

“丝绸之路经济带”建设中新疆对外开放 与经济发展的关系研究

牛风君

(新疆财经大学 新疆 乌鲁木齐 830012)

摘要:在共建“丝绸之路经济带”的战略提出后,新疆经济开放度及其对经济发展的贡献程度的研究,对于我国向西开放及把新疆建设成为“丝绸之路经济带”的核心区具有重要的意义。从直观数据上看,经济开放促进了新疆经济的快速发展,但实际上,并没有体现出两者的数量关系和因果关系。因此,文章将对新疆国内生产总值与各经济开放度指标进行实证分析,通过计量模型来判断经济开放度与经济发展的关系,并提出相应的对策建议。

关键词:“丝绸之路经济带”;经济开放度;经济发展;新疆

中图分类号:F283 **文献标识码:**A **文章编号:**2095-0098(2015)01-0053-04

一、引言

新古典经济增长理论提出,对外开放可以使国家或地区获得规模经济效应,促进资本的形成,提高资源配置率进而影响本国或地区的经济发展。因此,对外开放与经济发展一直是经济学家们研究关注的领域。国内外学者关于对外开放与经济发展的研究主要集中在两个方面:一是 Dollar、Leamer、徐冉^[1]等进行了对外开放度的指标测量,二是包群、胡智、黄蔚等从国家层面研究对外开放与经济发展的关系,但对区域研究的文献较少,尤其是新疆。^[2]

2013 年 9 月 7 日,习近平主席在哈萨克斯坦纳扎尔巴耶夫大学发表演讲时提出共同建设“丝绸之路经济带”的伟大战略构想。几千年来,丝绸之路的反复挫折遭遇,使得中国西北及中亚地区成为经济严重塌陷的地带。共建“丝绸之路经济带”战略构想的提出,无疑为新疆带来前所未有的发展新机遇,同时为新疆的对外开放开辟广阔的空间。在这样的背景下来分析新疆经济开放度及其对经济发展的贡献程度,对于我国向西开放及把新疆建设成为“丝绸之路经济带”的核心区具有重要的意义。改革开放以来,新疆经济总量快速增长,经济开放程度不断提高,直观数据上显示,经济开放促进了新疆经济的快速发展,但实际上,并没有体现出两者的数量关系和因果关系。到底是经济开放带动了经济发展,还是经济发展导致了经济开放度的提高?两者之间是否存在短期、长期的均衡关系?本文针对这些问题从实证分析的角度展开探讨研究。

二、新疆经济开放与经济发展的实证分析

(一) 指标选取

本文在共建“丝绸之路经济带”战略构想提出的背景下,考虑到新疆经济发展水平、数据的可得到性和可操作性以及国内外学者的研究做法等因素,分别采取以下实证指标:新疆国内生产总值(GDP)、外贸

收稿日期:2014-11-19

基金项目:新疆财经大学博士研究生科研基金项目资助

作者简介:牛风君(1987-),女,新疆财经大学金融学博士研究生,新疆教育学院讲师,研究方向为中国(新疆)与中亚区域金融合作。

依存度、外资依存度、对外投资依存度、中亚五国贸易依存度。^[3]

其中,外贸依存度是进出口贸易总额与国内生产总值的比值,反映了进出口对经济发展的贡献程度;外资依存度是实际利用外商直接投资额与国内生产总值的比值,显示了吸引及利用外商直接投资对经济发展的重要性;对外投资依存度是指对外投资与国内生产总值的比值,反映了对外投资对经济发展的贡献;中亚五国贸易依存度是与中亚五国的进出口贸易总额与国内生产总值的比值。

(二) 数据来源

本文选取 1993 年—2013 年新疆国内生产总值(GDP)、实际利用外商直接投资依存度(X1)、对外投资依存度(X2)、进口依存度(X3)、出口依存度(X4)、新疆对中亚五国出口贸易依存度(X5)、新疆对中亚五国进口贸易依存度(X6)等七个研究指标,利用 eviews5.0 来进行实证分析。数据分别来源于《新疆统计年鉴》(1994—2014)。

由于各变量的统计单位有所不同以及不同时期的汇率变动,本文则按照《中国统计年鉴》提供的人民币对美元的汇率,将所有数据统一转化为以万美元为单位来表示,并根据相应的公式计算出各衡量经济开放度的指标值。

(三) 模型建立与检验^[4]

1. 相关性分析。相关性分析主要是判断两个或两个以上变量之间是否存在相关关系,并分析变量间相关关系的性质和程度,通常以相关系数来表示。本文首先检验新疆 1993—2013 年度经济开放度指标与 GDP 之间的相关性,结果见表 1。

