

ФАКТОРНИЙ АНАЛІЗ ЯК ІНСТРУМЕНТ ДОСЛІДЖЕННЯ МНОЖИНИ ОЗНАК ПРИ ФОРМУВАННІ СТРАТЕГІЇ

Кагановський О.С.

*Харківський національний економічний університет
імені Семена Кузнеця, м. Харків*

В сучасних економіко-математичних дослідженнях під факторним аналізом розуміють сукупність методів, які на основі реально існуючих зв'язків ознак дають змогу виявляти латентні узагальнювальні характеристики організаційної структури та механізму розвитку явищ і процесів, що досліджуються. Усі методи і моделі факторного аналізу поділяються на класифікаційні групи.

1. Метод головних компонент за Г. Готеллінгом. Специфічним є, по-перше, те, що під час обчислювальних процедур одночасно отримують усі головні компоненти, і їх кількість спочатку дорівнює числу елементарних ознак; по-друге, постулюється можливість повного розкладання дисперсії елементарних ознак, інакше кажучи, її повне пояснення через латентні чинники.

2. Методи факторного аналізу. Відмінна особливість цих методів полягає в тому, що дисперсія елементарних ознак пояснюється не в повному обсязі, визнається, що частина дисперсії залишається нерозпізнаною, як характерність. Фактори зазвичай виокремлюють послідовно: перший, що пояснює найбільшу частку варіації елементарних ознак, потім другий, що пояснює меншу, другу після першого латентного фактора, частину дисперсії, третій, тощо. Процес виокремлення чинників може бути перервано на будь-якому кроці, якщо прийняте рішення про достатність частки поясненої дисперсії елементарних ознак або з урахуванням інтерпретованості латентних чинників.

Групу методів факторного аналізу доцільно класифікувати, як спрощені та сучасні апроксимуючі методи. Методи факторного аналізу мають широкі властивості, результати яких можуть використовуватися у складі інших статистичних методів та їх комбінацій, а саме в кореляційно-регресійному та кластерному аналізі, багатовимірному шкалюванні, тощо. Методи факторного аналізу дають змогу візуалізувати структуру досліджуваних явищ і процесів, а отже, визначати їхній стан, структуру, відмінності для прогнозування та формування стратегії сталого розвитку. Отже, результати факторного аналізу дають підстави для глибинної ідентифікації об'єкта згідно поставлених задач, що особливо актуально при формуванні стратегії сталого розвитку підприємств малого та середнього бізнесу у кластерних структурах[1].

Література:

1. Єгоршин О. О., Зосімов А. М., Пономаренко В. С. Методи багатого статистичного аналізу. – К.: ІЗМН, 1998. – 208 с.
2. Пономаренко В. С., Ястремська О. Н., Луцковський В. М. та ін. Механізм управління підприємством: стратегічний аспект. - Харків: Вид. ХДЕУ, 2002. - 252 с.