Методология статистического исследования инвестиционных процессов в регионах

тема диссертации и автореферата по ВАК 08.00.12, доктор экономических наук Сивелькин, Виталий Алексеевич

**Год:**

2005

**Автор научной работы:**

Сивелькин, Виталий Алексеевич

**Ученая cтепень:**

доктор экономических наук

**Место защиты диссертации:**

Москва

**Код cпециальности ВАК:**

08.00.12

**Специальность:**

Бухгалтерский учет, статистика

**Количество cтраниц:**

394

## Оглавление диссертации доктор экономических наук Сивелькин, Виталий Алексеевич

Введение.

Глава 1. Теоретические аспекты статистического анализа инвестиционных процессов в регионах России.

1.1. Инвестиционная привлекательность региона, как объект статистического исследования.

1.2. Проблемы анализа структуры инвестиционных процессов на региональном уровне.

1.3. Особенности развития Оренбургской области, как приграничной зоны России.

Глава 2. Проблемы построения системы показателей региональных инвестиций.

2.1. Основные концепции формирования априорной информации для статистического исследования.

2.2. Формирование иерархической системы сравнительных показателей инвестиционного климата.

2.3. Создание подсистемы показателей устойчивости экономического развития региона.

2.4. Методология статистического построения обобщающего индикатора эффективности региональных инвестиций.

Глава 3. Статистический анализ структуры инвестиций в основной капитал субъектов Российской Федерации.

3.1. Методические аспекты анализа структуры инвестиций.

3.2. Статистический анализ структурных сдвигов в инвестициях.

3.3. Статистический анализ различий региональных структур инвестиций от общероссийской структуры.

3.4. Структурный анализ динамики инвестиций Оренбургской области.

Глава 4. Методология статистического анализа инвестиционного климата в регионе.

4.1. Построение интегральных показателей инвестиционного климата региона.

4.2. Межрегиональные сопоставления инвестиционной привлекательности субъектов Российской Федерации.

4.3. Статистический анализ инвестиционной активности регионов Приволжского федерального округа.

Глава 5. Эконометрическое моделирование инвестиционных процессов на региональном уровне.

5.1. Статистическое исследование экономических факторов, обеспечивающих рост объемов производства региона.

5.2. Методологические подходы к классификации регионов России по уровню развития инвестиционного потенциала.

5.3. Статистическое моделирование финансовой устойчивости и платежеспособности промышленного производства, как факторов инвестиционной привлекательности субъектов Российской Федерации.

5.4. Эконометрическое моделирование инвестиционных процессов на межрегиональном уровне.

Глава 6. Анализ динамики и прогнозирование инвестиционной привлекательности регионов.

6.1. Особенности задачи и методика статистического анализа динамики и прогнозирования инвестиций на региональном уровне

6.2. Анализ динамики инвестиций субъектов Приволжского федерального округа.

6.3. Прогнозирование инвестиций в основной капитал Оренбургской области.

## Введение диссертации (часть автореферата) На тему "Методология статистического исследования инвестиционных процессов в регионах"

Актуальность темы исследования. Эффективное экономическое развитие как регионов, так и России в целом во многом определяется научно-обоснованной государственной инвестиционной политикой, направленной на модернизацию экономики. Инвестиционная политика позволяет урегулировать вопросы повышения технического уровня производственных сфер, ускорения темпов экономического роста, преодоления диспропорций, структурно-техническойнесбалансированности, обеспечения качественно новой структуры экономики, создания высокотехнологического инвестиционного комплекса.

Существующая многоаспектность и взаимозависимость происходящих процессов, например, таких как привлечение инвестиций в реальный сектор экономики при существенной неравномерности инвестиционной активности регионов, определяют потребность в разработке статистической модели, характеризующей инвестиционный климат наблюдаемых объектов. Для проведения межрегионального анализа в статике и динамике возникает необходимость создания иерархической статистической системы интегральных, обобщающих и частных показателей инвестиционного климата субъектов Российской Федерации, отвечающих требованиям сопоставимости.

С целью обоснования приоритетных направлений развития регионов, повышения адекватности принимаемых законодательных решений, выбора вариантов процедуры структурных реорганизаций для увеличения инвестиционной активности и привлекательности регионов необходима комплексная информация, характеризующая общую экономическую ситуацию, тенденции их экономического развития. Проблема заключается в оценке устойчивости экономического развития такой сложной системы, как регионы России. Одним из условий обеспечения устойчивости экономического развития региона является его инвестиционная активность и привлекательность.

Адекватное принятие решений в сфере приоритетного инвестирования деловой активности предполагает необходимость разработки системы оценочных показателей результатов региональной инвестиционной политики, критериев эффективности инвестиционных вложений. Это обуславливает актуальность разработки методологии статистического исследования эффективности региональной инвестиционной деятельности.

В экономике эффективность проводимой инвестиционной политики в регионе определяется выработкой определенной стратегии инвестирования и их освоения предприятиями реального сектора экономики региона. На момент исследования недостаточно разработаны методические рекомендации оценки экономической эффективности региональных инвестиций и их межтерриториальных сопоставлений. Региональные особенности, проявляющиеся при построении статистической оценки эффективности инвестиций, заключаются в существенной изменчивости факторов, определяющих своеобразное развитие экономики, трудового и ресурсного потенциалов регионов.

Инвестиционным проектам в части оценки их эффективности, рисков и доходности на микроуровне посвящено достаточно много работ отечественных и зарубежных ученых. Однако рассмотрению особенностей региональных инвестиций в современных условиях не уделено достаточного внимания. Это, прежде всего, относится к вопросам структуры инвестиций, инвестиционной привлекательности и эффективности, инвестиционного потенциала, оценки инвестиционного климата в регионе.

