

ADAM P. BALCERZAK

13. ANALIZA ZAKRESU OPERACYJNEJ KONTROLI PAŃSTWA NAD GOSPODARKĄ W KRAJACH UNII EUROPEJSKIEJ

WSTĘP

Dyskusja nad rolą państwa towarzyszy ekonomistom już od momentu ukształtowania się ich dziedziny, co umownie łączy się z publikacją *Bogactwa narodów* Adama Smitha. Praca ta stanowiła w znacznej mierze wykład poświęcony roli państwa w życiu gospodarczym. Stworzona przez Smitha tradycja badawcza, której rdzeniem była idea państwa minimalnego, stała się niekwestionowaną ortodoksją w środowisku naukowym i praktyce gospodarczej niemalże do połowy lat trzydziestych zeszłego wieku.

W okresie powojennym w efekcie doświadczeń związanych z wielkim kryzysem lat 30. i na gruncie teoretycznym przygotowanym przez J. M. Keynesa osiłą debaty dotyczącej roli państwa stała się kwestia potencjalnej nieefektywności mechanizmu rynkowego. Główny argument zwolenników szerszego interwencjonizmu gospodarczego sprowadzał się do postulatu, że tam gdzie istnieje możliwość zawodności mechanizmu rynkowego powinno dochodzić do interwencji państwa. W tym czasie ekonomiści reprezentujący poglądy antyetatystyczne byli w teoretycznej defensywie. W życiu gospodarczym towarzyszył temu bezprecedensowy rozwój bezpośredniej aktywności gospodarczej państwa, która stała się narzędziem realizacji idei państwa dobrobytu.

Dopiero doświadczenia lat 70., które stworzyły sprzyjające warunki do szybkiej ekspansji monetaryzmu, nowej ekonomii klasycznej i późniejszych nurtów z nią związanych, doprowadziły do wyrównania akcentów tej debaty. W tym samym czasie coraz więcej ekonomistów zaczęło dostrzegać poważne niedociągnięcia aksjomatyczne toczącej się dyskusji wokół zawodności mechanizmu rynkowego i potrzeby interwencjonizmu państwowego. A. Wojtyła zauważył, że w przypadku sfery prywatnej przyjmuje się klasyczne założenia dotyczące jednostek

kierujących się zasadą maksymalizacji indywidualnego zysku, motywowanych egoistycznymi pobudkami i partykularnymi interesami. Z drugiej strony, w przypadku sfery publicznej przez lata *a priori* traktowało się państwo jako supermaszynę maksymalizującą funkcję dobrobytu społecznego, kierowaną przez prywatnych urzędników, których jedynym motywem działania jest dobro publiczne¹. Sytuację tę odmieniły prace ekonomistów rozwijających takie nurty, jak teoria politycznego cyklu koniunkturalnego, teoria wyboru publicznego - a w szczególności hipoteza pogoni za rentą (*rent seeking*), czy teoria działań grupowych.

W ostatnich latach coraz więcej ekonomistów dostrzega, że nie można analizować roli państwa z perspektywy statycznej. V. Tanzi wskazuje, że interwencja państwa często prowadzi do zmiany systemu bodźców w określonej dziedzinie. W rezultacie państwo zamiast ograniczać nieefektywność rynku w danym sektorze ma tendencje do jego stopniowego zastępowania. W ostateczności prowadzi to do zahamowania rozwoju danej dziedziny². Poza tym należy także uwzględnić coraz szybsze tempo ewolucji systemów gospodarczych, które wynika z większej ilości pozytywnych szoków technologicznych. Wraz z rosnącym tempem transformacji życia społeczno-gospodarczego musi następować szybsze dostosowanie się instytucji, czemu towarzyszą zmieniające się potrzeby, jakim musi sprostać państwo oraz możliwości ich zaspokojenia.

Obecnie wielu ekonomistów wskazuje na dwie tendencje. Z jednej strony, podkreśla się rosnące znaczenie państwa w budowaniu efektywnego systemu instytucjonalnego, który powinien zapewniać możliwie niskie koszty transakcyjne, ochronę praw własności, gwarantować sprawność rynków finansowych i stymulować innowacyjność gospodarki³. Wszystkie te elementy uznawane są za fundament długookresowego zrównoważonego wzrostu gospodarczego. Z drugiej strony, akcentuje się malejącą rolę państwa w zakresie sprawowania operacyjnej kontroli nad gospodarką⁴. Argumentuje się, że jest to rezultat: po pierwsze, postępującej malejącej efektywności instrumentów państwa służących oddziaływaniu na gospodarkę i rosnący koszt ich stosowania⁵. Po drugie, wyni-

¹ A. Wojtyna, *Nowoczesne państwo kapitalistyczne a gospodarka. Teoria i praktyka*, Państwowe Wydawnictwo Naukowe, Warszawa 1990, s. 63.

