

УДК 332.14

ПРАКТИКА ПЛАНУВАННЯ СТРАТЕГІЧЕСКИХ МЕРОПРИЯТТЯЙ СОЦІАЛЬНО-ЕКОНОМІЧЕСКОЇ ПОЛІТИКИ
РАЗВИТИЯ РЕГИОНОВ

Коляденко С.В., проф., докт. економ. наук, зав. каф. економічної кібернетики Вінницький національний аграрний університет

Постановка проблеми в общем виде: Безусловно, далеко не все вопросы ранжирования и рейтинга могут быть решены с помощью формализации процедур сбора и обработки экспертной информации. Однако, корректное использование экспертных технологий и различных методик оценки рейтинга во многих случаях остается единственным реальным способом подготовки и принятия обоснованных инвестиционных решений.

Существует достаточно большое количество работ, авторы которых рассматривают адекватность экспертного оценивания при решении разнообразных управленческих проблем и особенностей применения в различных сферах деятельности /1-3/. Очевидна необходимость выделить очень важный аспект методологии формирования и определения интегрального показателя оценки уровня экономической безопасности региона с точки зрения объективности используемого информационного обеспечения. Это непосредственно связано с проблемами информационных войн (inform war). Исследование вопросов объективности оценки социально-экономического состояния, как в стране, так и в отдельном регионе позволяет формировать определенные критерии выбора инвестиционных вложений. «Информационные войны» являются реальным инструментом в современной конкурентной борьбе. Они затрагивают интересы практически всех участников инвестиционного процесса. Одной из основных проблем этого процесса в Украине является оптимизация соотношения источников инвестирования.

При формировании инвестиционных региональных и отраслевых фондов в стране данные, предоставленные инвесторам (с точки зрения информационного обеспечения) должны отвечать следующим требованиям: достоверность, своевременность, информативность, однозначность, сопоставимость.

Проблема заключается в выделении направления анализа для группы разнородных социально-экономических показателей. Потребности исследователей при выборе подобного рода данных не ограничиваются изучением связи простых переменных, измеренных по единой шкале. Как правило, необходимо рассматривать не только отдельные признаки, но и группы переменных.

Формулировка цели статьи: Как правило, началом этапа исследования сложных социально-экономических объектов при формировании направлений инвестиционных вложений является анализ коэффициентов связи между парами анализируемых показателей. Для разнотипных данных (в плане использования различных шкал измерения) формирование сравнимых между собой коэффициентов представляет определенную трудность.

Обычно измеряют взаимосвязь номинального признака, допускающего взаимно-однозначные преобразования, с количественным, ранговым с ранговым и т.п. Иногда проведение ранжирования и рейтингового исследования для удобства анализа данных разного типа рассматриваются в качественных шкалах либо подвергаются процедурам количественной оценки.

Изложение основного материала: Одной из основных задач является определение общего критерия оценок социально-экономических показателей инвестиционной привлекательности. Дальнейшее развитие этой задачи - определение допустимости операций, необходимых для отыскания результирующих оценок над числами, полученными в результате измерений. Это, в общем-то, и составляет проблему адекватности различного типа рейтингов.

В настоящее время существует достаточно большое количество методик формирования рейтингов, классов, упорядочивания, аккредитаций организаций на уровне глобальных социально-экономических систем, систем национальной региональной экономик.

