

В.В. Голикова,
К.Р. Гончар,
Б.В. Кузнецов

Национальный
исследовательский
университет
«Высшая школа
экономики»

ВЛИЯНИЕ ГЛОБАЛИЗАЦИИ НА ПОВЕДЕНИЕ РОССИЙСКИХ ПРОМЫШЛЕННЫХ ПРЕДПРИЯТИЙ

Влияние глобализации на развитие национальных экономик достаточно давно находится в центре внимания теоретических и прикладных экономических исследований. Они показывают, что глобализация повышает общую эффективность мировой экономики как за счет более глубокого разделения труда и соответственно более эффективного распределения ресурсов, так и за счет более быстрой передачи знаний, технологий, навыков. Принято считать, что на уровне фирм процессы глобализации, с одной стороны, создают дополнительные конкурентные стимулы к инновациям и повышению эффективности, с другой — новые возможности для бизнеса за счет проникновения на новые рынки и доступа к новым технологиям. Эмпирические доказательства позитивного влияния глобализации на поведение и эффективность фирм основаны главным образом на данных экономики развитых стран. В переходных и развивающихся странах ситуация не столь однозначна, а применительно к России эмпирические исследования этих процессов немногочисленны [Wilhelmsson, Kozlov, 2007; Aghion, Bessonova, 2006; Gorodnichenko et al., 2010].

Полагают, что российские обрабатывающие компании малозаметны на глобальных рынках в силу их низкой конкурентоспособности. Пока не слишком многочисленны и случаи интеграции отечественных предприятий в международные цепочки создания стоимости, а там, где эти процессы имеют место, российские фирмы встраиваются в основном в низкодходные звенья [Авдашева и др., 2005]. Вместе с тем многолетние наблюдения за процессами, происходящими в обрабатывающих отраслях российской промышленности, показывают, что в предкризисный период отмечалась тенденция к большей интеграции отечественных производителей в мировую экономику, к расширению масштабов как экспортной деятельности, так и закупок импортных сырья, комплектующих и оборудования. В предкризисные годы расширилось участие иностранных инвесторов в капитале российских об-

рабатывающих предприятий, интенсифицировались процессы заимствования не только производственных технологий, но и управленческих «ноу-хау» [Предприятия и рынки, 2010]. Предприятия (в основном крупные) нанимали на работу иностранных менеджеров, привлекали рабочую силу из зарубежных стран. В какой мере изменения инновационной активности, управленческих практик и других поведенческих характеристик фирм связаны с расширением участия в глобализации? Наблюдаются ли в России те же эффекты «обучения» фирм в процессе экспорта, которые отмечены в исследованиях в отношении других стран? Ответы на эти вопросы не вполне очевидны. Так, ряд исследователей полагают, что по меньшей мере в 1990-е годы внешняя торговля российских фирм продолжала носить черты старых дореформенных отношений, и поэтому глобализация не влияла на процессы трансформации фирм [Robinson, 1999]. Более поздние исследования указывают на гетерогенную реакцию фирм на стимулы от глобализации [Aghion, Bessonova, 2006].

Мы сделали попытку оценить обучающие эффекты экспорта на новых эмпирических данных, полученных в ходе двух раундов опроса предприятий обрабатывающей промышленности в 2005 и в 2009 гг. В отличие от предыдущих работ, данные опросы позволяют нам измерить некоторые параметры поведения фирмы напрямую и оценить последствия принятых ранее управленческих решений, связанных с участием в экспорте. Работа опирается на литературу, в которой обсуждается взаимосвязь участия в международной торговле с эффективностью и поведением фирмы. Основная теоретическая модель монополистической конкуренции с гетерогенными фирмами была предложена Мелитуем [Melitz, 2003], объяснившим, почему экспортирующие фирмы больше и производительнее, чем фирмы, работающие только на внутреннем рынке. Начиная с работы [Bernard, Jensen, 1999], в центре дискуссии стоит вопрос о наличии или отсутствии обучающих эффектов экспорта, причем большинство исследований продемонстрировали, что фирмы становятся более производительными еще до того, как они выходят на внешний рынок, в силу того что издержки входа, транспортировки, преодоления барьеров приспособления к новым покупателям и новым законам «по карману» только крупным и производительным фирмам. Обзор литературы по данной теме представлен в статьях [Greenaway, Kneller, 2004; Wagner, 2007].