² V. Tanzi, *Gospodarcza rola państwa w XXI wieku*, Materiały i Studia, Zeszyt nr 204, Narodowy Bank Polski, Warszawa 2006, s. 5.

³ Zob. V. Tanzi, *The Role of the State and the Quality of the Public Sector*, IMF Working Paper 2000, WP/00/36.

⁴ W. Bieńkowski, *Globalization, Integration and Government's Competitiveness Policy*, Optimum - Economic Studies 2004, No. 3 (23), s. 11-25.

⁵ A. Lipowski, *Ekonomiczna zawodność państwa - krytyka ujęcia antyetatystycznego*, Ekonomista 2002, nr 2, 165-193; W. Tanzi, *Globalization, Technological Developments, and the Work of Fiscal Terminals*, IMF Working Paper 2000, WP/00/181.

ka to z rosnącej złożoności i efektywności mechanizmu rynkowego, który jest w stanie coraz lepiej zaspokajać coraz bardziej wyrafinowane potrzeby społeczne. Głównymi siłami napędowymi tych procesów są: proces globalizacji, rosnące znaczenie nowej gospodarki, czy też gospodarki opartej na wiedzy.

Rosnąca rola państwa w zakresie budowania ładu instytucjonalnego nie budzi dzisiaj wielkich kontrowersji, o czym świadczy synergia teoretycznego dorobku nowej ekonomii instytucjonalnej z ekonomią głównego nurtu⁶. Natomiast druga część powyższej tezy, która mówi o malejących możliwościach sprawowania przez państwo operacyjnej kontroli nad gospodarką, jest przedmiotem znacznie większych kontrowersji.

Jednym z ważniejszych punktów tej debaty powinny być badania empiryczne o charakterze międzynarodowym, które pozwalają na oszacowanie i porównanie zakresu kontroli operacyjnej państwa nad gospodarką w poszczególnych krajach. Niestety, w literaturze przedmiotu dostrzegalna jest niewystarczająca liczba takich analiz. Jednym z najbardziej wartościowych opracowań o tym charakterze jest coroczna publikacja tzw. indeksu wolności gospodarczej, który jest przygotowywany przez ekonomistów pracujących pod auspicjami Instytutu Fraser'a. Ta praca stanowi szerokie badanie uwzględniające następujące czynniki wpływające na poziom wolności gospodarczej: rozmiary rządu, jakość systemu instytucjonalnego, stopień rozwoju oraz ograniczenia na rynkach finansowych i otwartość gospodarki⁷. Tymczasem znalezienie opracowań prezentujących badania empiryczne poświęcone mierzeniu zakresu operacyjnej kontroli państwa w gospodarce jest relatywnie trudne. Tym samym celem artykułu jest próba przeprowadzenia analizy zakresu operacyjnej kontroli państwa nad gospodarką w poszczególnych krajach Unii Europejskiej oraz ukazania ewentualnego związku pomiędzy operacyjną aktywnością państwa w sferze gospodarczej a dynamiką wzrostu gospodarczego.

DEFINICJA OPERACYJNEJ KONTROLI PAŃSTWA NAD GOSPODARKĄ

Przedmiotem niniejszego badania jest operacyjna kontrola państwa nad gospodarką, która jest definiowana jako możliwość krótkookresowego, czę-

⁶ Zob. Z. Hockuba, *Nowa ekonomia instytucjonalna – czy zdominuje nasze myślenie w rozpoczynającym się stuleciu*, [w:] A. Wojtyła (red.), *Czy ekonomia nadąży z wyjaśnieniem rzeczywistości*, t. I, PTE, Dom Wydawniczy Bellona, Warszawa 2001, s. 39–57.

⁷ J. Gwartney, R. S. Lawson, W. Easterly, *Economic Freedom of the World 2006 Annual Report*, The Fraser Institute, Vancouver 2006, s. 5–29.

sto dyskrecjonalnego oddziaływania na gospodarkę z zamierzeniem maksymalizacji funkcji celów danego rządu. Celem takim może być polityka stabilizacyjna nastawiona na ograniczenie wahań koniunkturalnych, przeciwdziałanie rozwarstwieniu dochodów, czy też ograniczanie negatywnych konsekwencji szoków popytowych i podażowych.

