

МИНИСТЕРСТВО ОБРАЗОВАНИЯ И НАУКИ РОССИЙСКОЙ  
ФЕДЕРАЦИИ

Федеральное государственное автономное образовательное  
учреждение высшего образования  
«Санкт-петербургский политехнический университет Петра Великого»  
Институт промышленного менеджмента, экономики и торговли  
Международная высшая школа управления

УДК 339

УТВЕРЖДАЮ  
Директор Международной  
Высшей Школы Управления  
к.э.н., доцент  
\_\_\_\_\_ О.В. Миролюбова  
« \_\_\_\_\_ » \_\_\_\_\_ 2017 г.

ВЫПУСКНАЯ КВАЛИФИКАЦИОННАЯ РАБОТА БАКАЛАВРА  
на тему:

**«Выбор стратегии внешнеэкономической деятельности  
Ямало-Ненецкого автономного округа РФ»**

Направление: 38.03.01- Экономика

Выполнила студентка гр. № 437331/0603 \_\_\_\_\_ Я.С. Паршина

Научный руководитель, профессор, д.э.н. \_\_\_\_\_ Н.И. Диденко

Нормоконтролер, ассистент \_\_\_\_\_ Л.А. Гончарова

Санкт-Петербург  
2017

## СОДЕРЖАНИЕ

ПЕРЕЧЕНЬ СОКРАЩЕНИЙ И УСЛОВНЫХ ОБОЗНАЧЕНИЙ .....	9
ВВЕДЕНИЕ.....	10
1. ХАРАКТЕРИСТИКА ВЭД ЯНАО НА УРОВНЕ ПРЕДПРИЯТИЙ, МУНИЦИПАЛЬНЫХ ОБРАЗОВАНИЙ РЕГИОНА И РЕГИОНА В ЦЕЛОМ .....	13
1.1 Анализ ВЭД ЯНАО на уровне предприятий.....	13
1.2 Анализ ВЭД на уровне муниципальных образований ЯНАО .....	23
1.3 Анализ ВЭД на уровне региона ЯНАО .....	35
2. ВЫБОР КОНЦЕПЦИИ ВЭД РЕГИОНА.....	46
2.1 Характеристика основных концепций ВЭД.....	46
2.2 Обзор существующей концепции развития ВЭД ЯНАО .....	48
2.3 Выбор концепции для последующей разработки стратегии ВЭД .	51
3. РАЗРАБОТКА МОДЕЛИ РАЗВИТИЯ ВЭД ЯНАО: ИНСТИТУЦИОНАЛЬНО-ФУНКЦИОНАЛЬНЫЙ ПОДХОД.....	55
3.1 Анализ состояния институциональной среды ВЭД ЯНАО .....	55
3.2 Анализ пространства институциональной среды ВЭД ЯНАО.....	57
3.3 Методика разработки модели развития ВЭД ЯНАО.....	60
3.4 Оценка уровней институциональной среды ВЭД ЯНАО при помощи системы эконометрических уравнений .....	64
3.4.1 Разработка модели первого уровня пространства институциональной среды ВЭД ЯНАО.....	64
3.4.2 Разработка модели второго уровня пространства институциональной среды ВЭД ЯНАО.....	77
3.4.3 Разработка модели третьего уровня пространства институциональной среды.....	121
4. ВЫБОР СТРАТЕГИИ ВЭД ЯНАО.....	142
4.1 Выбор стратегии ВЭД на концептуальном уровне .....	143
4.2 Разработка «Дорожной карты» ВЭД ЯНАО .....	150
4.3 Обобщения и полученные выводы .....	155

ЗАКЛЮЧЕНИЕ .....	158
СПИСОК ИСПОЛЬЗОВАННЫХ ИСТОЧНИКОВ .....	161
ПРИЛОЖЕНИЕ А .....	161
ПРИЛОЖЕНИЕ Б .....	171
ПРИЛОЖЕНИЕ В .....	176
ПРИЛОЖЕНИЕ Г .....	196

## ВВЕДЕНИЕ

Развитие мировой экономики тесно связано с ростом вовлеченности стран и их регионов в международно-хозяйственных связях. Современные процессы глобализации и интеграции в мировое сообщество качественно изменили условия внешнеэкономической деятельности. Сегодня основные решения принимаются преимущественно на уровне муниципальных образований. Поэтому роль регионов как субъектов международной деятельности в настоящее время существенно повышается, что стимулирует органы местного самоуправления все активнее заниматься развитием внешнеэкономических операций, поддерживая для этого иностранный бизнес на своих территориях и помогая предприятиям осваивать зарубежные рынки.

