

**ДЕРЖАВНИЙ ВИЩИЙ НАВЧАЛЬНИЙ ЗАКЛАД
«КИЇВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ ЕКОНОМІЧНИЙ УНІВЕРСИТЕТ
ІМЕНІ ВАДИМА ГЕТЬМАНА»**

ЛОЗОВИК ЮРІЙ МИКОЛАЙОВИЧ

УДК 658:005.21

**СТРАТЕГІЧНА ПОВЕДІНКА ПІДПРИЄМСТВА
НА ОЛІГОПОЛІСТИЧНОМУ РИНКУ
(на прикладі українських підприємств-виробників мінеральних добрив)**

Спеціальність 08.00.04 – Економіка та управління підприємствами
(за видами економічної діяльності)

АВТОРЕФЕРАТ
дисертації на здобуття наукового ступеня
кандидата економічних наук

Київ – 2008

Дисертацією є рукопис.

Роботу виконано на кафедрі стратегії підприємств ДВНЗ “Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана” Міністерства освіти і науки України (м. Київ).

Науковий керівник: доктор економічних наук, професор
Наливайко Анатолій Петрович,
ДВНЗ “Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана”,
декан факультету економіки та управління

Офіційні опоненти: доктор економічних наук, професор
Смолін Ігор Валентинович,
Київський національний торговельно-економічний університет,
професор кафедри підприємництва

кандидат економічних наук, доцент
Володькіна Марина Владиславівна,
ДВНЗ “Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана”,
доцент кафедри менеджменту

Захист відбудеться «9» жовтня 2008 р. о 14⁰⁰ годині на засіданні спеціалізованої вченої ради Д 26.006.03 ДВНЗ “Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана” за адресою: 03680, м. Київ, проспект Перемоги, 54/1, ауд. 203 .

З дисертацією можна ознайомитись у бібліотеці ДВНЗ “Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана”: 03680, м. Київ, вул. Дегтярівська, 49-г, ауд. 601.

Автореферат розіслано «8» вересня 2008 р.

Вчений секретар
спеціалізованої вченої ради
кандидат економічних наук, професор

О.С. Федонін

ЗАГАЛЬНА ХАРАКТЕРИСТИКА РОБОТИ

Актуальність теми. Для забезпечення успішної діяльності підприємств, що функціонують на олігополістичному ринку, необхідно приділяти особливу увагу розробці та реалізації науково-обґрунтованих управлінських рішень з урахуванням стратегічних намірів і дій конкурентів. Неточні прогнози та недооцінювання реакції контрагентів, в тому числі конкурентів, при плануванні діяльності підприємств призводить до того, що більшість з них змушені працювати в умовах недостовірної та/(чи) невичерпної інформації щодо різноманітних показників діяльності у майбутньому.

Теоретичні і практичні аспекти проблем розвитку, стратегічного вибору та досягнення довгострокового успіху підприємствами-олігополістами знайшли відображення у роботах багатьох закордонних і вітчизняних вчених. Значний внесок у становлення та розвиток теорії олігополії у різні роки зробили: А. Курно, Дж. Бертран, А. Боулі, Ф. Еджворт, Г. Хотеллінг, Е. Чемберлен, Дж. Робінсон, Г. фон Штакельберг, Т. Паландер, Р. Фріш, П. Свізі, Дж. фон Нейман і О. Моргенштейн, Дж. Неш, Р. Теохаріс, Д. Ранд, І. Гумовські, К. Міра, Джіан-Італо Біші, Ф. Ламантія, Л. Штефаніні, Л. Гардіні, М. Копел, К. Чіарела, Т. Пу, Дж. Дж. Стіглер, С. Б. Авдашева, І.М. Сушко, Н.М. Розанова, А. Мацумото, Т. Онозакі та інші вчені.

Разом з тим, ще не існує єдиної універсальної методики, яка пояснювала б поведінку олігополістів. У переважній більшості робіт науковцями розглядаються лише окремі аспекти визначення оптимальної стратегії підприємства-олігополіста на досліджуваному часовому інтервалі. Дискусійними залишаються питання щодо використання існуючих теоретичних моделей олігополії та оцінки результативності їх у практичній діяльності. Саме тому низка ключових питань щодо формування і реалізації своєчасної та ефективної стратегічної поведінки олігополіста потребує адаптації до умов сучасного етапу та подальшого наукового обґрунтування. Це обумовлено тим, що із зростанням рівня складності, конфліктності та непередбачуваності як середовища, так і поведінки кожного учасника ринку виникає необхідність покращувати існуючі та розробляти нові, більш досконалі підходи і концепції ефективного функціонування підприємств. Сукупність визначених проблемних питань, необхідність проведення системного дослідження теоретичних, методичних і прикладних аспектів стратегічної поведінки підприємств-олігополістів, зумовила вибір теми, мету, наукові завдання та логіко-структурну побудову дослідження.

Зв'язок роботи з науковими програмами, планами, темами. Дисертацію виконано на кафедрі стратегії підприємств ДВНЗ "Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана" згідно з планами наукових досліджень за темами: «Стратегія та економічна безпека підприємства» (№ ДР 0101U002945) – особисто автором досліджені теоретичні аспекти розробки і реалізації стратегічної поведінки підприємства, що функціонує на ринку олігополії та

сформовані науково-методичні підходи до її обґрунтування; «Базові положення сучасної економічної теорії як методологічна основа обґрунтування стратегії підприємства» (№ ДР 0189U100397) – особисто автором розроблені методичні засади діагностування можливих стратегічних намірів або вже реалізованої стратегії підприємством-конкурентом на ринку олігополії та проведено їх апробацію на підприємствах з виробництва азотних добрив в Україні.

Мета і завдання дослідження. Метою дисертаційної роботи є наукове обґрунтування теоретико-методичних аспектів і прикладних інструментів для формування та реалізації стратегічної поведінки підприємств, що функціонують на ринку олігополії.

Відповідно до мети роботи поставлено та вирішено наступні науково-практичні завдання:

- розкрито сутність і генезис економіко-управлінської категорії “стратегічна поведінка” підприємства, що функціонує на ринку олігополії, визначено місце, роль та значення цієї категорії як невід’ємної частини понятійно-категоріального апарату стратегічного управління;
- розглянуто еволюцію існуючих кількісних та цінових моделей стратегічної поведінки олігополістів, здійснено їх конструктивний аналіз;
- оцінено переваги і недоліки застосування інструментарію теорії динамічних систем та ймовірнісного підходу при моделюванні поведінки олігополістів;
- визначено концептуальні засади побудови моделей стратегічної поведінки, технологій їх розробки та реалізації підприємством-олігополістом;
- ідентифіковано структуру ринку мінеральних добрив України, а також стратегічну поведінку азотно-тукових підприємств;
- запропоновані напрямки посилення конкурентної позиції підприємства-олігополіста за рахунок кращого використання його внутрішнього потенціалу;
- проведено адаптацію теоретичних моделей стратегічної поведінки підприємства відповідно до потреб учасників олігополістичного ринку та перевірено їх прикладну значущість;
- запропоновано рекомендації щодо організаційного та інформаційного забезпечення впровадження моделей стратегічної поведінки підприємства-олігополіста.

Об’єктом дослідження виступають процеси забезпечення ефективного довгострокового функціонування підприємств-олігополістів.

Предметом дослідження є сукупність теоретичних, методичних і прикладних аспектів розробки і реалізації стратегічної поведінки підприємства-олігополіста, направленої на підтримку та зміцнення його конкурентної позиції на ринку.

