

Эта дефиниция с одной стороны исключает из объема публичных регистров такие, которые являются важными элементами информационной инфраструктуры государства, а с другой присваивает публичный статус типичным частным регистрам. В статье обращается также внимание на существенные различия между регистром, учетом и списком. Их отличие это один из важнейших вопросов в отношении к введению информационного порядка. В статье сделано также обозрение классификации регистров используемых в литературе. Была предпринята также попытка разработки классификации регистров здравоохранения. Эта классификация была использована для разработки модели интеграции публичных регистров в системе здравоохранения.

Bogusław GUZIK

Prognozy i oceny koniunktury w ankietach GUS

GUS przeprowadza co miesiąc badania koniunktury metodą testu koniunktury: przemysłowej — od 1992 r., budowlanej — od 1993 r., handlowej — od 1993 r. oraz usługowej — od 2003 r. Ich metodologię opisali, a wyniki przedstawili np.: Jerczyńska, Sokołowska (1995), Jerczyńska, Ciok, Sokołowska (1999), Sękowska, Zagożdżńska (2002), Zagożdżńska, Waczyńska (2002). Wyniki testów koniunktury organizowanych przez różne instytucje omówiono też na łamach „Wiadomości Statystycznych” — m.in.: Kwiatkowska-Ciotucha, Załuska (2001), Batóg (2004), Gawel (2004), Kowerski (2005), Jerczyńska, Sokołowska (2006).

W teście koniunktury, który pod względem metodologicznym jest jedną z metod prognozowania eksperckiego, przeprowadza się ankietę na temat aktualnego stanu danego zjawiska oraz jego prognoz. W najprostszym ujęciu organizator badania wyróżnia trzy warianty sytuacji: *korzystna/bez zmian/niekorzystna* i prosi o wybór jednego z wariantów. Końcowy wynik ustalany jest jako różnica odsetka odpowiedzi pozytywnych i odsetka odpowiedzi negatywnych. Jest to tzw. saldo koniunktury. Na podstawie sald koniunktury, które z definicji mogą przyjmować wartości od -100% (wszyscy twierdzą, że sytuacja jest niekorzystna) do $+100\%$ (wszyscy twierdzą, że sytuacja jest korzystna) i które grają rolę sald częściowych, konstruowane są agregatowe indeksy koniunktury. W najprostszej wersji jest to średnia zwykła sald częściowych.

Mówiąc dalej o prognozie oraz o ocenie koniunktury będziemy mieć na myśli odpowiednio: saldo prognoz koniunktury oraz saldo ocen koniunktury.

Uzasadnienie testów koniunktury na tle np. klasycznego prognozowania statystyczno-ekonometrycznego jest różne. Na pewno zaletą testów jest większa elastyczność i możliwość uwzględniania eksperckiej wiedzy jakościowej, w szczególności — potencjalnej wiedzy na temat punktów zwrotnych i możliwości przełączeń.

W artykule interesować nas będzie koincydencja między formułowanymi w miesiącu t prognozami stanu koniunktury w okresie następnym, jak również formułowanymi w miesiącu t ocenami koniunktury dotychczasowej. W szczególności chcemy sprawdzić, czy i w jakim stopniu ankietowani, formułując swoje prognozy, kierują się oceną dotychczasowego stanu rzeczy (konserwatyzm prognostyczny), a w jakim przesłankami wynikającymi z innych powodów (elastyczność prognostyczna) oraz z ewentualnej wiedzy na temat możliwych zmian jakościowych (fantazja prognostyczna).

DANE STATYSTYCZNE. ZAKRES BADANIA

Wykorzystane w artykule dane statystyczne charakteryzują wyniki miesięcznych testów koniunktury od 1993 r. do 2008 r. Przedstawia je GUS m.in. w publikacji *Badanie koniunktury ...* (2007), zamieszczonej na stronach internetowych Urzędu.

Badanie koniunktury dotyczyło trzech sektorów: budownictwa, handlu oraz przemysłu. Rozpatrzono przekrój ogółem oraz przekroje ze względu na liczbę zatrudnionych. Dążąc do porównywalności, zrezygnowano z analiz w odniesieniu do branż, ze względu na brak takiego podziału w sektorze budowlanym. Ponadto w wielu przypadkach trudno jest znaleźć odpowiedniki branż przemysłowych w branżach handlowych¹. Nie badano też sektora usługowego, gdyż publikowane szeregi są aż o 10 lat krótsze od pozostałych i nie uwzględniają podziału według skali przedsiębiorstwa.

W prowadzonych przez GUS badaniach koniunktury formułowane są dwie grupy pytań. Pytania z pierwszej grupy dotyczą ocen koniunktury, drugie — prognoz koniunktury. W ankiecie handlowej występuje 9 pytań na temat ocen koniunktury oraz 8 pytań na temat prognoz. Z kolei w ankietach budowlanej oraz przemysłowej występuje po 10 pytań dotyczących ocen oraz 8 odnośnie prognoz².

Wśród nich tylko trzy dotyczą zarówno oceny, jak i prognozy zjawisk, których odpowiedniki występują w ankietach dla trzech badanych sektorów. Są to:

- sprzedaż (wartość produkcji budowlano-montażowej, ilość sprzedanych towarów, poziom produkcji sprzedanej — kolejne analogiczne dotyczą: budownictwa, handlu, przemysłu);
- ogólna sytuacja firmy (ogólna sytuacja gospodarcza przedsiębiorstwa, ogólna sytuacja gospodarcza jednostki, *ogólna sytuacja gospodarcza przedsiębiorstwa*);

¹ W statystyce testów koniunktury GUS wyróżnia 17 branż przemysłowych oraz 4 branże handlowe.

