

На правах рукописи

**Кнобель Александр Юрьевич**

**Теоретические аспекты формирования тарифных  
ограничений в международной торговле**

Специальность 08.00.01 — «Экономическая теория»

**АВТОРЕФЕРАТ**  
диссертации на соискание ученой степени  
кандидата экономических наук

Москва — 2010

Работа выполнена в Институте экономической политики им. Е.Т. Гайдара

Научный руководитель

доктор экономических наук, профессор  
Синельников-Мурылев Сергей Германович

Официальные оппоненты

доктор экономических наук, профессор

Спартак Андрей Николаевич

кандидат экономических наук

Волчкова Наталья Александровна

Ведущая организация

Институт народнохозяйственного  
прогнозирования Российской академии наук

Защита состоится «08» декабря 2010 года в 15.00 на заседании объединенного диссертационного совета ДМ 520.011.01 Института экономики переходного периода и Академии народного хозяйства при Правительстве Российской Федерации по адресу 125993, Москва, Газетный переулок, д. 5, конференц-зал.

С диссертацией можно ознакомиться в библиотеке Института экономической политики им. Е.Т. Гайдара, а также в сети Интернет на сайте <http://www.iep.ru>

Автореферат разослан «02» ноября 2010 года

Ученый секретарь диссертационного совета

кандидат экономических наук

Мальгинов Г.Н

## **ОБЩАЯ ХАРАКТЕРИСТИКА РАБОТЫ**

**Актуальность темы исследования.** Современные процессы глобальной интеграции способствуют росту вовлечённости России в международную торговлю: в последнее десятилетие доля российского импорта в мировом товарообороте непрерывно росла с уровня 0.67% в 2000 г. до 1.78% в 2008 г. Процессы интеграции в мировое экономическое сообщество, как общемировые (глобализация рынков товаров и услуг), так и специфические для России (присоединение к ВТО, создание Таможенного союза и связанная с этим проблематика введения единого Таможенного тарифа) делают регулирование внешнеэкономической деятельности вообще, и импорта в частности, всё более значимым.

Тарифы на импорт, являясь важнейшим инструментом торговой политики, оказывают существенное влияние на совокупное общественное благосостояние, на конкурентоспособность продукции защищаемых отраслей, на поведение потребителей импортируемых товаров. Одновременно та или иная структура импортных пошлин является результатом общественного выбора, зависящего от распределения сил и политического влияния между взаимодействующими заинтересованными сторонами. В России эта структура динамично меняется. Так, в 2009 году были изменены ставки ввозных пошлин на порядка 1000 подсубпозиций: на 570 ставки были повышенны, на 430 — понижены. Поэтому, понимание закономерностей общественного выбора в области установления импортных пошлин необходимо для оценки осуществимости и прогнозирования последствий тех или иных планируемых мер таможенно-тарифной политики. Для развивающихся и переходных экономик этот вопрос недостаточно хорошо изучен.

В этой связи тема настоящего диссертационного исследования, посвящённого анализу детерминантов уровня тарифной защиты в международном контексте и в рамках межотраслевого сопоставления отечественной промышленности, представляется актуальной как с точки зрения развития теории, так и с точки зрения практического использования инструментов торговой политики.

**Объект и предмет исследования.** Объектом исследования в настоящей работе является уровень тарифной защиты, используемый в различных странах мира и уровень тарифной защиты различных отраслей отечественной промышленности в 1997–2008 гг. Предмет исследования — закономерности формирования тарифов на импорт на международном и отраслевом российском уровнях.

**Цель и задачи исследования.** Целью диссертации является разработка и эмпирическая оценка моделей формирования уровня тарифной защиты, объясняющих межстрановые и межотраслевые различия в тарифах на импорт.

В диссертации осуществлены построение и оценка эконометрических моделей межстрановых различий в уровне используемых странами средневзвешенных тарифов на импорт и межотраслевых различий в уровне средневзвешенного тарифа, применяемого для защиты отраслей российской промышленности. Для достижения поставленной цели автором были поставлены и решены задачи:

Во-первых, систематизированы современные теоретические и эмпирические подходы в области моделирования уровня тарифной защиты.

Во-вторых, построены теоретические модели, разработана методология оценки и проведена оценка моделей для факторов, влияющих на уровень тарифной защиты: вертикальной интеграции, как одной из характеристик структуры собственности, влияющих на уровень тарифов на страновом уровне; эластичностей спроса на импорт по ценам импорта и ценам отечественных товаров-субститутов, как факторов, влияющих на уровень тарифов на отраслевом уровне.

В-третьих, разработана методология эмпирической оценки и проведена оценка межстрановых различий в уровне тарифной защиты, определено место России в этом сопоставлении.

В-четвёртых, разработана методология эмпирической оценки и проведена оценка различий в уровне тарифной защиты, применяемой для отдельных отраслей отечественной промышленности.

**Степень научной разработанности проблемы.** Методология диссертации основана на систематизации теоретических подходов к построению моделей, описывающих формирование уровня тарифной защиты на страновом и отраслевом уровнях, современных методов экономического моделирования и проведения эконометрических оценок на данных панельной структуры.

Теоретическое моделирование торговой политики вообще и уровня тарифной защиты описаны, в частности, в исследованиях Р. Болдуина, Д. Болла, Б. Блонингена, Д. Блэка, К. Боуна, В. Брука, Н. Воусдена, Г. Гроссмана, И. Дестлера, М. Константопулса, Р. Кэйвза, С. Мегги, М. Ольсона, Ж. Пинкуса, Е. Хелпмана и других, а эмпирическое исследование различий в уровне протекционизма в исследованиях Ю. Бандиопадхая, К. Гаванде, П. Голдберга, П. Датта, Р. Лан-

верgne, Ф. МакМаламана, Г. Мегги, Д. Митры, Д. Томакоса, Д. Трефлера, М. Улубасоглу, Н. Фиелеке, и других. Из российских учёных вопросы торговой политики исследовали С. Афонцев, Н. Волчкова, С. Глазьев, А. Данильцев, И. Дюмулен, Т. Исаченко, В. Свинухов, А. Спартак и др.

Проведённый автором обзор литературы показал, что наиболее распространённым походом к моделированию торговой политики является построение экономико-политических моделей, в которых государство при принятии решения об установлении того или иного уровня защитных мер руководствуются влиянием этих мер на производителей, и влиянием торговых барьеров на потребителей конечной продукции и на совокупное общественное благосостояние. При этом, как показано автором, существует относительно мало работ, в которых исследуется торговая политика переходных экономик.

**Метод исследования.** Методологической базой исследования является сочетание теоретического и количественного анализа для выявления и описания причин и взаимосвязей, обуславливающих формирование тарифной политики.

При построении теоретических и эмпирических моделей в настоящей работе используется методология экономико-математического моделирования, в рамках количественного анализа применяются эконометрические модели и методы статистической проверки гипотез.

Эконометрическое оценивание в работе производилось на панельных данных. Отдельное внимание автором удалено исследованию однородности описания эконометрической моделью используемых панельных данных во временном и пространственном срезах, а также исследованию проблемы эндогенности в оцениваемых моделях.

**Научная новизна.** В диссертации впервые были получены следующие принципиально новые результаты:

1. На основе систематизации теоретических и эмпирических работ, посвящённых исследованию закономерностей формирования уровня тарифной защиты, разработана методология оценки межстрановых и межотраслевых различий в уровне используемых тарифов на импорт.

