

„Badania koniunktury — zwierciadło gospodarki”

Relacja z konferencji naukowej, SGH, 6–7 grudnia 2012 r.

Konrad Walczyk

Szkoła Główna Handlowa w Warszawie

W 2012 r. Instytut Rozwoju Gospodarczego Szkoły Głównej Handlowej (IRG) obchodził 40-lecie swojego istnienia. Instytut zajmuje się problematyką szeroko rozumianego rozwoju gospodarczego. Od 1986 r. nieprzerwanie prowadzi regularne badania koniunktury gospodarczej metodą testu, które stanowią zasadniczy przedmiot jego działalności. Badania te prowadzone są w pięciu działach gospodarki narodowej: rolnictwie, przemyśle przetwórczym, budownictwie, handlu, bankowości i w gospodarstwach domowych. Wyniki badań koniunktury stanowią podstawę do formułowania ocen stanu i zmian aktywności gospodarczej, prognozowania tendencji rozwojowych polskiej gospodarki, wykonywania analiz ilościowych oraz testowania nowych metod statystycznych i ekonometrycznych.

Dla uczczenia jubileuszu Instytut zorganizował konferencję naukową, która odbyła się w dniach 6 i 7 grudnia ub. r. Zasadnicza część konferencji rozpoczęła się od dyskusji poświęconej historii badań koniunktury gospodarczej w Polsce. Rozpoczęto je w drugiej połowie lat osiemdziesiątych ubiegłego wieku. Pionierami zastosowań testu koniunktury do badania gospodarki były dwa ośrodki akademickie: Akademia Ekonomiczna w Poznaniu (obecnie Uniwersytet Ekonomiczny w Poznaniu) oraz IRG. Historię rozwijania badań koniunktury przez ośrodek poznański przypomniła prof. Małgorzata Kokocińska. Uczestnicząc od początku w pracach zespołu kierowanego przez prof. Marka Rekowskiego przypomniła, iż prowadzenie badań koniunktury gospodarczej podjęto we współpracy z poznańskim Urzędem Wojewódzkim. W późniejszych latach — we współpracy z GUS — uruchomiono regularne badania koniunktury, obejmujące początkowo przemysł przetwórczy i budownictwo, a z czasem również handel i gospodarstwa domowe. Z innej perspektywy dorobek uczelni poznańskiej prezentował prof. Józef Garczarczyk. Był on zaangażowany w badania koniunktury metodą testu od lat 80., prowadząc początkowo badania wycinkowe na rynku mebli, a później na rynku usług turystycznych. Od początku lat dziewięćdziesiątych kierowany przez prof. Garczarczyka zespół prowadzi kwartalne badania koniunktury na rynkach finansowym i ubezpieczeniowym. Początki badania koniunktury przez IRG przypomniiał dr Alfred Bieć. Pierwszą partię 250 ankiet do przedsiębiorstw przemysłowych IRG wysłał w sierpniu 1986 roku. Dr Bieć wspominał swoją współpracę z czołowymi ośrodkami badania koniunktury w Europie, zwłaszcza włoskim ISCO. Kolejnym ośrodkiem, który zainteresował się badaniami koniunktury był Instytut Badań nad Gospodarką Rynkową (IBnGR). O doświadczeniach tej jednostki mówił dr Bohdan Wyżnikiewicz. Wspomnił także o badaniach koniunktury prowadzonych w Zakładzie Badań Statystyczno-Ekonomicznych GUS pod kierunkiem profesora Leszka Zienkowskiego oraz o wdrażaniu badań koniunktury metodą testu we współpracy z ośrodkiem poznańskim. Gdański Instytut Badań nad Gospodarką Rynkową badania koniunktury wprowadzał we współpracy z niemieckim Instytutem Badań Gospodarczych DIW w Berlinie, ograniczając je do województwa gdańskiego. Obecnie we współpracy z „Rzeczpospolitą” Instytut prowadzi tygodniowe badania

* Komunikat jest zmienioną wersją sprawozdania z jubileuszowej konferencji IRG, opublikowanego w „Gazecie SGH”, nr 1/13 (289), s. 34 i 35.

koniunktury na szczeblu ogólnopolskim. O rozwoju regionalnych badań koniunktury opowiadał dr Mieczysław Kowerski z Wyższej Szkoły Zarządzania i Administracji w Zamościu. Badania są prowadzone według metodyki udostępnionej przez IBnGR. Aktualny stan badań prowadzonych przez IRG przedstawiła profesor Elżbieta Adamowicz.

