

## АННОТАЦІЯ

Шифр наукової роботи: «CrisisBOP»

**Актуальність теми.** Українську економіку не раз вражали наслідки настання кризи платіжного балансу, що характеризувалась різким знеціненням валюти, скороченням міжнародних резервів, а також підвищенням відсоткових ставок. Україна зазнавала значних втрат в силу високої залежності від кон'юнктури окремих товарних ринків. Руйнівні наслідки кризи платіжного балансу українці могли відчутися не так давно, у 2015 році наша держава знаходилась на межі фактичного дефолту.

Моделювання кризових процесів та можливості їх передбачення залишається актуальним питанням. Лише в другій половині XX століття, коли після поглиблення торгівельних зв'язків наслідки кризи стали вражати країни, що розвиваються, у наукових колах сформувався значний інтерес до даної проблематики. Згодом почали з'являтися системи раннього попередження криз, які дозволили оцінити вірогідність виникнення кризи впродовж найближчого періоду. Для України питання створення адекватної моделі попередження кризи платіжного балансу залишається відкритим та надзвичайно актуальним.

**Мета і завдання дослідження.** Метою наукової роботи є створення економіко-математичної моделі для прогнозування кризи платіжного балансу.

Для досягнення цієї мети було поставлено та вирішено наступні завдання:

- визначити ознаки кризи платіжного балансу та фактори, що є каталізаторами до її появи в Україні та в світі загалом;
- застосувати сигнальний підхід та ряд економетричних моделей і методів інтелектуального аналізу даних для створення системи раннього попередження.

**Об'єктом** дослідження виступає сукупність економічних процесів, що призводять до виникнення кризи платіжного балансу. **Предметом** дослідження є система раннього попередження криз платіжного балансу на основі економіко-математичних моделей та сигнального підходу.

**Методи дослідження.** Для вирішення поставлених завдань застосовувались такі загальнонаукові методи, як історичний, структурний, системний, що дозволило з'ясувати сутність кризи платіжного балансу. На базі графічного аналізу були

ідентифіковані фактори впливу на утворення дисбалансів, а на основі методів економетричного моделювання та інтелектуального аналізу даних проведено прогнозування індексу валютного тиску та ймовірності настання кризи у відповідний момент часу. За допомоги сигнального підходу визначено набір індикаторів, що сигналізують про нестабільність у майбутньому.

**Практичне значення одержаних результатів** полягає у створенні динамічної системи раннього попередження кризи платіжного балансу за допомоги сигнального підходу та багатокритеріальної оптимізаційної моделі, що була розроблена у вигляді інформаційної системи та комбінації методів інтелектуального аналізу даних.

Наукова робота складається з 3 розділів, 30 сторінок, 6 рисунків, 5 таблиць, 16 додатків та 36 літературних джерел.

Ключові слова: криза платіжного балансу, сигнальний підхід, індекс валютного тиску, обмінний курс, міжнародні резерви, система раннього попередження.