² Zob. np. *Badanie koniunktury...* (2007), załączniki — formularze: AK-H/m, AK-P/m, AK-B/m.

- zdolność płatnicza (sytuacja finansowa przedsiębiorstwa, zdolność jednostki do bieżącego regulowania zobowiązań finansowych, zdolność przedsiębiorstwa do bieżącego regulowania zobowiązań finansowych).

Te zmienne wzięto właśnie pod uwagę.

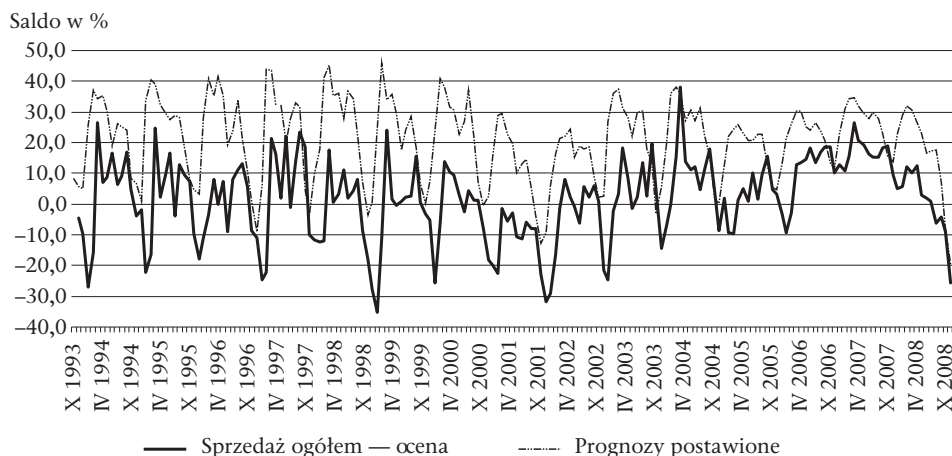
Publikowana ocena koniunktury jest określona co do daty i można przyjąć, że jest to — dokonana w miesiącu t — ocena sytuacji w miesiącu t^3 . Stawiana w miesiącu t prognoza dotyczy najbliższego kwartału, a więc okresu $t+1$, $t+2$, $t+3$. Jest to więc prognoza kwartalna, stawiana w cyklu miesięcznym. W tej sytuacji wiązanie prognozy kwartalnej z jakimś określonym miesiącem wymaga dodatkowych konwencji. Na szczęście, z punktu widzenia celu artykułu, nie musimy tego czynić. Chodzi w nim bowiem o stwierdzenie, czy formułowane w miesiącu t prognozy na kwartał ($t+1$, $t+2$, $t+3$) są podobne do formułowanych również w miesiącu t ocen kształtowania się zjawiska w miesiącu t , a zatem — czy formułując prognozę, wykorzystywano wiedzę o mijającym miesiącu. W artykule nie będziemy zajmować się badaniem trafności prognoz.

Kwartalna prognoza z miesiąca t jest prognozą jednoczesną z oceną miesiąca t .

MIERNIKI ZGODNOŚCI PROGNOZY JEDNOCZESNEJ Z OCENĄ KONIUNKTURY

Na wyk. 1 przedstawiono oceny oraz jednoczesne prognozy (= prognozy postawione) w zakresie wartości sprzedaży firm przemysłowych ogółem.

Wykr. 1. SALDO PROGNOZ I OCEN KONIUNKTURY



Źródło: opracowanie własne.

³ Tylko w nielicznych przypadkach ocena ankiety miesięcznej odwołuje się do okresów kwartalnych.

Można tu sformułować następujące generalne wnioski:

- prognozy postawione w miesiącu t są na ogół wyższe od ocen, co jednocześnie może oznaczać, według oceny ankietowanych, że przyszły stan rzeczy będzie lepszy od obecnego;
- uczestnicy ankiety charakteryzują się zatem dość dużym optymizmem bądź konsekwentnie wyrażaną nadzieją, że „w przyszłości będzie lepiej”. Dopiero w „kryzysowym” okresie ostatniego kwartału 2008 r. prognozy są tak pesymistyczne, jak oceny;
- kierunek prognozowanej koniunktury odpowiada mniej więcej kierunkowi ocen — wzrostowi (spadkowi) ocen na ogół towarzyszy wzrost (spadek) prognoz.

W artykule próbujemy ocenić tego typu intuicję za pomocą formalnie skonstruowanych mierników zgodności prognoz jednoczesnych z ocenami.

Z uwagi na formę pytań w teście koniunktury GUS, które dotyczą poprawy lub pogorszenia sytuacji w zakresie danego zjawiska:

- znak salda określa kierunek (typ) koniunktury; jeśli znak salda jest dodatni mówimy, że ma miejsce koniunktura dodatnia (lub po prostu — koniunktura), a jeśli znak jest ujemny, wówczas mówimy o koniunkturze ujemnej (lub — o dekoniunkturze);
- różnica między saldem obecnym i poprzednim określa dynamikę koniunktury; np. mówimy, że nastąpiła poprawa koniunktury, gdy znak różnicy sald jest dodatni oraz o jej pogorszeniu, gdy różnica jest ujemna;
- wartość salda określa siłę (poziom) koniunktury; np. duże saldo dodatnie oznacza, że koniunktura jest bardzo silna, z kolei małe ujemne, iż występuje nieznaczna dekoniunktura.

