

УКРАЇНСЬКА ДЕРЖАВНА АКАДЕМІЯ ЗАЛІЗНИЧНОГО ТРАНСПОРТУ

ЩЕРБИНА ЛАРИСА ВОЛОДИМИРІВНА

УДК 339.13.017:620.91

**ТЕОРЕТИЧНІ ЗАСАДИ ДОСЛІДЖЕННЯ ЕНЕРГОРИНКУ УКРАЇНИ ТА
ЙОГО СУБ'ЄКТІВ В УМОВАХ ТРАНСФОРМАЦІЇ ЕКОНОМІКИ**

Спеціальність 08.06.01 – економіка, організація і управління підприємствами

АВТОРЕФЕРАТ

дисертації на здобуття наукового ступеня
кандидата економічних наук

Харків - 2006

Дисертація є рукопис.

Робота виконана в Харківському національному університеті ім. В. Н. Каразіна Міністерства освіти і науки України.

Науковий керівник кандидат економічних наук, доцент **Чала Тетяна Георгіївна**, Харківський національний університет ім. В. Н. Каразіна, доцент кафедри статистики, обліку та аудиту

Офіційні опоненти: доктор економічних наук, професор **Науменкова Світлана Валентинівна**, Українська академія банківської справи Національного банку України, завідувач кафедри фінансів

кандидат економічних наук, старший науковий співробітник, **Інякін Віктор Миколайович**, інститут економіки промисловості НАН України, старший науковий співробітник відділу проблем управління виробництвом

Провідна установа Інститут проблем ринку та економіко-екологічних досліджень НАН України, відділ розвитку підприємництва, м. Одеса

Захист відбудеться “ 19 ” травня 2006 р. о 15. 00 годині на засіданні спеціалізованої вченої ради К 64.820.05 Української державної академії залізничного транспорту за адресою: 61050, м. Харків, майдан Фейєрбаха, 7, ауд. 3.501.

З дисертацією можна ознайомитись у бібліотеці Української державної академії залізничного транспорту за адресою: 61050, м. Харків, майдан Фейєрбаха, 7, ауд. 2.209.

Автореферат розісланий “18” квітня 2006 р.

Вчений секретар
спеціалізованої вченої ради

Чорнобровка І. В.

ЗАГАЛЬНА ХАРАКТЕРИСТИКА РОБОТИ

Актуальність теми. Без продукції підприємств паливно-енергетичного комплексу не обходиться жодне сучасне підприємство, окремо залучена галузь, економіка країни взагалі. В той же час, Україна належить до паливодефіцитних, а тому залежних від зовнішнього ринку країн. Вона має розвинену енергетичну інфраструктуру, є важливою країною транзиту паливно-енергетичних ресурсів. Узагальнення ж вивченої літератури дозволяють зробити висновок про недостатнє дослідження, теоретичне й практичне вирішення питань й проблем, пов'язаних з функціонуванням та сталим розвитком українського енергоринку.

Дослідження паливно-енергетичного комплексу є важливим засобом одержання інформації, без якої неможливе прийняття ефективних та своєчасних управлінських рішень. Основним призначенням досліджень енергоринку є вивчення закономірностей його формування та зміни притаманних йому тенденцій, а також характеру дії ринкового механізму.

Питання, пов'язані з дослідженням ринку, вивченням енергоринку та місцем підприємства у механізмі його формування знайшли відображення в роботах зарубіжних та вітчизняних вчених Ф. Лассаля, В. Репке, А. Шеффле, У. К. Мітчелля, К. Жюглара, Г. Менша, А. Л. Вайнштейна, Ф. Г. Піскоппеля, С. П. Нікітіна, Д. І. Опаріна, Л.О. Клименко, П. М. Левшина, Д. І. Костюхіна, І. К. Біляєвського, С. О. Первушина, М. Д. Кондратьєва, С. М. Меншикова, В. А. Карпова, В. Р. Кучеренко, В. М. Гейця, В.Е. Ліра, В. О. Точиліна, О. Бандури, І. Н. Карпа, І. В. Плачкова, В. Г. Бурлаки та ін.

Разом із цим, існуючі нині об'єктивні та суб'єктивні умови, а також національна та регіональна специфіка функціонування енергоринку потребують подальшого його системного аналізу та постійного проведення комплексного дослідження розвитку національного енергоринку України. Саме цим визначається актуальність теми дисертаційного дослідження, його мета й задачі.

Зв'язок роботи з науковими програмами, планами, темами. Дисертація виконувалась в рамках планової науково-дослідної роботи кафедри економічної теорії та економічних методів управління Харківського національного університету ім. В. Н. Каразіна за темою “Соціально-економічний механізм та наслідки ринкових перетворень”, номер державної реєстрації 0104U000675.

Мета і задачі дослідження. Метою дисертаційної роботи є визначення загальних умов розвитку національного енергоринку та його суб'єктів на етапі формування ринкової економіки і обґрунтування напрямків його удосконалення.

Для досягнення цієї мети було сформульовано і вирішено наступні задачі:
проведено аналіз основних категорій, пов'язаних з дослідженням енергоринку;
визначено основні напрямки дослідження енергоринку з метою подальшого його удосконалення;

критично розглянуто моделі короткострокових прогнозів розвитку виробництва базових видів продукції підприємств українського енергоринку;

проаналізовано існуючі підходи до визначення регіональної диференціації виробництва та споживання паливно-енергетичних ресурсів підприємствами України;

визначено основні кон'юнктурутворюючі фактори підприємств енергоринку України;

оцінено за рівнем значущості кон'юнктурутворюючі фактори національного енергоринку;

вказано ключові напрямки удосконалення українського енергоринку та функціонування на ньому підприємств.

Об'єктом дослідження є економічні процеси, що відбуваються на енергоринку та економічне середовище функціонування підприємств паливно-енергетичного комплексу.

Предметом дослідження є виявлення головних чинників, що визначають умови поточної діяльності та перспективи розвитку енергоринку України і його суб'єктів в період ринкової трансформації.

Методи дослідження. Для досягнення поставленої мети в роботі були використані такі методи дослідження: *системний аналіз та системний підхід* – для виявлення та розуміння сутності енергоринку та формування науково обґрунтованої методики проведення досліджень енергоринку; *теоретичного узагальнення* – для визначення теоретичних основ і напрямків дослідження та удосконалення енергоринку; *метод логічного моделювання* - для виявлення та класифікації кон'юнктурутворюючих факторів; *графічний метод* – для наочного представлення результатів дослідження; *економіко-статистичні методи (порівняння, індексний, головних компонент, кластерний аналіз, дисперсійний, ранжування, методи моделювання, методи аналізу часових рядів)* – для безпосередньої оцінки стану підприємств енергоринку і напрямків їх розвитку, *методи прогнозування*.

