Федюнина Анна Андреевна. Влияние экспорта на экономический рост в российских регионах: диссертация ... кандидата Экономических наук: 08.00.14 / Федюнина Анна Андреевна;[Место защиты: ФГАОУВО Национальный исследовательский университет Высшая школа экономики], 2017.- 226 с.

**Содержание к диссертации**

Введение

**ГЛАВА 1 Теоретические и эмпирические эффекты влияния экспорта на экономический рост 16**

1.1 Эффекты влияния экспорта на экономический рост в национальных экономиках в теоретических и эмпирических исследованиях 16

1.2 Эффекты влияния экспорта на экономический рост для территориально неоднородной национальной экономики 34

**ГЛАВА 2 Методология эмпирического анализа интенсивного и экстенсивного роста экспорта 62**

2.1 Эмпирические результаты оценки соотношения интенсивного и экстенсивного роста экспорта в мировой экономике 62

2.2 Гипотезы и эмпирические результаты оценки влияния интенсивного и экстенсивного роста экспорта на экономический рост в исследованиях микро-и макроэкономического уровня 76

2.3 Методика декомпозиции темпов роста экспорта, учитывающая товарное и географическое разнообразие экспорта 92

**ГЛАВА 3 Эмпирический анализ эффектов влияния экспорта на экономический рост в российских регионах в 2002-2010 годах 101**

3.1 Особенности интенсивного и экстенсивного роста экспорта российских регионов в 2002-2010 годах 101

3.2 Эмпирический анализ эффектов влияния интенсивного и экстенсивного роста экспорта на экономический рост в российских регионах в 2002-2010 годах 124

3.3 Эмпирический анализ факторов интенсивного роста экспорта российских регионов в 2002-2010 годах 136

Заключение 174

Список литературы 180

* [Эффекты влияния экспорта на экономический рост для территориально неоднородной национальной экономики](http://www.dslib.net/economika-mira/vlijanie-jeksporta-na-jekonomicheskij-rost-v-rossijskih-regionah.html#7651301)
* [Гипотезы и эмпирические результаты оценки влияния интенсивного и экстенсивного роста экспорта на экономический рост в исследованиях микро-и макроэкономического уровня](http://www.dslib.net/economika-mira/vlijanie-jeksporta-na-jekonomicheskij-rost-v-rossijskih-regionah.html#7651302)
* [Методика декомпозиции темпов роста экспорта, учитывающая товарное и географическое разнообразие экспорта](http://www.dslib.net/economika-mira/vlijanie-jeksporta-na-jekonomicheskij-rost-v-rossijskih-regionah.html#7651303)
* [Эмпирический анализ эффектов влияния интенсивного и экстенсивного роста экспорта на экономический рост в российских регионах в 2002-2010 годах](http://www.dslib.net/economika-mira/vlijanie-jeksporta-na-jekonomicheskij-rost-v-rossijskih-regionah.html#7651304)

## Эффекты влияния экспорта на экономический рост для территориально неоднородной национальной экономики

Модель Д.Рикардо с двумя странами, двумя товарами и одним фактором производства расширяет модель Смита для случая, когда одна страна более эффективна по производству обоих товаров. Международная торговля, согласно Рикардо, возникает вследствие международных различий в относительной производительности труда. Аналогично модели Смита, в модели Рикардо переход к специализации и экспорт одного из товаров приносит выгоды и рост благосостояния для обеих экономик.

Таким образом, как отмечается [Sen, 2005, p. 1012] свободная торговля и переход к специализации в моделях Смита и Рикардо может рассматриваться как способ достижения производственной эффективности на глобальном уровне. Это также соответствует результатам [Krugman, 2009, p. 34], где отмечается, что валовой мировой выпуск может увеличиться в случае внешнеторговой специализации стран на товарах их сравнительного преимущества.