Przez y_t oznaczamy wyrażone w miesiącu t saldo oceny koniunktury zjawiska w miesiącu t , a przez y_t^* — saldo sformułowanej w miesiącu t prognozy koniunktury. Badając trafność prognoz koniunktury oprzeć się można na porównaniu różnych cech koniunktury: wartości sald, ich przyrostów bezwzględnych, przyrostów względnych, trendów itp. Dalej podano definicje czterech prostych mierników zgodności prognoz z ocenami.

Wszystkie mierniki są tak określone, że ich większa wartość oznacza większą zgodność prognoz z ocenami.

1. Zgodność kierunku (M_K)

Jest to częstość występowania zgodności znaków sald oceny koniunktury i odpowiadających im prognoz:

$$M_K = \frac{1}{N} \sum_{t=1}^N k_t \quad (1)$$

$$\text{gdzie } k_t = \begin{cases} 1 & \text{gdy } y_t \text{ oraz } y_t^* \text{ mają ten sam znak}^4 \\ 0 & \text{w przeciwnym przypadku} \end{cases} \quad (2)$$

2. Zgodność dynamiki (M_D)

$$M_D = \frac{1}{N} \sum_{t=1}^N d_t \quad (3)$$

$$\text{gdzie } d_t = \begin{cases} 1 & \text{gdy przyrosty } (y_t - y_{t-1}) \text{ oraz } (y_t^* - y_{t-1}^*) \text{ mają ten sam znak} \\ 0 & \text{w przeciwnym przypadku} \end{cases} \quad (4)$$

Wskaźnik d_t osiąga wartość 1, gdy między miesiącem poprzednim a obecnym saldo dla ocen, jak i dla prognoz wzrosło lub też, gdy oba salda zmalały. Miernik M_D określa, jak często zmiany sald ocen i prognoz były jednokierunkowe, a więc charakteryzuje zgodność dynamiki koniunktury ocenianej i prognozowanej.

3. Zgodność siły (M_S)

Salda koniunktury ocenianej i prognozowanej są podobne, gdy ich różnice są niewielkie. Niech $\Delta \geq 0$ oznacza taką wartość, że odchylenie salda prognozy od salda oceny o nie więcej niż Δ uznawane jest za nieistotne⁵. Miernik zgodności siły koniunktury ma postać:

$$M_S = \frac{1}{N} \sum_{t=1}^N s_t \quad (5)$$

$$\text{gdzie } s_t = \begin{cases} 1 & \text{gdy } |y_t - y_t^*| \leq \Delta \\ 0 & \text{w przeciwnym przypadku} \end{cases} \quad (6)$$

Saldo koniunktury plasuje się w granicach od -100 do $+100$. Przyjmować będziemy, że różnica sald jest nieistotna, gdy nie przekracza 5% długości tego przedziału, czyli $\Delta = 10$.

4. Współczynnik zharmonizowania ocen i prognoz (M_H)

Za wskaźnik zharmonizowania koniunktury ocenianej oraz prognozowanej przyjmiemy współczynnik korelacji liniowej między szeregiem prognoz $(y_t^*, t = 1, \dots, N)$ a szeregiem odpowiadających im ocen $(y_t, t = 1, \dots, N)$. Jeśli współczynnik korelacji $r > 0$, oba szeregi są zharmonizowane (i to tym bardziej,

⁴ Dodajmy, że jeśli choć jedna z porównywanych liczb jest równa 0, to ich znaki są zgodne.

⁵ Wartość Δ ustala prowadzący badanie. Jeśli uznaje, że dwie liczby są podobne tylko wtedy, gdy są identyczne, to $\Delta = 0$. Im tolerancja dla odchyleń jest większa, tym Δ jest większa.

im r jest większe). Jeśli zaś $r < 0$, oba szeregi są niezharmonizowane (i to tym bardziej, im r jest bliższe wartości -1).

Dodajmy, że używając współczynnika korelacji można wprowadzić nieco inny miernik zharmonizowania, który — podobnie jak poprzednie — będzie unormowany w przedziale $[0, 1]$:

$$M_{H(2)} = \frac{1+r}{2} \quad (7)$$

ZGODNOŚĆ JEDNOCZESNYCH PROGNOZ I OCEN W ANKIETACH KONIUNKTURY GUS

W tabl. 1 przedstawiono wyniki badania zgodności kierunkowej kwartalnych prognoz koniunktury formułowanych w miesiącu t z ocenami koniunktury w miesiącu t .

Termin „średnia typologiczna” oznacza zwykłą średnią arytmetyczną z wartości dotyczących poszczególnych (tu trzech) typów i może być interpretowana tylko jako przybliżenie prawdziwej średniej, obliczanej na zbiorze wszystkich wyników obserwacji (lub jako średnia ważona na zbiorze „typów” z wagami wyznaczonymi przez liczebność tych „typów”).

