

МІЖРЕГІОНАЛЬНА АКАДЕМІЯ УПРАВЛІННЯ ПЕРСОНАЛОМ



НАУКОВІ ПРАЦІ МАУП

Засновано у 2001 р.

Випуск 2(16)

Київ 2007

УДК 330-339; 321.7; 159.9
ББК 65.9(4УКР)я43
М43

Редакційна колегія

Головатий М. Ф., д-р політ. наук, проф. — головний редактор
Антонюк О. В., д-р політ. наук, проф. — заступник головного редактора
Саввич І. Г., канд. філол. наук — відповідальний редактор
Чирков В. М. — відповідальний редактор за випуск

Економічні науки

Захожай В. Б., д-р екон. наук, проф., Федоренко В. Г., д-р екон. наук, проф., Дахно І. І., д-р екон. наук, проф., Баєва О. В., д-р біол. наук, проф., Шостак Л. Б., д-р екон. наук, проф., Поляков О. М., д-р екон. наук, проф., Радзівєвський О. І., д-р екон. наук, Дмитренко Г. А., д-р екон. наук, проф., Криклій А. С., д-р екон. наук, проф., Куроченко О. В., д-р екон. наук, проф.

Політичні науки

Головатий М. Ф., д-р політ. наук, проф., Антонюк О. В., д-р політ. наук, проф., Бабкіна О. В., д-р політ. наук, проф., Горбатенко В. П., д-р політ. наук, проф., Кирилюк Ф. М., д-р філос. наук, проф., Бідзюра І. П., д-р політ. наук, проф., Варзар І. М., д-р політ. наук, проф., Храмов В. О., д-р політ. наук, проф., Шуба О. В., д-р політ. наук, проф.

Психологічні науки

Балл Г. А., д-р психол. наук, проф., Охременко О. Р., д-р психол. наук, Ложкін Г. В., д-р психол. наук, проф., Приходько Ю. О., д-р психол. наук, проф., Чуприков А. П., д-р мед. наук, проф., Онищук Л. А., д-р пед. наук

Юридичні науки

Бабкін В. Д., д-р юрид. наук, проф., Коваленко В. В., д-р юрид. наук, проф., Марчук В. М., д-р юрид. наук, проф., Стеценко С. Г., д-р юрид. наук, проф., Александров Ю. В., канд. юрид. наук, проф., Корнієнко М. І., канд. юрид. наук, проф.

Міжрегіональна Академія управління персоналом.

М43 Наукові праці МАУП / Редкол.: М. Ф. Головатий (голов. ред.) та ін. — К. : МАУП, 2001. — Вип. 1. — ISBN 966-608-120-2

Вип. 2(16). — 2007. — 244 с. — Бібліогр. в кінці ст. — ISBN 978-966-608-837-9

У збірнику наукових праць публікуються статті науковців, які займаються проблемами розвитку економіки і менеджменту, політології, психології і права.

Для науковців, викладачів, студентів, а також усіх, кого цікавить розвиток науки в Україні.

Збірник "Наукові праці МАУП" зареєстровано Державним комітетом інформаційної політики, телебачення та радіомовлення України (свідоцтво від 11.04.02 за № 6048, серія КВ) як наукове видання, у якому висвітлюються результати наукових досліджень в галузях економіки, менеджменту, політології, соціології, психології, права, матеріалів наукових конференцій.

Вищою атестаційною комісією України "Наукові праці МАУП" визнано як фахове видання з економічних і психологічних наук (за постановою Президії ВАК України № 1-05/6 від 14 червня 2007 р.).