Эффективное взаимодействие регионов на мировой арене возможно только благодаря реализации качественной стратегии внешнеэкономической деятельности, которая способствовала бы многостороннему развитию его внешнеэкономических связей. Однако в настоящее время далеко не в каждом регионе разработан план действий, который способен повысить экономический потенциал региона. Кроме того, слабо развиты и методические рекомендации к разработке и реализации стратегии ВЭД на региональном уровне. Следовательно, необходимо разрабатывать и постоянно модернизировать стратегии ВЭД, которые должны занимать значимое место в политике региональных властей. Желательно при этом в основу данных стратегий закладывать инновационную компоненту, способной качественно изменить направления специализации региона и повысить его потенциал.

Тема бакалаврской работы была выбрана исходя из необходимости фундаментального и прикладного исследования Арктического пространства России, поскольку оно является одной из основных стратегических территорий нашей страны, где располагаются обширные запасы полезных ископаемых. На современном этапе Арктические территории, а именно Ямало-Ненецкий автономный округ является слабо исследованным, поэтому привлекает внимание многих экономистов, стремящихся эффективно использовать ресурсы данного округа.

Из выше сказанного вытекает актуальность работы, которая заключается в необходимости анализа ЯНАО с целью выбора и разработки стратегии его внешнеэкономической деятельности в условиях протекающих процессов глобализации и интеграции.

Так как в настоящее время основными субъектами международной деятельности становятся муниципальные образования и регионы, которые стремятся развивать внешнеэкономическую деятельность с целью повышения своего социально-экономического развития и уровня конкурентоспособности на мировом рынке. Следовательно, анализ внешнеэкономической деятельности ЯНАО РФ является не только актуальной, но социально-значимой задачей.

Значение работы обосновывается не только ее актуальностью, но и разработанным планом мероприятий, направленным на развитие внешнеэкономической деятельности ЯНАО, который может пригодиться правительству РФ, а также законодательным органам, занимающимся разработкой стратегий развития Арктических территорий.

Объектом исследования является внешнеэкономическая деятельность Ямало-Ненецкого автономного округа.

Предметом исследования является стратегия внешнеэкономической деятельности Ямало-Ненецкого автономного округа РФ.

Целью выпускной квалификационной работы является выбор вариантов стратегии внешнеэкономической деятельности Ямало-Ненецкого автономного округа РФ в формате «Дорожной карты» на основе разработанной институционально-функциональной модели развития ВЭД ЯНАО.

Для достижения поставленной цели были выделены следующие задачи:

- 1) Осуществить анализ ВЭД ЯНАО на уровне предприятий, муниципальных образований региона и региона в целом;
- 2) Охарактеризовать существующие концепции ВЭД региона и выбрать одну для последующей разработки стратегии ВЭД ЯНАО;
- 3) Описать состояние и пространство институциональной среды ВЭД ЯНАО;
- 4) Разработать трёхуровневую модель развития ВЭД ЯНАО на основе институционально-функционального подхода;
- 5) Разработать «Дорожную карту» внешнеэкономической деятельности Ямало-Ненецкого автономного округа РФ.

Работа структурирована согласно следующей логике. Во введении содержится обоснование актуальности темы бакалаврской работы, степень проработанности темы исследования, а также определяются цели и задачи.

В рамках первой главы анализируется ВЭД региона на уровне предприятий, муниципальных образований региона и региона в целом.

Во второй главе осуществляется выбор концепции внешнеэкономической деятельности региона, на основании которой будет построено дальнейшее исследование.

В третьей главе анализируется состояние пространства ВЭД региона, разрабатывается методика построения модели, осуществляется оценка уровней пространства институциональной среды ЯНАО на основе разработки трехуровневой модели ВЭД, а также производятся необходимые расчеты и формулируются выводы.

В рамках четвертой главы осуществляется выбор стратегии ВЭД региона на основании разработки «Дорожной карты».

В заключении формулируются выводы по проделанной работе.

Теоретической базой работы выступают монографии и учебные пособия, статьи российских и зарубежных авторов из РИНЦ и Scopus. Основной информационной базой исследования являются: сайт Федеральной службы государственной статистики, а также сайт правительства ЯНАО.