Wystąpienia wszystkich uczestników dyskusji wskazywały, jak użytecznym narzędziem do badania aktualnego stanu gospodarki są testy koniunktury. W „lustrze koniunktury” odbijają się procesy, których oficjalna statystyka nie rejestruje. Cenną zaletą tych badań jest fakt, iż obraz uzyskujemy niemal natychmiast, w czasie rzeczywistym. Obejmując tymi badaniami wielu sektorów gospodarki narodowej, zgromadzono dane, które opisują przebieg transformacji gospodarki polskiej i jej reakcje na kolejne kryzysy gospodarcze. Korzyści wynikające z wykorzystania danych, zgromadzonych w badaniach koniunktury omawiano na sesjach tematycznych, poświęconych kolejno:

- koniunkturze regionalnej,
- cyklom koniunkturalnym,
- metodom ilościowym stosowanym w badaniach koniunktury gospodarczej.

W pierwszej sesji dr Mieczysław Kowerski przedstawił doświadczenia Wyższej Szkoły Zarządzania i Administracji w Zamościu z ponad 10-letnich badań koniunktury gospodarczej w województwie lubelskim. Wyniki tych badań dostatecznie dobrze odzwierciedlają zmiany aktywności gospodarczej w regionie i jako takie są ważnym uzupełniającym źródłem informacji o jego sytuacji gospodarczej zwłaszcza wówczas, gdy państwowa statystyka ilościowa jest opóźniona. Do podobnych wniosków doszedł dr Rafał Warżała (Uniwersytet Warmińsko-Mazurski w Olsztynie) omawiający wyniki badań koniunktury gospodarczej w województwie warmińsko-mazurskim. Dr Zbigniew Matkowski, dr Mariusz Próchniak i prof. Ryszard Rapacki (SGH) przedstawili trzy scenariusze — optymistyczny, umiarkowany i ostrzegawczy — konwergencji dochodowej wybranych krajów Europy Środkowo-Wschodniej z Europą Zachodnią. W scenariuszu optymistycznym Polska potrzebowałaby 19 lat, licząc od 2010 r., aby osiągnąć przeciętny poziom PKB per capita w krajach UE15 (wg siły nabywczej). W scenariuszu umiarkowanym likwidacja istniejącej luki dochodowej byłaby możliwa w ciągu 23 lat, a w scenariuszu ostrzegawczym poczynając mniej więcej od 2045 r. Polska zaczęłaby ponownie zwiększać dystans dochodowy do krajów Europy Zachodniej. Akcentując scenariusz ostrzegawczy, referenci zaapelowali o podjęcie energicznych działań w ramach polityki ludnościowej i społeczno-gospodarczej. Dr Bohdan Wyżnikiewicz (IBnGR) analizował zależność między trafnością prognoz makroekonomicznych dla Polski a usytuowaniem ośrodków je formułujących i stwierdził, że trafność prognoz krajowych ośrodków jest większa niż ośrodków zagranicznych, które wykazują dość silny pesymizm. Wpływa na niego pryzmat oceny (prognozy dla Polski są zazwyczaj obciążone oceną całego regionu) oraz historycznie uwarunkowane negatywne stereotypy dotyczące Polski.

W sesji poświęconej cyklom koniunkturalnym prof. Elżbieta Adamowicz i dr Konrad Walczyk (IRG SGH) stwierdzili występowanie w wynikach badań koniunktury IRG SGH tych samych prawidłowości (stylised facts), które obserwowane są w gospodarce realnej. Można wręcz mówić o istnieniu „jakościowego cyklu koniunkturalnego”, skorelowanego z realnym cyklem koniunkturalnym. Prof. Maria Drozdowicz-Bieć (IRG SGH) pokazała, iż relacja przychodów do kosztów działalności gospodarczej jest użytecznym wskaźnikiem wyprzedzającym zmiany aktywności gospodarczej (w Polsce), a prof. Marek Lubiński (SGH) omówił mechanizm generowania fluktuacji gospodarczych przez sektor finansowy. Wyjaśnienie jego procykliczności wyrasta z asymetrii informacji między pożyczkodawcami a pożyczkobiorcami, nieadekwatnej ich reakcji na zmiany ryzyka w czasie i działania akceleratora finansowego. Prof. Józef Garczarzyk, dr Marek Mocek i dr Robert Skikiewicz (Uniwersytet Ekonomiczny w Poznaniu) zdiagnozowali ograniczony wpływ zmian koniunktury na aktywność polskich gospodarstw domowych na rynku ubezpieczeniowym, co tłumaczą niską świadomością ubezpieczeniową Polaków.