Исходя из данных официальной статистики и опроса топ-менеджеров ведущих компаний мира всемирный экономический форум (WEF, известный по проведению ежегодного форума в Давосе) составляет два рейтинга - «Индекс перспективной конкурентоспособности» - «ИПК» (Growth Competitiveness Index - GCI), оценивающий перспективы экономического роста стран на 5-8 лет, и «Индекс деловой конкурентоспособности - ИДК» (Business Competitiveness Index - BCI), который является индикатором, определяющим способность страны удерживать уровень экономического процветания. GCI складывается из оценок макроэкономической ситуации, качества государственных институтов и способности страны создавать и внедрять новые технологии, BCI оценивает деятельность и качество бизнес-среды, опираясь преимущественно на оценки национальной бизнес-элиты. Рейтинг конкурентоспособности рассчитывается с 1979 года и строится на основе оценок совокупности различных показателей, которые определяют возможности страны по созданию условий для быстрого экономического роста. В системе IMD (International Institute for Management and Development) они группируются в четыре блока факторов: экономические показатели, эффективность деятельности правительства, эффективность бизнеса, инфраструктурные составляющие развития (оценка в 2010 году проводилась по 314 критериям). Необходимо отметить, что IMD не включает в свой список Украину, учитывая невозможность получения данных для вычисления всех критериев. Согласно данным отчета WEF Украина согласно индексу ИПК в 2011 г. занимала 59 место, индексу ИДК в 2012 г. занимала 72 место, а в 2005 г. - 75 место относительно 116 стран.

Полученная от экспертов информация, с точки зрения статистической надежности, должна быть проанализирована. Существуют методы оценки согласованности экспертных суждений, высказанных в виде ранжирований, парных сравнений и т.д. Обычно устанавливается связь между различными коэффициентами, характеризующими согласованность экспертных суждений по различным мерам близости. На основании оценки степени согласованности экспертных суждений определяются согласованные группы экспертов.

Методология использования методов оценки непротиворечивости экспертных суждений особенно важна при использовании метода парных сравнений. Существуют методы оценки сравнительной точности экспертных суждений при использовании множества критериев оценки точности. Можно говорить о проблемности решения оценки степени конъюнктурности, конформизма и других факторов, характеризующих адекватность экспертной информации /4-10/.

Объективность эксперта может достигаться в процедурах с помощью учета возможной конъюнктурности эксперта. Очень часто встречаются экспертизы при существовании количества привлеченных экспертов, которые объективно не заинтересованных в результате экспертизы. Это приводит к тому, что эксперты, привлеченные для участия в оценивании, могут быть прямо либо косвенно заинтересованы в ее результатах. Поэтому перспективным направлением является использование методов оценки качества эксперта, основанных на сопоставлении результатов самооценки экспертов с результатами их участия в текстовых экспертизах /11-13/.

Стратегии инновационных организаций определяются задачами, целями (глобальными, национальными, региональными, отраслевыми и т. п.), которые они стремятся достигнуть. При этом необходимо учитывать следующие особенности использования технологий экспертного оценивания в социально-экономической динамике развития региона.

1. Очевидным является сочетание различных методов оценивания, возникающая при организации и проведении экспертиз социально-экономической информационной пространства регионов

2. Необходимость алгоритма, когда сначала определяется состав критериев выбора, характеризующих сравнительную предпочтительность инновационных проектов, а затем устанавливается их сравнительная значимость при принятии решения.

3. Регулярное проведение экспертиз вызывает необходимость формирования информационной базы знаний об экспертах. При этом целесообразно формировать рейтинг: на основании предварительной информации; по результатам работы экспертного совета.

4. Многовекторность интересов вкладчиков при проведении инновационного конкурса (инициаторами проведения могут быть: отраслевые министерства, региональные и районные образования в лице администрации) вызывает необходимость дополнительного анализа альтернативных вариантов финансирования для объективизации и повышения обоснованности инвестиционных решений.

5. Сравнительная весомость факторов рынка учитывается при определении ожидаемых тенденций развития оцениваемой ситуации, что вызывает необходимость использования более сложных зависимостей между факторами при анализе их действия на развитие ситуации.

6. Оценка ожидаемых значений факторов, показателей и параметров во многом определяются условиями, при которых такие оценки производятся. Совокупность этих условий описывается наиболее вероятными сценариями развития ситуации инвестирования. Их определение и описание является объектом самостоятельной экспертизы.

7. Вопрос повышения надежности результатов экспертизы часто требует дополнительного анализа. В ряде случаев используются методы организации и проведения экспертиз, позволяющие оценивать степень противоречивости экспертных оценок инвестиционных проектов.