Степень научной проработанности темы исследования представлена следующим перечнем. В трудах отечественных и зарубежных исследователей представлен разносторонний анализ проблем развития внешнеэкономической деятельности региона. Среди них, основными являются: Рязанцева С.В., Архипова А., Маневич В.Е., Березовенко С.Н., Мингалева Ж.А., Сакс Дж., Ромер П. и другие. В работах Диденко Н.И., Скрипнюк Д.Ф. рассматриваются концепции моделирования развития территорий. Также во многих работах российских экономистов исследовались отдельные формы внешнеэкономической деятельности, прежде всего внешней торговли и механизма ее государственного регулирования. К ним следует отнести труды: А. Басенко, Э. Батизи, Ю. Грачева, И. Дюмулена и другие.

В данном исследовании используются общенаучные методы и приемы, а именно: сравнительно-аналитический метод, методы графического анализа и экономико-статистические методы. Также методы корреляционного, регрессионного анализа, эконометрические методы исследования проблемы, а именно инструментальный построения ADL-модели и институционально-функциональный подход.

### 3.3 Методика разработки модели развития ВЭД ЯНАО

Методологические принципы построения модели развития ВЭД ЯНАО, согласно учениям доктора экономических наук, профессора Н. И. Диденко и д.э.н., профессора Д.Ф. Скрипнюк, основаны на использовании системы взаимосвязанных эконометрических уравнений. Так, пошаговая методика разработки соответствующей модели представлена ниже.

1. *Конкретизация постановки цели* и задач разработки модели внешнеэкономической деятельности Ямало-Ненецкого автономного округа. Так, основной целью разработки данной модели будет являться построение трехуровневой модели развития ВЭД ЯНАО, а также разработка «Дорожной карты» ВЭД региона.

*Цель первого уровня:* построить производственную функцию Кобба-Дугласа по четырем основным отраслям экономики региона и оценить степень зависимости между объемом отгруженной продукции соответствующих отраслей, с такими основными факторами как: затраты на технологические инновации организаций ЯНАО, количество работающих в каждой отрасли и стоимость основных производственных фондов в соответствующих отраслях экономики региона. То есть целью будет являться разработка модели, отображающей первый уровень пространства институциональной среды, а именно функционирование основных отраслей экономики ЯНАО, работающих в сфере ВЭД ЯНАО и их влияние на развитие института ВЭД автономного округа.

*Цель второго уровня:* оценка степени влияния показателей, характеризующих ВЭД региона, на функционирование 7 сфер жизнедеятельности округа при помощи построения ADL-модели.

*Цель третьего уровня:* разработать ADL-модель, отображающую результат взаимодействия 7 субпространств институциональной среды ВЭД ЯНАО и основных акторов, формируя, тем самым, стратегию внешнеэкономической деятельности региона.

2. *Выбор и обоснование показателей*, оценивающих каждый уровень пространства институциональной среды региона, а именно показателей, характеризующих деятельность основных отраслей экономики ЯНАО, которые работают в ВЭД региона. Также необходимо будет осуществить выбор и обоснование показателей, оценивающих каждое субпространство пространства институциональной среды региона. Кроме того, необходимо будет выбрать показатели, описывающие взаимодействие 7 субпространств институциональной среды ЯНАО и его основных акторов.

3. Анализ временных рядов показателей с целью *выбора эндогенных и экзогенных переменных* на основе построения функциональных зависимостей. Представление модели в общем виде.

4. *Сбор статистической информации* по выбранным показателям с периода 2004 года по 2016 год.

5. *Анализ временных рядов на стационарность* при помощи теста Дики-Фуллера. Осуществление теста Дики-Фуллера подразумевает построение авторегрессионного уравнения вида:

$$y_t = ay_{t-1} + \varepsilon_t \quad (1)$$

где  $y_t$  — временной ряд, а  $\varepsilon_t$  — ошибка. Если в результате расчетов обнаружится, что  $|a| < 1$ , то будет сделан вывод, что рассматриваемый ряд является стационарным. Если же  $a=1$ , то временной ряд имеет единичный корень, в этом случае будет сделан вывод, что ряд не стационарен [11]. То есть будет проведен тест на наличие «единичного корня» в рядах динамики. Если будет подтверждена гипотеза о наличии единичного корня, то будет сделан вывод, что рассматриваемый ряд является нестационарным. И наоборот соответственно.

6. *Трансформация нестационарных временных рядов в стационарные* при помощи перехода от исходной временной последовательности к ряду разностей соседних значений.

7. Осуществить обработку рядов динамики на основе *проверки временных рядов эндогенных и экзогенных переменных на наличие автокорреляции и на наличие мультиколлинеарности*. Для этого:

7.1 *Выбрать лаг эндогенных и экзогенных переменных* при помощи расчета коэффициента автокорреляции. Оставить лаги переменных, которые имеют сильную корреляционную связь со значением показателя в последнем периоде, *коэффициент корреляции* 0,8 и более.