ББК 65.9(4УКР)я43+88я43

ISBN 966-608-120-2
ISBN 978-966-608-837-9

© Міжрегіональна Академія управління персоналом (МАУП), 2007

ЗМІСТ

ЕКОНОМІЧНІ НАУКИ	5	Коваль О. В. <i>Система антикризового управління підприємством</i>	64
Шостак Л. Б. <i>Проблеми енергозабезпечення розвитку України</i>	5	ПОЛІТИЧНІ НАУКИ	68
Солопенко Р. І. <i>Методика економічного обґрунтування управлінських рішень на авіаційному підприємстві</i>	13	Головатий М. Ф. <i>Підготовка молоді політичної еліти як дійовий засіб розвитку політичного консенсусу</i>	68
Рябченко І. М., Волков Д. О., Клімбовська А. В. <i>Характеристика комплексної спеціалізованої інформаційної системи управління інженерними мережами на прикладі систем подачі й розподілу води</i>	19	Бідзюра І. П. <i>Території багатонародної країни, політична нація і політичний центр: роздуми “на полях” елітологічної концепції В’ячеслава Литинського</i>	74
Щокін Р. Г. <i>Індексний аналіз прибутковості недержавного вищого навчального закладу</i>	23	Варзар І. М. <i>Ще раз про генезисно-історіологічний та ролево-функціональний погляди на феномен політичної нації у багатонародній країні</i>	81
Захожай В. Б., Казак О. О., Кім М. І. <i>Аналіз пропорційності розвитку інвестиційної діяльності</i>	31	Храмов В. О. <i>Державна політика у фокусі політичної легітимності: Мислєдіяльнісна інтерпретація</i>	89
Рябченко І. М., Гречухін О. В., Свиридов С. О. <i>Теоретичні засади аварійного управління системами подачі й розподілу води</i>	37	Хижняк І. А. <i>“Українське питання” на завершальному етапі Першої світової війни (1917–1918 рр.)</i>	93
Солопенко Р. Р. <i>Вплив релігійних поглядів на прийняття управлінських рішень у системі кадрового менеджменту підприємства</i>	41	Гольцов А. Г. <i>Вплив геополітики Заходу й Російської Федерації на політичні процеси в Україні</i>	102
Вассуф Саміх Муса <i>Державне управління якістю медичної допомоги у контексті оцінки професійних правопорушень</i>	46	Зайченко Л. М. <i>До генези і сучасного стану концепції політичного технократизму крізь призму політичної етнології</i>	108
Сивальнева Е. И. <i>Экономическая сущность понятия “малый бизнес”</i>	51	Лясога А. Є. <i>Концепція етноменшинського лібералізму як компонента науки політичної етнології: історіологія і теорія проблеми</i>	116
Ашуров Векил <i>СНГ: пути усиления интеграции</i>	55		
Новодворський Я. В. <i>Маржа безпеки як концептуальна основа прийняття рішень щодо операцій з інструментами у глобальному інвестиційному середовищі</i>	62		

В. Б. ЗАХОЖАЙ**О. О. КАЗАК****М. І. КІТ***Інститут міжнародної економіки і фінансів МАУП, м. Київ*

АНАЛІЗ ПРОПОРЦІЙНОСТІ РОЗВИТКУ ІНВЕСТИЦІЙНОЇ ДІЯЛЬНОСТІ

Наукові праці МАУП, 2007, вип. 2(16), с. 31–36

У статті пропонується методичний підхід і практичне використання в якості вивчення пропорційності інвестиційної діяльності в розрізі видів економічної діяльності, використання кривої Лоренца та розрахунку коефіцієнтів локалізації та концентрації як складової статистичного забезпечення управління інвестиційною діяльністю.

Одним з найважливіших завдань держави є забезпечення сталого розвитку інвестиційної діяльності на основі пропорційного співвідношення між окремими галузями національної економіки.

Теорія і практика аналізу пропорційності розподілу показників інвестиційної діяльності в останні роки значно поширилась як один з напрямів статистичного обґрунтування взаємозв'язків розподілів, зокрема інвестицій та їх вкладення. Своім виникненням цей напрям завдячує потребам управління на макро- та мікрорівнях розвитку економіки.