Если в классических теориях международной торговли допущения об однородности и единственности производственного фактора (труда) обуславливают получение выгод всеми участниками международной торговли, то допущение о множественности и специфичности факторов, сделанные в неоклассических моделях, позволяют получить несколько иные выводы в отношении распределения выигрыша между торговли.

В соответствии со стандартной моделью Хекшера-Олина с двумя странами, двумя отраслями и двумя факторами производства, стимулом для торговли является различие между странами в относительной избыточности факторов производства, переход от автаркии к свободной торговле сопровождается эффектами перераспределения выгод: относительно избыточный в стране фактор производства выигрывает, а относительно дефицитный – проигрывает. Распределение выгод и потерь от международной торговли в случае модели Хекшера-Олина аналогично результату модели со специфическими факторами, предполагающей, что каждая отрасль имеет один специфичный фактор производства, который не может быть перемещен и использован в другой отрасли. В результате международной торговли изменения относительных цен приводят к изменению распределения дохода между секторами, при этом владельцы одного из факторов производства выигрывают, а владельцы другого несут потери, что соответствует, например, [Krugman, 2009, с. 88]. Размер выигрыша от торговли, как правило, превышает размеры потерь, что приводит к совокупному выигрышу для экономики.

Второй тип эффектов – эффекты повышения эффективности национальной экономики вследствие перераспределения ресурсов при допущении о возрастающей отдаче от масштаба в производственном секторе. Подход моделей монополистической конкуренции Новой теории торговли [Krugman, 1979; Lancaster, 1980], предполагающий возрастающую отдачу в производственном секторе, существенно превзошел существующие традиционные аргументы теорий, основанных на сравнительном преимуществе1. Действительно, модели Новой теории торговли предсказывают больший размер выгод от торговли, чем модели, основанные на сравнительном преимуществе. В исследовании [Krugman, 1979] отмечается, что это связано с тем, что выгоды в моделях Новой теории торговли возникают при торговле между странами, даже если они имеют идентичные предпочтения, технологии и запасы факторов производства2 . Модель, включающая в базовой версии 1 фактор производства (труд), несовершенную конкуренцию на рынках, n дифференцированных товаров и потребительские предпочтения к разнообразию потребляемых товаров, рассматривает в качестве выгод от международной торговли увеличение размера рынка [Krugman, Obstfeld, Melitz, 2008]. При переходе к международной торговле, вновь, как и в моделях Смита и Рикардо, происходит товарная специализация производства, при этом на более емком рынке будет наблюдаться снижение средних цен и увеличение доступного набора разновидностей товаров. Как следствие, рост благосостояния национальной экономики происходит вместе с ростом доступных для потребления разновидностей товара и повышением эффективности, вызванной снижением удельных издержек при возрастающей отдаче от масштаба3.

Третий тип эффектов – эффекты повышения эффективности национальной экономики вследствие перераспределения ресурсов внутри отраслей от наименее производительных фирм к более производительным.

Такие эффекты предствлены в Новейших моделях теории торговли. Как отмечается, Новейшие модели торговли с гетерогенными фирмами стали существенным прорывом в объяснении выгод от международной торговли, что оказалось связано с перемещением акцента анализа с уровня отрасли на уровень фирмы. Так, Мелитц [Melitz, 2003] рассматривает новый вид выгод от международной торговли и показывает, что международная торговля позволяет только наиболее производительным фирмам выходить на экспортный рынок (в то время, как менее производительные фирмы продолжают производить только для внутреннего рынка), при этом наименее производительные фирмы выходят с рынка4. Таким образом, вследствие перераспределения ресурсов внутри отраслей от наименее производительных фирм к более производительным, а также роста продаж наиболее производительных фирм, увеличивается валовая производительность в экономике.