Тестирование этой гипотезы на данных стран с переходной экономикой в основном показывает, что и в переходных экономиках высокая производительность предшествует экспорту. Но вместе с тем обучающий эффект наблюдается как в форме постэкспортного роста производительности в течение 2–4 лет, так и в форме большей склонности экспортирующих фирм к обновлению технологий и обучению персонала. К таким выводам пришли, например, авторы исследований [De Loecker, 2007], основанных на данных

фирм Словении, [Yang, Mallick, 2010] — на китайских данных, [Hagemejer, Kolasa, 2011] — на польских. Особый интерес представляет работа [Bustos, 2011], в которой продемонстрированы обучающие эффекты роста торговли в результате либерализации торгового режима между Аргентиной и Бразилией. Есть также целое семейство публикаций, в которых обучающие эффекты связывают с географическим направлением экспорта: торговля переходных стран с развитыми странами с большей вероятностью приводит к росту производительности и иных признаков обучения, чем с развивающимися, из-за большей требовательности западного покупателя к качеству, условиям поставки товара и сервисному обслуживанию [Damijan et al., 2004; Trofimenko, 2008; De Loecker, 2007]. Что касается выводов исследований, основанных на российских данных, то авторы работы [Wilhelmsson, Kozlov, 2007] продемонстрировали так называемый self-selection effect (сначала у фирм растет производительность, затем они выходят на экспорт) на сведениях реестра предприятий с присоединением данных таможенной статистики и сведений из реестра предприятий с иностранной собственностью. Де Роза [De Rosa, 2006] на тех же данных показал важность предшествующего опыта работы на внешних рынках. Городниченко и др. [Gorodnichenko et al., 2010] на данных опросов предприятий ВЕЕПС в 27 странах с переходной экономикой, включая Россию, продемонстрировали, как глобализация ведет к росту инновационности фирм.

В работе проверяются следующие исследовательские гипотезы.

1. На внешние рынки выходят более производительные и крупные фирмы.

2. Новые экспортеры, не связанные с предреформенной моделью внешней торговли, с большей вероятностью обладают высокой производительностью до момента выхода на внешние рынки, чем старые экспортеры.

3. Географическое направление экспорта оказывает влияние на проявление эффектов высокой доэкспортной производительности («self-selection»): фирмы, торгующие не только со странами СНГ, с большей вероятностью демонстрируют такие эффекты, чем фирмы, экспортирующие исключительно в страны бывшего Советского Союза.

Информационной базой исследования являются данные двух раундов опроса предприятий обрабатывающей промышленности, проведенных в 2005 и 2009 гг. в ходе проектов ИАПР ГУ ВШЭ, осуществленных по заказу и в сотрудничестве с Министерством экономического развития РФ. Опрошено около 1000 крупных и средних предприятий, выборка репрезентативна в разрезе ВЭД и размерных групп предприятий. Панельная часть выборки включает 499 наблюдений. Панель, расчеты по которой проведены в данной работе, в целом отражает отраслевую и размерную структуру полной выбор-

ки. Описательная статистика используемых в анализе группировок предприятий, выделенных по времени начала экспортной активности и ее географическому направлению, представлена в табл. 1.

Таблица 1. Описательная статистика экспортного статуса предприятий в 2005–2009 гг. и географии экспорта (панельные данные)

	Нет экспорта, 2005–2009 гг.	Старые экспортеры	Новые экспортеры	Бывшие экспортеры	Экспортеры только в СНГ в 2009 г.	Экспортеры на глобальный рынок в 2009 г.
Производительность труда по ВДС в 2005 г., тыс. руб./чел./год	152 (11)	235 (19)	268 (68)	180 (24)	224 (34)	258 (28)
Средний размер предприятия в 2005 г., чел.	275 (17)	937 (80)	470 (72)	573 (110)	576 (67)	1072 (106)
Доля фирм, сообщивших о высокой конкуренции с импортом или иностранными производителями в России в 2005 г., %	17,8	30,2	26,4	45,2	30,7	25,0
Доля предприятий – участников интегрированных групп, %	28,2	32,0	27,8	9,7	29,2	38,2
Доля предприятий с участием иностранного собственника в 2005 г., %	1,7	9,5	6,9	0,0	8,2	10,5
Доля предприятий с участием государства в собственности в 2005 г., %	10,3	12,2	8,3	6,5	10,9	12,5
Доля предприятий, созданных до 1991 г., %	76,4	72,1	66,7	67,7	73,9	69,7
Количество наблюдений	174	222	72	31	257	152

Примечание: в скобках – стандартная ошибка.

