

Семчишин Л.М.

кандидат фізико-математичних наук, доцент

Чортківський навчально-науковий інститут підприємництва і бізнесу

Західноукраїнського національного університету

ВИКОРИСТАННЯ МАТЕМАТИЧНОГО МОДЕЛЮВАННЯ В ЕКОНОМІЧНИХ ДОСЛІДЖЕННЯХ

Математичне моделювання в наукових дослідженнях і практичних застосуваннях є невід'ємною рисою прогнозування економічного процесу. Його ефективність визначається продуктивністю ЕОМ та якістю обчислювальних алгоритмів і програм, що використовуються. Сучасні наукові дисципліни широко включають у себе необхідні інструментальні засоби, математичні моделі і методи які дозволяють здійснювати більш високий рівень формалізації й абстрактного опису найбільш важливих істотних зв'язків техніко-економічних змінних систем і об'єктів, оцінювати форму і параметри залежностей їх змінних, отримувати нові знання про об'єкти, визначати найкращий розв'язок в тій чи іншій ситуації, формулювати висновки адекватні вивченому об'єкту, компактно викладати основні теоретичні положення. Більш того, активність економічних досліджень стає рушійною силою для математиків у подальшому розвитку математичного інструментарію. Сьогодні в економічній науці на перший план ставиться математична модель як дієвий інструмент дослідження та прогнозування розвитку економічних процесів і явищ.

Будь-яке прогнозування та моделювання економічних процесів завжди припускає об'єднання теорії (математичної моделі) із практикою (експериментом і статистичними даними). В якості прикладів економічних моделей можна назвати моделі: економічного росту, рівноваги на товарних і фінансових ринках, ціноутворення і конкурентна рівновага...

Економіко-математичні дослідження, що проводяться в країні, охоплюють важливі проблеми на різних рівнях планування та управління. Успішне розв'язання численних економіко-математичних задач стало можливим лише завдяки широкому використанню математичних моделей, обчислювальних методів і комп'ютерних технологій. Застосування математики в економіці дозволяє виділити й формально описати найголовніші зв'язки між економічними змінними та параметрами об'єктів дослідження, індуктивним шляхом одержати нові відомості про об'єкт, зробити важливі теоретичні висновки і прийняти правильні економічні рішення. Головні переваги математики як засобу наукового пізнання найповніше розкриваються саме у процесі побудови математичних моделей.

Застосування математичних методів в економічних дослідженнях передбачає використання математики як особливого способу вивчення економічних закономірностей і одержання теоретичних та практичних економічних висновків. Економіко-математичні задачі належать до числа найскладніших задач, які відомі науці. Характеристикам, які описують такі задачі, притаманні випадковість, невизначеність і динамічність економічних показників.

Основним методом дослідження таких складних задач є моделювання. Метод моделювання базується на принципі аналогії, тобто можливості вивчення реального об'єкта не безпосередньо, а через розгляд подібного йому і більш доступного об'єкта, його моделі.

Використання математичного моделювання в економіці та управлінні дозволяє поглибити кількісний економічний аналіз, розширити область економічної інформації, інтенсифікувати економічні розрахунки.

Економіко-математичне моделювання є одним із ефективних методів опису функціонування складних соціально-економічних об'єктів та процесів у виді математичних моделей, об'єднуючи тим самим в єдине ціле економіку та математику.

Методи розв'язування задач лінійного програмування найкраще розроблені, легко реалізуються на ПЕОМ, а тому набули широкого застосування в багатьох галузях науки, техніки та економіки. Проте лінійні моделі відображають лише певну й вельми обмежену сукупність властивостей навколишнього світу. Адже, скажімо, соціально-економічні процеси переважно не є лінійними. Галузі, об'єднання та окремі підприємства функціонують і розвиваються за умов невизначеності, а тому адекватно їх можна описати нелінійними, стохастичними, динамічними моделями. Отже, для ефективного управління галузями і окремими об'єктами господарювання потрібне застосування економіко-математичних моделей та методів. Тому кваліфікований аналітик, який використовує методи математичного моделювання у повсякденній практиці, певною мірою повинен бути:

а) економістом – щоб використовувати економічну теорію для аналізу емпіричних даних;

б) математиком – щоб формулювати економічну теорію засобами математичної мови, зробивши її придатною для побудови формалізованих схем та перевірки їх коректності;

в) спеціалістом у економічній статистиці – щоб володіти процесами формування інформаційної бази даних і вміти порівнювати у відповідності до змінних економічної теорії реально виміряні макро- та мікроекономічні емпіричні показники;

г) спеціалістом в математичній статистиці – щоб використовувати для аналізу емпіричних даних кількісні методи.