Метод получения согласованного мнения экспертов – это обычно одна из реализаций процедуры Делфи, ориентированная на получение согласованного мнения групп экспертов относительно определенных событий в той или иной области деятельности в заданный период будущего. Недостатком этого метода является изначальное отсутствие исследований, малое внимание, уделяемое взаимозависимости и взаимодействию различных факторов, динамике развития ситуации.

Агентство Moody's Investors Service в 2008г. решило изменить методики расчета рейтинговых сложных финансовых инструментов, из-за которых фактически возник кризис на мировых финансовых рынках. Необходимость технологии выставления рейтингов назревала давно, но, в первую очередь, к необходимости подобных изменений агентство подтолкнули события 2009 года в области ипотечного кредитования в США и колебаний цен на мировом рынке энергоносителей. Инвесторы, клиенты и рыночные регуляторы США, стран Евросоюза, пользующиеся рейтингами крупнейших агентств Moody's, S&P и Fitch для определения политики инвестирования, все чаще критикуют авторов экспертных оценок в их необъективности.

Предлагается использовать единый способ интерпретации коэффициентов оценки связи параметров и оценок, измеренных в различных шкалах, путем вычисления их статистической значимости. Это позволяет воспринимать абстрактные значения показателей связи в едином измерении как вероятность случайно получить величину коэффициента, в условиях независимости большую, чем рассчитанная с помощью эмпирических данных. Следовательно согласование коэффициентов на такой основе обеспечивает «одинаковое восприятие» ощущения силы взаимосвязи независимо от типа данных. Основной предпосылкой является метод описанный [14] для применения односторонних критериев значимости при построении коэффициентов связи на базе комбинаторного подхода.

Пусть $k(a, b)$ - произвольный коэффициент, характеризующий взаимосвязь a и b ; v - случайное значение k в условиях независимости аргументов и случайности выборки. Значимость $z(a, b)$ определяется как вероятность получить v не меньше чем $k(a, b)$, т.е. $z(a, b) = P\{v \geq k(a, b)\}$.

Известно, что в условиях нормального распределения признака a примерно 70% разброса оценок, a находится в пределах симметричного вероятностного поля относительно среднего интервала $(\bar{a} - s, \bar{a} + s)$, около 95% в пределах интервала $(\bar{a} - 1,96 s, \bar{a} + 1,96 s)$, аналогичное представление об оценках параметров моделей дают стандартные ошибки (s - обозначает оценку среднеквадратичного отклонения a).

Преобразование величины значимости связи с помощью функции, обратной функции распределения нормального закона $f(a, b) = \Phi^{-1}(1 + z(a, b))$ позволяет перейти от меры связи $k(a, b)$ к величине, выраженной такими же соотношениями. В данном случае преобразование Φ^{-1} носит нормирующий характер. Определим функцию $f(a, b)$ как стандартизацию коэффициента связи k . Таким образом $f(a, b)$ определяет отклонение от независимости в стандартных единицах. Нулевое значение f соответствует медиане v - в 50% случаев можно в условиях независимости показателей получить значение v , больше чем $k(a, b)$. Например равенство $f(a, b) = 1$ показывает, что значимая величина связи может быть случайно обнаружена в 16% ситуаций, а вероятность $P\{f(a, b) \geq 1,96\}$ составляет около 2,5%.

В качестве приближенного определения стандартных показателей используют известные выражения, связывающие различные виды распределения с нормальным. В определенных ситуациях это приводит к некоторым ограничениям на теоретическое распределение данных, когда присутствует двумерная нормальность при стандартизации коэффициента корреляции. Применение формул аппроксимации позволяет получать величины стандартизованных показателей для очень малых величин значимости, таких, при которых инвестиционные показатели приобретают эвристический характер, поскольку аппроксимация становится недостаточно точной, при этом возможно возникает необходимость в использовании методов теории игр.