Статистичне забезпечення управління (СЗУ) сформулювало щодо цього низку конкретних завдань, які є базою статистичного аналізу пропорційності. Серед них основне місце належить завданню впорядкування узгодженості розподілу показників інвестиційної діяльності: обсяг інвестицій в основний капітал України, обсяг інвестицій в основний капітал регіону, обсяг інвестицій в основний капітал певного виду економічної діяльності, обсяг вітчизняних інвестицій, обсяг іноземних інвестицій, обсяг введених нових основних засобів, валовий внутрішній продукт, кількість населення, прибуток від інвестицій, темп зростання інвестицій, рівень інвестицій в регіоні, рівень інвестицій певного виду економічної діяльності в регіоні, капіталовіддача, капіталомісткість, ін-

вестиції в основний капітал на одну особу, окупність інвестицій, рівень іноземних інвестицій. За групову ознаку можуть слугувати регіони, галузі, види економічної діяльності, групи фізичних та юридичних осіб та ін.

Під час аналізу пропорційності важливе місце належить порівнянню з певними критеріями, які визначають якість розподілу. Важливим критерієм ефективності інвестиційної діяльності є дотримання певних пропорцій між складовими ефективності (прибуток, нові основні засоби) і пов'язаними з ними витратами (обсяг інвестицій в основний капітал). До критеріїв, що визначають інвестиційну діяльність, належать:

- капіталомісткість (обсяг інвестицій на одиницю валового внутрішнього продукту);
- капіталовіддача (обсяг введених у дію основних засобів на одиницю вкладеного капіталу);
- співвідношення між вітчизняними та іноземними інвестиціями;
- обсяг інвестицій на душу населення (разом, у тому числі іноземних);
- темпи зміни обсягу інвестицій та ін.

Основними критеріями оцінювання ефективності інвестиційної діяльності для інвесторів є: інвестиційна привабливість об'єкта інвестування; дохідність від інвестування; прозорість та від-

критість діяльності об'єкта інвестування; показники діяльності та високий потенціал розвитку та ін. Основними критеріями оцінювання ефективності для власника об'єкта інвестування є обсяг інвестицій, витрати, пов'язані з процесом інвестування; ефективність від інвестування; джерело інвестицій та ін.

Основний критерій пропорційності розподілу полягає в узгодженні у розподілі за витратною ознакою ресурсів і отриманого ефекту. Потреби практики потребують дослідження і врахування у процесі управління пропорційності як двох взаємозв'язаних показників (результативної та факторної ознак), так і однієї результативної оцінки з кількома факторними. Узгодженість пропорцій має бути динамічною.

Характеристику узгодженості розподілів інвестиційної діяльності розглянемо на прикладі розподілів обсягу введених нових основних засобів як результативної ознаки та обсягу інвестицій в основний капітал за деякими видами економічної діяльності як факторної ознаки. Обсяг введених нових основних засобів загалом позначимо $OЗ$, обсяг інвестицій в основний капітал — I . Частка обсягу введених нових основних засобів (i) в загальному обсязі становитиме

$$d_1 = \frac{\hat{I} C_i}{\hat{I} C},$$

а частка інвестицій в основний капітал —

$$d_2 = \frac{i}{2}.$$

Співвідношення часток обсягу введених нових основних засобів та обсягу інвестицій в основний капітал називається коефіцієнтом локалізації:

$$\hat{E}_{\text{віє}} = \frac{d_1}{d_2}.$$

Коефіцієнт локалізації показує відношення часток результативної ознаки до частки факторної. Якщо $K_{\text{лок}} < 1$, то це означає, що на розглядуваний обсяг введених нових основних засобів припадає менше обсягу інвестицій в основний капітал порівняно з пропорційною часткою факторної ознаки, і навпаки.

Аналіз пропорційності розподілу обсягу введених нових основних засобів та інвестицій в основний капітал наведено в табл. 1, в якій подано розрахунки питомої ваги кожного виду економічної діяльності за окремими показниками і часткового показника пропорційності розподілу у вигляді коефіцієнта локалізації.

