**Пугачова Марина Володимирівна. Методологічні засади статистичного моніторингу ділової активності підприємств : Дис... д-ра наук: 08.00.10 – 2008**

|  |  |
| --- | --- |
|

|  |
| --- |
| **Пугачова М.В. Методологічні засади статистичного моніторингу ділової активності підприємств. – Рукопис.**Дисертація на здобуття наукового ступеня доктора економічних наук за спеціальністю 08.00.10 – статистика. – Державна академія статистики, обліку та аудиту Держкомстату України, Київ, 2008.У роботі надано новий науковий зміст поняттям статистичного моніторингу та системи статистичного моніторингу. Обґрунтовано місце і роль системи статистичного моніторингу ділової активності підприємств у державній статистиці. Визначено, що кон’юнктурні обстеження є складовою інформаційного забезпечення для цієї системи.Обґрунтовано програмно-методологічні та організаційні засади проведення кон’юнктурних обстежень, зокрема систему показників, організаційну схему, методичні аспекти формування і підтримки панелі респондентів.Розроблено механізми контролю якості вхідної інформації в системі статистичного моніторингу, процедури заповнення пропущених даних і визначено системи ваг для формування узагальненої інформації.Розроблено засади системного підходу до дослідження потреб користувачів і респондентів українських кон’юнктурних обстежень.Створено моделі розрахунків певних видів синтетичних (комбінаційних) індикаторів і розроблено засади їх використання для дослідження макроекономічних тенденцій. Запропоновано механізм ранжування окремих підприємств (або їх груп) на основі спеціальних індикаторів.Доведено можливість застосування кон’юнктурних обстежень для статистичного моніторингу таких аспектів діяльності підприємств, як корпоративне управління, конкурентне середовище, інвестиційна, інноваційна активність та тіньова економічна діяльність. |

 |
|

|  |
| --- |
| У дисертації наведено теоретичне узагальнення та нове вирішення важливої наукової проблеми – розроблення методології статистичного моніторингу ділової активності підприємств на базі кон’юнктурних обстежень у системі державної статистики. Проведені дослідження дозволили сформулювати такі висновки концептуального, методологічного та прикладного характеру.1. Система управління економічними та соціальними процесами, що відбуваються у суспільстві, потребує ґрунтовної інформаційно-аналітичної підтримки, значну роль у здійсненні якої відіграє статистичний моніторинг, що проводиться органами державної статистики.

Дослідження генезису моніторингових систем, який відбувався певною мірою автономно для різних предметних галузей, засвідчило, що розвитку власне теорії моніторингових систем з боку їх розробників приділялося недостатньо уваги. У дисертації моніторинг розглядається як сукупність таких процесів, що відбуваються регулярно: збирання даних, їх систематизація, обробка, архівація, аналіз, прогнозування та надання результатів користувачам у зручному для них вигляді. Статистичний моніторинг – це здійснення зазначених процесів із застосуванням великих масивів статистичної інформації. Створена на основі такого трактування система статистичного моніторингу дозволяє оптимізувати проведення моніторингу і сприяти раціональному використанню допоміжних ресурсів, таких як реєстри, класифікації та класифікатори. Для подальшого розвитку зазначеного напряму необхідно спроектувати системи моніторингу обраних предметних галузей і, спираючись на інформацію, що циркулює в системі державної статистики, визначити структури та наповнення баз даних, реєстрів, каталогів, довідників тощо.1. У сучасних статистичних системах суттєво посилилася роль метаданих в організації процесів оброблення інформації та постачання її користувачам.

