

УКООПСІЛКА
ЛЬВІВСЬКА КОМЕРЦІЙНА АКАДЕМІЯ



**МЕТОДОЛОГІЧНІ ОСНОВИ ПРОГНОЗУВАННЯ
РИНКОВОЇ КОН'ЮНКТУРИ**

ТЕКСТ ЛЕКЦІЇ З КУРСУ “КОН'ЮНКТУРА РИНКІВ”

для самостійного вивчення студентами економічних
спеціальностей

ЛЬВІВ
Видавництво Львівської комерційної академії
2004

УКООПСПЛКА
ЛЬВІВСЬКА КОМЕРЦІЙНА АКАДЕМІЯ

МЕТОДОЛОГІЧНІ ОСНОВИ ПРОГНОЗУВАННЯ
РИНКОВОЇ КОН'ЮНКТУРИ

ТЕКСТ ЛЕКЦІЇ З КУРСУ “КОН'ЮНКТУРА РИНКІВ”

для самостійного вивчення студентами

економічних спеціальностей

ЛЬВІВ

Видавництво Львівської комерційної академії

2004

Уклала: к.е.н., доц. Іванова Л.О.

Рецензенти: ст. викл. Федорчук А.І.,
ас. Орел Л.М.

Відповідальний за випуск: д.е.н., проф. Дайновський Ю.А.

Рекомендовано до друку кафедрою маркетингу

Протокол №4 від 25.11.2003р.

© Іванова Л.О.,

2004

1. ПОНЯТТЯ ПРОГНОЗУ. ВИМОГИ ДО ПРОГНОЗУ РИНКОВОЇ КОН'ЮНКТУРИ

Вивчення загальногосподарської кон'юнктури або кон'юнктури окремого товарного ринку необхідно для того, щоб правильно зробити прогноз, передбачити зміни.

Прогноз у перекладі з грецької мови означає “вперед”, “впізнання”.

У широкому розумінні прогноз - це науково обгрунтоване судження про можливі стани об'єкту в майбутньому і/або про альтернативні шляхи і строки їх досягнення.

Поняття прогнозу необхідно відрізнити від прогнозування.

Прогнозування - це процес формування ймовірних суджень про стан об'єкту в майбутньому.

В прогнозуванні виділяють поняття “об'єкт” і “прогнозний фон”.

До об'єкту *прогнозування* відносяться процеси, явища, події на які спрямована пізнавальна і практична діяльність людини.

Прогнозним фоном називається сукупність зовнішніх стосовно об'єкту умов, суттєвих для обгрунтованості прогнозу.

Можливість прогнозу спирається на пізнання об'єктивних законів дійсності. Можливості прогнозування соціально-економічних процесів, до яких відносяться загальногосподарська і товарно-галузева кон'юнктура визначаються, перш за все, *характером природи причинно-наслідкових зв'язків*. Одиначні події не можуть бути предметом прогнозу. Передбачати, прогнозувати можна лише загальні властивості і закономірності процесів, що відображають стійкі причинно-наслідкові зв'язки.

Принципова можливість складання прогнозу економічної кон'юнктури визначається наявністю прямої наступності в часі розвитку економічних явищ.

У суспільному явищі завжди є залишки минулого, основи теперішнього і зачатки майбутнього. Завдання прогнозиста якраз і полягає у тому, щоб на фоні сучасного з урахуванням минулого знайти елементи заро-

джуваного майбутнього і, досліджуючи загальні тенденції, дати найбільш імовірну картину розвитку цього явища на перспективу.

Мета або призначення прогнозу полягає у визначенні ймовірних альтернатив економічного розвитку та їх соціально-економічних наслідків для прийняття найраціональніших рішень.

Прогноз завжди є передплановою стратегією роботи і, більше того, основою одного з варіантів маркетингової програми і плану маркетингу, оскільки мета прогнозу - дати найімовірніші альтернативні шляхи розвитку досліджуваної події з широкою гамою можливих станів при заданому рівні знань і закладених в прогноз передумов.

Прийняття рішення у зв'язку з цим є обгрунтованим вибором одного із найімовірніших варіантів прогнозу.