TABL. 1. ZGODNOŚĆ KIERUNKU PROGNOZ I OCEN

Wyszczególnienie	Ogółem	Do 9 osób	10—49	50—249	250 i więcej
Sprzedaż					
Budownictwo	0,700	x	0,722	0,728	0,733
Handel	0,517	0,683	0,544	0,578	0,628
Przemysł	0,661	x	0,467	0,567	0,717
Średnia typologiczna	0,626	0,683	0,578	0,624	0,693
Ogólna sytuacja firm					
Budownictwo	0,917	x	0,894	0,900	0,917
Handel	0,733	0,861	0,783	0,639	0,767
Przemysł	0,661	x	0,467	0,567	0,717
Średnia typologiczna	0,770	0,861	0,715	0,702	0,800
Zdolność płatnicza					
Budownictwo	0,606	x	0,656	0,578	0,578
Handel	0,800	0,911	0,683	0,683	0,517
Przemysł	0,581	x	0,526	0,554	0,631
Średnia typologiczna	0,609	0,911	0,661	0,596	0,519
Średnia					
Budownictwo	0,741	x	0,757	0,735	0,743
Handel	0,683	0,819	0,670	0,633	0,637
Przemysł	0,581	x	0,526	0,554	0,631
Średnia typologiczna	0,669	0,819	0,651	0,641	0,670

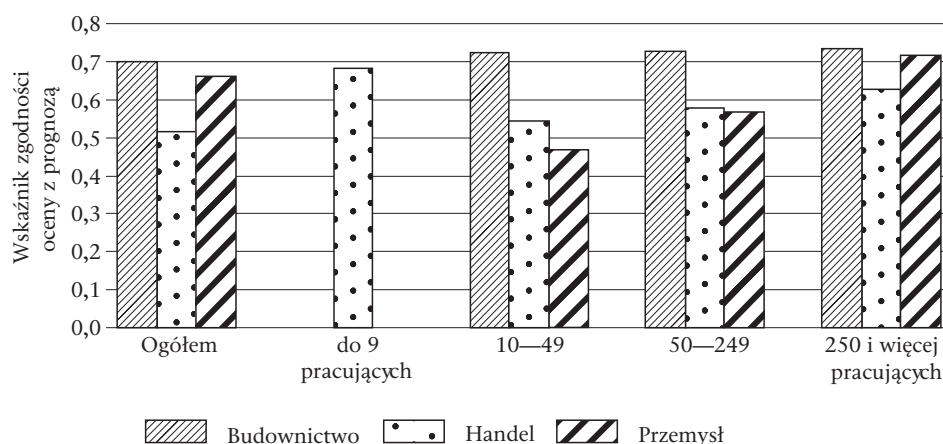
Źródło: obliczenia własne.

Dodajmy, że nie zawsze wielkość „ogółem” zawiera się w zakresie wielkości cząstkowych (zob. np. wskaźnik dla sprzedaży w budownictwie). Wskaźniki zgodności liczone są bowiem jako sumy odpowiednich zmiennych „logicznych”, por. (2), a nie algebraicznych⁶.

Wnioski są m.in. takie:

- formułując w miesiącu t prognozę kierunku koniunktury, badane trzy sektory dość wyraźnie sugerują się oceną dotychczasowego kierunku koniunktury w miesiącu t ;
- najbardziej dotyczy to budownictwa, gdzie, średnio biorąc, prognozy kierunku koniunktury aż w ok. 74% powielają oceny kierunku koniunktury w mijającym miesiącu. Bardziej skłonni do odstępstw od powielania oceny są pracujący w przemyśle, choć i tu średni wskaźnik zgodności typu ocen i prognoz kierunku koniunktury jest wysoki i wynosi blisko 55%;

**Wykr. 2. ZGODNOŚĆ OCEN I PROGNOZ
KIERUNKU KONIUNKTURY SPRZEDAŻY**



Źródło: opracowanie własne.

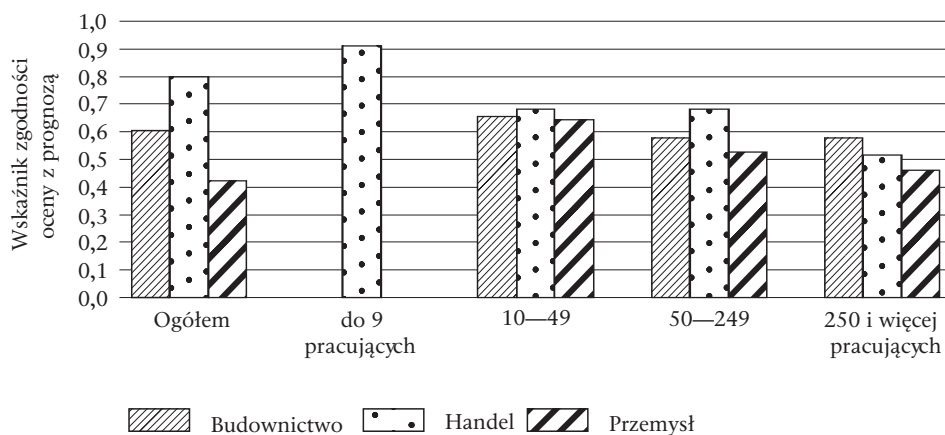
- średnio rzecz ujmując nie ma wyraźnych różnic między firmami o rozmaitej wielkości. Najbardziej widać to w budownictwie, gdzie średni wskaźnik zgodności kierunku prognoz i ocen dla wszystkich typów firm jest praktycznie taki sam (74—76%). Nieco większe zróżnicowanie miało miejsce w przemyśle (53—63%), a największe w handlu (63—82%), przy czym w przemyśle naj-

⁶ Na przykład, jeśli dla wszystkich części ma miejsce zgodność znaków, to zgodność znaków dla sumy tych części może nie mieć miejsca! Zależy to od skali wartości ujemnych i dodatnich dla poszczególnych części. Na przykład, jeśli pierwsza para to $(-3, -2)$, a druga — $(4, 1)$, to agregacja daje $(1, -1)$. Częstki charakteryzują się zgodnością znaków, a ich agregat — nie.

bardziej zachowawcze prognozy formułują firmy największe (powyżej 250 osób), a w handlu — odwrotnie, firmy najmniejsze, zatrudniające do 9 osób;