Методи дослідження. У роботі використані загальнонаукові та спеціальні методи дослідження, які дозволяють комплексно вирішувати поставлені завдання з обраного напрямку дослідження. Найвагоміші теоретичні і прикладні розробки ґрунтуються на положеннях сучасної

економічної теорії, загальної теорії управління, стратегічного управління, теорії організації промисловості, маркетингу, теорії динамічних систем і використанні методів: типології і класифікації – для уточнення та впорядкування понятійного апарату за обраним напрямком дослідження; історико-логічного аналізу при вивченні еволюції теорії статичної і динамічної олігополії, тенденцій розвитку ринків та окремих підприємств-олігополістів; спостереження, узагальнення, порівняння, групування, математичного моделювання (лінійного, матричного, теорії ігор), факторного аналізу, статистичних методів, графічних зображень та ін. – для дослідження характеристик галузі, ринку, окремих підприємств та їх стратегічних намірів; кореляційно-регресійного аналізу – для моделювання сезонних коливань і визначення функції попиту на продукцію азотно-тукових підприємств на внутрішньому ринку України; експертні методики (статистично-факторного аналізу та інструментарій теорії нечітких множин) – для визначення напрямків посилення конкурентної позиції підприємства-олігополіста за рахунок кращого використання його внутрішнього потенціалу; спеціальний інструментарій теорії динамічних систем (атрактори та біфуркації) – для вивчення можливості досягнення рівноваги за умов нелінійності процесів із складною схемою взаємодії учасників.

Інформаційну базу дослідження складають: нормативні та законодавчі акти України, що регламентують діяльність підприємств; основні положення наукових праць вітчизняних і закордонних вчених у межах досліджуваного проблемного поля; матеріали наукових конференцій, семінарів, періодичних видань і мережі Інтернет; офіційні матеріали Держкомстату; планова, звітна та організаційно-управлінська документація підприємств-виробників мінеральних добрив.

Наукова новизна отриманих результатів полягає у наступному:

вперше:

- обґрунтовано доцільність розгляду економіко-управлінської категорії “стратегічна поведінка” як процесу формування, обґрунтування і застосування власної манери стратегічних дій з урахуванням своєчасної та ефективної реакції підприємства на обрану поведінку конкурентів на основі попереднього аналізу їх стратегічних намірів, з метою забезпечення ефективного довгострокового функціонування підприємства в ринковому просторі;
- запропоновано концептуальні засади управління стратегічною поведінкою підприємства через проектування основних її процесів: проведення стратегічного моніторингу середовища підприємства, створення бази знань про стратегічні наміри та можливу поведінку контрагентів, розробку і вибір оптимальної моделі стратегічної поведінки, реалізація обраної моделі стратегічної поведінки, оцінка та контроль досягнутих результатів;
- формалізовано концепцію оцінки просторових меж ринку з використанням математичного інструментарію роботи з множинами, відображеннями та

тригонометричного аналізу за умов рівномірного чи нерівномірного розташування споживачів в ринковому просторі.

дістали подальший розвиток:

- методи оцінки конкурентних позицій азотно-тукових підприємств на галузевому рівні на базі використання інструментарію статистичного факторного аналізу та інструментарію теорії нечітких множин;
- методичні підходи щодо оцінки рівноваги у нелінійних динамічних моделях олігополії шляхом використання інструментарію теорії динамічних систем: відображень взаємозв'язків між учасниками ринку, біфуркаційного аналізу та аналізу атракторів.

удосконалено:

- понятійний апарат досліджуваної предметної галузі через розмежування та уточнення наступних категорій: “економічна поведінка підприємства”, “ринкова поведінка підприємства” та “стратегічна поведінка підприємства”;
- класифікацію типів(видів) стратегічної поведінки підприємства шляхом виділення таких основних ознак, як цільова спрямованість, характер взаємодії з учасниками ринку, ступінь обґрунтованості рішень, швидкість реагування на дії конкурентів тощо;
- методику визначення можливих зон конкуренції та зон монопольних позицій підприємств на основі модифікації моделі просторової оцінки меж ринку Г. Хотеллінга, яка передбачає попередній розрахунок виробничих і невиробничих витрат підприємства, витрат на транспортування, оцінку рівня прибутковості (збитковості) підприємства та визначення максимально допустимої ціни на продукцію підприємств;
- підходи до інформаційного та організаційного забезпечення впровадження моделі стратегічної поведінки азотно-тукового підприємства.

Практичне значення отриманих результатів полягає у подальшому розвитку теорії стратегії підприємств, що слугує підґрунтям для подальших теоретичних і прикладних досліджень факторів довгострокового успіху підприємства, а також підтверджується їх використанням у практиці діяльності: хімічних підприємств України з виробництва мінеральних добрив ВАТ «Рівнеазот» (довідка №844 від 26.02.2008 р.), ВАТ «Дніпроазот» (довідка № 624/01-6 від 02 квітня 2008 р.) і ВАТ «Одеський припортовий завод» (довідка №1453 від 25.03.2008 р.); Рівненської філії ДП «Інститут азотної промисловості і продуктів органічного синтезу» (довідка №9 від 14.03.2008 р.), а також у ДВНЗ «Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана» в навчальному процесі при викладанні дисциплін «Планування і контроль на підприємстві», «Управління витратами», «Економічна діагностика», «Стратегія підприємства» (довідка від 5.03.2008 р.).

Особистий внесок здобувача. Дисертація є самостійно виконаною науковою працею, подані до захисту рекомендації і пропозиції розроблені автором особисто, публікації відображають основний зміст дослідження.

Апробація результатів дослідження. Основні положення, результати та висновки дисертації обговорено та схвалено на міжнародних і всеукраїнських наукових та науково-практичних конференціях: “Стратегія підприємства: теорія і практичне втілення за умов структурно-мінливого середовища” (м. Київ, 3-4 квітня 2003 р.); “Економіко-математичні методи прийняття управлінських рішень на сучасному етапі” (м. Дніпропетровськ, 24 березня 2004 р.); “Наукова робота – складова діяльності університету” (м. Київ, 3 лютого 2005 р.); “Наука і освіта ‘2005” (м. Дніпропетровськ, 7-21 лютого 2005р.); “Економічний і соціальний розвиток України в ХХІ столітті” (м. Тернопіль, 24-25 лютого 2005 р.); “Управління стратегічними змінами на підприємстві: концептуальні засади, методологія та практика” (м. Київ, 27-28 жовтня 2005 р.); “Економічна організація та економічна освіта: взаємообумовленість стратегій розвитку” (м. Київ, 7-8 лютого 2007 р.); “Проблеми управління у сфері підприємництва” (м. Київ, 5-6 квітня 2007 р.).

Публікації. Основні положення та найважливіші результати дослідження опубліковано автором у 12 наукових працях, загальним обсягом 2,82 д. а., у тому числі 4 з них загальним обсягом 1,75 д.а. у наукових фахових виданнях.

Структура та обсяг роботи. Дисертація складається з вступу, трьох розділів, висновків, списку використаних джерел і додатків. Основний зміст роботи викладено на 182 сторінках друкованого тексту. У дисертації розміщено 63 рисунка на 31 сторінці і 20 таблиць на 12 сторінках. Список використаних джерел містить 152 найменувань. Дисертація має також 13 додатків на 54 сторінках.