Інформаційною базою дисертаційного дослідження є дані статистичних збірників, дані обліку діяльності підприємств енергоринку, матеріали періодичних видань, науково-практичних конференцій, офіційних Інтернет сайтів, наукові публікації та монографії.

Наукова новизна одержаних результатів полягає в наступному:

вперше:

встановлено (на основі компонентного аналізу) головні кон'юнктурутворюючі фактори, які в основному визначають стан підприємств енергоринку України (динамічний розвиток виробничо – сировинного та споживчого потенціалу внутрішнього енергоринку, зовнішній ціновий фактор, паливозалежність національного енергоринку від зовнішнього ринку та ресурсів) та ранжовано їх за

ступенем впливу на національний енергоринок, що дозволяє використовувати ці фактори для розробки прогнозів та програм розвитку підприємств паливно – енергетичного комплексу;

розроблено концепцію комплексної регіональної диференціації і ранжування рівня виробництва та споживання паливно-енергетичних ресурсів підприємствами України, яка включає відбір показників оцінки регіональної однорідності, групування регіонів в результаті кластерного аналізу та ранжування на основі інтегральних показників;

удосконалено:

обґрунтування висновку, що при короткостроковому прогнозуванні динаміки обсягів виробництва продукції підприємств паливно-енергетичного комплексу найбільш високий рівень достовірності прогнозу можна одержати для галузей менш залежних від зовнішнього постачання ресурсів;

формулювання основних взаємопов'язаних напрямків дослідження енергоринку України (аналіз пропорційності, варіаційності, динамічності, циклічності) та доведення необхідності їх комплексного використання при визначенні перспектив розвитку цього ринку та відповідних підприємств;

дістали подальшого розвитку:

економічний зміст поняття “кон’юнктура ринку”, яке, окрім традиційного урахування поточної ринкової ситуації, що визначається на основі застосування відповідних показників і факторів, розглядається разом з тим як динамічне ринкове явище, спричинене сукупністю умов, взаємозв’язків та факторів, діючих протягом певного часу і впливаючих на прийняття, перебіг та реалізацію рішень;

визначення основних напрямків удосконалення енергоринку України:

удосконалення міжрегіональних пропорцій в енергозабезпеченні підприємств;

удосконалення структури енергобалансу України;

розробка стратегій розвитку енергоринку та окремих підприємств на базі основних кон’юнктуруотворюючих факторів;

поступове зменшення та подолання цінових диспропорцій енергоринку;

формування конкурентних умов діяльності підприємств енергоринку;

розробка механізмів регулювання виробничих процесів та процесів енергоспоживання на підприємствах.

Практичне значення одержаних результатів. Практичне значення одержаних результатів полягає в розробці пропозицій щодо наукового обґрунтування дослідження ринку з метою одержання більш достовірних та ефективних результатів.

Одержані в дисертації наукові результати запропоновані для розробки стратегії розвитку підприємств енергоринку, націленої на досягнення та

забезпечення енергетичної стабільності на різних рівнях – від підприємства та регіону до загальнодержавного рівня.

Запропоновані в роботі напрямки дослідження енергоринку України обґрунтовують вибір основних складових програм розвитку та удосконалення енергоринку.

Виявлені вірогідні кон'юнктурутворюючі фактори, які можуть бути прийняті за основу при організації і управлінні підприємствами за умов відповідності основним тенденціям та напрямкам розвитку енергоринку та інших залежних від нього ринків та галузей економіки з метою забезпечення сталості розвитку економіки.

Практичне значення результатів дослідження підтверджується їх використанням у діяльності НВП “Зонд”, ВАТ “Нафтоавтоматика” і використанням в навчальному процесі Харківського національного університету ім. В. Н. Каразіна.

Апробація результатів дослідження. Основні результати виконаних досліджень, висновки і рекомендації представлені на: 65-й Міжнародній науково-технічній конференції кафедр академії та спеціалістів залізничного транспорту і підприємств (Харків, 2003 р.); четвертій Міжнародній науково-практичній конференції студентів і молодих вчених “Управління розвитком соціально-економічних систем: глобалізація, підприємництво, стале економічне зростання” (Донецьк, 2003 р.); на Всеукраїнській науковій конференції студентів, аспірантів і молодих вчених “Актуальні проблеми соціально-економічного розвитку в умовах ринкових перетворень” (Харків, 2004 р.).

Особистий внесок здобувача. Особистий внесок здобувача відображений у списку його публікацій за темою дисертації. По наукових працях [6, 8], опублікованих у співавторстві, здобувачем розширено і доповнено поняття “кон'юнктура ринку” задля зменшення протиріччя при його трактуванні та запропоновано методичку короткострокового прогнозування обсягів виробництва та переробки основних видів паливно-енергетичних ресурсів, в основі якої лежить аналітичне вирівнювання та аналіз періодичної складової.

Публікації. Основні положення і результати дисертаційного дослідження опубліковані у 11 наукових працях загальним обсягом 2,89 д.а., у тому числі 9 статей – у фахових виданнях з економіки.

Структура і обсяг роботи. Дисертація складається зі вступу, трьох розділів, висновків. Загальний обсяг дисертації складає 179 сторінок, список використаних джерел нараховує 167 найменувань. Робота містить 11 додатків, 31 таблицю, 46 рисунків.

ОСНОВНИЙ ЗМІСТ ДИСЕРТАЦІЇ

У **вступі** обґрунтовано актуальність теми, сформульовано мету, задачі, предмет та об'єкт, методологічні та методичні засади дослідження, відображено наукову новизну одержаних результатів та розкрито їх практичне значення.

У **першому розділі** – “**Теоретичні засади та методологія досліджень енергоринку та його суб'єктів**” – розкрито сутність основних понять та категорій, розглянуто основні особливості енергоринку як об'єкта дослідження, сформульовано методологічне забезпечення аналізу тенденцій розвитку енергоринку.

Інформація про стан енергоринку, про конкретну ситуацію, яка склалася на ньому в даний момент часу, а також аналіз, оцінка, передбачення та прогнозування подальшого розвитку подій на ринку вкрай актуальні як на державному рівні для ефективного керівництва економікою країни, так і на рівні окремого підприємства. Потрібно підкреслити, що інформація про стан енергоринку є ключовою для підприємств паливно-енергетичного комплексу, оскільки вивчення середовища, в якому воно існує і функціонує є одним із важливих напрямків діяльності підприємства.

