**О****десский национальный политехнический университет**

На правах рукописи

**Цабиева Татьяна Олеговна**

УДК 656.615

**Обеспечение устойчивого функционирования и развития морских портов Украины**

Специальность: 08.07.04 – экономика транспорта и связи

**Диссертация на соискание ученой степени**

**кандидата экономических наук**

Научный руководитель

**Продиус Иван Прокопьевич**

доктор экономических наук, профессор

Одесса – 2005

**Содержание**

[Введение 4](#_Toc118718430)

[раздел 1. Стратегическое управление капиталом как основа стабильного функционирования и развития морского порта 11](#_Toc118718431)

[1.1. Роль и место морских портов в транспортной системе Украины 11](#_Toc118718432)

[1.2. Обеспечение устойчивого функционирования и развития морских портов на основе стратегического управления капиталом 20](#_Toc118718433)

[1.3. Критерии оптимальности и методы оценки эффективности управления капиталом морских портов 46](#_Toc118718434)

[Выводы по разделу 1 72](#_Toc118718435)

[раздел 2. Предпосылки усовершенствования механизмов управления капиталом национальных морских портов 73](#_Toc118718436)

[2.1. Основные тенденции и закономерности развития национального морского транспорта Украины 73](#_Toc118718437)

[2.2. Обоснование выбора модели оптимальной стратегии функционирования морских портов 95](#_Toc118718438)

[2.3. Анализ влияния структуры капитала на показатели эффективности морских портов 114](#_Toc118718439)

[Выводы по разделу 2 137](#_Toc118718440)

[раздел 3. Инструменты обеспечения устойчивого функционирования и развития морских портов 139](#_Toc118718441)

[3.1. Концепция оптимального управления устойчивым функционированием и развитием морских портов 139](#_Toc118718442)

[3.2. Организационно-экономическое обеспечение оптимального стратегического управления формированием капитала морских портов 152](#_Toc118718443)

[3.3. Модель оптимального стратегического управления формированием капитала морских портов 163](#_Toc118718444)

[Выводы по разделу 3 191](#_Toc118718445)

[Выводы 193](#_Toc118718446)

[Список использованных источников 195](#_Toc118718447)

[Приложения 208](#_Toc118718448)

**Введение**

**Актуальность темы исследования.** В рыночных условиях обеспечение устойчивого функционирования и развития морских портов, как важнейшей составляющей производственной инфраструктуры отечественной экономики, занимает одно из центральных мест в экономической политике государства, формирует стратегию деятельности транспортного комплекса. Снижение объемов перевозок, дефицит финансово-инвестиционных и материально-энергетических ресурсов побуждают отечественных субъектов транспортного комплекса искать собственные пути обеспечения устойчивого развития, исходя из реальной экономической среды. Реформирование системы хозяйствования не обеспечило необходимых результатов хозяйственной деятельности большинства морских портов, а в последние годы имеет место тенденция к сокращению объемов перевозок, численности работающих, снижение прибыльности работы.

Поэтому в современных условиях объективно существует необходимость поиска форм и методов повышения эффективности функционирования морских портов, исследование и выявление причин, которые тормозят реформирование транспортного комплекса, снижают эффективность реформ и результатов хозяйствования. Это касается, в первую очередь, вопросов стратегического управления капиталом морских портов, оценки эффективности его использования, прогнозирование и планирование структуры капитала в условиях полного использования резервов, которые возникают благодаря наличию заемного капитала в его кругообороте.

Необходимость усовершенствования действующих систем управления обеспечением устойчивого развития морских портов доказана и нашла свое отображение в работах отечественных ученых-экономистов. В частности, необходимость комплексного и системного подхода к решению проблем усовершенствования управления обеспечением устойчивого функционирования и развития морских портов и транспортного комплекса Украины в целом в условиях трансформационной экономики освещена в работах таких ученых, как: Балобанов А.О., Гончаров М.Ю., Котлубай М.И., Котлубай О.М., Макушев П.А., Примачов М.Т., Постан М.Я., Степанов О.М., Тараканов Н.Л., Цвєтов Ю.М и др.

Однако целый ряд важных вопросов по этой проблеме пока что не нашел своего решения. Как и раньше, в морских портах формируется неэффективная структура капитала, которая приводит к снижению эффективности их хозяйствования, и отечественной транспортной системы в целом.

Эффективное стратегическое управление капиталом морских портов возможно лишь при условии обоснованного планирования структуры капитала за счет полного использования резервов, и учет специфики транспортной области. Вместе с этим все порты Украины отмечаются сегодня незначительной долей заемного капитала, которая не создает условий для максимально эффективного использования собственного капитала и уменьшает эффективность функционирования и развития морских портов Украины и ее транспортной системы в целом. Это предопределяет актуальность темы диссертации, ее задачу и структуру.