## Гипотезы и эмпирические результаты оценки влияния интенсивного и экстенсивного роста экспорта на экономический рост в исследованиях микро-и макроэкономического уровня

В теориях эндогенного роста также можно найти подтверждение положительной взаимосвязи экспортной диверсификации и экономического роста. В моделях утверждается важность экономической природы сектора, в котором специализируется страна, поскольку тип отдачи от масштаба зависит от самого сектора. Так, в моделях, где предполагается возрастающая отдача от масштаба в обрабатывающем секторе и постоянная отдача от масштаба в сельскохозяйственном секторе, естественным выводом является идея о том, что если страна имеет сравнительное преимущество в отрасли обрабатывающей промышленности (сельском хозяйстве), то производительность обрабатывающей промышленности будет расти быстрее (медленнее), чем в других странах и ускоряться (замедляться) со временем [Matsuyama, 1992].

Одним из наиболее распространенных взглядов на взаимосвязь структуры экспорта и экономического роста является идея о негативном влиянии экспортной специализации на сырьевых товарах вследствие избыточной обеспеченности страны природными ресурсами на экономическое развитие. [Corden, Neary, 1982] отмечают, что в первых работах данный эффект получил название проблемы «ресурсозависимости» или в случае одного сектора, негативно влияющего на промышленное производство, - «голландская болезнь». Более подробно, «голландской болезнью» принято называть совместное существование в рамках торгуемых товаров секторов с разной динамикой – прогрессирующих и сжимающихся, расширяющихся и сужающихся. Голландская болезнь проявлялась, среди прочего, в связи с расширением отрасли минерального сырья в Австралии, природного газа в Нидерландах, нефти в Великобритании, Норвегии и ряде стран-членов ОПЕК, что ставило под угрозу развитие обрабатывающих производств18 . Ресурсозависимостью в подходе [Sachs, Warner, 2001]принято называть наблюдение того, что страны, богатые природными ресурсами, как правило, развиваются значительно хуже. Ряд исследований продемонстрировали наличие ресурсозависимости для ряда ресурсоизбыточных стран в период после второй мировой войны19.

Выделяют различные прямые и непрямые факторы, определяющие взаимосвязь ресурсной зависимости и низкого уровня развития. Первое, природные ресурсы посредством государственного вмешательства в ресурсный сектор представляют широкие возможности по получению высокой ренты. Отсутствие ограничений на получение ренты ведет к неэффективным государственным расходам и высоким доходам элит. Возникающий в результате эффект прожорливости (voracity effect) снижает доход на душу населения. Второе, природные ресурсы негативно влияют на качество институтов и, таким образом, предопределяют более низкий уровень дохода на душу населения. Третье, повышение реального обменного курса и сокращение нересурсных секторов создает стимулы для усиления мер ограничения торговли (замещение импорта, субсидирование нефтеперерабатывающих компаний), неэффективное распределение ресурсов между отраслями, в том числе возникновение капиталоинтенсивных отраслей несмотря на дефицит капитала, и результирующий низкий уровень доходов на душу населения [Arezki et. al., 2011].

Как было показано в более поздних эмпирических работах, направленных на проверку полученных результатов о существовании эффекта ресурсной зависимости, в общем случае совершенствование методики оценивания приводит к тому, что проблема ресурсоинтенсивности слабо подтверждается или отвергается. Анализ возможных проблем оценивания в ранних работах представлен, например, в работе [Davis, 2013]. Как отмечается, большинство последних эмпирических исследований не находят строгого подтверждения более низких темпов роста в странах, богатых природными ресурсами [Alexeev, Conrad, 2009; Ploeg van der, Poelhekke, 2010; Smith, 2015]. Кроме того, в ряде других работ выявлено, что экономический рост в богатых ресурсами странах может быть ниже в краткосрочном, а не долгосрочном периоде вследствие запаздывания ресурсного сектора [Davis, 2011; James, James, 2011].