2. Разработана методология оценки и проведена оценка: модели российского импорта, что позволило получить количественные оценки эластичностей спроса на импорт для набора дезагрегированных отраслей российской промышленно-

сти, которые использовались для эмпирического анализа межотраслевых различий в применяемых тарифах на импорт в Россию; модели вертикальной интеграции на межстрановом уровне, что позволило подобрать для переменной вертикальной интеграции инструментальные переменные, которые использовались для эмпирического анализа межстрановых различий в уровне тарифной защиты.

3. Предложена и обоснована методика оценки влияния различных факторов на формирование уровня тарифной защиты, как на отраслевом российском уровне, так и на страновом уровне.

- Эмпирический анализ межотраслевых различий в уровне тарифной защиты, применяемой к отраслям российской промышленности показал, что механизм общественного выбора приводит к формированию структуры тарифов, характеризующейся следующими свойствами. Во-первых, меньшую защиту получают отрасли, относящиеся к тем секторам промышленности, концентрация собственности в которых высокая. Во-вторых, большую защиту получают отрасли, для которых спрос на конкурирующую импортируемую продукцию менее эластичен. В-третьих, те импортные товары, которые отличаются низкой долей в потреблении, облагаются более высоким тарифом. В-четвёртых, для тех отраслей, для которых доля конкурирующего импорта в общем объёме импорта сектора промышленности высока, тариф более высокий. В-пятых, резкое ослабление курса рубля сопровождается снижением таможенных пошлин для всего импорта в целом.
- Эмпирический анализ межстрановых различий в уровне тарифной защиты показал, что тарифы, применяемые странами в международной торговле, помимо общего уровня экономического развития, определяются также некоторыми характеристиками структуры собственности: чем больше экономика вертикально интегрирована и чем больше в экономике неравенства в распределении доходов, тем больше будет применяемый тариф на импорт.

**Теоретическая и практическая значимость диссертации.** Проведённое автором исследование позволило получить важные теоретические и практические результаты. Изложенные аспекты научной новизны могут рассматриваться как вклад в теорию международной торговли.

В частности, разработанная в диссертации методика оценки межстрановых различий в уровне тарифной защиты позволяет учитывать наряду с тради-

ционными детерминантами торговых ограничений показатели, характеризующие структуру собственности: по мере снижения неравенства в распределении доходов и снижения степени вертикальной интегрированности, будет иметь место снижение тарифных ограничений на импортируемую продукцию. Таким образом, результаты настоящего исследования могут быть использованы для дальнейших теоретических и прикладных исследований по торговой политике.

Практическая значимость результатов работы заключается в том, что они могут быть использованы в качестве инструмента анализа мер валютной, промышленной и таможенно-тарифной политики. Разработанная в диссертации методика анализа может применяться научно-исследовательскими организациями и аналитическими центрами для оценки влияния изменения цен на динамику импорта, для оценки влияния страновых характеристик структуры собственности на уровень протекционизма, для оценки влияния характеристик отраслей российской промышленности на уровень тарифной защиты, применяемой к ним.

Материалы диссертации могут быть также использованы при преподавании теории международной торговли, теории организации производства и других курсов и спецкурсов в высших экономических учебных заведениях России.

**Апробация результатов исследования и публикации по теме исследования.** Основные положения диссертации изложены в четырёх публикациях, из которых две работы опубликованы в журналах, включённых в Перечень ВАК ведущих рецензируемых научных журналов и изданий, где должны быть опубликованы основные научные результаты диссертации на соискание учёной степени кандидата экономических наук.

Результаты исследования на различных этапах представлялись на семинарах и конференциях ИЭП, АНХ, а также на X Международной научной конференции по проблемам развития экономики и общества ГУ-ВШЭ. Автором на основе данной работы были подготовлены аналитические записки для Минэкономразвития России по вопросам международной торговли.

**Структура диссертационного исследования.** Диссертация состоит из введения, трёх разделов и заключения, приложения, включая 21 рисунок и 19 таблиц, перечня использованных источников из 105 наименований. Объём работы составляет 150 страниц, приложение дополнительно занимает 15 страниц. Ниже приводится оглавление диссертации.

## **ВВЕДЕНИЕ**

### **1.СУЩЕСТВУЮЩИЕ ТЕОРЕТИЧЕСКИЕ МОДЕЛИ И ЭМПИРИЧЕСКИЕ ПОДХОДЫ К ОЦЕНКЕ УРОВНЯ ТАРИФНОЙ ЗАЩИТЫ**

1.1. ТЕОРЕТИЧЕСКИЕ МОДЕЛИ ФОРМИРОВАНИЯ ТОРГОВОЙ ПОЛИТИКИ

1.2. ФАКТОРЫ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИЕ ТАРИФНУЮ ПОЛИТИКУ

1.3. ЭМПИРИЧЕСКИЕ ИССЛЕДОВАНИЯ ТОРГОВОЙ ПОЛИТИКИ

### **2. ТЕОРЕТИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ ФАКТОРОВ, ОПРЕДЕЛЯЮЩИХ ТАРИФНУЮ ПОЛИТИКУ В ЦЕЛЯХ ИХ ИСПОЛЬЗОВАНИЯ ДЛЯ ЭМПИРИЧЕСКОЙ ОЦЕНКИ УРОВНЯ ТАРИФНОЙ ЗАЩИТЫ**

2.1. МОДЕЛИРОВАНИЕ ИМПОРТА

2.2. ТЕОРЕТИЧЕСКАЯ МОДЕЛЬ ВЕРТИКАЛЬНОЙ ИНТЕГРАЦИИ

### **3. ЭМПИРИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ УРОВНЯ ТАРИФНОЙ ЗАЩИТЫ**

3.1. ОЦЕНКА ФУНКЦИИ РАВНОВЕСНОГО ОБЪЁМА ИМПОРТА В РФ И ПОЛУЧЕНИЕ ОЦЕНОК ЭЛАСТИЧНОСТЕЙ ДЛЯ МОДЕЛИРОВАНИЯ МЕЖОТРАСЛЕВЫХ РАЗЛИЧИЙ В УРОВНЕ ТАРИФНОЙ ЗАЩИТЫ

3.2. ПРОБЛЕМА ЭНДОГЕННОСТИ ПРИ ИСПОЛЬЗОВАНИИ ПЕРЕМЕННОЙ ВЕРТИКАЛЬНОЙ ИНТЕГРАЦИИ ПРИ МОДЕЛИРОВАНИИ МЕЖСТРАНОВЫХ РАЗЛИЧИЙ В УРОВНЕ ТАРИФНОЙ ЗАЩИТЫ И ПОДБОР ИНСТРУМЕНТОВ ДЛЯ ЭТОЙ ПЕРЕМЕННОЙ

3.3. ЭМПИРИЧЕСКИЙ АНАЛИЗ УРОВНЯ ТАРИФНОЙ ЗАЩИТЫ: МЕЖСТРАНОВЫЕ И МЕЖОТРАСЛЕВЫЕ ОЦЕНКИ

## **ЗАКЛЮЧЕНИЕ**

## **СПИСОК ЛИТЕРАТУРЫ**

## **ПРИЛОЖЕНИЕ**

## **ОСНОВНОЕ СОДЕРЖАНИЕ РАБОТЫ**

Во введении в работу обоснована актуальность темы исследования, обозначены цели и задачи исследования, определены объект и предмет исследования, описана новизна и обоснована практическая значимость результатов.