Під енергоринком слід розуміти систему економічних відносин між виробниками та споживачами енергоресурсів.

Основними особливостями енергоринку як об'єкта дослідження є:

багатоструктурність, оскільки, з одного боку, складається з самостійних, а з іншого – пов'язаних між собою ринків різних рівнів;

варіаційність;

значна залежність від зовнішнього ринку;

повторюваність деяких тенденцій і закономірностей;

залежність від розвитку транспортної інфраструктури, яка забезпечує електро - та теплопостачання, постачання та зберігання рідких та газоподібних енергоносіїв, перевезення твердого палива.

До складу інфраструктурної мережі енергоринку входять електро - та тепломережі, трубопроводи, транспортні системи, розподільні вузли, компресорні станції, вузли керування і обліку транспортування палива, шахтні та наземні термінали, під'їзні колії залізничного транспорту, вантажні станції, станції формування транспортних одиниць і інші.

Особливим предметом дослідження енергоринку є його кон'юнктура, що при традиційній трактовці являє собою, поточну ринкову ситуацію, яку можна визначити за допомогою багатьох показників і факторів. Наведене поняття, разом з тим розглядається автором як динамічне ринкове явище, яке спричинене сукупністю умов, взаємозв'язків та збігом обставин, діючих певний час і впливаючих на прийняття, перебіг та реалізацію управлінських рішень.

Обґрунтовування напрямків удосконалення енергоринку можна здійснити в процесі його дослідження завдяки так званому ситуаційному аналізу.

В основу досліджень енергоринку доцільно покласти наступні методологічні вимоги.

По-перше, дослідження енергоринку не можна проводити ізольовано, без взаємозв'язку із ситуацією, яка склалася, та обліку особливостей функціонування в інших галузях чи на товарних ринках, оскільки між усіма явищами, які обумовлюють розвиток енергоринку, існує взаємозв'язок.

По-друге, тенденції, які притаманні одним ринкам, не можна автоматично, без додаткових досліджень, переносити на інші.

По-третє, необхідність в постійному та безперервному спостереженні за енергоринком, яка викликана нестійкістю ситуації.

По-четверте, дослідження енергоринку будь-якого рівня та його суб'єктів має здійснюватися в певній послідовності, а саме:

- виявлення та аналіз проблеми, яка обумовлює необхідність в дослідженні;
 - постановка цілей дослідження;
 - визначення завдань і об'єкту дослідження, обґрунтування цього вибору;
 - вивчення основних особливостей організації та функціонування енергоринку, їх загальна характеристика;
 - збір та накопичення інформації;
 - аналіз загальносвітових тенденцій та їх впливу на розвиток національного ринку та його суб'єктів;
 - оцінювання ситуації на енергоринку;
 - виявлення факторів, які впливають на стан підприємств енергоринку;
 - дослідження циклічних закономірностей розвитку економіки;
 - узагальнення проведеного дослідження у вигляді висновків, рекомендацій.
- Враховуючи особливості енергоринку та сформульовані методологічні положення, автором виділені основні напрямки його дослідження, які зазначені на рис. 1.

Рис. 1. Запропонована модель дослідження енергоринку для подальшого



Проведені в роботі дослідження за зазначеними напрямками дозволяють виявити, у чому полягають недоліки функціонування енергоринку України та обґрунтувати напрямки його удосконалення, завдяки чому можна зробити розвиток енергоринку більше передбачуваним і використати всі його потенційні можливості та переваги в майбутньому.

Потрібно завжди мати на увазі те, що в зв'язку з появленням нових факторів, нових тенденцій і закономірностей, тобто зі зміною значущості кон'юнктурутворюючих факторів, відбувається старіння методики дослідження енергоринку. Тому, доцільно та необхідно регулярно удосконалювати і переглядати методику дослідження енергоринку та, згідно з нею, уточнювати основні напрямки.

Другий розділ – “Аналіз функціонування та розвитку підприємств паливно-енергетичного комплексу України” – присвячений комплексному аналізу стану національного енергоринку, основних тенденцій та особливостей його розвитку; вивченню стану транспортної інфраструктури та його впливу на функціонування ринку енергоносіїв; моделюванню обсягів виробництва основних видів продукції підприємств паливно-енергетичного комплексу з урахуванням сезонних коливань.

Дослідження виробництва та споживання енергоносіїв в Україні та аналіз ситуації, яка склалася на національному енергоринку, дає змогу прийти до такого висновку.

Характерним є значний спад виробництва та споживання продукції підприємств паливно–енергетичного комплексу, в основному, з 1991 р. до 2001 р., а починаючи з 2001 р. відбувається поступове зростання цих показників.

Частка імпорту в постачанні паливно-енергетичних ресурсів в Україну становить близько 50%, що відповідає середньоєвропейському рівню, але монопольна залежність від імпорту нафти, газу, збагаченого ядерного палива з Росії, обмежені можливості з нарощування власного видобутку нафти, газу та незадовільний баланс енергоспоживання (частка газу близько 40%, середньоєвропейська – 22%) ще більше загострюють ситуацію. В зв'язку з цим, по можливості, потрібно досягти максимального рівня забезпеченості паливно-енергетичними ресурсами власного виробництва. Слід також розглянути питання щодо диверсифікації енергоринку, що пов'язане з появою його нових учасників (Азербайджан, Казахстан, країни Середньої Азії, Близького Сходу).

Важливою складовою національного енергоринку України є його потужна нафтотранспортна система, яку можна використовувати в найближчий період та з мінімальними капітальними вкладеннями в порівнянні з іншими альтернативними маршрутами для збільшення обсягів подачі нафти та газу в основні регіони їх споживання. Конкурентними перевагами України є наявність потужних підприємств нафтопереробної галузі.

Поряд з цим, Україна займає вигідне географічне положення між регіонами, які активно споживають нафту, нафтопродукти та газ, і регіонами їх видобування. Через територію України проходить понад 37 тис. км газопроводів, а до нафтотранспортної системи входять магістральні нафтопроводи загальною довжиною 4570 км. Потенційною перевагою України як країни - транзитера енергоресурсів у сфері транспортування природного газу, окрім можливості нарощування обсягів транзиту, є наявність підземних сховищ газу. Надійна робота газотранспортної системи забезпечується комплексом підземного зберігання газу, загальним активним обсягом понад 35 млрд. м куб. Тобто, українська газо - та нафтотранспортна система є вагомим передумовою інтеграції у загальноєвропейську систему трубопроводів.