Теоретические аспекты анализа инвестиционной привлекательности региона определяют необходимость установления факторов, наиболее качественно отображающих исследуемый процесс, концепции формирования априорной информации, статистические подходы к построению интегральных характеристик, краткосрочному и среднесрочному прогнозированию инвестиций в основной капитал.

Приведенное выше свидетельствует об актуальности разработки методологии статистического исследования инвестиционного процесса в регионах.

Цель и задачи моделирования. Целью диссертационной работы является разработка методологии статистического исследования инвестиционного климата в регионах, его количественная оценка и прогнозирование.

В соответствии с целью поставлены и решены следующие задачи теоретического и прикладного характера: систематизированы и обобщены результаты исследования об инвестиционной привлекательности субъектов Российской Федерации; разработана методология статистического анализа региональных инвестиционных процессов; предложены концептуальные основы понятия и оценки инвестиционного климата в регионе; разработаны методические принципы построения системы показателей, характеризующих состояние экономики, и предложена концептуальная статистическая модель устойчивости экономического развития регионов; разработана и апробирована методика построения и анализа обобщающего индикатора эффективности региональных инвестиций; предложена методология анализа структуры инвестиционных процессов на региональном уровне; для оценки инвестиционного климата региона разработаны и апробированы методологические подходы к построению интегральных характеристик; разработана методика сравнительного анализа инвестиционной привлекательности субъектов Российской Федерации; разработаны методологические подходы к исследованию причинно-следственных связей между экономическими показателями и ростом объемов инвестиций в регионе; усовершенствована методика дифференциации регионов по инвестиционному потенциалу; предложена методика статистического анализа динамики и прогнозирования региональных инвестиций; разработана методология краткосрочного и среднесрочного прогнозирования объемов инвестиций в основной капитал для субъектов Российской Федерации.

Объектом исследования являются региональные инвестиционные процессы.

Предмет исследования - методология статистического анализа инвестиционных процессов на региональном уровне.

Теоретической и методологической основой исследования послужили труды отечественных и зарубежных ученых по статистике, экономической теории, инвестициям, эконометрики, финансовому и экономическому анализу.

При исследовании методологии статистического анализа инвестиционного процесса использовались труды таких известных российских экономистов как А.Н. Асаула, Ю.В. Богатина, А. Бандурина, B.C. Барда, М.К. Беляева, А.С. Булатова, Б.И. Вайсблат,

A.И. Гладышевского, Н.Б. Григорьевой, И.В. Гришиной, Т.Н. Даниловой, О.А. Дорошевич, Д.А. Ендовицкого, И.Б. Закс, В.Е. Лихтенштейна,

B.А. Швандара и др.

Автор в диссертационной работе руководствовался научными трудами широко известных специалистов в сфере прикладной статистики, и эконометрического анализа Т.Н. Агаповой, С.А. Айвазяна, В.Н. Афанасьева, О.Э. Башиной, И.К. Беляевского, Г.Л. Громыко, A.M. Дуброва, И.И. Елисеевой, М.Р. Ефимовой, С.Д. Ильенковой, М.В. Карманова, И.А. Корнилова, Г.Д. Кулагиной, В.И. Кузнецова, Ю.П. Лукашина, B.C. Мхитаряна, М.Г. Назарова, А.В. Прокофьева, Б.Т. Рябушкина, Ю.В. Сажина, А.Н. Устинова, А.А. Френкеля, М.М. Юзбашева и др.

Использовались также работы зарубежных авторов Р. Анжел, Е. Беркович, М. Бромвих, К. Гренджер, К. Доугерти, Б. Карсберг, Дж. Кендалл, Б. Кох, Дж. Куралл, Я. Магнус, Дж. Хамильтон, П. Холмес, М. Шефер, Й. Шумпетер, Р. Энгл и др.

В качестве исследовательского инструментария применялись многомерные статистические методы корреляционного, регрессионного, факторного и кластерного анализа, методы анализа временных рядов и прогнозирования, а также табличные и графические методы представления результатов исследования.

Обработка исходной информации проводилась с использованием пакетов прикладных программ статистического и эконометрического анализа: Statistica, SPSS, Statgrapch, Мезозавр, MS Excel.

Информационную базу исследования составили официальные статистические данные Федеральной службы государственной статистики, а также информация, опубликованная в периодической печати и в научно-информационных изданиях, размещенная на официальных сайтах сети Internet и в электронных средствах массовой информации.

Научная новизна исследования. Научная новизна диссертационной работы заключается в том, что в ней дано решение научной проблемы, которая имеет важное государственное значение для выработки региональной инвестиционной политики в экономике.

К числу наиболее существенных результатов, полученных лично автором и обладающих научной новизной, относятся следующие: обобщены теоретические положения статистики по инвестиционной привлекательности регионов; сформулирована и обоснована концепция формирования системы показателей, характеризующих инвестиционный процесс в субъектах Российской Федерации; предложен алгоритм разработки системы показателей инвестиционного климата в регионах; разработана методика построения обобщающих характеристик устойчивости экономического развития региона и шкала интерпретации частных показателей устойчивости; разработана методология анализа эффективности региональных инвестиций; предложен методологический подход к статистическому анализу структурных сдвигов инвестиций субъектов Российской Федерации; создана методология статистического анализа инвестиционной привлекательности и активности регионов; разработана и апробирована методология классификации регионов России по уровню инвестиционного потенциала; предложена и апробирована методика построения модели зависимости финансовой устойчивости промышленного производства регионов от их экономических показателей; построена эконометрическая модель инвестиционной активности промышленного производства региона, получены оценки влияния факторов на процесс ее формирования; предложена методология статистического анализа динамики показателей инвестиционной деятельности на региональном уровне; разработана и апробирована методология построения модели среднесрочного прогнозирования региональных инвестиций в основной капитал.