Выгоды от диверсификации экспорта для экономического развития рассматриваются также с точки зрения портфельной теории. Так, утверждается, что диверсификация экспорта (и уход от ресурсозависимости) способствует стабилизации доходов от экспорта в долгосрочном периоде [Hesse, 2008]. Данный вывод подтверждается, среди прочего, в недавнем исследовании по странам БРИК с применением портфельных моделей Марковица [Gouvea, Mahto, Montoya, 2013]. Результаты показывают, что Китай имеет наиболее эффективный и доминирующий экспортный портфель по сравнению с остальными странами БРИК в терминах анализа среднего и дисперсии экспортных доходов. При этом Китай имеет наибольшую долю интенсивных по знаниям отраслей и обрабатывающих отраслей. Бразилия и Россия имеют более рискованные и менее эффективные экспортные портфели, что отражает растущую зависимость стран от экспорта сырьевых и ресурсных товаров20.

Исследование уровня неопределенности позволяет существенно расширить анализ. Показано, что несклонные к риску страны должны диверсифицировать структуру экспорта, учитывая ковариацию мировых цен на различные товары.

В ряде работ признается справедливость выводов о специализации стран согласно сравнительному преимуществу, однако показано, что в условиях неопределенности диверсификация может оказаться более выгодной стратегией для несклонных к риску экономических агентов. Так, [Giovanni, Levchenko, 2010] теоретически и эмпирически подтверждается, что страны, имеющие сравнительное преимущество в отраслях с низким уровнем риска или с ярко выраженным сравнительным преимуществом в отраслях с высоким риском, будут стремиться к специализации, а страны с менее ярко выраженным сравнительным преимуществом в рисковых отраслях будут диверсифицировать экспортную корзину для того, чтобы застраховаться от волатильности дохода

## Методика декомпозиции темпов роста экспорта, учитывающая товарное и географическое разнообразие экспорта

Эмпирические исследования эффектов влияния роста экспорта на экономический рост регионов в национальных экономиках Можно выделить сравнительно большое количество работ, исследующих зависимость расширения международной торговли и динамики регионального неравенства. Ряд работ использует данные одной страны, при этом особое внимание уделяется Мексике и странам БРИКС – Бразилии, Индии и Китаю. Подробный обзор результатов представлен в Приложении А. Исследования на основе данных Мексики [Chiquiar, 2005; Chiquiar, 2008; Faber, 2007; Gonzalez Rivas, 2007; Hanson, 1997; Hanson, 1998; Rodrguez-Pose, Snchez-Reaza, 2005] позволяют сделать вывод о наличии положительной взаимосвязи между ростом регионального неравенства (пространственной дивергенцией) и расширением торговой открытости. Так, в частности, отмечается гетерогенный эффект вступления в НАФТА для разных регионов, при этом этот эффект соответствует результатам неоклассических моделей торговли, в том числе теоремы Столпера-Самуэльсона [Chiquiar, 2008]. Регионы с большей ориентацией на зарубежные рынки (большей экспортной квотой) испытали относительный рост уровня зарплат и падение премии за квалификацию по сравнению с регионами, в большей степени ориентированными на внутренний рынок36. [Rodrguez-Pose, Snchez-Reaza, 2005] находят, что торговая либерализация и экономическая интеграция не только не способствовали снижению регионального неравенства, но и усилили поляризацию. При этом наибольший положительный эффект создался для приграничных с Северной Америкой регионов, что также может быть подтверждением некоторых выводом моделей Новой экономической географии. Похожие эмпирические результаты выявлены и для Китая [Fajgelbaum, Coar, 2013; Kanbur, Zhang, 2005; Zhang, Zhang, 2003]. В работах показано, что рост международной торговли способствовал экономическому росту приграничных регионов (регионов побережья), при этом, частично, за счет потерь менее доступных для внешних рынков и бедных внутренних регионов Китая.