До цього переліку слід додати необхідність обов'язкового знання та володіння комп'ютерною технікою, освоєння необхідних програмних продуктів, без використання яких сьогодні немислимий системний аналіз.

Застосування математичного апарату в економіці ґрунтується на засвоєнні необхідної бази математичних знань. Економіко-математичні методи – методологічний інструмент у професійній діяльності економістів-аналітиків, який допомагає їм вирішити два основні завдання: перше – визначити, чому у

виробничо-економічній системі чи іншій структурній інституції склалася поточна кризова ситуація, тобто провести комплексний економічний аналіз стану фінансово-господарської діяльності та виробити прогнозну стратегію наслідків прийнятих управлінських рішень на перспективу. Друге завдання полягає в кількісному обґрунтуванні процедури дій «що буде, якщо ...» для кожного з можливих сценаріїв розвитку, обираючи при цьому найбільш корисний (вигідний) за заданим критерієм або множиною критеріїв.

Широке використання математичних методів є важливим напрямком удосконалення аналізу різних сфер національної економіки, який підвищує ефективність діяльності процесів в суспільстві. Зазначимо що таке модель та моделювання. Модель – це такий матеріально або розумово зображуваний об'єкт, який у процесі дослідження замінює об'єкт-оригінал таким чином, що його безпосереднє вивчення дає нові знання про цей об'єкт. Іншими словами, модель – умовне зображення об'єкта, що певною мірою адекватно описує його функціональні характеристики, які істотно важливі для поставленої мети дослідження. Разом із тим, можна сказати, що модель – це інструмент кількісного аналізу певних явищ, крім того, вони розвивають інтелект і дають багато корисного для прийняття рішень [1]. Моделювання – це наукова теорія побудови і реалізації моделей, за допомогою яких досліджуються явища, процеси в природі і суспільному житті [4].

Математичні моделі забезпечують перехід до оригіналу, фіксують і досліджують його властивості і відношення за допомогою математичних методів. Серед них виділяють відповідні і розрахункові. Розрахункові моделі виражають властивості і відношення оригіналу за допомогою уявлень – формул, рівнянь, графіків, таблиць, операторів, алгоритмів і т.д. у відповідних моделях – змінні величини пов'язані з відповідними змінними величинами оригіналу певними математичними залежностями.

Побудова економіко-математичних моделей – складний процес, який вимагає глибоких знань з економічної теорії, предмета дослідження і математичного інструментарію [2].

Освоєння математичних методів і інструментарію наукових досліджень дасть можливість майбутньому спеціалістові сформувавши необхідні компоненти мислення: компетентність, світогляд і культуру, які будуть фахівцеві потрібні як у теоретичному плані, так і в плані орієнтації в професійній практичній діяльності. Математичні методи в економіці серед інших методів посідають чільне місце. Це детерміновано вагомістю обчислень обсягів випуску продукції, попиту, цін, термінів і т.д., тобто обчислень змінних, вимірюваних кількісною шкалою.

Задача пошуку оптимальних обсягів виробництва ґрунтується на допущеннях про лінійність зв'язку між витратами ресурсів і обсягами виготовленої продукції; між ціною, рекламою та попитом тощо. Але такі зв'язки насправді є нелінійними, тому точніші математичні моделі доцільно формулювати в термінах нелінійного програмування [3].

Нехай для деякої виробничої системи необхідно визначити план випуску продукції за умови найкращого способу використання її ресурсів. Відомі загальні запаси кожного ресурсу, норми витрат кожного ресурсу на одиницю продукції та ціни реалізації одиниці виготовленої продукції. Критерії оптимальності можуть бути різними, наприклад, максимізація виручки від реалізації продукції. Така умова подається лінійною залежністю загальної виручки від обсягів проданого товару та цін на одиницю продукції.

Однак, загальновідомим є факт, що за умов ринкової конкуренції питання реалізації продукції є досить складним. Обсяг збуту продукції визначається передусім її ціною, отже, як цільову функцію доцільно брати максимізацію не всієї виготовленої, а лише реалізованої продукції. Необхідно визначати також і оптимальний рівень ціни на одиницю продукції, за якої обсяг збуту був би максимальним. Для цього її потрібно ввести в задачу як невідому величину, а обмеження задачі мають враховувати зв'язки між ціною, рекламою та обсягами збуту продукції. Цільова функція в такому разі буде виражена добутком двох невідомих величин: оптимальної ціни одиниці продукції на оптимальний обсяг

відповідного виду продукції, тобто буде нелінійною. Отже, маємо задачу нелінійного програмування.