Коефіцієнт локалізації показує, як питома вага результативної ознаки відрізняється від пропорційної до неї факторної ознаки. Будується графік коефіцієнта локалізації (рис. 1).

У вигляді коефіцієнта локалізації, який встановлює ранги підприємств за величиною $K_{\text{лок}}$ від меншого до більшого, дається узагальнена характеристика пропорційності розподілу. На підставі ранжування будується табл. 2, в якій види економічної діяльності розподілені за рангами $K_{\text{лок}}$.

Для зведеної характеристики пропорційності обох розподілів можна використати криву концентрації Лоренца і відповідно коефіцієнт концентрації.

1. Порядок побудови кривої Лоренца:

- обчислюють частки ознак результативної d_1 і факторної d_2 ;

Таблиця 1

Аналіз пропорційності розподілу обсягу інвестицій і нових основних засобів у 2006 р.

Вид економічної діяльності	Нові основні засоби, млн. грн., ОЗ	Інвестиції в основний капітал, млн. грн., I	Частка основних засобів, d_1	Частка інвестицій в основний капітал, d_2	Коефіцієнт локалізації, $K_{\text{лок}} = d_1 / d_2$	Ранг за коефіцієнтом локалізації
Сільське господарство, мисливство та лісове господарство	3741	2141	10,67	5,06	2,11	5
Промисловість	14012	19726	39,95	46,62	0,86	2
Будівництво	1395	2502	3,98	5,91	0,67	1
Транспорт і зв'язок	9607	10230	27,39	24,18	1,13	4
Операції з нерухомістю	6316	7716	18,01	18,23	0,99	3
Разом	35071	42315	100,00	100,00		

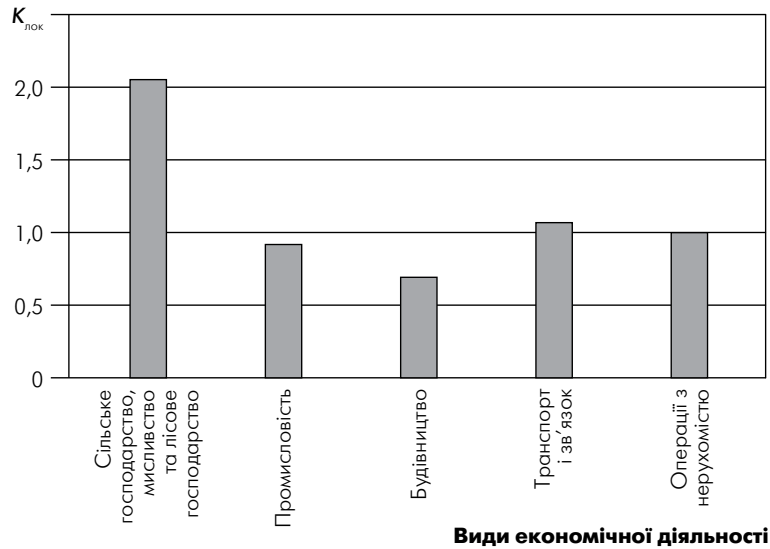


Рис. 1. Графік коефіцієнта локалізації

Таблиця 2

Розподіл видів економічної діяльності за рангами у 2006 р.

Вид економічної діяльності	Ранг за $K_{лок}$	Частка основних засобів, d_1	Частка інвестицій в основний капітал, d_2	d'_1	d'_2	$ d'_1 - d'_2 $
Будівництво	1	3,98	5,91	3,98	5,91	1,93
Промисловість	2	39,95	46,62	43,93	52,53	6,67
Операції з нерухомістю	3	18,01	18,23	61,94	70,76	0,22
Транспорт і зв'язок	4	27,39	24,18	89,33	94,94	3,21
Сільське господарство, мисливство та лісове господарство	5	10,67	5,06	100	100	5,61
Разом	15	100	100			17,64

- за кожною групою обчислюють $K_{лок}$;
- визначають ранги регіонів за значенням $K_{лок}$;
- будують таблицю, в якій види економічної діяльності розподіляють відповідно до значень рангів $K_{лок}$;
- обчислюють ряди кумулятивних d'_1 значень та d'_2 і на підставі цих значень будують криву Лоренца (рис. 2).