Практическая значимость результатов исследования. Разработанная методология комплексного статистического анализа инвестиционной привлекательности субъектов Российской Федерации использована администрацией Оренбургской области при реализации отраслевой инвестиционной программы «Развитие материальной базы строительного комплекса Оренбургской области в 2001 - 2003 годах», утвержденной законом Оренбургской области от 20 июня 2001 года № 267/298-П-ОЗ, Аппаратом полномочного представителя Президента Российской Федерации в Приволжском федеральном округе при выработке мер по регулированию региональных инвестиционных потоков, что подтверждается справками о внедрении.

Предложенная методология межрегиональной оценки инвестиционного климата может представлять интерес для Министерства экономического развития и торговли Российской Федерации, Министерства финансов Российской Федерации и Федеральной службы государственной статистики для научно-обоснованного принятия решений по управлению инвестиционными процессами на мезоуровне, а также при формировании бюджета, как механизма государственной поддержки инвестиций, федеральных целевых и региональных программ, регулирующих инвестиционную деятельность.

Основные положения и результаты научных исследований использовались в учебном процессе при чтении лекций по курсам «Статистика», «Теория статистики», «Социальная статистика», «Социально-экономическая статистика» в Оренбургском государственном университете (справки о внедрении имеются).

Апробация результатов исследования. Основные результаты исследования доложены и получили одобрение на 40 международных и всероссийских научно-практических конференциях, симпозиумах и семинарах, в их числе:

Региональная экономика: современное состояние и перспективы развития» (Воронеж, 2002 г.)

Отражая прошлое и настоящее: К 200-летию российской государственной статистики» (Новосибирск, 2002 г.)

Социально-экономические и правовые проблемы российских реформ» (Москва, 2002 г.)

Теория и практика становления региональной статистики» (Ростов-на-Дону, 2002 г.)

Методология преподавания статистики, эконометрики и математической экономики в вузах» (Сочи, 2003 г.)

Региональная статистика. Опыт, проблемы и перспективы развития» (Челябинск, 2003 г.)

Обеспечение устойчивого экономического и социального развития России» (Москва, 2003 г.)

Глобальные тенденции в статистике и математических методах: наука, практика и образование» (Санкт-Петербург, 2004 г.)

Россия как трансформирующееся общество: экономика, культура, управление (региональный аспект)» (Оренбург, 2004 г.)

Социально-экономические проблемы региона» (Иркутск, 2004 г.)

Проблемы качества экономического роста» (Самара, 2004 г.)

Публикации. Результаты исследования опубликованы в 74 работах общим объемом 101,74 п.л. (авторских 66,31 п.л.), в том числе, в двух монографиях объемом 18,2 п.л.

Структура и объем работы. Диссертационная работа состоит из введения, шести глав и заключения. Объем основного текста составляет 310 страниц, содержит 71 таблицу и 67 рисунков. Список использованной литературы включает 231 наименование.

## Заключение диссертации по теме "Бухгалтерский учет, статистика", Сивелькин, Виталий Алексеевич

Заключение

Современный период развития российской экономики при существующей взаимозависимости и многоаспектности инвестиционных и экономических факторов обуславливает приоритетное направление исследования инвестиционного климата регионов России. Стохастическая природа объекта исследования определяет необходимость комплексного рассмотрения структуры и эффективности инвестиционных процессов с позиции инвестиционной привлекательности регионов.

Повышение интереса к региональным аспектам исследования инвестиций обусловлено дифференциацией, неравномерностью, диспропорциональностью их развития. Рассмотренные в работе причины региональных различий, а также присущие субъектам России особенности функционирования в рыночных условиях определяют необходимость проработки вопросов формирования и использования инвестиций в регионе. Для этого предложена методология статистического анализа инвестиций региона, включающая следующие элементы: оценка состояния, информационного обеспечения реализации региональной инвестиционной политики, экономико-статистического и эконометрического моделирования.

Рассмотрены особенности развития Оренбургской области как приграничной зоны России, общие аспекты приграничного сотрудничества и схема приграничной инфраструктуры Оренбургской области. Установлено, что в целом для инвестиций в основной капитал области характерно пилообразное распределение по месяцам, т.е. если в каком-либо месяце осуществлялись инвестиции в основной капитал, то в последующем месяце они были намного ниже, чем в предыдущем месяце. Выбросы отмечались в марте 2001 г. и декабре 2004 г. в основном за счет приобретения дорогостоящего оборудования крупными и средними предприятиями при их модернизации, или реконструкции.

В диссертации сформулированы принципы отбора показателей для исследования региональных инвестиций и разработана соответствующая система показателей. Для регионов Приволжского и Уральского федеральных округов выявлена динамика структуры финансово-экономических процессов как фактора, определяющего объемы производства. Определен обобщающий показатель инвестиционной привлекательности для федеральных округов России, на основе которого проведено их ранжирование. Аналогично построены показатели инвестиционной привлекательности для субъектов Приволжского федерального округа и выявлены регионы, наиболее привлекательные для инвесторов, к которым отнесены Пензенская, Кировская и Саратовская области.