Цілком очевидно, що не може бути протиставлення плану прогнозу. Прогнозування - невід'ємний науково-аналітичний етап, що передує плануванню, прийняттю обгрунтованого рішення. Відмова від прийняття рішення на основі розроблених прогнозів також є рішенням. При цьому прогнозування повинно носити не епізодичний, а постійний характер.

Стосовно кон'юнктури товарного ринку можна дати наступне визначення.

Прогноз товарного ринку - це об'єктивне, науково обгрунтоване, імовірне за своєю природою судження про динаміку найважливіших характеристик товарного ринку та їх альтернативних варіантів з метою вироблення певних маркетингових рекомендацій для ефективної діяльності фірми на ринку.

Прогноз товарного ринку повинен відповідати вимогам:

1. Надійність, наукова обгрунтованість, системність з урахуванням факторів, які можуть впливати в перспективі. Системність у прогнозуванні ринкової кон'юнктури - це вимога взаємопов'язаності об'єкта і елементів прогнозування. Тобто, системність - це максимально можливе врахування взаємозв'язку кон'юнктуруотворювальних факторів.

2. Відтворюваність і доказовість, тобто отримання того ж результату при повторній розробці прогнозу, в тому числі на основі інших методів.
3. Варіантність - означає вимогу розробки варіантів прогнозів. Інакше кажучи, прогноз має мати альтернативний характер з чітким формулюванням всіх гіпотез і передумов, покладених в його основу.
4. Верифікація - це вимога і потреба у достовірності, точності і обґрунтованості прогнозу. Тобто верифікація прогнозу - це наявність надійної методики оцінки достовірності і точності прогнозу, виключаючи суб'єктивність, з метою здійснення його корегування.
5. Коректна і чітка мова формулювань, зрозуміла для осіб, що безпосередньо приймають рішення, яка не дає приводу для суперечливих тлумачень.
6. Плановий характер прогнозу. Прогноз повинен бути своєчасним і слугувати цілям прийняття підприємницьких рішень.
7. Ефективність прогнозування - визначає необхідність перевищення економічного ефекту від використання прогнозу над витратами з його розробки.

2. ТИПОЛОГІЯ ПРОГНОЗІВ КОН'ЮНКТУРИ

Існують різні підходи до типології кон'юнктурних прогнозів.

Для прогнозування загальногосподарської і товарно-галузевої кон'юнктури найбільш зручною на практиці є класифікація прогнозів, що базується на урахуванні наступних критеріїв:

1. Предмет прогнозування.
2. Масштабність об'єкта прогнозування.
3. Період або глибина прогнозування (критерій часу).
4. Функціональна ознака (проблемно-цільовий критерій).
5. Критерій складності прогнозу.
6. Ступінь детермінованості об'єкта.
7. Критерій кількісної оцінки.

1. **Предмет прогнозування** визначається на першому етапі роботи прогнозу відповідно до мети і завдань прогнозу.

Прогнози загальногосподарської кон'юнктури класифікуються за галузями і регіонами, прогнози товарної кон'юнктури - за видами товарів і товарних груп, а також за типами прогнозних показників:

- імпорт чи експорт товару,
- його виробництво чи споживання,
- прогноз ціни того чи іншого товару (представляє найбільший практичний інтерес).

2. **Масштабність об'єкта прогнозування.** У залежності від охоплення об'єктів дослідження прогноз може бути глобальним, регіональним, локальним. Інакше кажучи, він може охоплювати весь ринок країни або обмежуватися ринком визначеного регіону або локального ринку окремої фірми. Він може охоплювати ринкову ситуацію в цілому або ж його предметом буде ринок окремого товару.

3. **Період або глибина прогнозування** (критерій часу, горизонт прогнозування). За критерієм часу виділяють такі прогнози ринкової кон'юнктури: оперативні, короткострокові, середньострокові, довгострокові, далекострочкові. Оперативний прогноз складається на період до 1 місяця; короткостроковий - від 2 місяців до 1 року; середньостроковий - від 1 року до 5 років; довгостроковий - від 5 років до 15 років, далекострочковий - на період понад 15 років.

4. **Функціональна ознака (проблемно-цільовий критерій).**

Цей критерій дає відповідь на запитання: "Для чого розробляється прогноз?"