ОСНОВНИЙ ЗМІСТ ДИСЕРТАЦІЇ

У **вступі** обґрунтовано актуальність теми дослідження, сформульовано його мету і завдання, визначено об’єкт, предмет і методи дослідження, висвітлено наукову новизну і практичну значущість отриманих результатів, подано відомості про їх апробацію.

У **розділі 1 – “Теоретичні засади дослідження стратегічної поведінки підприємства на ринку продукту”** здійснено міждисциплінарний аналіз понятійного апарату досліджуваної предметної галузі та запропоновано авторську версію його впорядкування; розглянуто еволюції підходів щодо концепцій стратегічної поведінки підприємств; досліджено інструментарій діагностики типів ринкових структур і визначено концептуальні основи побудови моделі стратегічної поведінки як складової системи управління підприємством з урахуванням особливостей олігополістичної структури ринку.

Дослідження сутності, співвідношення та взаємозв'язку таких понять, як “економічна поведінка”, “стратегічна поведінка”, “ринкова поведінка” підприємства виявило, що мають місце неоднозначність, а іноді суперечливість трактувань зазначених термінів, відсутність їх чіткого розмежування, та дозволило сформулювати авторське визначення стратегічної поведінки підприємства як системи взаємопов'язаних дій, до складу якої входять дослідження, аналіз, оцінка вже існуючих стратегій чи можливих стратегічних намірів основних учасників ринку, а також формування, обґрунтування і застосування власної манери стратегічних дій з урахуванням своєчасної та ефективної реакції підприємства на обрану поведінку конкурента.

Розглянуто еволюцію підходів щодо інтерпретації концепцій стратегічної поведінки підприємств від найпростіших статичних моделей до моделей в умовах невизначеності та хаосу. Систематизація поглядів вітчизняних і закордонних науковців дозволила виокремити декілька етапів удосконалення наукових напрямів та інструментарію дослідження олігополістичних структур ринку і поведінки основних його учасників. По-перше, показано, що найпростіші лінійні статичні моделі дуополії еволюціонували у параметричні динамічні моделі дуополії Т.Паландера, П.Свізі та інших вчених. Пізніше моделі дуополії, тріополії та олігополії з великою кількістю учасників були доповнені інструментарієм дослідження мультирівноваги та мультистабільності за умов нелінійної функції попиту на ринку та функцій витрат. По-друге, доведено, що теорія ігор і теорія динамічних систем не суперечать одна одній, а скоріше формують необхідну досить багату методологічну базу для дослідження стратегічної поведінки олігополістів. По-третє, з'ясовано, що еволюція моделювання стратегічної поведінки підприємств тісно пов'язана з історичним розвитком ринкових структур та ускладненням схем взаємодії між її основними учасниками. Процес розвитку економіко-математичного моделювання стратегічної поведінки, на наш погляд, доцільно розглядати у вигляді вектора трансформацій ринкових структур. Історично першою розробленою моделлю ринку, що відповідала періоду становлення капіталізму, є модель поліполістичного способу дій. За такої ринкової структури завжди має місце пасивне сприйняття існуючої ціни певного товару, відсутність достатньої та повної інформації щодо місткості ринку, конкурентів, їх діяльності у виробничій та позавиробничій сферах і т. д. Як тільки суб'єкт господарювання відмовляється від поліполістичного способу дій, відбувається перехід до нової структури ринку: олігополії або монополії. З часом можлива подальша трансформація (ускладнення) ринкової структури, яка залежить від багатьох як суб'єктивних, так і об'єктивних чинників.

Класифікація видів стратегічної поведінки підприємства показала, що за умов існування олігополістичної структури ринку, вибір альтернативного варіанту стратегічних дій зводиться, або до наступальних, або до оборонних стратегій, які можуть бути реалізовані за допомогою наступних тактичних прийомів: поступки (пасивна поведінка, коли підприємство не в змозі протидіяти конкуренту або протидія не є доцільною), протидії (домінування на ринку),

компромісу (за умов укладання або без укладання таємної угоди) чи маніпулювання поведінкою контрагента.

Запропоновано загальну схему вибору моделі стратегічної поведінки через проектування основних її процесів, взаємозв'язок між якими показаний на рис. 1.

Рис. 1. Загальна схема вибору моделі стратегічної поведінки підприємства на основі інформаційного проектування

Обґрунтовано тезу, що для аналізу інформації, оцінки її достовірності та інтеграції різноманітних прогнозів (власних і зовнішніх аналітиків) на підприємстві має бути створена система моніторингу. На основі отриманої інформації суб'єкт, що приймає рішення, зможе визначити основні контури майбутньої моделі стратегічної поведінки підприємства, здійснити на її основі попередній аналіз ситуації та передбачити зміни у діях конкурентів щодо цін, обсягів продажу, рекламних заходів тощо. Автор вважає, що використання ситуаційного підходу в системі стратегічного управління дозволяє уникнути розриву між оперативними рішеннями і рішеннями стратегічного характеру.

В основу побудови моделі стратегічної поведінки підприємства покладені базові загальнонаукові принципи та принципи дисциплінарної методології (системного підходу – принципи досягнення пріоритетних цілей, функціональності, ієрархії, цілісності; маркетингу – принцип споживчої орієнтації; загальної теорії управління – принципи динамічності та відкритості; стратегічного управління – принципи процесності, довгострокової спрямованості та ін.), які виступають провідними поняттями, що об'єднують окремі категорії стратегічної поведінки в єдину цілеспрямовану систему знань. Реалізація цих принципів обумовлює наступні особливості моделей стратегічної поведінки: цілеспрямованість, системність, інтегрованість, безперервність, гнучкість, альтернативність, оптимальність, економічна доцільність та ін.

У розділі 2 “Діагностика галузі, ринків та ринкової поведінки вітчизняних підприємств-виробників мінеральних добрив” визначено тенденції та перспективи розвитку вітчизняного ринку азотних добрив за допомогою статистичних методів дослідження; ідентифіковано зони конкурентної боротьби і зони існування монопольного становища основних учасників ринку та обґрунтовані напрямки посилення конкурентної позиції підприємства-олігополіста за рахунок кращого використання його внутрішнього потенціалу.

Тенденції сьогодення щодо розвитку галузі азотних добрив в Україні визначають шість провідних підприємств-виробників: ВАТ “Одеський припортовий завод”, ВАТ “Концерн “Стирол” (м. Горлівка), ВАТ “Азот” (м. Черкаси), ВАТ “Дніпроазот” (м. Дніпродзержинськ), ЗАТ “Сєверодонецьке об'єднання “Азот” і ВАТ “Рівнеазот”. Це великі багатотоннажні виробництва, які мають ряд технологічних та організаційних особливостей, пов'язаних з необхідністю

здійснення безперервного випуску продукції протягом року для досягнення найбільшої ефективності функціонування. Через фізично і техніко-економічно застарілі виробничі потужності вітчизняні компанії мають незадовільну ресурсомісткість виробництва, а також несуть значні витрати на ремонт і реконструкцію основних засобів. Порівняльний аналіз показав, що витрати природного газу в розрахунку на одиницю випущеного аміаку на вітчизняних азотних підприємствах на 10-35% вищі, ніж у американських виробників. При цьому найнижчі витрати природного газу за цим показником має Одеський припортовий завод, де фактичне значення цього показника лише на 7% вище від еталону американських підприємств. Разом з тим, на ВАТ “Концерн “Стирол” показник перевищує відповідне еталонне значення аж на 32,7%.

