

ANDRZEJ K. KOŹMIŃSKI*
ADAM NOGA**
KATARZYNA PIOTROWSKA***
KRZYSZTOF ZAGÓRSKI****

W poszukiwaniu antykruczości systemu społeczno-ekonomicznego – zastosowania syntetycznego wskaźnika ALK

Wprowadzenie

W naszym artykule przedstawiamy wyniki interdyscyplinarnych badań prowadzonych przez nas w Akademii Leona Koźmińskiego w Warszawie. Badania dotyczą poszukiwania podstaw teoretycznych i analizy praktycznej cyklicznych przemian dokonujących się w polskiej gospodarce i polskim społeczeństwie – na tle przemian ekonomicznych, społecznych i politycznych w świecie. Sądzymy, że tradycyjna w naukach ekonomicznych analiza koniunkturalna wzrostów i spadków PKB, zatrudnienia czy inflacji ma już dzisiaj coraz słabszą wartość poznawczą, zdolność prognozowania, a przede wszystkim coraz bardziej ograniczoną możliwość kształtowania skutecznej polityki gospodarczej i społecznej: swoistego zarządzania i przedsiębiorczości makroekonomicznej państwa.

Przedstawiamy więc teorię oraz metodologię konstrukcji i analizy wskaźnika zrównoważonego rozwoju społeczno-ekonomicznego Akademii Leona Koźmińskiego (wskaźnika ALK), w którym cztery grupy czynników cząstkowych: ekonomiczne zewnętrzne i wewnętrzne oraz społeczna sytuacja bieżąca i społeczne przewidywania w latach 1999–2012, oddziałując różnokierunkowo na siebie, tworzą syntetyczny wskaźnik cyklicznych przemian w polskiej gospodarce i społeczeństwie XXI wieku. Odkryliśmy, że fazy tych cykli mają różne początki i końce

* Prof. dr hab. Andrzej K. Koźmiński, Akademia Leona Koźmińskiego w Warszawie – e-mail: kozmin@kozminski.edu.pl

** Prof. dr hab. Adam Noga, Akademia Leona Koźmińskiego w Warszawie – e-mail: anoga@kozminski.edu.pl

*** Mgr Katarzyna Piotrowska, Akademia Leona Koźmińskiego w Warszawie – e-mail: kpiotrowska@alk.edu.pl

**** Prof. dr hab. Krzysztof Zagórski, Akademia Leona Koźmińskiego w Warszawie – e-mail: zagorski@kozminski.edu.pl

w porównaniu z datami „klasycznych” wahań koniunktury ekonomicznej. Nasz wskaźnik pokazuje, kiedy i dlaczego specyficzna konfiguracja czterech grup czynników cząstkowych, a nie tylko ich poziom, może stać się przyczyną załamania lub pobudzać rozwój.

Analiza kształtowania się syntetycznego wskaźnika ALK oraz wpływającej na niego burzliwej dynamiki wskaźników cząstkowych zachęca również do wykorzystania go do celów prognostycznych, a właściwie do celów programowych polityki społeczno-gospodarczej, chroniącej Polskę przed załamaniem gospodarczymi i społeczno-politycznymi. W świetle naszych badań okazuje się bowiem, że „klasyczne” prognozowanie ekonometryczne ma tutaj bardzo ograniczony, jedynie szkieletowy charakter, a kluczowego znaczenia nabiera przygotowanie gospodarki na „nieprognozowalne” zdarzenia, swoiste „czarne łabędzie”, czyli nadanie gospodarce cech antykruchości według terminologii jednego z najwybitniejszych współczesnych prognostyków Nassima Taleba.

Szczególnie istotny jest jednak aspekt aplikacyjny wskaźnika ALK. Koncepcja równowagi funkcjonalnej opiera się na założeniu, że pewien minimalny poziom równowagi jest warunkiem sterowności systemu, czyli jego podatności na impulsy ośrodka kierowniczego. Zakłócenia równowagi występują wówczas, gdy zgodnie z teorią Liapunova (1992) poszczególne jego składniki nadmiernie odchylają się od siebie, czyli innymi słowy – równowagi cząstkowe „rozjeżdżają się”, co znajduje swój wyraz w rosnących odchyleniach standardowych. Zakłócenia równowagi mogą ciągnąć ogólny wskaźnik zarówno w górę, jak i w dół. Mogą więc mieć zarówno wpływ pozytywny, jak i negatywny. Kiedy jednak utrzymują się przez czas dłuższy, zagrażają sterowności systemu, czyli podatności na impulsy kierownicze. Dla utrzymania sterowności na wystarczającym poziomie konieczne jest wykorzystanie zależności pomiędzy składnikami równowagi i skompensowanie spadku jednych przez inne. W ten sposób statystyczny obraz równowagi społeczno-ekonomicznej może stać się dla polityków czymś w rodzaju „tablicy rozdzielczej”, na której zielone, pomarańczowe i czerwone wskaźniki niosą ostrzegawcze diagnozy i sugestie przeciwdziałania niepożądanym zdarzeniom. Takie podejście pozwala uniknąć „przebiegów” zarówno ekonomiczno-technokratycznego, jak i socjalnego.

Prognoza kształtowania się wskaźnika na najbliższych kilka lat wskazuje, że „rozjeżdżają się” ekonomiczne i społeczne elementy składowe równowagi ogólnej. O ile uwarunkowania ekonomiczne pozostają stabilne z lekką tendencją wzrostową, to zewnętrzne czynniki społeczne, czyli oczekiwania charakteryzują się tendencją spadkową, stanowiąc potencjalnie narastające zagrożenie dla osiągniętego poziomu „dobrostanu” i zarazem równowagi, czyli sterowności systemu. Wymaga to skoncentrowania polityki na obniżeniu poczucia niepewności i zagrożenia i poprawie społecznych oczekiwań przyszłości. W przeciwnym razie bowiem grozi kryzys indukowany czynnikami społecznymi, a nie ekonomicznymi, jak się zwykle uważać. Ten kryzys może się wyrazić zarówno zahamowaniem, a nawet regresem osiągniętego poziomu cywilizacyjnego, jak i dalszym osłabieniem mechanizmów rządzenia i zarządzania państwem.

W końcowej części artykułu przedstawiamy więc swoisty „dekalog” polityki społeczno-gospodarczej dla Polski, która może nadać systemowi społeczno-gospodarczemu tak pożądane cechy antykruchości poprzez przywrócenie zaufania społeczeństwa do rynku, biznesu i państwa. Nasze propozycje obejmują działania zmierzające do uruchomienia „trzeciej fali” polskiej przedsiębiorczości, kreatywności i innowacji nie tylko w sferze biznesu, ale także np. publicznej służby zdrowia i administracji, społeczności lokalnych czy organizacji pozarządowych. Wymaga to nie tylko zmian instytucjonalnych (np. w sferze stanowienia i egzekucji prawa), lecz także znacznie głębszych zmian kulturowych wynikających z afirmacji wolności, człowieka, obywatela i przedsiębiorcy w ramach dobrze uporządkowanego, przewidywalnego i pomocnego państwa.

1. Podstawy teoretyczne

U podstaw prowadzonych przez nas badań równowagi społeczno-gospodarczej w Polsce leżą trzy uzupełniające się koncepcje teoretyczne:

- 1) pomiaru rozwoju społeczno-gospodarczego za pomocą wskaźników wychodzących poza wskaźnik dochodu narodowego (nie rezygnując jednak z niego jako jednego ze składników wskaźnika ogólnego) i obejmujących jego społeczne aspekty;
- 2) równowagi systemu społeczno-ekonomicznego jako warunku jego sterowności, czyli jego podatności na procesy rządzenia i zarządzania;
- 3) budowy antykruchości systemu, czyli jego odporności na trudne lub niemożliwe do przewidzenia zakłócenia równowagi.

Aż do drugiej połowy XX wieku powszechnie i prawie wyłącznie stosowanym oraz niekwestionowanym wskaźnikiem rozwoju społeczno-gospodarczego był poziom dochodu narodowego, najczęściej *per capita*, i jego dynamika. S. Kuznets, jeden z prekursorów nowoczesnych ekonomicznych analiz rozwoju, w swym raporcie dla Senatu USA już osiemdziesiąt lat temu dał jednak wyraz przekonaniu, że jest to wskaźnik zbyt uproszczony i zbyt jednostronny (Kuznets 1934, s. 5–6). Mimo tego poważne prace nad uzupełnieniem lub alternatywami PKB rozpoczęły się dopiero od około pięćdziesięciu lat temu, od kiedy wzrosło zainteresowanie wskaźnikami społecznymi (Bauer 1966; Moser 1973) oraz zintegrowanym systemem statystyki społecznej w skali międzynarodowej (UN 1975) i w Polsce (Zagórski 1972, 1972a, 1975). Poprzedzone to było pracami R. Stone’a nad ulepszeniem systemu rachunków narodowych i zastosowaniem ich metod do rachunków społeczno-demograficznych (Stone, Brown 1962; Stone 1966). Bardzo szybko prace te zaowocowały propozycjami konstruowania złożonych indeksów rozwoju społecznego. Jako pionierski wymienić by tu należało program badawczy UNRISD (McGranahan i in. 1970). Pojawia się coraz więcej takich prób, kontynuowane są też niektóre dawno rozpoczęte programy (Constanza i in. 2009; Espinoza,

Arechvala 2013 ; Madonia, Cracolizzi, Cuffaro 2013; NEF 2009; OECD 2013; Reig-Martinez 2013; Shopelmann i in. 2010; UNDP 2013). Ostatnio wzrasta zainteresowanie kompleksowymi, specyficznymi dla poszczególnych krajów miarami rozwoju społeczno-gospodarczego ze strony władz państwowych, np. we Francji (Stiglitz i in. 2013) lub w Niemczech (Gisselmann i in. 2013), choć pierwszy taki projekt opracowany został już dość dawno na zlecenie króla Bhutanu (Pennock, Ura 2011, Ura i in. 2012).

Niektóre z tych projektów dotyczą tylko wskaźników społecznych, inne integrują aspekty społeczne i ekonomiczne. Integracja taka dokonywana jest zgodnie z paradygmatem „*beyond GDP*” (Constanza i in. 2009 ; Fleurbary, Blanchet 2013). W ten ogólny trend wpisuje się nasza propozycja wskaźnika rozwoju społeczno-ekonomicznego ALK dla Polski. Opracowanie tego wskaźnika dokonane zostało we wspomnianym wyżej paradygmacie „*beyond GDP*”, rozumianym jako zalecenie uzupełnienia – lecz nie zastąpienia – miary dochodu narodowego pomijanymi dotąd wskaźnikami ekonomicznymi oraz wskaźnikami różnych aspektów sytuacji społecznej. W ten sposób proponowany przez nas wskaźnik umożliwia bardziej wszechstronną, a zarazem syntetyczną charakterystykę rozwoju społeczno-gospodarczego.

U podstaw konstrukcji syntetycznego wskaźnika równowagi społeczno-ekonomicznej leży koncepcja równowagi funkcjonalnej jako czynnika warunkującego sterowność, a zatem przetrwanie i rozwój złożonego systemu w burzliwym otoczeniu. Tak rozumiane pojęcie równowagi wielu autorów stosowało (lub częściej proponowało stosować) do wyjaśniania dynamiki funkcjonowania organizacji (March 1981; Koźmiński, Oblój 1989) i większych, bardziej złożonych systemów (Weintraub 1974; Koźmiński 1995).

W ramach proponowanej koncepcji wskaźnika równowaga, czyli wzajemne dostosowanie i uzgodnienie (współzmienność) zachodzi pomiędzy czterema wymiarami rozwoju: ekonomicznymi aspektami zewnętrznymi i wewnętrznymi oraz społecznymi oczekiwaniami oraz obiektywną i subiektywną charakterystyką bieżącej sytuacji społecznej. Udało się dobrać statystyczne wskaźniki wszystkich tych czterech wymiarów rozwoju i prześledzić ich kształtowanie się oraz stopień równowagi (współzmienności, uzgodnienia) pomiędzy nimi w okresie 1999–2012. Średnią w danym roku z czterech złożonych indeksów charakteryzujących te cztery aspekty rozwoju społeczno-ekonomicznego traktujemy jako ogólny (syntetyczny) wskaźnik rozwoju społeczno-ekonomicznego. Za wskaźnik zbieżności czterech indeksów cząstkowych przyjęliśmy ich odchylenie standardowe. Przeprowadziliśmy analizę i interpretację zmienności w czasie wszystkich czterech wskaźników cząstkowych i wskaźnika ogólnego. Uzyskaliśmy empiryczne potwierdzenie, że ogólny wskaźnik równowagi rozwoju stanowi syntetyczne odzwierciedlenie społecznego „dobrostanu”, ponieważ stwierdziliśmy jego wysoką korelację negatywną z liczbą samobójstw oraz pozytywną z mierzonym regularnie przez CBOS dobrym stanem psychicznym reprezentatywnej próby Polaków.

