

# ZESZYTY PBR – CASE

# 8

Gospodarka Polski  
w latach 1990-1992  
Pomiary a rzeczywistość

Warszawa 1993

Fundacja Naukowa CASE

Polski Bank Rozwoju S.A.



Fundacja Naukowa CASE – Centrum Analiz Społeczno-Ekonomicznych  
00-585 Warszawa, ul. Bagatela 14

Polski Bank Rozwoju S.A.  
00-675 Warszawa, ul. Koszykowa 54

Copyright by: Fundacja Naukowa CASE i Polski Bank Rozwoju S.A.

Opracowanie tekstów: Tadeusz Baczek  
Krystyna Swinarska  
Opracowanie graficzne: Agnieszka Bury

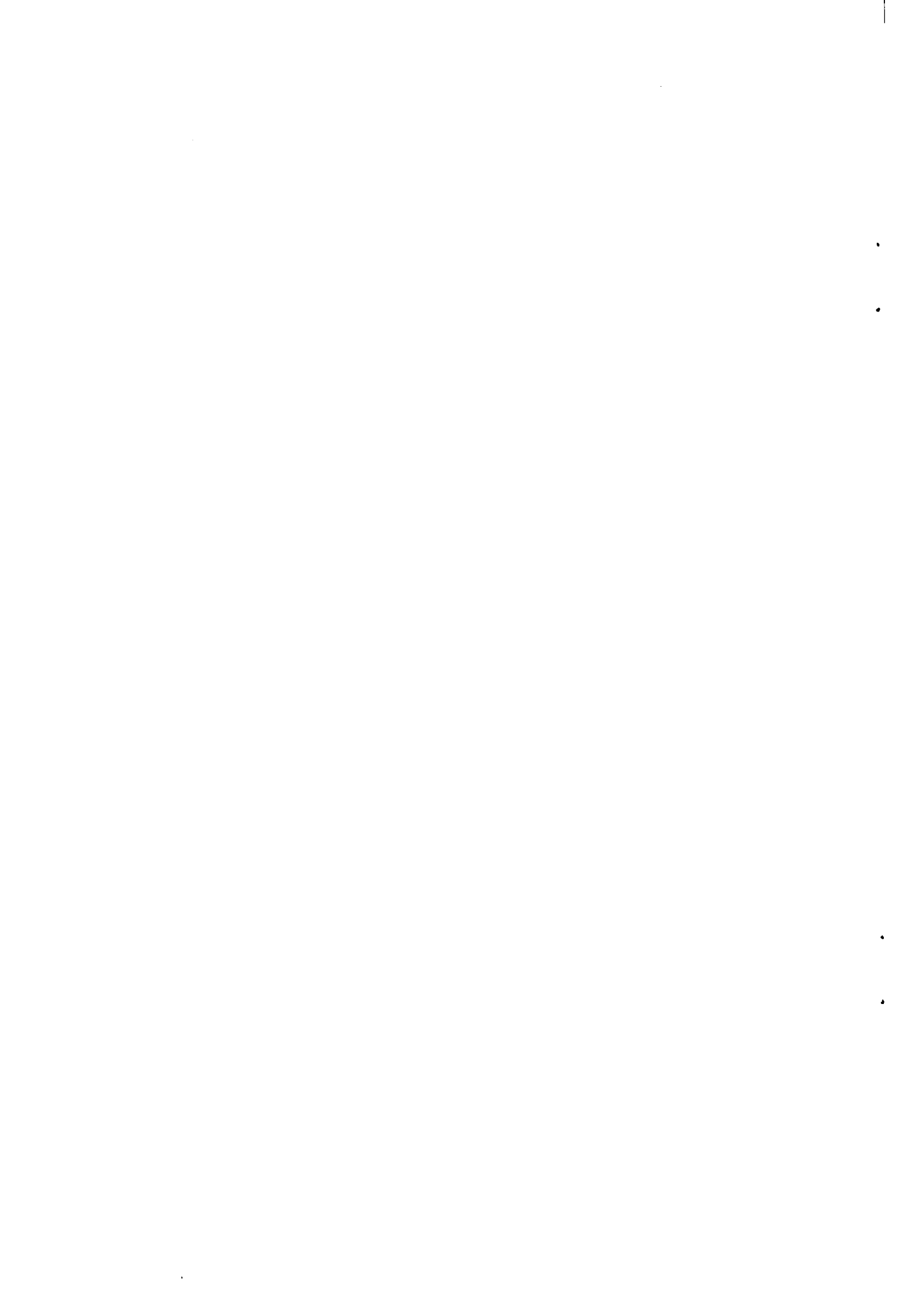
**MEDIABANK**  
 **S.A.**

Wydawca:  
Mediabank S.A. 00-640 Warszawa, ul. Mokotowska 17

Oddano do druku w grudniu 1993 r. Nakład 1000 egz.

## SPIS TREŚCI

T. Baczeko:	WSTĘP.....	5
L. Zienkowski:	BADANIA WYNIKÓW GOSPODARCZYCH W OKRESIE TRANSFORMACJI .....	7
Z. Rajewski:	PRODUKT KRAJOWY BRUTTO .....	11
K. Marczewski:	WSPÓŁPRACA GOSPODARCZA Z ZAGRANICĄ.....	13
A.S. Bratkowski:	OCENA STOSOWANEJ METODOLOGII BADAŃ STATYSTYCZNYCH.....	15
R. Barczyk:	KONIUNKTURA GOSPODARCZA W ŚWIELE WSKAŹNIKÓW JAKOŚCIOWYCH .....	19
G. Pruban:	OMÓWIENIE DYSKUSJI .....	23



## WSTĘP

W ramach seminariów organizowanych wspólnie przez Fundację Naukową CASE – Centrum Analiz Społeczno-Ekonomicznych oraz Polski Bank Rozwoju S.A. – poświęconych ocenie sytuacji gospodarczej prezentujemy w obecnym ósmym numerze „Zeszytów PBR - CASE” wyniki pierwszego spotkania nowego cyklu. Chcielibyśmy, by cykl tych dyskusji to było forum, gdzie wiodące ośrodki, zajmujące się badaniami gospodarki, przedstawiałyby wyniki swoich analiz i prognoz. Pozwoliłoby to opinii publicznej i ekspertom na uzyskanie pełniejszego obrazu dokonujących się przemian. Spotkanie, którego przebieg prezentujemy, zostało poświęcone pomiarom wyników gospodarczych w warunkach przemian jakie dokonały się w Polsce w ostatnich trzech latach.

Podstawą spotkania były wystąpienia panelistów. Zaproszonych zostało pięciu statystyków zajmujących się oceną sytuacji gospodarczej Polski w latach 1990-1992. Leszek Zienkowski z Zakładu Badań Statystyczno-Ekonomicznych GUS i PAN przedstawił główne dyskusyjne problemy związane z pomiarem wyników gospodarczych w okresie transformacji w Polsce. Zenon Rajewski z tego samego Zakładu poświęcił swoje wystąpienie problemom oceny skali recesji na podstawie pomiaru produktu krajowego brutto (PKB). Krzysztof Marczewski ze Szkoły Głównej Handlowej mówił o trudnościach związanych ze statystycznym opisem procesów gospodarczej współpracy z zagranicą. Wyniki dotychczasowych studiów nad metodologią badań statystycznych transformacji polskiej gospodarki przedstawił Andrzej S. Bratkowski z Fundacji Naukowej CASE. Ważne uzupełnienie badań statystycznych gospodarki stanowi metoda testu koniunktury, oparta na ankietach zbieranych bezpośrednio z przedsiębiorstw. Możliwości wykorzystania tej metody przedstawił Andrzej Barczyk z Akademii Ekonomicznej w Poznaniu.

Tematyka spotkania wywołała zainteresowanie wielu przedstawicieli ze sfer rządowych, kół gospodarczych oraz licznych dziennikarzy – publicystów ekonomicznych. Na uwagę zasługuje obecność przedstawicieli instytucji finansowych zagranicznych i krajowych, a w szczególności Banku Światowego, Europejskiego Banku Odbudowy i Rozwoju, Narodowego Banku Polskiego i kilku innych polskich banków. Informacja gospodarcza, w tym także makroekonomiczna, zyskuje na znaczeniu. Szczególnie dziś, kiedy polskie banki mają kontakty z przedstawicielami zagranicznych instytucji kapitałowych, niezbędne stało się dysponowanie aktualnymi informacjami gospodarczymi i to przedstawionymi w sposób zrozumiały. Wymaga to ustalenia mierników porównywalnych z przyjętymi w krajach o gospodarce rynkowej i jednocześnie adekwatnie opisujących przemiany gospodarcze i społeczne w Polsce, a przy tym komunikatywnych dla opinii publicznej.

Dyskusja, początkowo poświęcona metodom badań statystycznych, jaka nastąpiła po zagajeniu panelistów, szybko przekształciła się w atrakcyjną wymianę poglądów, w której wzięli udział między innymi Leszek Bałcerowicz, twórca polskiego programu stabilizacyjnego; Anna Fornalczyk: pierwsza w krajach postkomunistycznych prezes Urzędu Antymonopolowego; Bohdan Wyżnikiewicz, były prezes Głównego Urzędu Statystycznego; Wojciech Kostrzewa, prezes Polskiego Banku Rozwoju; Dariusz Ledworowski, prezes Banku Rolno-Przemysłowego, były Minister Współpracy Gospodarczej z Zagranicą; jak też szereg innych ekonomistów.

Seminarium stało się też okazją do spotkania licznych przedstawicieli ośrodków naukowo-badawczych i analitycznych, od których zależy w znacznym stopniu jakość informacji, a więc i podejmowanych na ich podstawie decyzji.

Tadeusz Baczeko

Lista uczestników seminarium PBR-CASE nr 8:

Andrzej Aranowski	— Polski Bank Rozwoju S.A.
Tadeusz Baczko	— Fundacja Naukowa CASE
Ewa Balcerowicz	— Fundacja Naukowa CASE
Leszek Balcerowicz	— Fundacja Naukowa CASE
Ryszard Barczyk	— Akademia Ekonomiczna w Poznaniu
Alina Białkowska	— Urząd Rady Ministrów
Barbara Błaszczuk	— Fundacja Naukowa CASE
Marżena Borowiec	— Ministerstwo Przekształceń Własnościowych
Jan Bossak	— Szkoła Główna Handlowa
Andrzej S. Bratkowski	— Fundacja Naukowa CASE
Tomasz Brochecki	— Agrobank S.A.
Andrzej Bury	— „Bank” i Polskie Radio
Józef Chmiel	— Zakład Badań Statystyczno-Ekonomicznych GUS i PAN
Krzysztof Chmielewski	— Fundacja Naukowa CASE
Adam Czyżewski	— Zakład Badań Statystyczno-Ekonomicznych GUS i PAN
Janusz Dąbrowski	— Instytut Badań nad Gospodarką Rynkową
Marek Dąbrowski	— Fundacja Naukowa CASE
Jerzy Drygalski	— Ministerstwo Przekształceń Własnościowych
Anna Fornalczyk	— Urząd Antymonopolowy
Witold Gadomski	— „Nowa Europa”
Paweł W. Gieryński	— Powszechny Bank Gospodarczy S.A.
Paweł Glikman	— Instytut Nauk Ekonomicznych PAN
Stanisław Gomułka	— The London School of Economics
Ian Hume	— Bank Światowy
Paweł Jabłoński	— „Rzeczpospolita”
Dorota Kalinin	— Centralny Urząd Planowania
Piotr Kazimierzczuk	— Polski Bank Rozwoju s.A.
Tadeusz Kochanowski	— Instytut Badawczo-Doradczy „Zmiany”
Ryszard Kokoszczński	— Narodowy Bank Polski
Wojciech Kostrzewa	— Polski Bank Rozwoju S.A.
Marżena Kowalska	— „Życie Gospodarcze”
Marek Krysiak	— Polski Bank Rozwoju S.A.
Stawomir Lachowski	— Powszechny Bank Gospodarczy S.A.
Dariusz Ledworowski	— Bank Rolno-Przemysłowy
Krzysztof Marczewski	— Szkoła Główna Handlowa
Marek Misiak	— „Życie Gospodarcze”
Tomasz Najda	— Fundacja Naukowa CASE
Andrzej Ochocki	— Główny Urząd Statystyczny
Witold Orłowski	— Bank Światowy
Andrzej Podsiadło	— Powszechny Bank Handlowy „Gecobank”
Grażyna Pruban	— Fundacja Naukowa CASE
Witold Radwański	— Europejski Bank Odbudowy i Rozwoju
Zenon Rajewski	— Zakład Badań Statystyczno-Ekonomicznych GUS i PAN
Roman Sawiński	— Główny Urząd Statystyczny
Maciej Stańczuk	— Polski Bank Rozwoju S.A.
Paweł Tarnowski	— „Polityka”
Krzysztof Telega	— Polski Bank Rozwoju S.A.
Andrzej Topiński	— Bank Handlowy S.A.
Agnieszka Wróblewska	— „Życie Warszawy”
Bohdan Wyżnikiewicz	— Instytut Badań nad Gospodarką Rynkową
Danuta Zagrodzka	— „Gazeta Wyborcza”
Leszek Zienkowski	— Zakład Badań Statystyczno-Ekonomicznych GUS i PAN