Проводится эконометрическая оценка модели следующего вида:

$$\begin{aligned} \text{Exp_status}^T &= F(LP^{T-1}, \text{Size}^{T-1}, \text{Comp}^{T-1}, \\ &\text{Foreign}^{T-1}, \text{State}^{T-1}, \text{Holding}^{T-1}, \text{age}, \text{Ind}), \end{aligned}$$

где *Exp_status* — отражает экспортную активность предприятий в оба года обследования survey; *LP* — индикатор производительности труда (в данном случае — отношение производительности труда на предприятии, измеренного как добавленная стоимость на 1-го занятого к среднеотраслевому уровню производительности труда для всех средних и крупных предприятий отрасли); *Size* — размер предприятия, измеренный количеством занятых; *Comp* — дамми-переменная, уровень конкурентного давления (высокая оценка конкуренции со стороны импортеров и зарубежных производителей на территории России); *Foreign* — дамми, присутствие иностранных собственников в капитале фирмы; *State* — дамми, присутствие государства в собственности; *Holding* — дамми, участие в холдинге; *age* — дамми-переменная, время создания фирмы — до 1991 г., в 1992–1998 гг., после 1998 г.; *Ind* — дамми-переменная для 8 ВЭД обрабатывающей промышленности. *T* – 1 – индексы, показывающие лаговые переменные, значение которых мы измеряли в прошлый период наблюдения. Экспортный статус измеряется принадлежностью предприятия к четырем группам: (1) базовая категория — отсутствие экспорта в 2005–2009 гг.; (2) «старые экспортеры» — наличие экспорта в 2005–2009 гг.; (3) «новые экспортеры» — отсутствие экспорта в 2005 г. и его появление в 2009 г.; (4) «бывшие экспортеры» — те, кто экспортировал в 2005 г., но не имел экспорта в 2009 г.

Во втором случае мы изменили спецификацию модели, приняв в качестве зависимой переменной группы экспортеров, выделенные по географическому признаку: базовая группа «неэкспортеров» сравнивалась с экспортерами только в страны СНГ и экспортерами на глобальные рынки. Результаты оценки обеих моделей приведены в табл. 2.

Гипотеза о том, что на экспорт выходят более производительные фирмы, подтверждается и на наших данных. И новые, и старые экспортеры были в 2005 г. более производительны, чем неэкспортеры и фирмы, прекратившие экспорт к 2009 г. Однако поскольку эффекты более значимы для старых экспортеров, есть основания полагать, что экспортеры продолжают наращивать производительность и после выхода на экспортные рынки. Против наших ожиданий мы не обнаружили значимого положительного влияния уровня конкуренции в 2005 г. на шансы фирмы стать экспортером. Более того, высокий уровень конкуренции статистически значимо негативно влияет на шансы фирмы выйти на экспорт. Это может свидетельствовать о том, что

Таблица 2.

Результаты оценки мультиномиальной логистической регрессии: влияние прошлой производительности труда и размера предприятий на экспортный статус предприятия и географическое направление экспорта

	Модель 1, экспортный статус как зависимая переменная			Модель 2, направление экспорта как зависимая переменная	
	Старые экспортеры	Новые экспортеры	Бывшие экспортеры	Экспортеры только в СНГ в 2009 г.	Экспортеры на глобальные рынки в 2009 г.
<i>LP05</i>	***	***		***	***
<i>Size05</i>	***	***	***	***	***
<i>Comp_05</i>		**			
<i>Holding_05</i>			**		
<i>Foreign_05</i>					
<i>State_05</i>		**		*	
<i>age1</i>		*			
<i>age3</i>					
Отрасли	Контролируются				
_cons	-6,71***	-3,37***	-2,56**	-4,24***	
Prob > chi2	0			0	
Pseudo R ²	0,2432			0,2142	
Число наблюдений	445			437	

Примечание: Базовая категория — отсутствие экспорта в 2005–2009 гг.