- relatywnie najrzadziej sugestie zmian kierunku koniunktury wyraża się w odniesieniu do ogólnej sytuacji firm. Rekordzistami są tu firmy budowlane, które aż w 90% stawiają na kontynuację dotychczasowego kierunku koniunktury i czynią to praktycznie niezależnie od skali przedsiębiorstwa. W przemyśle stwierdza tak średnio 66% firm, natomiast w handlu — 73%, przy czym najczęściej firmy najmniejsze (aż 86%);
- stosunkowo największą elastycznością (czyli najmniejszym konserwatyzmem) charakteryzuje się prognozowanie kierunku koniunktury w odniesieniu do zdolności płaćniczej. Najbardziej skłonni do prognozowania przełączeń kierunku koniunktury w zakresie zdolności płaćniczej są pracujący w przemyśle (zwłaszcza w firmach małych i średnich — tylko ok. 55% z nich wyraża konserwatyzm prognostyczny).

**Wykr. 3. ZGODNOŚĆ PROGNOZ I OCEN KIERUNKU KONIUNKTURY
W ZAKRESIE ZDOLNOŚCI PŁAĆNICZEJ**



Źródło: opracowanie własne.

Wniosek

Generalnie należy przyjąć, że przy prognozowaniu kierunku koniunktury największymi konserwatystami są bardzo duże firmy budowlane i przemysłowe oraz bardzo małe firmy handlowe. Relatywnie największą „fantazją” prognozowania kierunku zmian koniunktury odznaczają się natomiast ankietowani z małych firm przemysłowych.

Zgodność dynamiki koniunktury

Uzyskane wyniki charakteryzuje tabl. 2.

TABL. 2. ZGODNOŚĆ PROGNOZ I OCEN POD WZGLĘDEM DYNAMIKI KONIUNKTURY

Wyszczególnienie	Ogółem	Do 9 osób	10—49	50—249	250 i więcej
Sprzedaż					
Budownictwo	0,606	x	0,600	0,622	0,589
Handel	0,494	0,522	0,572	0,506	0,489
Przemysł	0,506	x	0,556	0,550	0,539
Średnia typologiczna	0,535	0,522	0,576	0,559	0,539
Ogólna sytuacja firm					
Budownictwo	0,850	x	0,850	0,867	0,811
Handel	0,572	0,611	0,500	0,522	0,500
Przemysł	0,506	x	0,556	0,550	0,539
Średnia typologiczna	0,643	0,611	0,635	0,646	0,617
Zdolność płatnicza					
Budownictwo	0,522	x	0,561	0,489	0,572
Handel	0,572	0,561	0,556	0,550	0,450
Przemysł	0,517	x	0,606	0,556	0,550
Średnia typologiczna	0,537	0,561	0,574	0,531	0,524
Średnia					
Budownictwo	0,659	x	0,670	0,659	0,657
Handel	0,546	0,565	0,543	0,526	0,480
Przemysł	0,509	x	0,572	0,552	0,543
Średnia typologiczna	0,572	0,565	0,595	0,579	0,560

Źródło: obliczenia własne.

Można sformułować wnioski:

- pod względem zgodności dynamiki prognoz z dynamiką ocen, firmy nie różnią się tak bardzo, jak pod względem kierunku koniunktury;
- relatywnie nieco większą skłonnością do stosowania zasady *status quo* w odniesieniu do dynamiki koniunktury charakteryzują się firmy budowlane. Średnia zgodność dynamiki ocen i prognoz formułowanych w momencie *t* wynosi tu 66%, podczas gdy w przemyśle i handlu — 50—55%;
- bardzo wyraźne zróżnicowanie prognoz i ocen dynamiki dotyczy ogólnej sytuacji firm. W 85% przypadków prognoz formułowanych przez firmy budowlane powielana jest dynamika ocen, podczas gdy w przemyśle i handlu ma to miejsce w 51—57% przypadków.

Wniosek

Podobieństwo dynamiki prognoz i dynamiki ocen praktycznie nie zależy od wielkości firmy. Również różnice między sektorami oraz między zmiennymi nie są tak wyraziste, jak w przypadku kierunku koniunktury⁷.

Zgodność poziomu

Syntetyczne rezultaty przedstawiono w tabl. 3.

TABL. 3. ZGODNOŚĆ PROGNOZ I OCEN SIŁY KONIUNKTURY

Wyszczególnienie	Ogółem	Do 9 osób	10—49	50—249	250 i więcej
Sprzedaż					
Budownictwo	0,272	x	0,350	0,256	0,278
Handel	0,383	0,517	0,350	0,267	0,150
Przemysł	0,233	x	0,300	0,244	0,261
Średnia typologiczna	0,296	0,517	0,333	0,256	0,230
Ogólna sytuacja firm					
Budownictwo	0,661	x	0,761	0,672	0,511
Handel	0,633	0,728	0,544	0,361	0,411
Przemysł	0,233	x	0,300	0,244	0,261
Średnia typologiczna	0,509	0,728	0,535	0,426	0,394
Zdolność płatnicza					
Budownictwo	0,239	x	0,339	0,194	0,222
Handel	0,578	0,628	0,539	0,544	0,511
Przemysł	0,278	x	0,433	0,394	0,311
Średnia typologiczna	0,365	0,628	0,437	0,378	0,348
Średnia					
Budownictwo	0,391	x	0,483	0,374	0,337
Handel	0,531	0,624	0,478	0,391	0,357
Przemysł	0,248	x	0,344	0,294	0,278
Średnia typologiczna	0,390	0,624	0,435	0,353	0,324

Źródło: obliczenia własne.