# BADANIE WYNIKÓW GOSPODARCZYCH W OKRESIE TRANSFORMACJI

*Leszek Zienkowski<sup>1)</sup>*

Organizatorzy tego spotkania powierzyli mi zadanie zainicjowania dyskusji kilkoma uwagami wstępnymi. Otóż dla właściwej oceny wyników gospodarczych niezbędne jest według mnie uzyskanie dokładnych informacji statystycznych w sześciu zakresach. Do nich trzeba zaliczyć:

- 1) poziom i dynamikę produktu krajowego brutto;
- 2) wielkość i wahania inflacji;
- 3) zmiany struktury, w tym struktury cen;
- 4) dochody i wynagrodzenia (nominalne i realne) oraz ich zróżnicowanie;
- 5) rentowność podmiotów gospodarczych, a właściwie ich sytuacja finansowa;
- 6) wielkość i zakres bezrobocia.

Tak więc pierwszym zadaniem dyskusji byłoby ustalenie jakimi informacjami statystycznymi dysponujemy i czy oddają one adekwatnie rzeczywisty stan w tych podstawowych dziedzinach.

Jeżeli idzie o poziom i dynamikę produktu krajowego brutto (PKB), to największe zastrzeżenia budzą szacunki pozarolniczej gospodarki prywatnej, ale zarejestrowanej. (O sferze określanej jako szara gospodarka będę mówił później).

Otóż wszystkie analizy wskazują, że w oficjalnych danych wielkość produkcji dodanej brutto w tym sektorze jest zdecydowanie zaniżana. Wywiera to wpływ nie tylko na wielkość nominalne, ale również na dynamikę. Jednocześnie jednak trzeba stwierdzić, że ten sektor rozwija się relatywnie bardziej dynamicznie niż inne. Rozwija się on jednak dynamicznie w każdym okresie i wobec tego jego waga jest zaniżona; wobec tego nawet jeżeli dynamikę by dobrze szacowano, to samo zniżenie już powo-

duje spadek i wywołuje nieadekwatne obliczenie dynamiki. Ponadto zaś można mieć wątpliwości, czy sama dynamika też jest tu dobrze liczona. Chcę powiedzieć, że opieranie się na sprawozdawczości przedsiębiorstw tego sektora jest metodologicznie niepewne, gdyż bardzo trudne są tu bowiem szacunki według symptomatycznych wskaźników – przynajmniej ja tak uważam.

Można też mieć zastrzeżenia co do szacunków prywatnego rolnictwa: czy tutaj pewne względy natury politycznej nie powodowały tendencji do zaniżania produkcji. Wreszcie sfera szarej gospodarki, która prowadzi działalność niezarejestrowaną. Chcę podkreślić jednak, że żaden urząd statystyczny na świecie nie zajmuje się w praktyce tą dziedziną gospodarki. Jednakże w naszych warunkach ma to istotne znaczenie, gdyż dotyczy zarówno produkcji jak i handlu zagranicznego. Podawane zaś wielkości eksportu i importu są bardzo wątpliwe, gdy pomija się te wszystkie tzw. prywatne eksporty i importy oraz najróżniejsze zniżenia w zeznaniach celnych.

Wreszcie następna sprawa metodologiczna: można mieć wątpliwości czy dostatecznie i w ogóle w jakim zakresie były uwzględniane w rachunkach narodowych różnice między wartością aktywów na początku i na końcu okresu (holding gain). Właściwie chodzi o to czy te holding gains powinny być zaliczane do produkcji danego orkesu, czy też nie powinny. GUS nie przestrzegal tego konsekwentnie, a to może mieć wpływ na dynamikę w szczególności między rokiem 1990 i poprzednim.

Dalej trzeba powiedzieć, że przy tak wysokiej inflacji jaka miała miejsce niepodobna dobrze oszacować ruch cen. Taki właśnie ruch cen wystąpił w 1990 r. i praktycz-

<sup>1)</sup> Prof. zw. dr hab. Leszek Zienkowski jest dyrektorem Zakładu Badań Statystyczno-Ekonomicznych GUS i PAN.

---

nie rzecz biorąc, nawet przy najlepszych chęciach statystyków zarówno w centrali jak i w terenie, ustalenie jest niestychanie trudne.

Nasze oraz alternatywne szacunki, opierające się na tzw. metodzie fizycznych indykatorów sugerują, że takiego spadku produkcji, jak wykazywany w 1990 roku nie było.

Chcę na marginesie powiedzieć, że jeżeli byśmy uznali, że produkt krajowy brutto jest wyższy nominalnie niż ten, który wykazuje Główny Urząd Statystyczny, to wtedy deficyt budżetowy w relacji do PKB jest za wysoki procentowo. Jeżeli chodzi o inflację, to o tym właściwie już mówiłem, że nie można poprawnie oszacować ruchu cen, gdy jest ona bardzo duża. Ponadto można tutaj mieć następujące zastrzeżenia. Jeżeli przyjmiemy, że w okresie 1990-1992 nastąpiła poprawa jakości, to wówczas te indeksy cen zostały zawyżone. Podobnie jest w krajach Europy Zachodniej, gdzie generalnie się mówi, że poprawa jakości jest fałszywie przedstawiana w indeksach stosowanych jako deflatory, ponieważ jest uwzględniana jako ruch cen, nie zaś jako ruch wolumenu, a w teorii jakość powinna być traktowana na równi z różnicą wolumenu. A to jest sprawa inflacji.

Sprawa zmian struktury. Tu oczywiście wraca sprawa sektora prywatnego, którego udział już zaniżony, wobec czego nie bardzo widać zmiany strukturalne w gospodarce narodowej. Podobnie sprawa wymiany (eksport i import) z zagranicą też zapewne nie jest adekwatnie uchwycona i wreszcie chyba niedostatecznie badano w ogóle zmiany struktury cen.

Zbierane są dane cenowe, ale ja osobiście nie widziałem analizy, która by koncentrowała się na zmianach cen. To trochę jest moja własna opinia, ale właściwie powinniśmy też taką analizę podjąć w zakładzie, który ja reprezentuję, a nie podjęliśmy jej. Dopiero teraz myślimy o tego typu analizach.

Również zniżenie dochodów nominalnych i realnych – z czym się łączy zniżenie spożycia, zarówno jego poziomu jak i dynamiki. Tutaj należy zwrócić uwagę na pewną niekonsekwencję czy niespójność między informacjami o dynamice spożycia i o dynamice handlu detalicznego. Jeżeliby ta druga miała być tak wysoka, jak podaje statystyka, to i dynamika handlu musiałaby być wyższa niż to jest wykazywane.

Wreszcie sprawa rentowności, a ściślej mówiąc sytuacji finansowej podmiotów gospodarczych. Otóż tutaj są dwie sprawy. Jedna to sprawa metody obliczania rentowności, zyskowności jak i różnych innych mierników, które określają sytuację finansową przedsiębiorstwa. Druga wątpliwość odnosi się do uwzględniania w przychodach wartości sprzedanego majątku (co nie ma nic wspólnego z bieżącą rentownością) oraz podatku obrotowego, który może być różnie traktowany jak mi się wydaje w zależności od celu analizy. Kuriozalne jest to właśnie, że niedociągnięcia metodologiczne powodowały w latach 80-tych zawyżanie dynamiki, natomiast od 1990 r. te wszystkie mierniki pokazują sytuację gorszą niż była w rzeczywistości. Ponadto należy tu uwzględnić różnice w rentowności sektora publicznego i prywatnego. Otóż dane o rentowności w sektorze prywatnym są niewiarygodne, co wpływa na obliczenie przeciętnej rentowności.

Dalej – jak ostatnio stwierdziliśmy – informacje kwartalne i wstępne roczne opierają się na nieostatecznych i niezatwierdzonych bilansach. Natomiast sprawozdawczość roczna, wykonywana dużo później i poprawiona, opiera się na bilansach zatwierdzonych. I jak się okazuje istnieje znaczna różnica między bilansami niezatwierdzonymi a zatwierdzonymi właśnie w dziedzinie kosztów, podatków, podatku obrotowego, podatków z kosztów. Otóż okazuje się, że przedsiębiorstwa podają w tych wstępnych informacjach znacznie wyższe koszty i podatki niż w rzeczywistości, co oczywiście prowadzi do tego, że wykazują u siebie mniejszy zysk. Znowu więc jest to problem: jeżeli się powie, że roczne są już skorygowane, to przecież te oceny przeważnie opierają się nie na rocznych, tylko na wcześniejszych informacjach. Jeszcze jest gorzej jeżeli porównuje się ostateczne bilanse z poprzedniego roku z niezatwierdzonymi z danego roku, gdyż wtedy to pogorszenie wychodzi głębsze niż by to wynikało nawet z ich porównania, gdy są w tej samej fazie weryfikacji. Tutaj jednak zastrzegam, że ta sprawa nie jest do końca zbadana. To, co w tej chwili powiedziałem, staram się traktować jako informację wstępną, bo cała ta dziedzina wymaga dalszych badań, zwłaszcza zaś owe różnice między informacją niezatwierdzoną a zatwierdzoną. Proszę więc traktować to jako hipotezę tylko częściowo opar-



