

**МІНІСТЕРСТВО ОСВІТИ І НАУКИ УКРАЇНИ
ОДЕСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ЕКОНОМІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ**

Кафедра економіки, права та управління бізнесом

**РЕФЕРАТ
кваліфікаційної роботи
на здобуття освітнього ступеня магістра**

зі спеціальності 076 «Підприємництво, торгівля та біржова діяльність»
за магістерською програмою професійного спрямування
«Економіка, планування та управління бізнесом»

на тему: «ДОСЛІДЖЕННЯ ТА ПРОГНОЗУВАННЯ КОН'ЮНКТУРИ РИНКУ (НА
ПРИКЛАДІ РИНКУ МЕТАЛОПРОКАТУ УКРАЇНИ)»

Виконавець:

студент 66 групи ФЕУП
Лозінський Ростислав Станіславович

Науковий керівник:

к.е.н., доцент
Янковий Володимир Олександрович

ЗАГАЛЬНА ХАРАКТЕРИСТИКА РОБОТИ

Актуальність дослідження. У даний час український ринок металопрокату знаходиться у складнішому становищі ніж це було декілька років назад. Існує декілька причин чому ємність ринку металопрокату в Україні в 2018 році падає, чому імпорт металопрокату вітчизняних підприємств та країни в цілому зростає. Одна із головних причин цьому досить наявна: окупація великих центрів накопичення підприємств, які виробляють металопрокат та ускладнення або навіть неможливість їх функціонування. Також можна назвати превалювання екстенсивного росту виробництва над інтенсивним, що сильно знижує конкурентоспроможність вітчизняних підприємств на міжнародному ринку металопрокату. Усе це замикається інвестиційною непривабливістю, або її повільною стагнацією в Україні та страх потенційних інвесторів щодо здійснення тих необхідних вкладень у металургію, які б надали «друге дихання» цій галузі та економіці в цілому, оскільки металопрокат та металургія як галузь займає досить вагоме місце в економіці України. Тому труднощі, з якими стикаються підприємства показують, що рішення які приймаються на основі минулого досвіду або навіть інтуїції керівників не можуть повною мірою та своєчасно бути якісними управлінськими рішеннями в умовах сучасності ринку, який зараз можна характеризувати як нестабільний, невизначений та схильний до випадковості. Тому в таких умовах постає необхідність прийняття таких управлінських рішень, які б дали змогу мінімізувати ризики, притаманні галузі та максимізувати потенційний дохід підприємству та як наслідок економіці країни. Інструментом, що може знизити негативний вплив вищезазначених факторів, є оцінювання та прогнозування кон'юнктури ринку, які дають змогу певною мірою об'єктивно отримати інформацію про ті фактори, які більше впливають на певні показники (як правило прибуток) та, що дуже важливо, виявити резерви, які підприємство зможе використовувати для збільшення прибутку та зменшення затрат або оптимізації інших елементів своєї діяльності. Правильна оцінка ситуації на ринку дає змогу спрогнозувати його напруження, отримати конкурентні переваги і тим самим знизити ряд ризиків, знайти нові сегменти ринку та встановити ціни на оптимальному рівні. Тому дослідження ринку є невід'ємною складовою успішного прийняття управлінських рішень на підприємствах, що працюють в умовах ринку.

Теоретичні і практичні аспекти вивчення та прогнозування економічної кон'юнктури – як загальногосподарської, так і кон'юнктури окремих товарних ринків – знайшли своє відображення у наукових працях зарубіжних учених-економістів, таких як Первушина С.А., Громана В.А., Бунятяна М., Бодрова В.Г., Білявського І., Обеленцева Л.В., Карпова В.В., Кондратьєва М.Д., Шульце-Деліч Ф., Кучеренка В.Р., та інших.

Метою дослідження є дослідження теоретичних та методологічних підходів до вивчення та прогнозування кон'юнктури ринку металопрокату в Україні, визначення основних тенденцій його розвитку та запропонування нового підходу до аналізу та прогнозування ринку металопрокату.

