

past data in a very direct way as a guide to what might happen in the future. We apply the current weights to the historical asset returns by going back in time such as over the last 100 days. The current portfolio weights are computed using standard mathematical optimization. These portfolio returns are then sorted and depending on the target probability the corresponding quantile of the distribution is taken. This gives us the 1-day VaR using Historical Simulation method. Hypothetical portfolios can also be generated using the current portfolio weights and the historical asset returns. This approach is called bootstrapping. Another procedure of generating scenarios for tomorrow for the market variables (such as equity prices, interest rates and so on) is based on their today's values. Advantages: Historical simulation method is relatively simple to implement if the past data is readily available for estimating Value-at-Risk. Historical simulation method allows nonlinearities and nonnormal distribution by relying on the actual prices. It does not rely on underlying stochastic structure of the market or any specific assumptions about valuation models. Historical simulation method does not rely on valuation models and is not subjected to the risk that the models are wrong.

In the same time the Historical Simulation method assumes the availability of sufficient historical price data. This is a drawback because some of the assets may have a short history or in some cases no history at all. There is also an assumption that the past represents the immediate future which is not always true. The Historical Simulation method quickly becomes cumbersome for large portfolios with complicated structures.

Марія БАШТОВА

Державна установа «Інститут економіки природокористування та сталого розвитку НАН України», Київ

МІЖНАРОДНА ЕКОНОМІЧНА БЕЗПЕКА КРІЗЬ ВІДНОСИНИ ТА ФАКТОРИ ПРИРОДОКОРИСТУВАННЯ

Міжнародна економічна безпека – це комплекс міжнародних умов існування домовленостей та інституційних структур, при якому кожній державі-члену світової спільноти забезпечується можливість вільно обирати і здійснювати свою стратегію соціального та економічного розвитку, не піддаючись зовнішньому і політичному тиску, розраховуючи на невтручання, розуміння і взаємоприйнятну та взаємовигідну співпрацю з боку решти держав.

Дане поняття розкриває логічний зв'язок між суспільною безпекою і безпекою державного сектору, оснований на мирній взаємодії всіх держав, що входять у світову спільноту і дотримуються ринкових умов господарювання. Кожна держава має право самостійно розробляти, коректувати і слідувати своїй стратегії економічного розвитку, погоджуючи її з цілями, що стоять перед народом і урядом. Ці цілі на державному рівні іменуються національними інтересами. Економічна безпека дуже залежна як від національних інтересів, так і від способів їх здійснення [1, 71].

Сталий розвиток економіки передбачає стійке економічне зростання, але забезпечення економічного зростання сьогодні пов'язане зі зростанням забруднення і деградації середовища, вичерпанням природних ресурсів, порушенням балансу біосфери, зміною клімату, що веде до погіршення здоров'я людини і обмежує можливості подальшого розвитку. Все це і визначає суть модернізації як забезпечення технологічного прогресу для економічного розвитку і підтримання сприятливого навколишнього природного середовища (екологічної безпеки, яка стає визначальною для економічного зростання і самого існування людини).

За рахунок виснаження природного капіталу для підтримки зростання економіки накопичується екологічний борг. Запаси природних ресурсів виснажуються, а розміри екологічного сліду збільшуються. Під поняттям «екологічний слід» розуміється міра потреб людини у екосистемах планети. Це стандартизований показник, що відображає попит

людської популяції на природний капітал, який може навіть перевищувати екологічну спроможність планети до регенерації цього капіталу. Сьогодні більше 80 відсотків населення земної кулі живе в країнах, які використовують більше ресурсів, ніж доступно в межах їх власних кордонів. Ці країни використовують для задоволення своїх потреб в ресурсах надлишки, зосереджені в країнах-кредиторах, які використовують менше біоємкості, ніж мають. У 1961 р. майже всі країни світу мали у своєму розпорядженні більш, ніж достатній потенціал для задоволення власних потреб. До 2013 р. становище радикально змінилося – багато країн здатні задовольняти свої потреби, лише імпортуючи ресурси з інших держав. В умовах надмірної експлуатації ресурсів у світовому масштабі для країн – екологічних боржників особливо актуальні ризики глобальних або локального перевитрат, що веде до скорочення обсягу послуг екосистем.

Один із парадоксів сучасності полягає в тому, що ніколи ще людство не мало стільки різноманітних і потужних засобів захисту і ніколи ще не стояло так близько біля порога, за яким уже ніщо не врятує [3].

Економічна безпека у постіндустріальному суспільстві спирається на дві позиції: ефективність господарювання та безпека господарської діяльності. Перша позиція – це, по суті, «зелена» чи «синя» економіка, друга – це екологічна безпека життєдіяльності суспільства в процесі виробництва, проведення з відходами, з комплексом проблем та викликів, так чи інакше пов'язаних з забезпеченням безпеки середовища життєдіяльності, включно з харчуванням, способом реалізації основних життєвих потреб, комунікацій, розселення тощо.

Стабільність в системі макроекономічної безпеки досягається правильним функціонуванням і сталим розвитком держави, чому, в свою чергу, сприяє достатня кількість матеріальних, фінансових, трудових і часових ресурсів. Економічно розвинені країни Західної Європи та багато інших країн світу, що розвиваються, розглядають економічну безпеку не тільки з позиції її регулювання з боку держави, але й з позиції задоволення своїх потреб у стратегічно важливих ресурсах.