Byliśmy w stanie sformułować *ex post* wiele wyjaśnień zaobserwowanej dynamiki wskaźników. Pojawił się jednak problem prognozowania przyszłości i wyciągania z prognoz wniosków użytecznych dla praktyki zarządzania i rządzenia.

W tej pracy podejmujemy próbę zmierzenia się z tak określonym problemem. Analizując badane zmiany, odnosimy się przy tym do idei kruchości i antykruchości (Taleb 2013) oraz zwracamy szczególną uwagę na zagadnienie równowagi (i jej braku) pomiędzy wyodrębnionymi aspektami rozwoju.

Idea antykruchości zrodziła się jako odpowiedź na zjawisko narastającej „uogólnionej niepewności”, czyli niemożności skutecznego przewidywania kluczowych parametrów przetrwania i rozwoju wszelkich systemów społeczno-ekonomicznych – od rodzin poczynając, na państwach i ich związkach kończąc. Przyczyną są „czarne łabędzie”: zjawiska ważne (zasadniczo zmieniające parametry funkcjonowania systemów), a zarazem mało prawdopodobne, czyli trudne lub wręcz niemożliwe do przewidzenia (Taleb 2007). Niektórzy autorzy dopatrują się przyczyn tych zjawisk w grach prowadzonych przez aktorów wewnątrz systemów (np.: Crozier, Friedberg 1982; Koźmiński, Zawiślak 1979; Koźmiński 2014). Historia polityczna i ekonomiczna świata oraz historia biznesu dostarczają w nadmiarze przykładów potwierdzających te tezy.

Pojawia się uzasadnione podejrzenie, że „czarne łabędzie” rodzą się w wyniku trudnych do przewidzenia zakłóceń kruchoj równowagi, czyli wzajemnego dopasowania niewielkich wahań (Lyapunov 1992) pomiędzy siłami o sprzecznych wektorach działającymi w systemach. Ich skutki podlegają całkowicie niespodziewanym amplifikacjom zgodnie z teorią katastrof (Thom 1991).

Zbudowaliśmy funkcję matematyczną, która opisuje dynamikę wskaźnika ALK jako syntetycznego wskaźnika równowagi ogólnej. Pozwala ona antycypować przegięcia, w których nadmiernie „rozjeżdżają się” wskaźniki cząstkowe, mierzące cztery elementy składowe równowagi. System narażony jest na obniżenie czy utratę sterowności, czyli zgodnie z sugestią Nassima Taleba (2013) wzrost kruchości systemu. Rośnie tym samym ryzyko spadku wartości wskaźnika charakteryzującego ogólny poziom równowagi rozwoju społeczno-ekonomicznego. Nie pójdziemy jednak drogą „proroctw” ani prostej ekstrapolacji znanych trendów. Na poziomie prognozy poprzestajemy na konstatacji narastania kruchości systemu i wskazaniu najważniejszych uwarunkowań tego zjawiska. Formułując wnioski z naszych badań, skoncentrujemy się na „antykruchości” systemu, czyli jego zdolności do pokonywania grożącego kryzysu – kiedykolwiek i skądkolwiek by on nie przyszedł.

2. Konstrukcja wskaźnika równowagi

Podstawową i unikalną zaletą wskaźnika ALK jest jego syntetyczny charakter, czyli zdolność do jednoczesnego pomiaru poziomu:

- osiągniętego poziomu rozwoju cywilizacyjnego, obejmującego całe bogactwo społecznych i ekonomicznych aspektów;
- równowagi funkcjonalnej systemu, czyli jego sterowności mierzonej stopniem zbieżności indeksów, a w praktyce odchyleniem standardowym czterech podstawowych wymiarów.

Nasz syntetyczny wskaźnik obejmuje cztery wymiary rozwoju społeczno-demograficznego, dwa ekonomiczne i dwa społeczne. Każdy z nich mierzony jest zestawem prostych wskaźników zaczerpniętych z ogólnie dostępnych statystyk, zagregowanych w cztery indeksy. Na podstawie wcześniejszych analiz i własnej konstrukcji modelowej uznaliśmy, że zmiany zachodzące w międzynarodowych stosunkach gospodarczych i międzynarodowym otoczeniu gospodarki są wyprzedzające w stosunku do wewnętrznych zmian gospodarczych (Koźmiński i in. 2014, s. 258). Okazało się też, że zmiany przewidywań przyszłej sytuacji przez polską opinię publiczną wyprzedzają jej późniejsze oceny, a także rzeczywiste (obiektywne) zmiany społeczne (Koźmiński i in. 2014, s. 261). Dlatego też wskaźniki społeczne zgrupowaliśmy w kategorii społecznych przewidywań przyszłości oraz subiektywnych i obiektywnych wskaźników sytuacji bieżącej. Podział ten przedstawiony jest w tabeli 1. Takie nasze modelowe ujęcie będzie miało kluczowe znaczenie dla prognozowania zjawisk społeczno-gospodarczych.

Tabela 1
Cztery kategorie wskaźników społeczno-ekonomicznych

Wskaźniki	Zewnętrzne/Wyprzedzające	Wewnętrzne/Bieżące
Ekonomiczne	„ Ekonomiczne zewnętrzne ” (relacje międzynarodowe)	„ Ekonomiczne wewnętrzne ” (ekonomiczna sytuacja wewnętrzna)
Społeczne	„ Społeczne oczekiwania ” (przewidywania zmian przez opinię publiczną)	„ Społeczna sytuacja ” (bieżące oceny przez opinię publiczną i bieżące wskaźniki obiektywne)

Jak widać, nastroje społeczne uczyniliśmy obok obiektywnych elementów społecznych i ekonomicznych składnikiem pojęcia rozwoju społeczno-gospodarczego. Uczyniliśmy tak z dwóch powodów. Po pierwsze, rozwój gospodarki nie może być traktowany jako cel sam w sobie, ale jako środek polepszania „kondycji ludzkiej”, w tym także zadowolenia, szczęścia, optymizmu itp., czyli stanu określonego angielskim terminem „*well-being*”, niezbyt zrećcznie tłumaczonego na język polski jako „dobrostan” społeczny i psychiczny. Po drugie, nastroje społeczne, polityczne i ekonomiczne kształtują realne zachowania indywidualne i zbiorowe, a te kształtują stan społeczeństwa i gospodarki. Występuje tu wyraźne sprzężenie pomiędzy subiektywnymi i obiektywnymi aspektami życia społecznego, politycznego i ekonomicznego. Rozerwanie tego sprzężenia uniemożliwia zrozumienie dynamiki społeczeństwa i gospodarki i może mieć bardzo negatywne skutki dla dalszego rozwoju.

Wstępna selekcja prostych wskaźników tworzących wspólnie cztery indeksy miała w dużej mierze charakter intuicyjny. Niezbędne okazało się więc merytoryczne i statystyczne zweryfikowanie pierwotnej listy. Statystyczna weryfikacja dokonana została za pomocą wstępnej analizy korelacji, a następnie zastosowania współczynnika α Cronbacha, mierzącego wewnętrzną spójność czterech syntetycz-

nych wskaźników mierzących „częstkowe” równowagi. Ostateczna lista wskaźników szczegółowych, wchodzących w ich skład, przedstawia się następująco:

1. Czynniki ekonomiczne wyprzedzające (zewnętrzne) – równowaga ekonomiczna zewnętrzna ($\alpha = 0,788$)
 - wielkość bezpośrednich inwestycji zagranicznych (BIZ) w Polsce;
 - kształtowanie się indeksu WIG 20 na warszawskiej GPW;
 - wartość importu;
 - wielkość eksportu;
 - kurs euro (odwrócony);
 - *spread* (różnica) między oprocentowaniem polskich 10-letnich obligacji i obligacji RFN (odwrócony);
 - *spread* między oprocentowaniem polskich 10-letnich obligacji i obligacji USA (odwrócony).
2. Równowaga ekonomiczna wewnętrzna ($\alpha = 0,839$)
 - produkcja energii elektrycznej;
 - liczba mieszkań oddawanych do użytku;
 - wzrost realnego wynagrodzenia;
 - produkt krajowy brutto;
 - wielkość spożycia;
 - wielkość akumulacji w gospodarce;
 - rentowność brutto przedsiębiorstw;
 - wielkość długu publicznego w stosunku do PKB (odwrócona);
 - stopa inflacji (odwrócona);
 - stopa bezrobocia (odwrócona).
3. Czynniki społeczne wyprzedzające (przewidywania) – równowaga społeczna zewnętrzna ($\alpha = 0,966$).

Stosunek pozytywnych („poprawi się”) do negatywnych („pogorszy się”) odpowiedzi na pytanie, czy w ciągu najbliższego roku sytuacja pod danym względem poprawi się, czy pogorszy.

 - przewidywania zmian sytuacji politycznej w Polsce;
 - przewidywania zmian sytuacji gospodarczej w Polsce;
 - przewidywania zmian sytuacji ogólnej w Polsce;
 - przewidywania zmian sytuacji w zakładzie pracy;
 - „Czy za rok Panu(i) i Pana(i) rodzinie będzie żyło się lepiej, czy gorzej?”;
 - (nie) liczenie się z możliwością utraty pracy.
4. Bieżąca ocena sytuacji społecznej – równowaga społeczna wewnętrzna ($\alpha = 0,965$)
 - stosunek do rządu (stosunek liczby zwolenników do przeciwników);
 - ocena sytuacji politycznej (stosunek liczby opinii „dobra” do „zła”);
 - ocena sytuacji gospodarczej (stosunek liczby opinii „dobra” do „zła”);
 - „Czy obecnie Panu(i) i Pana(i) rodzinie żyje się dobrze?” (stosunek odsetka wskazań „dobrze” do wskazań „źle”);
 - ocena sytuacji w zakładzie pracy (stosunek liczby opinii „dobra” do „zła”);
 - *Business Confidence Index*;
 - zagrożenie ubóstwem – granica ubóstwa skrajnego (odwrócone);

- wydatki z budżetu na opiekę społeczną (% PKB) (odwrócone);
- wydatki z budżetu na ochronę zdrowia (% PKB);
- bezrobocie młodych (15–24 lat);
- dostęp do Internetu (% gospodarstw domowych);
- przyrost naturalny;
- zgony niemowląt (odwrócone);
- stosunek liczby ludności w wieku przedprodukcyjnym do ludności w wieku poprodukcyjnym;
- osoby w wieku 18–59 lat mieszkające w gospodarstwach domowych bez osób pracujących (w %) (odwrócone);
- liczba absolwentów uczelni wyższych (publicznych i niepublicznych łącznie);
- liczba pracowników naukowo-badawczych;
- młodzież nie kontynuująca nauki (%) (odwrócone);
- liczba zabójstw (odwrócona);
- liczba kradzieży (odwrócona);
- liczba polskich studentów, którzy wyjechali na stypendium z programu Erasmus;
- liczba cudzoziemców w szkołach wyższych.

Dla każdego z tych wskaźników obliczono jego wartość zestandaryzowaną za poszczególne lata w okresie 1999–2012 (późniejsze dane nie były dostępne). Następnie obliczone zostały w każdym roku średnie wartości tak uzyskanych wskaźników w każdej z czterech wyróżnionych kategorii. Średnie tak obliczonych czterech indeksów składają się w poszczególnych latach na wartość ogólnego wskaźnika ALK.