В первом разделе диссертации “Существующие теоретические модели и эмпирические подходы к оценке уровня тарифной защиты” автором проведён обзор теоретических и эмпирических исследований по анализу факторов, определяющих торговую политику в части установления уровня тарифов.

На основе проведённого исследования автором показано, что в теоретических и эмпирических работах, изучающих закономерности формирования уровня протекционизма, экономисты ставят перед собой два основных вопроса: 1) на

каком основании те или иные отрасли получают защиту от конкурирующего импорта и с чем связаны различия в уровне тарифной защиты между отраслями; 2) как объяснить то, что одни страны используют больший уровень тарифной и нетарифной защиты, чем другие.

Автором подробно проанализированы модели формирования торговой политики и обоснован вывод о том, что их можно разбить на несколько групп, в каждой из которых приводятся свои аргументы в пользу выбора факторов, определяющих тот или иной уровень ограничений в международной торговле.

*Модели групповых интересов* или *модели давления групп* указывают на стимулы, которые побуждают производителей оказывать влияние на политиков, чтобы последние осуществляли выгодные им действия<sup>1</sup>.

*Модели статус quo* предполагают, что правительство придерживается определённой консервативной политики в отношении существующих порядков, а также может рассматривать небольшие отрасли как нуждающиеся в защите<sup>2</sup>.

Согласно моделям *аккумуляции голосов избирателей*<sup>3</sup>, выборные органы стремятся защитить те отрасли, которые могут дать им больше голосов на выборах, то есть отрасли с наибольшим количеством рабочей силы.

*Модели сравнительных издержек* предполагает, что отрасли, в которых отношение экспорта к производству высокое, будут получать меньшую защиту, так как они не воспринимаются властями как нуждающиеся в ней<sup>4</sup>.

В моделях *внешнеторговых переговоров и ответных мер* акцент делается на переговорной силе страны и на её возможностях по пересмотру ранее достигнутых договорённостей с торговыми партнёрами<sup>5</sup>.

<sup>1</sup> См. Olson Mancur (1965): *The Logic of Collective Action*, Cambridge, MA: Harvard University Press; Pincus J.J. (1975): Pressure Groups and the Pattern of Tariffs // *Journal of Political Economy*, vol. 83, pp. 775–778; Peltzman Sam (1976): Towards More General Theory of Regulation // *Journal of Law and Economics*, vol. 19, pp. 211–248; Olson, Mancur (1983): The Political Economy of Comparative Growth Rates // in D. Mueller (ed.), *The Political Economy of Growth*, New Haven: Yale University Press.; См. также Дюмулен И.И. (2009): *Международная торговля. Тарифное и нетарифное регулирование*, 2-е издание, Москва: ВАБТ; Афонцев С.А. (2010): *Политические Рынки и Экономическая Политика*, Москва: КомКнига.

<sup>2</sup> См. Corden W. Max (1974): *Trade Policy and Welfare*, Oxford: Oxford University Press; Lavergne Real P. (1983): *The Political Economy of US Tariffs: An Empirical Analysis*, New York, NY: Academic Press.

<sup>3</sup> Данная гипотеза была введена в работе Caves Richard E. (1976): Economic Models of Political Choice: Canada's Tariff Structure // *Canadian Journal of Economics*, vol. 9, pp. 278–300; среди более поздних исследований можно выделить Mayer Wolfgang (2002): Systematic Political Grass-Root Support for Tariffs // *Review of International Economics*, vol. 10, pp. 657–670.

<sup>4</sup> См. Mayer Wolfgang (1984): Endogenous Tariff Formation // *American Economic Review*, vol. 74, pp. 970–985; Vousden Neil (1990): *The Economics of Trade Protection*, Cambridge, UK: Cambridge University Press.

<sup>5</sup> Гипотеза сформулирована в работе Helleiner G.K. (1997): The Political Economy of Canada's Tariff Structure: An Alternative Model // *Canadian Journal of Economics*, vol. 4, pp. 318–326. См. также Blonigen B.A. and Bown C.P. (2003): Antidumping and Retaliation Threats // *Journal of International Economics*, vol. 60, pp. 249–273.

Согласно логике моделей общественных изменений и общественных интересов, из соображений социальной справедливости государство стремится уменьшить неравенство в экономике, а также обеспечить такую структуру торговых ограничений, которая бы при заданном уровне таможенных сборов влекла за собой минимум потерь в терминах совокупного благосостояния общества<sup>6</sup>.

Из проведённого обзора и систематизации литературы по торговой политике автором особо отмечается, что два фактора формирования уровня тарифной защиты заслуживают отдельного рассмотрения.

- Во-первых, это эластичности спроса на импорт по собственной (иностранный) цене и по цене отечественных товаров-субститутов. Согласно теории, применение больших импортных тарифов на товары с меньшей (по модулю) эластичностью будет приводить к меньшим потерям в совокупном общественном благосостоянии.

Эластичности являются структурными параметрами функции импорта, поэтому их получение требует оценки импорта как функции от факторов, определяющих международные торговые потоки. Проведённый автором обзор исследований по международной торговле<sup>7</sup> показал, что импорт определяется, главным образом, реальными доходами потребителей, а также ценами импортируемой продукции и ценами отечественных товаров-субститутов.

- Во-вторых, это вертикальная интеграция. Согласно теории, большая вертикальная интегрированность экономики означает большую лоббистскую силу её производителей, то есть эта характеристика структуры собственности может

---

<sup>6</sup> См. Ball D.S. (1967): United States Effective Tariffs and Labor's Share // *Journal of Political Economy*, vol. 75, pp. 183–187; Constantopoulos M. (1974): Labor Protection in Western Europe // *European Economic Review*, vol.5, pp. 313–318; Fieleke N. (1976): The Tariff Structure for Manufacturing Industries in the United States: A Test of Some Traditional Explanations // *Columbia Journal of World Business*, vol. 11, pp. 98–104. Согласно теории ценообразования Рамсея, чем больше эластичность спроса на импорт продукта по цене, тем меньший тариф государство должно устанавливать на этот продукт, так как в этом случае потеря в терминах совокупного общественного благосостояния будет меньше, см. Ramsey F.P. (1927): A Contribution to the Theory of Taxation // *Economic Journal*, vol. 37, pp. 47–61.

<sup>7</sup> См., например, Houthakker H.S. and Magee S.P. (1969): Income and Price Elasticities in World Trade // *Review of Economics and Statistics*, vol.51, pp. 111–125; Anderson J.E. (1979): A Theoretical Foundation for the Gravity Equation // *American Economic Review*, vol.69, pp. 106–116; Bergstrand J.H. (1985): The Gravity Equation in International Trade: Some Microeconomic Foundations and Empirical Evidence // *Review of Economics and Statistics*, vol. 67, pp. 474–481; Goldstein M. and Khan M. (1985): Income and Price Effects in Foreign Trade // in R.W. Jones and Kenen P.B. (eds.), *Handbook of International Economics*, vol. 2, pp. 1041–1105; Marques J. (1990): Bilateral Trade Elasticities // *Review of Economics and Statistics*, vol. 72, pp. 70–77; Marques J. (1991): The Dynamics of Uncertainty or the Uncertainty of Dynamics: Stochastic J-Curves // *Review of Economics and Statistics*, vol. 73, pp. 125–133; Sanso M., Cuarian R., and Sanz F. (1993): Bilateral Trade Flows, the Gravity Equation, and Functional form // *Review of Economics and Statistics*, vol. 75, pp. 266–275; Marques J. (1994): The Econometrics of Elasticities or the Elasticity of Econometrics: An Empirical Analysis of the Behavior of U.S. Imports // *Review of Economics and Statistics*, vol. 76, pp. 471–481.