При цьому головним завданням будь-якої структури, що має в розпорядженні ресурси, є не тільки забезпечення доступу до них, але й раціональне використання, що:

- безпосередньо впливає на рівень витрат (а отже, і на прибутковість заходів по захисту економічної безпеки);
- сприяє економії;
- створює і виконує соціальну відповідальність підприємств і держави перед головним власником ресурсів – громадянами країни.

Оскільки основоположним завданням в економіці є раціональний і обґрунтований розподіл ресурсів, необхідно зрозуміти, наскільки ця задача близька до реалізації, і чи вирішувана взагалі. В економічно розвинених країнах дана проблема може здаватися віддаленою – лише невелика кількість громадян турбується про брак ресурсів для забезпечення свого виживання. В переважній решті країн, однак, гідне існування окремих індивідів і навіть цілих суспільств не забезпечується державою в належній мірі. [1, 75-76]

Проблема природокористування за своєю природою є інтернаціональною. Під цим поняттям розуміється результат прозорості кордонів та транснаціоналізації виробництва товарів і послуг, отже, це закономірний процес економічного розвитку.

Значущість та невідворотність ресурсної проблеми проявляються в ряді причин. По-перше, вона безпосередньо торкається інтересів усіх людей, народів, країн та регіонів світу, зумовлюючи не тільки відмінні особливості сучасного буття, а й саму парадигму їхнього подальшого існування та розвитку. По-друге, вона має обов'язковий та безумовний характер і не може бути проігнорованою або недооціненою, оскільки подібне могло б мати надзвичайно несприятливі та навіть фатальні наслідки для мільярдів людей. По-третє, з точки зору практичного її вирішення, вона потребує участі всіх держав з метою комплексного розв'язання численних, пов'язаних з нею питань при безумовній відповідальності щодо результативності зусиль. [2, 566]

Отже, природокористування в системі економічної безпеки – це комплексність, пріоритетність стратегічних цілей над тактичними, мінімізація суспільних та правових ризиків, можливість оперувати десятиліттями використання ресурсу. Це зовсім інший процес, ніж той, що був описаний у минулому столітті, бо залежність світової економіки від природного ресурсу знижується, а ефективність його використання переходить від площини сировинної до площини асиміляційної, рекреаційної, бальнеологічної, туристичної тощо.

Головна думка даного дослідження – показати значущість природокористування в системі міжнародної економічної безпеки. Уміння правильно використовувати свої природні ресурси – основа сталого розвитку кожної держави, а отже, й світового співтовариства загалом.

Список літератури:

1. Економічна безпека в умовах глобалізації світової економіки: [колективна Е45 монографія у 2т.]. – Дніпропетровськ: «ФОР Дробязко С.І.», 2014. – Т.1. – 466 с.
2. Управління міжнародною економічною діяльністю: навчальний посібник / Новицький В.С., Бойцун Н.С. / К.: Інститут світової економіки і міжнародних відносин НАН України, 2010. – 615 с.
3. Чепеленко А.М. Екологічна безпека як основний пріоритет сталого розвитку економіки і міжнародної безпеки / А.М. Чепеленко // Вісник Донецького університету економіки та права. – 2013. - №2. – С. 40-45.
4. Чернега О.Б., Іваненко І.А НАТО та система міжнародної безпеки [Текст]: навч. посіб. / О.Б. Чернега, І.А. Іваненко; М-во освіти і науки України, Донец. Нац. Ун-т економіки і торгівлі імені М. Туган-Барановського, Каф. міжнар. економіки. – Донецьк: [ДонНУЕТ], 2009. – 228 с.

Анна БЕРЕЖНЯК

Відокремлений підрозділ Національного університету біоресурсів і природокористування України «Ніжинський агротехнічний коледж», м. Ніжин

ІНТЕГРАЦІЯ УКРАЇНИ У СВІТОВЕ СПІВТОВАРИСТВО: ПРОБЛЕМИ ТА ШЛЯХИ ЇХ ПОДОЛАННЯ

Проблема інтеграції України у світове співтовариство є актуальною. При цьому мається на увазі, що мова йде про економічне зближення з розвинутими країнами, про використання їхнього досвіду і переваг господарської взаємодії з ними в інтересах розвитку економіки України. Метою є обґрунтування особливостей інтеграції України у світове співтовариство та виявлення практичного значення інтеграційних процесів для економіки країни.

При інтеграції України у світове співтовариство, мова йде не про вступ держави в світове господарство, вона завжди була і зостається його учасником, а про активізацію її економічної взаємодії з іншими країнами з метою використання переваг міжнародного поділу праці для прискорення подолання відставання від країн - лідерів в розвитку економіки і добробуту населення. [1, с. 90-94].

Сучасне світове співтовариство - це 226 самостійних держав і народів, великих і малих, які перебувають на різних ступенях історичного та культурного розвитку, що належать до різноманітних суспільно-економічних систем. Це й держави, що розвиваються, розвинені індустріальні капіталістичні країни Європи, США, Канада та Японія, й багато інших країн, що визволились з колоніальної залежності і тепер йдуть демократичним шляхом розвитку.

Сучасна Україна має потужний потенціал, що складається з освіченого населення, багатих природних ресурсів, родючих земель і території, що обробляє. Але українська економіка заснована на застарілих сільськогосподарських об'єднаннях і занепадлій, неефективній індустрії. А для того, щоб держава стала конкурентоспроможною в Європі та в світі, більшість підприємств повинна бути демонтована і замінена новими, що випускають складне устаткування та електроніку.

Багато часу знадобиться Україні на перекваліфікацію сільського населення, розвиток управління, банківської та біржової систем. Вирішити ж проблеми можливо тільки з