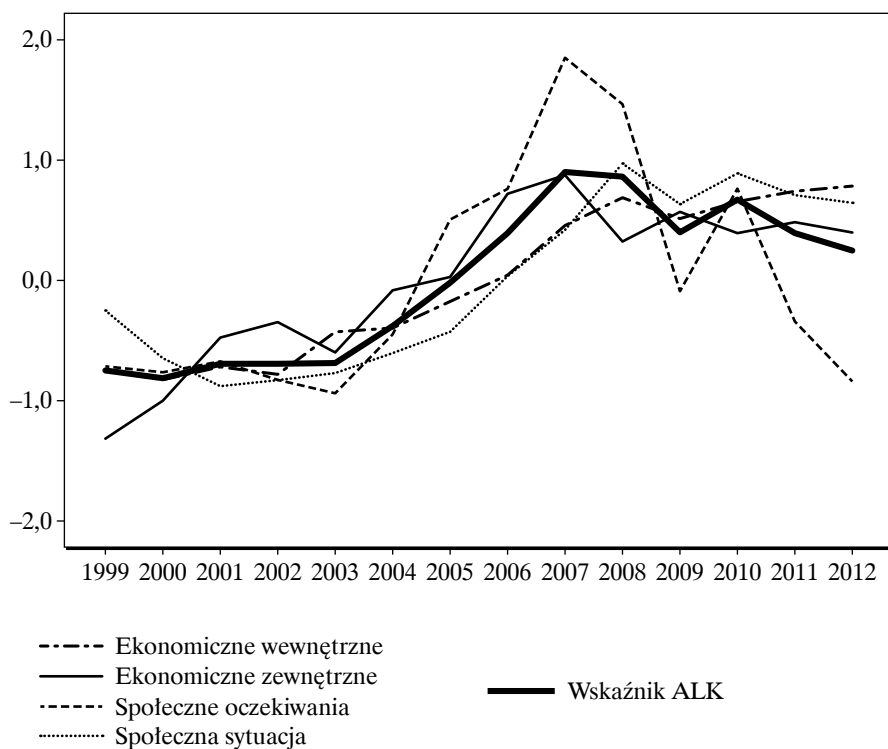
Horyzont czasowy, w którym obserwowaliśmy dynamikę naszych wskaźników, sprzyja takim obserwacjom, ponieważ mimo krótkiego stosunkowo okresu 12 lat obejmuje on burzliwe zmiany, włącznie z najpoważniejszym od 1929 r. kryzysem finansowym i gospodarczym rozpoczętym w lecie 2007 r. Wskaźnik został więc określony w silnym stress teście. Wydaje się, że gorszą podstawą do prognozowania byłby długi okres, ponieważ długi trend spłaszcza i łagodzi zagrożenia ponownego pojawienia się głębokiego załamania, które wciąż potencjalnie może się pojawić, chociażby ze względu na trudność poważniejszego niż powierzchowne zalecenia obecnego kryzysu.

3. Statystyczna weryfikacja wskaźnika

Wysoka zbieżność zmian wyróżnionych czterech aspektów rozwoju pozwala na obliczenie ogólnego wskaźnika ALK jako średniej czterech złożonych wskaźników równowag cząstkowych (rys. 1).

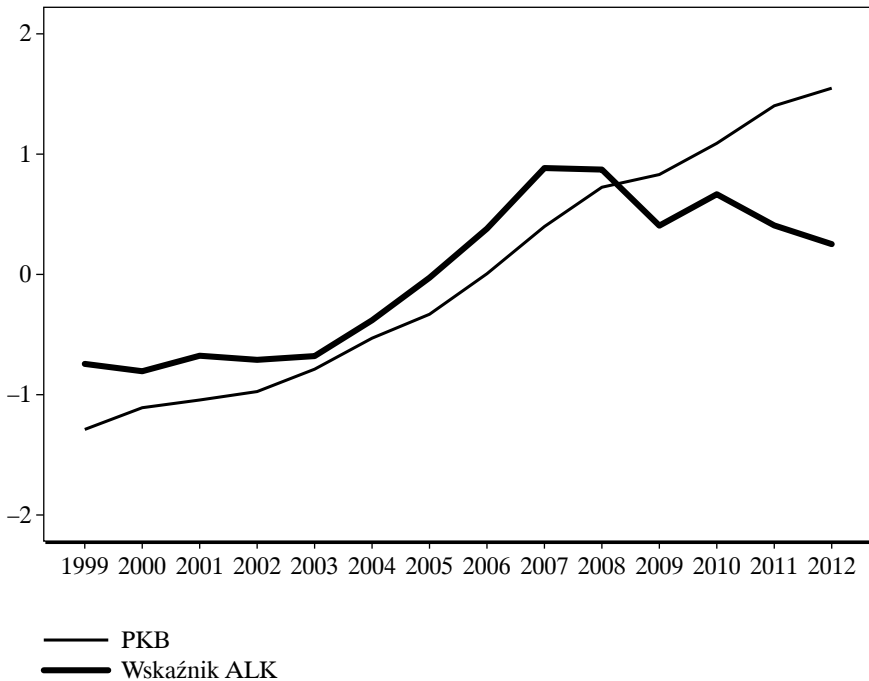
Widać wyraźnie, że zmiany dokonujące się w Polsce przebiegają w bardzo podobny sposób we wszystkich czterech wymiarach rozwoju. Zmiany poziomu ogólnego

Rysunek 1
Cztery komponenty wskaźnika ALK



nego wskaźnika, obliczonego jako ich średnia, dobrze obrazują przebieg rozwoju społeczno-ekonomicznego w Polsce. Potrzebne jest przy tym ważne wyjaśnienie. Ekonomiści i politycy podkreślają stały choć nikły wzrost polskiego PKB w okresie kryzysowym i pokryzysowym. Nasz ogólny wskaźnik wykazuje jednak w tym samym czasie nieznaczną tendencję spadkową z niewielkimi wahaniami. Stoi to więc w sprzeczności z ogólnym przekazem ekonomistów, którzy uważają, że to gospodarka decyduje o nastrojach: „być określa świadomość”. Sprzeczności takiej jednak nie ma, bo PKB jest wskaźnikiem wyłącznie ekonomicznym, a wskaźnik ALK dotyczy również sytuacji społecznej, w tym np. bezrobocia, zagrożenia ubóstwem, pogarszającej się struktury demograficznej, niedostatecznych rezultatów polityki społecznej i pogarszających się nastrojów zarówno ekonomicznych, jak i politycznych. Nieznaczną tendencją spadkową obserwowaną w ostatnich latach, nie wykazywaną przez tak jednostronny wskaźnik jak PKB, dotyczy ogólnej sytuacji społeczno-gospodarczej, a nie tylko produkcji dóbr i usług. Wykazanie jej przez nasz wskaźnik świadczy o jego wysokiej „rozdzielczości” i praktycznej przydatności dla polityków i funkcjonariuszy państwa. Znamienne jest narastająca w czasie różnica pomiędzy PKB a wartościami wskaźnika ALK. Widać to wyraźnie na rysunku 2.

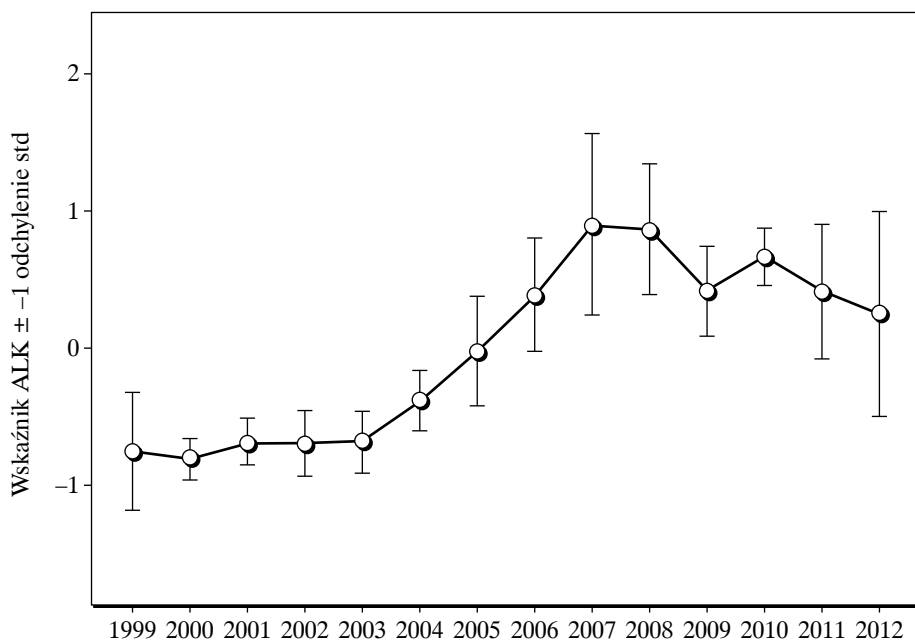
Rysunek 2
PKB i wskaźnik ALK w latach 1999–2012 (wartości standaryzowane)



W tym miejscu trzeba nawiązać do koncepcji równowagi. Za miarę równowagi przyjmujemy odchylenie standardowe wyróżnionych czterech wymiarów. Dzięki takiemu ujęciu możemy wyjść ponad obserwację wyłącznie wartości zintegrowanej miary rozwoju. Zgodnie z naszą hipotezą o krzywoliniowej zależności okresy wzrostu i spadku (a więc zmian w obu kierunkach) charakteryzują się wzrostem odchylenia standardowego, a więc zachwianiem równowagi. Okres relatywnej stagnacji lub co najmniej spowolnienia na samym początku XXI wieku charakteryzował się dużą równowagą. Z kolei początek związanego z kryzysem spadku wskaźnika w latach 2007–2009 nastąpił w warunkach bardzo wysokiej nierównowagi w 2007 r. Uwzględnienie zróżnicowania składowych wskaźnika ALK pozwala zatem m.in. na nieco mniej optymistyczne interpretacje bardzo wysokich wartości wskaźnika, jak np. z 2007 r. Odchylenie standardowe, które w tym roku przekroczyło 0,65, wskazuje na zbyt wysoką nierównowagę, a tym samym wysokie prawdopodobieństwo pogorszenia się ogólnej sytuacji społeczno-ekonomicznej w następnym roku lub, w najlepszym przypadku, zahamowania wzrostu. Należy zastanowić się, czy podobnie gwałtowny wzrost nierównowagi w 2012 r. doprowadzi do ponownego odwrócenia trendu i ogólnej poprawy sytuacji w latach następnych. Możemy zaryzykować próbę odpowiedzi na to pytanie na podstawie naszego modelu statystycznego, przedstawionego poniżej, we fragmencie poświęconym prognozie.

Rysunek 3

Zmiana wskaźnika ALK i odchyłek standardowych jego czterech komponentów

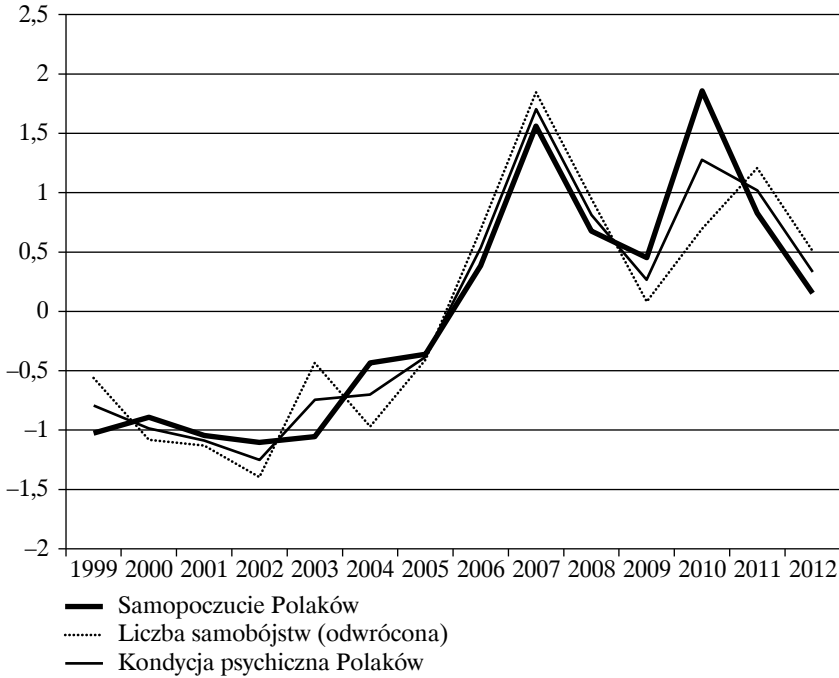


Zgodnie z tym, co pisaliśmy w naszym poprzednim opracowaniu (Koźmiński, Noga, Piotrowska, Zagórski 2014, s. 384), ostatecznym celem rozwoju gospodarczego i społecznego powinno być lepsze życie ludzi. Zbadanie trafności proponowanego tutaj wskaźnika równowagi społeczno-gospodarczej powinno zatem polegać na sprawdzeniu, czy jego poprawa powoduje lepsze życie, a pogorszenie skutkuje gorszym życiem społeczeństwa. Należałoby zatem znaleźć odrębną, nie wchodzącą w zakres naszego wskaźnika, miarę dobrej kondycji ludzi. Dysponujemy stosowaną corocznie w reprezentatywnych badaniach CBOS syntetyczną miarą psychologicznego samopoczucia Polaków. Jest to miara oparta na ocenach wystawianych przez ludzi własnemu stanowi emocjonalnemu, ma więc w dużej mierze charakter subiektywny. Za drugą obiektywną miarę dobrego życia przyjęliśmy „odwrócony” wskaźnik samobójstw (im mniej samobójstw, tym lepiej). Porównanie zmian tych dwóch wskaźników wykazuje ich wyjątkowo dużą zbieżność, co pozwala na obliczenie syntetycznego wskaźnika dobrej kondycji ludzi (rys. 4). Następnym krokiem powinno więc być sprawdzenie, jak zmiany proponowanego tu wskaźnika równowagi mają się do zmiennej, którą można uznać za rezultat tego rozwoju, tzn. do psychicznej kondycji społeczeństwa (rys. 5).