3 точки зору практичної спрямованості прогнозування здійснюють поділ прогнозів за функціональною ознакою на:

4.1. Дослідницько-пошукові (пошукові).

4.2. Нормативні.

Пошуковий прогноз (дослідницький, генетичний, трендовий) - це прогноз подальшого розвитку ринку, у першу чергу попиту і пропозиції.

Він дає відповідь на запитання, що найімовірніше відбудеться за умови збереження чинних тенденцій. Основним методом прогнозування є екстраполяція. Результати такого прогнозу наперед не ув'язуються з конкретними цілями їх використання (прогноз народжуваності, прогноз шлюбів і розлучень в суспільстві, урожайність сільськогосподарських культур, технічний прогрес в галузі).

Нормативний (практичний, цільовий) прогноз виконується з метою визначення шляхів і термінів досягнення можливих станів кон'юнктурних індикаторів ринку в майбутньому. Наприклад, прогноз динаміки споживання м'ясопродуктів населенням регіону при визначених фізіологічних нормах.

Основним методом прогнозування є інтерполяція (спосіб розрахунку показників, яких не вистачає у динамічному ряді явища на основі встановленого взаємозв'язку).

Нормативні прогнози - це виявлення можливих шляхів досягнення мети і наслідків прийнятих рішень.

5. За критерієм склади ості розрізняють прогнози:

- 5.1. Простий.
- 5.2. Складний.
- 5.3. Надскладний.

Ці прогнози різняться наявністю взаємозалежних перемінних у їхньому описі: у простому прогнозі відсутні істотні взаємозв'язки, у надскладному прогнозі - взаємозв'язки тісні (із коефіцієнтом кореляції близьким до 1).

6. За ступенем детермінованості об'єкта прогнози можуть бути:

- 6.1. Детерміновані, тобто без істотних втрат інформації в описі умов.
- 6.2. Стохастичними, у яких потрібне урахування випадкових величин.
- 6.3. Змішаними, що включають характеристики двох вище зазначених прогнозів.

7. За критерієм кількісної оцінки розрізняють прогнози:

7.1. Інтервальні.

7.2. Точкові.

Інтервальний прогноз подається результатом у вигляді довірчого інтервалу.

Точковий - представляється результатом у вигляді єдиного значення характеристики об'єкта в майбутньому.

Точність прогнозу залежить від:

1. Надійності і повноти інформації про ринкові процеси і чинники, що визначають їхній рівень і розвиток;
2. Ступеня усталеності ринку й економіки (чим менше стійкий ринок, тим менша ступінь надійності прогнозу);
3. Правильності вибору виду моделі (методу прогнозування);
4. Технічної озброєності прогнозу (тип ЕОМ, якість програм, алгоритмів тощо).

3. ОРГАНІЗАЦІЯ РОЗРОБКИ ПРОГНОЗІВ КОН'ЮНКТУРИ. МЕТОДИ ПРОГНОЗУВАННЯ

Мета прогнозу як найважливішого етапу дослідження кон'юнктури полягає у визначенні найімовірніших оцінок стану кон'юнктури у майбутньому.

Основним завданням прогнозу є визначення тенденцій розвитку чинників, що впливатимуть на ринок протягом визначеного проміжку часу у майбутньому.

Прогноз кон'юнктури є імовірним результатом і здійснюється у такій послідовності:

1. Вибір горизонту прогнозування.
2. Визначення параметрів прогнозування.
3. Вибір методів прогнозування.
4. Проведення розрахунків прогнозних параметрів.
5. Інтерпретація прогнозу.

Горизонт прогнозування передбачає різні часові відрізки. Вибір терміну прогнозу є одним з найважливіших етапів прогнозування. *ГОРИЗОНТ ПРОГНОЗУВАННЯ* - це термін, на який складається прогноз. Триваліші кон'юнктурні прогнози вважаються малоімовірними через швидку змінюваність ринку. Тому періодизація кон'юнктурних прогнозів докорінно відрізняється від узвичасної для прогнозування інших видів. Специфіка розробки кон'юнктурних прогнозів полягає в тому, що їх термін не може перевищувати 1,5 року.