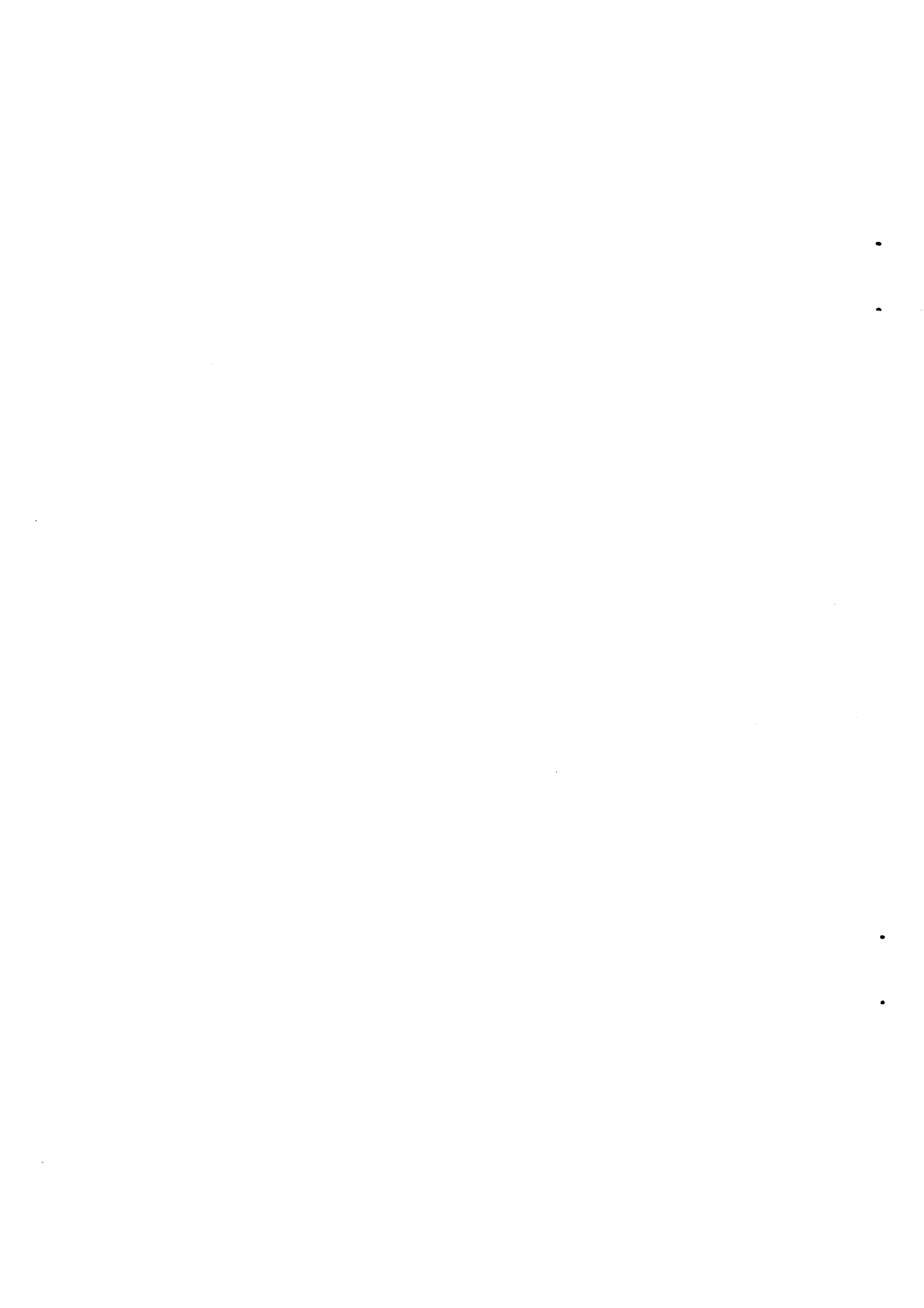
---

tą na materiale empirycznym. Muszę niestety być taki ostrożny.

I ostatnia dziedziną: dane dotyczące bezrobocia. Jak we wszystkich krajach, również w Polsce można mieć wątpliwości, czy mamy adekwatny obraz rzeczywistego stanu bezrobocia, zarówno rejestrowanego jak i nierejestrowanego oraz pozornego. To jest temat bardzo skomplikowany. Wydaje mi się, że ani to zarejestrowane bezrobocie, ani to, które wynika z badań ankietowych GUS-u nie oddają w pełni rzeczywistego obrazu. Jak ten rzeczywisty obraz powinien być przedstawiony i przy pomocy jakich metod – na to pytanie odpowiedzieć w tej chwili nie potrafię, ale podnoszę sprawę jako problem.

Wreszcie na zakończenie taka uwaga co do badania wyników gospodarczych. Nie bardzo wiem, co to są „wy-

niki gospodarcze w okresie transformacji”. Jeśli jednak mam coś powiedzieć na ten temat – nie tylko to, że nie wiem – to wydaje mi się, że jednak należałoby się zastanowić, jakie mierniki w okresie transformacji powinny być przyjmowane, co jest dobre, co jest złe, co jest korzystnym objawem, a co niekorzystnym? Jednym słowem z punktu widzenia metodologicznego być może inflacja na początku 1990 r. w rzeczywistości powinna być większa; może powinniśmy się byli martwić nie tym, że była ona taka duża, tylko że była za mała? Może nierentowne przedsiębiorstwa powinny w ogóle zaprzestać produkcji, może właściwie jeszcze za mało przestały one produkować, a nie za dużo. Wydaje mi się że jest problemem, jakie mierniki powinny być przyjmowane do oceny wyników gospodarczych.



# PRODUKT KRAJOWY BRUTTO

Zenon Rajewski<sup>1)</sup>

W swoim wystąpieniu ustosunkuję się pokrótce do problematyki rozmiarów recesji gospodarczej w okresie transformacji w świetle badań nad rachunkiem kategorii: produkt krajowy brutto (PKB). Chciałbym przypomnieć, że według oficjalnej statystyki PKB zmniejszył się w 1992 r. w stosunku do 1989 r. o około 18%, zaś produkcja przemysłowa o około 35%. Spadek ten wystąpił głównie w latach 1990-1991, natomiast w 1992 roku zanotowano prawdopodobnie niewielki wzrost. Mówię: „prawdopodobnie” i „niewielki” dlatego, że jeszcze do dziś dnia nie mogłem uzyskać w GUS-ie informacji, jaki był ostateczny wynik obliczenia dynamiki PKB za ten rok. Takie są, krótko mówiąc, zmiany recesji postrzeganej statystycznie. Powstaje pytanie: czy ten pomiar statystyczny stanowi odbicie realnych procesów zachodzących w gospodarce? Już z wystąpienia pana Zienkowskiego wynikało, że nie stanowił. Pan Profesor wskazał szereg czynników, które pozwalają sądzić, że zarówno wielkość PKB jak i jego dynamika były wyższe niż to pokazała oficjalna statystyka. Na marginesie tej sprawy jedna uwaga. Te zaniżenia spowodowała w dużym stopniu niedoskonałość warsztatu statystycznego, która moim zdaniem wynika z dwóch czynników:

- W tym okresie przechodzono z jednego systemu do drugiego, z MPS na system SNA, co powodowało wprowadzenie do statystyki całego szeregu nowych pojęć, kategorii i standardów.

- Drugim czynnikiem było to, że pozbawiono system statystyczny luksusu niemal pełnej sprawozdawczości, do czego był przyzwyczajony przez dziesiątki lat. Natomiast teraz stanął przed problemem, że nagle całe

dziedziny gospodarki znalazły się poza rutynową sprawozdawczością; trzeba więc było znaleźć nowe metody, nowe rozwiązania, żeby rozmiary tych dziedzin uchwycić.

Tak jak to pisaliśmy w naszej zeszłorocznej ekspertyzie Zakładu Badań Statystyczno-Ekonomicznych i to, co mówił pan profesor Zienkowski przed chwilą, można wymienić dwie wyraźne i podstawowe przyczyny zaniżenia PKB. Pierwsza to jego niedoszacowanie w przedsiębiorstwach prywatnych, a zwłaszcza w przedsiębiorstwach określanych jako małe, tj. zatrudniające do 5 pracowników, które w ogóle znajdują się poza rutynową sprawozdawczością.

Wyniki gospodarcze tych małych przedsiębiorstw są określane na podstawie badań ankietowych, ale ciągle jeszcze nie reprezentatywnych. GUS nie dorobił się jeszcze bowiem właściwej metody badań dla tej dziedziny. I w zasadzie odpowiedzi w ankietach, które są sporządzane dla potrzeb GUS-u, powtarzają te same dane, które prywatne zakłady zgłaszają w swoich deklaracjach dla ZUS-u, dotyczących wynagrodzeń, jak też w tych, które składają urzędowi finansowemu, a więc są one wyraźnie i bezdyskusyjnie zaniżone.

Druga taka przyczyna – o której też mówił pan profesor Zienkowski – to jest prawdopodobnie niedobre, czy nienależyte oszacowanie PKB, zwłaszcza w zakresie przyrostu zapasów w roku 1989 z powodu inflacji, co przypuszczalnie spowodowało zawyżenie realnych rozmiarów produktu. W rezultacie tego spadek produkcji w roku 1990 był faktycznie mniejszy niż to wykazała oficjalna statystyka.

<sup>1)</sup> Dr Zenon Rajewski jest zastępcą dyrektora Zakładu Badań Statystyczno-Ekonomicznych GUS i PAN.

---

Pozostaje jeszcze bardzo kontrowersyjne i bardzo niejasne określenie rozmiarów produktu krajowego brutto szarej sfery gospodarki.

Wypowiedzi, które spotykałem w opracowaniach ekonomistów, są bardzo rozbieżne. W naszej ekspertyzie szacowaliśmy szarą sferę na podstawie analizy bilansu siły roboczej w wieku produkcyjnym, czyli niejako opierając się na liczebności zatrudnionych lub ludności zawodowo czynnej. Ta druga grupa może ewentualnie pracować na czarno lub jako pracownicy niezarejestrowani w przedsiębiorstwach zarejestrowanych, co oczywiście rzutuje na rozmiary szarej sfery. I w naszej ekspertyzie określiliśmy, że naszym zdaniem szara sfera mogła dać około 20% PKB, a jego spadek w okresie 3 lat mógł wynieść nie 18%, jak wynika z oficjalnej statystyki, ale 10%. Natomiast kilka tygodni temu pan Gulewicz w „Gazecie Wyborczej” w ciekawym artykule ocenił, że szara sfera może wytworzyć nawet 50% produktu krajowego brutto. Oczywiście chciałbym powiedzieć, że w tych krajach, które prowadzą badania nad PKB przez różne zespoły i przy pomocy różnych metod, nie takie bywają rozbieżności jak między panem Gulewiczem a nami, ale nieraz rzędu kilkudziesięciu punktów procentowych. Na przykład przypominam sobie w końcu lat 70-tych z danych zebranych w Republice Federalnej Niemiec według jednych ocen wielkość szarej sfery wynosiła ok. 5%, a według innych – ok. 25%. Tak, że tu praw-

dopodobnie tego typu rozbieżności będą zawsze, choć wydaje się, że mamy pełne podstawy do twierdzenia, że jeżeli byśmy uwzględnili szarą sferę szeroko rozumianą – to znaczy również to, o czym już mówiliśmy, że w przedsiębiorstwach prywatnych formalnie zarejestrowanych występują procesy właściwie nielegalnych i niezarejestrowanych dochodów i obrotów, to prawdopodobnie rozmiary szarej sfery będą znacznie większe, a dynamika PKB znacznie niższa. Powstaje jednak wtedy takie pytanie: jeżeli taką hipotezę postawimy, to czy może się okazać, że zmniejszenie PKB było faktycznie minimalne i czy w 1992 r. był nawet już jakiś notowany wzrost gospodarczy? Otóż żeby sobie wyjaśnić ten problem, należy kilka słów powiedzieć o strukturze tego produktu. Wydaje się, że produkt szarej sfery powstaje w niewielkim zakresie w produkcji i w budownictwie – stanowi go głównie marża handlowa. I teraz tak: na co wtedy on jest przeznaczany, to znaczy czy ten produkt przyczynia się do ogólnego wzrostu gospodarczego czy nie? Otóż według statystyki inwestycji możemy powiedzieć, że w zasadzie one nie rosną, czyli że ten kapitał handlowy nie przekształca się wcale albo przekształca się w minimalnym stopniu w kapitał przemysłowy. To znaczy, że nie widzimy wzrostu inwestycji w przemyśle rejestrowanym. Niewątpliwie duża część czy podstawowa część produktu powstającego w szarej sferze zwiększa pod względem dynamiki i zakresu spożycie.