объяснять межстрановые различия в уровне тарифного протекционизма. В то же время, как отмечается в литературе<sup>8</sup>, высокая доля импорта в экономике должна снижать уровень вертикальной интеграции. В работе показано, что это связано с тем, что закупка импортных товаров означает сужение взаимодействия между отечественными производителями: если покупается промежуточная продукция, то это означает что часть отечественных фирм не использует собственное производство промежуточной продукции для выпуска конечной. Таким образом, вертикальная интеграция промышленности, помимо прочего, отрицательно связана с открытостью экономики. Поскольку открытость экономики находится в устойчивой отрицательной связи с торговыми ограничениями, в частности с тарифами, это, как показал автор, может вызвать проблему эндогенности, вызывающую смещение оценок коэффициентов в эмпирических моделях, при использовании переменной вертикальной интеграции для объяснения межстрановых различий в уровне тарифной защиты.

Следовательно, как обосновано в работе, для полноценного анализа необходимо дополнительное теоретическое моделирование и эмпирическая оценка вертикальной интеграции с целью подбора инструментов, то есть, факторов, от которых зависит вертикальная интеграция, но которые напрямую не связаны с уровнем тарифной защиты.

Обзор теоретических и эмпирических исследований по вертикальной интеграции<sup>9</sup> показал, что существует два основных подхода к исследованию её детерминантов. Первый основан на изучении транзакционных издержек, а второй — на теории прав собственности. Оба подхода подчеркивают важность институтов в установлении структуры собственности: при низком уровне институционального развития, фирмы в экономике будут стремиться быть более крупными и вертикально интегрированными, что будет давать им возможность компенсировать недостатки институциональной среды за счёт внутренней организации.

Проведённое в диссертации обобщение результатов эмпирического анализа, полученных различными авторами, показывает, что тестирование гипотез о

<sup>8</sup> См., например, Kildegaard A. and Williams P. (2002): Banks, systematic risk, and industrial concentration: theory and evidence // *Journal of Economic Behavior & Organization*, vol. 47, pp. 345–358.

<sup>9</sup> См., например, Grossman G. M. and Helpman E. (1991): *Innovation, Growth in Knowledge-Based Economies*; Grossman S. J. and Hart O. D. (1986): The Costs and Benefits of Ownership: A Theory of Vertical and Lateral Integration // *Journal of Political Economy*, vol. 94, pp. 691–719; Hart Oliver and John Moore (1990): Property Right and the Nature of the Firm // *Journal of Political Economy*, vol. 98, pp. 1119–1158; Perry M. (1998): Vertical Integration: Determinants and Effects // in R. Schmalensee and R. Willig (eds.), *Handbook of Industrial Organization*, Amsterdam: Elsevier Science, pp. 183–255.

влиянии факторов на уровень тарифной защиты может быть основано на двух альтернативных подходах: подход *ad hoc* предполагает использование набора переменных, отражающих базовую логику используемых гипотез относительно влияния тех или иных факторов, выбранных на основе различных моделей, на уровень тарифной защиты; формальный подход, предполагающий тестирование теоретической модели формирования тарифов, пригодной для эконометрической проверки<sup>10</sup>. Как показано автором, наиболее приемлемым является использование подхода *ad hoc*, так как формальные теоретические модели торговой политики либо непригодны для эмпирической проверки, либо предсказывают спорные направления влияния факторов на уровень тарифов<sup>11</sup>.

Второй раздел диссертации “**Теоретический анализ факторов, определяющих тарифную политику в целях их использования для эмпирической оценки уровня тарифной защиты**” посвящён теоретическому моделированию функции импорта и вертикальной интеграции.

Автором приведены теоретические обоснования, в рамках которых импорт продукции, конкурирующей с продукцией отдельно взятой отрасли отечественной промышленности, зависит от объёма российского ВВП, объёма ВВП страны-экспортёра, собственного объёма выпуска промышленности, собственного уровня цен страны-экспортёра, собственной цены импортируемой продукции, цены отечественных товаров субститутов. На этой основе во втором разделе автором обоснована следующая модель импорта в Россию. В представленной ниже модели  $i$  — индекс страны-импортёра,  $j$  — индекс отрасли (соответствующей ей товарной группы),  $j_k$  — индекс товара из отрасли  $j$ ,  $t$  — индекс времени:

---

<sup>10</sup> Среди эмпирических работ по торговой политике и формированию уровня тарифной защиты см. **Lavergne Real P.** (1983): *The Political Economy of US Tariffs: An Empirical Analysis*, New York, NY: Academic Press; **Trefler Daniel** (1993): Trade Liberalization and the Theory of Endogenous Protection: An Econometric Study of US Import Policy // *Journal of Political Economy*, vol. 101, pp. 138–160; **Gawande Kishore** (1998): Comparing Theories of Endogenous Protection: Bayesian Comparison of Tobit Models Using Gibbs Sampling Output // *Review of Economics and Statistics*, vol. 80, pp. 128–140; **Goldberg P. and Maggi G.** (1999): Protection for Sale: An Empirical Investigation // *American Economic Review*, vol. 89, pp. 1135–1155; **Gawande Kishore and Usree Bandyopadhyay** (2000): Is Protection for Sale? A Test of the Grossman-Helpman Theory of Endogenous Protection // *Review of Economics and Statistics*, vol. 89, pp. 139–152; **Mitra Devashish, Thomasos Dimitrios D., and Ulubasoglu Mehmet A.** (2001): Protection For Sale in a Developing Country: Democracy versus Dictatorship // *Review of Economics and Statistics*, vol. 84, pp. 497–508; **McCalman Phillip** (2004): Protection for Sale and Trade Liberalization: An Empirical Investigation // *Review of International Economics*, vol. 12, pp. 81–94; **Dutt Pushan and Devashish Mitra** (2005): Political Ideology and Endogenous Trade Policy: An Empirical Investigation // *Review of Economics and Statistics*, vol. 87, pp. 59–72.