Після того, як період прогнозування вибрано, настає етап визначення параметрів прогнозування. На цьому етапі встановлюються оцінюваний сегмент ринку і показники кон'юнктури. Для короткострокових і середньострокових прогнозів як основні показники оцінки кон'юнктури використовуються рівні і дані динаміки кон'юнктури ринку. Саме тому основними методами короткострокового і середньострокового прогнозування є економіко-статистичні методи прогнозування.

Економічне прогнозування ґрунтується на таких основних припущеннях:

- якщо система перебуває у стані рівноваги, то її поведінка підпорядковується внутрішнім законам розвитку;
- якщо система вийшла зі стану рівноваги, то прогнозування її поведінки залежить від стану зовнішніх чинників. Для економіки - це плин соціально-економічних процесів та урахування того, що економічні закони інертні за своєю сутністю.

У прогнозуванні кон'юнктури товарного ринку та загальногосподарської кон'юнктури велике значення має обраний метод.

Сукупність спеціальних правил, прийомів і методів складає методику прогнозування.

У сучасній науці в даний час використовується понад 100 методів і прийомів прогнозування, що відрізняються за своїм інструментарієм, сферою застосування і науковою обґрунтованістю. Завдання прогнозиста вибрати такий метод, який би найбільше відповідав завданням і принципам прогнозування з даного явища (об'єкта).

У практиці повсякденної кон'юнктурної роботи використовуються такі методи:

1. Екстраполяція.
2. Нормативні розрахунки, в тому числі, інтерполяція.
3. Метод експертних оцінок (переважно для довгострокових прогнозів).
 - 3.1. Індивідуальна експертна оцінка.
 - 3.2. Колективна експертна оцінка.
 - 3.3. Метод психінтелектуальної генерації ідей.
 - 3.4. Аналітичний метод.
 - 3.5. Метод інтерв'ю.
 - 3.6. Метод експертних комісій.
 - 3.7. Дельфійський метод.
 - 3.8. Метод колективної генерації ідей (метод “мозкового штурму”).
4. Метод аналогії.
 - 4.1. Метод історичної аналогії.
 - 4.2. Метод математичної аналогії.
5. Економіко-математичне моделювання (передбачає створення моделей взаємодії різноманітних чинників, що визначають ринкову кон'юнктуру).

Наведений розподіл методів прогнозування досить умовний, оскільки вони можуть взаємодоповнюватись і переплітатись. Так, моделювання може використовувати гіпотезу екстраполяції, а значення деяких кон'юнктуруювальних факторів встановлюється експертним шляхом.

1. *Екстраполяція* - це перенесення явищ, характерних для ринку в минулому у відносних показниках (темпи росту) на прогнозний період.

Перевага — його простота, недолік - обмежена достовірність і пов'язана з цим можливість використання. Цей метод може застосовуватись лише тоді, коли є впевненість що досліджуване явище протягом прогнозного періоду буде знаходитись під впливом тих же факторів, що і в попередньому періоді, а характер впливу цих факторів не зазнає істотних змін, що забезпечить збереження попередньо встановлених тенденцій.

На практиці використання методів екстраполяції (лінійної, криволінійної екстраполяції з корегуванням минулих трендів) у чистому вигляді неможливе, бо ситуація на товарних ринках піддана впливу багатьох факторів, і постійно змінюється. При розробці прогнозу необхідно відслідковувати і групувати фактори, характерні для даного ринку і нетипові фактори, які мають тимчасовий або випадковий характер.

2. *Нормативний метод* прогнозування частіше застосовується для програмних і цільових прогнозів. Використовуються як кількісне вираження, так і певна шкала можливостей оціночної функції. Цей метод підходить як для ринку засобів виробництва (де велику роль відіграють виробничо-технічні нормативні та інші детермінанти), так і для споживчого ринку.

У випадку використання кількісного вираження, наприклад фізіологічних і раціональних норм споживання окремих продовольчих і споживчих товарів, розроблених спеціалістами для різноманітних груп населення, можна визначити рівень споживання цих товарів на роки, що передують досягненню зазначеної норми.