W tradycji keynesowskiej instrumenty fiskalne były głównym narzędziem sterowania zagregowanym popytem w celu oddziaływania na krótkookresową sytuację makroekonomiczną. Uznaje się, że sam J. M. Keynes raczej sceptycznie podchodził do możliwości efektywnego wykorzystania polityki monetarnej w celu prowadzenia aktywnej polityki antycyklicznej⁸.

W okresie powojennym zaczęto jednak aktywnie wykorzystywać politykę monetarną w celu makroekonomicznego sterowania gospodarką. Tym samym przyjmuje się, że w tym czasie państwo mogło utrzymywać krótkookresowy wpływ na gospodarkę za pomocą narzędzi fiskalnych i monetarnych. Jednak od początku lat 80. w wyniku rewolucji racjonalnych oczekiwań, poprzedzonej znacznymi sukcesami i popularnością monetaryzmu, jak również w konsekwencji doświadczeń stagflacji z lat 70., następował coraz większy wzrost samodzielności banków centralnych. Oznaczało to spadek możliwości prowadzenia krótkookresowej kontroli rządu nad polityką monetarną.

Obecnie w przypadku krajów będących członkami strefy euro wpływ większości państw nawet na długookresową politykę EBC, rozumiany jako możliwość kontrolowania wyboru władz tej instytucji, został znacznie ograniczony. Także w krajach europejskich, które jeszcze nie przyjęły wspólnej waluty, banki centralne cechują się stosunkowo dużą niezależnością. W efekcie w badaniu przyjęto, że państwo może utrzymywać operacyjną kontrolę nad gospodarką głównie przy pomocy zestawu narzędzi o charakterze fiskalnym.

METODOLOGIA BADANIA

Państwo dysponuje wachlarzem instrumentów fiskalnych, za pomocą których może oddziaływać na procesy gospodarcze w krótkim okresie. Tym samym należy traktować zakres operacyjnej kontroli państwa nad gospodarką jako zjawisko złożone. Oznacza to, że w celu dokonania jego oceny w po-

⁸ Argumentem teoretycznym sugerującym raczej niską skuteczność polityki monetarnej była możliwość występowania pułapki płynności. J. M. Keynes, *Ogólna teoria zatrudnienia, procentu i pieniądza*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2003, s. 286.

szczególnych państwach można wykorzystać narzędzia analizy wielowymiarowej. W niniejszym przypadku została zastosowana metoda syntetycznego miernika rozwoju, gdyż dzięki tej metodzie było możliwe dokonanie pomiaru zakresu operacyjnej kontroli państwa w poszczególnych krajach, stworzenie ich rankingu oraz dokonanie podziału na przyjęte grupy typologiczne.

Badanie zostało przeprowadzone na podstawie danych zebranych przez Eurostat w roku 2004 dla krajów Unii Europejskiej⁹.

Pierwszym, zarazem kluczowym etapem badania był dobór zmiennych diagnostycznych. Ustalony zbiór potencjalnych zmiennych diagnostycznych został poddany selekcji ze względu na kryteria oceny merytoryczno-formalnych własności zmiennych oraz kryteria wartości informacyjnej mierników¹⁰.

Wśród zmiennych diagnostycznych opisujących działania państwa, które w świetle teorii ekonomii mogą krótkookresowo oddziaływać na gospodarkę oraz które spełniają kryteria oceny merytoryczno-formalnej, wyselekcjonowano następujące wskaźniki:

- X1 – Poziom długu sektora publicznego w relacji do PKB¹¹;
- X2 – Saldo budżetu państwa w relacji do PKB¹²;
- X3 – Pomoc sektorowa oraz pomoc państwa ad hoc jako procent PKB¹³;
- X4 – Ogólna produkcja sektora publicznego jako procent PKB¹⁴;

⁹ W badaniu nie uwzględniono Słowenii ze względu na brak lub niską wiarygodność części danych. Obliczenia wykonano na podstawie: *Europe in figures, Eurostat Yearbook 2005*, Office for Official Publications of the European Communities, Luksemburg 2005.

¹⁰ Szczegółowy opis postulatów o charakterze merytoryczno formalnym można znaleźć w następujących pracach: T. Grabiński, *Metody taksonometrii*, Akademia Ekonomiczna w Krakowie, Kraków 1992, s. 43–44.