## WSPÓŁPRACA GOSPODARCZA Z ZAGRANICĄ

*Krzysztof Marczewski<sup>1)</sup>*

Proszę państwa, celem mojej wypowiedzi jest pokazanie, jakie kłopoty pojawiają się w związku z realizacją tego zadania dla mnie – człowieka, który się zajmuje badaniem handlu zagranicznego. Może będzie to nadmierne ukierunkowane na pokazywanie trudności, gdyż jestem świadom jak trudno niektóre z nich usunąć.

Chcę tu poruszyć głównie dwie sprawy:

- jakość statystyki wartości obrotu, tej pierwotnej statystyki handlu zagranicznego;
- jakość statystyki wolumenu i cen handlu zagranicznego.

Ponadto chciałbym jeszcze zająć się problemem parytetu siły nabywczej i tutaj mam pytania do pana profesora Zienkowskiego. Następne pytanie: czy my dobrze mierzymy powiązania handlu zagranicznego z gospodarką narodową? I ostatnia sprawa: co my właściwie wiemy w statystyce o zagranicznych inwestycjach bezpośrednich?

Proszę państwa, w maju 1993 r. ukazały się dawno oczekiwane dane statystyczne za rok 1992. Dzisiaj są pierwsze komentarze prasowe, moim zdaniem dość powierzchowne i wprowadzające w błąd. Skoncentrowały się na porównaniach między statystyką płatniczą i rzeczową oraz na wydziwianiu, że istnieją różnice między nimi. Nie chcę się tym zajmować tu, ponieważ są opracowania, gdzie zainteresowane instytucje zrobiły duży wysiłek, żeby osiągnąć jakąś interpretację wspomnianych różnic. Różnice według mnie były, są i będą.

Dużo ważniejsza wydaje mi się inna sprawa: różnice między naszą statystyką rzeczową, czyli statystyką GUS-u, a statystyką rzeczową w krajach naszych partnerów gospodarczych. Pytanie jest takie: czy i na ile trendy

przedstawione przez naszą statystykę odpowiadają tym, które pokazują nasi partnerzy gospodarczy? Oczywiście stanowi to wielki kłopot, bo do 1991 roku były poważne różnice metodologiczne między GUS-em a zachodnią statystyką. Jednak od 1992 r. różnice te bardzo się zmniejszyły. Pozwoliłem więc sobie tutaj nie porównywać bezpośrednio tych wielkości, a porównać dynamiki. Każda statystyka podaje je według swojej metody, jednak te dynamiki powinny być w miarę zbliżone.

Porównajmy np. dane o handlu Polski z EWG z lat: 1990 i 1989 oraz 1991 i 1990, a na końcu dane uzyskane dla 1992 r. podawane z jednej strony przez Eurostat a z drugiej przez GUS.

Dla 1990 r. Polska (GUS) podaje, że jej eksport dla EWG wzrósł o 55%, natomiast Eurostat, że o 58%, czyli informacje są bardzo zbliżone. Teraz weźmy rok 1991. Polska mówi, że eksport do EWG zwiększył się w stosunku do 1990 r. o 30%, a według Eurostatu miał wzrosnąć o 14,5%.

Podobny obraz mamy w imporcie. Dla 1990 r. wg GUS-u wzrost importu z Polski do EWG wyniósł 8%, a Eurostat obliczył, że aż 45%. Natomiast w roku następnym (1991) analogiczne dane to 86% oraz 55%.

Z dużym prawdopodobieństwem można powiedzieć, że w 1990 r. GUS nie objął całego importu z EWG. Przyczyny mogą być różne: związane ze spóźnionymi zapisami zgłoszeń celnych, ale także oczywiście tkwić w przemycie i nie rejestrowanym imporcie. Oczywiście w imporcie nie umieszczono pokażnej pomocy charytatywnej, około 300 milionów \$, która nie była wtedy obejmowana przez GUS, a ponadto pewne różnice są związane z tym, że od 1991 r. rejestrowaliśmy jeszcze wyłącznie handel

<sup>1)</sup> Dr Krzysztof Marczewski jest pracownikiem naukowym Szkoły Głównej Handlowej i byłym Zastępcą Prezesa GUS.

---

zagraniczny według zasady: kraj sprzedaży, kraj kupna, natomiast Eurostat stosował już zasadę: kraj przeznaczenia, kraj pochodzenia. Mimo wszystko różnica w wartościach bezwzględnych w imporcie Polski ze Wspólnoty Europejskiej wykazanych przez Eurostat oraz przez GUS jest zbyt duża, żeby można było wszystko na podane tu przyczyny złożyć.

Innym problemem pozostaje dla mnie sprawa, dlaczego my podajemy, że mieliśmy dwa razy większe tempo wzrostu eksportu (30%) w 1991 roku niż to podają Wspólnoty (14,5%). Przypuszczam, że może tu mieć duże znaczenie eksport usług budowlanych, którego Zachód już od dawna nie uwzględnia w handlu towarami, a my jeszcze uwzględnialiśmy.

I może być też coś, co moim zdaniem wadliwie rzutuje na wyniki bo obciąża je w porównaniu z obliczeniami dla roku 1992. Grudzień zawsze charakteryzuje się dużymi obrotami, ale w 1991 roku były one nieprawdopodobnie wysokie. Może chciano uniknąć wypełnienia formularzy SAD, tak że duża część tego eksportu, którą normalnie zaliczano by na rok 1992, obciążała rok poprzedni. Nie upieram się jednak przy tej interpretacji, bo nie jestem pewien na ile ona jest słuszna.

To jest w ogóle ciekawy problem, co się zdarzyło wtedy w eksporcie. Dane za 1992 rok mam z Eurostatu tylko do października. One mówią, że eksport wzrósł, po przeliczeniu na dolary, o 18%, import zaś około 7,5%. Natomiast co do naszych danych to niestety muszę powiedzieć, że GUS tutaj zrobił unik i nie podał po prostu tej informacji o zmianie wartości w stosunku do roku poprzedniego. Po prostu miał trudności ze zrobieniem porównywalnym danych z 1991 r. Dla towarów jednak zrobił to i wielka szkoda, że mamy możliwości porównania lat 1990 i 1991, natomiast w ujęciu geograficznym takiego porównania zrobić nie można.

Natomiast jeżeli chodzi o wartości bezwzględne to GUS podaje, że za 10 miesięcy 1992 r. zanotowaliśmy saldo ujemne 232 miliony \$, chociaż w 1991 roku mieliśmy nadwyżkę 560 milionów \$, Eurostat zaś stwierdza saldo ujemne miliard \$, a jednocześnie informuje, że w 1992 roku w porównaniu z rokiem poprzednim zmniejszyliśmy deficyt dwukrotnie, bo w 1991 r. mieliśmy deficyt 2 miliardy \$.

To bardzo ważna sprawa wyjaśnianie i eliminowanie różnic w obliczaniu wyniku dwustronnych stosunków naszych z EWG.

# OCENA STOSOWANEJ METODOLOGII BADAŃ STATYSTYCZNYCH

*Andrzej S. Bratkowski<sup>1)</sup>*

Nie da się ogólnie ocenić metodologii stosowanej w badaniach statystycznych, ponieważ nie ma czegoś takiego jak ogólna metodologia statystyki. Na dobrą sprawę należałoby omówić wskaźnik po wskaźniku, ale oczywiście nikt samodzielnie, ani nawet w dosyć dużej grupie badawczej, nie jest w stanie przeanalizować wszystkich wskaźników. Interesując się różnymi danymi natrafiamy jednak na podobne problemy. Mogą one stanowić pewną podstawę do różnych uogólnień dotyczących metod badań statystycznych. Według mnie mamy trzy główne przyczyny problemów w opracowaniach statystycznych.

Pierwsze stanowią pewne zjawiska nowe, ewentualnie takie, które gdzieś już wystąpiły, ale marginalnie. Obecnie gwałtownie nabierają one ważności, a cała „aparatura pomiarowa” statystyki nie została dostatecznie szybko na nie przestawiona. Tu cała szara sfera byłaby najbardziej typowym przykładem, jednak myślę, że nie należy się ograniczać tylko do tego zagadnienia.

Wydaje się, że to samo można powiedzieć o pewnych zjawiskach finansowych, które przez cały 1990 rok były jeszcze badane według tradycyjnej metodyki, a zmiany wprowadzone w następnych latach są niewystarczające.

Dosyć istotnym takim nowym elementem, na który ostatnio natrafiłem, jest brak danych o wielkości kredytów zagranicznych uzyskiwanych z pominięciem polskiego systemu bankowego, a jest to przecież zjawisko, które w jakimś momencie może stanowić zaskoczenie dla naszego bilansu płatniczego, analogicznie jak zaskoczeniem był w drugiej połowie 1990 r. import przy-

watny, który od zera urósł prawie do 50% całego naszego importu. Chciałbym więc uczulić Główny Urząd Statystyczny, że trzeba przewidywać jakie zjawiska staną się ważne w przyszłości i z wyprzedzeniem organizować odpowiednie badania. W przeciwnym razie powstawać muszą poważne luki w statystycznym opisie rzeczywistości.

W przypadku drugiej i trzeciej przyczyny kłopotów statystycznych, problemy wyboru metodyki wysuwają się na czoło.

Druga przyczyna tych kłopotów to skala zmian ilościowych i jakościowych, a także niestykanie duże wahania tych zmian w bardzo krótkim okresie. Tu największym utrudnieniem dla statystyki była inflacja 1989 roku, która niestykanie zaciemniła wszelkie dane dotyczące realnych wielkości. Myślę, że można powiedzieć nie tylko o gospodarce Polski, ale i o dowolnym kraju świata, w którym przez jakiś czas była wysoka inflacja, że dane statystyczne dotyczące tego kraju są niespójne i zawierają mnóstwo błędów. Jako przykład mogę tu podać pewne błędy w ustalaniu dochodu narodowego. Oprócz tego, że nie obserwowaliśmy całego sektora prywatnego, to był jeszcze problem z zapasami. Jeżeli bowiem następuje gwałtowny skok inflacji, a potem gwałtowny jej spadek to – biorąc pod uwagę, że różne wielkości ekonomiczne z różnym opóźnieniem reagują na zmiany cen – ustalenie zmian wielkości realnych wymaga stosowania specjalnych metod. Na przykład, rzeczą ważną z punktu widzenia dochodu narodowego jest opóźnienie nominalnych wielkości kosztów spowodowanych inflacją w stosunku do zmian wielkości przy-

<sup>1)</sup> Dr Andrzej S. Bratkowski jest pracownikiem naukowym i reprezentował Fundację CASE.

---

chodu. Ze względu na to, że wpływ inflacji na nominalną wysokość kosztów jest bardziej rozłożony w czasie niż na nominalną wysokość przychodów, realne koszty w 1990 roku zostały nieco zawyżone. Dla uzyskania prawidłowego wyniku uwzględniającego efekt inflacyjny z 1989 roku, deflatory dla kosztów powinny być obliczane dla trochę innego okresu (wcześniejszego 2-3 miesiące) niż deflatory dla przychodów. Nie zrobiono tego, co moim zdaniem spowodowało zaniżenie dochodu narodowego, o co najmniej kilka, jakieś dwa lub trzy punkty procentowe.