**Связь работы с научными программами, планами, темами.** Диссертационная работа выполнялась в соответствии с тематическими планами научно-исследовательских работ Одесского национального политехнического университета 1999-2005 гг. Результаты исследования были использованы при выполнении госбюджетной НДР "Система управления внешнеэкономической деятельности в условиях интеграции Украины в мировую экономику" (№ ДР 0102U004912), где автором исследованы факторы развития морских портов на мировом и национальном уровнях; хоздоговорных НДР "Разработка концепции реструктуризации предприятия" (номер ДР 1345-71) и "Разработка концепции стратегического маркетинга предприятия" (номер ДР 1338-71), в которых использованы авторские разработки диссертанта относительно стратегического управления капиталом.

**Цель и задачи исследования.** Цель диссертационной работы состоит в развития теоретических положений организационно-экономического обеспечения управления устойчивым функционированием и развитием морских портов Украины на основе стратегического управления их капиталом и разработке аналитического обеспечения такого управления. Достижение поставленной цели обусловило решение таких задач:

сформулировать критерии оптимальности структуры капитала для достижения устойчивого функционирования и развития морских портов;

обосновать концепцию оптимального стратегического управления капиталом морских портов;

разработать организационно-экономическое обеспечение стратегического управления капиталом морских портов;

определить функции оптимального управления капиталом морских портов;

предложить систему оптимального стратегического управления капиталом морских портов;

разработать модель оптимального стратегического управления формированием капитала морских портов.

*Объектом исследования* является процесс устойчивого функционирования и развития морских портов Украины.

*Предмет исследования* – теоретические и научно-практические основы организационно-экономического обеспечения устойчивого функционирования и развития морских портов Украины на базе стратегического управления формированием капитала.

*Методы исследования*. Методологической основой диссертационного исследования стали законодательные и нормативные акты, которые регламентируют хозяйственные процессы в Украине, публикации отечественных и заграничных ученых - экономистов, которые отображают результаты исследований по вопросам управления и анализа деятельности морских портов, места и роли функций анализа, оценки экономической эффективности результатов функционирования и развития морских портов Украины.

В процессе исследования применялись средства и методы:

экономического анализа для анализа показателей финансовой деятельности морских портов Украины;

статистического анализа – для выявления динамики развития морских портов;

экономико-математического моделирования – для построения модели оптимального стратегического управления капиталом морских портов;

экспертных оценок – для определения стратегической позиции ОМТП,

стохастичного факторного анализа – для выявления стохастических зависимостей структуры капитала от финансовых результатов деятельности морских портов.

Источниками информации для проведенных исследований были данные государственной статистической отчетности, отчетные материалы морских портов, научные публикации по рассмотренной тематики, показатели функционирования и развития транспортной области развитых стран мира, независимые и собственные экспертные исследования.

**Научная новизна полученных результатов.** В диссертационной работе получили дальнейшее развитие теоретические и методические положения организационно-экономического обеспечения устойчивого функционирования и развития морских портов Украины на основе оптимизационного стратегического управления формированием их капитала.

*Впервые:*

разработана модель оптимального стратегического управления капиталом морских портов, которая позволяет управлять формированием капитала морских портов в соответствии с критерием эффективности функционирование и развития.

*Усовершенствовано***:**

обобщенная классификация структуры капитала морских портов, которая позволяет получить разные уровни детализации структуры капитала в зависимости от целей управления капиталом;

комбинированный метод решения оптимизационной задачи формирования структуры капитала морских портов, который является комбинацией итерационного метода и метода прямого перебора параметров.

*Получило дальнейшее развитие:*

концепция управления устойчивым функционированием и развитием морских портов, которая базируется на достижении оптимального баланса между показателями эффективности использования капитала и показателями финансовой стабильности;

аналитическое обеспечение процесса управления, научные основы и методический инструментарий анализа управленческой информации через усовершенствование методов расчета влияния структуры капитала на показатели устойчивого функционирования и развития морских портов;

управленческий инструментарий контроля эффективности функционирования и развития морских портов за счет интеграции в систему управлениякапиталом морских портов систем мониторинга и контроллинга.

*Уточнено* содержание категорий "устойчивое функционирование и развитие", "оптимальное управление капиталом" и сущность отношений, обусловленных данными категориями.

**Практическое значение полученных результатов.** Полученные результаты исследования позволяют осуществить разработку организационно-экономического и аналитического обеспечения устойчивого функционирования и развития морских портов Украины на основе оптимального стратегического управления капиталом.