Zestawienie przedstawione na rysunku 5 pokazuje wyjątkowo silną korelację między wskaźnikiem ALK i wskaźnikiem kondycji psychicznej, który traktujemy jako „ostateczną” miarę dobrego życia, wynikającego z dobrego stanu społeczeństwa ($r = 0,952$; $\rho = 0,908$). Stanowi to najlepsze potwierdzenie trafności pierw-

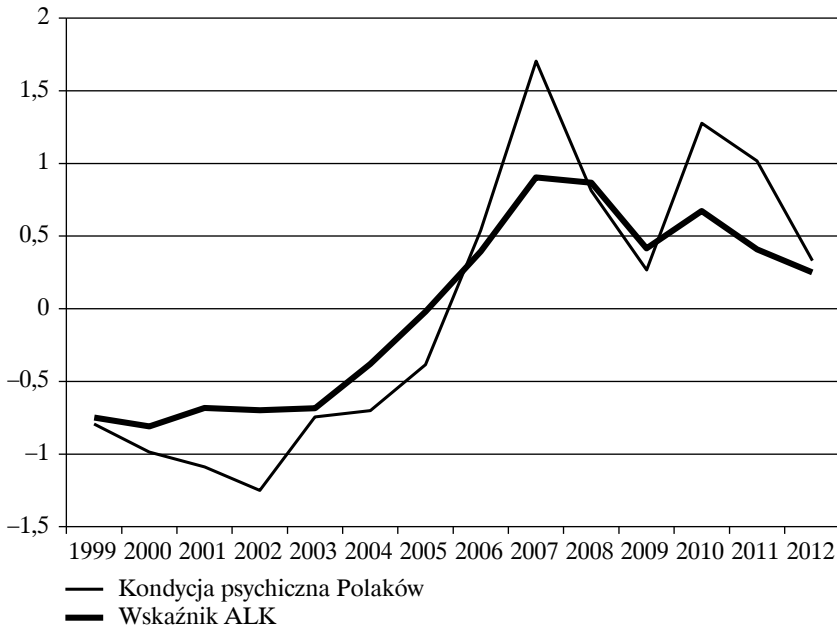
Rysunek 4

Zmiany psychicznego stanu społeczeństwa polskiego, 1999–2012



Rysunek 5

Wskaźnik syntetycznego rozwoju społeczno-gospodarczego a psychiczna kondycja Polaków, 1999–2012



szego z nich. Należy przy tym podkreślić większą zmienność w czasie ludzkiej kondycji psychicznej niż ogólnej sytuacji społeczno-ekonomicznej. Świadczy to raz jeszcze o wspomnianej już poprzednio „nadwrażliwości” ludzi na zmiany sytuacji społeczno-gospodarczej i skłonności do wahań nastrojów. Być może jest to konsekwencja historycznie nagromadzonych doświadczeń.

4. Analiza równowagi społeczno-gospodarczej w okresie 1999–2012

Zmiany ekonomicznych zewnętrznych i wewnętrznych aspektów rozwoju wykazały, zgodnie z przewidywaniami i wcześniejszymi analizami (Koźmiński i in. 2014, s. 258), dużą współzbieżność. Współczynnik korelacji dla 14 par obserwacji okazał się bardzo wysoki ($r = 0,829$, $\rho = 0,741$). Widać to wyraźnie na rysunku 6.

Mimo tej wysokiej korelacji, również zgodnie z oczekiwaniami, wykres wskazuje na „wyprowadzającą” naturę „zewnętrznego” wskaźnika cząstkowego wobec „wewnętrznego” wskaźnika charakteryzującego gospodarkę kraju. Wewnętrzna sytuacja gospodarcza Polski zaczęła się szybko poprawiać po 2002 r., podczas gdy sytuacja zewnętrzna wykazywała poprawę już w latach 1999–2002. Przejściowe pogorszenie sytuacji zewnętrznej w 2003 r. odbiło się tylko niewielkim spowolnieniem wzrostu „wewnętrznego” w 2004 r. Następny, kilkuletni okres poprawy zapoczątkowany został w wymiarze międzynarodowym po 2003 r., podczas gdy w wymiarze wewnętrznym rozpoczął się rok później. Spowodowane kryzysem finansowym załamanie sytuacji zewnętrznej nastąpiło w 2008 r., podczas gdy znacznie mniejsze pogorszenie sytuacji wewnętrznej w 2009 r. Niewielka poprawa zewnętrznej sytuacji gospodarczej w 2009 r. spowodowała podobną poprawę sytuacji krajowej rok później. Ta ostatnia utrzymywała się w ciągu następnych lat mimo nieznacznych wahań sytuacji zewnętrznej, co świadczy o uniezależnieniu się (przynajmniej częściowym) gospodarki krajowej od jej kontekstu międzynarodowego.

W okresie 1999–2012, w którym testowany był wskaźnik ALK, mamy dwa osłabienia gospodarcze w Polsce: pierwsze słabsze (2000–2001), drugie silniejsze (2008–2009), chociaż naprawdę drugie nie kończy się do dnia dzisiejszego. Syntetyczny wskaźnik pokazuje dobrze te osłabienia, co oczywiście nie jest rewelacją, ale na pewno ciekawe są społeczne konsekwencje tych załamań: w przypadku pierwszego syntetyczny wskaźnik pokazuje konsekwencje osłabienia do 2004 r. (choć w 2004 r. PKB rośnie o 5,3%, a nawet w 2003 r. rośnie o 3,9%), a w przypadku drugim od 2008 r. mamy płaski przebieg syntetycznego wskaźnika ALK, mimo że w tym okresie mamy w 2008 r. wzrost PKB o 5,1%, w 2010 r. o 3,9%, a w 2011 r. o 4,3%. To kolejna cenna cecha tego syntetycznego wskaźnika, zdecydowanie bardziej adekwatnie pokazująca stan społeczeństwa i gospodarki niż PKB, a także inne wskaźniki, pomijające społeczne uwarunkowania sterowalności gospodarkę.

Analiza wskaźników potwierdza, że zmiany w gospodarce następują pod bardzo silnym wpływem zmian na rynkach kapitałowych (w Polsce bardzo silna zmiana WIG 20), co w wcale nie oznacza podręcznikowej zależności, że giełda jest dobrym barometrem koniunktury albo narzędziem wyprzedzającym określone stany gospodarki. Silne zmiany na giełdzie miały źródła zewnętrzne: kryzysy nieruchomości w USA i w innych częściach świata indukują zachowania inwestorów na giełdzie warszawskiej: np. kryzys argentyński spowodował wycofywanie środków zainwestowanych w Polsce i na innych „rynkach wschodzących”. Bardzo silny dyktat giełd wyraża się w polskiej gospodarce silnym odpływem kapitału zagranicznego, obniżającym możliwości inwestycyjne w Polsce, psychologią apatii inwestycyjnej nawet wśród tych podmiotów, które posiadają środki inwestycyjne, spadkiem bogactwa konsumentów (oceniających swoje bogactwo według kursów akcji i przede wszystkim kursów jednostek uczestnictwa w funduszach inwestycyjnych), osłabiającym wydatki konsumpcyjne i inwestycyjne, oraz przede wszystkim podsycaniem sensacyjności krachu przez media, kształtujące bardzo silnie opinie kryzysowe konsumentów i częściowo inwestorów.

Krzywa zewnętrznych czynników ekonomicznych jest jednakże od 2007 r. powyżej syntetycznej krzywej i pozwala ją utrzymywać na płaskim przebiegu, bez obniżania się. Pokazuje ona przede wszystkim bardzo ambitny wzrost eksportu, jakkolwiek załamany w 2009 r. o 8 % w stosunku 2008 r., ale też ograniczanie importu.

Wzrost ogólnego importu, eksport do Niemiec, wzrost średniej płacy nominalnej, wykorzystania mocy energetycznych oraz natężenie ruchu na drogach, gdyby zostały przedstawione w postaci oddzielnych krzywych, dostarczyłyby nam bardzo ciekawego materiału ilustrującego spór o prymat wewnętrznych czy zewnętrznych czynników leżących u podstaw zmian koniunktury ekonomicznej w Polsce.

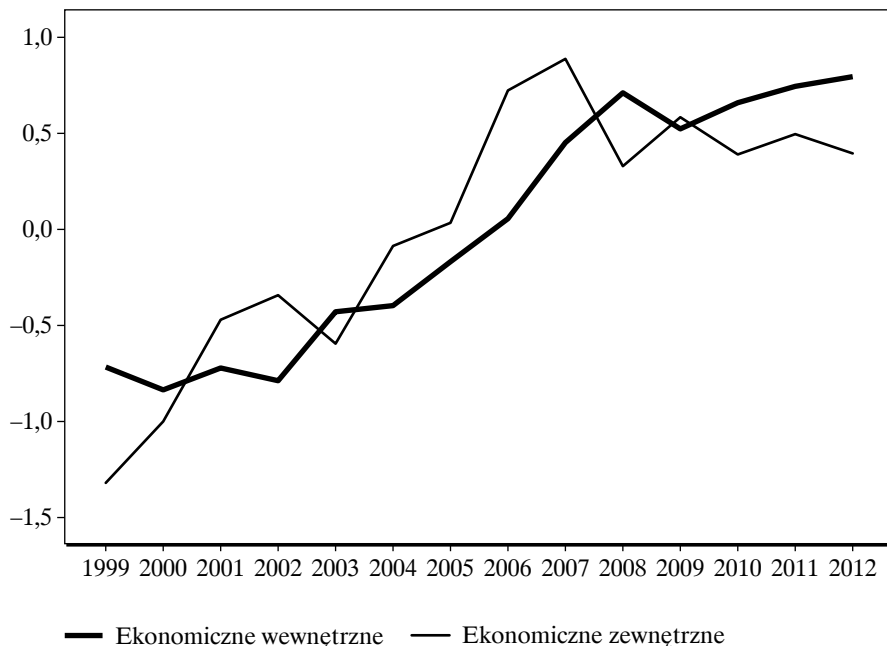
W latach 2006 i 2007 import rósł realnie odpowiednio o 17 i 15%! Tę typy zmiany już same w sobie są silnym sygnałem ostrzegania przed załamaniem. Eksport Polski do Niemiec w okresie od 2007 r. do 2012 r. zwiększył się z 26 mld euro do 35 mld euro, z jedynym rokiem spadkowym 2009, co pokazuje jego istotną rolę amortyzującą polską gospodarkę. Średnia płaca nominalna w latach 2007 i 2008 rosła odpowiednio o 7,9% oraz 10,0%, podczas gdy z reguły jej wzrost o 4–5% uważany jest za wysoki. W latach 2007–2009 średnie roczne zapotrzebowanie na moc szczytową zbliżało się do produkcji energii brutto, podczas gdy jeszcze w poprzednich dziesięciu latach produkcja ta była znacznie powyżej tego zapotrzebowania. W badaniach losowych natężenia ruchu na drogach prowadzonych przez GUS w latach 2007–2008 odnotowywano dwucyfrowe przyrosty.

Na rysunku 6 widać wyraźnie, jak czynniki ekonomiczne zewnętrzne „ciągną” w górę i w dół wewnętrzną sytuację ekonomiczną.

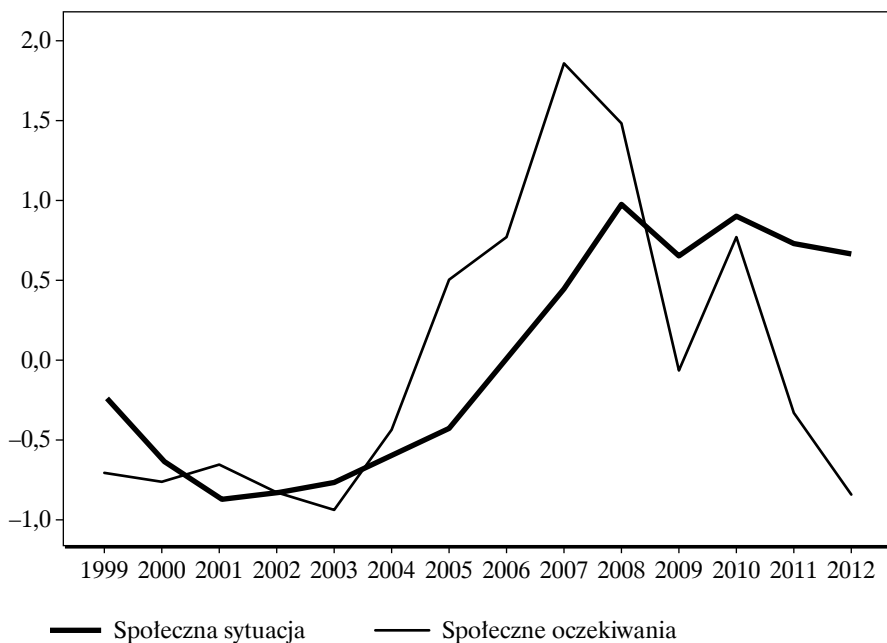
Zmiany obu społecznych indeksów składających się na wskaźnik równowagi również wykazują, zgodnie z oczekiwaniami, silną współzależność. Współczynnik korelacji r Pearsona wynosi 0,574, a ρ Spearmana 0,565 (rys. 7).