To jest jeden przykład, ale oczywiście jest wiele problemów związanych ze strukturą i jakością produkcji, które najbardziej utrudniają oceny na podstawie liczb tych zmian, jakie zaszły w gospodarce. W pewnych przypadkach można było i można nadal sięgać do bardziej szczegółowych danych i próbować poprawiać wcześniejsze obliczenia. Na pewno dotyczy to dochodu narodowego. Mając bardziej szczegółowe informacje, można wprowadzić korekty wielkości kosztów. W agregacji indeksów cen dla kosztów wykorzystywano ich struktury z 1984 roku, przez co uzyskiwano bardzo dziwne wyniki, jak np. spadek produkcji dodanej w energetyce o 50%, chociaż z liczb naturalnych widać, że nie mógł on przekroczyć 10%. Z tego co właśnie dowiedziałem się dzisiaj przed spotkaniem, GUS będzie takie bardziej szczegółowe badania prowadził i wprowadzał korekty popełnionych w przeszłości błędów.

W przypadku handlu zagranicznego wystąpiły zasadnicze problemy z wyznaczaniem deflatorów cen związane z przejściem na rozliczenia dewizowe w handlu z krajami byłej RWPG. Mamy podstawy by sądzić, że deflatory cen szczególnie w imporcie zostały bardzo zaniżone. I efekt jest taki, że oficjalna statystyka zawyżyła wolumen tej części importu, która była objęta badaniem statystycznym. Bo z kolei drugą sprawą jest to, że istniała duża grupa handlujących, którzy w ogóle w tej statystyce nie zostali uwzględnieni. Nie ma ogólnych recept, jak należałoby przy tak wielkich zmianach strukturalnych i jakościowych konstruować wskaźniki statystyczne. Można tylko powiedzieć jedno, że przy takich dużych zmianach jakościowych w gospodarce absolutnie nie można opierać jakichkolwiek ocen na

pojedynczych liczbach, będących jakby syntetycznymi miernikami zachodzących zmian. To czy dochód narodowy wzrósł o 2 lub 3%, czy spadł o 10% samo w sobie niewiele mówi, trzeba jeszcze zbadać, co się za tym kryło. Dotyczy to wszystkich agregatów makroekonomicznych. Trzeba analizować strukturę handlu, strukturę produkcji, strukturę konsumpcji. Generalna konkluzja jest więc taka, że nie oczekujemy zbyt wiele po metodologii statystycznej, że to nie jest tak, iż statystycy mogą wymyślić jakieś dwa czy trzy wskaźniki, które dostarczą syntetycznego obrazu zachodzących zmian i zwolnią ekonomistów od analizowania znacznie szerszego kontekstu ilościowego tych zmian. To oczywiście nie zmienia faktu, że pewne błędy metodyczne były popełnione i że mogą one być częściowo korygowane. Trzeba też pamiętać, że przy dużych zmianach strukturalnych pojawiają się problemy z interpretacją podstawowych pojęć ekonomicznych. Na przykład przy tak zróżnicowanej strukturze wzrostu cen, z jaką mamy obecnie do czynienia, nie bardzo właściwie wiadomo, co to jest realna stopa procentowa. W zależności od tego, jakim wskaźnikiem się posługiwać, uzyskuje się bardzo różne wnioski.

Wreszcie trzecim źródłem problemów statystyki jest to, że przy wszystkich porównaniach dotyczących aktywności gospodarczej trzeba pamiętać, że punkt odniesienia w tych porównaniach był sztuczny. To znaczy cała statystyka, która opierała się na nierynkowych cenach, na nierynkowych zasadach funkcjonowania gospodarki była moim zdaniem fałszywa. W najlepszym razie można ją traktować jako statystykę ponoszonych nakładów, gdyż wszystkie mierniki aktywności gospodarczej przed 1990 rokiem były konstruowane z wykorzystaniem cen tworzonych w oparciu o formuły kosztowe. Dlatego brak nam danych na temat efektów tej działalności. To zasadniczo się zmieniło w latach 1990-1991, kiedy rynek rzeczywiście zweryfikował niektóre rodzaje nakładów i po prostu wyrzucił z gospodarki produkcję niepotrzebną lub zbyt drogą. Dlatego trzeba szukać lepszych odpowiedników właściwej rynkowej wyceny wartości różnego rodzaju dóbr i usług wytwarzanych w przeszłości. Tego nie zrobiono i zresztą jest to na pewno bardzo trudne badanie. W każ-



---

dym razie w tej sytuacji mówienie o tym, że nam spadł nasz dochód narodowy o tyle, a inwestycje o tyle, jest mylące. Szczególnie inwestycje są przykładem dość rażącym, bo to są przecież nakłady inwestycyjne, a traktuje się je jako miernik zdolności produkcyjnych. Przez wiele lat ponoszono coraz większe i coraz mniej efektywne nakłady, co w gruncie rzeczy było tylko marnotrawstwem, a jednocześnie dawało wysokie wskaźniki dynamiki dochodu narodowego. Dzisiaj rzeczywistość wielkość inwestycji nieco spadła, natomiast widać bardzo duży wzrost importu inwestycyjnego, który przecież jest importem technologii, co ma ogromne znaczenie dla perspektyw rozwojowych gospodarki. Mnie się wydaje, że mówienie w odniesieniu do ostatnich lat o recesji jest właśnie taką uproszczoną oceną,

opartą na kilku wskaźnikach syntetycznych nie uwzględniających zmian jakościowych. Nie mieliśmy wielkiej recesji, mieliśmy dwa zupełnie równoległe zjawiska, które zachodziły w tej gospodarce. Jedno polegało na tym, że to, co było niepotrzebne i co było zbyt drogie itd., likwidowano, a równoległe do tego mieliśmy zupełnie oszałamiający rozwój sektora prywatnego, mieliśmy duże zmiany strukturalne, przede wszystkim związane z otwarciem gospodarki i niezależnie od tego, jak oceniamy dokładność tych wskaźników, to rząd wielkości jest taki, że po prostu jest to widoczne. Operowanie średnią z tych zupełnie przeciwstawnych tendencji i mówienie, że mieliśmy recesję, jest po prostu nieuzasadnione, bo mieliśmy jednocześnie i głęboką recesję i wielkie ożywienie.



# KONIUNKTURA GOSPODARCZA W ŚWIELE WSKAŹNIKÓW JAKOŚCIOWYCH

*Ryszard Barczyk<sup>1)</sup>*

Metoda testu koniunkturalnego należy współcześnie do ważniejszych przy diagnozowaniu i prognozowaniu zmian poziomu aktywności ekonomicznej w systemach gospodarczych, gdzie dominują mechanizmy rynkowe. Polega ona na wykorzystaniu specjalnie przygotowanej ankiety, za pomocą której od poszczególnych podmiotów gospodarczych są otrzymywane niewymierne informacje cząstkowe o aktualnych i przyszłych kierunkach zmian koniunktury gospodarczej. Podejmując próbę adaptacji tej metody do badania fluktuacji w gospodarce polskiej okresu transformacji, przyjęto kilka założeń, z których trzy, jak się wydaje, były najważniejsze. Pierwszym z nich było przeświadczenie, że w okresie przebudowy występują krótko- i średniokresowe wahania koniunkturalne. Geneza i morfologia tych oscylacji są wynikiem działania nie tylko wewnętrznych, obiektywnych mechanizmów gospodarczych, lecz także są one konsekwencją ocen, odczuć i przewidywań poszczególnych podmiotów. Subiektywne reakcje uczestników życia gospodarczego są z kolei m.in. skutkiem dominującego wcześniej systemu gospodarczego w naszym kraju.

Drugą przesłanką istotną dla decyzji o zastosowaniu w badaniu gospodarki polskiej testu koniunkturalnego to przeświadczenie o tym, że wykaże on również wszystkie swoje zalety w systemie podlegającym przekształceniom społecznym, politycznym i gospodarczym. Wśród tych zalet do najważniejszych należą:

– wysoka komplementarność wskaźników jakościowych, obliczonych na podstawie badań metodą testu koniunkturalnego w stosunku do oficjalnych danych statystycznych. Otrzymane wyniki doskonale są uzupełniane

przez dane ilościowe, gdyż pochodzą one od tych samych podmiotów gospodarczych, choć w innej aniżeli dotychczas stosowanej formie (odpowiedzi jakościowego typu: poprawa, pogorszenie, brak zmian; sytuacja dobra, zła, zadowolająca) przekazują informacje o aktualnych i przyszłych kierunkach zmian koniunktury gospodarczej;

– wyprzedzający charakter wskaźników jakościowych w stosunku do danych ilościowych, charakteryzujących rzeczywiste zmiany gospodarcze, co umożliwi budowanie krótkookresowych prognoz koniunktury;

– wysoka wrażliwość wskaźników jakościowych na zmiany koniunktury, wyższa aniżeli indeksów ilościowych, która przejawia się w stosunkowo wysokiej amplitudzie wahań występujących w tych szeregach czasowych.

Kolejnym czynnikiem determinującym zakres i charakter badań koniunktury w gospodarce polskiej lat 90. za pomocą metody testu była konieczność uzyskania indeksów jakościowych: prostych i złożonych, które byłyby w pełni porównywalne ze stosowanymi w gospodarkach krajów rozwiniętych. Czynnikiem ten jest szczególnie ważny teraz, gdy trwają dyskusje na temat warunków i możliwości integracji gospodarki polskiej ze Wspólnotami Europejskimi.

Otrzymane od respondentów – jako odpowiedzi na pytania specjalnie przygotowanej ankiety – informacje służą do konstrukcji wskaźników jakościowych prostych i złożonych. Indeksy proste są obliczane jako różnica między procentowym udziałem odpowiedzi pozytywnych na dane pytanie i procentowym udziałem odpowiedzi negatywnych na to samo pytanie. Wskaźniki złożone to tzw. indeksy ogólnego klimatu koniunkturalnego, które łączą w

<sup>1)</sup> Prof. dr hab. Ryszard Barczyk jest kierownikiem Katedry Koniunktury Gospodarczej Akademii Ekonomicznej w Poznaniu.

---

sobie oceny respondentów o bieżącej sytuacji gospodarczej i ich oczekiwania co do kształtowania się koniunktury w najbliższej przyszłości.

Oszacowane wartości wskaźników jakościowych są zawarte w przedziale <+100; -100>. Oznacza to, że:

– sytuacja w zakresie badanego zjawiska lub procesu gospodarowania jest pomyślna, jeżeli obliczony wskaźnik ma wartość dodatnią i jest ona tym lepsza, im ta wartość jest bliższa +100;

– sytuacja koniunkturalna jest zła, jeżeli wartość indeksu jest ujemna, a tym gorsza im ta wartość jest bliższa wartości -100.

Na podstawie kwartalnych badań prowadzonych od 1988 r. przez Akademię Ekonomiczną w Poznaniu na próbie około 650 przedsiębiorstw polskiego przemysłu przetwórczego można zaobserwować, począwszy od III kwartału 1991 r., stopniowy wzrost wartości wskaźników ogólnego klimatu koniunkturalnego. Może to oznaczać, że w latach 1992-1993 poziom aktywności gospodarczej w tej sferze wytwarzania stopniowo się poprawia. Załamanie koniunktury, zaobserwowane na początku lat 90., osiągnęło swoje dno w II kwartale 1991 roku. Jak wynika z analizy kształtowania się badanych indeksów jakościowych, załamanie to było głębsze aniżeli spadek, który wystąpił w II kwartale 1990 r. Takiego kształtowania się koniunktury gospodarczej nie potwierdzają indeksy dynamiki wartości produkcji sprzedanej (w cenach stałych). Załamanie gospodarcze, obserwowane przy analizie tej grupy danych empirycznych, było bowiem w II kwartale 1990 r. zdecydowanie głębsze aniżeli spadek w IV kwartale 1991 r. Począwszy od II kwartału 1991 r. (dla indeksów klimatu koniunkturalnego) i od IV kwartału 1991 r. (dla indeksów produkcji sprzedanej) w polskim przemyśle przetwórczym można zaobserwować bardzo powolną poprawę poziomu aktywności gospodarczej.

