

Badania koniunktury jako dodatkowe źródło informacji o sytuacji gospodarczej

Elżbieta Adamowicz

Instytut Rozwoju Gospodarczego, Szkoła Główna Handlowa

Streszczenie: Uczestnicy działalności gospodarczej na wszystkich szczeblach, działający zarówno w sferze realnej jak i regulacyjnej, nieustannie zgłaszają zapotrzebowanie na informacje. Są one niezbędne dla potrzeb procesów decyzyjnych w celu ograniczenia zakresu niepewności i ryzyka. Spośród wszystkich rodzajów informacji, jakie gromadzą podmioty gospodarcze, największe znaczenie mają: prawidłowa diagnoza rzeczywistego przebiegu procesów gospodarczych, trafne prognozy dotyczące przyszłego przebiegu procesów gospodarczych.

Przedmiotem rozważań w referacie będzie analiza użyteczności danych, pozyskiwanych w badaniach koniunktury metodą testu dla podmiotów gospodarczych. W szczególności rozważać będziemy użyteczność tych danych dla podmiotów analizujących przebieg procesów gospodarczych i prowadzących politykę gospodarczą. W celu oceny użyteczności tych danych, podejmiemy próbę odpowiedzi na następujące pytania: czy są one w stanie uzupełnić w sposób znaczący zestaw informacji, istotnych zarówno przy podejmowaniu bieżących decyzji gospodarczych jak i rozstrzyganiu dylematów dotyczących przyszłości, czy są one wiarygodne, czy mają własności prognostyczne?

W rozważaniach wykorzystane zostaną przede wszystkim doświadczenia z badań prowadzonych w IRG SGH. Ich wyniki były prezentowane zarówno w kraju jak i na arenie międzynarodowej. Za szczególnie inspirujące należy uznać dyskusje prowadzone w gronie członków CIRET-u (Centre for International Research on Economic Tendency Survey), organizacji zrzeszającej główne ośrodki zajmujące się badaniami koniunktury na świecie.

Wstęp

Dane pozyskiwane w badaniach koniunktury metodą testu mają charakter jakościowy. Oznacza to, iż nie przedstawiają one twardych faktów, lecz opinie na temat poszczególnych zjawisk czy zmiennych ekonomicznych, formułowane przez bezpośrednich uczestników działalności gospodarczej: przedsiębiorstwa i gospodarstwa domowe. W rozważaniach dotyczących użyteczności tych danych, kluczową sprawą jest zawsze ocena ich wiarygodności. Chcemy wiedzieć, czy możemy wierzyć, że w sposób prawidłowy odzwierciedlają one przebieg zjawisk gospodarczych, do których się odnoszą. Istotną rolę w ocenie użyteczności danych odgrywają także: zestaw informacji, jaki pozyskujemy w badaniach koniunktury oraz czas pozyskiwania danych. Przedmiotem rozważań w niniejszym referacie będzie próba oceny użyteczności danych, pozyskiwanych w badaniach koniunktury. Do oceny wykorzystamy zestaw następujących pytań pomocniczych:

- czy dane pozyskiwane w badaniach koniunktury są wiarygodne,
- czy są one w stanie uzupełnić w sposób znaczący zestaw informacji, istotnych zarówno przy podejmowaniu bieżących decyzji gospodarczych jak i rozstrzyganiu dylematów dotyczących przyszłości?
- czy są pozyskiwane w czasie krótszym niż inne dane,
- czy mogą być wykorzystywane do prognozowania działalności gospodarczej?

Pozytywna odpowiedź na powyższe pytania świadczyć będzie o przydatności danych, pozyskiwanych w badaniach koniunktury do analiz makroekonomicznych i dla potrzeb decyzyjnych uczestników działalności gospodarczej różnych szczebli.

W rozważaniach wykorzystane zostaną przede wszystkim doświadczenia z badań prowadzonych w IRG SGH. Ich wyniki były prezentowane zarówno w kraju jak i na arenie międzynarodowej.

Zmienne obserwowane w badaniach koniunktury

W badaniach koniunktury metodą testu prowadzonych w IRG SGH obserwacji poddaje się ponad 15 zmiennych. Są one dobrane w taki sposób, iż pozwalają na wszechstronne opisanie działalności gospodarczej [por. Adamowicz 2001, Oppenlander 2002]. Dla ekonomistów, reprezentujących różne szkoły myślenia ekono-

micznego, taka wszechstronność opisu zdarzeń gospodarczych może mieć duże znaczenie. W szczególności zbiory danych, gromadzonych w badaniach koniunktury, charakteryzują następujące cechy:

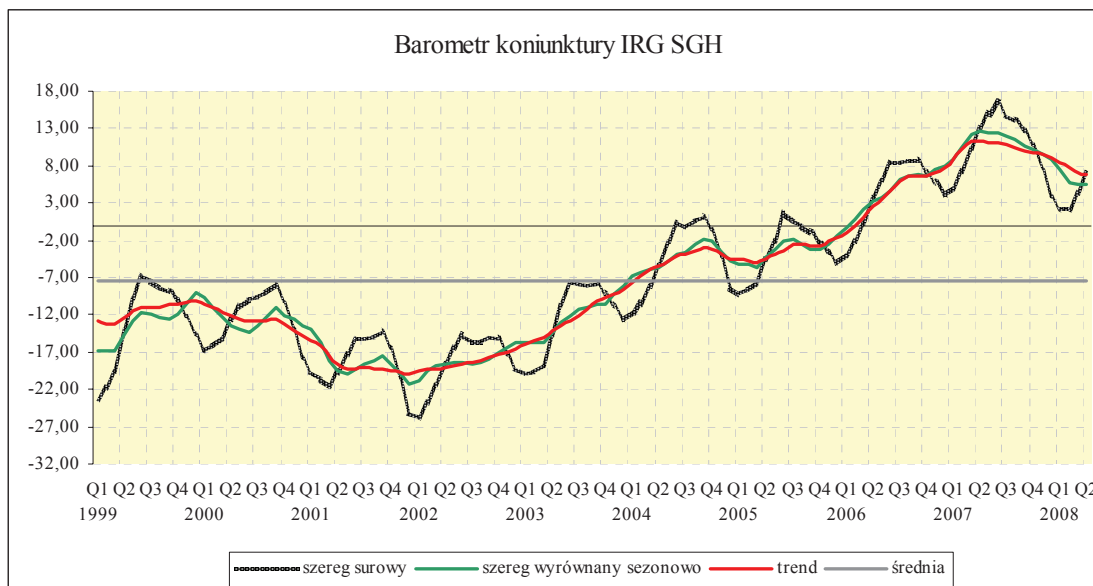
- zawierają zestaw zmiennych, istotnych dla strony popytowej (należą do nich takie zmienne jak zamówienia, zarówno w ujęciu ogółem jak i eksportowe), jak i dla strony podaży (np. produkcja, zatrudnienie),
- zdarzenia przedstawiane są w sposób dualny: dla każdej zmiennej podawana jest ocena tego, co się wydarzyło (stan) i jak i przewidywane kierunki przyszłych zdarzeń (przewidywania),
- dostarczają informacji o zdarzeniach nie rejestrowanych w statystykach ilościowych. Są to przede wszystkim przewidywania dotyczące najbliższej przyszłości, ale także opinie przedsiębiorstw o kondycji danej branży i całej gospodarki, barierach działalności gospodarczej czy zamierzeniach inwestycyjnych,
- pozyskiwane są bardzo szybko, umożliwiając opisywanie działalności gospodarczej w czasie „rzeczywistym”, niemal równocześnie z zachodzącymi zdarzeniami,
- mają ekspercki charakter, co wynika z faktu, iż źródłem informacji są podmioty prowadzące działalność gospodarczą: przedsiębiorstwa, gospodarstwa domowe, gospodarstwa rolne. Dane pozyskiwane są niejako z pierwszej ręki,
- bazują na podstawach mikroekonomicznych,
- są zharmonizowane w skali międzynarodowej, co stwarza możliwość wykorzystywania zarówno samych danych jak i wyników konkretnych analiz do porównań w skali międzynarodowej.

Oczywiście dane te nie są pozbawione wad. Jako największą wadę zwykle wymienia się fakt, iż są to opinie badanych podmiotów, a nie twarde fakty. Ponieważ takie opinie mogą być formułowane pod wpływem chwilowych emocji, może to się przekładać na chwiejność opisu badanego zjawiska. W ponad dwudziestoletniej historii badania koniunktury przez IRG SGH udało się nam wypracować metody eliminacji tych emocji. Nasze doświadczenia wykazują także, iż w przeciwieństwie do innych podmiotów, przedsiębiorcy nie ulegają tak łatwo emocjom chwili – raczej chłodno kalkulują. Dlatego też ich opinie są bardziej stabilne niż innych uczestników badań opinii publicznej. Jakościowy charakter danych, pozyskiwanych w badaniach koniunktury stwarza pewne problemy natury metodologicznej. Mianowicie nie wszystkie metody badawcze, wykorzystywane w analizach danych ilościowych można wykorzystać do analizy danych jakościowych. Czasami konieczne jest zastosowanie nowych narzędzi badawczych. Z drugiej jednak strony dane te pozwalają na rozszerzenie zastosowań wielu narzędzi, w szczególności dotyczy to tradycyjnych narzędzi analiz ekonomicznych i ekonometryczno statystycznych. Interesujące są wyniki wykorzystania metod analizy logitowej, przełącznikowych modeli Markowa, statystycznych metod bayesowskich czy teorii racjonalnych oczekiwań.