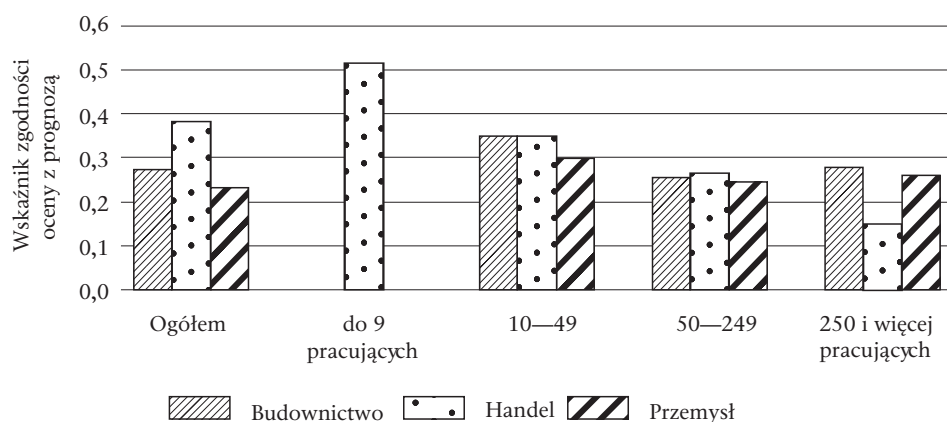
Wnioski są następujące:

- największą skłonnością do stosowania zasady *status quo* przy prognozowaniu siły koniunktury charakteryzują się firmy budowlane (średnia zgodność ocen i prognoz siły koniunktury wynosi 53%), a najmniejszą — firmy przemysłowe (25%);

⁷ Jest to dość zaskakujące na tle stwierdzonego zróżnicowania kierunku prognoz i kierunku ocen, bowiem w badaniach ekonometryczno-statystycznych zróżnicowanie dynamiki zazwyczaj jest większe od zróżnicowania kierunku zmian.

- ekstrapolacja dotychczasowego stanu rzeczy jest bardzo wyrazista w przypadku ogólnej sytuacji firm (średnio 51%), a w handlu oraz budownictwie odsetek ten wynosił 63—66%;
- konserwatyzm prognostyczny w zakresie siły koniunktury jest generalnie tym mniejszy, im większa jest firma. Zjawisko to jest bardzo wyraźne w handlu. Wskaźnik zgodności siły koniunktury prognozowanej i ocenianej spada tu z 62% (dla firm najmniejszych) do 36% (dla firm największych). W szczególności spada on dla sprzedaży z 52% w firmach najmniejszych do zaledwie 15% w firmach największych, a dla ogólnej sytuacji firm handlowych — z 75% w firmach najmniejszych do 40% w firmach największych;

Wykr. 4. ZGODNOŚĆ OCEN I PROGNOZ SIŁY KONIUNKTURY SPRZEDAŻY



Źródło: opracowanie własne.

- w prognozowaniu siły koniunktury stopień stosowania przez firmy asekuuracyjnej postawy *status quo* jest wyraźnie mniejszy niż w prognozowaniu dynamiki koniunktury czy kierunku koniunktury. O ile np. średni stopień zgodności kierunku prognoz i ocen wynosił ok. 67%, to średni wskaźnik zgodności prognoz i ocen siły koniunktury wynosił zaledwie 39%.

Wniosek

Firmy o wiele częściej ekstrapolują dotychczasowy kierunek lub dynamikę koniunktury niż jej siłę. Konserwatyzm prognostyczny jest tu zdecydowanie mniejszy, a ankietowani w większym stopniu dopuszczają wyraźne zmiany siły koniunktury, nawet jeśli jej kierunek lub dynamika są takie same.

Zharmonizowanie prognoz z ocenami

Współczynniki zharmonizowania (korelacji) przedstawiono w tabl. 4. Wnioski są tu następujące:

- ogólny stopień zharmonizowania prognoz i ocen jest umiarkowany lub mały (ok. 40%). Zharmonizowanie prognoz i ocen praktycznie nie zależy od skali firm budowlanych (i jednocześnie jest dość wysokie). W przypadku firm przemysłowych, a zwłaszcza handlowych, maleje ono wraz ze wzrostem wielkości przedsiębiorstwa. Na przykład w handlu maleje od 37% (w firmach najmniejszych) do praktycznie 0% (w firmach największych);