Nieco bardziej złożona jest kwestia wyprzedzającego charakteru społecznych przewidywań. Stopień optymizmu zaczął szybko spadać w 2008 r. w wyniku

Rysunek 6
Wyprzedzające (zewnętrzne) i bieżące (wewnętrzne)
wskaźniki ekonomicznych aspektów rozwoju



Rysunek 7
Wyprzedzające (społeczne oczekiwani) i bieżące (społeczna sytuacja)
aspekty rozwoju



wiadomości o kryzysie światowym i oczekiwań jego rychłego dotarcia do Polski; przełożyło się to na znacznie słabszy spadek ocen bieżącej sytuacji wraz z jej obiektywnymi wskaźnikami dopiero rok później. W tym przypadku można więc mówić o wyprzedzającym charakterze przewidywań. Sytuacja zmieniła się jednak w późniejszych latach, kiedy zmiany oczekiwań następowały w tym samym czasie co zmiany sytuacji bieżącej. Jednocześnie wzrost optymizmu obserwowany na początku XXI wieku zaczął się aż dwa lata później od niewielkiej poprawy sytuacji bieżącej, choć znaczne przyspieszenie bieżących ocen społecznych aspektów rozwoju w następnym okresie było już wyraźnie spóźnione (2005 r.) w stosunku do gwałtownego wzrostu optymizmu (2004 r.).

W wyniku tych analiz potwierdziły się wcześniejsze spostrzeżenia, że zmiany społecznego optymizmu i pesymizmu wskazują na silną tendencję do nadmiernego reagowania społeczeństwa na rzeczywiste warunki społeczne, rozpatrywane zarówno obiektywnie (na podstawie rzeczywistych wskaźników społecznych), jak i subiektywnie (na podstawie bieżących ocen własnej sytuacji). Przedkryzysowy silny wzrost optymizmu był znacznie większy od rzeczywistej poprawy sytuacji oraz jej ocen. Związany z kryzysem gwałtowny spadek tego optymizmu był też znacznie silniejszy od rzeczywistego pogorszenia sytuacji. Te wahania nastrojów pomiędzy optymizmem i pesymizmem były też znacznie silniejsze od zmian sytuacji w późniejszych latach. Propaganda Polski jako „zielonej wyspy”, której udało się uniknąć istotnych negatywnych skutków kryzysu, zaowocowała znacznie silniejszym wzrostem optymizmu niż niewielka wówczas poprawa aktualnej sytuacji. Następujące później ostrzeżenia polityków i mediów przed możliwością opóźnionego dotarcia niektórych aspektów kryzysu do Polski, uzupełnione wiadomościami o trudnościach budżetowych, konieczności oszczędzania na wydatkach społecznych i zawirowaniach w sprawie funduszy emerytalnych, spowodowały gwałtowny wzrost pesymizmu, o wiele większy niż nieznaczne pogorszenie obiektywnej sytuacji gospodarki i subiektywnej oceny sytuacji osób badanych. Jest to zjawisko bardzo niepokojące w świetle znanej w naukach społecznych prawidłowości, że optymizm lub pesymizm, kształtując wyobrażenia o przyszłości, stanowią znacznie ważniejszą determinantę postaw i zachowań społecznych i politycznych niż postrzeganie bieżącej sytuacji.

5. Prognoza równowagi

Wadą prognozowania metodami ekonometrycznymi jest zdolność przewidywania przede wszystkim „uśrednionych” procesów wolnych od nieciągłości, zasadniczo zmieniających przebieg badanych zjawisk. Na szczęście w badanym przez nas okresie takie właśnie gwałtowne zmiany następowały i dlatego uważamy, że model opisujący dokładnie kształt krzywej rozwojowej w całym okresie 1999–2012 stwarza także możliwości prognozowania zmian kierunku krzywej w perspektywie 2–3 lat.

Proponowany przez nas model przedstawia się w postaci ogólnej następująco:

$$ALK' = b_0 + b_1 \times ALK_{t-1} + b_2 \times \Delta ALK + b_3 \times (\Delta ALK)^2 - b_4 \times \Delta S - b_5 \times (\Delta S)^2 \quad (1a)$$

a z uwzględnieniem konkretnych wartości współczynników równania:

$$ALK' = -0,096 + 0,614 \times ALK_{t-1} + 0,052 \times \Delta ALK + 2,953 \times (\Delta ALK)^2 - 0,154 \times \Delta S - 2,013 \times \Delta S^2 \quad (1b)$$

gdzie :

- ALK' – wartość wskaźnika ALK w roku t (przewidywana),
 ALK_{t-1} – wartość wskaźnika ALK w roku poprzedzającym rok, dla którego dokonywane jest przewidywanie ($t-1$),
 $\Delta ALK = ALK_{t-1} - ALK_{t-2}$ – (różnica między wartością wskaźnika ALK w roku poprzedzającym przewidywanie a wartością dwa lata wcześniej),
 $\Delta S = S_{t-1} - S_{t-2}$ – (zmiana wartości odchylenia standardowego składowych wskaźnika między rokiem poprzedzającym rok, dla którego dokonywane jest przewidywanie, a dwoma latami wcześniej),
 S_{t-1} – wartość odchylenia standardowego składowych wskaźnika ALK w roku poprzedzającym rok, dla którego dokonywane jest przewidywanie ($t-1$).

Podstawowym założeniem jest tu przyjęcie krzywoliniowego kształtu zależności pomiędzy dotychczasowym tempem rozwoju oraz stopniem jego równowagi a dalszym jego przebiegiem. Zakładamy, że wspomniane dwie zależności mają kształt odwróconego „U”. Stagnacja społeczno-ekonomiczna oraz/lub całkowity brak nierównowagi (całkowita równowaga) nie sprzyjają dalszemu rozwojowi. Stymuluje go zachwianie równowagi powodowane bodźcem rozwojowym występującym w jednym lub niektórych tylko dziedzinach. Zarówno jednak zbyt ni wysoki wzrost nierównowagi, jak i zbyt szybki ogólny rozwój powodują „przeegrzanie” systemu, niesterowalność i „kruchość”. Mamy tu więc do czynienia z procesem przeciwnym do opisanego w bajce o brzydkim kaczątku. W naszym przypadku to zbyt wyrosnięty „biały łabędź” przekształca się w „czarnego”. Stosując tę metaforę, zwracamy uwagę na fakt, iż kruchość materiału występuje zarówno w warunkach jego przegrzania, jak i zmrózenia. Ustalenie punktu zmrózenia lub przegrzania powodującego odwrócenie trendu jest kwestią analizy empirycznej. Obserwacja dotychczasowych wyników pozwala na sformułowanie przypuszczenia, iż z pożądanym, sprzyjającym rozwojowi poziomem równowagi mamy do czynienia, gdy wartość odchylenia standardowego czterech składowych syntetycznego wskaźnika wynosi ok. 0,4. Jak dotąd nierównowaga na takim poziomie zawsze wiązała się ze wzrostem wartości wskaźnika ALK w kolejnym roku. Odchylenia znacznie przewyższające tę wartość (jak np. 0,67 w 2007 r.) lub zdecydowanie od niej niższe

(np. 0,17 w 2001 r. czy 0,21 w 2010 r.) zapowiadały natomiast pogorszenie się sytuacji społeczno-ekonomicznej lub stagnację.

W celu prognozowania ogólnego wskaźnika ALK niezbędne było prognozowanie również odchylenia standardowego jego czterech składowych. Posłużyliśmy się w tym celu wzorem:

$$S' = b_0 + b_1 \times S_{t-1} + b_2 \times (\Delta S)^2, \quad (1a)$$

$$S' = 0,238 + 0,427 \times S_{t-1} + 0,398 \times \Delta S - 0,017 \times (\Delta S)^2. \quad (1b)$$

(oznaczenia jak wyżej).

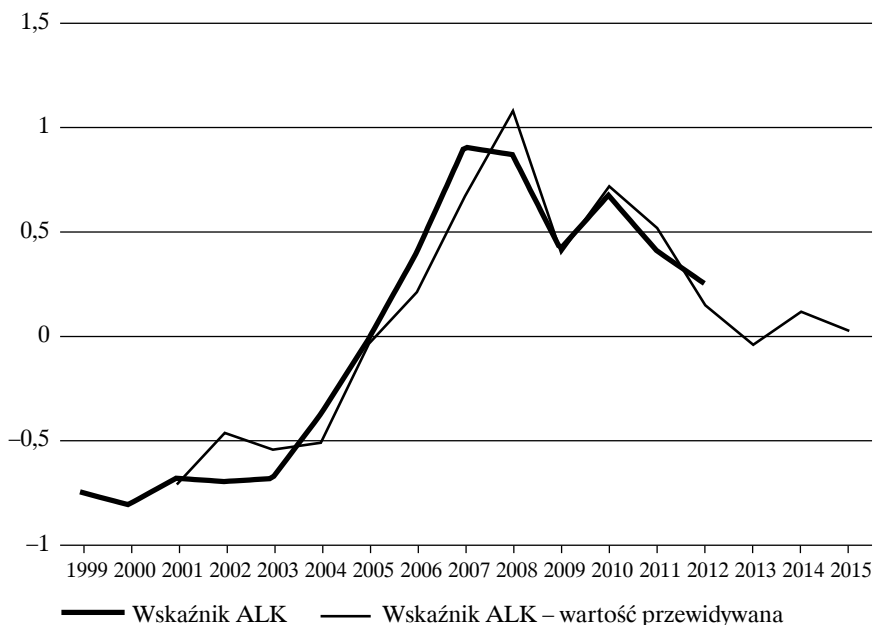
Stosując nasz model, udało się z bardzo dużą dokładnością odtworzyć rzeczywisty kształt krzywej wskaźnika ALK przez krzywą przewidzianą równaniem regresji, mimo jej załamań, które zostały przez nasz model dokładnie odtworzone. Korelacja między wartościami rzeczywistymi a estymowanymi na podstawie modelu wyniosła 0,97. Nasze estymacje trafnie pokazały punkty zmiany kierunku trendu, z rocznym tylko opóźnieniem zmian rzeczywiście zaobserwowanych w latach 2001 i 2003. Od 2005 r. do 2012 r. krzywe całkowicie się pokrywały, nawet w czasie częstych wahań w latach 2007–2010. Dotychczasowe pozytywne doświadczenia naszej analizy pozwalają jednak oczekiwać, iż prawidłowo przewidzimy ewentualną zmianę trendu rozwojowego w takim stosunkowo krótkim okresie. Model pozwolił na estymację wskaźnika ALK na trzy lata naprzód. W warunkach znacznej niepewności nie pokusiliśmy się jednak na estymacje w dłuższym okresie.

Wyniki przedstawia rysunek 8, porównujący zaobserwowaną i estymowaną krzywą wskaźnika ALK do 2012 r. oraz estymacje jej przebiegu za lata 2013 i 2015, dla których nie mamy bieżących danych statystycznych. Jak widać, w latach 2013–2015 przewidywaliśmy zahamowanie spadku wartości ogólnego wskaźnika ALK, a być może nawet jego nieznaczną poprawę.

Tego typu statystyczne predykcje nie mogą być jednak stuprocentowo pewne. Nie wiadomo bowiem, jaki „czarny łabędź” przyleci ze świata. Można tylko starać się zapobiegać pogorszeniu sytuacji i stymulować antykruchość, czyli odporność systemu na wstrząsy. Jednym ze sposobów wydaje się poprawa jakości życia politycznego, przekładającego się na nastroje społeczne. Dla zapobiegania znacznym, historycznym wahaniom na skali od społecznego optymizmu do pesymizmu istotne są wszelkie działania zmierzające do redukcji poczucia niepewności, stanowiącej istotny element sytuacji kryzysowej – np. w wyniku sytuacji w służbie zdrowia i jej fatalnych ocen społecznych (Koźmiński, Zagórski 2014; Staszyńska 2014).