Якщо крива Лоренца збігається з лінією рівномірного розподілу, то частки результативної та факторної ознак збігаються. Що більше крива Лоренца відхиляється від лінії рівномірного розподілу, то більше відхиляються один від одного розподіли.

2. Порядок обчислення коефіцієнта концентрації $K_{конц}$. Мірою концентрації може бути відношення площі P до площі ΔOAB . Таке відношення називається коефіцієнтом концентрації ($K_{конц}$):

$$\hat{E}_{\text{еііо}} = \frac{S_p}{S_{\Delta OAB}}$$

Якщо $K_{конц} = 0$, то розподіли збігаються. Що більше значення $K_{конц}$, то істотніше різняться між собою розподіли.

Коефіцієнт концентрації можна обчислити за формулою

$$\hat{E}_{\text{еііо}} = \frac{1}{2} \sum |d'_q - d'_w| = \frac{1}{2} \sum |d_q - d_w|$$

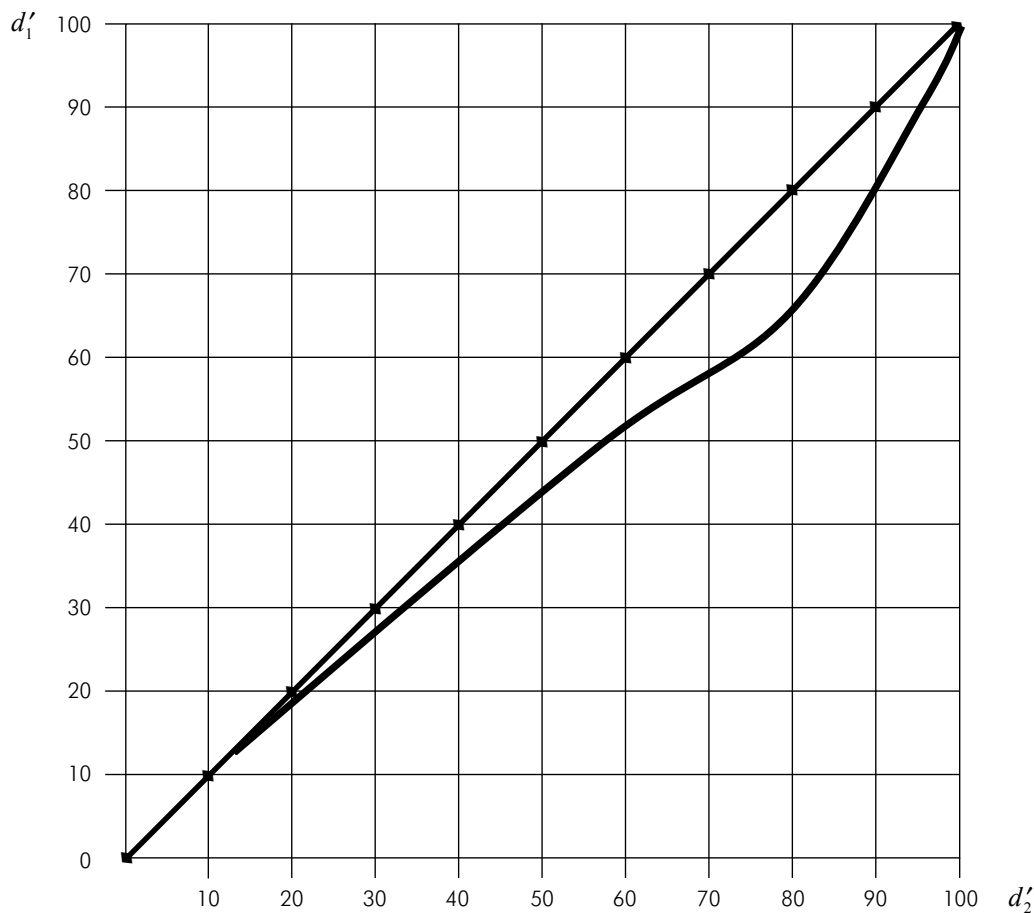


Рис. 2. Крива концентрації Лоренца

У результаті аналізу розробляються пропозиції вдосконалення управління розподілами інвестиційної діяльності, нехай не на рівні оптимальних співвідношень, але хоча б щодо раціональних результатів. У такий спосіб статистичне дослідження пропорційності створює передумови для вдосконалення управління процесами інвестиційної діяльності в частині узгодження розподілу взаємозв'язаних показників, результатів діяльності та чинників, які істотно впливають на характер узгодженості розподілів.

У згаданому вище прикладі коефіцієнт концентрації становить

$$\hat{E}_{\text{еіо}} = 0,5 \sum |d'_1 - d'_2| = 0,5 \cdot 17,64 = 8,82 \%$$

Різниця у розподілі обсягу інвестицій в основний капітал та обсягу введених нових основних засобів між різними видами економічної діяльності невелика, результат у 8,82 % відносять до нормальної концентрації з невеликою різницею у розподілах.

Комплекс методів аналізу пропорційності дає змогу визначити ступінь впливу окремих чинників на розподіл результативної ознаки за допомогою коефіцієнтів концентрації, а частинні характеристики розподілу – коефіцієнти локалізації – роль окремих груп або одиниць розподілу у формуванні узагальнювальної міри концентрації.