<sup>11</sup> Так, базовая модель Гроссмана-Хелпмана формирования уровня тарифов предсказывает для отраслей, не способных лоббировать свои интересы, субсидирование импорта и экспортные пошлины, что в реальности не наблюдается, см. **Grossman Gene M. and Elhanan Helpman** (1994): Protection for Sale // *American Economic Review*, vol. 84, pp. 833–850.

$$\begin{aligned} \ln IM_{ij_k,t} - \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T \ln IM_{ij_k,t} = & \gamma_1 \left( \ln Y_t^i - \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T \ln Y_t^i \right) + \gamma_2 \left( \ln Y_t^{RUS} - \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T \ln Y_t^{RUS} \right) + \\ & + \gamma_3 \left( \ln Q_{j,t}^{RUS} - \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T \ln Q_{j,t}^{RUS} \right) + \gamma_4 \left( \ln P_t^i - \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T \ln P_t^i \right) + \\ & + \beta \left( \ln p_{ij_k,t} - \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T \ln p_{ij_k,t} \right) + \delta \left( \ln(e_t^S \times p_{j,t}^{RUS}) - \frac{1}{T} \sum_{t=1}^T \ln(e_t^S \times p_{j,t}^{RUS}) \right) + \tilde{\varepsilon}_{ij_k,t}, \end{aligned} \quad (1)$$

где  $IM_{ij_k,t}$  — импорт в физическом выражении товарной подгруппы  $j_k$  отрасли  $j$  в период  $t$  (год, принадлежащий рассматриваемому промежутку времени  $T$ ) из страны  $i$  в Россию;  $Y_t^i$  — ВВП по ППС в постоянных ценах страны  $i$  в период  $t$  в долларах США;  $Y_t^{RUS}$  — ВВП РФ по ППС в постоянных ценах в период  $t$  в долларах США;  $P_t^i$  — дефлятор ВВП страны  $i$  в период  $t$ , базовый индекс;  $Q_{j,t}^{RUS}$  — индекс промышленного производства отрасли  $j$  в период  $t$ ;  $p_{ij_k,t}$  — собственная цена товара  $j_k$  отрасли  $j$ , импортируемого из страны  $i$  в Россию период  $t$ ;  $e_t^S \times p_{j,t}^{RUS}$  — индекс цен отрасли  $j$  в период  $t$ , переведённый в долларовое выражение.

При этом три варианта установления ограничений на коэффициенты  $\beta$  и  $\delta$  задают три типа уравнения функции импорта: 1) коэффициенты постоянны для импорта всех товаров; 2) коэффициенты варьируются между отраслями промышленности, но постоянны во времени; 3) коэффициенты варьируются между отраслями промышленности и во времени. Как подробно обсуждается во втором разделе работы, коэффициенты второго и третьего типов можно трактовать как эластичности по собственной цене и по цене отечественных товаров-субститутов. В работе также обосновано, что удельную стоимость покупки при определённых предпосылках можно трактовать как цену продукции. Оценка уравнений таких типов позволяет получить соответствующие значения эластичностей, которые можно использовать для дальнейшего анализа.

Далее во втором разделе диссертации предлагается теоретическая модель вертикальной интеграции производства, которая является оригинальной модификацией модели Асемоглу, Агиньона, Гриффита и Зилиботти<sup>12</sup> (AAGZ) и отличается от неё следующим. Во-первых, в отличие от AAGZ, рассмотрена предпосылка о возможной возрастающей отдаче от масштаба: если фирмы объединяются в одну вертикально интегрированную структуру, появляется возможность сокращения эксплуатационных затрат и/или сокращения транспортных издержек за счёт совмещения двух технологически связанных процессов в рамках одной

<sup>12</sup> Acemoglu D., Aghion Ph., Griffith R., and Zilibotti F. (2004): Vertical Integration: Theory and Evidence // NBER Working Paper, no. 10997.

фирмы, а также сокращения административных издержек. В работе показано, что большая технологическая связанность производства означает большую вероятность вертикальной интеграции. Во-вторых, в отличие от AAGZ, в которой в качестве показателя развития институциональной среды рассматривается мера конкуренции среди фирм, производящих продукцию конечного пользования, в диссертации введены параметры, отвечающие за степень развитости рынков как промежуточной, так и конечной продукции и сделан вывод относительно снижения вероятности вертикальной интеграции при росте этих параметров, причём эффекты от влияния различных институтов усиливают друг друга. Кроме того, как и в модели AAGZ, автором обнаружено, что чем больше разрыв в уровне производительности труда сторон, потенциально участвующих в процессе вертикальной интеграции, тем больше вероятность её возникновения.

Далее автором показывается, что результаты теоретического моделирования позволяют строить эмпирические оценки для переменной вертикальной интеграции, на основании которых можно подбирать для неё инструменты с целью их использования при оценке межстрановых различий в уровне тарифов.

В третьем разделе работы “**Эмпирический анализ уровня тарифной защиты**” автор приводит результаты эконометрической оценки модели импорта с целью получения оценок эластичностей импорта, модели вертикальной интеграции с целью подбора инструментов для неё, модели межстрановых тарифных различий и модели межотраслевых российских различий в уровне тарифов.

Для оценки функции импорта (1) автором использовались статистические данные по международной торговле ООН Comtrade за 1997–2008 гг. в классификации ТН ВЭД с детализацией до 6-ти знаков, статистика по ВВП Всемирного Банка, статистика по индексам производства и индексам цен Росстата и ГУВШЭ. Выбор товарных групп, на которых проводилась оценка, обуславливался возможностью их сопоставления с продукцией отечественных отраслей промышленности по классификации ОКОНХ<sup>13</sup>. В табл. 1 представлены основные результаты оценки трёх типов функции импорта.

---

<sup>13</sup> Выбор классификации ОКОНХ, а не ОКВЭД обусловлен наличием для первой в открытом доступе данных по стоимостному объёму производства для дезагрегированного набора отраслей промышленности. В исследовании под товарной субпозицией подразумевается какая-либо 6-тизначная товарная подгруппа (таких подгрупп в конечной выборке 1359) из конкретной страны (92 страны). Например, товары подгруппы 848210 (шариковые подшипники), ввезённые из Франции и товары подгруппы 848210, ввезённые из США — это разные товарные субпозиции. Всего товарных субпозиций 29128, каждая из которых соответствует одной из 62 отраслей промышленности.

ТАБЛИЦА 1

## Эмпирические результаты оценки моделей физического объёма импорта

Зависимая переменная: логарифм импорта товаров в физическом выражении			
	Предположение относительно коэффициентов перед логарифмом удельной стоимости импортируемого товара и логарифмом цены отечественного аналога		
	Оценка в предполо- жении единых коэф- фициентов для всего массива данных	Оценка в предполо- жении того, что коэффициенты различны для каж- дой отрасли	Оценка в предполо- жении того, что коэффициенты раз- личны для каждой отрасли в каждый год
<b>Логарифм ВВП страны-торгового партнёра</b>	1.50*** (0.0549)	1.59*** (0.0547)	1.44*** (0.0558)
<b>Логарифм ВВП России</b>	0.227*** (0.0525)	0.328*** (0.0570)	0.159** (0.0676)
<b>Логарифм отраслевого индекса промышленного производства России</b>	-0.171*** (0.0298)	-0.330*** (0.0353)	-0.293*** (0.0453)
<b>Логарифм дефлятора ВВП страны-торгового партнёра</b>	-1.28*** (0.0253)	-1.28*** (0.0261)	-1.15*** (0.0298)
<b>Логарифм удельной стоимости импортируемого товара</b>	-0.915*** (0.00319)	Оценки представлены в диссертации	Оценки представлены в диссертации
<b>Логарифм цены отечественного аналога</b>	1.28*** (0.0179)		
<i>R</i> <sup>2</sup> <i>within</i>	0.33	0.34	0.36
<i>Количество товарных субпозиций</i>		29128	
<i>Суммарное количество наблюдений</i>		169866	

Источник: расчёты автора. В скобках указаны стандартные ошибки. \*\*\* (\*\*) — значимость на уровне 1% (5%).