¹¹ Sektor publiczny zgodnie z definicją UE obejmuje władze centralne, władze lokalne oraz fundusze emerytalne. PKB wykorzystany w mianowniku szacowany jest jako produkt krajowy brutto według aktualnych cen rynkowych. Dług jest ujęty zgodnie z jego wartością nominalną, natomiast dług denominowany w walutach obcych jest przeliczony na walutę krajową według rynkowego kursu wymiany na koniec roku. Dane pierwotne wyrażane w walutach narodowych są przeszacowane na euro przy wykorzystaniu kursu walutowego dla euro przekazanego przez Europejski Bank Centralny. *Europe in figures...*

¹² Liczone jako różnica pomiędzy przychodami a wydatkami sektora publicznego, określonego przez definicję UE. PKB wykorzystane w mianowniku był szacowany zgodnie z jego aktualną wartością według cen rynkowych. Ibidem.

¹³ W liczniku powyższego wskaźnika znajduje się suma pomocy przyznanej określonym sektorom oraz pomoc przekazywana ad hoc wybranym przedsiębiorstwom. Zgodnie z teorią ekonomii ten typ interwencjonizmu państwowego prowadzi do największych zakłóceń funkcjonowania mechanizmu rynkowego i konkurencji. W mianowniku znajdują się PKB. Ibidem.

¹⁴ Ogólna produkcja sektora publicznego (ESA95 kod P.1) składa się z produktów wytworzonych przez jednostki sektora publicznego. Kategoria ESA95 P.1 obejmuje trzy rodzaje produktu: produkt rynkowy, produkt wytworzony na potrzeby własne oraz pozostałe produkty nierynkowe. Ibidem.

- X5 – Podatki nałożone na produkcję oraz import jako procent PKB¹⁵;
- X6 – Udział wydatków sektora publicznego w PKB¹⁶;
- X7 – Udział dochodów sektora publicznego w PKB¹⁷;
- X8 – Ogólna akumulacja kapitału brutto w sektorze publicznym jako procent PKB¹⁸;
- X9 – Subsydia wypłacane przez rząd jako procent PKB¹⁹;
- X10 – Udział ogólnych finalnych wydatków konsumpcyjnych rządu w PKB²⁰;
- X11 – Wydatki socjalne (inne niż transfery socjalne) wypłacane przez rząd jako procent PKB²¹;

Powyższe wskaźniki poddano ocenie ze względu na kryteria wartości informacyjnej zmiennych. W przypadku tego kryterium zmienne powinny charakteryzować się wysoką zmiennością przestrzenną, wysoką ważnością informacyjną oraz niewysokim stopniem skorelowania.

Postulat wysokiej zmienności przestrzennej oznacza, że zmienne diagnostyczne nie powinny wykazywać podobieństwa do siebie w sensie infor-

¹⁵ Podatki nakładane na produkcję (ESA95 kod D.2) składają się z obowiązkowych bezwrotnych opłat nakładanych przez rząd lub instytucje UE na produkcję i import dóbr i usług, opodatkowanie pracy, opodatkowanie ziemi, budynków lub innych zasobów wykorzystywanych w procesie produkcji. Ibidem.

¹⁶ Ogólne wydatki sektora publicznego są definiowane jako: pośrednia konsumpcja, ogólna akumulacja kapitału, płatności kompensacyjne na rzecz pracowników, subsydia, wydatki socjalne, transfery socjalne, inne transfery socjalne, pozostałe transfery, kapitałowe transfery i transakcje dotyczące zasobów nieprodukcyjnych. Ibidem.

¹⁷ Dochody sektora publicznego obejmują następujące kategorie: predykcję rynkową, produkcję na potrzeby własne, płatności za inną nierynkową produkcję, opodatkowanie produkcji i importu, otrzymany dochód z własności, podatki dochodowe, kapitałowe, inne bieżące płatności. Ibidem.

¹⁸ Ogólna akumulacja kapitału brutto (ESA95 kod P.51) składa się z przejęć producentów krajowych, minus sprzedaż kapitału stałego w danym czasie, plus dodatki do wartości kapitału nieprodukcyjnego osiągnięte w wyniku działań producentów państwowych. Ibidem.

¹⁹ Subsydia (ESA95 kod \$D.3) stanowią bieżące, bezzwrotne wypłaty rządu lub instytucji EU na rzecz lokalnych producentów, w celu wpływania na poziom ich produkcji, poziom cen, poziomu wynagrodzenia czynników produkcji. Ibidem.

²⁰ Ogólne finalne wydatki konsumpcyjne (ESA95 kod P.3) składają się z wydatków ponoszonych przez krajowe instytucje rządowe na produkty lub usługi w celu zaspokojenia ich indywidualnych potrzeb lub potrzeb zbiorowych danej społeczności. Finalny wydatek konsumpcyjny może zostać wykonany na terytorium wewnętrznym lub za granicą. Ibidem.