Предложена методология оценки устойчивости экономического развития региона. Разработаны показатели производственно-технической, экономической, финансовой устойчивости. Для каждой характеристики устойчивости определены следующие элементы: для производственно-технической устойчивости - это индикаторы технологического уровня и трудового потенциала; для экономической устойчивости - это эффективность производства, уровня рентабельности и инвестиционной активности; для финансовой устойчивости - это уровень финансовой устойчивости и платежеспособности. Для интерпретации результатов предложена шкала оценки устойчивости экономического развития региона, которая апробирована на примере регионов Приволжского федерального округа. На ее основании получено распределение регионов, которое свидетельствует о том, что в 2003 г. по сравнению с 2002 г. происходило перераспределениетерриторий в сторону повышения устойчивости экономического развития. В количественном аспекте это увеличение числа территорий с тенденцией к повышению за счет перегруппировки субъектов Федерации. Среди наблюдаемых территорий Оренбургская область по устойчивости экономического развития в 2003 г. находилась на 10-м месте (в 2002 г. - на 8-м).

Предложена модель оценки экономической эффективности региональных инвестиций и методика межрегиональных сопоставлений экономической эффективности. На основе полученных оценок установлено, что чем больше разрыв в темпах прироста ВРП и инвестиций в сторону увеличения последних, тем ниже коэффициент эффективности инвестиций. За период с 1999 г. по 2003 г. произошла существенная перегруппировка регионов ПФО по анализируемой эффективности. Субъекты Федерации первой группы обладают отрицательным значением межрегиональной экономической эффективности инвестиций, обусловленной снижением темпов прироста ВРП. Территории, вошедшие во вторую группу, близки к экономической эффективности по всему ПФО. Регионы последней, четвертой, группы резко отличаются эффективностью от ПФО в целом, т.е. эффективность у них намного выше, чем у наблюдаемой совокупности.

Выявлены основные типы структур, наиболее часто подвергаемые анализу на региональном уровне. К ним можно отнести региональную структуру экономики, структуру инвестиций, включая иностранные инвестиции, институциональную и территориальную структуры. Рассмотрены методологические аспекты особенностей определения количественной оценки структурных сдвигов и структурных различий для региональных инвестиций. Распределение 88 субъектов Российской Федерации по доле инвестиций в основной капитал в разрезе форм собственности установило уменьшение удельного веса государственной формы собственности в инвестициях в основной капитал. Эта закономерность наблюдается и в России, что свидетельствует о формировании рыночной инфраструктуры в регионах Российской

Федерации. Оценка их мобильности направлена на выработку эффективной структурной политики в регионах. Анализ структурных сдвигов инвестиций в основной капитал по формам собственности федеральных округов и 88 субъектов Федерации показал, что при постоянной базе сравнения малые структурные сдвиги отмечались лишь на двух территориях, существенные - на 71 территории, большие структурные сдвиги - на 15 территориях. Построены группировки 88 субъектов Федерации по показателям линейного структурного сдвига инвестиций в основной капитал по отраслям экономики и иностранных инвестиций по видам за период с 1998 г. по 2000 г. По результатам расчетов региональных структурных различий инвестиций от общероссийской структуры можно сделать вывод, что в регионах России происходят процессы разгосударствления экономики и создаются условия для эффективного функционирования рыночной системыхозяйствования.

Сформирована иерархическая система показателей для сравнительной оценки инвестиционного климата в регионе, которая состоит из четырех уровней. На ее основе разработана схема вложенности показателей инвестиционного климата в регионе: частная, обобщающая, частная интегральная и интегральная. Разработаны методологические рекомендации отбора факторов в иерархическую систему. Предложена методология построения интегрального показателя инвестиционного климата. Ее апробация проведена по субъектам Приволжского и Уральского федеральных округов. Выполнена группировка объектов наблюдения по интегральному показателю инвестиционного климата. Исследована вариация частных и интегральных показателей инвестиционного климата. Установлено, что наиболее однородны наблюдаемые субъекты Федерации по частному интегральному показателю инвестиционного потенциала. Существенная вариация анализируемых объектов отмечалась по инвестиционным рискам, причем наибольшие риски отмечались в Курганской области (оценка приняла наименьшее значение 1,049) и наименьшие в Республике Башкортостан (оценка приняла наибольшее значение 2,828). В 2003 г. интегральный показатель инвестиционного климата выше среднего значения (1,2) наблюдался на восьми территориях, входящих в Приволжский и Уральский федеральные округа, а среднее значение - у Саратовской области.

Проведено межрегиональное сравнение инвестиционной привлекательности субъектов Федерации с учетом сопоставимости данных. По этим оценкам определены рейтинги регионов. Анализ абсолютных отклонений обобщающих показателей регионов Приволжского и Уральского федеральных округов от общероссийских показал, что регионы более приближены к российскому уровню по следующим относительным индикаторам (в процентах к ВРП): платные услуги; инвестиции в основной капитал; доходы консолидированного бюджета субъекта Федерации; продукция, подвергавшаяся усовершенствованию; удельный вес полностью изношенных основных фондов. Анализ показал, что 72% наблюдаемых регионов характеризовалось инвестиционной непривлекательностью, из них шесть объектов можно считать слабо привлекательными. Методика оценки инвестиционной привлекательности регионов направлена на активизацию инвестиционной деятельности в регионе.

Предложена система показателей инвестиционной активности и определены их количественные оценки для регионов. Апробация методики выполнена на примере регионов Приволжского федерального округа в динамике. Установлены субъекты Федерации с высокой, средней и низкой инвестиционной активностью. В 2003 г. наибольшая инвестиционная активность прослеживалась в Оренбургской области, причем в динамике (с 1999 по 2003 гг.) в первые два года наблюдалась тенденция увеличения степени ее активности, в последующие два года - снижение и далее резкое увеличение. В пяти регионах инвестиционная активность растет первые три года, а затем снижается.