Możliwości wykorzystania danych pozyskiwanych w badaniach koniunktury

Wymienione w poprzednim punkcie cechy danych, gromadzonych w badaniach koniunktury wskazują na ich wysoką przydatność do analizowania i prognozowania działalności gospodarczej. Możliwe zastosowania tych danych rozpatrujemy w zależności od horyzontu czasowego, obejmowanego zasięgiem analizy. Z perspektywy krótkiego okresu dane te można wykorzystywać do bieżącego monitorowania działalności gospodarczej. Służą temu badania koniunktury w poszczególnych dziedzinach działalności gospodarczej. Aktualnie IRG SGH obejmuje badaniami koniunktury 6 obszarów: przemysł przetwórczy, budownictwo, handel, rolnictwo, sektor bankowy i gospodarstwa domowe. Wynik każdego badania dostarcza informacji o aktualnym przebiegu działalności gospodarczej, mierzonej za pomocą wskaźnika koniunktury, definiowanego osobno dla poszczególnych dziedzin, kształtowaniu się głównych zmiennych, mających decydujący wpływ na aktywność gospodarczą w danej dziedzinie oraz zamierzeniach przedsiębiorców z danej branży na najbliższą przyszłość. Te informacje dostępne są już w końcu danego miesiąca lub na początku następnego (między 20 a 6 dniem miesiąca) w przypadku badań miesięcznych i na początku II miesiąca w przypadku badań kwartalnych. Są to zatem pierwsze informacje jakie możemy uzyskać o działalności gospodarczej, pojawiające się niejako na bieżąco, jeszcze w trakcie trwania okresu, którego dotyczą (w przypadku badań kwartalnych) lub natychmiast po jego zakończeniu. Wszelkie inne dane, w tym dane statystyczne, pojawiają się znacznie później: z miesięcznym lub kwartalnym opóźnieniem.

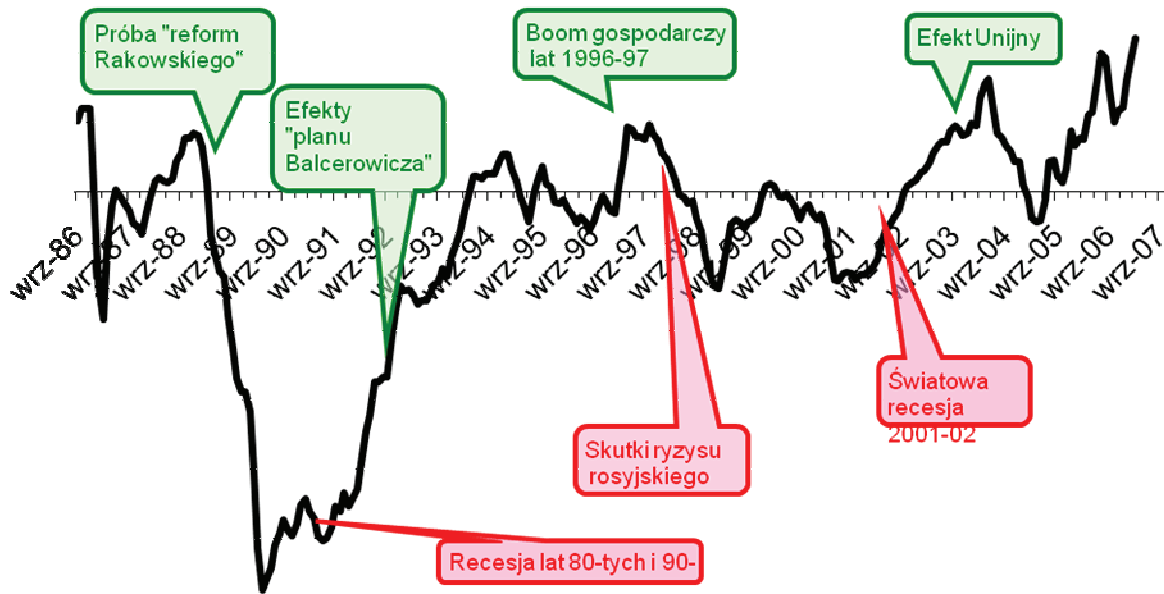
Niezależnie od bieżącego monitorowania przebiegu działalności gospodarczej w poszczególnych obszarach, badania koniunktury pozwalają na opisywanie, przy pomocy syntetycznych wskaźników, tzw. barometrów koniunktury, jak również różnego rodzaju wskaźników złożonych, dynamiki działalności gospodarczej w całej jej złożoności. Wykorzystując dane gromadzone w badaniach własnych i dodatkowo wyniki badania koniunktury w transporcie, prowadzone przez Instytut Transportu Samochodowego w IRG SGH co kwartał obliczany jest barometr działalności gospodarczej, BARIRG, który jest syntetyczną miarą przebiegu działalności gospodarczej w Polsce.



Rys. 1. Barometr koniunktury IRG SGH II kwartał 2008
Źródło: opracowanie J. Klimkowskiej na podstawie danych IRG

Zmienne syntetyczne, a więc wskaźniki i barometry koniunktury, jak i salda odpowiedzi na poszczególne pytania ankiet, wykorzystywanych w badaniach koniunktury, dostarczają informacji o bieżącej dynamice zmian obserwowanych zmiennych (w postaci surowej), cyklicznych wahanach prowadzonej działalności (w postaci oczyszczonej z wahań sezonowych i przypadkowych) i długookresowych tendencjach, ujawniających się w gospodarce (trend). Przeprowadzone badania i analizy [m. i. Adamowicz et al. 2001, 2002, 2006, Dudek et al. 2006] wykazały, iż pozyskiwane w badaniach IRG SGH dane dobrze odwzorowują rzeczywisty przebieg działalności gospodarczej. Badania dotyczące zgodności opisu zdarzeń gospodarczych przez dane jakościowe z opisem przedstawianym przez dane ilościowe pozwalają na stwierdzenie, że spełniają one w sposób zadowalający to zadanie. Najlepsze wyniki uzyskano dla następujących zmiennych: produkcja, zamówienia i zamówienia eksportowe. Przykłady dobrego odwzorowywania działalności gospodarczej przez dane pozyskiwane w badaniach koniunktury, dotyczące danych z badania koniunktury w przemyśle przetwórczym pokazane są na rysunkach 3 i 4. Zmienną referencyjną jest w tym przypadku wartość dodana w przemyśle. Równie zadowalające wyniki uzyskano dla indeksu produkcji przemysłowej [Dudek 2006].

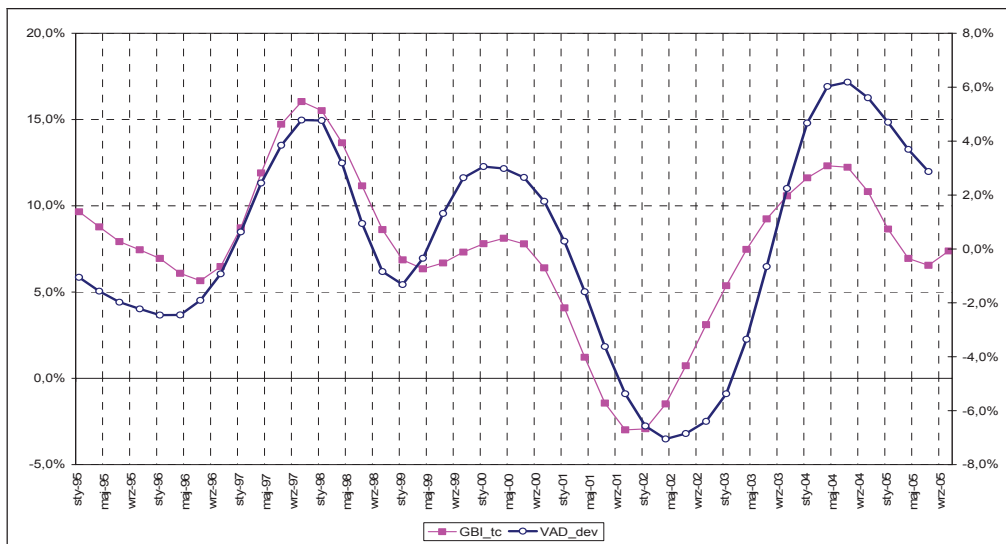
Analizy wykazały także, iż tworzone w oparciu o dane jakościowe lub z ich wykorzystaniem wskaźniki syntetyczne mają własności wyprzedzające. Ich wykorzystanie dla monitorowania przebiegu działalności pozwala zatem na bardzo wczesne zorientowanie się w rzeczywistości gospodarczej i wychwycenie sygnalizowanych zmian jej dynamiki [Dudek 2006, Matkowski 2001, 2004]. Szczególną rolę odgrywają w tej dziedzinie wyprzedzające wskaźniki koniunktury, obliczane przez M. Drozdowicz-Bieć [Drozdowicz-Bieć 2002]. Syntetyczne wskaźniki i barometry koniunktury pozwalają także na śledzenie wzajemnych związków między zachowaniami uczestników działalności gospodarczej, prowadzących działalność w różnych branżach oraz ocenę ich wpływu na zachowania całego systemu gospodarczego. Z perspektywy już ponad dwudziestoletniego okresu badania koniunktury w gospodarce możemy stwierdzić, iż dzięki tym badaniom trafnie diagnozowaliśmy najważniejsze wydarzenia w okresie transformacji naszego systemu gospodarczego. Prezentujemy to na poniższym rysunku.