Sesja nt. metod ilościowych w badaniach koniunktury gospodarczej zgromadziła najliczniejszą reprezentację referentów. Dr Michał Bernardelli i dr Monika Dędyś (SGH) pokazali, że zastosowanie algorytmu Viterbiego w analizie ukrytych modeli Markowa ułatwia identyfikację punktów zwrotnych w cyklu koniunktury. Dr Piotr Białowolski, prof. Tomasz Kuszewski i dr Bartosz Witkowski (SGH) wykazali, że zastosowanie w budowie modelu prognostycznego metody bayesowskiego

uśredniania klasycznych oszacowań, umożliwiającą prognozowanie wartości zmiennych endogenicznych bez czynienia jakichkolwiek założeń co do wartości regresorów w okresie prognozy i zakładającej określoną sekwencję zależności między zmiennymi endogenicznymi, poprawia trafność prognoz wskaźników makroekonomicznych. Dr Piotr Boguszewski i Katarzyna Puchalska (NBP) przekonywali, że badania koniunktury gospodarczej na stałej próbie (danych panelowych) umożliwiają lepsze zrozumienie zachowania się jakościowych wskaźników koniunktury, a dr Sławomir Dudek i Tomasz Zajac (SGH) stwierdzili, że użycie modeli czynnikowych poprawia oszacowanie wskaźników aktywności gospodarczej (PKB). Podobnie Bartosz Olesiński (SGH), który zauważył, że zastosowanie metody głównych składowych do budowy złożonego wskaźnika koniunktury umożliwia trafniejsze prognozowanie zmian koniunktury (w przemyśle przetwórczym i całej gospodarce polskiej). Konstrukcją syntetycznego wskaźnika wyprzedzającego zajmowała się również dr Magdalena Ulrichs (Uniwersytet Łódzki), proponując inną metodę, a mianowicie wielostopniową procedurę selekcji zmiennych z wykorzystaniem rozmaitych narzędzi analizy statystycznej. Dr hab. Emilia Tomczyk (SGH) zaproponowała innowacyjne zastosowanie miar entropii statystycznej do analizy zróżnicowania odpowiedzi respondentów testu koniunktury. Wyniki ujawniają zróżnicowanie cech ankietowanych podmiotów, które istotnie determinują ich zmienność.



W trakcie konferencji Prorektor Wyższej Szkoły Zarządzania i Administracji w Zamościu, dr Mieczysław Kowerski, wręczył prof. dr hab. Elżbiecie Adamowicz i prof. dr hab. Marii Bieć najwyższe odznaczenie przyznawane przez WSZiA — medal *Scholae Amicis*.

Po zakończeniu prezentacji referatów odbyła się dyskusja, w której grupa ekspertów w składzie: prof. dr hab. Andrzej Sławiński (SGH, NBP), dr Bohdan Wyżnikiewicz (IBnGR), dr Ernest Pytlarczyk (BRE Bank) i mgr Aleksander Łaszek (FOR) przedstawiła prognozy rozwoju sytuacji gospodarczej w Polsce. Eksperti ustosunkowywali się do postawionych przez profesor Marię Drozdowicz-Bieć kwestii: perspektyw rozwojowych gospodarki polskiej, perspektyw rozwoju gospodarek unijnych i możliwości pojawienia się trzeciej fazy kryzysu. Konferencję zakończyło wystąpienie profesor Leszka Balcerowicza, w przeszłości sekretarza naukowego Instytutu.

Referaty wygłoszone na konferencji zostały opublikowane w *Pracach i Materiałach Instytutu Rozwoju Gospodarczego SGH*, nr 90 i 91.