3. Одними з основоположних при розробці економічних прогнозів (в тому числі і кон'юнктурних) є *методи експертних оцінок*, які використовуються як самостійно, так і у поєднанні з іншими методами.

Методи експертних оцінок припускають різноманітний вірогідний розвиток системи і ґрунтуються на використанні досвіду, знань та інтуїції висококваліфікованих спеціалістів (експертів), що займаються вивченням і прогнозуванням того або іншого явища. Основна відмінна риса цих методів полягає в тому, що оцінка ймовірного значення кон'юнктурних показників подається у вигляді суджень і думок експертів. Зібрані думки аналізуються, сумуються і в результаті відпрацьовується варіант прогнозу. У сучасній практиці прогнозування використовуються різновидності як індивідуальних, так і колективних експертних оцінок.

До методів колективних експертних оцінок відноситься *метод Лельфі*. Базується на письмовому опитуванні широкого кола експертів в декілька турів. При цьому на думку кожного експерта не впливають думки

інших. У процесі обробки отриманої інформації через коефіцієнти, враховується компетентність думки кожного спеціаліста-експерта. В даний час цей метод отримав визнання і вважається найкваліфікованішим методом прогнозування на основі експертних оцінок.

Одним з різновидів експертних оцінок є метод “**МОЗКОВОГО ШТУРМУ**”. На відміну від анкетних опитувань за методом Дельфі, при “мозковому штурмі” експерти (широке коло спеціалістів даної галузі і суміжних галузей знань) роблять свої висновки в ході засідання, що значно спрощує процедуру експертизи. Кожен експерт розглядає проблеми під різними кутами зору. При цьому всі присутні на засіданні діляться на дві групи: перша генератори ідей і оцінок; друга - аналітики. При оперативному варіанті експертні оцінки можна проводити у формі кон’юнктурних нарад.

Основною проблемою експертних методів є оцінка компетентності і узгодженості думок експертів. З позиції математичної логіки оцінка компетентності експертів встановлюється за формулою:

$$\bar{X}_j = \frac{\sum_{i=1}^m E_{ij} \cdot K_i}{\sum_{i=1}^m K_i}$$

Де \bar{X}_j - оцінка компетентності експертів, середнє значення відповіді;

x_i - оцінка і-м експертом відносної важливості рго елемента балів;

$i \approx 1, \dots, m$ - номери експертів, t - число експертів;

$I = 1, \dots, n$ - номери досліджуваних елементів;

K_i - коефіцієнт компетентності і-го експерта.

Цей коефіцієнт враховує ступінь обізнаності з обговорюваним питанням (K_3) і аргументованість відповіді (K_a), і розраховується за формулою:

$$\hat{K}_i = \frac{K_3 + K_a}{2}$$

де K_i - коефіцієнт компетентності і-го експерта;

K_3 - коефіцієнт обізнаності експерта;

K_a - коефіцієнт аргументованості відповіді експерта

Середнє значення відповіді варіює між 1 і 100 балами:

$$1 > \bar{X}_i < 100.$$

Чим більше \bar{X}_i більша важливість i -го елемента.

Узгодженість думок експертів можна оцінити за допомогою коефіцієнта конкордації Кендела:

$$W = \frac{128}{T^2(n^3 - n)},$$

де W - коефіцієнт конкордації;

n - кількість експертів;

m - число оцінюваних чинників

$$S = \sum_{i=1}^n \left\{ \sum_{j=1}^m X_{ij} - \frac{1}{2} m(n-1) \right\}^2,$$

де X_{ij} - формально-числова оцінка i -го чинника j -м експертом.

4. *Метод аналогії* передбачає перенесення знань про один предмет (явище) на інший. Тут у якості прогнозу розглядаються сприятливі показники ринкової ситуації в якому-небудь регіоні або країні.

5. *Економіко-математичне моделювання* є найскладнішим методом прогнозування. На основі групи показників розробляються економіко-математичні моделі, що виражають функціональну залежність між кон'юнктурними показниками того чи іншого товарного ринку. Використовуються різноманітні типи моделей, що найбільше відповідають характеру і закономірностям розвитку даного ринку. Позаяк на розвиток кон'юнктури товарного ринку впливає багато факторів, які не вможливити включити жодна модель, то дуже важливо відібрати такі кон'юнктурні показники, які б відображали вплив на даний ринок найважливіших факторів стосовно не лише минулого і сучасного, але і майбутнього.