Zaobserwowane różnice w kształtowaniu się analizowanych danych jakościowych i ilościowych mogą wynikać ze stwierdzonej stosunkowo wysokiej wrażliwości wskaźników oszacowanych na podstawie metody testu koniunkturalnego. Wrażliwość ta przejawia się m.in. w tym, że w danych jakościowych występują punkty zwrotne, których nie można wyodrębnić w danych oficjalnych lub też amplituda wahań zaobserwowanych we wskaźnikach ja-

kościowych jest zdecydowanie wyższa aniżeli amplituda oscylacji istniejących w szeregach czasowych wskaźników ilościowych.

Coraz wyraźniejsze symptomy ożywienia w przemyśle przetwórczym współwystępują ze stałym spadkiem aktywności gospodarczej w budownictwie polskim. Analizy empiryczne prowadzone przez ośrodek poznański na próbie około 300 przedsiębiorstw budowlanych jednoznacznie wskazują, że szczególnie ostry i w dalszym ciągu pogłębiający się kryzys jest widoczny wśród przedsiębiorstw budujących obiekty mieszkaniowe. Załamanie wśród przedsiębiorstw budownictwa przemysłowego jest zdecydowanie płytsze.

Szczegółowa analiza poziomu aktywności gospodarczej w przemyśle przetwórczym w I kwartale 1993 r. prowadzona na podstawie wskaźników jakościowych prostych pozwala na stwierdzenie, że:

– respondenci ocenili ogólną sytuację gospodarczą w I kwartale 1993 r. jako nieco gorszą aniżeli w ostatnim kwartale 1992 roku. Powodem był przede wszystkim spadek koniunktury gospodarczej w przemyśle elektromaszynowym. Nieznaczną poprawę poziomu aktywności odnotowano w przemyśle chemicznym, lekkim i spożywczym;

– stosunkowo więcej analizowanych przedsiębiorstw przemysłowych sygnalizowało spadek dynamiki wartości produkcji sprzedanej w porównaniu z tymi, którzy twierdzili, że ich produkcja wzrosła. Może to oznaczać, że w pierwszych miesiącach 1993 roku dynamika wzrostu produkcji sprzedanej została zahamowana;

– więcej przedsiębiorstw w I kwartale analizowanego roku natrafiło na barierę popytu. Ograniczenie możliwości sprzedaży wytworzonych produktów dotyczyło w jednakowym stopniu wszystkich analizowanych grup gałęzi przemysłu;

– szybszy spadek dynamiki popytu aniżeli produkcji sprzedanej doprowadził do wzrostu w I kwartale badanego roku poziomu zapasów wyrobów gotowych. Jedynie w przemyśle spożywczym sytuacja nieznacznie poprawiła się, co może być spowodowane wahaniami sezonowymi;

– w stosunku do ostatniego kwartału 1992 roku możliwości finansowe badanych przedsiębiorstw przemysłu przetwórczego uległy w pierwszych miesiącach 1993 r.

---

niewielkiemu pogorszeniu. Oszacowane w tym zakresie wskaźniki jakościowe świadczą o utrzymywaniu się w długim okresie bardzo trudnej sytuacji finansowej przedsiębiorstw i o braku istotniejszych różnicowań międzygałęziowych;

– w analizowanym kwartale 1993 r. zmniejszyła się presja na rynku siły roboczej, gdyż ilość przedsiębiorstw sygnalizujących nadwyżki zatrudnienia w stosunku do poziomu produkcji pozostała bez zmian. Może to oznaczać zmniejszenie się w pierwszych miesiącach tego roku dynamiki wzrostu liczby bezrobotnych w naszym kraju.

Diagnoza sytuacji w pierwszym kwartale 1993 r. w budownictwie polskim wskazuje na zdecydowanie niższy poziom koniunktury aniżeli w przemyśle przetwórczym. W szczególności można stwierdzić, że:

– w I kwartale 1993 r. w stosunku do poprzedniego kwartału nastąpił w ocenie respondentów dalszy spadek zamówień na prace budowlane. Dynamika tego spadku była mniej więcej równa wśród przedsiębiorstw budujących mieszkania jak i obiekty przemysłowe. Poziom zamówień był jednakże zdecydowanie niższy na prace, których efektem są obiekty mieszkaniowe;

– ceny na usługi budowlane wzrosły w I kwartale 1993 r. w mniejszym stopniu aniżeli w ostatnim kwartale poprzedniego roku. Przyrost ten silniej zaznaczył się wśród przedsiębiorstw budownictwa przemysłowego;

– w wyniku zmniejszenia portfela zamówień nastąpiło w badanym okresie dalsze pogorszenie sytuacji finansowej przedsiębiorstw budowlanych zajmujących się przede wszystkim budową mieszkań.

Pierwsze wyniki empiryczne kształtowania się koniunktury w gospodarce polskiej, uzyskane za pomocą metody testu koniunkturalnego w ośrodku poznańskim, były na tyle ciekawe poznawczo, że Główny Urząd Statystyczny w Warszawie i Akademia Ekonomiczna w Poznaniu podjęły wspólne prace wdrożeniowe, mające na celu rozszerzenie tych analiz na większą próbę respondentów.

W badaniach diagnostycznych i prognostycznych, prowadzonych od czerwca 1992 r. w miesięcznych odstępach czasu, bierze udział ponad 2500 przedsiębiorstw przemysłu przetwórczego. W identycznych analizach empirycznych dotyczących przedsiębiorstw budowlanych, realizowanych od czerwca 1993 r. także w przekrojach miesięcznych, uczestniczy około 2000 respondentów.



## Omówienie dyskusji

*Grażyna Pruban*

Dyskusję prowadzili Leszek Balcerowicz i Tadeusz Baczko.

Jako pierwszy zabrał głos Bohdan Wyżnikiewicz z Instytutu Gospodarki Rynkowej wskazując, że szara sfera jest najlepszym przykładem zjawiska, którego kompetentna, odpowiedzialna ocena jest niemal niewykonalna. Z zasady nie definiuje się tego pojęcia, ale może ono być określone różnie. Dokładnie wiadomo, że najwyższe oszacowania wielkości tego zjawiska dają zawsze badania wykorzystujące jako punkt odniesienia rynek pracy, ale jest to tylko jedno z wielu możliwych podejść do tematu – inne badania dają zupełnie odmienne rezultaty. Nie można jednak w żadnym wypadku na podstawie jakiegoś oszacowania wielkości szarej sfery prorokować o jej wpływie na dynamikę produktu krajowego brutto, tym bardziej że szara sfera istniała także przed okresem transformacji.

Następnie dyskutant zwrócił uwagę na zagadnienia związane ze statystyką, sektora prywatnego. Stwierdził, że nie wystarczy znajomość samego faktu, że rentowność tego sektora jest bliska zeru czy wręcz ujemna, trzeba wiedzieć, dlaczego tak jest. System finansowy prowokuje sytuację, że właściciele przedsiębiorstw dla uniknięcia podatku, całość lub część własnych wydatków wliczają w koszty. Dla ubezpieczeń ZUS-u podaje się zwykle płace minimalne; inwestycje wlicza się w koszty, bardzo często kupując sprzęt w kawałkach (np. komputer). Obserwuje się także tworzenie pozornych obrotów między firmami i są to obroty nierejestrowane.

Profesor Paweł Glikman z Instytutu Nauk Ekonomicznych PAN stwierdził, że czuje się upoważniony do zabrania głosu jako ten, który wykorzystuje i analizuje dane statystyczne. Nawiązał do wystąpienia profesora Zienkowskiego stawiając pytanie: co w obecnym specyficz-

nym okresie naszej gospodarki należy uznać za korzystne dla niej, a co nie? Poruszył dwie sprawy: majątku trwałego i inwestycji spraw zasygnalizowanych przez pana Bratkowskiego, oraz bezrobocia.

Zwróćmy uwagę na statystykę środków trwałych, która w całym okresie Polski powojennej wykazywała trend dodatni. Jeżeli jako punkt odniesienia przyjmiemy rok 1980, to w latach 1980-1991 wzrost środków trwałych był rzędu 45%, natomiast spadek produkcji (PKB) wyniósł 20-25%. Z zestawienia tych dwu liczb widać, że duży potencjał produkcyjny majątku trwałego (ponad 50%) został nie wykorzystany.

Dyskutant określił, że w dziedzinie środków trwałych i inwestycji zjawiskiem korzystnym jest wzrost stopy likwidacji, czyli relacja likwidowanych urządzeń w stosunku do majątku na początku roku. W Polsce wskaźnik ten wynosi 1%, w krajach zachodnich 6%, czyli rotacja jest tam znacznie szybsza.

Drugą sprawą było zatrudnienie. W ostatnich latach (1991-1992) produkcja mocno spadła, natomiast zatrudnienie niewspółmiernie mniej. Jednak według szacunków prof. Glikmana – oprócz jawnego bezrobocia (około 2.600.000 osób) mamy co najmniej drugie tyle ukrytego, rzędu 2.500.000 – 2.800.000 osób zatrudnionych tylko nominalnie, a faktycznie nie pracujących.

Anna Fornalczyk – Prezes Urzędu Antymonopolowego z racji Urzędu i swojej pracy stwierdziła, że statystyka robi co może, żeby dostosować się do nowych zjawisk, o których mówił pan Bratkowski, obejmując zupełnie nowe pola badań. Rzeczywiście pierwszym krokiem jest badanie rynku i pozycji przedsiębiorstwa na tym rynku. W gospodarce polskiej statystyka jest niezbędna, żeby można było określić pozycję naszego sprzedawcy na światowym

---

rynku. I tu stajemy przed trudnościami, bo dane statystyczne są niestychnie ogólnikowe.

Nawiązując do pytania profesora Zienkowskiego o mierniki w procesie transformacji wyjaśnia, że zgadza się z panem Bratkowskim: naszej sytuacji nie można nazywać recesją. Klasycznym przykładem tego co się dzieje w zmieniającej się strukturze produkcji w Polsce jest budownictwo mieszkaniowe, w którym z różnych przyczyn odrzuca się obecnie wielką płytę i fabryki domów.

Gdy nie ma statystyki, wszystko trzeba mierzyć „na oko”. Gotym okiem widać bum budownictwa jednorodzinnego, który byłby może jeszcze większy, gdyby nie mnóstwo administracyjnych ograniczeń, m.in. przy wykupie ziemi.

Otóż z doświadczeń urzędu antymonopolowego wiadomo, że muszą być mierniki ilościowe i jakościowe, ponieważ ocenianie tylko skutków z pominięciem przyczyn jest niemiernodajne.

Czasami bywa, że dane statystyczne dają negatywny obraz, a jednak w rzeczywistości to, co wydawało się być jak najbardziej negatywne, okazało się jak najbardziej korzystne. Złożone cele transformacji wyznaczają mierniki, jakie należy stosować. Trzeba też pamiętać, że nawet najlepsze przedsięwzięcie restrukturyzacyjne nie może przynieść pozytywnych efektów w pierwszym okresie.

Reasumując: Rzeczywiście to bardzo ważna sprawa jak mierzyć, jak wyjaśniać. Powinno się stosować do analiz metody ilościowe i jakościowe, a przede wszystkim trzeba mieć jasno sprecyzowane cele, którym statystyka ma służyć.