* Значимость на уровне 10%; ** — на уровне 5%; *** — на уровне 1%.

российский рынок слишком мал для большинства фирм с высоким уровнем производительности и данное обстоятельство стимулирует их к выходу на внешний рынок. В группе новых экспортеров знак коэффициента перед переменной наличия иностранного собственника является положительным, но статистически незначимым. Возможно, это связано с малым числом предприятий, имеющих иностранных собственников в нашей выборке. Напротив, присутствие среди собственников государства значимо отрицательно влияет на шансы стать экспортером.

Наши результаты подтверждают значимость эффекта масштаба для выхода на внешние рынки (хотя новые экспортеры несколько меньше по размеру, чем старые, и для них статистическая значимость этого фактора чуть

ниже). Время создания фирмы значимо только для новых экспортеров: среди них существенно больше предприятий, созданных в 1992–1998 гг. Что касается группы бывших экспортеров, то в силу ее малочисленности полученные результаты следует интерпретировать с осторожностью. Будучи большими фирмами (больше, чем новые экспортеры), они отличались существенно меньшей производительностью в 2005 г., чем старые и новые экспортеры. Возможно, их экспорт унаследован еще из советского прошлого и постепенно сошел на нет, поскольку отсутствие достаточного запаса прочности в виде высокой производительности труда не позволило им удержаться на зарубежных рынках. Устойчивость полученных результатов была проверена на парных регрессиях, сравнивающих группу новых экспортеров с каждой из анализируемых групп. Несмотря на то что значимость коэффициентов существенно упала из-за малого числа наблюдений, все основные результаты подтверждены.

Не подтвердилась наша гипотеза о сохранении предреформенной природы внешней торговли. Экспортеры и в дальнейшем зарубежье, и в СНГ обнаруживают преимущество по производительности в предшествующий период, что позволяет предположить, что «экспорта по привычке», в рамках сложившихся еще в советский период хозяйственных и технологических связей, осталось немного, и вряд ли стоит пытаться объяснить динамику экспорта в страны СНГ ссылкой на советское наследие.

Гипотезы о положительном влиянии экспорта на поведение предприятий (*learning by exporting*) проверялись нами на результатах анализа таблиц сопряженности экспортного статуса фирмы в 2005–2009 гг. и характеристик рыночного поведения фирмы, доступных нам в рамках проведенных двух раундов опроса (табл. 3).

Предварительный анализ поведенческих характеристик выделенных групп предприятий показывает, что значимо более активной является группа старых и новых экспортеров, среди которых старые экспортеры опережают новых по внедрению международных стандартов ISO, наличию расходов на НИОКР и IT-подразделения, диагностике и реструктуризации бизнес-процессов. Эти результаты свидетельствуют не только об обучении предприятий в процессе экспорта, но и о наиболее важных каналах, по которым оно происходит. Дальнейшие исследования будут направлены на эконометрическую проверку предварительных результатов и оценку их устойчивости.

Итак, в настоящей работе продемонстрировано, что российские предприятия обрабатывающей промышленности, так же как и во многих других странах, становятся более производительными еще до начала выхода на экспортные рынки. При этом не подтвердилась гипотеза о нерыночной природе экспорта в страны СНГ. Обнаружены признаки обучения предприятий в

Таблица 3. Взаимосвязь экспортного статуса фирмы в 2005–2009 гг. и характеристик рыночного поведения предприятий (панельные данные)

	Нет экспорта, 2005–2009 гг.	Старые экспортеры	Новые экспортеры	Бывшие экспортеры	Статистическая значимость различий*
Регулярно разрабатывается стратегия развития на срок более 3 лет	21,3	40,5	37,5	25,8	0,000
Проводится бенчмаркинг с зарубежными конкурентами	6,9	23,4	25,0	6,5	0,000
Проводится диагностика, реструктуризация бизнес-процессов	22,0	48,6	36,1	29,0	0,000
Сертификация по стандартам ISO и иным международным стандартам	32,2	64,9	47,2	32,3	0,000
Собственное IT-подразделение на предприятии	15,5	46,4	38,9	19,4	0,000
Наличие инвестиций в 2005–2008 гг.	57,5	77,5	73,6	51,6	0,000
НИОКР на постоянной основе	14,9	39,6	31,9	16,1	0,000
Наличие расходов на НИОКР	17,8	53,2	38,9	32,3	0,000

* Использован критерий хи-квадрат.