Побудувавши модель, можна обдумувати альтернативні варіанти прогнозу і обирати оптимальні.

Використання математичних моделей для прогнозування того чи іншого кон'юнктурного показника, як правило, не виключає необхідності проведення додаткової експертизи.

6. **Механістичне прогнозування** - чартизм - використовується для короткочасного прогнозу.

При графічному аналізі динаміки окремих економічних показників виявляються схожі моменти у їх поведінці з метою наступного прогнозування змін. При цьому застосовуються різні чисто технічні прийоми (чартизм - технічний аналіз), що дозволяє отримати більш наглядне представлення про зміни поведінки показників у часі.

В основі чартизму лежить використання представлення про те, що одні і ті ж дані про розвиток товарних ринків можуть інтерпретуватися по-різному і відповідно надавати різний вплив на динаміку цін.

Даний метод знаходить застосування при прогнозуванні котувань товарних і фондових бірж.

Прихильники чартизму ігнорують якісний аналіз товарної кон'юнктури, вони повністю базують свої заключення на вивченні графіків біржових цін, бо вважають, що ціна акумулює в собі прояв всіх основних факторів, що діють на ринку. Прихильники чартизму стверджують, що достовірний прогноз може бути отриманий на основі лише ретельного дослідження графіків попередньої поведінки ціни.

Аналіз практики використання чартизму показує, що визначальним фактором його ефективності є досвід і кваліфікація самого прогнозіста.

На заключному етапі прогнозування здійснюється інтерпретація і оцінка достовірності прогнозу, складеного на основі того чи іншого методу або їх поєднання. Чим більший термін прогнозування, тим менша достовірність прогнозу. Інтерпретація прогнозу полягає в оцінці тенденцій зміни кон'юнктури ринку на основі розрахункових показників.

Важливим моментом прогнозування є перевірка надійності і точності прогнозу.

Найчастіше для цього використовують такий показник, як коефіцієнт якості прогнозу:

h

к-їтт?

де К - коефіцієнт якості прогнозу;

Ь - кількість прогнозів, що справдилися;

ч - кількість прогнозів, що не справдилися.

ЛІТЕРАТУРА

1. Владимирова К.П. Прогнозирование и планирование в условиях рынка. М : Изд-во "Дашков и К⁰", 2001 - 308с.
2. Демидов В.И. Комплексный анализ и прогнозирование товарных рынков. - М.: Международные отношения, 1991. - 197с.
3. Методические рекомендации по анализу и прогнозированию товарных рынков. - М.: Новый век, 2001 - 96с.
4. Поляков В.В. Прогнозирование мирового товарного рынка. - М.: Экзамен, 2002. - 288с.
5. Ноздрева Р.Б., Цыгичко Л.И. Маркетинг: как побеждать на рынке. - М.: Финансы и статистика, 1991. - 304с.
6. Мухопад В.И., Ахматова М.Р., Булатова В.А. Основы изучения отраслевой конъюнктуры. - М.: НПО "Поиск", 1992. - 182с.

7. Кузнецов В.Р., Карпов В.А. Основи економічної кон'юнктури Кавказького регіону. Центральноукраїнський економічний університет, ІТЧс.

8. Мошин Ю.Н., Мошин А.Ю. Анализ конъюнктуры потребительского рынка. Бяисе ^сбие. -Аг; Ж. Изд. УРАО, 2001-196

9. Ашенико Г.Г.) Назедник /у 'ТУхл'ихр^у/ на ді... Навказький регіон. - Ірмінь, Укр. ділянка ДПС України, 2003. - 92с.

10. Буров А.С. Кон'юнктура... *100Б-160с.

11. Светушков С.Г. Основи економічної кон'юнктури: теорія та практика. - Київ, Видавництво "Либерецький національний університет", 1996. - 88с.

12. Светушков С.Г. Прогнозування економічної кон'юнктури в Україні. - Київ, Видавництво "Либерецький національний університет", 1996. - 106с.

13. & ...

14. Коба ...