Дослідження транспортної інфраструктури України свідчить про те, що значна частка в вантажоперевезенні належить продукції підприємств паливно-енергетичного комплексу. Крім того, майже половина загального вантажообороту припадає на трубопровідний транспорт (табл.1).

Таблиця 1

Загальні показники діяльності паливно-енергетичного та транспортного комплексів за період 1997-2004 рр.

Показники	Роки							
	1997	1998	1999	2000	2001	2002	2003	2004
Частка продукції підприємств паливно-енергетичного комплексу серед перевезених вантажів залізничним транспортом загального користування, %	36,7	37,0	37,6	38,1	39,2	39,7	39,6	37,7
Частка трубопровідного транспорту (транспортування нафти та газу) у загальному вантажообороті, %	46,0	48,0	50,0	48,0	47,0	45,0	42,0	42,0

Примітка. Розраховано автором за даними Державного комітету статистики України

Щодо цінових характеристик, то на перевезення продукції підприємств паливно-енергетичного комплексу трубопровідним транспортом тарифи є більш стабільними (табл.2). Для збереження конкурентоспроможності ринку енергоресурсів варто мінімізувати витрати на їх транспортування.

Таблиця 2

Індекси тарифів на транспортування вантажів, % до попереднього року

Показники транспортування	2002	2003	2004
Залізничним транспортом (вугілля, нафта та нафтопродукти, кокс)	100,07	113,77	118,70
Трубопровідним (нафта та газ)	93,00	83,500	101,80

Примітка. Дані Державного комітету статистики України

Оскільки Україна має обмежений сировинний енергетичний потенціал, пріоритетом в розвитку інфраструктури енергоринку має бути, в першу чергу, модернізація і розвиток ресурсопровідних мереж, насамперед нафто - та газопроводів, враховуючи роль України в транзиті цих ресурсів до Європи.

З метою виявлення основних тенденцій та закономірностей обсягів виробництва, видобування, переробки та можливості прогнозування майбутніх тенденцій найважливіших паливно-енергетичних ресурсів в дисертаційному дослідженні проведено їх моделювання за період 1994 – 2005 рр.

При вивченні динаміки ринкових процесів доцільно вважати, що значення рівнів часових рядів представлені у вигляді трьох складових: систематичної, тобто тренду, сезонної та випадкової.

При побудові моделей часових рядів, які характеризують тенденції виробництва, видобування та переробки паливно - енергетичних ресурсів підприємствами України було розраховано різні моделі часових рядів з подальшим виділенням сезонної складової. Після застосування методів дисперсійного аналізу, відбирались ті з них, які мали найкращу апроксимацію.

В процесі моделювання обсягів пропозиції ключових видів продукції підприємств паливно-енергетичного комплексу на основі аналізу сезонних коливань виявлено основні тенденції та закономірності розвитку цих процесів. Показано, що в основному до 2001 р. спостерігалася тенденція до скорочення виробництва електроенергії, переробки нафти, видобування газу, виробництва дизельного палива та бензину автомобільного, а починаючи з 2001 р. відбувалося поступове його зростання. Що стосується виробництва вугілля готового та нафти,

включаючи газовий конденсат, то тенденція до зростання не спостерігається й нині.

Точність одержаних прогнозів оцінювалась за величиною відносної похибки екстраполяції та її середнього значення. Значення середньої похибки прогнозів знаходиться в межах від 1,57% (виробництво електроенергії) до 12,09% (виробництво автомобільного бензину і дизельного палива). Для моделей, які характеризуються впливом постійно діючих та сезонних факторів і які є менш залежними від зовнішнього постачання ресурсів, одержано більш точні прогнози, аніж для тих, на розвиток яких чималий вплив мають раптові фактори, і які характеризуються значною залежністю від зовнішніх поставок.

Наведене вище свідчить про можливість використання побудованих моделей для аналізу та прогнозування ситуації на національному енергоринку. У тому числі, на основі одержаних моделей можна передбачити, врахувати та зменшити наслідки прояву сезонності, зокрема, таких як значні збитки, пов'язані з нерівномірністю використання обладнання, устаткування, робочої сили, сировини; з нерівномірним використанням інфраструктури, а також викликану необхідністю створення різного роду нераціональних резервів тощо.

У третьому розділі дисертаційної роботи – “Дослідження циклічності, динамічності та варіаційності національного енергоринку України” – розроблено концепцію комплексної регіональної диференціації і ранжування рівня виробництва та споживання паливно-енергетичних ресурсів підприємствами України на основі обраних показників, за якими проведено кластерний аналіз та розрахована інтегральна оцінка; запропоновано методику прогнозування та виділення основних кон'юнктурутворюючих факторів підприємств українського енергоринку; на основі результатів проведеного дослідження вказано основні напрямки удосконалення національного енергоринку та функціонування підприємств на ньому.

З метою удосконалення стратегії розвитку окремих регіонів України (областей та їх сукупностей), енергетичні підприємства яких об'єднані в одне економічне ціле, доцільно виділити найбільш однорідні групи областей, що схожі між собою за рівнем споживання та виробництва паливно-енергетичних ресурсів.

Для досягнення цієї мети було зібрано дані про виробництво та споживання енергоносіїв підприємствами, які характеризували 25 регіонів України. Множиною ознак, за якими оцінювались об'єкти в залежності від споживання енергоносіїв, обрано наступні: вугілля, природний газ; основна продукція нафтопереробки (мазут, автомобільний бензин, дизельне пальне), тепла та електрична енергія на виробничо-експлуатаційні потреби. Для оцінювання регіонів України в залежності від виробництва енергоносії відібрано такі показники: видобуток вугілля, газу, нафти, включаючи газовий конденсат; виробництво електро- та теплової енергії.

В результаті кластерного аналізу одержано по 4 групи регіонів як за рівнем виробництва, так і за рівнем споживання паливно-енергетичних ресурсів. За рівнем виробництва до I групи ввійшли Полтавська, Харківська, Сумська, до II – Луганська, Донецька, Дніпропетровська, до III – Запорізька, Київська, решта регіонів - IV група.

В залежності від рівнів споживання, одержано наступні результати. I групу склали Дніпропетровська і Донецька області, II – Запорізька, Київська, Луганська, III – АРК, Вінницька, Івано-Франківська, Львівська, Одеська, Полтавська, Черкаська, IV – решта областей.

Для більш повного та комплексного дослідження енергоринку України в регіональному розрізі виникає потреба не лише згрупувати регіони, але й ранжувати їх, тобто мати змогу провести порівняльний аналіз регіонів.

Інтегральну оцінку, на основі якої було ранжовано регіони, побудовано з використанням багатовимірної середньої.