Запропоновані в роботі методологічні аспекти визначення і використання метаданих у системах статистичного моніторингу суттєво розширюють їхні можливості: метадані розглядаються не лише як джерело описової інформації про статистичні дані, але й як сукупність глобальних даних (тобто каталогів, словників, довідників, описів статистичних алгоритмів тощо) та даних про процеси створення і використання статистичної інформації. В цьому контексті зазначено, що користувачами статистичних метаданих є зовнішні відносно системи користувачі статистичної інформації та виробники даних (статистики-практики і респонденти). У дисертації визначено категорії метаданих, що використовуються безпосередньо в системі статистичного моніторингу ділової активності підприємств.1. Кон’юнктурні обстеження підприємств різних видів економічної діяльності проводяться у всіх країнах – членах ЄС та в інших розвинених країнах світу, надаючи багато корисної інформації для мікро- та макроекономічного аналізу і короткострокового прогнозування. За методологічним керівництвом автора вони були запроваджені і в Україні, проте до теперішнього часу зазначені обстеження не розглядались в контексті створення єдиної системи статистичного моніторингу.

Розробка структурної моделі системи статистичного моніторингу ділової активності підприємств та визначення її місця в інформаційній системі державної статистики надають можливість, виходячи із загальної логіки її функціонування, узгодити процеси, які відбуваються в окремих підсистемах, що значно поліпшує якість системи в цілому та якість вихідної інформації.1. Розробка організаційної схеми проведення обстеження, що передбачає взаємопов’язаність, узгодженість та взаємодію всіх її елементів, є неодмінною складовою у процесі проектування обстеження, а сама схема – постійним об’єктом удосконалення.

З огляду на необхідність дотримання оптимального співвідношення “мінімізація ресурсів – необхідний обсяг інформації”, створена організаційна схема проведення кон’юнктурних обстежень у рамках статистичного моніторингу ділової активності підприємств України, що включає як одну з важливих ланок територіальні органи статистики. Така схема забезпечує якісне формування вибіркових сукупностей, підтримку стабільної панелі респондентів та достатній рівень повернення анкет.1. Впровадження у статистичну практику кон’юнктурних обстежень, що зазвичай проводяться на вибірковій основі, значною мірою залежить від загальної стратегії формування обстежуваних сукупностей за галузями економіки. У цьому контексті актуальним є визначення одиниці спостереження, генеральної сукупності, методу формування вибіркової сукупності з урахуванням можливостей доступу до необхідної інформації та створення панелі респондентів. Запропонована модифікована процедура побудови стратифікованої вибірки дозволяє сформувати панелі респондентів за видами економічної діяльності.
2. Важливою методологічною складовою організації статистичного спостереження є створення системи показників, яка відповідає його цілям та дозволяє отримати достатньо повний обсяг інформації для характеристики явища, що досліджується.

Розроблені системи показників кон’юнктурних обстежень промисловості, будівництва, роздрібної торгівлі та сфери нефінансових послуг ґрунтуються на адаптованих до українських умов гармонізованих системах міжнародних організацій. Вперше розроблено системи показників обстежень транспорту і сільського господарства, а системи показників обстежень комерційних банків створено з використанням досвіду розвинених країн.1. У контексті євроінтеграції України важливим методологічним питанням є гармонізація національних кон’юнктурних обстежень з системами обстежень країн – членів ЄС і OECD. При розробці програми обстежень українських підприємств чотирьох видів економічної діяльності частина постійних показників гармонізована з основними показниками міжнародних організацій; це дозволяє, незважаючи на певні методичні та організаційні відмінності, здійснювати зіставлення відповідних результатів на рівні окремих країн, Євросоюзу і зони євро, а також надавати додаткову інформацію для аналізу та прогнозування.

Для подальшого розвитку цього напряму та здійснення більш оперативного моніторингу ділової активності підприємств слід сформувати та впровадити методичні засади переходу з квартальних на місячні обстеження та охопити регулярними обстеженнями сферу послуг і домогосподарства.1. Однією з головних вимог, які постали перед статистиками різних країн, є забезпечення якості статистичної інформації, що надається користувачам. У цьому контексті в роботі приділена увага тим проблемам забезпечення якості даних кон’юнктурних обстежень, що пов’язані з особливостями цих опитувань. У дисертації розроблено механізми контролю якості вхідної інформації у системі статистичного моніторингу ділової активності підприємств. Також вирішено важливу методологічну проблему створення унікальних процедур імпутації пропущених даних для показників різного характеру.