В среднем за пять лет (1999 - 2003 гг.) по инвестиционной активности на первом месте находилась Республика Татарстан и Оренбургская область, на втором - Республика Мордовия и Самарская область, на третьем - Удмуртская Республика.

Модель активности промышленного производства субъектов Центрального, Приволжского, Уральского федеральных округов позволяет учесть причинно-следственные связи между объемами промышленного производства, уровнем рентабельности реализованной продукции (работ, услуг) и инвестиций в основной капитал. Рекурсивная система одновременных уравнений выявила статистическую связь между инвестициями в основной капитал, финансовыми вложениями и иностранными инвестициями.

Построены корреляционные плеяды для экономических и природно-ресурсных показателей на примере 88 субъектов Российской Федерации. Установлены непосредственные и опосредованные связи между анализируемыми индикаторами. В результате установлено, что инвестиционные факторы коррелируют практически со всеми рассмотренными показателями и оказывают на них существенное влияние. Проведено исследование дифференциации 88 регионов России по уровню развития инвестиционного потенциала. Методом кластерного анализа построены многомерные классификации субъектов Федерации: по уровню экономического развития; финансовой деятельности и природно-ресурсного состояния, определяющих инвестиционную привлекательность. Выявлены субъекты Российской Федерации с высоким уровнем экономического развития. Установлены кластеры для регионов России с высоким, средним и низким уровнем инвестиционного потенциала. Выполнено ранжирование наблюдаемых регионов по интегральному показателю уровня экономического развития. Проведена классификация 88 регионов России по устойчивости и платежеспособности их предприятий.

Приведены методологические рекомендации по анализу динамики и прогнозированию инвестиций в регионе. Проведен анализ колеблемости и устойчивости развития показателей инвестиционной активности и эффективности, выявлен тип колеблемости для субъектов Приволжского федерального округа. Выполнена экстраполяция показателей инвестиционной активности для наблюдаемых регионов ПФО, на основе которой установлено, что в 2003 г. наиболее инвестиционно активными будут Республика Марий Эл, Пензенская и Самарская области.

В диссертации построены модели прогнозирования и получен прогноз инвестиционной эффективности для 14 субъектов ПФО. При прогнозировании рассматривались методы экстраполяции, экспоненциальное сглаживание и АРПСС. Предложена схема прогнозирования региональных инвестиций. Для индекса физического объема инвестиций в основной капитал в Оренбургской области по статистическим критериям адекватности и прогностическим свойствам наилучшими оказались модель аддитивного экспоненциального сглаживания и модель Бокса и Дженкинса. Для индекса физического объема инвестиций в основной капитал Оренбургской области в эмпирических данных прослеживается высокая флуктуация признака. На основании тренда можно сделать вывод, что незначительное снижение объемов инвестиций отмечается за период 1959 - 1961 гг., существенное -1976 - 1979 гг., резкое - 1988 - 1994 гг.; заметное повышение анализируемых объемов наблюдается за период 1962 - 1975 гг., незначительное - 1980 - 1987 гг. и высокое - 1995 - 2002 гг. В последующие годы будет наблюдаться снижение объемов инвестиций в основной капитал области.

В 2004 г. индекс физического объема инвестиций в основной капитал в процентах к предыдущему году будет составлять 97,4%, нижняя граница - 94%, верхняя - 100,8%; в 2005 г. соответственно 96,7%, нижняя граница будет составлять 89,7%, верхняя - 103,8%; в 2006 г. - 96,4%, 85,9%, 106,9%.

Проведена оценка адекватности этих моделей. Выполнена экстраполяция для показателя инвестиций в основной капитал, представленного в абсолютном выражении, индексом цен и индексом физического объема. Приведен содержательный анализ оценкам качества и точности моделей.

## Список литературы диссертационного исследования доктор экономических наук Сивелькин, Виталий Алексеевич, 2005 год

1. Агапова Т.Н. Методы статистического изучения структуры сложных систем и ее изменения. М.: Финансы и статистика, 1996.

2. Агеенко А.А. Методологические подходы к оценке инвестиционной привлекательности отраслей экономики региона и отдельных хозяйствующих субъектов // Вопросы статистики. 2003. № 6. С. 48-51.

3. Айвазян С.А. Экономическое моделирование Выпуск 3: Сравнительный анализ интегральных характеристик качества жизни населения субъектов Российской Федерации. - М.: МЭСИ, 2002. - 64 с.

4. Антюшина Н. Некоторые вопросы обеспечения устойчивого промышленного развития в России и Европе // Вопросы статистики. 1996. № 4. С. 30-40.

5. Апарин Н.С., Мымрикова JI.C., Заварина Е.С., Рябушкин Б.Т. К вопросу о концепции и содержании системы статистических показателей для анализа социально-экономического развития России и ее регионов // Вопросы статистики. 1999. № 7. С. 40-45.

6. Апарин Н.С., Мымрикова JI.C., Рябушкин Б.Т. К вопросу об интегрированной статистической информации для системного анализа социально-экономических процессов // Вопросы статистики. 2004. № 5. С. 27-35.

7. Асаул А.Н., Иванов С.Н. Региональный инвестиционно-строительный комплекс существует // Экономика строительства. 2002. № 1.С. 2-20.

8. Бандурин А. Определение инвестиционной привлекательности банка // Вопросы статистики. 1995. № 8. С. 72-75.

9. Бард B.C. Финансово-инвестиционный комплекс. М.: Финансы и статистика, 1998.