Для достовірності висновків в роботі проведено комплексний аналіз, який поєднує результати групування регіонів України з використанням кластерного аналізу і результати ранжування за інтегральними оцінками. Одержані підсумки щодо регіональної диференціації за рівнем виробництва та споживання підприємствами основних видів паливно-енергетичних ресурсів наведені в табл.3.

Для аналізу ступеня погодженості результатів проведення кластерного аналізу і ранжування були розраховані коефіцієнти кореляції рангів Кенделла, які для рівнів виробництва та споживання паливно - енергетичних ресурсів в регіональному розрізі дорівнюють 0,6958 і 0,8206 відповідно. Це свідчить про погодженість і достовірність результатів комплексного використання зазначених методів. Одержана комплексна оцінка регіональної однорідності запропонована для удосконалення стратегії розвитку та планування рівня виробництва та споживання паливно-енергетичних ресурсів підприємствами окремих регіонів.

Таблиця 3

Групування регіонів України в залежності від рівня виробництва та споживання паливно-енергетичних ресурсів підприємствами в результаті комплексного застосування кластерного аналізу та розрахунку інтегральної оцінки

За рівнем виробництва			За рівнем споживання		
Запропоновані групи регіонів	Регіони	Рейтинг	Запропоновані групи регіонів	Регіони	Рейтинг
I	Донецька	1	I	Донецька	1
	Полтавська	2		Дніпропетровська	2
	Сумська	3	II	Луганська	3
	Харківська	4		Запорізька	4
II	Дніпропетровська	5	III	Київська	5
	Луганська	6		Харківська	6
III	Запорізька	7		Полтавська	7
	Київська	8	Івано-Франківська	8	

IV	Івано-Франківська	9	IV	Львівська	9
	Львівська	10		Одеська	10
	Рівненська	11		Вінницька	11
	Чернігівська	12		Черкаська	12
	Черкаська	13		АРК	13
	Миколаївська	14		Миколаївська	14
	АРК	15		Сумська	15
	Хмельницька	16		Рівненська	16
	Вінницька	17		Кіровоградська	17
	Кіровоградська	18		Хмельницька	18
	Одеська	19		Житомирська	19
	Херсонська	20		Чернігівська	20
	Волинська	21		Херсонська	21
	Житомирська	22		Волинська	22
	Тернопільська	23		Закарпатська	23
Чернівецька	24	Тернопільська	24		
Закарпатська	25	Чернівецька	25		

Передбачення, виявлення, оцінювання перспектив розвитку, основних тенденцій, закономірностей, притаманних енергоринку та його суб'єктам нині і в майбутньому, тобто обґрунтування кон'юктуроутворюючих факторів є надзвичайно важливим і, в той же час, складним досить суб'єктивним завданням.

Проведення моделювання та прогнозування кон'юктуроутворюючих факторів підприємств енергоринку на основі методу головних компонент дозволяє виділити з великої сукупності факторів лише декілька вагомих, що пояснюють більшість ринкових коливань, а також дає можливість позбутися суб'єктивізму при з'ясуванні таких факторів. Це пояснюється тією особливістю методу головних компонент, що в результаті дослідження значної кількості початкових даних, які характеризують енергоринок, можна виявити кон'юктуроутворюючі фактори, які безпосередньо неможливо спостерігати та оцінювати, оскільки вони є внутрішніми, прихованими властивостями.

При застосуванні методу головних компонент використані прогнозні дані, розраховані експертами Міністерства палива та енергетики та представлені в проекті „Концепції національної енергетичної стратегії України на період до 2030 року”. Об'єктом аналізу є національний енергоринок, який представлений прогнозними рівнями трьох сценаріїв розвитку: песимістичним, базовим та оптимістичним за 2005, 2010, 2015, 2020, 2025 та 2030 роки. Екзогенними ознаками в даній моделі здобувачем визначені: видобуток вугілля, газу, нафти, виробництво електроенергії, світові ціни на нафту, газ, валовий внутрішній продукт на душу населення, попит на електроенергію, вартість органічного палива при вірогідній зміні ціни, частка імпорту вугілля, газу, нафти у їхній сукупній пропозиції, частка експорту вугілля у загальному обсязі його видобування, внутрішня ціна на газ, мазут, вугілля, динамічна складова.

В процесі аналізу виділено три головні компоненти. Разом ці три

компоненти пояснюють понад 90% ринкових коливань.

Перша компонента щільно пов'язана з ознаками: видобуток вугілля, газу, нафти, виробництво електроенергії, валовий внутрішній продукт на душу населення, попит на електроенергію, вартість органічного палива в Україні при вірогідній зміні ціни, частка імпорту вугілля у його сукупній пропозиції, внутрішня ціна на газ, мазут, вугілля, динамічна складова. Цю компоненту можна проінтерпретувати як динамічний розвиток виробничо-сировинного та споживчого потенціалу внутрішнього енергоринку.

Друга компонента пов'язана зі світовими цінами на нафту та світовими цінами на газ. Вона легко інтерпретується як зовнішній ціновий фактор.

Третя компонента щільно пов'язана з імпортом газу та нафти у сукупній пропозиції. Її можна охарактеризувати як дефіцит чи паливозалежність національного енергоринку від зовнішнього ринку і ресурсів.

На основі результатів проведеного аналізу виділено, оцінено за ступенем впливу на український енергоринок (загальний вплив - 91,04%) та ранжовано за рівнем значущості такі основні кон'юнктурутворюючі фактори як:

- 1) динамічний розвиток виробничо-сировинного та споживчого потенціалу внутрішнього енергоринку (вплив - 61,85%);
- 2) зовнішній ціновий фактор (вплив - 15,81%);
- 3) паливозалежність національного енергоринку від зовнішнього енергоринку та ресурсів (вплив - 13,38%).

Фактор “динамічний розвиток виробничо-сировинного та споживчого потенціалу внутрішнього енергоринку”, в свою чергу, залежить на 31,11% від наявних паливно-енергетичних ресурсів в країні; на 35,89% - від внутрішніх цінових характеристик; на 8,92% - від ВВП та на 6,45% - від часового параметру.

Проведене дослідження з використанням методу головних компонент засвідчує можливість наукового обґрунтування основних кон'юнктурутворюючих факторів, які мають бути прийняті за основу при формуванні ключових напрямків удосконалення енергоринку та функціонування підприємств на ньому.