Przyjmując zgodnie z naszą predykcją, że nastąpi zahamowanie spadku tempa rozwoju ekonomicznego, a nawet jego ponowny wzrost, należy to wykorzystać zmieniając proporcje przeznaczenia jego owoców na cele czysto ekonomiczne i społeczne na korzyść tych drugich w celu podniesienia antykruchości systemu społeczno-gospodarczego, czyli jego odporności na indukowane zewnętrznie i wewnętrznie, trudne do przewidzenia zaburzenia równowagi.

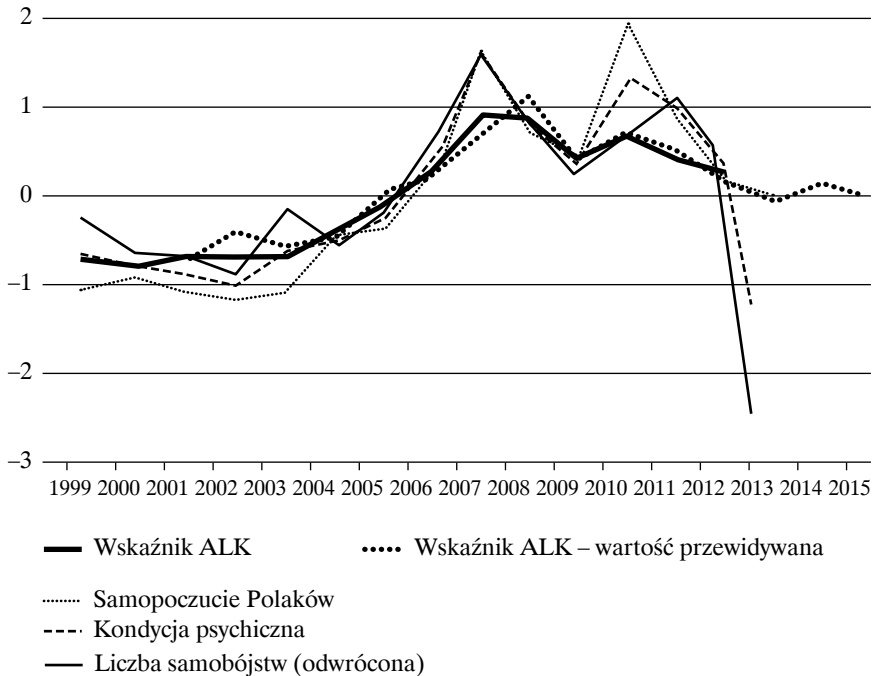
Rysunek 8
Rzeczywisty i przewidywany przebieg rozwoju społeczno-gospodarczego, mierzonego wskaźnikiem ALK



Biorąc pod uwagę zewnętrzne czynniki ekonomiczne i ich oddziaływanie na koniunkturę w Polsce jako czynniki wyprzedzające, jak to przyjęliśmy w naszym modelu, trzeba zwrócić uwagę na perspektywy rozwojowe całej Europy do końca tej dekady. Wykorzystując wstępnie (szkieletowo) światowe prognozy ekonometryczne, np. OECD („Economic Outlook”, www.oecd.org/eco/economicoutlook.htm) czy Banku Światowego (*Global Economic Prospects*, www.worldbank.org/en/publication/global-economic-prospects/), można wskazać, że Europa powinna się w miarę stabilnie rozwijać w tempie 1,5–1,8% średniorocznego wzrostu PKB, a Niemcy minimalnie wolniej: 1,4%. W świetle tych prognoz dotyczących Europy gospodarka Polski ma szansę na 3–4% wzrost gospodarczy do końca dekady. Nasza analiza tych prognoz i szeregu innych, ogłaszanych przez wiele instytucji i firm konsultingowych, wskazuje jednakże na ich dużą niepewność, co już zaczęło się potwierdzać w połowie 2014 r. Spełnienie się możliwości wzrostu gospodarki polskiej w tempie 3–4% rocznie do końca dekady wymaga podjęcia szeregu intensywnych działań wewnętrznych, o których piszemy w ostatniej części tego opracowania. W najbliższym okresie powinny one polegać przede wszystkim na zainwestowaniu w uspokojenie nastrojów społecznych, w niwelację poczucia niepewności i zagrożenia. Wymaga to stabilizacji warunków działania czterech najważniejszych regulatorów gospodarki: gospodarstw domowych, przedsiębiorstw, rynków i państwa. Powinno to przynieść zarówno bezpośrednie efekty pro wzrostowe, jak i ustabilizować nastroje społeczne. Jeśli tak się nie stanie, pociągną one w dół zarówno wskaźniki ekonomiczne, jak i społeczne, i całościowy indeks równowagi.

Rysunek 9

Rzeczywisty i przewidywany przebieg rozwoju społeczno-gospodarczego mierzonego wskaźnikiem ALK a kondycja psychiczna Polaków i jej składowe



Pełne zrozumienie dynamiki tego procesu wymaga uzupełnienia „twardej” prognozy ekonometrycznej o jakościową analizę opartą na wynikach najnowszych badań świadomości („wyobraźni”) ekonomicznej polskiego społeczeństwa (Koźmiński, Zagórski 2014). Wynika z nich, że trend poprawy warunków życia polskich rodzin uległ po 2008 r. zahamowaniu, ale nie odwróceniu. Okres promowania w mediach Polski jako „zielonej wyspy” zaowocował nawet niewielkim wzrostem ocen warunków życia, które mimo późniejszego niewielkiego spadku nie powróciły już do najniższego poziomu z 2008 r. Można więc mówić raczej o tendencji do kontynuacji niż pogorszenia tych ocen, szczególnie od drugiej połowy 2012 r.

W przeciwieństwie do ocen i przewidywań własnych warunków życia, przewidywania i oceny całej gospodarki są zdecydowanie i coraz bardziej pesymistyczne, powodując obniżenie całego ogólnego indeksu równowagi. Dominuje niepewność co do przyszłości, która przybierając natężenie bliskie zbiorowej histerii czy obsesji, zagraża stabilności całego systemu, co może się wyrazić w antysystemowych zachowaniach politycznych, takich jak absencja wyborcza, wsparcie dla skrajnych lub „dziwnych” ugrupowań, ruchy protestu, „oburzenia” itp. Narasta poczucie niepewności i obniża się tolerancja na nią.

Przewidywania przyszłości kształtują się nie tyle pod wpływem ocen własnej sytuacji materialnej, które pozostają niezmiennie raczej dobre, ile raczej pod

wpływem przekazów medialnych. To, co poddane jest osobistemu doświadczeniu oceniane jest znacznie lepiej niż to, o czym dowiadujemy się od dziennikarzy, polityków czy od występujących w mediach ekonomistów. Pokazana na wykresie próba konfrontacji dynamiki społecznych wskaźników równowagi i przewidywanych wartości wskaźnika ogólnego dowodzi, że w najbliższych latach samopoczucie Polaków i kondycja psychiczna społeczeństwa będą ciągnęły w dół ogólny wskaźnik równowagi, mimo utrzymującej się niezłej koniunktury ekonomicznej. Rodzi to bezpośrednie zagrożenie sterowności systemu, z możliwością wspomnianego już „tąpnięcia” systemu na niższy poziom w wyniku emocjonalnych zachowań społecznych i politycznych, generowanych przez poczucie niepewności, zagrożenia i antysystemową agresję.

6. Budowanie antykruchości systemu społeczno-ekonomicznego

W dyskursie ekonomicznym jedni uważają, że budować antykruchość systemu ekonomiczno-społecznego można jedynie drogą liberalno-rynkową, a drudzy, że tylko drogą socjalno-etatystyczną. Próby poszukiwania trzeciej drogi dotychczas nie udawały się ani teoretycznie, ani praktycznie, choć podejmowane bywają intelektualnie stymulujące próby, np. w formie koncepcji neoinstytucjonalizmu (Chmielewski 2011) lub „nowego pragmatyzmu” (Kołodko 2014).

Zwolennicy drogi liberalnej proponują „krew, pot i łzy”, czyli dotkliwie społecznie reformy, w imię przyszłych korzyści. Nawet jeżeli takie posunięcia jak radykalna sanacja finansów publicznych kosztem obniżenia poziomu świadczeń społecznych mogą zadziałać pro wzrostowo w średnim i długim okresie, to są one bardzo trudne do przeprowadzenia w społeczeństwach demokratycznych i wiążą się z dużym ryzykiem politycznym.

Druga szkoła myślenia – socjalno-etatystyczna, nabierająca ostatnio w świecie bardzo wpływowego znaczenia, zyskująca pokłony szefów np. MFW czy Banku Anglii, nie mówiąc o silnym poparciu politycznym i coraz większym poparciu publicystycznym także w Polsce, zwraca uwagę, że prognozy i działania proponowane przez liberałów doprowadzą do katastrofy. Obciążenia bowiem proponowanymi reformami liberalno-rynkowymi doprowadzą do buntu społecznego, który sparaliżuje gospodarkę. Równocześnie jednak proponują posunięcia, które z jednej strony zwiększają poziom zadłużenia państwa poza granicę bezpieczeństwa, a z drugiej – zwiększenie jego bezpośredniego udziału w gospodarce i życiu społecznym podnosząc ryzyko marnotrawstwa, nieudolności i złego zarządzania.

Trzeba jednak również dostrzec, że obie szkoły myślenia ekonomicznego, tak silne w dyskursie intelektualnym (choć w znacznej mierze publicystycznym) i politycznym, nie dokonują jakiegoś istotnego postępu – raczej jałowo „mięły” stare koncepcje. W takiej sytuacji podstaw teoretycznych do budowy antykruchości systemu ekonomiczno-społecznego należy szukać w nowocześniejszych ujęciach,

takich jak np. równowaga czterech podstawowych regulatorów gospodarki: gospodarstw domowych, przedsiębiorstw, rynków i państwa, bliższych koncepcji równowagi społeczno-ekonomicznej i wskaźnika ALK. Z tych nowych podstaw teoretycznych – naszym zdaniem – wynika obecnie dla Polski potrzeba dziesięciu kluczowych działań o charakterze politycznym, społecznym i ekonomicznym, zmierzających do ograniczenia poczucia niepewności i zagrożenia Polski.

Po pierwsze – skoro podstawowym czynnikiem ciągnącym w dół wskaźnik równowagi jest obecnie poczucie niepewności i lęk o przyszłość, dążąc do równowagi i podniesienia sterowności systemu należy poszukiwać przeciwwagi dla tych stanów świadomości w sferze realnych działań i obserwowalnych mechanizmów funkcjonowania gospodarki i społeczeństwa. Należy też unikać wszelkich, nawet ekonomicznie uzasadnionych działań, które potęgują poczucie niepewności (np. bałagan w służbie zdrowia, zamieszanie wokół emerytur i OFE).

W gospodarce i społeczeństwie są dwie wspomagające się wzajemnie „kotwice”, które stabilizują ludzkie oczekiwania: przedsiębiorczość i społeczno-ekonomiczna (a nie osobno gospodarcza i socjalna) polityka państwa. I wokół nich powinny się koncentrować działania zmierzające do przywrócenia chwiejącej się równowagi. Celowe wydaje się uchwalenie przez parlament w formie obowiązujących ustaw długookresowych celów rozwoju społeczno-ekonomicznego Polski na najbliższe 5, 10 i 15 lat w takich obszarach, jak np. energia, gospodarka wodna, mieszkalnictwo, edukacja, ochrona zdrowia, polityka prorodzinna. Tego typu cele i związane z nimi obligatoryjne budżety (podobne do tego, jaki obowiązuje w zakresie obronności) stanowią szansę na poprawę sytuacji demograficznej Polski i postrzeganie Polski jako dobrego miejsca do inwestowania dla krajowych i międzynarodowych przedsiębiorców. Gwarantują bowiem dłuższą perspektywę czasową zarówno rodzinom, jak i inwestorom. Tego typu silna determinacja polityczna nie ma charakteru ani lewicowego, ani prawicowego, ani etatystycznego, ani liberalnego, i z pewnością nie jest powrotem do „gospodarki planowej”. Tworzyć ma solidne trwałe ramy dla działania sił rynku. Ambitne cele zaakceptowane przez społeczeństwo są silnym stymulatorem wszystkich regulatorów gospodarki: gospodarstw domowych, rynków, przedsiębiorstw i państwa.