Аналіз місткості внутрішнього ринка азотних добрив за 2000-2007 рр. виявив стійку тенденцію до скорочення його величини. Подальша оцінка та інтерпретація результатів дослідження дозволила автору визначити основні фактори, що спричиняють скорочення місткості внутрішнього ринку – це зростання цін на природний газ, неефективне державне втручання, неплатоспроможність аграрних підприємств. До того ж, було виявлено, що найбільшим попитом на внутрішньому ринку користується аміачна селітра, а інші види добрив (карбамід, складні фосфорні добрива) не мають такого розповсюдження і використання. Основна причина – високі ціни для споживачів. Виробництво аміачної селітри - основного азотного добрива, що в значних обсягах реалізується на внутрішньому ринку, здійснюється на чотирьох підприємствах: ВАТ “Концерн “Стирол”, ВАТ “Азот”, ВАТ “Рівнеазот” і ЗАТ “Сєвєродонецьке об’єднання “Азот”.

Запропоноване автором використання методики розрахунку сезонних індексів на аміачну селітру дозволило кількісно оцінити вплив сезонності на поведінку споживачів на ринку добрив*.

$$D = 55588.93 - 580.7965n + 73386.34m_2 + 110138.8m_3 + 85936.40m_4 + 37599.12m_5 +$$

(t-Statistic=8,465; St.error=6566,67)	(t-Statistic=-2,07; St.error=280,04)	(t-Statistic=10,22; St.error=7177,65)	(t-Statistic=13,44; St.error=8192,019)	(t-Statistic=10,55; St.error=8140,44)	(t-Statistic=5,72; St.error=6571,27)
--	---	--	---	--	---

$$+ 33481.86m_9 + [\varepsilon = 0.625]. R^2 = 0.934. DW = 1.57. E = 0.000.$$

(t-Statistic=6,71; St.error=4993,39)	(t-Statistic=3,80; St.error=0,16)
---	--------------------------------------

(1)

Умовні позначення:

*- для оцінки сезонних змін використовувалась економетрична модель, яка дозволяє оцінити зміни обсягів продажу відносно лінії тренду, прийнявши за базовий період перший місяць року - m_1 :

$$D_i = \beta_0 - \beta_1 n + \beta_2 m_2 + \beta_3 m_3 + \dots + \beta_{12} m_{12} + \varepsilon,$$

де D – обсяги продажу аміачної селітри на внутрішньому ринку України; β_0 і β_1 параметри лінійної функції, які дозволяють кількісно проаналізувати як зміниться D_i у наступному місяці n_i ; $\{\beta_2, \beta_3, \dots, \beta_{12}\}$ – кількісні значення сезонної компоненти відносно першого місяця по лінії тренду за умов закріплення певного n_i за відповідним значенням місяця $m_{j=\{2,3,\dots,12\}}$. Для перевірки значущості моделі використовувались наступні критерії: R^2 – коефіцієнт детермінації; t -statistic – критерій Стьюдента; $St. error$ – стандартна похибка; DW – критерій Дарбіна-Уотсона; E – ймовірність помилки при прийнятті моделі в цілому за значенням критерію F – статистики; ε – середньо ковазна за помилкою.

Результати розрахунків показали, що для українського ринку мінеральних добрив характерною є активна поведінка аграрних підприємств у весняний та осінній періоди. При цьому аграрні підприємства не приділяють достатньої уваги закупівлі мінеральних добрив у міжсезонний період, коли ціни на добрива знижуються.

Застосування статистичних методик дало можливість встановити функцію попиту на аміачну селітру у період 2000-2003 рр., яка є квадратичною, і має наступний вигляд:

$$Q = 167598.2703 - 170.7000178 * p + 0.02956293446 * p^2 + [\varepsilon = 0.976] . \quad (2)$$

Std.Error=3168.466 t-Statistic=52.89572	Std.Error=9.483066 t-Statistic=-18.00051	Std.Error=0.006842 t-Statistic=4.320502	Std.Error=0.022690 t-Statistic=43.03270
--	---	--	--

Розрахунок показників ринкових часток трьох найбільших азотно-тукових підприємств ($\tilde{N}R_3 > 70\%$) і показника Херфіндаля-Хіршмана (знаходиться в діапазоні від 2500 до 4500) дозволив зробити висновок про наявність високого рівня ринкової концентрації, що підтверджує існування стратегічної взаємозалежності між учасниками ринку олігополії.

Проведено позиціонування українських підприємств-виробників на галузевому рівні. Результатом застосування інструментарію статистичного факторного аналізу (метода головних компонент і методики багатомірного шкалування відстаней) є побудова спільної проекції, у яку одночасно проектується всі азотно-тукові підприємства (тобто – об'єкти) і критерії їх оцінювання. За результатами дослідження у роботі були зроблені висновки, що лідируючі позиції у галузевому просторі займають Одеський припортовий завод, ВАТ “Концерн “Стирол”. Позицію досить близьку до лідерів займає ВАТ “Азот”. Для ВАТ “Дніпроазот”, ЗАТ “Сєвєродонецьке об'єднання “Азот” характерними є значення показників, які досить близькі до середньогалузевих. ВАТ “Рівнеазот”, в свою чергу, через значні технологічні та господарські проблеми, має показники нижчі від середньогалузевого рівня.

У роботі доведена можливість і доцільність застосування методики оцінки просторових меж ринку азотних добрив, оскільки її інструментарій дозволяє не лише визначити ступінь успішності ринкових дій, але й надає можливість оцінити стратегічні наміри підприємств-конкурентів на ринку. Важливо також звернути увагу на те, що існуючим моделям просторової оцінки ринку (С. Селопа, Г. Хотеллінга, М. Ланкастера та ін.) притаманні такі недоліки, як незмінність чи умовне прийняття незмінності параметрів у часі; лінійність функцій попиту, витрат, пов'язаних з виробництвом і транспортуванням продукції; однорідність покупців; обмеженість числа учасників ринку та ін. З метою усунення зазначених недоліків автором запропоновано удосконалити методику просторової оцінки меж ринку за допомогою використання математичного інструментарію роботи з множинами і відображеннями.

На рис. 2 графічно представлені окремі варіанти стратегічної взаємодії між дуополістами:

Рис. 2. Окремі варіанти взаємодії підприємств на просторовому ринку за умов асиметрії у цінах і витратах на транспортування

На підставі використання запропонованої методики була здійснена оцінка монопольних і конкурентних позицій українських підприємств-виробників на внутрішньому ринку, яка довела існування стратегічних взаємозв'язків між ВАТ “Рівнеазот” і ВАТ “Азот” у західних, центральних та північних областях, і між ВАТ “Азот” і ЗАТ “Сєвєродонецьке об'єднання “Азот” у східних та південних областях.

При цьому слід зазначити, що ВАТ “Концерн “Стирол” в основному спеціалізується на експорті продукції і незацікавлений у конкурентній боротьбі з ВАТ “Азот” і ЗАТ “Сєвєродонецьке об'єднання “Азот”. Це, в свою чергу, дозволило зробити припущення про існування дуополістичної залежності між учасниками ринку.

У розділі 3 – **“Методичне та організаційно-інформаційне забезпечення формування, обґрунтування і реалізації стратегічної поведінки підприємства-олігополіста”** проведено критичний огляд теоретичних підходів, що стосуються питання моделювання стратегічної взаємодії учасників ринку; визначено можливості застосування інструментарію теорії динамічних систем для моделювання поведінки олігополістів; показано правила взаємодії учасників за умов одночасного і поетапного прийняття рішень; розроблено графічні моделі поведінки дуополістів, що демонструють досягнення складної рівноваги; запропоновано методику визначення найбільш доцільної моделі стратегічної поведінки для підприємств-виробників мінеральних добрив та організаційно-інформаційного механізму її забезпечення.