Результаты оценки модели второго типа показывают, что гипотезы о равенстве нулю коэффициентов при логарифме цены импортируемой товарной субпозиции отвергаются во всех случаях (62 коэффициента из 62 отрицательны и статистически значимы), а гипотезы о равенстве нулю коэффициентов при логарифме цены отечественного аналога отвергаются для 61 коэффициента из 62 (исключением является шёлковая промышленность).

Результаты оценки модели третьего типа показывают, что гипотеза о равенстве нулю коэффициентов при логарифме собственной (иностранный) цены импорта не отвергается в 73 случаях из 744 (62 отрасли за 12 лет). В остальных случаях (671 из 744) коэффициенты отрицательны и статистически значимы. Гипотеза о равенстве нулю коэффициентов при логарифме отечественной цены не отвергается в 313 случаях из 744. В 431 случаях из 744 коэффициенты положительны и статистически значимы. Результаты говорят в пользу гипотезы о существовании отрицательной зависимости между ценой импорта и его объёмом при неизменных ценах отечественных товаров-субститутов, а также в пользу гипотезы о том, что рост долларовой цены отечественных аналогов, при неизменной цене иностранной продукции, смещает спрос в сторону импортных товаров.

Статистически значимые оценки трактуются автором как усреднённые эластичности и используются для оценок межотраслевых различий в тарифах.

Далее автором обсуждена проблема эндогенности, возникающая при использовании переменной вертикальной интеграции для моделирования уровня тарифов, проведена эмпирическая оценка детерминантов вертикальной интеграции, на основании которой подобраны инструменты для этой переменной.

Автором подробно обсуждена проблема построения индекса вертикальной интегрированности экономики и в качестве такового выбрано отношение добавленной стоимости к промежуточному потреблению по тем же соображениям, что и в случае отношения добавленной стоимости к суммарным продажам: если экономика полностью вертикально интегрирована, то продаются только конечные продукты, и размер продаж примерно равен добавленной стоимости. Если же предприятия различных технологических ступеней функционируют по отдельности, то фирмы продают друг другу промежуточную продукцию и суммарные продажи оказываются значительно больше добавленной стоимости. Использование индексов такого типа описано в литературе<sup>14</sup>.

На основании результатов теоретического моделирования второго раздела автором проведена эмпирическая оценка детерминантов вертикальной интеграции, которая показала, что реальные данные говорят в пользу гипотез, сформулированных в теоретическом разделе работы, что говорит в пользу возможности использования построенного индекса вертикальной интегрированности экономики при проведении межстранового анализа уровня тарифной защиты. Как показывает автор на основе эмпирического анализа, для переменной вертикальной интеграции можно использовать такие инструментальные переменные, как производительность труда в сельском хозяйстве; производительность труда в промышленности; доля внутреннего кредита в ВВП; численность населения; индекс, показывающий уровень развития институтов защиты прав собственности; индекс, показывающий уровень развития институтов защиты от коррупции.

Далее в третьем разделе диссертации автором проводится эмпирическая оценка межстранных различий в уровне тарифной защиты, которая заключается в проверке следующих теоретических гипотез: 1) Уровень экономического раз-

<sup>14</sup> См., например, **Tucker I.B. and Wilder R.P.** (1977): Trends in Vertical Integration in the U.S. Manufacturing Sector // *Journal of Industrial Economics*, vol. 26, pp. 81–94; **Perry M.** (1998): Vertical Integration: Determinants and Effects // in R. Schmalensee and R. Willig (eds.), *Handbook of Industrial Organization*, Amsterdam: Elsevier Science, pp. 183–255. Недостатком такого индекса является то, что на практике многие крупные компании продают промежуточную продукцию своим дочерним структурам и филиалам, однако делают они это зачастую по трансферным ценам, ниже рыночных, поэтому промежуточное потребление будет меньше, чем если бы такие сделки происходили в условиях раздельного функционирования.

вития страны определяет открытость для свободной торговли: при более высоком уровне развития должно наблюдаться меньшее значение уровня протекционизма, в том числе и потому, что более развитые страны объединяются в зоны свободной торговли и таможенные союзы активнее, чем развивающиеся (используется переменная подушевого ВВП по ППС). 2) Высокая степень вертикальной интегрированности экономики способствует большей организованности производителей, что приводит к установлению уровня их тарифной защиты на более высоком уровне. 3) Высокая степень неравенства в распределении доходов означает, что собственность сконцентрирована у небольшой группы собственников, что позволяет им лучше организовываться и оказывать давление на государство. В этой связи естественно ожидать положительную связь между уровнем применяемых тарифов и такими характеристиками неравенства, как коэффициент Джини и доля доходов у 10% или 20% самых богатых граждан государства.

В табл. 2 представлены результаты оценок моделей межстрановых различий в уровне тарифной защиты.

**ТАБЛИЦА 2**

**Результаты оценок моделей межстрановых различий  
в уровне тарифной защиты (78 стран за период 1997–2008 гг.)**

Зависимая переменная: средневзвешенный уровень тарифов (данные Всемирного Банка)					OLS, FE			
	OLS (pool regression)				OLS, FE			
Логарифм ВВП на душу населения	-2.20*** (0.158)	-0.904*** (0.247)	-0.828*** (0.244)	-0.535** (0.226)	-5.17*** (0.643)	-5.24*** (1.20)	-5.40*** (1.18)	-5.27*** (1.12)
Вертикальная интеграция	3.05*** (0.48)	2.49*** (0.774)	2.46*** (0.758)	2.36*** (0.682)	3.92*** (0.913)	6.09*** (1.64)	5.72*** (1.61)	6.03*** (1.54)
Коэффициент Джини		0.140*** (0.0202)				0.153*** (0.0485)		
Доля доходов у 10% самых богатых			0.190*** (0.0254)				0.219*** (0.0567)	
Доля доходов у 20% самых богатых				0.197*** (0.0218)				0.243*** (0.0576)
Скорректированный R <sup>2</sup>	0.37	0.46	0.48	0.53				
R <sup>2</sup> within					0.16	0.23	0.26	0.28
Количество наблюдений	551	218	218	215	551	218	218	215

Источник: расчёты автора. В скобках указаны стандартные ошибки. \*\*\* (\*\*) — значимость на уровне 1% (5%). OLS — метод наименьших квадратов; OLS, FE — метод наименьших квадратов с фиксированными эффектами.

Для получения более адекватных оценок необходимо учесть возможное смещение, возникающее вследствие эндогенности переменной вертикальной интеграции, которая заключается в том, что не только вертикальная интегрированность экономики оказывает влияние на формирование уровня тарифной защиты вследствие больших возможностей производителей оказывать давление на государство, но и высокий уровень тарифов снижает открытость экономики и способствует усилению вертикальной интеграции.