Wojciech Kostrzewa – Prezes Polskiego Banku Rozwoju zwrócił uwagę, że mierzenie przez GUS aktywności gospodarczej małych przedsiębiorstw (zatrudniających mniej niż 5 osób) jest bardzo trudnym zadaniem, a już prawie zupełnie niemożliwym, gdy jako podstawy do szacunku używa się deklaracji dla ZUS-u. Wpłaty dla Zakładu Ubezpieczeń są bowiem w swej obecnej konstrukcji niczym innym, jak podatkiem dochodowym od osób fizycznych. W związku z tym większość tych małych przedsiębiorstw podaje, że płace zatrudnionych w nich kształtują się na poziomie minimalnym.

Druga uwaga dotyczy statystyki handlu zagranicznego. Jeżeli przyjąć dane Eurostatu za prawdziwe, wów-

czas powstają bardzo ciekawe pytania badawcze: w jaki sposób bylibyśmy w stanie zlikwidować deficyt bilansu płatniczego? Czy polska gospodarka jest tak szalenie atrakcyjna dla zagranicznych inwestycji bezpośrednich, tylko one nie są ujawniane, czy też nie ujawnione transfery ludności i osób prywatnych są tak olbrzymie? Jeżeli tak było, oznacza to, że mamy duże rezerwy.

Trzecia sprawa interesuje dyskutanta ze względów zawodowych, a jest to kwestia realnej stopy procentowej i jak ją należy mierzyć? To pytanie dla każdego kto jest związany z bankowością, ale także dla makroekonomistów i przedstawicieli banku centralnego. Trzeba przy tym wziąć pod uwagę fakt, że w kraju od co najmniej trzech lat (dokładnie czwarty rok z rządu) mamy ogromne różnice między trzema podstawowymi wskaźnikami: wskaźnikiem zmian cen dóbr i usług konsumpcyjnych, cen producentów oraz deflatorem PKB. Ten ostatni jest publikowany z dużym opóźnieniem i w zasadzie nie stanowi praktycznego wskaźnika dla bieżącego sterowania. Należałoby więc zadać pytanie: czym powinni kierować się banki (centralny, komercyjne) oraz politycy gospodarczy? Czy rzeczywiście jest uzasadnione pozostawianie więzienia stopy inflacji konsumpcyjnej? – tym bardziej że ten wskaźnik w państwie znajdującym się w procesie transformacji jest generowany przez zupełnie inne czynniki, niż w państwach liberalizujących swoją gospodarkę rynkową?

Krzysztof Telega z Polskiego Banku Rozwoju wyraził opinię o możliwościach wykorzystania statystyk i prognoz w praktyce bankowej: Muszę stwierdzić, że banki są bardzo wdzięcznym odbiorcą wszelkiego rodzaju materiałów statystycznych, opisujących stan ex post, a jeszcze wdzięczniejszym, jeśli chodzi o prognozy gospodarcze: jednocześnie zaś mają wysokie wymagania w stosunku do statystyki. Dlaczego tak jest? Dlatego, że dobre dane statystyczne i prognozy zmniejszają ryzyko działania banku w trzech płaszczyznach:

Pierwsza to działalność operacyjna, mianowicie ocenianie ryzyka kredytowego i inwestycyjnego. Dobre prognozy dotyczące kształtowania się podstawowych wielkości ekonomicznych umożliwiają lepszą relatywizację danych zawartych we wnioskach kredytowych czy też inwestycyjnych, kierowanych do nas przez kredytobiorcę. Jed-



---

nakże konieczne jest zachowanie jednolitości przyjętej metodyki, co umożliwi porównywanie międzyokresowe i budowanie odpowiednio skonstruowanych szeregów czasowych przy projekcji wielkości finansowych. Z drugiej strony przy wnioskach kredytowych napotyka się poważne problemy w określaniu stopy dyskonta, realnej stopy procentowej, a dzieje się tak ze względu na brak wiarygodnych prognoz dla tychże wielkości na najbliższą przyszłość. Banki są również zainteresowane otrzymywaniem informacji statystycznej w nowych przekrojach informacyjnych: dane winny być podzielone pod względem struktury własnościowej, branżowej, a nawet terytorialnej. Idealne rozwiązanie to otrzymywanie zbiorczej informacji branżowo-terytorialnej z każdego regionu, aby w momencie, gdy wpłynę wniosek kredytowy z danego regionu Polski, bank miał bazę porównawczą i mógł umiejscowić kredytobiorcę na tle jemu podobnych i w branży, i w regionie.

Drugą płaszczyzną jest działalność planistyczna, od planu strategicznego po plany operacyjne. Korzysta się w niej z wielkości makroekonomicznych, jak szacowanie wielkości nakładów inwestycyjnych czy też nadwyżki bilansowej brutto w przedsiębiorstwach, które niejako są tym źródłem finansowania przyszłych inwestycji, a także z przyjętego poziomu rezerw dewizowych czy kursu dewizowego.

Trzecia płaszczyzna to samoocena banków. Bank (zarząd banku) dysponując kapitałem nie swoim, ale udziałowców, musi móc odpowiedzieć na pytanie: czy polityka prowadzona przez bank doprowadziła do deprecjacji tego kapitału? Mamy tutaj trzy punkty odniesienia: inflacja konsumpcyjna, inflacja przemysłowa i deflator PKB. W zależności od punktu odniesienia możemy mówić o realnie dodatniej bądź ujemnej stopie wzrostu kapitału netto.

Dr Tadeusz Kochanowski z Instytutu „Zmiany” podzielił opinię pana Bratkowskiego, że w gospodarce polskiej nie ma recesji, a tylko oczyszczanie z pozostałości przeszłości. Wskazał na trudności uchwycenia i objęcia statystyką nowych rodzajów produkcji i usług. Nie zgodził się z poglądem pani prezes Fornalczyk na temat rozkwitu budownictwa indywidualnego. Postulował wyliczanie wynagrodzeń i dochodów ludności w układzie terytorialnym i dostosowania odpowiedniego do tego polityki społecznej.

Prof. Leszek Zienkowski z Zakładu Badań Statystyczno-Ekonomicznych GUS i PAN podzielił się wątpliwościami na temat metodologii badań statystycznych. Według niego w momencie gwałtownych przemian strukturalnych gros zainteresowań powinno być poświęcone nie tyle badaniom zmian w dynamice tych zjawisk, ile analizie ich charakteru. Problem polega głównie na badaniach strukturalnych i daleko idącej ich dezagregacji.

Z kolei Profesor poinformował, że w badaniach GUS zakładano, iż zarówno uprzednio, jak i obecnie istnieje szara sfera gospodarki, która rośnie w miarę wzrostu gospodarki prywatnej. Stwierdził, że do wyznaczenia stopy procentowej winny być brane inne czynniki, a nie tylko ruch cen. Podał, iż doceniając potrzebę informacji regionalnej GUS planuje wprowadzenie statystyki według zakładów i jednostek terytorialnych. Na koniec stwierdził, że różnice w danych o eksporcie w 1990 r. oraz imporcie w 1991 r. między Eurostatem i Polską są stosunkowo duże. Normalnie w krajach Europy Zachodniej takie różnice są większe i są wręcz regułą. Zgodził się z panem Wyżnikiewiczem, że duży wpływ na dane statystyczne ma ewidencyjne przeliczanie obrotów między ostatnim miesiącem jednego roku i pierwszym kwartałem następnego.

Prowadzący dyskusję Leszek Balcerowicz skorzystał z prawa udzielenia sobie głosu w celu podzielenia się swoimi refleksjami dotyczącymi z jednej strony statystycznego opisu zjawisk gospodarczych w danym okresie, z drugiej zaś strony ekonomicznej oceny tychże zjawisk. Bardzo trudno o dobrą ekonomiczną ocenę przy złym statystycznym opisie. Jeśli chodzi o statystyczny opis, to składa się on z dość znużonej operacji, jaką jest gromadzenie danych i w tym procesie niezwykle istotna jest kwestia reprezentatywności danych w stosunku do badanego procesu. W opis ten wchodzi również operacje polegające na porównywaniu danych i wszystkie one dotyczą dynamiki. Jeśli się porównuje mechanicznie np. dane z 1989 r. z danymi z roku następnego, to wprowadza się opinię publiczną w błąd.

Z takiego właśnie porównywania wzięta się magiczna liczba -30% spadku płacy realnej w Polsce w 1990 r., która funkcjonuje do dziś dnia i będzie długo funkcjonować. Liczba ta wzięta się stąd, że mechanicznie jakoś tam obli-

---

czony poziom płacy nominalnej zestawiono z poziomem płacy w 1989 r. bez uwzględnienia faktu, że owe poprzednie płace znacznie szybciej rosły niż ceny, a zatem nie był to żaden realny wzrost. Jakakolwiek ekonomiczna analiza wymagałaby innego punktu odniesienia, ale tego nie zrobiono i gdyby jako inny punkt odniesienia wzięto np. poziom płac realnych sprzed wielkiej inflacji, to wynik ukształtowałby się na poziomie -30% spadku płac realnych, ale na -8 czy nawet mniej.

Profesor Leszek Balcerowicz zwrócił również uwagę, że naturalne jest popełnianie błędów, ale przy ich interpretacji trzeba wiedzieć jak są one ukierunkowane. Odnosi bowiem wrażenie, że przynajmniej jeśli chodzi o główne kategorie dynamiki dochodu narodowego i pogłębiania wykazywanego statystycznie jego spadku. Lista błędów, które tu zostały wymienione, jest oczywiście niekompletna, jest ich minimum kilkanaście – w sumie powodują one, że oficjalne do tej pory liczby zostały wyolbrzymione w stosunku do jakiegoś prawdziwego obrazu, o który można się kłócić, ale o którym wiadomo, że jest inny od tego oficjalnie wykazywanego. Jednym z czynników, którym to przypisujemy, jest wstrząs zewnętrzny (dobrym punktem odniesienia jest tu Finlandia, która ma teraz bezrobocie 20%, a 4 lata temu miała 4%). Wchodzimy już zatem na płaszczyznę ekonomicznej oceny zjawisk.

Inną sprawą, w której błędy wydają się być liczone tylko w jednym kierunku, to rentowność przedsiębiorstw. Kwestia bezrobocia jest dyskusyjna – z całą pewnością mamy zjawisko ukrytego zatrudnienia. Pojawia się natomiast pytanie: czy tzw. ukryte bezrobocie przedsiębiorstwa wzrosło czy nie? (Trzeba zachować ogromną ostrożność w podawaniu różnych liczb typu 2 mln, bo wszystko zależy od założenia). Duże znaczenie dla ekonomicznej oceny zjawiska ma statystyczny ich obraz. Całe mnóstwo ocen wzięło się z tego, że posługiwano się jedną magiczną liczbą, np. -20%, -12% i tak to jest do dziś. Tymczasem trzeba mieć jakieś liczby bliższe prawdy i wówczas dokonać operacji polegającej na porównaniu najbliższego prawdziwego obrazu statystycznego z jakimś hipotetycznym obrazem gospodarki, który istniałby w tych samych warunkach początkowych i przy tych samych warunkach zewnętrznych (np. wstrząsie zewnętrznym), ale przy zastosowaniu odmiennej strategii gospodarczej.

Wtedy patrzy się również na zjawiska negatywne (których obecność przy każdej strategii przejścia w trudnej sytuacji w pewnej mierze jest oczywista) i na skalę zjawisk, które można przy pewnych kryteriach zaliczyć do pozytywnych. Ważne, aby ta praca była wspomagana przez coraz lepszy opis zjawisk gospodarczych.