Rys. 2. Najważniejsze wydarzenia gospodarcze w okresie 1998–2007 odwzorowane w badaniach koniunktury w przemyśle

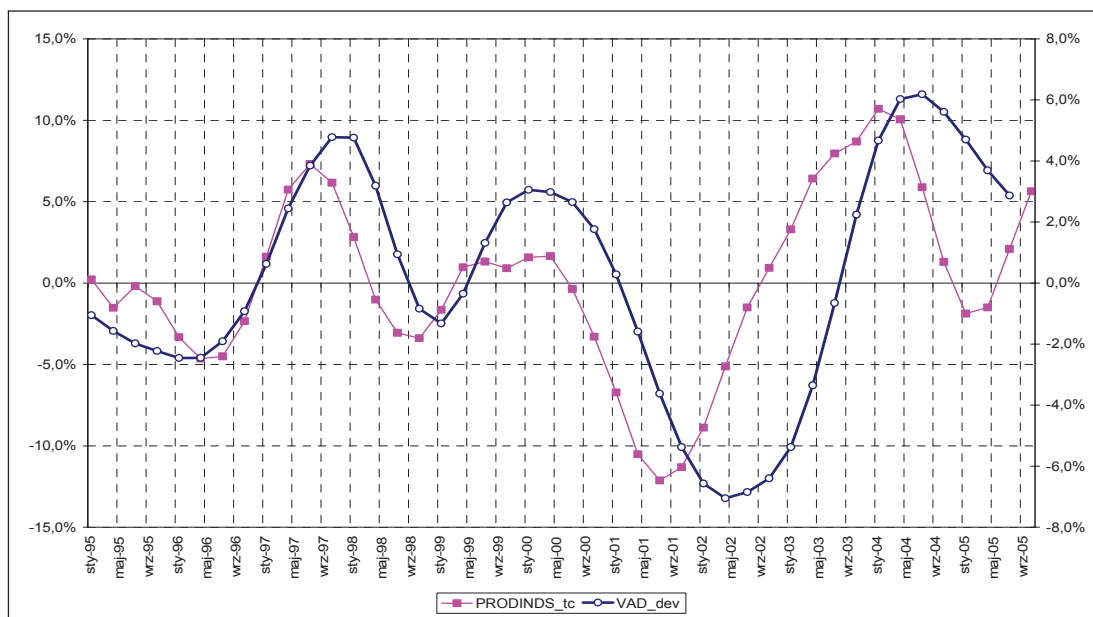
Źródło: opracowanie M. Drozdowicz-Bieć na podstawie danych IRG

Pozyskiwane w badaniach koniunktury dane są bardzo użyteczne do analizowania wahań aktywności gospodarczej. Badania nad morfologią cyklu koniunkturalnego w Polsce [Adamowicz et al. 2006] wykazały dużą przydatność danych jakościowych w odwzorowywaniu przebiegu komponentów cyklicznych. Najlepsze wyniki uzyskano dla danych pozyskiwanych w badaniu koniunktury w przemyśle przetwórczym. Na rysunkach 3 i 4 pokazano odwzorowanie cyklicznego przebiegu wartości dodanej w przemyśle przez wskaźnik koniunktury w przemyśle i saldo poziomu produkcji (stan).



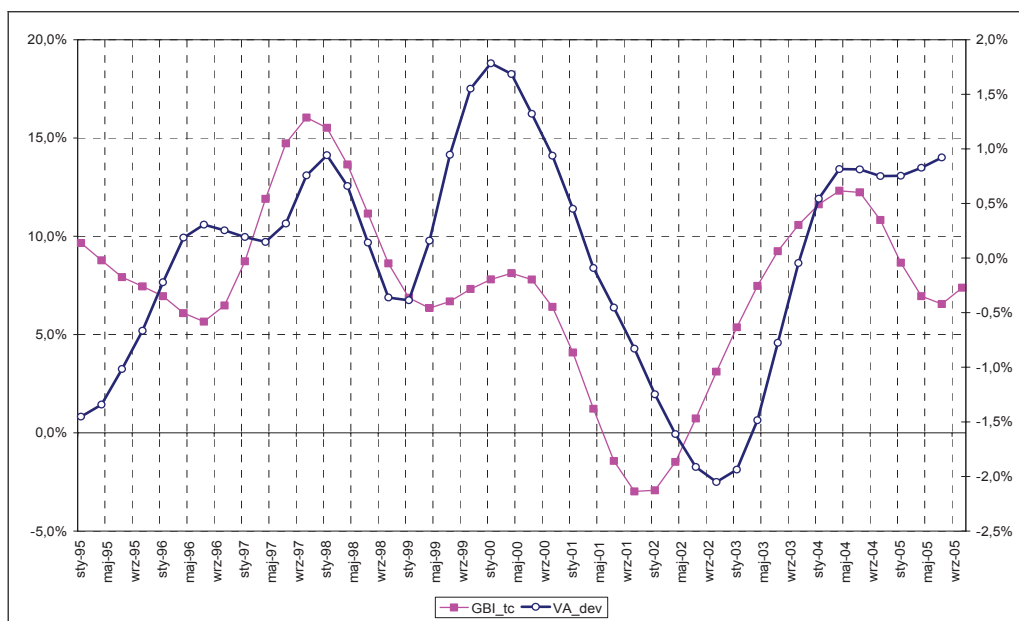
Rys. 3. Ogólny wskaźnik koniunktury w przemyśle na tle wartości dodanej w przemyśle przetwórczym

Źródło: opracowanie K. Walczyka na podstawie danych IRG i Eurostatu



Rys. 4. Saldo bieżących zmian produkcji na tle wartości dodanej w przemyśle przetwórczym
Źródło: opracowanie K. Walczyka na podstawie danych IRG i Eurostatu

Gorzej niż oczekiwaliśmy wskaźnik koniunktury w przemyśle przetwórczym odwzorowuje wahania w całej gospodarce. Jest to zaskakujące, zwłaszcza jeśli uwzględnimy fakt, iż wartość dodana w przemyśle przetwórczym jest ciągle istotnym składnikiem wartości dodanej w całej gospodarce.

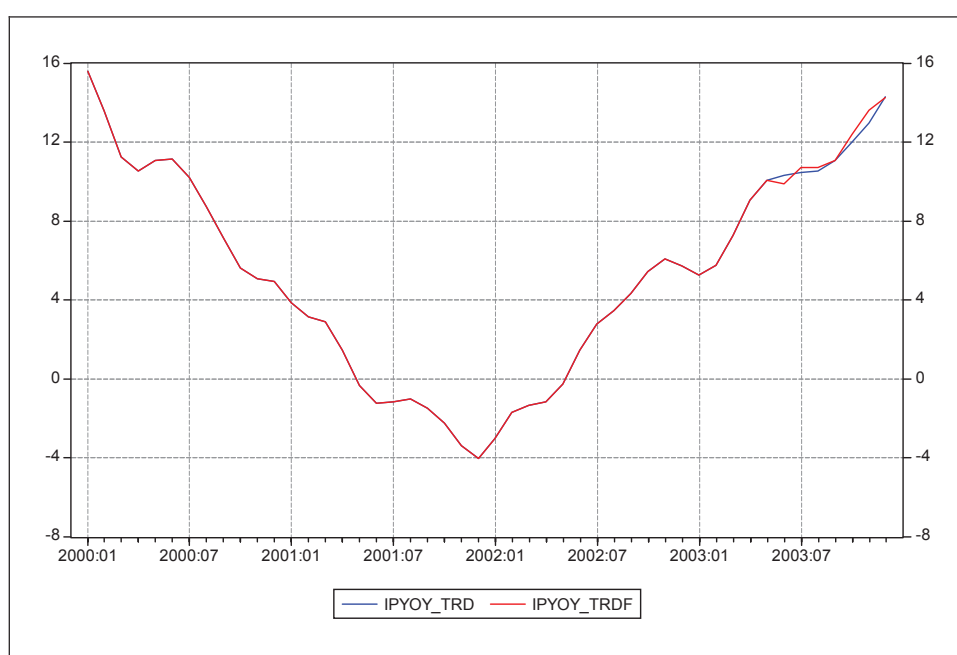


Rys. 5. Ogólny wskaźnik koniunktury w przemyśle na tle wartości dodanej w gospodarce ogółem
Źródło: opracowanie K. Walczyka na podstawie danych IRG i Eurostatu.

Najwyraźniej zmiany struktury gospodarki polskiej prowadzące do zmniejszania udziału przetwórstwa przemysłowego w produkcji gospodarki wpływają także na zmniejszanie udziału wahań koniunktury w przemyśle w wahaniami cyklicznych produktu całej gospodarki. W niektórych fazach cyklu wahania produkcji przemysłowej były wyraźnie łagodzone przez cykliczne zmiany w innych sektorach gospodarki.

Pozyskiwane w badaniach koniunktury dane nie tylko dobrze odzwierciedlały dynamikę aktywności gospodarczej ale również przewidywały kierunki jej zmian. Większość wskaźników stosunkowo dobrze sygnalizowała punkty zwrotne z niewielkim wyprzedzeniem, sięgającym od jednego do trzech kwartałów [por. Adamowicz et al. 2006].

Wydłużenie horyzontu czasowego pozwala na wykorzystanie danych, gromadzonych w badaniach koniunktury do formułowania prognoz krótkookresowych. Większość wskaźników syntetycznych, budowanych z wykorzystaniem danych gromadzonych w badaniach IRG SGH ma charakter wyprzedzający [Matkowski 2001, 2004]. Dodatkowo dane te można wykorzystać do budowy prognoz krótkookresowych. Badania prowadzone przez S. Dudka zaowocowały opracowaniem narzędzi krótkookresowego prognozowania indeksu produkcji przemysłowej [Dudek 2006]. Wykorzystując znajomość zależności i związków między poszczególnymi zmiennymi, obserwowanymi w badaniach koniunktury, można prognozować ich przebieg. Na rysunku 6 przedstawiona jest próba prognozowania indeksu produkcji przemysłowej na podstawie portfela zamówień.