Интересно, что расходящиеся с описанными выше результатами получены для Бразилии [Castilho, Menndez, Sztulman, 2012; Daumal, 2013; Martincus, 2010]. В большинстве работ утверждается снижение регионального неравенства. Так, показано, что расширение экспортной деятельности в бразильских регионах способствовало снижению бедности и неравенства37. Как отмечается [Федюнина, 2016, с.102], возможным объяснением данного феномена может служить особенность структуры торговли Бразилии. В одной из работ анализируется влияние расширение экспорта на региональное неравенство в Бразилии и Индии и утверждается, что Бразилия экспортирует сравнительно больше сельскохозяйственных продуктов (чем отраслей обрабатывающей промышленности) по сравнению с Индией. При этом сельскохозяйственные регионы, как правило, имеет менее высокий уровень благосостояния. Как следствие, расширение экспорта способствовало росту сельскохозяйственных регионов Бразилии и, соответственно, региональной конвергенции, противоположное – рост экспорта товаров обрабатывающих отраслей и дивергенция, выявлено в Индии [Daumal, 2013].

В рамках эмпирических исследований можно выделить только несколько работ, исследующих взаимосвязь динамики регионального роста и расширения международной торговли на межстрановом уровне. В работе [Brlhart, 2011] рассмотрено 11 таких исследований, большинство из которых использует в качестве зависимой переменной, объясняющей распределение экономической активности, переменную относительного размера городов в стране («urban primacy»). Последнее связано скорее с вопросами урбанизации и не является предметом исследования в настоящей работе, поэтому мы представляем в таблице 1.2.2 основные результаты только тех исследований, которые используют переменные на основе оценок динамики валового продукта регионов. В целом, на основе анализа исследований, представленных в таблице 1.2.2, можно сделать вывод о том, что расширение экспорта (рост торговой открытости) оказывает различное влияние на регионы, часть регионов ускоряет темпы экономического роста, другая часть – замедляет, что, в конечном счете, приводит к росту регионального неравенства. Так, [Ezcurra, Rodrguez-Pose, 2013; Ezcurra, Rodrguez-Pose, 2014; Rodrguez-Pose, 2012] рассматривают зависимость регионального неравенства от динамики внешнеторговой открытости для групп стран и выявляют факторы такой взаимосвязи. Наибольший рост регионального неравенства при росте открытости наблюдается в странах с высокими внутренними транзакционными издержками, а также в странах с низким уровнем доходов. Однако ограниченное число работ, в которых исследование динамики пространственного развития не являлось центральной проблемой исследования, а переменная торговой открытости была включена в регрессию регионального неравенства в качестве контрольной, показывают расходящиеся результаты. Так, выявлено, что торговая открытость не оказывает влияния на динамику регионального неравенства, являясь статистически незначимой [Milanovic, 2005; Rodrguez-Pose, Ezcurra, 2010], или зависит от выборки стран, включенной в анализ [Petrakos, Rodrguez-Pose, Rovolis, 2003].

## Эмпирический анализ эффектов влияния интенсивного и экстенсивного роста экспорта на экономический рост в российских регионах в 2002-2010 годах

Мартинс и Янг [Martins, Yang, 2009] проводят мета-анализ 30 работ, представляющих результаты около 300 оценок взаимосвязи экспортной деятельности и производительности фирм. Результаты показывают, что влияние экспорта на производительность выше в развивающихся, чем в развитых странах. Кроме того, авторы находят, что эффекты обучения от экспорта: (1) выше в первый год начала экспортной деятельности, чем в последующие годы; (2) ниже в случае, когда используются ограниченные выборки, включающие только фирмы с похожими характеристиками53.

Результаты мета-анализа подчеркивают важность доступа к международным рынкам в качестве важной детерминанты деятельности фирмы в развивающихся странах, что, вероятно, объясняется более существенным расстоянием до технологической границы, что, в свою очередь, является одной из определяющих характеристик фирм развивающихся стран.