В результаті комплексного дослідження українського енергоринку за запропонованими в роботі напрямками, на базі узагальнення та обґрунтування висновків, одержаних в процесі аналізу, можна стверджувати, що питання удосконалення національного енергоринку стоїть особливо гостро. В українській економіці деформована структура виробництва та енергоспоживання, на підприємствах надзвичайно повільно впроваджуються енергозберігаючі технології, структура паливно-енергетичного балансу не відображає внутрішній паливно-енергетичний потенціал країни, основні фонди підприємств не відповідають сучасному рівню виробництва, відсутні ефективні ринкові саморегулятори, незадовільний стан транспортної інфраструктури. Зазначені

проблеми потребують особливої уваги при формуванні напрямків удосконалення національного енергоринку (рис. 2).

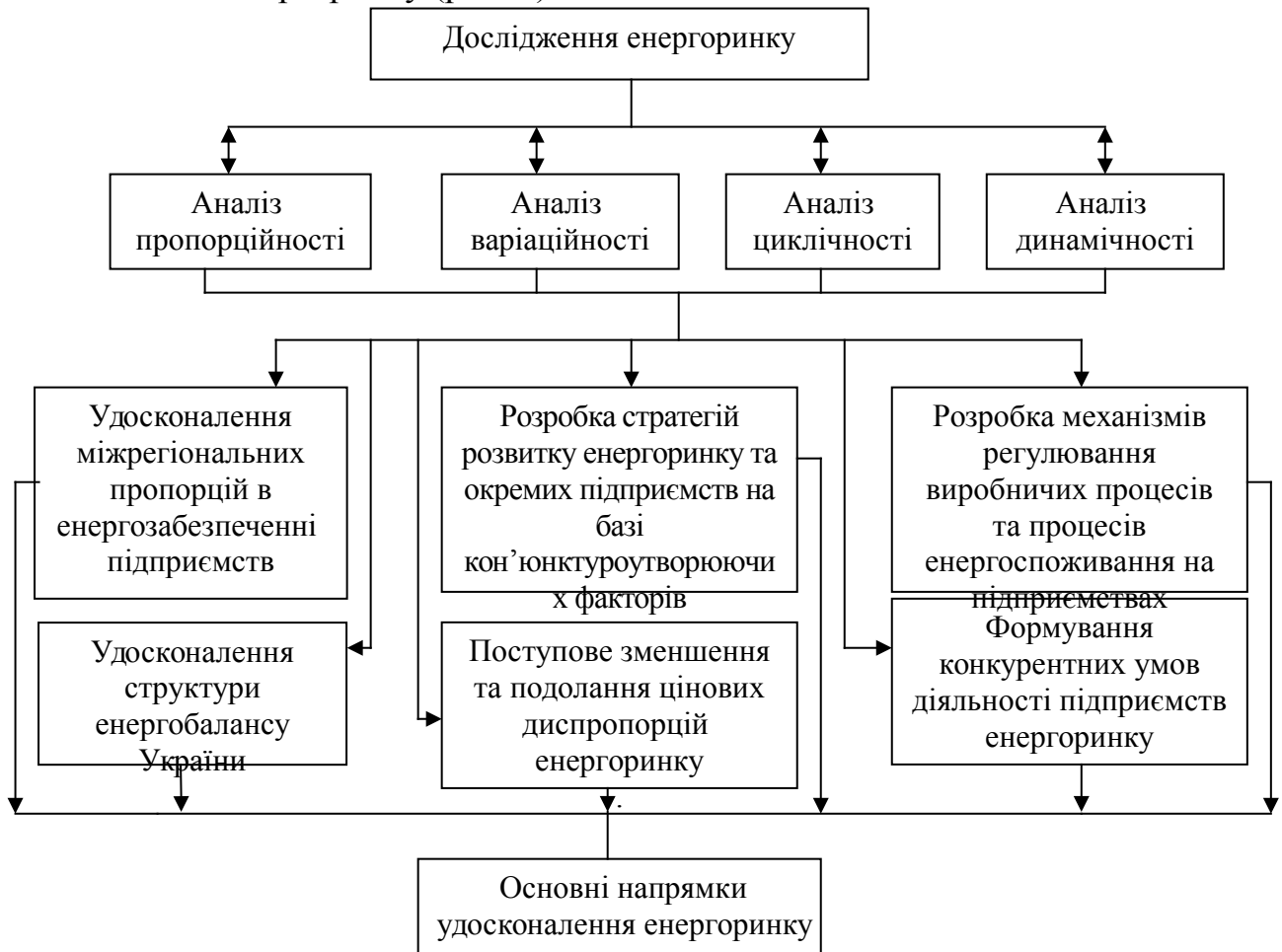


Рис.2. Напрямки удосконалення енергоринку України та функціонування підприємств на ньому

Вказані напрямки удосконалення енергоринку є ключовими. В залежності від галузевої належності підприємств, вказані напрямки необхідно коригувати, враховуючи реальний стан функціонування та специфіку суб'єктів енергоринку.

ВИСНОВКИ

Дослідження питань функціонування та розвитку українського енергоринку та його суб'єктів дозволило зробити наступні висновки.

1. Вивчення хронології еволюції поняття “кон'юнктура ринку” та узагальнення теоретичних визначень даної категорії дозволило дати йому уточнення, яке полягає в наступному. Кон'юнктура ринку, окрім традиційного розуміння як поточної ринкової ситуації, що визначається на основі застосування відповідних показників та факторів, являє собою також динамічне функціонування ринку, спричинене сукупністю умов, взаємозв'язків та факторів, діючих певний час і впливаючих на прийняття, перебіг та реалізацію рішень.

2. Детальне вивчення і аналіз українського енергоринку, його основних особливостей та розроблені методологічні положення дали можливість

сформулювати комплекс взаємопов'язаних напрямків дослідження національного енергоринку України та його суб'єктів. Глобальними та ключовими напрямками дослідження виділено: аналіз пропорційності, варіаційності, циклічності та динамічності.

3. Аналіз національного енергоринку показав, що в Україні існує нерациональна структура паливно-енергетичного балансу, яка орієнтована на переважне використання природного газу за найменшої забезпеченості ним. Цим обумовлюється необхідність в зміцненні вітчизняної вугільної промисловості, яку можна вважати перехрестям державних і регіональних інтересів. Вихід вугільної промисловості із кризи бачиться у реалізації єдиної, цілеспрямованої, скоординованої політики, що ґрунтується на глибокому вивченні та використанні власних можливостей.

4. Проведене моделювання динаміки обсягів виробництва основних видів паливно-енергетичних ресурсів, основане на коригуванні виявленої тенденції розвитку на сезонні відхилення, дозволило обґрунтувати висновок, що при короткостроковому прогнозуванні динаміки обсягів виробництва продукції підприємств паливно-енергетичного комплексу найвищий рівень достовірності прогнозу можна одержати для підприємств тих галузей, які є менш залежними від зовнішнього постачання ресурсів.