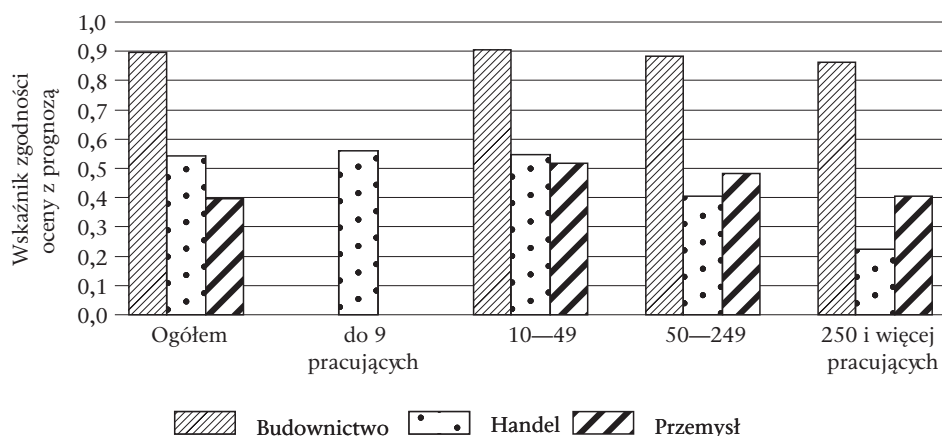
TABL. 4. ZHARMONIZOWANIE PROGNOZ I OCEN KONIUNKTURY

Wyszczególnienie	Ogółem	Do 9 osób	10—49	50—249	250 i więcej
Sprzedaż					
Budownictwo	0,417	x	0,514	0,428	0,381
Handel	0,143	0,172	0,063	–0,020	–0,127
Przemysł	0,396	x	0,516	0,485	0,404
Średnia typologiczna	0,319	0,172	0,364	0,298	0,220
Ogólna sytuacja firm					
Budownictwo	0,895	x	0,904	0,882	0,862
Handel	0,544	0,561	0,548	0,403	0,224
Przemysł	0,396	x	0,516	0,485	0,404
Średnia typologiczna	0,612	0,561	0,656	0,590	0,497
Zdolność płatnicza					
Budownictwo	0,575	x	0,589	0,560	0,606
Handel	0,455	0,380	0,419	0,324	0,066
Przemysł	0,320	x	0,363	0,348	0,368
Średnia typologiczna	0,450	0,380	0,457	0,411	0,347
Średnia					
Budownictwo	0,629	x	0,669	0,623	0,616
Handel	0,381	0,371	0,343	0,236	0,054
Przemysł	0,371	x	0,465	0,439	0,392
Średnia typologiczna	0,460	0,371	0,492	0,433	0,354

Źródło: obliczenia własne.

- najwyższym stopniem zharmonizowania z ocenami charakteryzują się prognozy ogólnej sytuacji firm (średnio 61%), w budownictwie jest to aż 90%.

Wykr. 5. ZHARMONIZOWANIE OCEN I JEDNOCZESNYCH PROGNOZ



Źródło: opracowanie własne.

Wniosek

Oceny i jednocześnie prognozy są na ogół zharmonizowane w mniejszym lub większym stopniu (współczynniki korelacji na ogół są dodatnie). Jedynie w przypadku sprzedaży w handlu stwierdza się nieznaczne niezharmonizowanie (współczynniki są nieistotnie ujemne).

Podsumowanie

1. Firmy ankietowane przez GUS w testach koniunktury budowlanej, handlowej oraz przemysłowej charakteryzują się umiarkowaną skłonnością do stosowania zasady *status quo*.
2. Nazwijmy współczynnikiem „konserwatyzmu” średnią z wskaźników zgodności prognoz i ocen dla badanych tu trzech cech koniunktury: kierunku (tabl. 1), dynamiki (tabl. 2) oraz siły (tabl. 3). Oszacowane wskaźniki konserwatyzmu podano w tabl. 5.
3. Ogólny współczynnik „konserwatyzmu” prognostycznego można szacować na poziomie ok. 50—55%. Tak więc ankietowani formułując prognozy koniunktury na okres najbliższy, generalnie rzecz ujmując, w połowie kierują się ocenianym stanem koniunktury, a w połowie innymi okolicznościami. Biorą zatem zwykłą średnią z tego, co pewne (co już było) i z tego, co jest niepewne⁸.

⁸ Warto wspomnieć, że w jednej z podstawowych reguł podejmowania decyzji w teorii gier (regule Hurwicza, laureata Nagrody Nobla) za typowe dla „przeciętnego” człowieka uznaje się przyjęcie współczynnika ostrożności oraz 50% współczynnika ryzykanctwa. Potwierdzało się to w odniesieniu do prognoz koniunktury.

TABL. 5. WSPÓŁCZYNNIKI „KONSERWATYZMU” PROGNOSTYCZNEGO

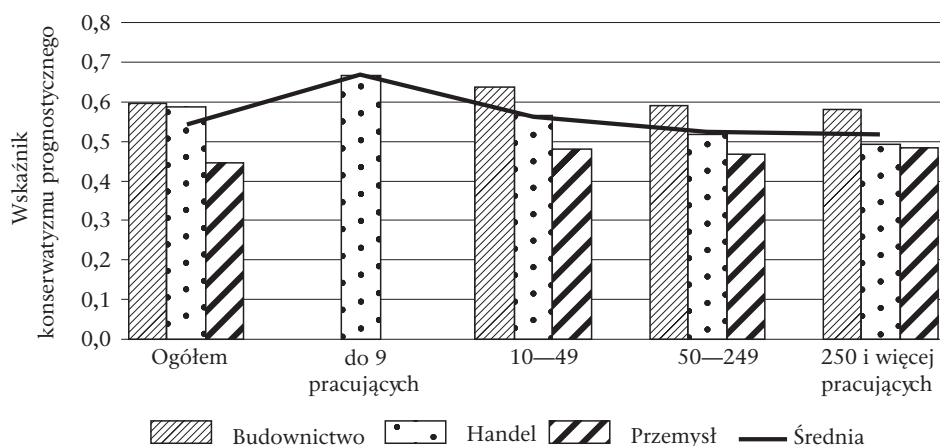
Wyszczególnienie	Ogółem	Do 9 osób	10—49	50—249	250 i więcej
Sprzedaż					
Budownictwo	0,526	x	0,557	0,535	0,533
Handel	0,465	0,574	0,489	0,450	0,422
Przemysł	0,467	x	0,441	0,454	0,506
Średnia typologiczna	0,486	0,574	0,496	0,480	0,487
Ogólna sytuacja firm					
Budownictwo	0,809	x	0,835	0,813	0,746
Handel	0,646	0,733	0,609	0,507	0,559
Przemysł	0,467	x	0,441	0,454	0,506
Średnia typologiczna	0,641	0,733	0,628	0,591	0,604
Zdolność płatnicza					
Budownictwo	0,456	x	0,519	0,420	0,457
Handel	0,650	0,700	0,593	0,593	0,493
Przemysł	0,406	x	0,561	0,493	0,441
Średnia typologiczna	0,504	0,700	0,557	0,502	0,464
Średnia					
Budownictwo	0,597	x	0,637	0,590	0,579
Handel	0,587	0,669	0,564	0,517	0,491
Przemysł	0,446	x	0,481	0,467	0,484
Średnia typologiczna	0,543	0,669	0,560	0,524	0,518

Źródło: obliczenia własne.