Також добре відома транспортна задача стає нелінійною, якщо вартість перевезення одиниці товару залежить від загального обсягу перевезеного за маршрутом товару. Тобто коефіцієнти при невідомих у цільовій функції, що в лінійній моделі були сталими величинами, залежатимуть від значень невідомих (отже, самі стають невідомими), що знову приводить до нелінійності у функціоналі.

І нарешті, будь-яка задача стає нелінійною, якщо в математичній моделі необхідно враховувати умови невизначеності та ризик. Як показник ризику часто використовують дисперсію, тому для врахування обмеженості ризику потрібно вводити нелінійну функцію в систему обмежень, а мінімізація ризику певного процесу досягається дослідженням математичної моделі з нелінійною цільовою функцією [5].

Розглянемо утворення найхарактерніших нелінійних моделей.

Загальну задачу математичного програмування сформулюємо так: знайти такі значення змінних x_j ($j = \overline{1, n}$), щоб цільова функція набувала екстремального (максимального чи мінімального) значення:

$$\max (\min) F = f(x_1, x_2, \dots, x_n) \quad (1)$$

за умов:

$$g_i(x_1, x_2, \dots, x_n) \{ \leq, =, \geq \} b_i \quad (i = \overline{1, m}); \quad (2)$$

$$x_j \geq 0 \quad (j = \overline{1, n}). \quad (3)$$

Якщо всі функції $f(x_1, x_2, \dots, x_n)$ та $g_i(x_1, x_2, \dots, x_n)$, $i = \overline{1, m}$ є лінійними, то це задача лінійного програмування, інакше (якщо хоча б одна з функцій є нелінійною) маємо задачу нелінійного програмування.

Часто задачу нелінійного програмування намагаються звести до лінійного вигляду, що призводить до значних похибок.

Зведення нелінійної задачі до лінійної дає змогу отримати, симплексним методом, розв'язок, близький до розв'язку початкової нелінійної задачі. Однак

з вище розглянутого прикладу бачимо, що при побудові наближених лінійних задач можна отримати надто неточний розв'язок, який непридатний для використання. Питання щодо існування розв'язку задачі нелінійного програмування потребує окремого дослідження [6].

Розглянемо основні труднощі розв'язування нелінійних задач.

1. Для лінійних задач можна завжди знайти оптимальний розв'язок універсальним методом – симплексним. При цьому не існує проблеми стосовно доведення існування такого розв'язку, тобто в результаті застосування алгоритму симплексного методу завжди отримують один з таких варіантів відповіді:

- а) отримали оптимальний розв'язок;
- б) умови задачі суперечливі, тобто розв'язку не існує;
- в) цільова функція необмежена, тобто розв'язку також не існує.

Для задач нелінійного програмування не існує універсального методу розв'язання, що зумовило розроблення значної кількості різних методів розв'язування окремих типів задач нелінійного програмування. Для кожного специфічного методу необхідно доводити існування розв'язку задачі та його єдиність, що також є досить складною математичною задачею.

Відомі точні методи розв'язування нелінійних задач, але в такому разі існують труднощі обчислювального характеру, тобто навіть для сучасних ЕОМ такі алгоритми є досить трудомісткими, тому здебільшого для розв'язування нелінійних задач виправданим є застосування наближених методів.

2. Для задач лінійного програмування доведено наявність єдиного екстремуму, що досягається в одній (або кількох одночасно) з вершин багатогранника допустимих розв'язків задачі.

3. Класичний метод оптимізації. Метод множників Лагранжа. Як уже згадувалось, для розв'язування задач нелінійного програмування не існує універсального методу, тобто до них необхідно застосовувати широке коло різних методів і обчислювальних алгоритмів. Вони в основному базуються на

застосуванні диференційного числення і залежать від конкретної постановки задачі та форми економіко-математичної моделі.

Ідея методу множників Лагранжа полягає в заміні початкової задачі простішою. Для цього цільову функцію замінюють іншою, з більшою кількістю змінних, тобто такою, яка включає в себе умови, що подані як обмеження. Після такого перетворення подальше розв'язування задачі полягає в знаходженні екстремуму нової функції, на змінні якої не накладено ніяких обмежень. Тобто від початкової задачі пошуку умовного екстремуму переходимо до задачі відшукування безумовного екстремального значення іншої функції. Отже, завдяки такому перетворенню можливе застосування методів класичного знаходження екстремуму функції кількох змінних.