Разработанные методические рекомендации относительно создания и внедрения системы управления капиталом в систему управления морскими портами позволяют повысить эффективность их функционирования и развития.

Результаты диссертационного исследования апробированы и внедрены в деятельность государственного предприятия "Одесский морской торговый порт" (справка № 03/3321 от 13.04.05 г.) и учтены при разработке стратегии его развития на 2005-2010 гг., апробированы и частично внедрены в деятельность частного предприятия "Укртрансконтейнер" (справка № 02-248 от 27.09.05 г.) при разработке стратегии его развития на 2006-2010 гг., введены в учебный процесс Одесского национального политехнического университета и используются в учебных курсах: "Стратегический менеджмент", "Транспортный менеджмент", "Комплексный анализ финансово-экономической деятельности предприятия" (справка № 500/87-06 от 19.04.05 г.).

**Личный вклад соискателя.** Диссертационное исследование является самостоятельно выполненной научной работой, в которой изложен персональный авторский подход и лично полученные им теоретические и практические результаты в сфере усовершенствования процессов управление устойчивым функционированием и развитием морских портов Украины.

Из числа научных работ, опубликованных в соавторстве, в работе использованные лишь те положения, которые являются результатом личных исследований соискателя. Конкретный вклад соискателя в этих роботах указан в автореферате в перечни публикаций по теме диссертации.

**Апробация результатов диссертации.** Основные теоретические положения и практические результаты исследования были рассмотрены на научных и научно-практических конференциях. Результаты работы докладывались и обсуждались на международных конференциях: 3-я Международная научно-практическая конференция "Маркетинг и логистика в системе менеджмента" (Львов, 2000 г.); 3-я Международная научно-практическая конференция (Черкассы, 2002 р); 1-ая Международная 2-ая Всеукраинская научная конференция студентов и молодых ученых "Управление развитием социально-экономических систем: глобализация, предпринимательство, устойчивый экономический рост" (Донецк, 2001 г.); Всеукраинская научно-практическая конференция "Повышение роли финансовых отношений в комплексном социально-экономическом развитии региона" (Днепропетровск, 2001 г.); Всеукраинская научно-практическая конференция "Экономические проблемы развития регионов и предприятий в начале XXІ столетие" (Полтава, 2001 г.); 5-ая Всеукраинская научно-практическая конференция "Финансово-экономические проблемы развития регионов Украины" (Днепропетровск, 2004 г.).

**Публикации.** По результатам проведенного исследования опубликовано 9 научных работ объемом 1,5 др. арк., из них 1,1 др. арк. пренадлежит лично автору. Пять статей опубликованы в сборниках научных работ, четыре из них -единолично, четыре статьи - в материалах и тезисах научных конференций, три из них - единолично.

**Выводы**

В диссертации приведено теоретическое обобщение и новое решение научной задачи, которое проявляется в разработке организационно-экономического обеспечения управления устойчивым функционированием и развитием морских портов Украины на основе стратегического управления их капиталом и аналитического обеспечения такого управления.

По результатам выполненного исследования автором сформулированы такие выводы и рекомендации:

1. Доказано, что устойчивое функционирование и развитие морских портов в большой мере зависят от эффективности использования их капитала. Поскольку эффективность использования капитала морских портов непосредственно определяется оптимальностью структуры капитала, оптимизацию структуры капитала надо рассматривать как важнейший фактор эффективного и устойчивого функционирования и развития морских портов.

2. Установлено, что между изменением структуры капитала морских портов и реакцией в виде изменения показателей эффективности функционирования и развития существует временной лаг в 1,5-2 года, поэтому эффективное управление формированием капитала морских портов возможно лишь на основе стратегического планирования.

3. Доказано, что стратегические установки, которые вырабатываются в процессе стратегического планирования, должны быть экономически и математически обоснованными, - это позволяет осуществить предложенную в диссертации модель оптимального стратегического управления формированием капитала в соответствии с критерием эффективности функционирование и развития морских портов.

4. Выявлено, что управление формированием структуры капитала - сложный и многомерный процесс, поэтому для обеспечения устойчивого функционирования и развития морских портов в общей системе управления следует предусмотреть подсистему управления формированием капитала. Для создания и обеспечения функционирования подсистемы управления формированием капитала морских портов целесообразно использовать организационно-экономическое и аналитическое обеспечение, предложенное в данной работе.

5. Доказано, что первостепенное значение среди функций управления формированием структуры капитала морских портов имеет анализ информации и контроль показателей эффективности и стабильности функционирования и развития морских портов. Эффективность реализации данных функций можно обеспечить за счет внедрения предложенной в работе системы контроллинга, которая оказывает содействие реализации стратегии управления капиталом морских портов.