4. Skłonność do stosowania zasady *status quo* w prognozowaniu koniunktury jest relatywnie największa w budownictwie i handlu (ok. 60%), a najmniejsza w przemyśle (ok. 45%).
5. Z punktu widzenia skali firm, konserwatyzm prognostyczny był, średnio biorąc:
 - a) podobny w różnych klasach firm przemysłowych,
 - b) nieznacznie zmalał w budownictwie,
 - c) wyraźniej zmalał w handlu.
6. Zasada *status quo* stosowana jest rzadziej przy prognozowaniu sprzedaży, a częściej przy prognozowaniu ogólnej sytuacji firm, zwłaszcza w przypadku firm budowlanych (współczynnik konserwatyizmu wynosi aż 81%) oraz przy prognozowaniu ogólnej sytuacji firm i ich sytuacji płatniczej w najmniejszych firmach handlowych (współczynnik konserwatyizmu ok. 70%).
7. Wstępne symulacje sugerują, że autentyczna trafność tych (w połowie konserwatywnych, a w połowie fantazyjnych) prognoz nie jest zbyt wysoka. Ge-

neralnie lepsze wyniki, co może być zaskakujące, uzyskuje się stosując 100% zasadę *status quo*. Wygląda więc na to, że wyniki testów koniunktury należy badać metodami analizy zjawisk chaotycznych. Rozwijanie tego tematu wykracza jednak poza ramy artykułu.

**Wykr. 6. WSKAŹNIKI „KONSERWATYZMU” PROGNOSTYCZNEGO
W TESTACH KONIUNKTURY GUS**



Źródło: opracowanie własne.

prof. dr hab. Bogusław Guzik

LITERATURA

- Badanie koniunktury* (1994), „Zeszyty metodyczne i klasyfikacje”, GUS, Warszawa
- Badanie koniunktury gospodarczej* (2007), GUS, Warszawa
- Batóg J. (2004), *Analiza porównawcza koniunktury gospodarczej w woj. zachodniopomorskim i w Polsce*, „Wiadomości Statystyczne”, nr 11
- Gawel A. (2004), *Diagnozowanie i prognozowanie koniunktury gospodarczej na podstawie wskaźników jakościowych testu koniunkturalnego*, „Wiadomości Statystyczne”, nr 6
- Jerczyńska M., Ciok A., Sokołowska K. (1999), *Koniunktura gospodarcza w handlu detalicznym w latach 1993—1998*, „Handel Wewnętrzny. Marketing. Rynek. Przedsiębiorstwo”, nr 3
- Jerczyńska M., Sokołowska K. (1995), *Test koniunktury w handlu detalicznym*, „Handel Wewnętrzny. Marketing. Rynek. Przedsiębiorstwo”, nr 4

- Jerczyńska M., Sokołowska K. (2006), *Porównanie wskaźników testu koniunktury w handlu detalicznym krajów Unii Europejskiej*, „Handel Wewnętrzny. Marketing. Rynek. Przedsiębiorstwo”, nr 2
- Kowerski M. (2005), *Badanie nastrojów gospodarczych w woj. lubelskim*, „Wiadomości Statystyczne”, nr 3
- Kwiatkowska-Ciotucha D., Załuska U. (2001), *Ocena przedsiębiorstw według ich szefów*, „Wiadomości Statystyczne”, nr 2
- Sękowska H., Zagoździńska I. (2002), *Kondycja polskiego przemysłu przetwórczego na podstawie jakościowych badań koniunktury*, „Prace i Materiały IRG SGH”, Warszawa
- Zagoździńska I., Waczyńska E. J. (2002), *Kondycja polskiego handlu: stan bieżący i perspektywy rozwoju (na podstawie wyników jakościowych badania koniunktury)*, „Prace i Materiały IRG SGH”, Warszawa

SUMMARY

The question, 'in which degree the surveyed business cycles test use the conservative principle status quo,' is considered in the paper. The survey concerned construction, commercial and industrial business cycles in general as well as by enterprise size. Three variables were compared between following sectors: sale, general company situation as well as payment capacity. The conformity of the direction, dynamic and conjuncture force was surveyed. Results indicate a diversification of company types. It can be estimated that prognoses are formulated with 50 per cent coefficient of the prognostic conservatism.

РЕЗЮМЕ

В статье исследовалась степень, в какой респонденты в тестах по конъюнктуре используют консервативный принцип status quo. Исследование касалось строительной, торговой и промышленной конъюнктуры в целом и по величине предприятий. Были рассмотрены три сравниваемые переменные между секторами: продажа, общая ситуация фирм и платежеспособность. Исследовалось соответствие направления, динамики и силы конъюнктуры.

Результаты указывают на дифференциацию отдельных типов фирм. В общем можно оценивать, что прогноз определяется с 50% коэффициентом прогностичного консерватизма.