Центральне місце у запропонованій автором концепції стратегічної поведінки підприємства займає методичний інструментарій, застосування якого дозволить аналітикам і планово-економічним підрозділам підприємств кількісно оцінити стратегічні наміри підприємств-конкурентів та визначити власну довгострокову ринкову поведінку. Опрацювання висвітлених в науковій літературі підходів стосовно формування концепції стратегічної поведінки на базі використання математичного інструментарію показало, що погляди з цього питання науковців є неоднозначними. Так, в моделях олігополії дослідники часто приймають припущення про “раціональні очікування” основних учасників ринку, які в змозі передбачити результати власних дій і дій своїх конкурентів, а інші дослідники, навпаки, вважають, що учасники ринку не в змозі оцінити складну динаміку при прийнятті рішення в умовах невизначеності і можливої недостовірності інформації. Зазначено, що більшість сучасних методик діагностування ринкових структур розглядається на прикладі лінійних взаємозв'язків, що є значним спрощенням реальної дійсності. Але сучасна економічна система переповнена різноманітними нелінійними процесами, тому в рамках даного наукового дослідження автором розглянуто моделі поведінки олігополістів з урахуванням нелінійних взаємозв'язків.

За допомогою використання біфуркаційного аналізу було досліджено динамічні моделі поведінки олігополістів за умов поетапного чи одночасного прийняття рішень підприємствами-конкурентами. Результати дослідження підтвердили досягнення складної рівноваги, тобто виникнення циклів різного періоду і хаосу; автором доведено, що окремі положення неокласичної школи, які розглядались за умов лінійності, не спрацьовують. Розгляд лінійних динамічних моделей олігополії показав, що періодичні зовнішні впливи загасають після перехідних процесів і відбувається рух до рівноваги. Виключенням є параметричні лінійні системи, яскравим прикладом яких є модель Т. Паландера з ламаною функцією ринкового попиту і незначною асиметрією у функції витрат основних учасників.

Уточнено зміст економічної категорії “стабільність” через розмежування та деталізацію понять “мультирівновага” та “мультистабільність”. Пропонується визначати мультирівновагу як здатність системи досягати рівноваги, більше ніж в одній точці. На відміну від мультирівноваги мультистабільність характеризує процес, який пов’язаний не лише з досягненням рівноваги (атракторів), але й зі здатністю учасників у разі виникнення вимушених відхилень знову повертатись до області рівноваги.

Досліджено взаємозв’язок між значеннями параметрів та змінних у нелінійній динамічній моделі олігополії Д. Ранда за допомогою побудови біфуркаційної діаграми. За результатами аналізу обсягів продажу продукції конкурентів, виведено наступну закономірність, що за умов підвищення рівня складності у кривих реагування учасників у моделях олігополії утворюються цикли різних періодів і хаотичні коливання. Чим складніші криві реагування учасників, тим більша ймовірність отримання нестабільної моделі (рис. 3 а, б).

Узагальнення наукових розробок з області економіко-математичного моделювання та інших областей наукового пізнання дозволило зробити важливий висновок про те, що інструментарій теорії динамічних систем доцільно використовувати з метою моделювання стратегічної поведінки підприємства за умов чіткого визначення лінійної або нелінійної залежності між основними змінними у моделі. За таких умов основні завдання аналітичних служб підприємства зводяться до визначення виду хаотичного коливання та критичних значень біфуркаційних параметрів досліджуваної системи, узагальнення критеріїв хаосу, виділення різних хаотичних режимів і побудови якісних характеристик хаотичного атрактора.

Рис. 3. Біфуркаційні діаграми, побудовані за обсягами продажу продукції дуополістів у моделі Д. Ранда (початкова умова: $x_0 = 0,1$, $y_0 = 0,1$)

Запропоновані рекомендації для азотно-тукових підприємств щодо доцільності застосування ряду спрощень при моделюванні стратегічної поведінки підприємств, а саме: зменшення кількості учасників до двох або трьох; прийняття лінійних взаємозв’язків у функції

попиту, витрат та інших основних змінних. Доведено, що при визначенні кривих реагування підприємств неможливо недооцінювати нелінійні процеси, за результатом пояснення яких у моделях олігополії може виникати мультирівновага. За відсутності можливості отримання точного прогнозу майбутнього стану системи, для моделювання стратегічної поведінки підприємства доцільно використовувати ймовірнісний підхід.

Для визначення найбільш доцільної моделі стратегічної поведінки підприємства автором за попередньо визначеними параметрами та змінними (ступенем впливу на дії конкурентів, схемами взаємодії між учасниками ринку, видом керованої змінної, рівнем доступу до інформації, швидкістю реагування учасників тощо) проаналізовано альтернативні моделі стратегічної поведінки підприємства. На основі запропонованої класифікації моделей визначено, що для підприємств-виробників мінеральних добрив, які конкурують на внутрішньому ринку, слід застосовувати моделі цінової дуополії за умов обмеженого доступу до інформації, погоджених або непогоджених дій її учасників, нелінійної функції попиту.

За результатами здійсненої ідентифікації моделей стратегічної поведінки дуополістів визначено можливість використання інструментарію теорії ігор, як одного із альтернативних варіантів моделювання стратегічної поведінки підприємства. Так, за умов застосування теорії ігор прогнозування обсягів збуту продукції підприємствами-виробниками азотних добрив доцільно описувати через тактичні прийоми: $\mathfrak{Z}_1$ – поступки (пасивна поведінка, коли підприємство не в змозі протидіяти конкуренту або протидія не є доцільною), $\mathfrak{Z}_2$ – протидії (домінування на ринку), $\mathfrak{Z}_3$ – компромісу (за умов укладання або без укладання таємної угоди), $\mathfrak{Z}_4$ – маніпулювання. У такій же послідовності можна визначити можливі стратегії конкурента, позначивши їх через $\mathfrak{R}_1, \mathfrak{R}_2, \mathfrak{R}_3, \mathfrak{R}_4$.

На основі розрахункових значень показників (функцій близькості виробників до споживачів, величини транспортного тарифу, розрахункової величини витрат підприємств, рівня прибутковості, величини прямих податків) для кожної пари учасників ринку азотних добрив нами було побудовано матриці прибутків (збитків).

Результати моделювання величини прибутку (збитку) кожного учасника за умов реалізації ними обраних стратегій показали, що для ВАТ “Азот” і ЗАТ “Севєродонецьке об’єднання “Азот” дана задача має розв’язок лише у чистих стратегіях за Дж. Нешем, оскільки в змішаних стратегіях розв’язку немає. Розгляд чистих стратегій вказує на домінування стратегій $\mathfrak{R}_3$ і $\mathfrak{Z}_3$, що визначає необхідність погодження дій між ВАТ “Азот” і ЗАТ “Севєродонецьке об’єднання “Азот” (рис. 4).
Рис. 4. Визначення домінуючих стратегій для ВАТ “Азот” і ЗАТ “Севєродонецьке об’єднання “Азот”

Моделювання дуополістичної залежності між ВАТ “Азот” і ВАТ “Рівнеазот”, навпаки, показало наявність розв’язку у змішаних стратегіях. ВАТ “Рівнеазот” є єдиним виробником азотних добрив у північно-західній частині України, але через недосконалу схему виробництва аміаку, ціни на його продукцію є значно вищими, ніж на ВАТ “Азот”, навіть з урахуванням транспортних витрат. За таких умов, у зазначеному регіоні ВАТ “Азот” можна вважати лідером, а ВАТ “Рівнеазот” – аутсайдером. Результати моделювання підтвердили, що ВАТ “Рівнеазот”, як аутсайдер, при виборі власної стратегії знаходиться в значній залежності від обраної стратегії лідера.

