику в зовнішньоекономічній діяльності: Дис... канд. екон. наук: 08.03.02 / Київський національний економічний ун-т. - К., 2002. - 204 арк. - Бібліогр.: арк. 158-167**

|  |  |
| --- | --- |
| |  | | --- | | **Маханець Л.Л. Моделювання ризику в зовнішньоекономічній діяльності.-*Рукопис.***  Дисертація на здобуття наукового ступеня кандидата економічних наук за спеціальністю 08.03.02-економіко-математичне моделювання.-Київський національний економічний університет, Київ, 2002.  Дисертація містить результати дослідження ризику в зовнішньоекономічній сфері засобами економіко-математичного моделювання. У роботі проведено порівняльний аналіз існуючих класифікацій ризиків та економіко-математичних моделей зовнішньоекономічної діяльності. Запропонована власна класифікація ризиків ЗЕД.  З метою врахування ризиків, пов’язаних з управлінськими рішеннями щодо зовнішньоекономічної діяльності, побудовано теоретико–ігрову модель вибору раціональної умови постачання з множини INCOTERMS та запропоновано багатокроковий алгоритм вибору інвестиційного проекту з врахуванням ставлення іноземного інвестора до ризику. На основі розрахованого показника економічної безпеки, визначені області стійкості економічного стану країни. Розроблена методика дозволяє встановити області стійкості економіки.  Крім того, побудована та розрахована модель залежності політичного ризику від зміни валового внутрішнього продукту та зовнішньої заборгованості, що дозволяє визначати за заданого ступеня політичного ризику бажаний рівень зовнішнього боргу. Виходячи з даної моделі, побудована карта ізоквант міри політичного ризику, яка дає можливість прогнозувати зміну зовнішнього боргу при бажаному ступені політичного ризику і прогнозованій зміні ВВП. Проведена числова апробація запропонованих моделей дозволяє зробити висновок про доцільність та ефективність їх застосування у зовнішньоекономічній діяльності України. | |
| |  | | --- | | У дисертації наведене теоретичне узагальнення і нове вирішення наукової задачі щодо моделювання ризику зовнішньоекономічної діяльності. Аналіз теоретичних концепцій ризику дозволив зробити узагальнюючі висновки щодо вдосконалення методики, оцінки, урахування та ефективного управління ризиками зовнішньоекономічної діяльності в умовах економіки України. Результати проведеного наукового дослідження дають можливість зробити наступні висновки:   1. Аналіз існуючих економіко-математичних моделей зовнішньоекономічної діяльності показав, що більшість з них не враховують невизначеність та конфліктність при здійсненні ЗЕД. Доведено, що однією із сфер, яка найбільше підлягає впливу ризику і в якій найчастіше виникає невизначеність та конфлікт є зовнішньоекономічна діяльність. 2. Запропоновано виокремити метасистемний ризик, яким обтяжені всі види ЗЕД. Його можна деталізувати наступним чином: політичний, макроекономічний та валютний ризики. 3. Побудовано теоретико–ігрову модель вибору умови постачання з множини INCOTERMS, показник ефективності якої – ступінь транспортного ризику. Дана модель дозволяє встановити, що при виході на зарубіжний ринок як експортеру, так й імпортеру з метою мінімізації ризику втрат необхідно користуватися такими умовами постачання: CPT, CFR, FOB, FCA, CIP, CIF, FAS. 4. Запропоновано вимірювати економічну безпеку країни інтервальними оцінками. Для визначення ризику економічної безпеки сформована система показників та задані їхні граничні інтервали. На базі розрахованого показника економічної безпеки, визначені області стійкості економічного стану країни. 5. Запропонована кількісна оцінка ступеня ризику економічної безпеки може використовуватись як один із ключових показників національної безпеки чи економічної безпеки регіону. 6. Аналіз методик якісної та кількісної оцінки політичного ризику показав, що в основному політичний ризик класифікується суто вербальними поняттями. Запропонована кількісна інтервальна оцінка політичного ризику на підґрунті індексу BERI та дев’яти ступенів прояву даного ризику. Виділені дев’ять інтервалів значень кількісної оцінки політичного ризику. 7. Запропонована модель залежності експорту від політичного ризику, яка дозволяє розраховувати максимально можливий обсяг зовнішнього боргу держави для певного ступеня політичного ризику. Певній величині політичного ризику відповідає певний інтервал обсягів експорту та зовнішнього боргу. 8. Дано оцінку залежності (взаємозв’язку) ступеня політичного ризику від двох чинників: зміни валового внутрішнього продукту та зовнішньої заборгованості. Виходячи з цього розраховано та побудовано карту ізоквант міри політичного ризику, яка дозволяє прогнозувати зміну зовнішнього боргу за бажаного ступеня політичного ризику та прогнозованої зміни ВВП. 9. Розроблена модель залежності ступеня політичного ризику від зміни валового внутрішнього продукту та зовнішньої заборгованості може бути використана для оцінки раціонального рівня зовнішньої заборгованості держави виходячи із бажаного ступеня політичного ризику і оцінки обсягу зміни ВВП. 10. Запропонована система кількісної оцінки ступеня ризику іноземного інвестора, що враховує його ставлення до невизначеності та конфліктності, яким обтяжений інвестиційний проект. Обґрунтовано доцільність використання, поряд із математичним сподіванням, моди та медіани таких показників привабливості проекту, як , та термін окупності. Відхилення від модального чи медіанного значення у несприятливий бік є однією із складових міри ризику інвестиційного проекту. 11. Сформована система кількісних показників ступеня інвестиційного ризику та запропонований багатокроковий алгоритм вибору інвестиційного проекту з низки альтернативних варіантів дозволяють враховувати інтереси зацікавлених сторін та їх ставлення до ризику. | |