Досягнення поставленої мети обумовило необхідність вирішення таких **завдань**:

- визначити сутність та особливості кон'юнктурних досліджень;
- охарактеризувати методологічні підходи дослідження та визначити види кон'юнктури ринку;
- розглянути економіко-математичні моделі аналізу та прогнозування ринкової кон'юнктури;
- провести аналіз сучасного стану розвитку ринку металопрокату в Україні;
- дослідити стан світового ринку металопрокату;
- дослідити основні проблеми зміцнення позицій України на світовому ринку металопрокату та шляхи їх вирішення;
- провести прогнозування кон'юнктури ринку металопрокату методом балансу змінних;
- спрогнозувати стан ринку металопрокату України за допомогою виробничої функції Кобба-Дугласа-Тінбергена.

Об'єктом дослідження є процес функціонування ринку металопрокату в Україні.

Предметом дослідження є вивчення теоретичних та методологічних аспектів дослідження та прогнозування кон'юнктури ринку

Методи дослідження. Для вирішення поставлених завдань в роботі використовуються теоретичні методи, а саме: метод аналізу та синтезу (дослідження стану українського ринку металопрокату), індукції та дедукції, абстракції та формальної логіки (для визначення і уточнення економічної сутті понятійного апарату), методи узагальнення, систематизації, спостереження, порівняння та групування (для опрацювання статистичних даних про масштаби виробництва, потенціалу), метод кластерного аналізу (для побудови кластерної моделі), кореляційно-регресійний аналіз, адаптивні методи прогнозування (для побудови кореляційно-регресійної моделі та виявлення впливу факторів на результативний признак, а також для прогнозування розвитку ринку металопрокату), а також за допомогою програмного забезпечення Statistica 10.

Інформаційною базою дослідження стали вітчизняні та зарубіжні публікації і монографічні видання, відображені в них результати теоретичних і методичних розробок; матеріали Державної служби статистики України, Укрметалургпрома та інших державних інституцій; закони і нормативні матеріали, що регламентують функціонування ринку металопрокату в Україні; результати наукових досліджень, проведених провідними інститутами України, а також безпосередньо автором.

Структура та обсяг роботи. Кваліфікаційна робота магістра складається зі вступу, трьох розділів, висновків, списку використаних джерел (60 найменувань). Загальний обсяг роботи становить 76 сторінок. Основний зміст викладено на 67 сторінці. Робота містить 19 таблиць, 11 рисунків.

Публікації. За матеріалами дослідження було опубліковано статтю «Особливості експортного потенціалу металургійного комплексу України у рамках світової економіки» у науковому студентському віснику ФЕУП №29 та статтю

«Прогнозування ринку металургійної продукції України на базі виробничої функції» у науковому віснику Одеського національного економічного університету №5(257).

ОСНОВНИЙ ЗМІСТ РОБОТИ

У першому розділі «**Теоретичні аспекти дослідження та прогнозування кон'юнктури ринку Сировинних товарів**» розглянуто сутність та особливості кон'юнктурних досліджень; методичні підходи щодо дослідження кон'юнктури ринку; економіко-математичні моделі у прогнозуванні ринкової кон'юнктури.

У другому розділі «**Дослідження кон'юнктури ринку металопрокату в Україні**» надано загальну оцінку стану ринку металопрокату України; виявлено світові тенденції розвитку ринку металопрокату України; визначено основні проблеми зміцнення позицій ринку металопрокату України у світовому середовищі.

У третьому розділі «**Прогнозування кон'юнктури ринку металопрокату в Україні**» здійснено прогнозування стану ринку металопрокату України двома методами та розраховано похибку між ними.

ВИСНОВКИ

У кваліфікаційній роботі надано методичні засади та практичні рекомендації, спрямовані на підвищення розвитку кон'юнктури ринку інформаційно-комунікаційних технологій в умовах глобальної інформатизації суспільства. Проведене дослідження ринку на фоні галузі металопрокату дозволило зробити наступні висновки теоретичного і науково-практичного характеру:

1. Визначено наукові теоретичні засади категорій «кон'юнктура ринку» та «металопрокат». На основі вивчення різних підходів до визначення «кон'юнктура ринку» та її дефініцій було запропоновано дещо інший термін цього явища. Отже, кон'юнктура ринку – це процес дослідження сукупності економічних та неекономічних факторів, системи взаємопов'язаних обставин, що створилися у певний момент часу та які виражаються у співвідношенні попиту, пропозиції та рівноважною ціною, а також суб'єктами, які ведуть діяльність та конкурують між собою на цьому ринку.