10. Барсукова С.Ю. Методы оценки теневой экономики: критический анализ // Вопросы статистики. 2003. № 5. С. 14-24.

11. Беляев М.К. Оценка адаптивности к инвестициям залог успешной инвестиционной политики в регионе // Экономика строительства. - 2002. № 4. С. 36-43.

12. Беляевский И. Статистика рынка: задачи, показатели, методология.// Вестник статистики, 1991. №9. С. 21-30.

13. Бережная Е.В., Бережной В.И. Математические методы моделирования экономических систем: Учеб.пособие. М.: Финансы и статистика, 2001. - 368 с.

14. Бобылев С. Россия на пути антиустойчивого развития? // Вопросы экономики. 2004. № 2. С. 43-54.

15. Богатин Ю.В., Швандар В.А. Инвестиционный анализ: Учебное пособие для вузов. М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2001.

16. Бокун Н., Кулибаба И. Проблемы статистической оценки теневой экономики // Вопросы статистики. 1997. № 7. С. 11-19.

17. Бородкин К.В., Преображенский Б.Г. Построение и анализ статистических модулей прогнозирования основных финансовых агрегатов // Вопросы статистики. 2004. № 7. С. 85-89.

18. Булатов А.С. Капиталообразование в России. // Вопросы экономики. 2001. №3. С. 54-68.

19. Булатов А.С. Особенности капиталообразования в современной России // Деньги и кредит. 2001. № 7. С. 34-48.

20. Вайсблат Б.И., Долнаков А.Е. Риск, анализ и управление производственным инвестиционным процессом // Экономический анализ: теория и практика, 2003. № 2. С. 22-27.

21. Вардомский Л.Б., Матвеев В.А. Вопросы регулирования территориальных пропорций экономики России / Сборник докладов «Общеэкономические и отраслевые проблемы стратегии территориальногоразвития России», М.: СОПС РАН, -2002. С. 145-151.

22. Венецкий И.Г., Венецкая В.И. Основные математико-статистические понятия и формулы в экономическом анализе. М.: Статистика, 1979.

23. Волков А.Г., Иванкова JI.B. Московские демографы обсуждают проблемы миграционной политики // Вопросы статистики. 2003. №9. С. 38-45.

24. Гладилин А., Торопцев Е., Гурнович Т. Численный анализ высокоразмерных моделей экономической динамики // Вопросы статистики. 1998. № 8. С. 32-34.

25. Гладышевский А.И. Инвестиции в адаптационном процессе российской экономики // Экономика строительства. 2002. № 8. С. 2-21.

26. Голуб А. Факторы роста российской экономики и перспективы технического обновления // Вопросы экономики. 2004. № 5. С. 44-58.

27. Голубцов А. Некоторые аспекты информатизации региона как основы процесса управления экономикой // Вопросы статистики. 1996. № 6. С. 8-10.

28. Горбачева T.JL, Рыжикова З.А. Методические подходы измерения занятости в неформальном секторе экономики // Вопросы статистики. 2002. № 4. С. 36-44.

29. Горисов С. Масштабы и структура неформальной занятости // Вопросы экономики. 2004. № 3. С. 115-127.

30. Государственное регулирование рыночной экономики / Подобщ.ред. Н.А.Кушлина; Редкол.; А.А. Владимирова и др. М.: ОАО «НПО Экономика». 2000.

31. Государство. Антропоток / Доклад Центра стратегических исследований Приволжского федерального округа. Нижний Новгород -Москва. 2002.- 174 с.

32. Гранберг А. Стратегия территориального социально-экономического развития России: от идеи к реализации // Вопросы экономики. 2001. № 9. С. 15-27.

33. Гранберг А.Г. Принципы разработки стратегии территориального развития России и задачи конференции. / Сборник докладов «Общеэкономические и отраслевые проблемы стратегии территориального развития России», М.: СОПС РАН, 2002. С. 6-10.

34. Гренджер К., Хатанака М. Спектральный анализ временных рядов в экономике. М.: Статистика, 1972.

35. Григорьева Н.Б., Лихтенштейн В.Е. Методология разработки инвестиционной программы развития розничной сети АЗС крупной вертикальной интегрированной нефтяной компании // Экономический анализ: теория и практика, 2003. № 3. С. 21-28.

36. Гришин В.И., Конев Ю.М. О законодательном регулировании территориального и регионального развития / Сборник докладов «Общеэкономические и отраслевые проблемы стратегии территориального развития России», М.: СОПС РАН, 2002. С. 20-27.

37. Гутман Г.В. и др. Управление региональной экономикой / Г.В. Гутман, А.А. Мироедов, С.В. Федин; Под ред. Г.В. Гутмана. М.:

38. Финансы и статистика, 2001.

39. Давыдянц Д.Е. Критерий, показатели и оценка социально-экономической эффективности // Вопросы статистики. 2002. № 8. С. 73-78.

40. Данилова Т.Н. Инвестиционный рынок и его место в структуре финансового рынка // Финансы и кредит. 2002. № 8. С. 10-25.

41. Дедов Л.А. О некоторых причинах цикличности экономических процессов // Вопросы статистики. 2002. № 5. С. 65-67.

42. Дженкинс Г., Ватте Д. Спектральный анализ и его приложения. Вып. 1 и 2.-М.: Мир, 1971,1972.

43. Дибирдеев В.И. Информационное обеспечение и управленческие решения // Вопросы статистики. 2002. № 10. С. 45-49.

44. Доугерти К. Введение в эконометрику. М.: ИНФРА-М, 1997.- XIV, 402 с.