Аналіз існуючих схем організаціо-інформаційного забезпечення підприємств-виробників мінеральних добрив показав їх недосконалість, що зумовлено цілим рядом стихійних перетворень у окремих структурних підрозділах цих підприємств: посилилась роль аналітичного відділу, відділів збуту, маркетингу та були створені нові відділи (безпеки інформації та антикризового управління). Але питання побудови гнучкої організаційної структури, яка б базувалась на принципах самоорганізації та самонавчання так і не було вирішено. Реалізація запропонованих нами механізмів впровадження стратегічної поведінки підприємства дозволила поєднати елементи методичного, організаційного та інформаційного забезпечення в єдину систему управління підприємством, що в свою чергу, дало змогу вирішити питання побудови ефективної гнучкої організаційної структури.

ВИСНОВКИ

У дисертації здійснено теоретичне узагальнення і запропоновано нове вирішення наукового завдання щодо розробки й обґрунтування теоретичних, методичних і прикладних аспектів стратегічної поведінки підприємства-олігополіста. Основні висновки та результати теоретичного, методичного і наукового спрямування, є такими:

1. Розмежування та змістовне уточнення понять “економічна поведінка підприємства”, “ринкова поведінка підприємства”, “стратегічний намір підприємства” дозволило визначити поняття “стратегічна поведінка” як систему взаємопов’язаних дій, до складу якої входять дослідження, аналіз, оцінка, прогнозування вже існуючих стратегій чи можливих стратегічних намірів основних учасників ринку, а також формування, обґрунтування і застосування власної манери стратегічних дій з урахуванням своєчасної та ефективної реакції підприємства на обрану поведінку конкурента. Сприйняття стратегічної поведінки підприємства як процесу розробки й прийняття управлінських рішень дозволило визначити її складові та можливості інтеграції в загальну систему планування і контролю на підприємстві.

2. Здійснений розгорнутий ретроспективний аналіз існуючих моделей стратегічної поведінки підприємства показав, що окремі моделі можуть лише фрагментарно пояснювати

складність та багатоаспектність стратегічної поведінки підприємств. Основними причинами визначені наступні: неможливість врахування в окремій моделі одночасно всіх змінних, складність взаємодії основних учасників та багатоваріантність їх інтересів, полікритеріальність визначення оптимальної стратегії. Доведено, що лише взяті у своїй сукупності моделі стратегічної поведінки підприємства формують багатий методичний інструментарій для дослідження цього явища.

3. Оцінено переваги і недоліки застосування інструментарію теорії динамічних систем та ймовірного підходу при моделюванні поведінки олігополістів і визначено, що в рамках будь-якої економіко-математичної моделі неможливо врахувати всі стратегічні наміри її учасників, які можуть використовуватися як для маскувння неефективності, так і для забезпечення високих економічних результатів підприємства. Результати розгляду динамічних моделей олігополії з нелінійною функцією попиту показали, що навіть за умов повної визначеності, можливе виникнення точкових циклів різного періоду та хаосу, як крайнього випадку складної рівноваги. Обґрунтовано, що за відсутності можливості отримання точного прогнозу майбутнього стану системи, для моделювання поведінки підприємств-конкурентів доцільно використовувати ймовірнісний підхід.

4. Побудована концепція стратегічної поведінки через проектування основних її процесів, а саме: проведення стратегічного моніторингу середовища підприємства, створення бази знань про стратегічні наміри та можливу поведінку контрагентів, розробки і вибору алгоритму стратегічної поведінки, реалізації обраної поведінки, оцінки та контролю досягнутих результатів, дозволила поєднати елементи методичного, організаційного та інформаційного забезпечення в єдину цілеспрямовану систему управління підприємством на базі загальнонаукових та спеціальних принципів наукового пізнання.

5. Магістральною тенденцією сучасного ринку азотних добрив України є підвищення рівня інтенсивності конкуренції між вітчизняними підприємствами-виробниками у сезонний період підвищення попиту зі сторони споживачів і, навпаки, тенденцію до скорочення його рівня – у міжсезонний період. Для підтримки та розвитку власної конкурентної позиції вітчизняні підприємства-виробники азотних добрив, за умов випуску і реалізації стандартизованої продукції, змушені більш активно реагувати на зміни у діях підприємств-конкурентів. Проведені розрахунки показників ринкової концентрації підприємств-виробників та оцінка взаємозв'язків між ними дають підстави визначити структуру ринку як олігополістичну.

6. На основі запропонованої методики просторової оцінки меж ринку проведено діагностування зон монопольної і конкурентної боротьби українських підприємств-виробників на внутрішньому ринку аміачної селітри, що засвідчило існування стратегічної взаємозалежності між ВАТ “Рівнеазот” і ВАТ “Азот” у західних, центральних і північних областях, і між ВАТ “Азот” і ЗАТ “Севєродонецьке об'єднання “Азот” – у східних і південних областях. Стосовно ВАТ “Концерн “Стирол” слід зазначити, що воно в основному спеціалізується на експорті продукції і

незацікавлено у конкурентній боротьбі з ВАТ “Азот” і ЗАТ “Сєвєродонецьке об’єднання “Азот”. Це, в свою чергу, дозволило зробити припущення про існування дуополістичної залежності між учасниками ринку.

7. Результати статистичного факторного аналізу, в ході якого було проведено позиціонування українських підприємств-виробників азотних добрив, чітко фіксують, що лідируючі позиції у галузевому просторі займають Одеський припортовий завод, ВАТ “Концерн “Стирол”, позицію досить близьку до лідируючих займає ВАТ “Азот”. Для ВАТ “Дніпроазот”, ЗАТ “Сєвєродонецьке об’єднання “Азот” характерними є значення показників, які досить близькі до середнього галузевих. ВАТ “Рівнеазот”, в свою чергу, через значні технологічні та господарські проблеми має показники значно нижчі від середньогалузевого рівня.

8. Ключова ідея розроблених автором рекомендацій щодо застосування економіко-математичних моделей для оптимізації стратегічної поведінки підприємств полягає у необхідності обґрунтування низки змістовних спрощень, які пов’язані зі зменшенням кількості учасників до двох або трьох, прийняттям лінійних взаємозв’язків у функціях попиту, витрат та інших основних змінних. Реалізація зроблених спрощень дозволила отримати адекватні моделі, використання яких дало змогу суттєво підвищити ефективність діяльності підприємства та зміцнити його ринкові позиції у довгостроковій перспективі.

9. Аналіз базових моделей стратегічної поведінки підприємств-олігополістів дозволив виявити найбільш значущі стратегічні параметри та змінні: ступінь впливу на дії конкурентів, схему взаємодії між учасниками ринку, вид керованої змінної, рівень доступу до інформації, швидкість реагування учасників тощо. Розроблені методичні рекомендації дозволяють підприємствам-виробникам мінеральних добрив на основі попередньо визначених ними параметрів і змінних майбутньої моделі чітко ідентифікувати прийнятну для використання модель стратегічної поведінки підприємства та оцінити можливості її застосування на практиці.