Незначительные оценки стандартизованных показателей статистической значимости необязательно свидетельствуют об отсутствии связи или о малой зависимости данных (оценок). Возможны варианты использования неадекватной модели для вычисления и формирования общего критерия рейтинга. Однако большие по абсолютной величине отрицательные показатели свидетельствуют, как правило, о принципиальном характере независимости.

Определяющим является решение задач оценивания степени конъюнктурности, конформизма и других факторов, определяющих объективность процедур экспертизы.

РЕЗЮМЕ

Наводяться основні положення планування стратегічних заходів при розробці політики соціально-економічного розвитку регіонів. Досліджуються визначення і зміст принципів планування та розвитку регіонів.

Ключові слова: соціально-економічний розвиток регіону, планування розвитку, стратегічні заходи.

РЕЗЮМЕ

Приводятся основные положения планирования стратегических мероприятий при разработке политики социально-экономического развития регионов. Исследуются определения и содержание принципов планирования и развития регионов.

Ключевые слова: социально-экономическое развитие региона, планирование развитие, стратегические мероприятия.

SUMMARY

The principal activities of strategic planning in the development of policies of social and economic development of regions. Explores the definition and content of the principles of planning and regional development.

Keywords: socio-economic development of the region, development planning, strategic activities.

СПИСОК ИСТОЧНИКОВ:

1. Герасимчук З.В. Політика розвитку проблемних регіонів: Монографія / З.В. Герасимчук, В.Л. Галушак. – Луцьк: Надтир'я, 2006. – 244с.
2. Сидельников Ю.В. Теория и организация экспертного прогнозирования / Ю.В. Сидельников. – М.: ИММО АН СССР, 1990. – 195с.
3. Литвак Б.Г. Экспертные технологии в управлении: учебное пособие / Б.Г. Литвак. – М.: Дело, 2004. – 400 с.
4. Активізація інноваційної діяльності: організаційно-правове та соціально-економічне забезпечення: Монографія / О.І. Амоша, В.П. Антонюк, А.І. Земляк та ін. // НАН України. Ін-т економіки пром-сті. – Донецьк, 2007. – 328 с.
5. Рейтинг міст і регіонів України. Рейтингова агенція НАЦ «Інститут реформ». – К.: 2005. – 66 с.
6. Моделі і методи соціально-економічного прогнозування / В.М. Гесць, Т.С. Клебанова, О.І. Черняк та ін. – Харків: ВД «ІНЖЕК», 2005. – 396с.
7. Новикова О.Ф. Економічна безпека: концептуальне визначення та механізм забезпечення: Монографія / О.Ф. Новикова, Р.В. Покотиленко // НАН України. Ін-т економіки пром-сті. –Донецьк, 2006. – 408 с.
8. Кашпур А. Информационные войны / А. Кашпур // &Стратегии. – К.: Издательский дом «Максимум», 2007. – № 10(68). – С. 52-57.
9. Кизилова Л.О. Шляхи удосконалення політики інвестування в регіонах України / Л.О. Кизилова, Ю.І. Мізів // Коммунальное хозяйство городов: науч.-техн. сб. Вып. 77. – К.: Техника, 2007. – С. 80-88.
10. Литвак Б.Г. Экспертная информация: методы получения и анализа / Б.Г. Литвак. – М.: Радио и связь, 1982. – 184 с.
11. Annual Report World Economic Forum, 2005, - V. 17.
12. Lerman I.C. Combinatorial Analysis in the statistical Treatment of Behavioral Data // Quality and Quantity, 1980. – V. 14. – №3.
13. Закс Л. Статистическое оценивание / Л. Закс. – М.: Статистика, 1976. – 598 с.
14. Фісун К.А. Методологія програмування розвитку регіонів України: Монографія / К.А. Фісун. – Харків: ХНАМГ, 2007. – 401 с.