процессе экспорта и выделены конкретные каналы такого обучения, связанные с инновационной деятельностью и применяемыми управленческими технологиями.

Литература

Авдашева С.Б., Буданов И.А., Голикова В.В., Яковлев А.А. Модернизация российских предприятий в цепочках создания стоимости // Экономический журнал ВШЭ. 2005. № 3. С. 361–377.

Предприятия и рынки в 2005–2009 годах: итоги двух раундов обследования российской обрабатывающей промышленности. М.: ГУ ВШЭ, 2010.

Acemoglu D. Patterns of Skill Premia // Review of Economic Studies. 2003. 70. P. 199–230.

Aghion Ph., Bessonova Y. On Entry and Growth: Theory and Evidence // OFCE. June 2006. P. 259–278.

Bernard A.B., Jensen J.B. Exceptional Exporter Performance: Cause, Effect, or Both? // Journal of International Economics. 1999. 47. P. 1–25.

Bustos P. Trade Liberalization, Exports, and Technology Upgrading: Evidence on the Impact of MERCOSUR on Argentinean Firms // The American Economic Review. 101. P. 304–340 (<http://www.aeaweb.org/articles.php?doi=10.1257/aer.101.1.304>). Febr. 2011.

Damijan J.P., Polanec S., Prasniak J. Self-selection, Export Market Heterogeneity and Productivity Improvements: Firm Level Evidence from Slovenia. LICOS Discussion paper 148/2004. LICOS Centre for Transition Economics, Katholieke Universiteit Leuven. Leuven. 2004. (<http://www.econ.kuleuven.ac.be/licos/DP/DP2004/DP148.pdf>)

De Loecker J. Do Exports Generate Higher Productivity? Evidence from Slovenia // Journal of International Economics, 2007. 73(1). P. 69–98.

De Rosa D. Explaining Russian Manufacturing Exports: Firm Characteristics and External Conditions. Working paper No. 2006-22. Paris-Jourdan Sciences Economiques, 2006.

Gorodnichenko Yu., Svejnar J., Terrell K. Globalization and Innovation // Emerging Markets American Economic Journal: Macroeconomics. Apr. 2010. Vol. 2. No. 2. P. 194–226.

Greenaway D., Kneller R. Firm Heterogeneity, Exporting and Foreign Direct Investment // Economic Journal. 2007. 117(517). P. 134–161.

Hagemejer Y., Kolasa M. Internationalisation and Economic Performance of Enterprises: Evidence from Polish Firm-level Data // The World Economy. Jan. 2011. Vol. 34(1). P. 74–100.

Melitz M.J. The Impact of Trade on Intra-Industry Reallocations and Aggregate Industry Productivity // Econometrica. 2003. 71(6). P. 1695–1725.

Robinson N. The Global Economy, Reform and Crisis in Russia // Review of International Political Economy. Winter, 1999. Vol. 6. No. 4. P. 531–564.

Şeker M. Importing, Exporting and Innovation in Developing Countries. The World Bank. Finance and Private Sector Development Department Enterprise Analysis Unit. Dec. 2009. WPS5156.

Trofimenko N. Learning by Exporting: Does it Matter Where One Learns? Evidence from Colombian Manufacturing Plants. *Economic Development and Cultural Change*. 2008. 56(4). P. 871–894.

Verhoogen E.A. Trade, Quality Upgrading, and Wage Inequality in the Mexican Manufacturing Sector // *Quarterly Journal of Economics*. 2008. 123(2). P. 489–530.

Wagner J. Exports and Productivity: a Survey of the Evidence from Firm-level Data // *The World Economy*. 2007. 30(1). P. 60–82.

Wilhelmsson F., Kozlov K. Exports and Productivity of Russian Firms: in Search of Causality // *Economic Change & Restructuring*. Dec. 2007. Vol. 40. Iss. 4. P. 361–385.

Yang Y., Mallick S. Export Premium, Self-selection and Learning-by-Exporting: Evidence from Chinese Matched Firms // *The World Economy*. Oct. 2010. Vol. 33. Iss. 10. P. 1218–1240.