Rys. 6. Przewidywania indeksu produkcji przemysłowej na podstawie portfela zamówień
Źródło: opracowanie K. Walczyka na podstawie danych IRG

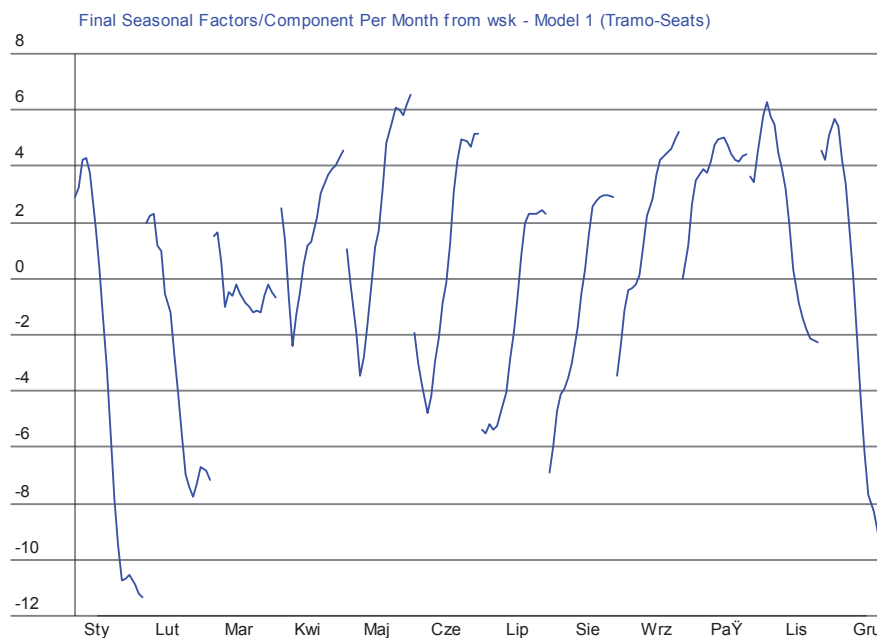
Prowadzone badania i analizy dotyczące wiarygodności danych, pozyskiwanych w badaniach koniunktury IRG SGH wykazały, iż dane te opisują przebieg działalności gospodarczej w podobny sposób jak dane ilościowe. Są zatem wiarygodne. Mogą być zatem wykorzystywane do bieżącego monitorowania przebiegu działalności gospodarczej i prognozowania kierunków zmian aktywności gospodarczej. Można je także wykorzystywać do prognozowania przyszłych wartości zmiennych makroekonomicznych. W badaniach własności prognostycznych tych danych zaobserwowano pewną poprawę wskazań po 1995 roku. Można to tłumaczyć postępującym dostosowywaniem podmiotów gospodarczych do działania w zmieniających się warunkach jak i postępującą racjonalizacją ich oczekiwań.

Wartość informacyjna danych jakościowych

Dla użyteczności danych jakościowych równie istotne znaczenie jak ich wiarygodność ma zestaw informacji, jaki możemy dzięki nim uzyskać. Odpowiedź na pytanie czy dane te w sposób znaczący uzupełniają zestaw informacji, możliwych do pozyskania z innych źródeł jest jednoznacznie pozytywna. Świadczy o tym przede wszystkim ilość zmiennych, obserwowanych w badaniach koniunktury i wskaźników syntetycznych, tworzonych zarówno na podstawie danych jakościowych jak i w połączeniu

z danymi ilościowymi. Wydaje się, że dla użytkowników tych danych zarówno przy podejmowaniu bieżących decyzji gospodarczych jak i rozstrzygnięciu dylematów dotyczących przyszłości duże znaczenie ma możliwość wykorzystania informacji niedostępnych z innych źródeł. Takimi są wszelkie informacje o zamierzeniach przedsiębiorców na najbliższą przyszłość. IRG SGH gromadzi te informacje w odniesieniu do głównych pytań testu. Cennym uzupełnieniem dla odbiorców są także informacje dotyczące wykorzystania mocy produkcyjnych, konkurencyjności polskich towarów na rynkach zagranicznych, barierach działalności gospodarczej, zamierzeniach inwestycyjnych czy opinie o kondycji całej gospodarki. Dzięki tym informacjom nie tylko poszerzamy zasoby informacji o zachowaniach uczestników działalności gospodarczej. Możemy także śledzić zmiany zachodzące w tych zachowaniach [Adamowicz, Podgórska 1999]. Poniżej przedstawimy dwa przykłady takich zmian.

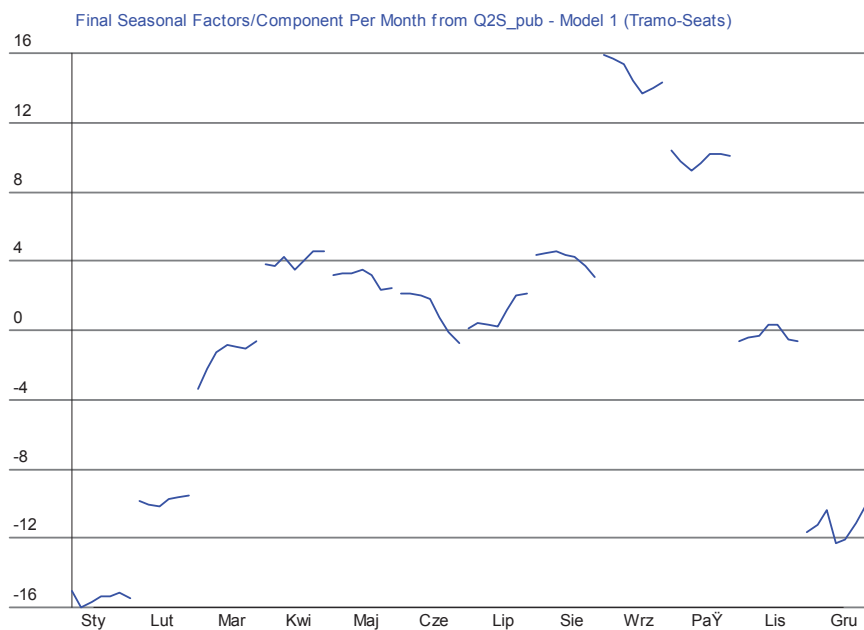
Jednym z przykładów są zmiany wzorców sezonowości, jakie miały miejsce w początkowym okresie transformacji. Polegały one na przesunięciu szczytu aktywności z wymuszanego realizacją planów końca roku do okresów odpowiadających zwiększonym zamówieniom. Najszybciej odnotowaliśmy je w przetwórstwie przemysłowym. Rysunek 7. pokazuje zmiany wzorców sezonowości na przykładzie przesunięć najwyższych wartości wskaźnika koniunktury.



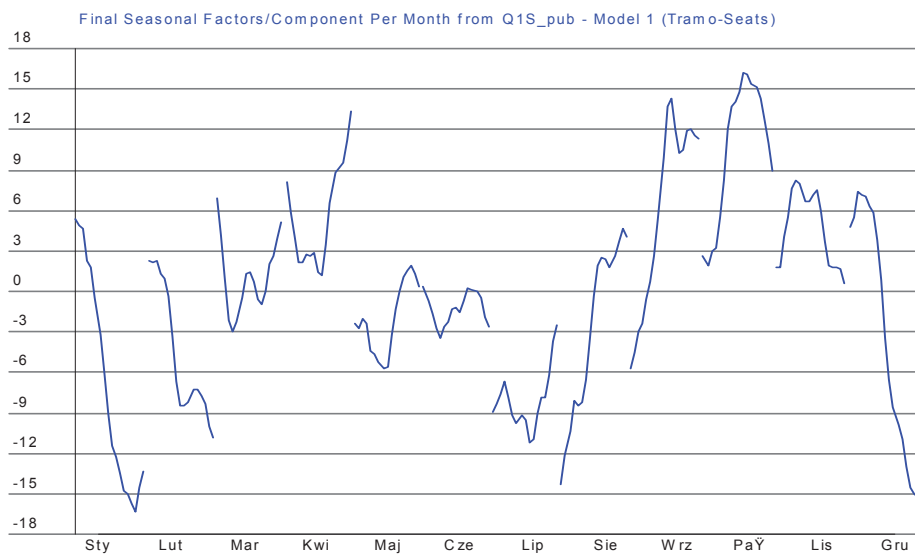
Rys. 7. Zmiany maksymalnych wartości wskaźnika koniunktury w przemyśle przetwórczym
Źródło: opracowanie D. Żochowskiego na podstawie danych IRG

W warunkach gospodarki planowej przypadały one na końcowe miesiące roku, kiedy to wszystkie przedsiębiorstwa dążyły do wykonania zadań planowych, co miało to istotne znaczenie dla przyszłego zaopatrzenie w surowce i materiały oraz środki finansowe. Po zmianie systemu gospodarczego najwyższą aktywność obserwujemy w II kwartale, co odpowiada największej fali zamówień.