Po drugie – konieczne jest przywrócenie kluczowej roli w społeczeństwie i gospodarce gospodarstwu domowemu. Wyraża się to m.in. w koncepcjach „konfirmy”, czyli hybrydy gospodarstwa domowego i firmy (Noga 2009, s. 208–317). Pomimo bardzo młodego wieku polskiej gospodarki rynkowej nastąpiło już bardzo silne wyalienowanie się korporacji, rynków i administracji państwowej od gospodarstw domowych – głównego regulatora i celu gospodarki. Osłabia to mechanizm demokracji w Polsce i w efekcie spiralnie pogłębia ten proces alienacji, wyrażający się w antagonistycznej relacji przedsiębiorstw i instytucji w stosunku do gospodarstw domowych, zgodnie z hasłem „instytucje przeciwko ludziom”. Kreuje to coraz bardziej niebezpieczne i skomplikowane układy polityczne i świadomość polityczną, społeczną i ekonomiczną. Podważana jest sensowność wolności gospodarczej, a nawet wolności w ogóle (Balcerowicz 2012). Konieczny jest więc renesans prawny i polityczny polskiej konstytucji wolności

gospodarczej i wolności jednostki w ogóle. Na tym tle szczególnego znaczenia nabiera następujący postulat.

Po trzecie – konieczne jest uruchomienie „trzeciej fali” polskiej przedsiębiorczości, a zwłaszcza przedsiębiorczości młodych. Mogą temu służyć sieci intensywnie wspieranych przez państwo inkubatorów przedsiębiorczości lokalizowanych przy uczelniach, być może nawet w szkołach średnich i w społecznościach lokalnych. Konieczna jest nowa „konstytucja wolności gospodarczej” i najwyższej wagi deklaracja polityczna priorytetu dla przedsiębiorczości, uwalniająca przedsiębiorców z coraz bardziej dotkliwego gorsetu drobiazgowych przepisów i regulacji oraz z odziedziczonego po poprzednim systemie i ciągle obecnego w świadomości kręgów urzędniczych piętna społecznego stygmatu i braku zaufania. Rzeczywiste wdrożenie takich deklaracji (które niejednokrotnie już padały) wymaga jednak całkowitej, radykalnej zmiany nastawienia administracji do przedsiębiorczości z formalistycznie bezdusznego i podejrzliwie łupieżczego na jednoznacznie proprzedsiębiorcze. Wymaga to zarówno „kija” w postaci osobistej odpowiedzialności urzędników i funkcjonariuszy publicznych (np. prokuratorów czy inspektorów podatkowych) za szkody wyrządzone w wyniku opóźnionych i błędnych, a często bezprawnych decyzji, jak i „marchewki” w postaci osobistego materialnego zainteresowania administracji (zwłaszcza lokalnej) konkretnymi pozytywnymi efektami, czyli np. wzrostem zatrudnienia, liczbą nowo tworzonych przedsiębiorstw i rozbudową bazy podatkowej. Takie pragmatyczne podejście powinno stopniowo zastępować tępy formalizm zakorzeniony w gąszczu sprzecznych, niezrozumiałych przepisów i norm prawnych.

Nie można tolerować niekompetencji i skandalicznych opóźnień działania sądów rozpatrujących sprawy przedsiębiorców. Warto byłoby zapewne rozważyć specjalną szybką ścieżkę sądownictwa gospodarczego. Można sobie wyobrazić siłę oporu środowisk urzędniczych i prawniczych przeciwko takim rozwiązaniom. Ten opór można jednak przełamać bez narażania równowagi społecznej, a nawet przy aprobacie znacznej części społeczeństwa, której te środowiska wyrządziły wiele szkód i krzywd. Chodzi o swego rodzaju „kontrolowaną rewolucję antybiurokratyczną”.

Po czwarte – konieczna jest nowa fala aktywności gospodarczej środowisk lokalnych i regionalnych na drodze przedsiębiorczości społecznej, takiej jak sieć przedsiębiorstw społecznych „Barka” zajmująca się aktywizacją osób „wykluczonych” czy słynna hiszpańska sieć spółdzielni „Mondragon”, którą Fundacja Petera Druckera uznała za perspektywiczną organizację XXI wieku. Polska tradycja spółdzielcza zasługuje na reaktywację m.in. poprzez wykorzystanie sieci banków spółdzielczych i towarzystw ubezpieczeń wzajemnych, jako swoistych biegunów wzrostu, redukujących zarazem poczucie niepewności i wyobcowania, zagrażające dziś równowadze społeczno-ekonomicznej.

Po piąte – rola administracji państwowej musi zostać zdefiniowana na nowo. Nasze państwo jest nieudolnym, niedbałym i politycznie interesownym właścicielem i zarządcą swego majątku i nic nie wskazuje na to, żeby to się mogło zmienić, zwłaszcza szybko i radykalnie (Koźmiński 2014a). Dlatego z czysto pragmatycznego punktu widzenia konieczne jest dokończenie procesu prywatyzacji i docelowo

objęcie nią także obszaru usług społecznych, takich jak edukacja i służba zdrowia. Trzeba jednak pamiętać, że obecnie opinia publiczna jest zdecydowanie przeciwna takim działaniom, które mogą zwiększyć groźne dziś dla równowagi społeczno-ekonomicznej poczucie niepewności (Koźmiński, Zagórski 2014). Dlatego w bliższym horyzoncie czasowym większą wagę należy przywiązać do wzmocnienia roli regulacyjnej państwa, jako podmiotu kształtującego konsekwentnie w długim okresie, przejrzyste i społecznie akceptowane polityki. Chodzi o politykę przemysłową, politykę ochrony konkurencji oraz politykę w takich obszarach jak ochrona zdrowia, nauka, edukacja, bezpieczeństwo, obrona narodowa. Tak rozumiane polityki muszą być ujęte w wieloletnich zadaniowych budżetach, nie podlegających rewizji w dół, i sprawnie realizowane przy zachowaniu zasad pełnej przejrzystości, czyli poinformowania opinii społecznej. Takie polityki skutecznie neutralizują poczucie niepewności. Ludzie czują się bowiem lepiej, kiedy wiedzą, lub przynajmniej sądzą, że wiedzą, w którą stronę zmierza ich państwo. Przekształcenie roli administracji z hamulca w napęd rozwoju wymaga jej radykalnej przebudowy w kierunku odpolitycznienia i profesjonalizacji. Trzeba więc znaleźć inne sposoby wynagradzania lojalności aktywistów partyjnych niż przysłowiowe „posady”, zwłaszcza w kluczowych instytucjach administracji, i powrócić do modelu służby cywilnej.

Po szóste – odrębnego priorytetowego znaczenia musi nabierać polityka energetyczna. Brak takiej polityki grozi silnym ograniczeniem wzrostu, od czego w przeszłości częściowo uratował nas kryzys światowy i spowolnienie wzrostu gospodarczego w Polsce w końcu pierwszej dekady XXI w. W energetyce pojawia się wiele niebezpieczeństw, ale i szans rozwojowych dla Polski. Stąd też polityka energetyczna staje się polem bardzo niebezpiecznych manipulacji i brutalnie realizowanych interesów. Różne ścieżki bezpieczeństwa energetycznego Polski często są wyznaczane na podstawie lobbystycznej gry interesów, a nie realistycznego rachunku opłacalności różnych rodzajów energii i rzeczywistych potrzeb energetycznych Polski. Raz jedno lobby przeważa (etanol), raz drugie (węgiel), i w rezultacie nikt, łącznie z inwestorami, nie wie, czego się spodziewać. Konieczna jest konsekwentnie i przejrzystie realizowana strategia o kilkudziesięcioletnim horyzoncie czasowym.

Po siódme – fatalny stan polskiego prawa i systemu sądowiczego wskazuje także na potężne źródło rezerw rozwojowych, jakie tkwią w tej części naszego państwa. Na takie kluczowe znaczenie prawa bardzo dobitnie od dawna wskazuje ekonomia instytucjonalna. W jej świetle polski system prawa i wymiaru sprawiedliwości jawi się jako szczególnie dysfunkcyjny. Badania jakościowe i ilościowe D. Kaufmana, A. Kraaya, M. Mastruzzi (2010) czy D. Rodriki, A. Subramaniana i F. Trebbi (2004) pokazują wymierne punktowe (nawet ponad 1%) efekty wzrostu PKB na jednego mieszkańca w wyniku polepszenia systemu prawa i systemu sądowiczego. Poza wymiernymi efektami wzrostu PKB w wyniku głębokiej reformy polskiego systemu prawnego i sądowiczego można się spodziewać bardzo pozytywnych jakościowych efektów społecznych i politycznych tego procesu, który długofalowo wpłynie również na te efekty ilościowe.

Po ósme – konieczne jest wykorzystanie potencjału regulacyjnego rynków w gospodarce. Pomimo deklaracji, iż od 25 lat budujemy gospodarkę rynkową, nie wykorzystujemy wszystkich dobrodziejstw, jakie stwarzają rynki i nie eliminujemy wielu jego negatywnych konsekwencji. Często fasadowa polityka konkurencji i ochrony konkurencji, prowadzona przez co najmniej kilkanaście jednostek państwowych, nie zawsze pozwalała zapewnić dostateczne korzyści dla gospodarstw domowych i nie zawsze pozwalała na kształtowanie się dobrej jakości rynków w gospodarce. Wśród tak rozumianych funkcji regulacyjnych szczególnie istotna jest polityka ochrony konkurencji w takich „wrażliwych” sektorach jak: bankowość, ubezpieczenia, ochrona zdrowia czy edukacja oraz aktywne kształtowanie profilu działania bezpośrednich inwestorów zagranicznych w zgodzie z polityką przemysłową. Wymaga to nadania aparatowi państwowemu cech menedżerskiej sprawności, które zgodnie z koncepcjami zarządzania publicznego powinny zastąpić legalistyczny formalizm. Taka administracja budzi zaufanie i redukuje niepewność.

Po dziewiąte – wielką kruchością naszego systemu jest permanentnie nieprzyjazna pacjentom służba zdrowia, której funkcjonowanie odbija się szczególnie negatywnie na nastrojach społecznych. Istotny postęp w tej dziedzinie mógłby ogromnie poprawić psycho-społeczną kondycję polskich gospodarstw domowych z szeregiem pozytywnych konsekwencji (demograficznych, efektywnościowych, przedsiębiorczych itp.). Badania opinii publicznej wykazują jednak jednoznacznie, że Polacy nie chcą i boją się prywatyzacji służby zdrowia, która mogłaby znacznie poprawić dostępność i jakość świadczeń przy założeniu skutecznej i konsekwentnej polityki państwa. Wszelkie działania zmierzające w tym kierunku niebezpiecznie zwiększą jednak poczucie niepewności, bez skrupułów eksploatowane politycznie. Rezygnacja z szerzej zakrojonej prywatyzacji nie przekreśla jednak możliwości znacznych usprawnień oraz ograniczenia bijącego w oczy marnotrawstwa i pasożytnictwa w uspołecznionej służbie zdrowia. Występowanie wielu już nieźle funkcjonujących i sprawnie zarządzanych jednostek państwowej służby zdrowia podważa doktrynalnie wykorzystywaną tezę o niemożliwości takich usprawnień.

Po dziesiąte – antykruchość rozumiana i budowana tak, jak przedstawiliśmy to powyżej, musi oczywiście kosztować w kategoriach czysto ekonomicznych, ponieważ wymaga nakładów na przygotowanie i wdrożenie proponowanych reform oraz zapewne na kompensację ewentualnych szoków spowodowanych tymi reformami. Czas na ich przeprowadzenie jest jednak nie tylko „najwyższy” ze względu na zaniedbania z przeszłości, ale także i najważniejszy ze względu na co najmniej umiarkowanie pozytywne prognozy sytuacji ekonomicznej w najbliższych latach. Można dodać, że jest to także czas „ostatni” na zasadnicze reformy. Po pierwsze dlatego, że po 25 latach „złotego wieku” polskiej gospodarki – bezprecedensowego w skali historycznej wzrostu gospodarczego i wzrostu konsumpcji – „proste rezerwy” zostały wyczerpane. Konieczne jest oparcie dalszego wzrostu na innowacjach i przedsiębiorczości, w znacznej mierze dzisiaj zablokowanych. Po drugie, konieczne jest ustabilizowanie, a następnie poprawa nastrojów i oczekiwań społecznych. Alternatywą jest bierne konsumowanie efektów wzrostu i marnotrawie-

nie ich przez dysfunkcyjną administrację, bez większych szans na poprawę ani rzeczywistych warunków społecznych, ani społecznych nastrojów. Oznacza to dopuszczenie do dalszego pogarszania się równowagi społecznej, która coraz silniej będzie ciągnęła w dół ogólny poziom równowagi, łącznie z ekonomiczną. Jest wysoce prawdopodobne, że doprowadzi to do radykalnego kryzysowego przesilenia, zapewne w formie mniej lub bardziej gwałtownej zmiany politycznej inspirowanej populistycznymi hasłami. Musi to w średnim okresie oznaczać „tąpnięcie” całego systemu na niższy poziom równowagi ogólnej i równowag cząstkowych, czyli innymi słowy – zaprzepaszczenie znacznej części olbrzymiego cywilizacyjnego dorobku ostatnich 25 lat.