ТАБЛИЦА 3

**Результаты альтернативных оценок моделей межстранных различий в уровне тарифной защиты методом инструментальных переменных**

	Зависимая переменная: средневзвешенный уровень тарифов							
	Instrumental Variables (pool regression)				Instrumental Variables, FE			
Логарифм ВВП на душу населения	–1.63*** (0.199)	–0.532* (0.282)	–0.461* (0.271)	–0.388 (0.274)	–3.99*** (0.643)	–3.95*** (1.25)	–4.23*** (1.22)	–4.31*** (1.23)
Вертикальная интеграция	5.98*** (1.01)	5.11*** (1.36)	5.13*** (1.29)	4.90*** (1.33)	5.86*** (1.47)	11.7*** (2.28)	10.8*** (2.22)	11.0*** (2.22)
Коэффициент Джини		0.148*** (0.0233)				0.150*** (0.0511)		
Доля доходов у 10% самых богатых			0.206*** (0.0284)				0.204*** (0.0584)	
Доля доходов у 20% самых богатых				0.197*** (0.0278)				0.231*** (0.0635)
Список инструментов для вертикальной интеграции	производительность труда в сельском хозяйстве; производительность труда в промышленности; доля внутреннего кредита в ВВП; численность населения; индекс, показывающий уровень развития института защиты прав собственности; индекс, показывающий уровень развития института защиты от коррупции							
Скорректированный R <sup>2</sup>	0.27	0.52	0.54	0.54	0.14	0.16	0.19	0.22
R <sup>2</sup> within								
Количество наблюдений	431	198	198	197	431	198	198	197

Источник: расчёты автора. В скобках указаны стандартные ошибки. \*\*\* — значимость на уровне 1%, \*\* — значимость на уровне 5%, \* — значимость на уровне 10%. Instrumental Variables — метод инструментальных переменных; Instrumental Variables, FE — метод инструментальных переменных с фиксированными эффектами.

Из результатов альтернативных оценок, представленных в табл. 3 видно, что использование инструментальных переменных даёт качественно те же результаты, что и базовые оценки МНК. Несмотря на то, что нет возможности формально проверить гипотезу о различиях в значениях оценок коэффициентов из разных моделей, можно заключить, что количественно модель с использованием инструментальных переменных демонстрирует более сильное влияние (примерно в 2 раза больше, чем в базовой модели) вертикальной интегрированности экономики на уровень протекционизма, что, в свою очередь, показывает, что эндогенность (взаимное влияние переменных вертикальной интеграции и уровня тарифной защиты) действительно имеет место.

В целом на основании эмпирического анализа автором делается вывод, что тарифы, применяемые странами в международной торговле, определяются, помимо уровня экономического развития, ещё и некоторыми характеристиками структуры собственности: чем больше экономика вертикально интегрирована и чем больше в экономике неравенства в распределении доходов, тем больше будет применяемый тариф на импорт. Это согласуется с теоретической гипотезой давления групп, согласно которой, чем больше лоббистская сила собственников, тем больше будут применяемые меры тарифной защиты. Автором в работе, на основании построения *between* моделей, также показано, что результат справедлив и для межстраницового, и для межвременного сопоставления. При переходе от

одной страны к другой с большей вертикальной интегрированностью экономики, равно как и при переходе от одной страны к другой с большим неравенством в распределении доходов и большей концентрацией собственности, в среднем наблюдается большее средневзвешенное значение применяемого тарифа. При росте вертикальной интегрированности экономики, неравенства в распределении доходов и концентрации собственности в отдельно взятой стране во времени, в среднем в ней будет иметь место рост протекционизма, выраженного в средневзвешенном тарифе на импортируемые товары.

В заключительной части третьего раздела диссертации автор оценивает на российских данных эмпирическую модель межотраслевых различий в уровне тарифной защиты, которая основывается следующих теоретических гипотезах, отражающих базовую логику моделей давления групп, статус-кво, общественных интересов, аккумуляции голосов избирателей, максимизации доходов бюджета:

1) При высокой концентрации отрасль, вследствие своей организованности, может самостоятельно эффективно противодействовать импорту товаров-субститутов, в связи с чем государство может предоставлять защиту отрасли на невысоком уровне<sup>15</sup>.

2) В российских условиях небольшое количество рабочей силы может означать, что отрасль сама по себе небольшая и требует большей защиты, из-за чего государство может устанавливать больший уровень защиты для отраслей с меньшим количеством рабочей силы<sup>16</sup>.

3) Если государство следует на практике правилу Рамсея, то, при прочих равных условиях должно наблюдаться отрицательное влияние эластичности импорта на уровень средневзвешенного тарифа, поскольку более низкие значения этого показателя сопряжены с меньшими потерями благосостояния при любом заданном уровне внешнеторговых барьеров<sup>17</sup>.

4) Государство может с большей готовностью предоставляет защиту отраслям с низкой степенью проникновения импорта, так как в этом случае потери, наносимые благосостоянию потребителей таможенными пошлинами, ока-

<sup>15</sup> В регрессионном анализе используются данные по средней за доступный период доле трёх крупнейших фирм в агрегированном секторе промышленности, к которой принадлежит отрасль (то есть, как показатель, не меняющийся во времени).

<sup>16</sup> Данные по занятости ограничиваются периодом до 2005 года, поэтому в регрессионном анализе используется среднее за весь доступный период значение количества рабочей силы в отрасли (то есть, как показатель, не меняющийся во времени).

<sup>17</sup> В регрессионном анализе используются полученные автором оценки эластичностей спроса на импорт, постоянные во времени, так и оценки эластичностей спроса на импорт для каждого года.

жутся ниже. В качестве показателя степени проникновения импорта автор использует отношение импорта к отечественному производству, переведённому в долларовое выражение с помощью номинального обменного курса.

5) Чем больше доля импорта конкретной отрасли промышленности в импорте всего сектора промышленности, к которому эта отрасль принадлежит, тем лучше производители отрасли могут обосновать необходимость тарифной защиты. Поэтому, при прочих равных условиях, должна наблюдаться положительная зависимость между долей импорта в агрегированном секторе промышленности и уровнем отраслевого тарифа.

6) Чем выше номинальный обменный курс (количество долларов за один рубль), тем ниже цена импорта и тем больше отечественное производство нуждается в защите. В связи с этим естественно ожидать положительное влияние номинального обменного курса на уровень тарифа.

В табл. 4 представлены результаты оценок моделей межотраслевых различий уровня тарифной защиты.

**ТАБЛИЦА 4**

**Результаты оценок моделей межотраслевых различий уровня тарифной защиты (62 отрасли за 1997, 2001, 2002, 2005, 2007, 2008 гг.)**

Зависимая переменная: средневзвешенный уровень тарифов <sup>18</sup> , OLS				
Доля 3-х самых крупных предприятий	-0.245*** (0.0360)	-0.266*** (0.0380)	-0.313*** (0.0442)	-0.312*** (0.0442)
Логарифм количества рабочей силы	-0.342* (0.201)	-0.516** (0.223)	-0.752*** (0.257)	-0.778*** (0.258)
Эластичность спроса на импорт по собственной (иностранный) цене, оцененная в предположении постоянства во времени	-4.53*** (1.27)			
Эластичность спроса на импорт по собственной (иностранный) цене, оцененная для каждого года		-1.20* (0.716)		-2.22*** (0.881)
Эластичность спроса на импорт по цене отечественных аналогов, оцененная в предположении постоянства во времени	-1.72*** (0.551)			
Эластичность спроса на импорт по цене отечественных аналогов, оцененная для каждого года			-0.158* (0.0921)	-0.167* (0.0987)
Степень проникновения импорта	-0.0937** (0.0369)	-0.0929** (0.0371)	-0.0915*** (0.0383)	-0.109*** (0.0379)
Номинальный обменный курс	12.4** (5.39)	13.6** (5.58)	14.8*** (6.32)	15.8** (6.25)
Доля импорта отрасли промышленности в импорте агрегированного сектора промышленности	7.01*** (1.19)	7.40*** (1.20)	8.19*** (1.36)	8.20*** (1.34)
Скорректированный R <sup>2</sup>	0.20	0.17	0.24	0.25
Количество наблюдений	366	334	244	236

Источник: расчёты автора. В скобках — стандартные ошибки. \*\*\*, \*\*, \* — значимость на уровне 1%, 5%, 10%.