45. Дубров A.M. Математико-статистическая оценка эффективности в экономических задачах. М.: Финансы и статистика, 1982. 176 с.

46. Дубров A.M. Обработка статистических данных методом главных компонент. М.: Статистика. 1978. 135 с.

47. Дубров A.M., Корнилов И.А. Математические и математикостатисические методы, используемые в курсе «Многомерные методы в статистике». М.: МЭСИ, 1991. 130 с.

48. Дуброва Т.А. Методологические вопросы прогнозирования производства важнейших видов промышленной продукции // Вопросы статистики. 2004. № 1. С. 52-57.

49. Дуброва Т.А., Осипова Н.П. Многомерный статистический анализ финансовой устойчивости предприятий // Вопросы статистики. 2003. № 8. С. 3-10.

50. Елисеева И.И., Юзбашев М.М. Общая теория статистики: Учебник / Под ред. чл. корр. РАН И.И.Елисеевой. - 4-е изд., перераб. и доп. - М.: Финансы и статистика, 2001.

51. Ендовицкий Д.А. Комплексный анализ и контроль инвестиционной деятельности: методология и практика / Под ред. проф. J1.T. Гиляровской. -М.: Финансы и статистика, 2001.

52. Закон Оренбургской области «Об инвестиционной деятельности на территории Оренбургской области, осуществляемой в форме капитальных вложений» от 26 февраля 2003 года № 119.

53. Закс И.Б. Принципы инвестиционной политики // Экономика и организация промышленного производства. 1993. № 12.

54. Зарембо Ю.Г. О сравнении экономической эффективности инвестиций// Экономика строительства. 2002. № 3. С. 16-27.

55. Иваненко В. Перспективы привлечения прямых иностранных инвестиций при вступлении России в ВТО // Вопросы экономики. 2003. № 10. С. 27-33.

56. Иванов Ю.Н., Карасева B.JI. Проблемы измерения ненаблюдаемой экономики (о Руководстве по измерению ненаблюдаемой экономики, разработанной ОЭСР, МВФ, МОТ, Статкомитетом СНГ) // Вопросы статистики. 2003. № 2. С. 18-22.

57. Ильенкова С.Д., Кузнецов В.И. Основы менеджмента, М.:1. МЭСИ, 1999. 179 с.

58. Казакова Н.А. Информационно-аналитическая система как современный инструмент экономического анализа.

59. Казанцев С.В. Потенциал и эффективность экономики российских регионов (опыт межрегионального сопоставления) / Сборник докладов «Общеэкономические и отраслевые проблемы стратегии территориального развития России», М.: СОПС, 2002. С. 95-107.

60. Казинец JT.C. Темпы роста и структурные сдвиги в экономике. М.: Экономика, 1981.

61. Карманов М.В. Методология статистического исследования состояния и развития физической культуры и спорта. М.: Диамонд, 1998. 186 с.

62. Кендалл М. Дж., Стюарт А. Многомерный статистический анализ и временные ряды. -М.: Наука, 1976. 736 с.

63. Кисельников А.А. Механизм управления субъектом Федерации. ЧастьI. Новосибирск: СибУПК, 2001.

64. Кисельников А.А. Субъекты Федерации: Управление в период реформ. Новосибирск: Сибирское соглашение, 2002.

65. Кистанов В.В. Федеральные округа России: важный шаг в укреплении государства / В.В. Кистанов. М.: ЗАО «Издательство1. Экономика», 2000. 172 с.

66. Клинов В. Волновая природа научно-технического прогресса и большие циклы конъюнктуры мирового хозяйства // Общество и экономика. 2002. № 6. С. 3-33.

67. Козлов Т. Заметки о статистических показателях и их системам // Вопросы статистики. 1996. № 12. С. 62-64.

68. Колодко Г. Институты, политика и экономический рост // Вопросы экономики. 2004. № 7. с. 35-50.

69. Кондратьева Н.И., Гумекова О.Н., Мымрикова J1.C., Апарин Н.С. Проблемы совершенствования Каталога статистических показателей // Вопросы статистики. 2001. № 2. С. 11-17.

70. Котляревская Т.И., Луппов А.Б., Мишутина С.А. Современная концепция качества статистических данных и ее использование в статистической практике // Вопросы статистики. 2002. № 5. С. 3-7.

71. Кузнецова JI.A., Ширяева Н.А. Инвестиционная деятельность в Тамбовской области // Вопросы статистики. 2002. № 3. С. 38-43.

72. Кузнецова О. Теоретические основы государственного регулирования экономического развития регионов // Вопросы экономики. 2002. № 4. С. 46-66.

73. Кулагина Г.Д. Основные показатели в статистике товарного обращения. М.: МЭСИ, 1983. 53 с.

74. Кулешов В., Маршак В. Финансовые аспекты прогнозирования темпов экономического роста // Вопросы экономики. 2002. № 11. С. 31-45.

75. Курс социально-экономической статистики: Учебник для вузов / Под ред. проф. М.Г. Назарова. М.: Финстатинформ, 2002.

76. Ларина Н.И., Кисельников А.А. Региональная политика в странах рыночной экономики: Учеб.пособие / НГАЭиУ. М.: ОАО Издательство «Экономика». 1998. - 172 с.

77. Лисин В. Инвестиционные процессы в российской экономике //

78. Вопросы экономики. 2004. № 6. С. 4-27.

79. Литвинцева Г.П. Продуктивность экономики России и структурные сдвиги в производстве товаров и услуг // Вопросы статистики. 2003. № 4. С. 11-26.