В целом, как отмечается в ряде работ, эффекты самоотбора о наличии наиболее производительных фирм, приобретающих статус экспортеров, является более простой гипотезой для теоретического и эмпирического подтверждения. При этом попытки подтвердить эффекты обучения от экспорта основаны на использовании, как правило, косвенных данных, в том числе, связывающих рост общей факторной производительности с экспортом. Наилучшим способом измерения эффектов обучения от экспорта могло бы стать использование информации о специфических механизмах, посредством которых фирмы приобретают новые знания для инноваций или становятся более эффективными, однако сложность измерения таких данных препятствует такой процедуре. Кроме того, к настоящему моменту не существует теоретической модели, объясняющей эффекты обучения от экспорта, что свидетельствует о неполноте информации об этих эффектах и стимулирует будущие эмпирические исследования, которые бы фокусировались на анализе отдельных каналов обучения вместо анализа абстрактных эффектов обучения от экспорта [Silva, Afonso, Africano, 2012].

Рассматривая гипотезу самоотбора, ряд исследований отмечает также различия фирм не только в уровне производительности, но и в уровне заработных плат и зарплатных премий экспортеров и неэкспортеров. Так, [Bernard, Jensen, Lawrence, 1995] исследуют обрабатывающую промышленность США 1976-1987 годов и находят существенные различия между экспортерами и неэкспортерами. Как отмечают авторы, экспортеры существенно больше, чем неэкспортеры, и систематически отличаются по ресурсным характеристикам. Экспортеры имеют более высокую капиталоинтенсивность и объем инвестиций на одного занятого54. В работе [Schank, Schnabel, Wagner, 2007] представлен анализ 21 исследования, опубликованных в 1995-2005 годы по данным 22 странах от высокоразвитых (США, Германия, Швеция) до переходных экономик (Эстония, Словения) и наименее развитых стран Африки южнее Сахары (Бурунди, Эфиопия). Методы эмпирических оценок в этих работах, в целом, повторяют подход [Bernard, Jensen, Lawrence, 1995], а результаты подтверждают наличие более высокой зарплатной премии экспортеров.

Современный обзор исследований зарплатной премии представлен в работе [Wagner, 2012]. Как отмечается автором, в настоящее время открытым является вопрос о том, действительно ли более высокая зарплатная премия экспортеров отражает тот факт, что экспортеры платят более высокие заработные платы так, что рабочие на эквивалентных позициях получают более высокую зарплату на фирмах-экспортерах при прочих равных. Учитывая, что все рассматриваемые эмпирические исследования используют средние данные на уровне завода или фирмы, индивидуальные характеристики рабочих, которые могут оказывать влияние на производительность (и, соответственно, заработную плату) не могут быть учтены, кроме того, определенные характеристики рабочего места, которые могут предопределять различия в заработной плате, не полно представлены в исследованиях55.

Следовательно, представляется более объективной эмпирическая оценка различий в зарплатных премиях с учетом контроля за наблюдаемыми и ненаблюдаемыми характеристиками работников и их рабочих мест, анализ таких исследований периода 2006-2010 годов и представлен в работе [Wagner, 2012]. Автор отмечает, что в сравнении с эмпирическими исследованиями на уровне фирмы, контроль за наблюдаемыми и ненаблюдаемыми характеристиками индивидуальных рабочих позволяет получать результаты о том, что зарплатная премия экспортеров существенно ниже, чем было оценено первоначально. Кроме того, в части исследований зарплатная премия экспортеров не выявлена вовсе. В поддержку данного вывода выступают [Schank, Schnabel, Wagner, 2010]. Авторы отмечают, что более высокие зарплаты фирм-экспортеров могут наблюдаться в результате эффекта самоотбора более производительных фирм, способных платить более высокую заработную плату, и, следовательно, не связаны с самим фактом экспортной деятельности.

Эмпирические исследования влияния интенсивного и экстенсивного роста экспорта на экономический рост могут быть классифицированы в соответствии с используемыми гипотезыми по двум признакам. Первое, в соответствии с уровнем проведенного анализа, подходом и типом данных работы могут быть классифицированны на микро- и макроэкономические. Второе, в соответствии с исследуемым типом роста экспорта рассмотренные гипотезы могут быть отнесены к интенсивному или экстенсивному росту. Результаты классификации представлены в таблице 2.2.4.