Tekst wpłynął: 17 listopada 2014 r.

Bibliografia

- Chmielewski P., *Homo agens. Instytucjonalizm w naukach społecznych*, Poltext, Warszawa 2011.
- Constanza R., Hart M., Posher S., Tolberth J., *Beyond GDP: The Need for New Measures of Progress*, „The Pardee Papers” 2009, nr 4.
- Crozier M., Friedberg E., *Człowiek i system. Ograniczenia działania zespołowego*, PWN, Warszawa 1982.
- Espinoza P.Z., Arechvala N.S., *An Assessment of Social Welfare in Spain: Territorial Analysis Using a Synthetic Welfare Indicator*, „Social Indicators Research” 2013, nr 111.
- Fleurbary M., Blanchet D., *Beyond GDP – Measuring Welfare and Assessing Sustainability*, Oxford University Press, Oxford 2013.
- Giesselmann M., Hilmer R., Siegel N.A., Wagner G.G., *Measuring Well-Being: W3 Indicators to Complement GDP*, DIW Economic Bulletin, 2013, nr 5.
- Kaufmann D., Kraay A., Mastruzzi M., *The Worldwide Governance Indicators: Methodology and Analytical Issues*, Working Paper No. 5430, World Bank Policy Research, 2010, Pobrano z: <http://ssrn.com/abstract=1682130>.
- Keynes J.M., *The Collected Writings of John Maynard Keynes*, t. IV, Cambridge University Press, Cambridge UK, 2013.
- Kołodko G.W., *The New Pragmatism or Economics and Policy for the Future*, „Acta Oeconomica” 2014, nr 64(2).
- Koźmiński A.K., Zawisłak A.M., *Pewność i gra*, PWE, Warszawa 1979.
- Koźmiński A.K., Obłój K., *Zarys teorii równowagi organizacyjnej*, PWE, Warszawa 1989.
- Koźmiński A.K., *Mikro- i makrorównowaga funkcjonalna w warunkach transformacji*, „Ekonomista” 1995, nr 1–2.
- Koźmiński A.K., *Czas pokera*, Wolters Kluwer, Warszawa 2014.
- Koźmiński A.K., *Przedsiębiorcze państwo*, „Ekonomista” 2014a, nr 2.
- Koźmiński A.K., Noga A., Piotrowska K., Zagórski K., *Wskaźnik ALK równowagi społeczno-ekonomicznej dla Polski*, w: *Zarządzanie i polityka społeczno-gospodarcza dla rozwoju*, red. Grzegorz W. Kołodko, Poltext, Warszawa 2014.
- Kuznets, S., *National Income 1929–32 – A Report to the U.S. Senate, 73rd Congress, 2nd Session*, US Government Printing Office, Washington 1934.

- Llewellyn Consulting, *UK Infrastructure. The Challenges for Investors and Policymakers*, White Paper, 2013; https://www.pensioncorporation.com/sites/default/files/news/pic_uk_infrastructure_investment_white_paper_july_2013.pdf
- Lyapunov A.M., *The General Problem of the Stability of Motion*, Taylor & Francis, London 1992.
- Madonia G., Cracolizzi M.F., Cuffaro M., *Exploring Wider Wellbeing in the EU 15 Countries. An Empirical Application of the Stiglitz Report*, „Social Indicators Research” 2013, nr 111.
- March J.G., *Footnotes to Organizational Change*, „Administrative Science Quarterly” 1981, nr 26(4).
- McGranahan D.V., Richard-Proust C., Sovani N.V., Subramanian M., *Content and Measurement of Socio-Economic Development – An Empirical Inquiry*, United Nations Research Institute for Social Development, Report nr 70.10, 1970.
- Moser C.A., *Social Indicators – Systems, Methods and Problems*, „The Review of Income and Wealth” 1973, nr 19(2).
- NEF (The New Economics Foundation), *The Happy Planet Index*, 2009; www.dow-sx417g17s.cloudfront.net/nefoundation/defaultpage/-/files/happy-planet-index-report.pdf.
- Noga A., *Teorie przedsiębiorstw*, PWE, Warszawa 2009.
- Odkrywając wolność*, red. L. Balcerowicz, Zysk i S-ka, Poznań 2012.
- OECD, *Better Life Index*; www.sttats.oecd.org/Index.aspx?DataSetCode=BLI#.
- Pennock M., Ura K., *Gross national happiness as a framework for health impact assessment*, „Environmental Impact Assessment Review” 2011, nr 31, doi:10.1016/j.eiar.2010.04.003
- Reig-Martinez E., *Social and Economic Wellbeing in Europe and the Mediterranean Basin: Building and Enlarged Human Development Indicator*, „Social Indicators Research” 2013, nr 111.
- Reiss A., *Assessing the Current Crime Wave*, w: *Crime in Urban Society*, red. B.N. McLennan, Donellen, New York 1970.
- Rodrik D., Subramanian A., Trebbi F., *Institutions Rule: The Primacy of Institutions over Geography and Integration in Economic Development*, „Journal of Economic Growth” 2004, nr 9.
- Social Indicators*, red. R.A. Baurer, MIT Press, Cambridge 1966.
- Staszyńska K., *Cele życiowe, poczucie deprywacji i strategie życiowe Polaków 1980–2011*, w: *Polacy 1980–2011*, red. W. Adamski, Wyd. IFiS PAN, Warszawa 2014.
- Stiglitz J.E., Sen A., Fitoussi J.P., *Błąd pomiaru. Dlaczego PKB nie wystarczy*, PTE, Warszawa 2013.
- Stone R., *Input-Output and Demographic Accounting: a Tool for Educational Planning*, „Minerva” 1966, nr 4(3).
- Stone R., Brown A., *A Computable Model of Economic Growth*, Chapman and Hall, London 1962.
- Taleb N., *The Black Swan: The Impact of the Highly Improbable*, Random House, New York 2007.
- Taleb N., *Antykruchłość – O rzeczach, którym służą wstrząsy*, Kurhaus, Warszawa 2013.
- Thom R., *Parabole i katastrofy. Rozmowy o matematyce, nauce i filozofii z Giulio Giorello i Simoną Marini*, PIW, Warszawa 1991.
- Towards Sustainable Development – Alternative to GDP for Measuring Progress*, red. P. Schopelmann, Y. Goosens, A. Makipaa, Wuppertal Institute, Wuppertal 2010.

- United Nations Development Programme, *Human Development Index*, 2013; www.hdr.undp.org/en/statistics/hdi
- United Nations, *Towards a System of Social and Demographic Statistics, Studies in Methods*, Series F, nr 18, 1975.
- Ura K., Alkire S., Zangmo T., Wangdi K., *An Extensive Analysis of GNH Index* Centre for Bhutan Studies, 2012; <http://www.grossnationalhappiness.com/wpcontent/uploads/2012/10/An%20Extensive%20Analysis%20of%20GNH%20Index.pdf>
- Weintraub E.R., *General Equilibrium Theory*, Macmillan, London, Basingstoke 1974.
- Zagórski K., *Zintegrowany system statystyki społeczno-demograficznej*, „Wiadomości Statystyczne” 1972, nr 8.
- Zagórski K., *Dwa typy kompleksowej analizy procesów społecznych*, w: *Ludność*, GUS, Warszawa 1972a.
- Zagórski K., *Socio-demographic Statistics in the System of Central Socio-economic Planning*, „Bulletin of the International Statistical Institute” 1975, nr 46.
- Zagórski K., *Warunki życia, postrzeganie konfliktów i postawy wobec demokracji rynkowej*, w: *Fenomen Solidarności. Polacy 1980–2011*, red. W. Adamski, Wyd. IFiS PAN, Warszawa 2014.
- Zagórski K., Koźmiński A.K., Morawski W., Piotrowska K., Rae K., Strumińska-Kutra M., *Podstawy ekonomiczne w czasach niepewności – ekonomiczna wyobraźnia Polaków*, Wydawnictwo Naukowe SCHOLAR, Warszawa 2015.

W POSZUKIWANIU ANTYKRUCHOŚCI SYSTEMU SPOŁECZNO-EKONOMICZNEGO – ZASTOSOWANIA SYNTETYCZNEGO WSKAŹNIKA ALK

Streszczenie

Artykuł przedstawia zastosowanie nowego syntetycznego wskaźnika równowagi społeczno-ekonomicznej dla Polski, zwanego wskaźnikiem ALK, do analizy i prognozy rozwoju społeczno-ekonomicznego w Polsce w okresie 1999–2015. Wskaźnik ten został skonstruowany, ponieważ tradycyjne miary rozwoju gospodarczego, takie jak dynamika PKB, tempo inflacji, saldo budżetu państwa itp., są niewystarczające dla oceny i prognozowania sytuacji społeczno-ekonomicznej, określającej warunki życia społeczeństwa. Wskaźnik ALK obejmuje cztery grupy wskaźników: dwie opisujące sytuację ekonomiczną (wewnętrzną i zewnętrzną) oraz dwie zawierające oceny sytuacji społecznej (sytuacja aktualna i przewidywana). Wskaźniki te są łączone w cztery zbiorcze indeksy, które są następnie agregowane w ogólny wskaźnik ALK. Miarodajność wskazań tego wskaźnika potwierdza jego wysoka korelacja z nastrojami społecznymi odzwierciedlającymi ocenę sytuacji społeczno-ekonomicznej kraju i kondycję psychiczną społeczeństwa. Autorzy przedstawiają analizę dotychczasowego rozwoju społeczno-ekonomicznego Polski opartą na wskazaniach tego wskaźnika. Wyniki analizy, interpretowane w kategoriach zrównoważonego rozwoju społeczno-ekonomicznego, są podstawą wniosków formułowanych pod adresem polityki społeczno-ekonomicznej państwa.

Słowa kluczowe: wskaźnik zrównoważonego rozwoju ALK, rozwój społeczno-ekonomiczny, Polska

IN SEARCH OF NON-FRAGILITY OF THE SOCIO-ECONOMIC SYSTEM: USING THE SYNTHETIC BDI INDEX

Summary

The paper presents a new composite Balanced Development Index (BDI), named “ALK Indicator”, applied to analyse and predict socio-economic changes in Poland during 1999-2015 period. This is done because traditional measures of economic development, such as GDP growth, inflation, state budget etc., are insufficient for assessing and forecasting socio-economic situation of the country, shaping the living conditions of the society. There are four groups of indicators entering the composite BDI: two economic (internal and external) and two social (current situations and predictions). They are used to construct four intermediate indexes, which are aggregated into the general BDI. The validity of that index is proven by its high correlation with confidence indicators reflecting the assessments of socio-economic situation in the country and psychological condition of the society. The authors present the analysis of the past socio-economic development in Poland, based on this composite index. The results are interpreted in terms of balanced socio-economic development as guidelines for socio-economic policy.

Key words: balanced development index (BDI), socio-economic development, Poland

В ПОИСКЕ АНТИХРУПКОСТИ СОЦИАЛЬНО-ЭКОНОМИЧЕСКОЙ СИСТЕМЫ – ПРИМЕНЕНИЯ СИНТЕТИЧЕСКОГО ПОКАЗАТЕЛЯ ALK

Резюме

В статье представлен пример применения нового синтетического показателя социально-экономического равновесия Польши (показатель ALK) для анализа и прогноза социально-экономического развития страны на период с 1999 по 2015 гг. Необходимость создания такого показателя вытекала из того факта, что традиционные мерила экономического развития, такие как динамика ВВП, темпы инфляции, сальдо государственного бюджета и тому подобные, оказались недостаточными для оценки и прогнозирования социально-экономического положения, определяющего условия жизни общества. Показатель ALK охватывает четыре группы показателей: две из них описывают экономическую ситуацию – внутреннюю и внешнюю, а оставшиеся две содержат оценки социального положения (текущее положение и прогнозы). Эти показатели объединяются в четыре совокупных индекса, которые затем подвергаются агрегации в общий показатель ALK. Достоверность этого показателя подтверждается его высокой корреляцией с настроениями в обществе, отражающими оценку социально-экономического положения страны и психологическое состояние общества. Авторы представляют анализ уже пройденного этапа социально-экономического развития Польши, опирающийся на показания этого показателя. Результаты анализа, интерпретируемые в категориях устойчивого социально-экономического развития, являются основой для предложений, выдвигаемых по отношению к социально-экономической политике государства.

Ключевые слова: показатель устойчивого развития ALK, социально-экономическое развитие, Польша