表 1 相关系数

指标	X1	X2	X3	X4	X5	X6
GDP	-0.5066	0.5474	-0.3022	0.8014	0.8383	-0.266

结果表明,出口依存度、新疆对中亚五国出口依存度与 GDP 的相关系数分别为 0.8014、0.8383,说明出口依存度、新疆对中亚五国出口依存度这两个指标与 GDP 之间存在高度的正相关,即新疆的出口与新疆对中亚五国的出口对新疆经济发展起着至关重要的作用。对外投资与 GDP 的相关系数为 0.5474,表明两者之间也存在正向相关关系,即对外投资能够促进新疆经济发展。而实际利用外资依存度、进口依存度、新疆对中亚五国进口依存度这三个指标与 GDP 之间存在的是负向的相关关系,即新疆的进口、新疆对中亚五国的进口及利用外资抑制了新疆经济的发展。

2. 平稳性检验。在时间序列分析过程中,直接对变量进行回归会导致高拟合度、显著性等伪回归现象出现,这样的实证研究得出的结果没有任何意义。因此为防止伪回归现象的发生,首先应该对变量进行平稳性检验。为消除异方差,在进行平稳性检验之前,本文对所有原始数据进行了对数处理,验证结果如表 2。

表 2 各变量的单位根检验值

变量	ADF 值	5% 临界值	是否平稳	变量	ADF 值	5% 临界值	是否平稳
GDP	2.615678	-3.052169	否	Δ GDP	-6.283139	-3.040391	是
X1	-2.998423	-3.081002	否	Δ X1	-6.705804	-3.710482	是
X2	-3.074299	-3.673616	否	Δ X2	-7.585000	-3.690814	是
X3	-1.891932	-3.029970	否	Δ X3	-3.335239	-3.040391	是
X4	-1.273569	-3.02997	否	Δ X4	-4.184057	-3.040391	是
X5	-0.966529	-3.029970	否	Δ X5	-3.575510	-3.040391	是
X6	-2.262395	3.029970	否	Δ X6	-4.145735	-3.040391	是

ADF 检验设定的原假设 $I_0: x = 0$, 备选假设 $I_1: x > 0$ 。接受 I_0 , 意味着变量有单位根, 非平稳; 否则, 拒绝 I_0 , 变量无单位根, 平稳。

根据 ADF 检验结果我们可以看出, 在 5% 的显著水平, 各原始指标变量接受了原假设, 都是非平稳的, 但经过一阶差分后各个变量则拒绝了原假设, 都变成平稳的, 满足一阶单整, 可以进行协整关系检验。

3. 协整检验。根据 ADF 检验结果, GDP、X1、X2、X3、X4、X5、X6 具有同阶单整性, 因此可以做变量间的

协整关系检验。本文采用多变量下的 Engle&Granger 协整回归残差的两步检验法进行检验。

首先,建立如下回归方程: $GDP = a + b \cdot X_1 + c \cdot X_2 + d \cdot X_3 + e \cdot X_4 + f \cdot X_5 + g \cdot X_6$

运用 OLS 法进行线性回归,回归结果如下:

$$GDP = 14.133331 - 0.2916732448 \cdot X_1 + 0.1217348693 \cdot X_2 - 0.05618226506 \cdot X_3 + 0.6346402012 \cdot X_4 + 0.06557288406 \cdot X_5 - 0.552224594 \cdot X_6$$

(t)	(7.692645)	(-4.515262)	(3.967402)
(P)	(0.0000)	(0.0018)	(0.0036)

	(-4.049689)	(6.426672)	(13.058970)
	(0.0024)	(0.0007)	(0.0000)

	(-3.496638)
	(0.0037)

$$R - \text{squared} = 0.965131 \quad \text{Adjusted } R - \text{squared} = 0.95673$$

$$F = 17.58 \quad P(F \text{ 统计量}) = 0.0016$$

通过回归结果我们可以看出,在5%的显著水平下,回归方程中各变量拒绝了原假设,是显著的; R^2 为 0.97,拟合度较好;方程通过了 F 显著性检验。

其次,为确定回归方程之间是否存在协整关系,需要对回归方程的残差进行 ADF 平稳性检验,同时也还可以判断模型设定的正确与否。如果结果显示残差序列是平稳的,那么就说明我们的回归方程是设定合理的,回归方程的因变量和解释变量之间存在稳定的均衡关系;反之,则说明模型设定有问题,因变量和解释变量之间不存在稳定的均衡关系,即使出现很理想的参数的回归结果,也有可能是一个伪回归。设定上述线性回归方程式的残差为 e ,ADF 检验结果见表 3。

表 3 残差单位根检验值

	ADF 检验值	5% 临界值	是否平稳
残差 e	-3.320752	-2.660551	是

ADF 检验结果显示,残差序列 e 是一个平稳的序列。因此,可以明显地表明, GDP 与各经济开放度指标之间长期内存在协整关系。

三、实证结果与对策建议

(一) 实证结果

1. 新疆实际利用外资与经济发展之间存在负相关关系。一般来讲,利用外资是促进经济发展的重要因素,然而对于经济欠发达的新疆而言,根据新疆统计年鉴的数据显示,虽然外商合同投资额很高,但履行合同比例较低、实际利用外商投资占比很小并且效率低下,不能实现快速有效的将投入转为产出,因此,会对新疆的经济发展产生抑制作用。