7.2 Осуществить *проверку значимости коэффициентов автокорреляции* при помощи Q-теста Льюнга — Бокса. Сущность проведения данного теста состоит в проверке на отличие от нуля сразу несколько коэффициентов автокорреляции. Первоначальным этапом проведения данного теста является выдвижение двух гипотез: 1)  $H(0)$  - данные являются случайными (то есть представляют собой белый шум); 2)  $H(1)$  - данные не являются случайными [2]. Затем проводится испытание при помощи использования следующей формулы:

$$\sigma = n(n+2) \sum_{k=1}^m \frac{\rho_k^2}{n-k} \quad (2)$$

где  $n$ -число наблюдений,  $\rho_k^2$ -автокорреляция  $k$ -го порядка,  $m$ -число проверяемых лагов.



Если в результате расчетов получается неравенство вида  $Q > \chi_{1-\alpha, m}^2$ , где  $\chi_{1-\alpha, m}^2$  – это квантили распределения хи-квадрат с  $m$  степенями свободы, то нулевая гипотеза отвергается и признаётся наличие автокорреляции до  $m$ -го порядка во временном ряду. То есть коэффициент автокорреляции признаётся значимым и наоборот.

7.3 *Определить тесноту связи между экзогенными и эндогенными переменными* при помощи построения корреляционной матрицы. Оставить экзогенные переменные для дальнейшего анализа, которые имеют сильную корреляционную связь с эндогенной переменной, коэффициент корреляции 0,8 и более.

7.4 *Осуществить проверку на значимость коэффициентов корреляции* при помощи  $t$ -критерия Стьюдента. Для этого вычисляется  $t_{\text{расч}}$  и находится  $t$ . табл по таблице  $t$ -распределения Стьюдента и затем сравнивается. Как правило,  $t_{\text{расч}}$  находится по формуле:

$$t_{\text{расч}} = \frac{r}{\sqrt{1-r^2}} \sqrt{n-2},$$

где  $r$  – коэффициент парной корреляции;  $n$  – число элементов в выборке. Затем для тех пар переменных, у которых коэффициент парной корреляции будет высок (больше 0,7), выполняется неравенство  $t_{\text{расч}} > t$ . табл, следовательно, коэффициент корреляции при них значим.

7.5 *Проверить экзогенные переменные на мультиколлинеарность* на основе построения корреляционной матрицы. Рассмотреть тесноту связи между каждой парой экзогенных переменных, коэффициент корреляции у которой 0,8 и более. Исключить из дальнейшего анализа одну из переменных, которая коррелирует с большим количеством остальных экзогенных переменных. *Осуществить проверку на значимость коэффициентов корреляции* при помощи  $t$ -критерия Стьюдента.

8. *Представить систему уравнений в общем виде на основе функциональных зависимостей* после выбора лага эндогенных переменных, после удаления экзогенных переменных, которые имеют слабую связь с выбранными экзогенными переменными, после удаления экзогенных переменных, которые имеют сильную связь с остальными экзогенными переменными.

9. *Представить систему уравнений в структурной форме.*

10. *Представить систему уравнений в приведённой форме* при помощи метода подстановок.

11. *Произвести идентификацию каждого уравнения системы* на основе проверки необходимого и достаточного условия

идентификации. Это означает осуществить проверку каждого уравнения при помощи следующего правила:

$D + 1 = H$  — уравнение идентифицируемо;

$D + 1 < H$  — уравнение неидентифицируемо;

$D + 1 > H$  — уравнение сверхидентифицируемо

где  $H$  — число эндогенных переменных в конкретном уравнении системы;  $D$  — число экзогенных переменных, которые содержатся в системе, но не входят в данное уравнение [11]. Результатом проверки станет определение типа модели, то есть ее идентифицируемость, неидентифицируемость или сверхидентифицируемость.

11.1 *Выбор метода наименьших квадратов* для нахождения коэффициентов уравнения системы. По результатам проверки идентифицируемости модели необходимо будет выбрать, какой МНК (обычный, косвенный, двухшаговый) нужно использовать для нахождения коэффициентов уравнения системы.

12. *Найти коэффициенты каждого уравнения системы* при помощи выбранного метода наименьших квадратов. *Проверить на соответствие полученного уравнения исходным данным* при помощи R-квадрата. *Осуществить проверку на достоверность* полученных уравнений системы при помощи F-критерия Фишера. *Проверить значимость коэффициентов* каждого уравнения при помощи расчета t-критерия Стьюдента.

13. *Построение прогноза* на ближайшие 3 года.

14. Выводы. Результаты исследования.