УДК 330.322.011 (477)

МЕЖДУНАРОДНАЯ ИНВЕСТИЦИОННАЯ ПОЗИЦИЯ УКРАИНЫ НА МИРОВОМ ФИНАНСОВОМ РЫНКЕ

Кучеренко В.В., аспирант кафедры международной экономики, Донецкий национальный университет

Актуальность темы исследования. Концептуальная основа Международной инвестиционной позиции (МИП) была представлена в пятом издании Руководства по платежному балансу (РПБ5) международного Валютного Фонда (МВФ) в 1993 году и была отражением возросшего интереса к данным об уровнях или состоянии иностранных инвестиций, в том числе и внешнего долга. В то время как многие государства-члены внедрили рекомендации РПБ5 в отношении статистики платежного баланса, реализация рекомендаций по составлению МИП продвигается более медленными темпами. Как платежный баланс, так и международная инвестиционная позиция дают полезную информацию для оценки экономических взаимоотношений страны с остальным миром. В платежном балансе отражаются операции между резидентами и нерезидентами страны (так называемые «внешние операции») за определенный период. Операции с финансовыми активами и обязательствами отражаются по финансовому счету платежного баланса [5].

Цель исследования состоит в анализе международной инвестиционной позиции Украины на современном этапе в контексте формирования национальной инвестиционной политики в условиях глобальных долговых вызовов и финансовой нестабильности.

Основная часть. Международная инвестиционная позиция Украины составляется во исполнение общего постановления Национального банка Украины и Кабинета Министров Украины от 17.03.2000 № 517 «О составление платежного баланса» и постановления Национального банка Украины от 14.10.2003 № 444 «Об утверждении Правил составления и предоставления отчетности Международному валютному фонду», начиная с 2001 г. Начиная с 1997 года Национальным банком Украины начата работа по формированию методики и информационной базы для составления международной инвестиционной позиции Украины [7].

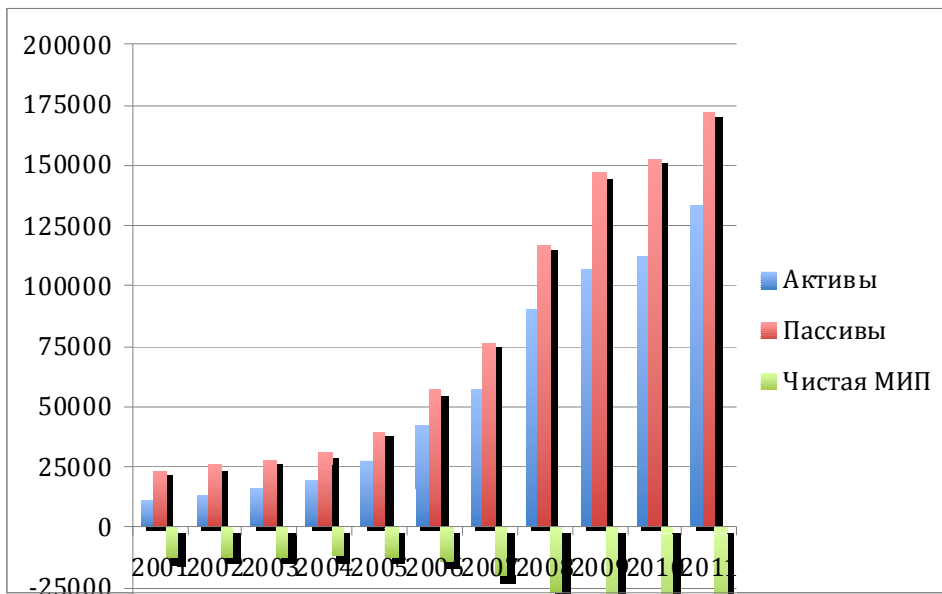


Рис. 1. Динамика международной инвестиционной позиции Украины с 2001 по 2011 гг., млн. долл. США [6]

По состоянию на 01.10.2011 г. чистая международная инвестиционная позиция Украины находилась на отметке -43537 млн. долл. США (рис. 1). За период с 2001 Украина не имела положительного значения чистой международной инвестиционной позиции.