2. Подано науково-методичні підходи і методи дослідження, які використовуються в залежності від обраної кон'юнктури ринку для дослідження: загальногосподарська кон'юнктура, кон'юнктура товарного ринку; кон'юнктура світового товарного ринку, проста кон'юнктура диференційована кон'юнктура; знижувальна кон'юнктура, низька (в'яла) кон'юнктура, підвищувальна кон'юнктура, висока (стабільна) кон'юнктура; рівноважна кон'юнктура, стійка кон'юнктура тощо.

3. Враховуючи позитивні та негативні сторони різноманітних математичних, статистичних методів, для оцінювання розвитку ринку металопрокату в Україні в рамках існуючих моделей та наявності необхідних даних було обрано виробничу функцію Кобба-Дугласа-Тінбергена та метод балансу змінних для дослідження, котрі, якнайкраще аналізують стан ринку який склався на момент, та дають змогу прогнозувати його розвитку на майбутній період.

4. Досліджено діяльність та рівень розвитку основних компаній галузі металопрокату України як найбільшого сектора промисловості. Ринок металопрокату України представлений досить великою кількістю заводів, але по факту вони належать декільком корпораціям. Але, аналіз внутрішнього ринку також показав, що з 2014 року промисловість нашої держави увійшла в глибоку кризу. Сьогодні металургійний ринок в Україні переживає складний період. Відновлення світової економіки проходить повільно, а обтяжуючими ситуацію факторами для багатьох регіонів нашої країни стають геополітичні конфлікти, низька ціна на нафту, слабка інвестиційна активність.

5. Проведений аналіз світового ринку показав, що на світовому ринку металів на сучасному етапі є такі тенденції:

- низкою країн сталеплавильний комплекс розглядається як складова оборонного потенціалу;
- незважаючи на появу і широку популярність конкуруючих конструкційних матеріалів, чорний метал залишається на першому місці;
- за останні 20-30 років помічено прагнення деяких високорозвинених країн позбутися металургійного виробництва;

Досліджений стан світового ринку металургійної продукції показав, що світовим лідером з виробництва металургійної продукції є Азія, а саме Китай, так, станом на кінець 2017 року виробництво металургійної продукції в Китаї склало 831,7 млн. т.

Лідуючі позиції з обсягу експорту займають практично ті самі країни, що і виробляють більше всього металопрокату, а саме: Китай із величиною експорту в 74,8 млн. т., Японія, яка експортує 37,5 млн. т., а двадцятку найбільших країн-експортерів закриває Іран із обсягом експорту в 7,5 млн. т.

6. Дослідження проблем на ринку металопрокату показало, що поточні можливості внутрішнього ринку металопродукції оцінюються експертами максимально в 10–11 млн т, що майже втричі менше порівняно з обсягами її експорту. Низький попит на внутрішньому ринку пояснюється тим, що протягом останніх років відбулося падіння виробництва у галузях економіки, що формують основний попит на металопродукцію. Зважаючи на те, що металургійна промисловість залишається базовою галуззю для економіки України, її модернізація та усунення структурних деформацій є важливими передумовами забезпечення економічної безпеки держави та забезпечення економічного зростання.

Для того щоб зберегти і примножити своє становище на ринку, запропоновано врахувати заходи та технології, які лягають в основу конкурентних переваг на даному ринку, а саме досвід зарубіжних країн:

- використання нових методів виплавки;
- збільшення потужностей підприємств, розташованих ближче до моря;
- створення міні- і міди-заводів. Під впливом зміни світового попиту і ефективності використання окремих видів ресурсів металургія повного циклу поступово поступається позиції підприємствам малої металургии;
- зростання попиту на певні марки сталі;

- роль держави в розвитку галузі. Як показує практика останнього десятиліття, в уряду країни немає певного бачення розвитку металургійної галузі України.

7. Запропоновано аналіз та прогнозування обсягу виробництва металопрокату в Україні на 2019 рік за допомогою методу балансу змінних. В результаті отримано наступне балансове рівняння з трьома змінними: Виробництво = Споживання + Експортно-імпортне сальдо. У виразі змінна «Виробництво» включає наступні елементи: Виробництво, Зміна запасів; змінна «Споживання» – оскільки даних щодо споживання металопрокату з офіційних ресурсів немає, розрахуємо об'єм споживання за допомогою даного рівняння, тобто як різницю між виробництвом та експортно-імпортним сальдо; змінна «Експортно-імпортне сальдо» відповідає виразу Експорт – Імпорт. Прогнозні значення агрегованих змінних «Виробництво», «Споживання» та «Експортно-імпортне сальдо» отриманого варіанту від комбінаторики за допомогою ступеневих функцій (виробництво та експортно-імпортне сальдо) та поліному (споживання). Прогнозування показників за балансовим методом показало, що агрегované виробництво металопрокату в Україні в 2019 році складе 31,6 млн. т, споживання буде на рівні 19,22 млн. т, а експортно-імпортне сальдо буде позитивним, при чому експорт переважатиме імпорт на 12,41 млн. т. Найбільш точно обсяг виробництва описує рівняння ступеневого тренду: $y = 57,772x^{-0,29}$.