²¹ Wydatki socjalne (inne niż transfery socjalne) wypłacane przez rząd stanowią płatności na rzecz gospodarstw domowych w gotówce lub innej formie, których celem jest złagodzenie obciążeń finansowych wynikających z ryzyka lub innych potrzeb (wiązących się z: chorobą, inwalidztwem, innymi wydatkami, starszym wiekiem, wypadkami losowymi, stanem rodzinnym, promowaniem zatrudnienia, bezrobociem, wydatkami na mieszkanie, edukację itd.), wykonywane przez programy zbiorowe lub poza nimi przez jednostki rządowe. Ibidem.

macji o obiektach. Do oceny zmienności przestrzennej powszechnie wykorzystuje się współczynnik zmienności, przy czym eliminuje się cechy, dla których współczynnik ten osiąga wartość mniejszą od arbitralnie przyjętej liczby $V = ?$ ²². Do dalszej analizy zakwalifikowano te zmienne, dla których wartość współczynnika zmienności przekraczała 10%.

Zmienne diagnostyczne uznawane są za ważne, jeśli trudno osiągają wysokie wartości. Do oceny ważności cech najczęściej wykorzystuje się współczynnik asymetrii, który dla cech ważnych przyjmuje wartości dodatnie. Jeżeli rozkład cechy jest lewostronnie asymetryczny, to słabo różnicuje ona badane obiekty, ponieważ większość z nich osiąga wysoki stopień nasycenia²³.

Silna korelacja pomiędzy zmiennymi diagnostycznymi powoduje powtarzanie się informacji, dlatego w przypadku stwierdzenia zbyt wysokiego stopnia skorelowania cech dokonuje się wyboru zmiennych-reprezentantek, przyjmując za progowy poziom współczynnika korelacji $r = r^*$. Wartość współczynnika r^* ustalana jest arbitralnie lub w oparciu o przyjęte kryteria formalne. W niniejszym badaniu przyjęto, że $r^* = 0,8$ ²⁴.

Powyższe kryteria wartości informacyjnej zmiennych diagnostycznych zostały wypełnione przez następujące mierniki, które były ostatecznie wykorzystane w badaniu: X1, X2, X3, X4, X5, X7, X9, X10.

Następnym etapem badania był proces normalizacji zmiennych diagnostycznych. W tym celu wykorzystano metodę unitaryzacji zerowej, gdyż spełnia ona wszystkie postulaty stawiane metodom normowania²⁵. W przypadku przyjętej metody normalizacja zmiennych diagnostycznych jest dokonywana w następujący sposób²⁶:

²² *Statystyczne metody analizy danych*, 1998, W. Ostasiewicz (red.), Wydawnictwo Akademii Ekonomicznej im. Oskara Langego we Wrocławiu, Wrocław 1998, s. 115–117, 120–121.

²³ *Ibidem*, s. 115–117, 120–121.

²⁴ K. Kukuła, *Metoda unitaryzacji zerowej*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2000, s. 48.

²⁵ K. Kukuła stawia następujące postulaty wobec procedur normalizacji: 1. pozbawienie mian, w których są wyrażane cechy diagnostyczne; 2. sprowadzenie rzędu wielkości zmiennych diagnostycznych do stanu porównywalności, co oznacza wyrównanie zakresów zmienności cech, w konsekwencji możliwości ich dodawania; 3. równość długości przedziałów zmienności wartości cech unormowanych oraz równość dolnej i górnej granicy ich przedziału zmienności, w szczególności przedziału $[0, 1]$; 4. możliwość normowania cech diagnostycznych przyjmujących wartości zarówno dodatnie jak i ujemne lub tylko ujemne; 5. możliwość normowania cech przyjmujących wartość równą zero; 6. nieujemność cech unormowanych; 7. istnienie prostych formuł ujednociających charakter zmiennych. K. Kuła, *Metoda unitaryzacji...*, s. 81.

²⁶ *Ibidem*, s. 79, 90.

a) dla zmiennych diagnostycznych będących stymulantami²⁷:

$$z_{ij} = \frac{x_{ij} - \min_t \{x_{ij}\}}{\max_t \{x_{ij}\} - \min_t \{x_{ij}\}}$$

b) dla zmiennych diagnostycznych będącymi destymulantami²⁸:

$$z_{ij} = \frac{\max_t \{x_{ij}\} - x_{ij}}{\max_t \{x_{ij}\} - \min_t \{x_{ij}\}}$$

c) dla zmiennych diagnostycznych będących nominantami²⁹:

$$\left\{ \begin{array}{l} \frac{x_{ij} - \min_t \{x_{ij}\}}{\max_t \{x_{ij}\} - \min_t \{x_{ij}\}} \quad \text{dla } x_{ij} < \text{nom} \{x_{1j}\} \\ 1 \quad \text{dla } \text{nom} \{x_{1j}\} \leq x_{ij} < \text{nom} \{x_{2j}\} \\ \frac{x_{ij} - \max_t \{x_{ij}\}}{\max_t \{x_{ij}\} - \min_t \{x_{ij}\}} \quad \text{dla } x_{ij} > \text{nom} \{x_{2j}\} \end{array} \right.$$