<sup>18</sup> Данные ООН, которые по тарифам России доступны за 1997, 2001, 2002, 2005, 2007, 2008 гг. Взвешивание производилось с весами, равными долям импорта товара в общем импорте соответствующей товарной группы. Для тех товарных позиций, для которых применяется специфическая или комбинированная пошлина, использовалось значение адвалорного эквивалента.

Далее автор показывает, что на основании результатов эконометрического анализа межотраслевых различий в уровне тарифной защиты, применяемой к отечественной промышленности, которые говорят в пользу сформулированных гипотез, можно разработать рекомендации по направлениям изменения структуры тарифов. Как аргументируется автором, если целью регулирующих органов является унификация импортных пошлин, то в первую очередь следует унифицировать тарифы внутри тех товарных групп, для которых имеет место высокая доля импорта в общем объеме смежного импорта и которые обладают низкоэластичным спросом и небольшой долей импорта в совокупном потреблении, и, возможно, пожертвовать унификацией импортных пошлин внутри товарных групп с высокоэластичным спросом и высокой долей в потреблении по сравнению с отечественными аналогами, не повышая при этом общего уровня тарифов.

На основании проведённого исследования в **заключении** автором формулируются следующие основные выводы:

1. Выполненный анализ теоретических и эмпирических работ и систематизация существующих исследований по тарифной политике, позволили разработать методологию для оценки факторов, определяющих межстрановые и межотраслевые различия в уровне используемых тарифов, применяемых для защиты внутреннего производства от конкурирующего импорта. На отраслевом уровне основными факторами, определяющими уровень тарифной защиты, являются концентрация собственности в отрасли, занятость в отрасли, эластичности спроса на импорт по собственной цене импорта и по цене отечественных товаров-субститутов, степень проникновения импорта, доля импорта товарной группы в общем объеме импорта. На уровне межстратового анализа такими факторами являются, во-первых, общий уровень экономического развития; во-вторых, такие характеристики структуры собственности в экономике, как степень вертикальной интегрированности и степень неравенства в распределении доходов.

2. Теоретическое моделирование функции равновесного объема импорта показало, что величина импорта отдельно взятой товарной группы зависит от стандартных переменных, таких как доход потребителей импортирующей страны, объем производства экспортной страны, общий уровень цен страны-экспортера, цена импорта, цена отечественных товаров-субститутов.

Построенная в работе теоретическая модель детерминантов вертикальной

интеграции, показала, что степень вертикальной интеграции определяется, главным образом, качеством институтов функционирования рынка и разрывом в производительности различных отраслей в экономике. Теоретическое моделирование позволило разработать эмпирическую модель вертикальной интеграции.

3. Эмпирический анализ факторов, определяющих объёмы российского импорта, показал, что, в соответствии с теоретическими соображениями, российский импорт положительно зависит от реальных доходов населения и цен на отечественные товары-субституты и отрицательно зависит от собственных цен на импортируемую продукцию. В работе впервые получены достоверные оценки воздействия на объёмы импорта цен на импортные товары и цен на отечественные товары-субституты для дезагрегированного набора отраслей промышленности, которые могут использоваться для эмпирического анализа межотраслевых различий в применяемых тарифах на импорт в Россию.

Эмпирический анализ детерминантов вертикальной интеграции показал, что реальные данные говорят в пользу гипотез, сформулированных в теоретическом разделе работы. Эконометрические оценки позволили подобрать для переменной вертикальной интеграции инструментальные переменные, которые использовались для эмпирического анализа межстрановых различий в уровне тарифной защиты.

Эмпирический анализ межстрановых различий в уровне тарифной защиты показал, что тарифы, применяемые странами в международной торговле, помимо уровня экономического развития, определяются также некоторыми характеристиками структуры собственности: чем выше степень вертикальной интегрированности экономики и чем выше в экономике степень неравенства в распределении доходов, тем больше будет применяемый тариф на импорт. Результат справедлив как для межстранового, так и для межвременного сопоставления.

Эмпирический анализ межотраслевых различий в уровне тарифной защиты, применяемой к отраслям российской промышленности показал значимость экономико-политических факторов формирования уровня тарифов. Результаты говорят в пользу гипотезы, согласно которой государственные органы при установлении импортных пошлин руководствуются, в том числе, правилом Рамсея: наибольшие тарифы на импорт устанавливаются для отраслей, спрос на конкурирующий импорт которых наименее эластичен. Результаты эмпирического ана-

лиза свидетельствуют также в пользу отрицательного влияния концентрации собственности в отраслях на уровень тарифной защиты.

Результаты работы могут быть использованы в качестве инструмента для проведения анализа мер валютной, промышленной и таможенно-тарифной политики. Оцененные в работе эластичности позволяют ранжировать отрасли по чувствительности к колебаниям обменного курса, оценить влияние политики обменного курса на экономический рост и торговый баланс. Анализ межотраслевых различий в уровне тарифной защиты отраслей российской промышленности позволяет выдвинуть предложения по унификации таможенных пошлин. Проведённый анализ межстрановых различий в торговой политике показывает, что для торговых партнёров России по мере снижения неравенства в распределении доходов и смещения структуры собственности в сторону меньшей вертикальной интегрированности, будет иметь место снижение тарифных ограничений на импортируемую продукцию и продвижение к свободной торговле.

## **СПИСОК ПУБЛИКАЦИЙ ПО ТЕМЕ ИССЛЕДОВАНИЯ**

**Работы, опубликованные автором в журналах, рекомендованных ВАКом**

**Министерства образования и науки Российской Федерации:**

1. Кнобель А.Ю. (2010): Детерминанты уровня тарифной защиты: межстрановой анализ // *Российский Внешнеэкономический Вестник* №9, 2010, с. 27–37, 0.6 п.л.
2. Кнобель А.Ю. (2010): Вертикальная интеграция, технологическая связанность производств, оппортунистическое поведение и экономический рост // *Экономика и Математические Методы*, том 46, № 1, с. 117–132, 0.9 п.л.

**Другие работы, опубликованные по теме кандидатской диссертации:**

3. Кнобель А.Ю. (2009): Вертикальная интеграция и экономический рост: эмпирическое исследование // *Журнал Новой Экономической Ассоциации*, № 3–4, с. 54–70, 0.9 п.л.
4. Кнобель А.Ю. (2010): Закономерности формирования уровня тарифов в международной торговле // *Научные труды ИЭП*, № 143Р, 8.5 п.л.

Объем 1.3 п.л. Тираж 100 экз.  
Отпечатано 29.10.2010 в ИЭП  
125993, Россия, Москва, Газетный пер., 3-5  
Тел.: (495) 629-6413. Факс: (495) 697-8816, 695-6841  
[www.iep.ru](http://www.iep.ru)