6. Разработанные в результате проведенных исследований рекомендации по организационно-экономическому обеспечению управления устойчивым функционированием и развитием морских портов на основе стратегического управления формированием их капитала, которые включают аналитическое обеспечение такого управления, могут быть использованы в деятельности морских портов Украины, а также в процессе подготовки управленческих работников. Это обусловит повышение эффективности использования капитала при обеспечении устойчивого функционирования и развития морских портов Украины.

**Список использованных источников**

1. Абрамов А.П., Галабурда В.Г., Иванов Е.А. Маркетинг на транспорте. – М.: Желдориздат, 2001.
2. Азизов Ф.Х., Мальцев В. Й. Поддержка управленческих решений. – М., 1994. – 168 с.
3. Акофф Р. Планирование в больших экономических системах / Пер, с англ. Г. Б. Рубальского; Под ред. И. А. Ушакова. – М.: Сов. радио, 1972. – 224 с.
4. Акофф Р. Планирование будущего корпорации / Пер, с англ. – М.: Прогресс, 1985. – 326 с.
5. Ананьев О.А. Комп'ютерні технології в менеджменті: Навч. посібник. – Київ: НМЦ Укоопосвіта, 1999. – 200 с.
6. Андрушків Б.Н., Кузьмін О.Є. Основи менеджменту. – Львів: Світ, 1995. – 340 с.
7. Ансофф И. Стратегическое управление / Пер, с англ.; Под ред. Л. И. Евенко. – М.: Экономика, 1989. – 519 с.
8. Афонин И.В. Управление развитием предприятия: Стратегический менеджмент, инновации, инвестиции, цены: Учебное пособие. – М.: Издательско-торговая корпорация "Дашков и Ко", 2002. – 380 с.
9. Багриновский К.А., Егоров Н.Е., Радненко В.В. Имитационные модели в народнохозяйственном планировании. – М.: Экономика, 1980. – 236с.
10. Бакаєв О.О., Пирожков С.І., Евенко В.Л. Міжнародні транспортні коридори – особливий пріоритет України на шляху інтеграції у світову економічну систему // Стратегічна панорама. – 1999. – № 4. – С. 37—55.
11. Балабанов И.Т. Основы финансового менеджмента. – М.: Финансы и статистика, 1997.
12. Балабанов И.Т. Основы финансового менеджмента. Как управлять капиталом. – М.: Финансы и статистика, 1995.
13. Балабанов И.Т. Риск-менеджмент. – М.: Финансы и статистика, 1996.
14. Балашевич В.А., Андронов А.М. Экономико-математическое моделирование производственных систем. – Минск, 1995. – 186 с.
15. Балыбердин В. Р. Оценка и оптимизация характеристик систем обработки данных. – М.: Радио и связь, 1987. – 142 с.
16. Баркалов Н.Б. Производственные функции в моделях экономического роста. – М.: Изд-во МГУ, 1981. – 161 с.
17. Бартенев С.А. Экономические теории и школы. – М.: Бек, 1996. – 352с.
18. Башарин Г. П. Начала финансовой математики. – М.: ИНФРА-М, 1997.
19. Беланок Д.Г. Теория и практика принятия решений. – М.: Экономика, 1990. – 231 с.
20. Белолипецкий В.Г. Финансы фирмы. – М.: ИНФРА-М, 1998.
21. Бернстайн Л.А. Анализ финансовой отчетности: тео­рия, практика и интерпретация. Пер. с англ. – М.: Финансы и статистика, 1996.
22. Бертсекас Л.. Галлагер Р. Сети передачи данных / Пер, с англ. Н.Б. Лиханова и др. – М.: Мир, 1989. – 321 с.
23. Бланк И.А. Основы финансового менеджмента. В 2-х томах. – Киев: Ника-Центр, Эльга, 1999.
24. Бланк И.А. Словарь-справочник финансового менед­жера. – Киев: Ника-Центр, Эльга, 1998.
25. Бланк И.А. Управление формированием капитала. – К.: "Ника-Центр", 2000. – 512 с.
26. Бланк И.А. Финансовый менеджмент: Учебный курс. – Киев: Ника-Центр, Эльга, 1999.
27. Блауг М. Экономическая мысль в ретроспективе. Пер. с англ. – М.: Дело ЛТД, 1994.
28. Блейк Р.. Моутон Длс. Научные методы управления. – Киев: Выща школа, 1990. – 412 с.Боумэн К. Основы стратегического менеджмента. – М.: ЮНИТИ,1997. – 172с.
29. Бошняшін П., Загорський В.С., Середа А.Р., Медведев В.С. Ринкова економіка. – Київ: ІСДО,1996. – 382 с.