²⁷ Zmienna jest stymulantą, jeżeli dla każdych dwóch jej wartości x_{ij}^S, x_{kj}^S odnoszących się do obiektów A_i, A_k zachodzi $x_{ij}^S \succ x_{kj}^S \Rightarrow A_i \succ A_k$, gdzie \succ oznacza, że obiekt A_i jest preferowany nad A_k . M. Walesiak, *Uogólniona miara odległości w statystycznej analizie wielowymiarowej*, Wydawnictwo Akademii Ekonomicznej we Wrocławiu, Wrocław 2002, s. 17.

²⁸ Zmienną jest destymulantą, jeżeli dla każdych dwóch jej wartości x_{ij}^D, x_{kj}^D odnoszących się do obiektów A_i, A_k zachodzi $x_{ij}^D \succ x_{kj}^D \Rightarrow A_i \prec A_k$, gdzie \prec oznacza, że obiekt A_k jest preferowany nad A_i . M. Walesiak, op. cit., s. 16.

Celem przeprowadzonej analizy było uporządkowanie badanych krajów w kolejności od krajów charakteryzujących się najniższym zakresem operacyjnej kontroli państwa nad gospodarką do krajów charakteryzujących się najwyższym zakresem operacyjnej kontroli państwa nad gospodarką. Tym samym zmienne X1, X3, X4, X5, X7, X9, X10 zostały uznane za destymulanty, natomiast zmienna X2 za nominantę³⁰. Wśród wyko-

²⁹ Zmienną jest nominantą jednomodalną, gdy dla każdych dwóch jej wartości x_{ij}^N, x_{kj}^N

odnoszących się do obiektów A_i, A_k ,

$$\text{jeżeli } x_{ij}^N, x_{kj}^N > \text{nom}_j, \text{ to } x_{ij}^N > x_{kj}^N \Rightarrow A_i \prec A_k,$$

$$\text{jeżeli } x_{ij}^N, x_{kj}^N > \text{nom}_j, \text{ to } x_{ij}^N > x_{kj}^N \Rightarrow A_i \prec A_k.$$

Ibidem, s. 17. W przypadku przeprowadzonego badania pojawiła się zmienna diagnostyczna będąca nominantą z zalecanym przedziałem wartości, gdzie dla każdych dwóch wartości x_{ij}^N, x_{kj}^N odnoszących się do obiektów A_i, A_k ,

$$\text{jeżeli } x_{ij}^N, x_{kj}^N < \text{nom}_{1j}, \text{ to } x_{ij}^N > x_{kj}^N \Rightarrow A_i \succ A_k,$$

$$\text{jeżeli } \text{nom}_{1j} \leq x_{ij}^N, x_{kj}^N < \text{nom}_{2j}, \text{ to } x_{ij}^N > x_{kj}^N \Rightarrow A_i = A_k,$$

$$\text{jeżeli } x_{ij}^N, x_{kj}^N \geq \text{nom}_{2j}, \text{ to } x_{ij}^N > x_{kj}^N \Rightarrow A_i \prec A_k.$$

D. Strahl, M. Walesiak, *Normalizacja zmiennych w granicznym systemie referencyjnym* [w:] K. Jajuga, M. Walesiak (red.), *Klasyfikacja i analiza danych. Teoria i zastosowania*, Akademia Ekonomiczna w Wrocławiu, Jelenia Góra-Wrocław-Kraków 1996, s. 40-41.