5. Проведене дослідження національного енергоринку на основі відбору показників оцінки регіональної однорідності, кластерного аналізу і розрахунку інтегральної оцінки дозволило розробити концепцію регіональної комплексної диференціації і ранжування рівня виробництва та споживання паливно-енергетичних ресурсів з метою удосконалення стратегії розвитку підприємств окремих регіонів країни. Правильність і можливість поєднувати ці методи одним, доведена розрахованим коефіцієнтом кореляції рангів Кенделла, який свідчить про високу ступінь погодженості результатів комплексної оцінки.

6. Розроблена в дисертації прогнозна модель кон'юнктури енергоринку України доводить, що у будь-якому випадку розвитку українського енергоринку потрібно враховувати при формуванні енергетичної політики держави наступні основні кон'юктуроутворюючі фактори:

по-перше, динамічний розвиток виробничо-сировинного та споживчого потенціалу національного енергоринку. Особливе значення мають забезпеченість підприємств України власними ресурсами, доступність ресурсів, їх обсяги та вартість в межах країни;

по-друге, світові ціни на паливно-енергетичні ресурси, вплив загальносвітових тенденцій;

по-третє, недостатня кількість паливно-енергетичних ресурсів, тобто залежність підприємств національного енергоринку від ситуації на зовнішньому енергоринку.

7. В результаті проведеного дослідження українського енергоринку, згідно розробленої методології та запропонованих глобальних і основних напрямків дослідження, обґрунтовано ключові напрямки, за якими першочергово необхідно удосконалювати національний енергоринок та функціонування на ньому вітчизняних підприємств.

СПИСОК ОПУБЛІКОВАНИХ ПРАЦЬ ЗА ТЕМОЮ ДИСЕРТАЦІЇ

Статті у фахових виданнях:

1. Щербина Л. В. Экономико-статистическая оценка конъюнктуры рынка нефтепродуктов Украины // Вісник Харківського національного університету ім. В.Н. Каразіна. Економічна серія.- 2002.- №575.- С. 189-194.

2. Щербина Л. В. Економіко-статистична оцінка кон'юнктури ринку палива та енергетики // Вісник Харківського національного університету ім. В.Н. Каразіна. Економічна серія. - 2003.- №580. – С. 240-243.

3. Щербина Л. В. Статистичне прогнозування кон'юнктури енергоринку України // Вісник економіки транспорту і промисловості.- 2004.- №5-6.- С. 302-308.

4. Щербина Л. В. Багатовимірне ранжування регіонів України за рівнем попиту, пропозиції та ступенем забезпеченості паливно-енергетичними ресурсами // Вісник Харківського національного університету ім. В.Н. Каразіна. Економічна серія. - 2004.- №608.- С. 172-178.

5. Щербина Л. В. Методологія аналізу тенденцій розвитку галузевого ринку // Вісник Харківського національного університету ім. В.Н. Каразіна. Економічна серія. – 2004. - №634. – С. 259-262.

6. Чала Т. Г., Щербина Л. В. Дослідження процесу становлення поняття кон'юнктура // Науково-технічний збірник “Коммунальное хозяйство городов”. – 2004. - №59. – С. 192-200.

7. Щербина Л. В. Групування регіонів України в залежності від рівня споживання, виробництва та ступеня забезпеченості паливно-енергетичними ресурсами // Вісник економіки транспорту і промисловості. – 2005. - №9-10. – С. 345-351.

8. Чала Т. Г., Щербина Л. В. Моделювання обсягів пропозиції основних видів продукції паливно-енергетичного комплексу України на основі аналізу сезонних коливань // Науково-технічний збірник “Коммунальное хозяйство городов”. – 2005. - №61. – С. 38-46.

9. Щербина Л. В. Модель удосконалення національного енергоринку України // Науково-технічний збірник “Коммунальное хозяйство городов”. – 2005. - №65. – С. 167-175.

Інші праці:

10. Щербина Л. В. Сучасний стан, проблеми та перспективи розвитку національного енергоринку // Матеріали Четвертої міжнародної науково-

практичної конференції студентів і молодих вчених “Управління розвитком соціально-економічних систем: глобалізація, підприємництво, стале економічне зростання”.- Донецьк, 2003. – С.321-323.

11. Щербина Л. В. Використання багатовимірних статистичних методів для прогнозування кон’юнктури енергоринку України // Матеріали Всеукраїнської наукової конференції студентів, аспірантів та молодих вчених у рамках Каразінських читань, присвячених 200-річчю від дня заснування Харківського університету “Актуальні проблеми соціально-економічного розвитку в умовах ринкових перетворень”. – Харків, 2004. – С. 41-44.

АНОТАЦІЯ

Щербина Л. В. Теоретичні засади дослідження енергоринку України та його суб’єктів в умовах трансформації економіки. – Рукопис.

Дисертація на здобуття наукового ступеня кандидата економічних наук за спеціальністю 08.06.01 – економіка, організація і управління підприємствами. – Українська державна академія залізничного транспорту, Харків, 2006.

Запропоновано в основу досліджень енергоринку покласти певні методологічні вимоги, обґрунтовано послідовність проведення досліджень енергоринку та його суб’єктів, включаючи базові підприємства.

Проведено моделювання динаміки обсягів пропозиції основних видів продукції підприємств паливно-енергетичного комплексу України на основі аналізу сезонних коливань, виявлено основні тенденції та закономірності цих процесів.

Розроблено концепцію комплексної регіональної диференціації і ранжування рівня виробництва та споживання паливно-енергетичних ресурсів підприємствами України.

Обґрунтовано теоретичні основи методики виявлення вірогідних кон’юктуроутворюючих факторів, які мають вплив на стан підприємств українського енергоринку і можуть бути взяті за основу при організації і управлінні підприємствами.

Розроблені методологічні підходи до моделі удосконалення національного енергоринку та функціонування на ньому підприємств на основі результатів проведеного комплексного дослідження енергоринку за запропонованими напрямками.

Ключові слова: дослідження, енергоринок, паливно-енергетичні ресурси, підприємства паливно-енергетичного комплексу, тенденція, прогноз, кон’юктуроутворюючий фактор, удосконалення.

АННОТАЦІЯ

Щербина Л. В. Теоретические основы исследования энергорынка Украины и его субъектов в условиях трансформации экономики. – Рукопись.