10. Діагностика існуючих організаційних структур управління вітчизняних підприємств-виробників мінеральних добрив показала їх недосконалість, що зумовлено цілою низкою стихійних перетворень і реорганізаційних змін. Реалізація розробленої схеми організаційно-інформаційного забезпечення найбільш прийнятної моделі стратегічної поведінки підприємства дозволила інтегрувати її в загальну структуру управління, попередньо закріпивши функції щодо проектування, затвердження, інформування, узгодження, виконання та контролю за центрами відповідальності. Це, в свою чергу, дозволило удосконалити існуючу організаційну структуру підприємства та забезпечити її гнучкість через реалізацію адекватної та своєчасної реакції підприємства на поведінку основних конкурентів.

Пропозиції і рекомендації дисертаційної роботи апробовані на практиці та можуть бути використані для формування, обґрунтування і застосування науково-обґрунтованих моделей

стратегічної поведінки підприємства з урахуванням можливої поведінки конкурентів на олігополістичному ринку.

ПЕРЕЛІК ПУБЛІКАЦІЙ АВТОРА ЗА ТЕМОЮ ДИСЕРТАЦІЇ

У наукових фахових виданнях:

1. Лозовик Ю.М. Економічне діагностування ринку аміаку: ціновий контекст / Ю.М. Лозовик // Стратегія економічного розвитку України : Наук. зб. – Вип. 17/ Гол. ред. А.П. Наливайко. – К. : КНЕУ, 2005. – С. 58-66 (0,48 д. а.).
2. Лозовик Ю.М. Збутова поведінка підприємств-виробників за умов сезонного попиту на мінеральні добрива в Україні / Ю.М. Лозовик // Менеджмент : збірник наукових праць. – Вип. 6. – К. : Міжгалузовий інститут управління, 2006. – С. 120-134 (0,30 д. а.).
3. Лозовик Ю.М. Моделювання поведінки олігополістів з використанням інструментарію теорії динамічних систем / Ю.М. Лозовик // UKRAINIAN JOURNAL “Економіст”. – №11. – 2007. – С. 61-65 (0,56 д. а.).
4. Лозовик Ю.М. Оцінка стабільності у динамічних кількісних моделях стратегічної поведінки олігополістів / Ю.М. Лозовик // Економіка : проблеми теорії та практики : Збірник наук. праць. – Вип. 234. – Дніпропетровськ : ДНУ, 2007. – С. 600-613 (0,41 д. а.).

В інших наукових виданнях:

5. Лозовик Ю.М. Дослідження поведінки цін на ринку азотних добрив у період 2001-2003 рр. / Ю.М. Лозовик // Вчені записки. – Вип. 14. – К. : Університет економіки і права “Крок”, 2005. – С. 64-73 (0,51 д. а.).
6. Лозовик Ю.М. Особливості поведінки підприємств-виробників мінеральних добрив в умовах невизначеності / Ю.М. Лозовик // Матеріали II Всеукраїнської науково-практичної конференції “Економіко-математичні методи прийняття управлінських рішень на сучасному етапі”. – Дніпропетровськ : Наука і освіта, 2004. – С. 91-93 (0,06 д. а.).
7. Лозовик Ю.М. Процес розробки і реалізації стратегії за умов структурно мінливого зовнішнього середовища / Ю.М. Лозовик // Наукова робота – складова діяльності університету : збір. мат. науково-практичної конференції науково-педагогічних працівників. – К. : Університет економіки і права “Крок”, 2005. – С. 144-147 (0,11 д. а.).
8. Лозовик Ю.М. Стратегічна поведінка українських підприємств-експертів на ринку аміачної селітри / Ю.М. Лозовик // Збірник тез доповідей ТАНГ Другої міжнародної науково-практичної конференції молодих вчених “Економічний і соціальний розвиток України в ХХ столітті : національна ідентичність та тенденції глобалізації”. – Ч. 1 – Тернопіль : Економічна думка, 2005. – С. 213-215 (0,09 д. а.).

9. Лозовик Ю.М. Стратегічна поведінка підприємств-виробників на олігополістичному ринку / Ю.М. Лозовик // Матеріали VIII Міжнародної науково-практичної конференції “Наука і освіта 2005”. – Т. 79. – Маркетинг та менеджмент. – Дніпропетровськ : Наука і освіта, 2005. – С. 28-30 (0,11 д. а.).
10. Лозовик Ю.М. Формалізація методики дослідження внутрішнього потенціалу підприємств-конкурентів на базі інструментарію статистичного факторного аналізу / Ю.М. Лозовик // Управління стратегічними змінами на підприємстві: концептуальні засади, методологія та практика : Міжнар. наук.-практ. конф. / Відп. ред. А.А. Мазаракі. – К. : Київ. нац. торг.-екон. ун-т, 2005. – С. 131-133 (0,08 д. а.).
11. Лозовик Ю.М. Мультирівновага і динаміка у моделях олігополії з нелінійною функцією ринкового попиту / Ю.М. Лозовик // Економічна організація та економічна освіта : взаємообумовленість стратегій розвитку: збір. мат. Міжн. наук.-практ. конф., присвяч. 100 річчю від дня народження Бухала Сергія Максимовича, доктора економічних наук, професора. / Відп. за вип. А.П. Наливайко. – К. : КНЕУ. – 2007. – С. 299-301 (0,05 д. а.).
12. Лозовик Ю.М. Оцінка стабільності і рівноваги у відкритих соціально-економічних системах / Ю.М. Лозовик // Проблеми управління у сфері підприємництва : Матеріали науково-практичної конференції. – К. : Університет економіки і права “Крок”, 2007. – С. 229-230 (0,06 д. а.).

АНОТАЦІЯ

Лозовик Ю.М. Стратегічна поведінка підприємства на олігополістичному ринку (на прикладі українських підприємств-виробників мінеральних добрив) – Рукопис.

Дисертація на здобуття наукового ступеня кандидата економічних наук за спеціальністю 08.00.04 – «Економіка і управління підприємствами (за видами економічної діяльності)». – ДВНЗ «Київський національний економічний університет імені Вадима Гетьмана», Київ, 2008.

Дисертацію присвячено вирішенню теоретичних, методичних і прикладних питань формування, обґрунтування та застосування стратегічної поведінки підприємства, що функціонує на олігополістичному ринку.

Досліджено еволюцію теорії олігополії, присвяченої питанням стратегічної поведінки підприємства. Здійснено міждисциплінарний аналіз понятійного апарату досліджуваної предметної галузі та проведене його впорядкування. Сформовані базові підходи до побудови концепції стратегічної поведінки підприємства.

Проведено діагностику галузі, ринків і ринкової поведінки українських підприємств-виробників мінеральних добрив. Оцінені сильні та слабкі сторони підприємств-виробників азотних добрив у галузевому аспекті. За авторською методикою оцінено просторові межі

внутрішнього ринку азотних добрив. Обґрунтовано вибір моделей стратегічної поведінки підприємств на рівні двох учасників (дуополії).

Розглянуті переваги і недоліки існуючих моделей дуополії, тріополії та математичного інструментарію, що використовується для їх аналізу. Розроблені методичні рекомендації щодо вибору оптимальної моделі стратегічної поведінки підприємства-олігополіста із альтернативних варіантів та її адаптації до потреб підприємства з використанням інструментарію теорії динамічних систем і теорії ігор. Запропоновані рекомендації щодо організаційного та інформаційного забезпечення реалізації моделі стратегічної поведінки підприємства.