8. Також було запропоновано аналіз кон'юнктури ринку металопрокату на основі виробничої функції Кобба-Дугласа-Тінбергена. В якості даних було взято звітність 20 найбільших підприємств за період 2012-2017 роки опираючись на принцип Паретто : 20% підприємств виробляють 80% металопрокату. Таким чином, виробнича функція Кобба-Дугласа-Тінбергена отримала такий вигляд: $Y = 0,010237 L^{4,3641} e^{-0,08519t}$. Слід також відмітити, що під час будування функції було викинуто фактор К – капіталу, оскільки імовірність помилки та неадекватного впливу була досить велика. У результаті розробленого точкового прогнозу було отримано наступний довірчий інтервал: $\hat{y}_{N+L} \pm \Delta = 351,11 \pm 101$. Отже, результати прогнозування показали, що обсяг виробництва в 2019 році збільшиться приблизно до 351,11 (млрд. грн.). Причому з достовірністю 95% можна стверджувати, що вказаний обсяг випуску буде перебувати в межах від 264,01 до 466,94 млрд. грн. Розрахувавши похибку між двома прогнозами, було отримано значення у 1,77%, що дає змогу сказати про точність отриманих даних, оскільки допустиме значення розбіжності складає приблизно 2-3%.

На основі проведеного аналізу можна зробити короткий висновок, що перспективи розвитку української металургії тісно пов'язані з підвищенням конкурентоспроможності продукції на основі зменшення енерго- і матеріалоємності вироблених товарів, зменшення трудових витрат, впровадження досягнень науково-технічного прогресу. Така зацікавленість підприємств повинна стимулюватися пільгами податку на прибуток, всебічною підтримкою з боку держави, спрямованої в першу чергу на розширене відтворення, впровадження НТП, а також на використання інновацій.

АНОТАЦІЯ

Лозінський Ростислав Станіславович «Дослідження та прогнозування кон'юнктури ринку (на прикладі ринку металопрокату України)».

Кваліфікаційна робота на здобуття освітнього ступеня магістра зі спеціальності: «Підприємництво, торгівля та біржова діяльність» за магістерською програмою професійного спрямування «Економіка, планування та управління бізнесом». – Одеський національний економічний університет. – Одеса, 2018.

У роботі розглядаються сутність та особливості дослідження ринку металопрокату в Україні; економіко-математичні моделі та прогнозування кон'юнктури ринку. Проаналізовано особливості функціонування ринку металопрокату України; обґрунтовано необхідність впровадження певних кроків для зміцнення позицій України на ринку металопрокату у світовому середовищі. Запропоновано та розроблено новий підхід до прогнозування на основі двох методів дослідження кон'юнктури ринку (балансу змінних та виробничої функції); проведено порівняння отриманих результатів та виявлено мінімальну похибку між ними.

Ключові слова: металопрокат, кон'юнктура ринку, виробнича функція, прогнозування, економіко-математичні моделі.

ANNOTATION

Lozinskyi Rostyslav “Research and forecasting of market conjuncture (on example of metal rolling market of Ukraine)”

Thesis for Master degree in specialty “Entrepreneurship, Trade and Stock Exchanges” under the program “Economics, Planning and Business Management”. – Odessa National University of Economics. – Odessa, 2018.

The article considers the essence and specifics of the research of the market of rolled metal in Ukraine; economic and mathematical models and forecasting of market conditions. The peculiarities of functioning of the metal-roll market in Ukraine are analyzed; the necessity of introducing certain steps to strengthen the position of Ukraine on the market of rolled metal in the world environment is substantiated. A new approach to forecasting has been proposed and developed on the basis of two methods of market research (balance of variables and production function); a comparison of the obtained results was made and the minimum error between them was found.

Keywords: metal rolling, market conjuncture, production function, forecasting, economic and mathematical models.