Одним із шляхів підвищення точності отриманої в ході обстежень інформації є використання процедур зважування даних. Запропоновані в роботі системи ваг та показників, що підлягають зважуванню, дозволять покращити якість вихідної інформації, передусім за триваріантними запитаннями.1. Респонденти та користувачі інформації кон’юнктурних обстежень відіграють важливу роль у процесі статистичного моніторингу ділової активності підприємств.

Запровадження щорічної додаткової анкети для визначення потреб респондентів у результатах кон’юнктурних обстежень і оцінки якості даних та використання засад системного підходу до узагальнення вимог інших категорій користувачів стосовно інформації про стан ділової активності підприємств дозволило розробити порядок їх забезпечення інформаційними ресурсами.1. Важливими блоками системи статистичного моніторингу ділової активності підприємств є блоки аналізу, прогнозування та формалізації процесів прийняття рішень, без яких система моніторингу не може в повному обсязі виконувати свої функції та надавати користувачам потрібну інформацію.

У зазначених блоках доцільно використовувати сконструйовані на основі запропонованої моделі синтетичні індикатори, що містять унікальну інформацію про стан та найближчі перспективи розвитку окремих галузей економіки, регіонів та економіки країни в цілому. Вирішення важливих методологічних питань стосовно формування складу синтетичних індикаторів і визначення статистичних показників, що виступають у ролі базових рядів, дозволило отримати синтетичні індикатори прийнятної якості з високим ступенем кореляції з цими показниками.1. Важливим компонентом ґрунтовного макроекономічного аналізу є інформація про короткострокові зміни макропоказників у поточному періоді та найближчому майбутньому. В дисертації доведено можливість поєднання показників кількісного та якісного характеру для моделювання змін і отримання короткострокових прогнозів макропоказників української економіки. З цією метою запропоновано калібраційні та інші статистичні моделі, до яких як незалежні змінні включаються поряд з економічними показниками синтетичні індикатори.
2. Підтримка прийняття управлінських рішень – головне завдання функціонування системи статистичного моніторингу. З метою формалізації процесів прийняття рішень у системі статистичного моніторингу ділової активності підприємств поряд з синтетичними індикаторами, що досліджують тенденції, використовуються також індикатори для ранжування окремих об’єктів за важливістю, які вперше запропоновано до застосування у контексті кон’юнктурних обстежень. Ці індикатори, створені з використанням механізму бінарних відношень, уможливлюють здійснення порівнянь на основі інформації, отриманої за запитаннями кількісного та якісного характеру.
3. Система статистичного моніторингу ділової активності підприємств надає можливість дослідити окремі важливі аспекти діяльності підприємств. Організація та здійснення моніторингу таких питань, як стан корпоративного управління, конкуренція, інвестиційно-інноваційна активність та тіньова діяльність не потребують запровадження додаткових обстежень. З цією метою використовується базова система показників та додаються певні спеціальні запитання до звичайних анкет. Запропоновані для аналізу показники та нові індикатори дозволяють отримати унікальні результати щодо зазначених сфер діяльності підприємств.
4. Запровадження наведених вище методологічних положень дозволить створити ефективну систему статистичного моніторингу діяльності підприємств, яка функціонує на базі кон’юнктурних обстежень та інших статистичних спостережень, покращити систему надання статистичної інформації користувачам, що сприятиме підвищенню якості економічного аналізу на мікро- і макрорівні та поліпшенню порівнянності інформації щодо ділової активності підприємств для різних країн.

Отримані в дисертації результати не вичерпують всієї багатоаспектної проблематики статистики ділової активності підприємств, але вони дають відповіді на її найбільш актуальні питання, сприяють розширенню інформаційної бази та підвищенню якості статистичної інформації. Проведене дослідження є підґрунтям для подальшого вдосконалення методологічних засад статистичного моніторингу і забезпечення системи управління статистичною інформацією, необхідною для прийняття обґрунтованих рішень. |

 |