Динаміка цих характеристик розподілу дає змогу визначити тенденції розвитку пропорційності результатів інвестиційної діяльності під впливом розподілу окремих чинників і на цій основі обґрунтувати управлінські рішення щодо підвищення ефективності розподілу як чинника загальної ефективності інвестиційної діяльності.

Як зазначалося, під час аналізу взаємозв'язку двох розподілів модель пропорційності складається з двох показників: частки результативної ознаки $d'_{\text{рез}}$ та частки факторної ознаки $d'_{\text{фак}}$.

Відповідні коефіцієнти локалізації: $\hat{E}_{\text{еіе}} = \frac{d'_{\text{оае}}}{d'_{\text{оае}}}$.

Групування регіонів за чисельністю населення та обсягом прямих іноземних інвестицій у 2006 р.

Групи регіонів за чисельністю населення, млн осіб	Частка регіонів у загальній їх кількості $d_p, \%$	Частка прямих іноземних інвестицій у загальному їх обсязі $d_i, \%$	$\hat{E}_{ei\epsilon} = \frac{d_i}{d_p}$	$ d_i - d_p $
До 1	7,4	0,9	0,115	0,066
1–2	59,3	31,0	0,524	0,282
2–3	25,9	55,2	2,129	0,293
3–4	3,7	5,8	1,576	0,021
Понад 4	3,7	7,1	1,910	0,034
Разом	100,0	100,0	—	0,696

У складі коефіцієнтів локалізації вирізняються дві групи зі значеннями $K_{\text{лок}} < 1$ і $K_{\text{лок}} > 1$, тобто з від'ємними та додатними значеннями пропорційності розподілу у конкретній групі інвестиційної діяльності.

Для визначення їх впливу на загальну концентрацію у кожній групі розраховуються суми модулів:

$$D^- = \sum_K |d_{\text{дв}} - d_{\text{дв}}|; \quad D^+ = \sum_K |d_{\text{дв}} - d_{\text{дв}}|.$$

Визначається частка цих сум у загальній сумі відхилень:

$$\dot{I}^- = \frac{D^-}{\sum_K |d_{\text{дв}} - d_{\text{дв}}|}; \quad \dot{I}^+ = \frac{D^+}{\sum_K |d_{\text{дв}} - d_{\text{дв}}|}.$$

Ці показники дають характеристику ролі цих груп у формуванні як від'ємних, так і додатних характеристик розподілу і використовуються під час розроблення відповідних управлінських рішень.