2. 新疆对外直接投资与经济发展之间存在正相关关系,即新疆对外直接投资对经济发展起着明显的促进作用。

3. 新疆进口、新疆对中亚五国的进口与经济发展之间存在负相关关系,即在一定程度上抑制了新疆的经济发展。这主要的原因可能是由于新疆位于我国西北边陲,与中国内陆省份进行经济往来远不比临近的中亚五国方便,同时新疆与中亚五国的进口多为钢材、原油等,并没有充分发挥出新疆的比较优势。

4. 新疆出口、新疆对中亚五国的出口与经济发展之间存在高度的正相关关系,即在很大程度上促进了新疆的经济发展,具有很强的拉动效力。

(二) 对策建议

自中国实施向西开放战略以来,新疆取得了巨大的成绩,这很大程度上也是取决于新疆经济开放程度的提高,特别是对外贸易的蓬勃发展。当前在共建“丝绸之路经济带”的背景下,新疆应充分发挥其区位优势、

高校利用优厚的政策条件,大力提高自身水平及综合竞争力,为实现“丝绸之路经济带”核心区建设提供坚实的基础。为此提出以下对策建议:

1. 大力吸引外资并着实提高外资利用率。^[5]目前,新疆在利用外商直接投资的过程中存在的主要因素还是集中在缺乏投资开发环境、利用外资规模小、效益差等。因此,我们应该针对这些主要因素专门制定相关政策及措施,例如,政府部门应参与到投资开发环境的建设与维护中,抓住机遇,发挥优势;通过将引进外资投入到新疆科技创新能力和管理水平的培养等薄弱环节中来提高利用效率;在吸引外商投资,特别是中亚外商投资时,不能全盘接收,而要去粗取精以保证项目的质量;加强政策机制规范投融资,促进疆内企业和外资企业的竞争。

2. 以共赢为出发点,提高对外投资有效、多元化。充分利用新疆和中亚之间有差异的资源配置,多多参与经济技术的国际合作和交流,以共赢为出发点,真正做到融入区域国际经济活动当中去。

3. 转变和突出新疆的战略地位,进一步促进新疆与中亚国家的经贸合作。中国与中亚国家签署的多项经贸合作协议,也为新疆与中亚国家经贸合作提供了坚实的国家政治基础和更广阔的发展空间。而共建“丝绸之路经济带”战略构想的提出以及加强“五通”的发展思路,为与中亚国家经贸合作指明了发展的方向及重点,为投资、搭建涉外平台、市场环境等都提供了有力支撑。在这样有利的背景下,新疆应尽快转变和突出战略地位,加强建设“丝绸之路经济带”的核心区;同时还应全面考虑各种政治安全威胁,例如,俄罗斯、美国、西欧以及日韩等国家、国内东南沿海等内地发达省区所带来的强有力的竞争、恐怖活动的蔓延、跨国犯罪等。^[6]

参考文献:

- [1]徐冉. 基于VAR的对外开放度与经济增长关系研究[J]. 地域研究与开发, 2014(6).
- [2]程中海, 罗芳. 贸易开放度与经济增长关联性研究——以新疆为例[J]. 生产力研究, 2010(1).
- [3]张双杰, 周登龙. 基于中亚区域经贸合作的新疆经济开放度与经济增长关系研究[J]. 武汉商业服务学院学报, 2013(4).
- [4]高铁柯. 计量经济分析与建模 Eviews 应用与实例[M]. 北京: 清华大学出版社, 2009.
- [5]孙慧, 邢娟娟, 滕文静, 钟小梅. 新疆对外开放与经济增长关系的实证分析[J]. 资源与产业, 2013(4).
- [6]段秀芳. 发挥思路精神, 共建丝绸之路经济带——突出中亚经贸合作[N]. 新疆日报, 2013-10-23.

The Study of the Relationship between Xinjiang's Economic Openness and Economic Development in the Construction of "Silk Road Economic Zone"

NIU Fengjun

(Xinjiang University of Finance and Economics, Urumqi, Xinjiang 830012, China)

Abstract: After the strategy of building "Silk Road economic zone" proposed, the study of Xinjiang's economic openness and the extent of its contribution is of great significance to the opening of the west and to make Xinjiang become the core area of "Silk Road economic zone". Judging from the data intuitively, economic openness promoted the rapid development of Xinjiang's economy; but in fact, they have no quantitative relationship or causal connection. Therefore, in the article, we make an empirical analysis of the GDP and various economic openness indicators in Xinjiang, judge the relationship between economic openness and economic development by using econometric models, and put forward some corresponding countermeasures and suggestions.

Key words "Silk Road economic zone"; economic openness; economic development; Xinjiang

(责任编辑: 沈 五)