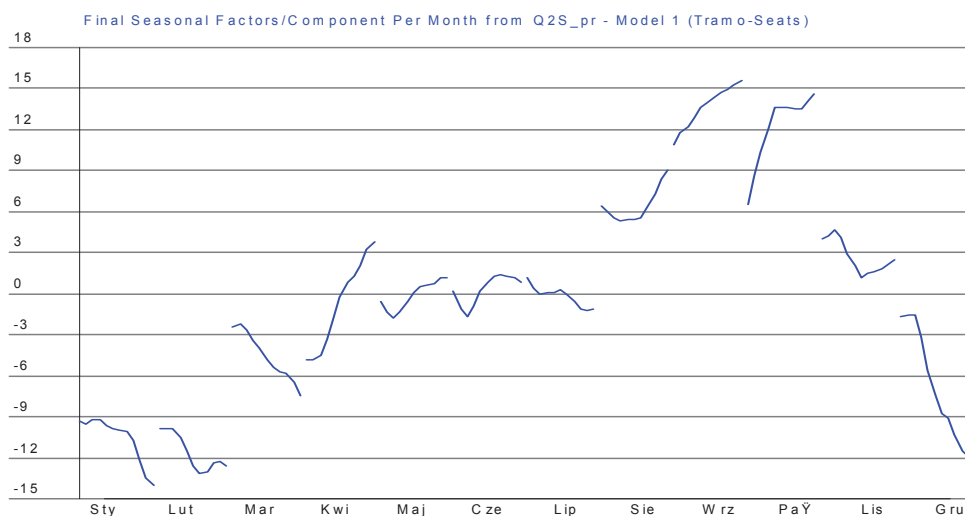
Zmiany wzorców sezonowości przebiegały z różną intensywnością w zależności od formy własności przedsiębiorstw. Znacznie szybciej do zmienionych warunków gospodarowania dostosowywały się firmy prywatne. Tempo tych dostosowań pokazują zmiany maksymalnych wartości sald portfela zamówień i poziomu produkcji, przedstawione na rysunkach od 8 do 11.



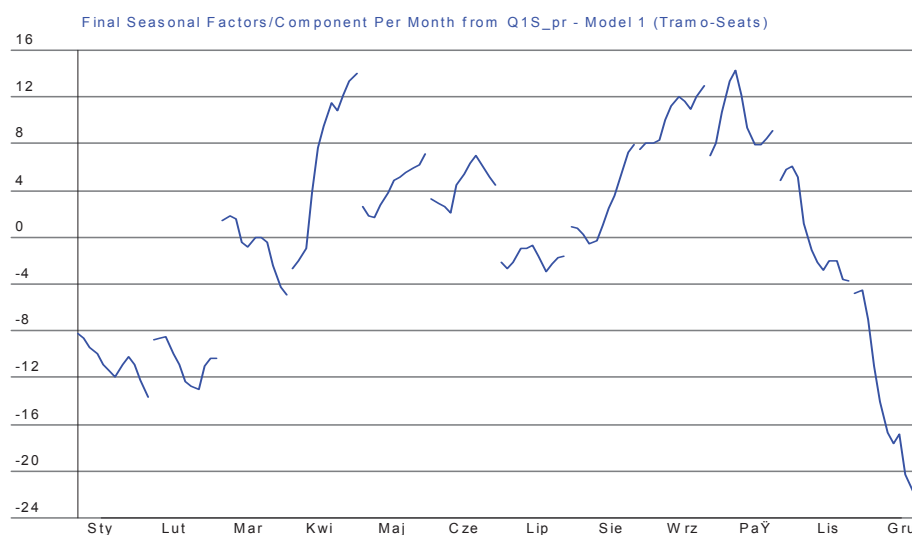
Rys. 8. Maksymalne wartości salda portfela zamówień w sektorze publicznym
Źródło: opracowanie D. Żochowskiego na podstawie danych IRG



Rys. 9. Maksymalne wartości salda poziomu produkcji w sektorze publicznym
Źródło: opracowanie D. Żochowskiego na podstawie danych IRG



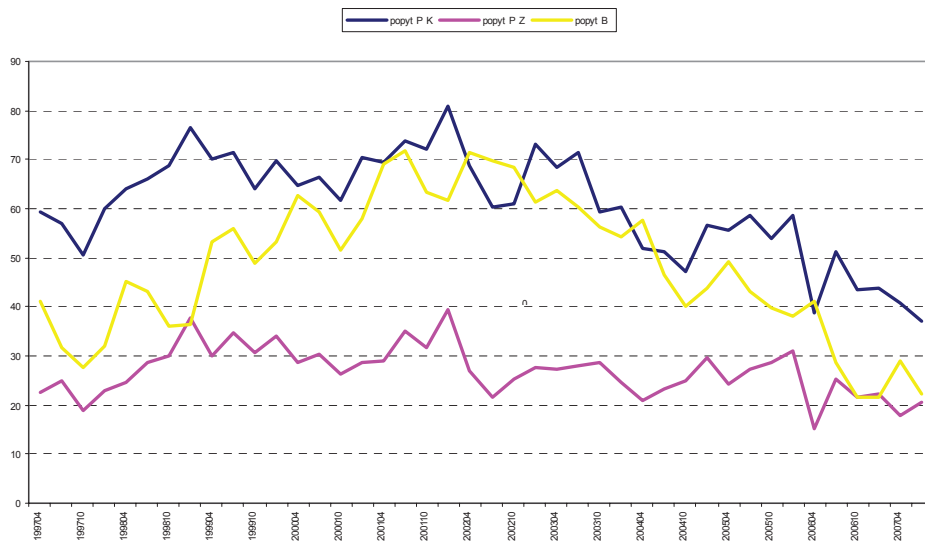
Rys. 10. Maksymalne wartości salda portfela zamówień w sektorze prywatnym
Źródło: opracowanie D. Żochowskiego na podstawie danych IRG



Rys. 11. Maksymalne wartości salda poziomu produkcji w sektorze prywatnym
Źródło: opracowanie D. Żochowskiego na podstawie danych IRG

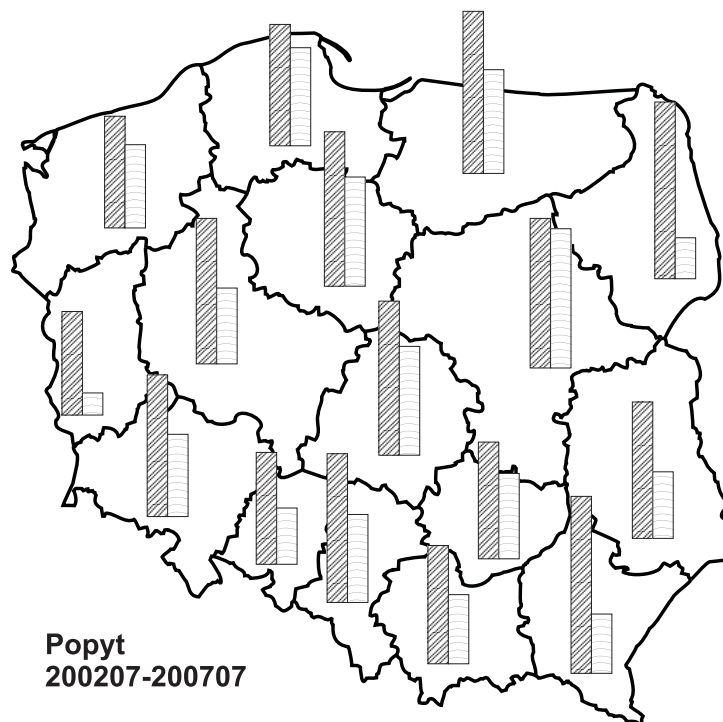
Na zmiany tempa reakcji na nowe warunki gospodarowania bez wątpienia miały wpływ doświadczenia z przeszłości. Były one udziałem zwłaszcza przedsiębiorstw publicznych. Przedsiębiorstwa prywatne w przetwórstwie przemysłowym pojawiły się w zasadzie dopiero po zmianie systemu gospodarczego, czy to jako firmy nowopowstałe (większość, ale były to przedsiębiorstwa najmniejsze) czy też w wyniku przekształceń własnościowych.

Badając opinie przedsiębiorców o ograniczeniach, napotykanym w prowadzonej działalności gospodarczej mogliśmy z kolei stwierdzić zmiany w uciążliwości tych barier [Adamowicz, Józwiak 2007]. Zmiany te świadczą o stosunkowo szybkim dostosowaniu się przedsiębiorców polskich do zmieniających się warunków gospodarowania. W szczególności odnotowaliśmy fakt narastania uciążliwości barier kreowanych przez państwo przy równoczesnym spadku uciążliwości barier o charakterze rynkowym. Najlepszym przykładem bariery rynkowej jest bariera popytowa. Przedsiębiorstwa zawsze wolały spotykać się z rosnącym popytem, jego wielkość zwykle jest określana jako niezadowolająca. Na rysunku 12. możemy zaobserwować, uciążliwość tej bariery maleje po roku 2000. Pozwala to na stwierdzenie, iż przedsiębiorstwa uczą się nowych zachowań w miarę umacniania się ładu rynkowego w naszej gospodarce.



Rys. 12. Uciążliwość bariery popytowej w opiniach przedsiębiorstw w latach 1997–2007.