Profesor Ryszard Barczyk z Akademii Ekonomicznej w Poznaniu nawiązał do wypowiedzi panelistów o jakości statystyki, jakości pomiarów, które można byłoby w naszej gospodarce prowadzić, stwierdzając że należy pamiętać o jeszcze jednym aspekcie, który jest poważnym ograniczeniem tych naszych możliwości – my nie dysponujemy żadną hipotezą teoretyczną o tym, czym jest transformacja i jak ona przebiega. Dlatego nie możemy powiedzieć ani jakimi wskaźnikami powiniemy się posługiwać ani oceniać czy wskaźniki, które stosujemy, są adekwatne, czy nie do przyjętej przez nas jakiejś tam hipotezy.

Klasycznym przykładem tego jest dyskusja nad tym, czym jest sytuacja, którą mamy – czy to kryzys, recesja na tle strukturalnym, czy też jest to klasyczna sytuacja recesji w sensie cyklu koniunkturalnego? Czy więc jest to zjawisko krótko- czy średnioterminowe, jakie występuje w gospodarkach rynkowych, czy też jest to długotrwały kryzys strukturalny, z którego wyjście nie będzie na pewno ani łatwe, ani szybkie? Dlatego powstaje obowiązek dla wszystkich obecnych odpowiedzenia sobie na gruncie teoretycznym na pytanie, czym jest ta nasza sytuacja, a także jakie wskaźniki i metody należałoby stosować do jej analizy?

Profesor Stanisław Gomułka z London School of Economics zwrócił natomiast uwagę na dwa szczególnie ważne problemy: porównywalność danych w dłuższym okresie czasu (w szczególności chodzi tu o dynamikę dochodu narodowego), a drugi: jakiego rodzaju systematyczny błąd był popełniany przed transformacją oraz w odwrotnym kierunku idący błąd popełniany teraz – czyli jak należy traktować zmiany jakościowe? Wiadomo, że w krajach zachodnich zmiany produktu, liczenie tych zmian i uwzględnienie tego w dochodzie narodowym jest problemem. W tym sensie tempo wzrostu jest zawsze czymś relatywnym, tzn. międzynarodowe porównywanie dochodów narodowych od czasu do czasu są jakby sprawdzianem porównywalności metod statystycznych, stosowa-

nych w różnych krajach. Wiadomo z badań np. profesora Zienkowskiego i jego grupy, będących próbą porównywania Polski z innymi krajami, że w przeszłości tempo wzrostu dochodu narodowego było zawyżane.

To samo dotyczy prawie wszystkich krajów Europy Wschodniej, a związane jest z tym, że zmiany jakościowe tutaj były mniejsze niż w innych krajach. obecnie występuje błąd w innym kierunku. Nastąpiła bardzo poważna poprawa jakości produktów, nie tylko importowanych, ale również produkcji krajowej i w tym tkwi problem: czy statystyka uwzględnia te zmiany i nie zaniża w związku z tym poziomu i tempa zmian dochodu narodowego?

Profesor Gomułka stwierdził ponadto, że w obserwacji zjawisk występuje asymetria: przed transformacją i po transformacji. Jednak jest jeszcze inna asymetria, która dotyczy okresu przed reformami i po nich. Chodzi tu o inflację i zapasy. Pozostaje bowiem niewyjaśnione, że masa zapasów stanowiła około 35-40% dochodu narodowego 8 lat temu, a obecnie mieści się w granicach 15-20%. Wobec tego powinny być wystąpić ujemne inwestycje w zapasy; mamy spadek zapasów większy niż dochodu narodowego, a tymczasem statystyka z ostatnich lat pokazuje i dodatnie inwestycje w zapasy i dodatni udział dochodu.

Według profesora Gomułka dochód narodowy w latach 1985-1989 rósł wolniej niż pokazywała to statystyka i w 1989 r. wykazał poziom niższy niż był naprawdę. Powiedzmy, że jeśli w 1985 r. mieliśmy poziom 100, to w 1989 nie było 110, jak pokazuje GUS, ale także w okolicy 100%. Przy uwzględnieniu tej korekty spadek dochodów w latach następnych byłby wtedy dużo mniejszy. Mielibyśmy zatem zupełnie inne wyobrażenie nie tylko o poziomie, ale i o dynamice tuż przed transformacją i po okresie transformacji. Wtedy spadki nie byłyby rzędu 20%, ale 10%, od 1989 r. i tłumaczenia, skąd to się wzięło, są zupełnie inne.

Dr Dariusz Ledworowski, Prezes Banku Rolno-Przemysłowego, podkreślił w swojej wypowiedzi, że nie chce usprawiedliwiać statystyki, gdyż sam odczuwał liczne jej braki przy ocenianiu różnych zjawisk. Natomiast wydaje mu się, że przełom z lat 1989-1992 w zakresie handlu zagranicznego, zmian systemowych i metodologii jest bardzo głęboki (każdy rok kumulował nowe elementy).

Dopiero w 1993 roku, czyli po trzech latach transformacji, zawirowania w statystyce handlu zagranicznego nie dają się już wytłumaczyć zewnętrznymi, obiektywnymi zmianami metodologicznymi, systemowymi i realnymi. Również po tym roku będzie można powiedzieć, co naprawdę zaszło w relacji między handlem zagranicznym a gospodarką narodową – jeśli przyjmie się, że punkt wyjścia (rok 1989) był dobrze statystycznie zbadany. Niektóre opracowania pokazują, że udział handlu zagranicznego wzrósł dwukrotnie w stosunku do dochodu narodowego, że handel zagraniczny zwiększył prawie o 70% swój udział w tworzeniu dochodu narodowego w stosunku do punktu wyjściowego – ciekawe czy to się rzeczywiście potwierdzi?

Prezes Ledworowski zwrócił też uwagę na sprawę, która wymyka się statystyce i we wszystkich gospodarkach jest mało widoczna, czyli na przygraniczną turystykę przywózowo-wywózową. Na granicy wschodniej mamy przyływ towaru zewnętrznego, a na granicy zachodniej odpływ towaru na były rynek wschodniemiecki. Badania bilansu płatniczego pokazują, że salda tych ruchów niemal znoszą się, czyli nie można tłumaczyć różnic w bilansie płatniczym, towarowym jakimś ruchem kantorów na wschodniej czy też zachodniej granicy. Oddziaływanie tego zjawiska turystycznego handlu zagranicznego na poziom popytu i podaży jest jednak bardzo ważne.

Ten zły stan statystyki handlu zagranicznego wpływał zawsze na szerzenie się o nim pewnych mitów. Jak w okresie gospodarki niedoborów niewiarygodność statystyki lub jej nieporównywalność wskutek stosowania różnych cen, różnych walut podbudowywały mit o wywozie wszystkiego na rynki wschodnie, tak obecnie brak tej statystyki wspiera drugi mit: o zalewie przez produkty zachodnie naszej gospodarki. Wiarygodność statystyki to nie tylko ważny element prowadzenia badań naukowych, ale też tworzenia pewnych poglądów i opinii o handlu zagranicznym.

Redaktor Marek Misiak z „Życia Gospodarczego” postulował, aby statystyka dostarczała więcej danych dla obiektywnej oceny stanu gospodarki. Inaczej grozi nam poddanie się euforiom politycznym.

Dr Witold Orłowski z Banku Światowego bronił statystyki, gdyż czasem bywają okresy kiedy niewłaściwe sto-

---

sowanie jej metod może dawać wyniki różniące się ze zdrowym rozsądkiem. Zwykle następuje to wtedy, kiedy np. wprowadza się bardzo duże zmiany strukturalne, a także zmiany relatywnych cen, stosowanych do badania struktur.

Biorąc taki przykład – czy udział rolnictwa w dochodzie narodowym wynosi 6% czy 15%? to odpowiedź jest bardzo prosta: przy cenach stałych z 1989 r. jest to 15%, przy cenach stałych w 1990 r. jest to 6%. I niestety ten problem metodologicznie jest nie do rozstrzygnięcia, bo obie odpowiedzi są prawdziwe. Dr Orłowski nie zgadza się z prof. Gomułą, że można szukać prostych wyjaśnień typu: w 1989 r. był PKB przeszacowany. Wszystko jest możliwe: i liczba z 1989 r. i z 1992 i z 1987 roku, a problem polega na tym, że statystyka z definicji zajmuje się sprawami ilościowymi, nie zaś jakościowymi – tych drugich zmian w ogóle nie dostrzega. Proste mechaniczne zestawienie wielkości PKB z kilku lat daje prosty rezultat, natomiast tu chodzi o porównywanie rzeczy nieporównywalnych – PKB z 1989 r. jest nie do porównania z PKB z 1992 r. Ten pierwszy był sztuczką statystyczną, podczas gdy w innym systemie gospodarczym opracowywano rachunki narodowe, które w tamtym systemie do roku 1990 w ogóle się nie sprawdzają.

Należy sobie zdawać sprawę, że w sytuacjach gwałtownej zmiany systemowej możliwości statystyki są ograniczone, co nie oznacza, że nie należy z niej korzystać.

Dr Krzysztof Marczewski ze Szkoły Głównej Handlowej zaczął swoją wypowiedź od komentarza na temat PKB, uznając wyliczanie tego wskaźnika makroekonomicznego za wyzwanie intelektualne dla statystyka. Jeżeli chodzi o zapasy, które stanowiły bardzo dużą część PKB z 1989 r., to statystycy nie mają potrzebnych danych pozwalających uwzględnić przecenę. Prelegent zaznaczył, że nie dysponuje przy wyliczaniu PKB danymi

umożliwiającymi uwzględnienie przeceny zapasów w 1992 r. Zwrócił też uwagę na znaczenie danych statystycznych dla prowadzących negocjacje w handlu zagranicznym, zwłaszcza z EWG.

Profesor Leszek Zienkowski z Zakładu Badań Statystyczno-Ekonomicznych GUS i PAN polemizował ze stwierdzeniem dr Marczewskiego, że gdy nie mamy danych źródłowych, to nie przeceniamy zapasów, gdyż dla statystyka czy ekonomisty byłaby to herezja. Na tym polegają rachunki narodowe, że jeśli nie wiadomo jak podzielić jakąś wielkość na dwie części, to dzieli się ją pół na pół, gdyż wtedy popełnia się najmniejszy błąd. Trzeba robić nawet ryzykowne szacunki – przecież jest to jasne, że zapasy muszą być przeceniane i nawet jeśli przy ich szacowaniu nastąpi pomyłka, jest to lepiej niż zostawić zapasy nie przeceniane.

Spotkanie podsumował doc. Tadeusz Baczek reprezentujący Fundację CASE, stwierdzając, że otworzyło ono nowy cykl w ramach seminariów Fundacji. Widać, że jest jeszcze mnóstwo problemów do przedyskutowania. Rzeczywistość zmienia się bardzo szybko, szybciej niż jesteśmy ją w stanie zmierzyć, czy też znaleźć odpowiednie sposoby jej opisu. Poinformował też zebranych, że Fundacja CASE zamierza stworzyć forum dla dyskusji nad metodami badań, jak też nad nie rozwiązanymi problemami, które pozostają w cieniu oficjalnych komunikatów i raportów analitycznych. W ramach kolejnych seminariów będą reprezentowane różne ośrodki badawcze, ich oceny wyników gospodarczych i prognozy, licząc że przyczyni się to rozwinięciu badań w Głównym Urzędzie Statystycznym, niezależnych ośrodkach statystycznych, a także do zmiany wyobrażenia o gospodarce Polski, jakie ma opinia publiczna.

Podziękował też wszystkim uczestnikom za udział i wkład w to seminarium inicjujące nowy cykl.