Розглянемо метод множників Лагранжа для розв'язування задачі нелінійного програмування, що має вигляд:

$$\max(\min) Z = f(x_1, x_2, \dots, x_n) \quad (4)$$

за умов:

$$q_i(x_1, x_2, \dots, x_n) = b_i \quad (i = \overline{1, m}), \quad (5)$$

де функції $f(x_1, x_2, \dots, x_n)$ і $q_i(x_1, x_2, \dots, x_n)$ мають бути диференційовними.

Задача (4)-(5) полягає в знаходженні екстремуму функції $f(x)$ за умов виконання обмежень $q_i, (i = \overline{1, m})$.

Переходимо до задачі пошуку безумовного екстремуму. Теоретично доведено, що постановки та розв'язання таких задач еквівалентні.

Замінюємо цільову функцію (4) на складнішу. Це є функція Лагранжа і має такий вигляд:

$$L(x_1, x_2, \dots, x_n; \lambda_1, \lambda_2, \dots, \lambda_m) = f(x_1, x_2, \dots, x_n) + \sum_{i=1}^m \lambda_i (b_i - q_i(x_1, x_2, \dots, x_n)), \quad (6)$$

де λ_i – деякі невідомі величини, множники Лагранжа.

Обчисливши частинні похідні, прирівнявши їх до нуля, отримаємо розв'язки $X^* = (x_1^*, x_2^*, \dots, x_n^*)$ і $\lambda^* = (\lambda_1^*, \lambda_2^*, \dots, \lambda_m^*)$ – стаціонарні точки. Оскільки, ці

розв'язки отримані з необхідної умови екстремуму, то вони визначають максимум, мінімум задачі (6).

Ефективність розв'язку нелінійних задач у великій мірі залежить від рівня раціонального розподілу ресурсів, в основі яких лежать оптимізаційні моделі.

Одним із найефективніших методів розв'язування економіко-математичних моделей є оптимізаційні задачі з лінійною формою взаємозв'язків. Вони мають задовольняти наступні вимоги:

- будь-яка задача повинна бути представлена в математичній формі за допомогою систем нерівностей або рівнянь;
- будь-який отриманий розв'язок не повинен суперечити економічному змісту задачі;
- система лінійних рівнянь повинна бути невизначеною;
- для знаходження оптимального розв'язку необхідно сформулювати критерій оптимальності і виразити його у формі цільової функції, яка в процесі розв'язку набуде екстремального значення.

Використання методів економіко-математичного моделювання дає змогу аналізувати якісно і кількісно складні економічні процеси. Нові методи моделювання, засновані на строгих математичних розв'язаннях економічних завдань із застосуванням виявлених законів економіки виробництва, у поєднанні із сучасною обчислювальною технікою сприяють створення вискоєфективних систем для аналізу стану і науково обґрунтованого прогнозування розвитку економіки підприємств, галузей і країни загалом, дають можливість усвідомлено управляти економічними процесами виробництва.

Спираючись на результати проведених досліджень, можемо сказати що існує достатня кількість методів та моделей, які можна застосовувати в економічних дослідженнях на макро- та мікрорівні.

Одержані результати збагачують теорію математичних методів і розширюють область застосування математичних моделей в економіці.

Отже, прогнозування та моделювання дає змогу здобути навички використання математичного апарату у дослідженні економічних процесів і розв'язанні економіко-математичних задач, як на мікрорівні так і на макрорівнях.

Література

1. Грабовецький Б.Є. Економічне прогнозування і планування: навч. посібник / Б.Є. Грабовецький. – Київ, 2003. – 188 с.
2. Григорків В. С. Моделювання економіки. Ч. 2: Навч. посібник / В. С. Григорків. – Чернівці: Рута, 2006. – 100 с.
3. Жуков С.А. Математичні методи та моделі в економіці: Навч. посібник / С.А. Жуков, В.С. Остапчук, О.І. Сторубльов. – К.: Видавничо-поліграфічний центр “Київський університет”, 2002. – 231 с.
4. Економіко-математичне моделювання: Навчальний посібник / За ред. О.Т. Іващука. Тернопіль. ТНЕУ, 2008. – 704 с.
5. Ляшенко І.М. Економіко-математичні методи та моделі сталого розвитку / І.М. Ляшенко. – К. : Вища школа, 1999. – 236 с.
6. Недашковський М.О. Обчислення з λ -матрицями / М.О. Недашковський, О.Я. Ковальчук. – К.: Наукова думка, 2007. – 294 с.
7. Семчишин Л.М. Динамічні математичні моделі в економіці / Л.М. Семчишин. – Вісник Тернопільського національного економічного університету. – Тернопіль: Економічна думка, 2008. – Випуск 3. – С. 123-129.