Досліджуючи багатофакторну пропорційність, доцільно використовувати комбіновану модель, в яку входять одна результативна ознака і сукупність факторних ознак. Відповідно розраховується сукупність коефіцієнтів локалізації:

$$\hat{E}_{ei\epsilon}^1 = \frac{d_{\text{дв}}}{d_{\text{дв}}^1}; \quad \hat{E}_{ei\epsilon}^2 = \frac{d_{\text{дв}}}{d_{\text{дв}}^2}$$

з відповідним коефіцієнтом M :

$$\dot{I}^- = \frac{D^{1-}}{\sum_K |d_{\text{дв}} - d_{\text{дв}}|}; \quad \dot{I}^+ = \frac{D^{1+}}{\sum_K |d_{\text{дв}} - d_{\text{дв}}|}.$$

Це дає змогу дати диференційовану оцінку формування взаємозв'язку розподілу результату із сукупністю факторних ознак, зокрема ранжи-

рувати факторні ознаки за мірою взаємозв'язку і впливу на розподіл результативної ознаки. Наприклад, на підставі наведених даних про групування регіонів за чисельністю населення і обсягом прямих іноземних інвестицій у 2006 р. (табл. 3) необхідно розрахувати коефіцієнти локалізації та концентрації розподілів прямих іноземних інвестицій і регіонів за чисельністю населення.

Розв'язання. Обчислюємо коефіцієнт концентрації

$$\hat{E}_{ei\epsilon} = \frac{1}{2} \sum |d_i - d_p| = \frac{1}{2} 0,695 = 0,348.$$

Коефіцієнт концентрації становить 34,8%. Найбільше прями іноземні інвестиції сконцентровані у семи областях з чисельністю населення 2–3 млн осіб, помітно менше — в областях із чисельністю 3–4 млн і понад 4 млн осіб. Зовсім незначна концентрація в регіонах з чисельністю населення менше 2 млн осіб. Загалом за сукупністю регіонів концентрація розподілу прямих іноземних інвестицій помірна.



Література

1. Закон України "Про інвестиційну діяльність" від 18 вересня 1991 р. № 1560-XII // ВВР України. — 1991. — № 47. — Ст. 646.
2. Головач А. В., Захожай В. Б., Головач Н. А. Статистичне забезпечення управління економікою: прикладна статистика: Навч. посіб. — К.: Вид-во КНЕУ, 2005. — 333 с.
3. Статистичний щорічник України за 2006 рік / Держкомстат України / За ред. О. Г. Осауленка. — К.: CD — Інфо-диск, 2007.
4. Статистика. Збірник індивідуальних завдань з використанням Excel: Навч.-метод. посіб. для самостійного вивч. дисципліни. — К.: Вид-во КНЕУ, 2005. — 268 с.

Таким чином, запропонований підхід дозволив дати оцінку пропорційності розподілу за видами економічної діяльності. Разом з тим дослідження показало, що аналогічний аналіз може бути використаний і для аналізу дослідження пропорційності і за іншими розподілами — регіональним, галузевим тощо.

Таким образом, предложенный подход позволил дать оценку пропорциональности распределения по видам экономической деятельности. Вместе с тем исследование показало, что аналогичный анализ может быть использован и для анализа исследования пропорциональности и по другим распределениям — региональным, отраслевым и т. п.

Thus, offered approach allowed giving the estimation of proportion of division after the kinds of economic activity. At the same time, research showed that a similar analysis can be used and for the analysis of research of proportion and after other divisions — regional, industry and others like that.

Надійшла 26 червня 2007 р.