80. Лукашин Ю.П. Адаптивные методы краткосрочного прогнозирования временных рядов: Учеб. пособие. М.: Финансы и статистика, 2003. - 416 с.

81. Лукашин Ю.П. Нетрадиционный корреляционный анализ временных рядов // Экономика и математические методы 1992. т.28. Вып. 3. С. 406-413.

82. Лукьянчиков Н.Н. Экономическая стратегия природопользования в уловиях перехода России на устойчивый путь развития / Сборник докладов «Общеэкономические и отраслевые проблемы стратегии территориального развития России», М.: СОПС, 2002. С. 27-37.

83. Люсов А.Н. Инвестиции и инвестиционная деятельность в России // Деньги и кредит. 1993. № 10-11.

84. Магнус Я.Р., Катышев П.К., Пересецкий А.А. Эконометрика. Начальный курс. М.: Дело, 2000. - 400 с.

85. Макашева Н. Загадка Н.Д. Кондратьева: неоконченная теория динамики и методологические проблемы экономической науки // Вопросы экономики. 2002. № 3. С. 4-16.

86. Максимова В.Ф. Руководство по изучению дисциплины «Инвестирование» М. Московский государственный университет экономики, статистики и информатики, 2003.27 с.

87. Малахов С. Трансакционные издержки, экономический рост и предложение труда // Вопросы экономики. 2003. № 9. С. 49-61.

88. Маршалл А. Принципы экономической науки. Т.1, 2, 3. М.: Издательская группа «Прогресс» «Универс», 1993. 414 с.

89. Маслова И., Бараненкова Т. Неформальная занятость в России // Вопросы экономики. 2003. № 9. С. 89-99.

90. Мелкушов Я.С. Экономическая оценка эффективности инвестиций и финансирование инвестиционных проектов. М.: ИКЦ «ДИС», 1997.- 160 с.

91. Меньшиков С.М., Клименко JI.A. Длинные волны в экономике. М.: Международные отношения. 1989. 270 с.

92. Методические положения по статистике. Вып-1, Госкомстат России.-М.: 1996 г.-674 с.

93. Методологические положения по формированию и ведению Каталога статистических показателей (КСП). Утверждены постановлением Госкомстата России от 30.11.2000, № 118. М.: 2000.

94. Методология проведения комплексного анализа социально-экономического развития регионов: Учебное пособие. М.: МИПК учета и статистики, 1998.-С.24.

95. Миркин Б.Г. Анализ качественных признаков и структур М.: Статистика, 1980.

96. Михайлова Т.М. Системный метод расчета показателей, составляющих систему// Вопросы статистики. 2003. № 3. С. 71-72.

97. Мкртчян Н.В. Возможные причины снижения иммиграции в Россию в 2000-2001 годах// Вопросы статистики. 2003. № 5. С. 47-50.

98. Моисеенко В.М. Источники данных о миграции населения в России: эволюция и перспективы // Вопросы статистики. 2002. № 6. С. 3340.

99. Мхитарян B.C., Дуброва Т.А., Ткачев А.В. Многомерная классификация с использованием пакета программы «STATIST1CA». Методические указания / МЭСИ.- М.: 1997. 56 с.

100. Мхитарян B.C., Сивелькин В.А. Статистический анализ структуры инвестиций в основной капитал субъектов Российской

101. Федерации // Вопросы статистики, 2003. №2. С. 46-53.

102. Наливайский В.Ю., Иванченко И.С. Исследование волновой динамики инвестиций в основной капитал // Вопросы статистики. 2003. №11. С. 60-64.

103. Об иностранных инвестициях в Российской Федерации. Закон от 25.06.99.

104. Оппенлендер К.Х. Экономический рост: теория и практика. -М.: Экономика, 1992. 298 с.

105. Определение региональной системы статистических показателей М.: Евростат, Госкомстат России/ Под ред. Пашинцевой Н.И., Завариной Е.С., 2001. - 326 с.

106. Отраслевая инвестиционная программа «Развитие материальной базы строительного комплекса Оренбургской области в 2001-2003 годах», утвержденная Законом Оренбургской области от 20 июня 2001 года № 267 / 298-П-ОЗ.

107. Павлов К. Показатели, характеризующие межрегиональные экономические отношения // Вопросы статистики. 1998. № 2. С. 29-30.

108. Павлов К.В. Оценка структурных и инерционных факторов экономического развития // Вопросы статистики. 2002. № 5. С. 67-70.

109. Петер фон дер Липпе. Экономическая статистика. Йена: Издательство Густав Фишер Ферлаг Штуттгард. 1995.

110. Плышевский Б. Прогнозирование и статистика в ФРГ // Вопросы статистики. 1996. № 5. С. 66-69.

111. Погребняк Л.В., Мисаков B.C., Нагаплов Э.В., Погребняк И.В., Дзуганов С.А. Развитие финансового анализа на стадии инвестирования // Вопросы статистики. 2002. № 2. С. 36-40.

112. Пономаренко А. Подходы к определению параметров «Теневой экономики» // Вопросы статистики. 1997. № 1. С. 23-28.

113. Пономаренко А., Грицина В., Засько В. Об альтернативных расчетах показателей экономического роста // Вопросы статистики. 1997. № 10. С. 3-6.

114. Прикладная статистика. Основы эконометрики: Учебник для вузов: В 2 т. 2-е изд., испр. Т. 1: Айвазян С.А., Мхитарян B.C. Теория вероятностей и прикладная статистика. - М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2001.

115. Прикладная статистика. Основы эконометрики: Учебник для вузов: В 2т. 2-е изд., испр. Т. 2: Айвазян С.А. Основы эконометрики. -М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2001.