Ключові слова: стратегічна поведінка підприємства, олігополістична ринкова структура, олігополіст, дуополія, тріополія, теорія ігор, динамічна система, азотно-тукові підприємства (підприємства-виробники мінеральних добрив).

АННОТАЦИЯ

Лозовик Ю.Н. Стратегическое поведение предприятия на олигополистическом рынке (на примере украинских предприятий-производителей минеральных удобрений). – Рукопись.

Диссертация на соискание учёной степени кандидата экономических наук по специальности 08.00.04 – «Экономика и управление предприятиями (за видами экономической деятельности)». – ГВУЗ «Киевский национальный экономический университет имени Вадима Гетьмана», Киев, 2008.

В диссертации проведено междисциплинарное исследование различных аспектов стратегического поведения предприятия, что позволило уточнить сущность таких понятий, как «экономическое поведение», «стратегическое поведение» и сформулировать авторское видение понятия «стратегическое поведение» как систему взаимосвязанных действий, в состав которой входит исследование, анализ, оценка, прогнозирование уже существующих стратегий или возможных стратегических намерений основных участников рынка, а также формирование, обоснование и использование собственной манеры стратегических действий с учетом своевременной и эффективной реакции предприятия на выбранное поведение конкурента.

Осуществлена систематизация научных взглядов, концепций, методик стратегического поведения предприятия, начиная с пионерной работы О. Курно в 1838 г. и целого ряда первоначальных критических работ исследователей XIX-XX вв. и заканчивая рассмотрением новых подходов к разработке стратегического поведения олигополиста в условиях неопределённости и хаоса.

Анализ научных работ по моделированию поведения олигополистов в области экономической динамики с учётом нелинейных процессов указывает на возможность возникновения в модели сложной динамики (циклов различного периода, торов и хаотических

режимов). Переход от стабильности к нестабильности в подобных системах происходит циклично – период стабильности сменяется хаотичностью, и наоборот, хаотичность сменяется стабильностью.

В работе сделан вывод, что понятие «стратегическое поведение предприятия» выходит за рамки эффективного проектирования и моделирования возможных стратегий участников рынка, поскольку определенные параметры не поддаются формализации, например: скорость реагирования участников, качество полученной информации и др. параметры. Поэтому концепция «рациональных ожиданий» не всегда оправдана на практике, но, безусловно, является необходимой теоретической платформой для понимания трансформационных процессов, связанных со структурой рынка. Доказано, что при отсутствии возможности получения точной информации, относительно его будущего состояния системы для моделирования поведения олигополиста целесообразно использовать вероятностный подход.

В диссертации доказана целесообразность использования методики пространственной оценки рынка, которая позволяет не только оценить степень успешности рыночных действий основных участников, но и дает возможность определить их стратегические замыслы.

На основе полученных результатов диагностики монопольных и конкурентных зон украинских азототуковых предприятий на внутреннем рынке Украины определены основные зоны конкуренции между ОАО «Ривнеазот» и ОАО «Азот» в северных, западных и центральных областях, и между ОАО «Азот» ЗАО «Северодонецкое объединение «Азот» в южных и восточных областях. Установлено, что ОАО «Концерн «Стирол» в основном специализируется на экспорте своей продукции и незаинтересовано в осуществлении конкуренции с ОАО «Азот» и ЗАО «Северодонецкое объединение «Азот». Это позволило выдвинуть гипотезу о существовании дуополистической зависимости между участниками рынка. В работе доказана необходимость использования инструментария теории игр при разработке и реализации стратегии, которая позволит оценить реакцию конкурента на поведение определённого предприятия. В работе приведены примеры использования инструментария теории игр при разработке возможных схем взаимодействия участников на внутреннем рынке азотных удобрений в Украине.

Автором осуществлено позиционирование украинских азототуковых предприятий на отраслевом уровне. Для этого в исследовании были использованы экспертные методики на основе инструментария нечётких множеств, которые чаще всего используются для работы с интервальными значениями, а также статистический факторный анализ, который целесообразно использовать для работы с точечными значениями.

Моделирование величины прибыли (убытка) каждого участника в условиях реализации выбранных ими стратегий показало, что для ОАО «Азот» и ЗАО «Северодонецкое объединение «Азот» данная задача имеет решение только в чистых стратегиях по Дж. Нешу, так как в смешанных стратегиях решения нет. Рассмотрение чистых стратегий указывает на доминирование

стратегий, которые определяют необходимость согласования действий между ОАО «Азот» и ЗАО «Северодонецкое объединение «Азот».

Моделирование дуополистической зависимости между ОАО «Азот» и ОАО «Ривнеазот», наоборот, показало наличие решения в смешанных стратегиях. ОАО «Ривнеазот» является единственным производителем азотных удобрений в северо-западной части Украины, но из-за несовершенной схемы производства аммиака, цены на его продукцию являются значительно более высокими, чем на ОАО «Азот», даже с учетом транспортных затрат. Сделан вывод, что в названном регионе ОАО «Азот» можно считать лидером, а ОАО «Ривнеазот» - аутсайдером. Результаты моделирования подтвердили, что ОАО «Ривнеазот», как аутсайдер, при выборе собственной стратегии находится в значительной зависимости от выбранной стратегии лидера.

Разработанная схема организационно-информационного обеспечения оптимальной модели стратегического поведения предприятия позволяет интегрировать ее в общую структуру управления, предварительно закрепив функции проектирования, утверждения, информирования, согласования, исполнения и контроля по центрам ответственности. Это дало возможность усовершенствовать существующую организационную структуру предприятия и обеспечить ее гибкость с помощью реализации адекватной и своевременной реакции предприятия на поведение основных конкурентов.

Ключевые слова: стратегическое поведение предприятия, олигополистическая структура рынка, олигополист, дуополия, триополия, теория игр, динамическая система, азотнотуковые предприятия.

ABSTRACT

Lozovik Y.M. The strategic behavior of the enterprise on the oligopolistic market (based on the example of the Ukrainian enterprises-manufacturers of the mineral fertilizers). – the manuscript.

The dissertation is on getting scientific degree of the candidate of economic sciences on a speciality 08.00.04 – «Economy and management of the enterprises (by kinds economics activities)». – «Kiev National Economic University named by V. Getman», – Kiev, 2008.

The dissertation has been devoted to the decision of theoretical, methodical and applied questions of forming, grounding and application of the strategic behavior of an enterprise which functions on an oligopolistic market.

Development of the oligopoly theory is considered in the papers. The multi disciplinary analysis of concepts of the investigated subject area has been carried out and its arrangement has been conducted. Basic approaches to the construction of conception of the strategic behavior of an enterprise have been formed.

Diagnostics of the industry, markets and marketing behavior of the Ukrainian enterprises-producers of mineral fertilizers has been conducted. The strengths and weaknesses of enterprises-producers of nitric fertilizers have been appraised in an industry aspect. Based on the author methodic, the spatial scopes of internal market of nitric fertilizers have been appraised. The choice of models of strategic behavior of enterprises at the level of two participants (duopoly) has been substantiated.

Advantages and lacks of existent models of duopoly, triopoly and mathematical tools for their analysis have been considered. Methodical recommendations on the choice of optimum model of strategic behavior of an enterprise-oligopolist and its adaptation to the company needs with the use of tool of theory of dynamic systems and theory of games have been developed. The recommendations on organizational and informative providing of realization of the model of strategic behavior of enterprise have been proposed.

Keywords: strategic behavior of the enterprise, oligopolistic market structure, oligopoly, duopoly, triopoly, the theory of games, dynamical system, nitrogen fertilizer enterprise.