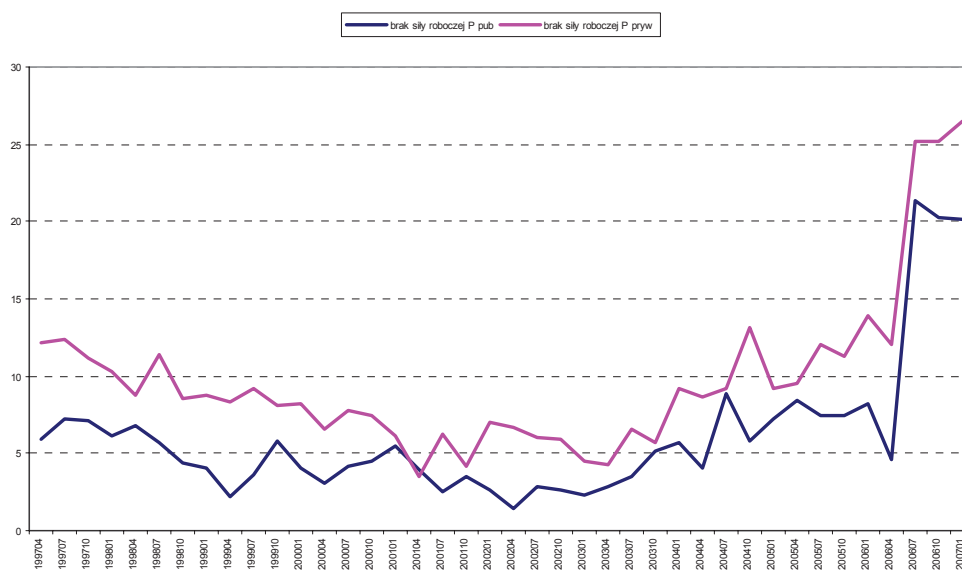
Na rysunku 13. przedstawiono zróżnicowanie opinii dotyczących bariery popytowej przedsiębiorstw przemysłowych w układzie regionalnym według województw. Do prezentacji wybrano dwa okresy: lipiec 2002 i lipiec 2007 roku. Są to odpowiednio okresy, w których bariera popytowa była najsilniej i najslabiej odczuwalna. Widoczne jest zjawisko powiększającego się zróżnicowania uciążliwości bariery popytowej w przekroju regionalnym, które nie pokrywa się z różnicami w zamożności poszczególnych województw, mierzonych wielkością PKB na głowę mieszkańca. W regionach najbiedniejszych, takich jak lubelskie, podkarpackie czy warmińsko-mazurskie wraz z poprawą koniunktury ograniczenie ze strony popytu jest odczuwane słabiej. W województwach najbogatszych, takich jak mazowieckie czy śląskie jej uciążliwość w roku 2007 niewiele się zmniejszyła w stosunku do roku 2002, który był okresem gorszej koniunktury.



Rys. 13. Zróżnicowanie uciążliwości bariery popytowej w opinii przedsiębiorstw przemysłowych w okresach lepszej (lipiec 2007) i gorszej (lipiec 2002) koniunktury w przekroju według województw

Można to zjawisko wytłumaczyć faktem szybszego wzrostu wydatków konsumpcyjnych w budżetach rodzin o najniższych dochodach, przekładającego się na wzrost popytu. Wydaje się jednak, iż wymaga to pogłębionej analizy, która będzie przedmiotem odrębnych opracowań.

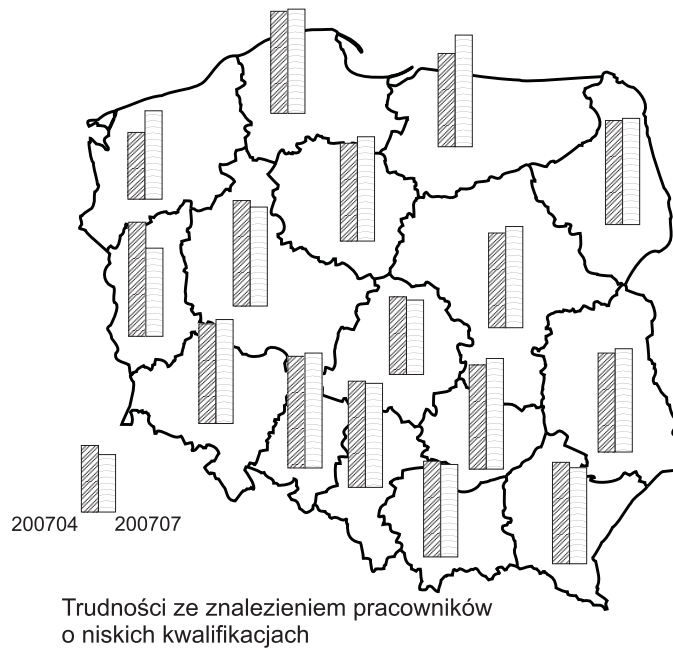
Innym przykładem bariery rynkowej jest bariera zatrudnienia. Badania koniunktury z wyprzedzeniem sygnalizowały narastanie problemów ze znalezieniem początkowo wykwalifikowanej a później także niewykwalifikowanej siły roboczej. Pierwsze sygnały o zwiększających się problemach ze znalezieniem wykwalifikowanej siły roboczej pojawiły się w roku 2004. Od tego momentu odsetek przedsiębiorstw odczuwających to ograniczenie zwiększał się bardzo szybko. Opinie przedsiębiorstw przemysłowych, dotyczące braku wykwalifikowanej siły roboczej przedstawione są na rys. 14.



Rys. 14. Opinie przedsiębiorstw przemysłowych o braku wykwalifikowanej siły roboczej

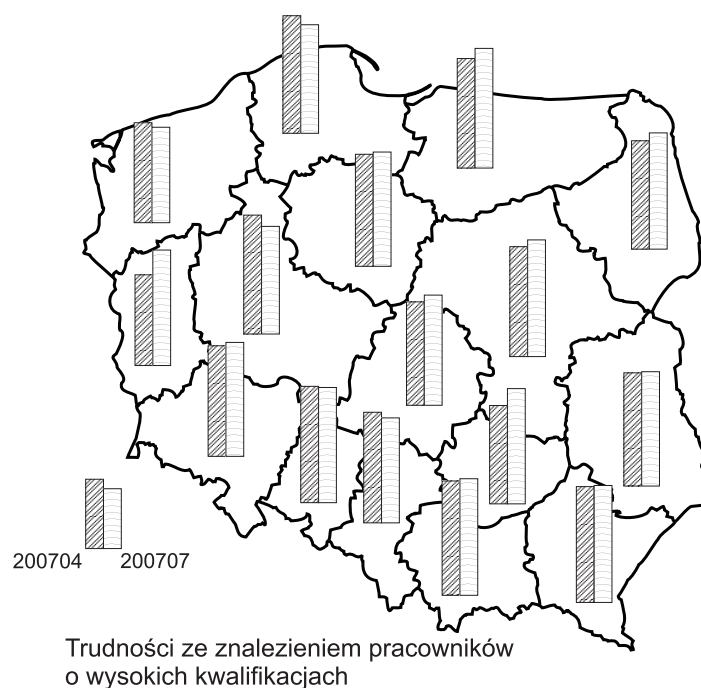
Skokowy wzrost uciążliwości tej bariery miał miejsce wiosną 2006 roku. Uwzględniając fakt, iż większość (ponad 70 procent pracujących według GUS) znajduje zatrudnienie w sektorze prywatnym, opinie te są przedstawione w rozbiciu na sektory własnościowe. Nie można jednak stwierdzić istotnych rozbieżności opinii na temat braku siły roboczej w zależności od formy własności przedsiębiorstwa. Pewne różnice pojawiły się w ostatnim okresie. Odsetek przedsiębiorstw prywatnych silnie odczuwających tę barierę jest większy niż w przypadku publicznych. Różnica przekracza 5 punktów procentowych. W obu grupach odsetek przedsiębiorstw odczuwających tę barierę przekracza 20 procent. Jest to zatem silne ograniczenie i należy oczekiwać zwiększania się jego uciążliwości. Narastaniu bariery braku siły roboczej towarzyszy utrzymujące się stosunkowo duże bezrobocie.

Jeszcze silniej niż przedsiębiorstwa przemysłowe problemy ze znalezieniem pracowników odczuwają firmy budowlane. W ich przypadku problem dotyczy zarówno pracowników o wysokich jak i niskich kwalifikacjach. W 2007 roku ograniczenie to odczuwało prawie 80 procent badanych przedsiębiorstw. Prezentacja tych problemów w przekroju regionalnym przedstawiona jest na rysunkach 15 i 16. Rysunek 16 prezentuje narastające problemy przedsiębiorstw ze znalezieniem pracowników wysoko wykwalifikowanych II i III kwartale 2007 roku, rysunek 15. prezentuje te problemy w odniesieniu do pracowników o niskich kwalifikacjach. Ze względu na działanie czynników sezonowych II i III kwartał są okresem zwiększonej aktywności w budownictwie, zatem i problemy ze znalezieniem pracowników są bardziej dotkliwe. Widzimy także, że trudności ze znalezieniem pracowników o niskich kwalifikacjach mają także firmy działające w regionach tradycyjnie wysokiego bezrobocia.



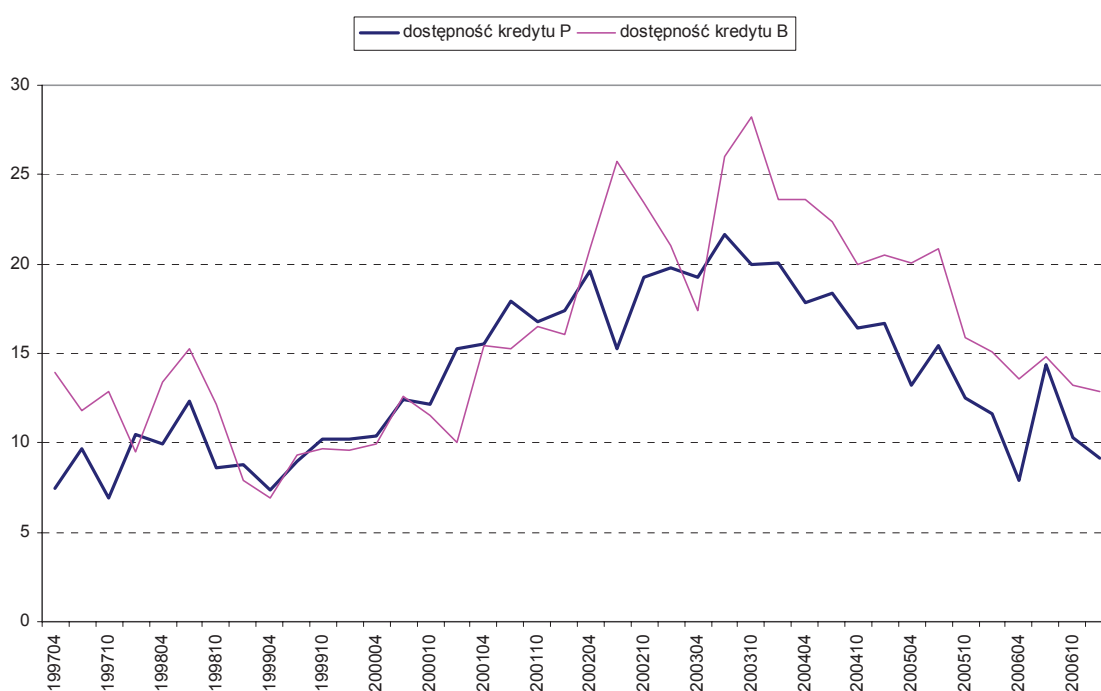
Rys. 15. Odsetek firm budowlanych mających trudności ze znalezieniem pracowników o niskich kwalifikacjach w II i III kwartale 2007.