Диссертация на соискание ученой степени кандидата экономических наук по специальности 08.06.01 – экономика, организация и управление предприятиями. – Украинская государственная академия железнодорожного транспорта, Харьков, 2006.

Диссертация посвящена разработке теоретических основ и методологических рекомендаций по проведению комплексного исследования рынка, в частности, украинского энергорынка, его субъектов.

В работе изучен процесс становления понятия «конъюнктура рынка» как особого предмета исследования энергорынка, в результате чего, расширено и дополнено экономическое содержание данного понятия, что позволяет уменьшить разногласия при его трактовке.

В работе предложено в основу исследований энергорынка положить определенные методологические требования, рассмотрена последовательность проведения исследований, а также разработаны основные направления исследования энергорынка и его субъектов.

Изучен национальный энергорынок в разрезе общемировых тенденций. Проведен анализ состояния украинского энергорынка за несколько лет и определены основные закономерности и особенности его развития. В результате проведенного исследования сделаны выводы, а также сформулированы причины, которые влияют на состояние энергорынка.

Особое внимание в работе уделено изучению транспортной инфраструктуры украинского энергорынка, ее состоянию и влиянию на функционирование рынка энергоносителей. Показано, что приоритетными направлениями в развитии инфраструктуры энергорынка должны быть модернизация и развитие нефте – и газопроводов, учитывая роль Украины в транзите этих ресурсов.

Проведено моделирование динамики объемов предложения основных видов продукции предприятий топливо – энергетического комплекса Украины на основе анализа сезонных колебаний, выявлены основные тенденции и закономерности развития этих процессов. Полученные результаты позволили обосновать вывод, что при краткосрочном прогнозировании динамики объемов производства продукции предприятий топливо – энергетического комплекса, самый высокий уровень достоверности прогноза можно получить для тех отраслей, которые являются менее зависимыми от внешних поставок ресурсов. В основе моделирования лежит аналитическое выравнивание и анализ периодической составляющей. При этом предусмотрена статистическая оценка прогностических возможностей моделей.

Разработана концепция комплексной региональной дифференциации и ранжирования уровня производства и потребления топливо - энергетических

ресурсов предприятиями Украины на основе отобранных показателей, по которым проведен кластерный анализ и рассчитана интегральная оценка. На основе кластерного анализа в зависимости от уровня производства и потребления предприятиями топливно-энергетических ресурсов была проведена группировка регионов Украины. Но в связи с тем, что на основании полученных группировок невозможно проводить сравнительный анализ объектов исследования в пространстве, было рекомендовано проведение многомерного ранжирования регионов Украины на основе расчета интегральных оценок и рейтингов в зависимости от уровня спроса и предложения топливно-энергетических ресурсов. В диссертационном исследовании доказана возможность комплексного применения кластерного анализа и ранжирования на основе расчета коэффициента Кэнделла.

Разработана и обоснована методика моделирования и прогнозирования конъюнктурообразующих факторов национального энергорынка с использованием многомерных методов исследования, в частности, метода главных компонент. С использованием данного метода из множества факторов выделены несколько наиболее весомых, которые объясняют значительную часть рыночных колебаний, а также определена значимость каждого из факторов. В работе основными конъюнктурообразующими факторами, которые оказывают влияние на состояние предприятий украинского энергорынка и должны учитываться при разработке энергетической политики выделены такие: динамическое развитие производственно – сырьевого и потребительского потенциала внутреннего энергорынка, внешний ценовой фактор, зависимость национального энергорынка от внешнего энергорынка и ресурсов.

В результате проведенного исследования украинского энергорынка, согласно разработанной методологии и предложенных основных направлений исследования энергорынка, обоснованы ключевые направления, по которым необходимо совершенствовать национальный энергорынок и функционирование предприятий топливо – энергетического комплекса. Такими основными направлениями усовершенствования в диссертационном исследовании выделены: усовершенствование межрегиональных пропорций в энергообеспечении предприятий, усовершенствование структуры энергобаланса Украины, разработка стратегий развития энергорынка и отдельных предприятий на основе выделенных конъюнктурообразующих факторов, постепенное сокращение ценовых диспропорций на энергорынке, разработка механизмов регулирования производственных процессов и процессов энергопотребления на предприятиях, формирование конкурентных условий на энергорынке.

Ключевые слова: исследование, энергорынок, топливно-энергетические ресурсы, предприятия топливо – энергетического комплекса, тенденция, прогноз, конъюнктурообразующий фактор, усовершенствование.

SUMMERY

L. V. Shcherbyna. A basic theoretical study of the energy market of Ukraine and its sectors by research under the conditions of transformation economics. - Manuscript.

Thesis for scientific degree of Candidate of Economic Sciences with specialty 08.06.01. – Economics, Organization and Enterprise Management. – The Ukrainian State Academy of a Railway Transportation, Kharkiv, 2006.

The paper is offered on the basis of market investigations to put the definite methodological requirements; the sequence of realization of market investigations is reviewed.

The technique of using models of supply volume for the main types of production of fuel and energy in complex enterprises is considered using analysis of season fluctuations.

The technique of realization of a grouping of locales of Ukraine is offered on the basis of cluster analysis and on the basis of calculation of integral estimations and ratings depending on a level of demand and supply of fuel and energy resources.

The thesis dives the description of the method of conjuncture forecasting of national energy market with the use of many - dimensional statistical methods, in particular the main components' method. The basic conjuncture forming factors, which have influence on Ukrainian energy market conjuncture and should be taken into account in energy policy development, are emphasized.

The model of improving of the national energy market is built as a result of extensive research of energy market using proven methods.

Key words: research, energy market, fuel and energy resources, enterprises of fuel and energy market, tendency, forecast, conjecture forming factor, improving.

ТЕОРЕТИЧНІ ЗАСАДИ ДОСЛІДЖЕННЯ ЕНЕРГОРИНКУ УКРАЇНИ ТА ЙОГО СУБ'ЄКТІВ В УМОВАХ ТРАНСФОРМАЦІЇ ЕКОНОМІКИ

Спеціальність 08.06.01 – економіка, організація і управління підприємствами

АВТОРЕФЕРАТ

дисертації на здобуття наукового ступеня
кандидата економічних наук

Відповідальний за випуск
к. е. н., доцент
Т. Г. Чала

Підписано до друку 10.04.2006 Формат 60 × 84/16
Папір друкарський. Друк офсетний. Обсяг 1,0 умов.–друк. арк.
Тираж 100 прим. Зам. № 85/06. Безкоштовно.

Надруковано на РІЗО
Харківського національного університету ім. В. Н. Каразіна,
61077, м. Харків, пл. Свободи, 4