Trudności przedsiębiorstw, które prowadzą działalność gospodarczą w regionach o najwyższych wskaźnikach bezrobocia powinny stać się przyczyną refleksji nad efektywnością polityki socjalnej rządu. Nie powinniśmy bowiem zostawiać bez wyjaśnienia sytuacji, w której z jednej strony występują duże problemy z utrzymującym się wysokim bezrobociem, z drugiej zaś w tym samym czasie i w tym samym miejscu narastają problemy z zatrudnieniem. Zjawisko to wskazuje także na niską mobilność wewnętrzną tej grupy pracowników. Ta konstatacja jest zaskakująca w świetle dużej mobilności międzynarodowej Polaków. Fakt, iż wyjeżdżają przede wszystkim pracownicy o wyższych kwalifikacjach nie do końca wyjaśnia to zróżnicowanie. Wyjazdy za granicę wiążą się bowiem ze znacznie większymi wyzwaniami i większym ryzykiem niż przemieszczanie się wewnątrz kraju.



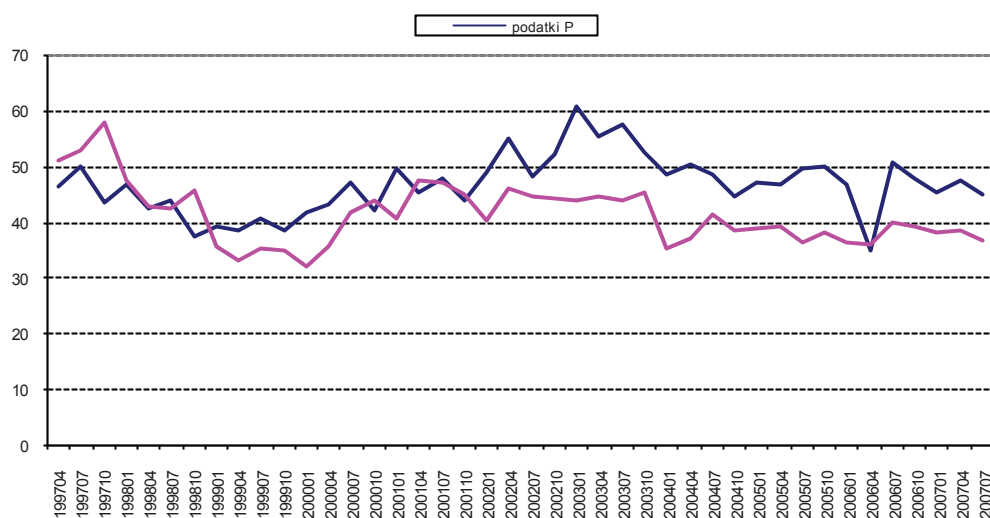
Rys. 16. Odsetek firm budowlanych mających trudności ze znalezieniem pracowników o wysokich kwalifikacjach w II i III kwartale 2007.

Istotny wpływ na warunki prowadzenia działalności gospodarczej mają warunki finansowe, w tym możliwości pozyskiwania kredytów. Opinie przedsiębiorstw o dostępności kredytów i warunkach ich pozyskiwania także zmieniały się w analizowanym okresie. Zmiany te kształtowały się odmiennie niż w przypadku bariery popytowej czy bariery zatrudnienia. Trudności w dostępności kredytów narastały, w opinii przedsiębiorstw do roku 2003, po czym nastąpiło zmniejszenie ich uciążliwości. Najwyższy odsetek przedsiębiorstw odczuwających tę barierę – 27 procent w szczytowym momencie, czyli w III kwartale 2003 roku – występował w grupie przedsiębiorstw budowlanych. Wśród przedsiębiorstw przemysłowych odsetek ten wynosił 22 procent. Fakt, iż narastaniu tych trudności towarzyszył wzrost długu publicznego wskazuje na występowanie w naszym kraju zjawiska wypychania. Zmian opinii przedsiębiorstw należy także upatrywać w oddziaływaniu czynników o charakterze instytucjonalnym, w tym zmianach regulacji kredytowych. Opinie przedsiębiorstw przemysłowych i budowlanych dotyczące możliwości pozyskiwania kredytów przedstawione są na rysunku 17.



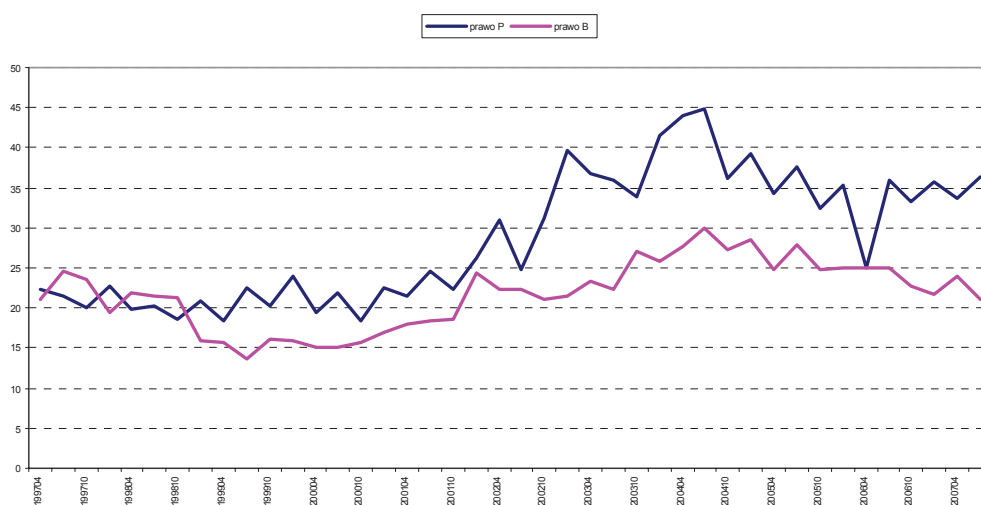
Rys. 17. Dostępność kredytu w opinii firm przemysłowych i budowlanych

Inaczej kształtują się opinie przedsiębiorstw na temat uciążliwości barier kreowanych przez państwo. To państwo bowiem tworzy system prawny i podatkowy. Opinie przedsiębiorstw o rezultatach tej działalności są coraz bardziej krytyczne. W obu przypadkach wyraźnie zauważalny jest wzrost uciążliwości dla przedsiębiorstw tworzonych przez państwo regulacji. Jedną z najsilniej odczuwanych, zarówno przez firmy przemysłowe jak i budowlane, barier, są ograniczenie podatkowe. Okres największej uciążliwości bariery podatkowej przypada na początek roku 2003. Odsetek przedsiębiorstw wskazujących na podatki jako ograniczenie działalności gospodarczej każe umieścić ją w czołówce rankingu, na równi z barierą popytową. Obecnie jest to miejsce pierwsze, albowiem odsetek przedsiębiorstw odczuwających tę barierę jest o prawie dziesięć procent wyższy niż w przypadku bariery popytowej. Te opinie potwierdzają fakt, iż prowadzona przez rząd polityka cechuje się nadmiernym fiskalizmem. Należy także podkreślić, iż wbrew postulatam teorii ekonomicznej polityka ta ma charakter procykliczny: obciążenia podatkowe (podobnie jak wydatki rządowe) rosły w okresie bardzo dobrej i szybko poprawiającej się koniunktury. Fakt ten należy uznać za zagrożenie dla deklarowanej przez nowy rząd zmiany polityki podatkowej. W okresie słabnącej koniunktury wszelkie zmiany w tej dziedzinie będą bardzo trudne do przeprowadzenia i mogą wywoływać negatywne emocje. Kształtowanie się bariery podatkowej przedstawione jest na rysunku 18.



Rys. 18. Uciążliwość bariery podatkowej w opinii przedsiębiorstw przemysłowych i budowlanych.

Bardzo krytyczne są także opinie przedsiębiorstw o systemie prawnym. Na niestabilność przepisów prawnych jako ograniczenie działalności gospodarczej wskazuje obecnie ponad 30 procent badanej populacji przedsiębiorstw w przemyśle i ponad 20 procent w budownictwie. Kształtowanie się tych opinii przedstawione jest na rysunku 19.



Rys. 19. Niestabilność przepisów prawnych w opinii przedsiębiorstw przemysłowych i budowlanych.

Najsłabiej to ograniczenie było odczuwane przez przedsiębiorstwa w końcu lat dziewięćdziesiątych. Od tego czasu jego uciążliwość narasta. Obecnie obserwujemy pewne zahamowanie wzrostu uciążliwości tej bariery przy dość wysokim odsetku przedsiębiorstw wskazujących na nią. W warunkach słabnącej koniunktury informacje o barierach i ograniczeniach działalności gospodarczej, napotykanym przez firmy są szansą dla rządu. Zmiana najbardziej dotkliwych regulacji może bowiem mieć działanie prorozwojowe i przeciwdziałać spowolnieniu aktywności gospodarczej.

Prowadzone analizy i badania, zarówno w IRG SGH jak i w innych ośrodkach badania koniunktury, zarówno w Polsce jak i na świecie, potwierdzają iż dane gromadzone w badaniach koniunktury znacząco poszerzają naszą wiedzę o przebiegu działalności gospodarczej. Stanowią cenne uzupełnienie danych jakościowych, dostarczają także dodatkowych informacji o zamierzeniach przedsiębiorców i zmianach wzorców ich zachowań.

Użyteczność danych jakościowych dla polityki gospodarczej

O sukcesie w uprawianiu polityki makroekonomicznej decyduje jej efektywność. Ta zaś w znacznym stopniu zależy od trafności diagnozy, co do rzeczywistego stanu gospodarki. Wydaje się, iż w diagnozowaniu stanu gospodarki najważniejsze są:

- określenie odchylenia poziomu realnego produktu od produktu równowagi,
- stabilizacja produktu na poziomie pełnego zatrudnienia.

Wśród danych, pozyskiwanych w badaniach koniunktury są informacje które mogą być pomocne przy szacowaniu luki produktu. W szczególności są to informacje o stopniu wykorzystania mocy produkcyjnych, niedostępne w zbiorach danych ilościowych dla gospodarki polskiej.

Dane, gromadzone w badaniach koniunktury odzwierciedlają przede wszystkim dynamikę zmian działalności gospodarczej. Mogą zatem być użyteczne w polityce stabilizacyjnej.

Badania koniunktury, prowadzone w skali ogólnopolskiej i regionalnej, dostarczają informacji na temat regionalnego zróżnicowania aktywności gospodarczej. Pokazują także zróżnicowanie reakcji uczestników działalności gospodarczej, wynikające z lokalnych uwarunkowań. Obserwować je można zwłaszcza na rynku pracy [Bielak, Kowerski 2008, Pater, Wargacki 2008], ale nie tylko. Zachowania te z kolei wpływają na kształtowanie się zarówno zmiennych makroekonomicznych jak i zależności między nimi. Znajomość tej specyfiki może przyczynić się do zwiększenia efektywności polityki regionalnej.

Można podać więcej przykładów wykorzystania danych, pozyskiwanych w badaniach koniunktury. Wydaje się jednak, iż dla polityków, prowadzących politykę gospodarczą w skali kraju jak i na szczeblu regionalnym największe znaczenie mają:

- szybkość pozyskiwania informacji,
- wiarygodność opisu zdarzeń gospodarczych,
- wielostronność tego opisu,
- możliwość poznania zamierzeń uczestników działalności gospodarczej na najbliższą przyszłość.

Cechy te powodują, iż w badaniach koniunktury możemy niejako na bieżąco monitorować przebieg działalności gospodarczej a obraz wynikający z tego monitoringu jest wyjątkowo bogaty w warstwie informacyjnej. Dlatego wykorzystanie danych, pozyskiwanych w badaniach koniunktury pozwala na wyeliminowanie co najmniej dwóch z czterech sygnalizowanych przez Friedmana opóźnień polityki makroekonomicznej: opóźnienia diagnozy i opóźnienia decyzji [Friedman 1953]. Dodatkowo, ze względu na wielostronność opisu zdarzeń gospodarczych dane te mogą być wykorzystywane przez polityków różnych opcji i orientacji, hołdujących różnym nurtom współczesnej ekonomii

Dlatego sądzimy, iż dane jakościowe mogą być bardzo użyteczne w polityce makroekonomicznej, przyczyniając się do zwiększenia jej efektywności.

Podsumowanie

Prowadzone badania nad wiarygodnością i użytecznością danych, pozyskiwanych w badaniach koniunktury wskazują na ich wysoką przydatność zarówno do monitorowania bieżącego przebiegu działalności gospodarczej jak i formułowania krótkookresowych prognoz dotyczących przyszłych zdarzeń. Stanowią zatem cenne źródło informacji o gospodarce. Wielostronność opisu zdarzeń gospodarczych, jaki powstaje dzięki tym badaniom powoduje, że stanowią one wartościowe dopełnienie informacji, pozyskiwanych w inny sposób. Dane jakościowe są zwłaszcza cennym uzupełnieniem danych ilościowych. Do głównych zalet danych jakościowych należy zaliczyć:

- szybkość pozyskiwania,
- wielostronność opisu zdarzeń gospodarczych,
- możliwość śledzenia wzajemnych związków między zachowaniami poszczególnych uczestników działalności gospodarczej,
- możliwość diagnozowania zmian, zachodzących w zachowaniach tych uczestników.

Dane te są szczególnie przydatne do analizowania przebiegu działalności gospodarczej w konwencji cyklu koniunkturalnego. Zwłaszcza możliwość prognozowania kierunków zmian dynamiki gospodarczej wydaje się cenną cechą tych danych, zwiększającą ich przydatność dla szerokiego grona użytkowników.

Na bazie danych, pozyskiwanych w badaniach koniunktury, można konstruować wiele wskaźników syntetycznych, w tym barometrów koniunktury, wzbogacających opis zdarzeń gospodarczych.

Pozyskiwane w badaniach koniunktury dane pozwalają także na poznanie przebiegu procesu dostosowań uczestników działalności gospodarczej do zmieniających się warunków otoczenia, co pozwala na określanie wzorców ich zachowań.

Ponieważ badania koniunktury prowadzone są przy pomocy zharmonizowanych narzędzi badawczych, pozyskiwane w nich dane mogą być wykorzystywane do analiz porównawczych, zarówno w skali regionalnej jak i międzynarodowej.

Wymienione cechy danych, pozyskiwanych w badaniach koniunktury wskazują na ich wysoką użyteczność. Dlatego do grona osób zainteresowanych wynikami tych badań należy zaliczyć wszystkich zaangażowanych w działalność gospodarczą, tak przedsiębiorców, analityków jak i polityków gospodarczych, badaczy zainteresowanych zarówno teorią jak i praktyką działalności gospodarczej. Wykorzystanie danych pozyskiwanych w badaniach koniunktury w polityce gospodarczej może przyczynić się do zwiększenia jej efektywności.

Literatura

- ADAMOWICZ E., PODGÓRSKA M. 1999: *Changes in Polish Firm Behaviour during 1986–1996*. CIRET Studien Munich.
- ADAMOWICZ E. 2001: *Użyteczność badań koniunktury dla polityki ekonomicznej*. [w:] Analiza tendencji rozwojowych w polskiej gospodarce na podstawie testu koniunktury. „Metody i Wyniki, Prace i Materiały IRG SGH”, nr 70.
- ADAMOWICZ E., GUTKOWSKA A., KOTŁOWSKI J., WALCZYK K. 2002: *Survey Data as a Source of Information for Policy recommendations: A Logit Analysis*. Economic Surveys and Data Analysis, CIRET Conference Proceedings. OECD.
- ADAMOWICZ E., BIAŁOWOLSKI P., DUDEK S., WALCZYK K., ŻOCHOWSKI D. 2006: *Zmiany aktywności gospodarczej w Polsce w latach 1995–2005*, Warszawa, (praca niepublikowana).
- Badania gospodarki polskiej: stan bieżący i perspektywy rozwoju*. „Prace i Materiały IRG SGH”, nr 72, 2002.
- BIELAK J., KOWERSKI M. 2008: *Próba określenia czynników determinujących oceny regionalnego rynku pracy przez mieszkańców województwa lubelskiego*. [w:] „Prace i Materiały IRG SGH”, nr 80.
- Diagnozy i prognozy stanu gospodarki w świetle badań koniunktury*. „Prace i Materiały IRG SGH”, nr 73, 2002.
- FRIEDMAN M. 1953: *Essays in Positive Economics*. The University of Chicago Press.
- DROZDOWICZ-BIEĆ M. 2002: *Charakterystyka wskaźników wyprzedzających*. „Prace i Materiały IRG SGH”, 73.
- DUDEK S., WALCZYK K. 2005: *Business Climate Indicators to Predict Economic Activity*. „Prace i Materiały IRG SGH”, nr 75.
- DUDEK S. 2006: *Krótkookresowe prognozowanie działalności gospodarczej przedsiębiorstw przemysłowych na podstawie testu koniunktury*. (praca doktorska, maszynopis).
- Economic Tendency Surveys and Cyclical Indicators. Polish Contribution to the 27th CIRET Conference*. „Prace i Materiały IRG SGH”, nr 75, 2005.
- MATKOWSKI Z. 2001: *Syntetyczne wskaźniki koniunktury dla gospodarki polskiej. Edycja 2000*. „Prace i Materiały IRG SGH”, nr 67.
- MATKOWSKI Z. (red.) 2004: *Composite Indicators of Business Activity for Macroeconomic Analysis*. „Prace i Materiały IRG SGH”, nr 74.
- OPPENLANDER K. H. 2002: *Business Cycle Survey Data: Definition, Importance and Application*. (referat na 26 Konferencję CIRET), Tajpei.
- PATER R., WARGACKI M. 2008: *Specyfika cyklicznych wahań rynku pracy województwa podkarpackiego na podstawie badań koniunktury*. „Prace i Materiały IRG SGH”, nr 80.