³⁰ Tradycyjnie głównym narzędziem krótkookresowego zarządzania zagregowanym popytem w celu makroekonomicznego zarządzania gospodarką był deficyt budżetowy. Sytuację zbilansowania budżetu można uznać za sytuację neutralną z perspektywy krótkookreso-

wej kontroli państwa nad gospodarką. Z tego powodu przyjęto, że $\text{nom} \{x_{1j}\} = 0$. Z kolei pojawienie się nadwyżki budżetowej budzi więcej kontrowersji teoretycznych przy próbie określenia znaczenia tego faktu w kontekście krótkookresowej kontroli państwa nad gospodarką. Było to szczególnie widoczne w toku dyskusji toczącej się wokół nadwyżki budżetowej, jaka pojawiła się w Sanach Zjednoczonych pod koniec poprzedniego wieku. Dla wielu ekonomistów utrzymywanie nadwyżek budżetowych może być narzędziem długookresowej polityki o charakterze podażowym, której celem jest np. zwiększenie stopy oszczędności niezbędnego dla podniesienia inwestycji i produktywności pracy w gospodarce. Z kolei dla innych utrzymywanie się długookresowej nadwyżki lub jej zbyt wysoki poziom oznacza interwencjonizm państwa w celu alokacji dochodu, który może być niezgodny z preferencjami społecznymi i jest nie akceptowalny politycznie. (Zob. J. B. Taylor, *Monetary Policy and The Long Boom*, Federal Reserve Bank of ST, Louis Review 1999, November/

rzystanych zmiennych diagnostycznych nie było stymulant. Tak zakwalifikowane mierniki zostały poddane procedurze określenia poprawności charakteru zmiennych diagnostycznych *ex post*³¹.

Jako funkcję agregującą znormalizowane wartości zmiennych diagnostycznych została wykorzystana średnia arytmetyczna. W rezultacie otrzymano następujący syntetyczny miernik rozwoju:

$$SMR_t = \frac{1}{k} \sum_{j=1}^k z_{tj}$$

gdzie:

t – numer kolejny kraju (t = 1, 2, ..., n)

j – numer zmiennej diagnostycznej (j = 1, 2, ..., k)

Skonstruowany syntetyczny miernik pozwolił także na stworzenie typologii krajów pod względem zakresu operacyjnej kontroli państwa nad gospodarką. Typologia ta opiera się na metodzie wykorzystującej średnią arytmetyczną oraz odchylenie standardowe. Tym samym badane kraje zostały podzielone na cztery grupy:

1. grupa krajów o niskim zakresie operacyjnej kontroli państwa nad gospodarką, dla których:

$$SMR_t \geq \overline{SMR} + S(SMR)$$

December, s. 9–10) Rozwiązaniem kompromisowym było przyjęcie, że $nom\{x_{2,j}\} = 3$. Tym samym sytuację, w której saldo budżetu państwa w relacji do PKB mieści się w przedziale [0, 3] uznano za neutralną z perspektywy krótkookresowego operacyjnego kontrolowania gospodarki przez państwo. Natomiast, gdy nadwyżka budżetu państwa przekracza 3% PKB, może być uznana za efekt zacieśniania polityki w fiskalnej w celu ograniczenia zagregowanego popytu dla ustabilizowania przegrzanej gospodarki. Choć należy podkreślić, że z perspektywy stanu wiedzy współczesnej ekonomii politycznej taka możliwość jest raczej mało prawdopodobna, a ewentualne nadwyżki budżetowe mają charakter głównie endogeniczny, nie są natomiast efektem dyskrecjonalnego działania rządu. Zob. A. Alesina, *The Political Economy of the Budget Surplus in the U.S.*, Journal of Economic Perspectives 2000, Vol. 14, No. 3, s. 3–19.

³¹ Zgodnie z postulatami weryfikacji poprawności charakteru zmiennych, stymulanty powinny być ze sobą skorelowane dodatnie. To samo odnosi się do destymulant. Współczynniki korelacji liniowej między stymulantami oraz destymulantami powinny mieć wartości ujemne. Między stymulantami i nominantami, jak i między destymulantami i nominantami nie powinny występować istotne zależności korelacyjne. *Taksonomiczna analiza przestycznego zróżnicowania poziomu życia w Polsce w ujęciu dynamicznym*, A. Zeliaś (red.), Wydawnictwo Akademii Ekonomicznej w Krakowie, Kraków 2000, s. 39.

2. grupa krajów o średnim zakresie operacyjnej kontroli państwa nad gospodarką, dla których:

$$\overline{SMR} \leq SMR_i < \overline{SMR} + S(SMR)$$

3. grupa krajów o wysokim zakresie operacyjnej kontroli państwa nad gospodarką, dla których:

$$\overline{SMR} - S(SMR) < SMR_i \leq \overline{SMR}$$

4. grupa krajów o bardzo wysokim zakresie operacyjnej kontroli państwa nad gospodarką, dla których:

$$SMR_i \leq \overline{SMR} - S(SMR)$$

WYNIKI BADANIA

Wyniki przeprowadzonego badania zostały przedstawione w tabeli 1. Do grupy charakteryzującej się najniższym zakresem operacyjnej kontroli państwa nad gospodarką zostało zaliczonych sześć krajów. Liderem sporządzanego rankingu jest Irlandia, która jest przykładem bezprecedensowego sukcesu w nadrobianiu zaległości rozwojowych. Kraj ten w ciągu ostatnich dwóch dekad zmienił się z rolniczej gospodarki o jednym z najniższych poziomów rozwoju wśród krajów Unii Europejskiej, w gospodarkę w znacznej mierze opartą na wiedzy z średnim PKB per capita w roku 2004 przekraczającym 135% średniej unijnej³². Podobnie Hiszpania, dzięki przeprowadzeniu szerokich reform ograniczających bezpośrednią aktywność państwa, w ciągu ostatniej dekady odnotowała ogromny postęp gospodarczy. Dla porównania Grecja i Portugalia, które znacznie mniej efektywnie wykorzystały niemal dwie dekady członkostwa w UE, w roku 2004 zostały zakwalifikowane jako kraje o wysokim zakresie kontroli operacyjnej państwa nad gospodarką.

Należy podkreślić, że wśród dziewięciu krajów o wysokim zakresie kontroli operacyjnej państwa oraz wśród czterech gospodarek o jej najwyższym zakresie nie ma społeczeństw, które w ciągu ostatnich lat zdołały w dużym zakresie ograniczyć lukę rozwojową.

³² Dane dla EU-25 PKB według parytetu siły nabywczej. *Europe in figures...*

Tabela 1. Wartości syntetycznego miernika rozwoju dla poszczególnych krajów, miejsce w rankingu oraz grupa typologiczna

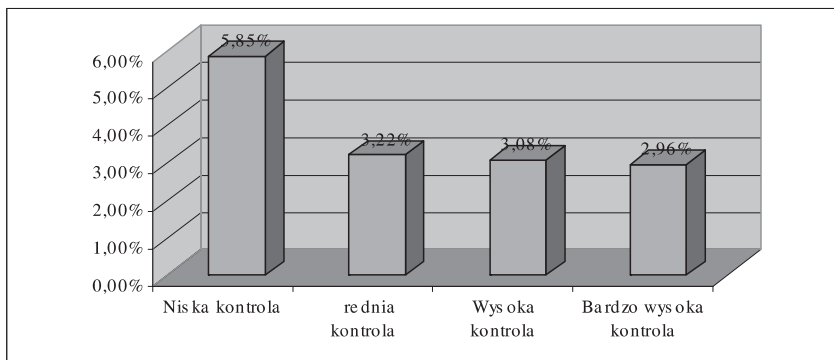
MIEJSCE W RANKINGU	KRAJ	SMR
Kraje o niskim zakresie kontroli operacyjnej państwa nad gospodarką		
1	Irlandia	0,868989
2	Litwa	0,861472
3	Estonia	0,853056
4	Luksemburg	0,833575
5	Hiszpania	0,82469
6	Łotwa	0,809556
Kraje o średnim zakresie kontroli operacyjnej państwa nad gospodarką		
7	Niemcy	0,732784
8	Słowacja	0,71414
9	Czechy	0,694481
10	Wielka Brytania	0,678278
11	Holandia	0,650303
Kraje o wysokim zakresie kontroli operacyjnej państwa nad gospodarką		
12	Austria	0,643109
13	Belgia	0,638999
14	Grecja	0,617371
15	Włochy	0,600207
16	Portugalia	0,596945
17	Polska	0,580775
18	Finlandia	0,569438
19	Cypr	0,562888
20	Francja	0,513068
Kraje o bardzo wysokim zakresie kontroli operacyjnej państwa nad gospodarką		
21	Węgry	0,487958
22	Dania	0,425762
23	Szwecja	0,422669
24	Malta	0,39084

Źródło: obliczenia własne na podstawie danych *Europe in figures...*

Warto szczególnie zwrócić uwagę na zakres operacyjnej kontroli państwa nad gospodarką w krajach, które brały udział w rozszerzeniu UE w roku 2004. Kraje nadbałtyckie, które najlepiej wykorzystują potencjał wynikający z członkostwa w UE, znalazły się w pierwszej grupie typologicznej. Polska i Węgry, które

jeszcze kilka lat temu uważane były za liderów przemian gospodarczych w regionie, znalazły się odpowiednio wśród krajów o wysokim zakresie operacyjnej kontroli nad gospodarką i bardzo wysokim. W przypadku Polski w roku 1997 PKB per capita wynosiło 44,2% średniej unijnej, w 2004 było to 48,7%. Zgodnie z prognozą z 2005 r. PKB per capita w Polsce w roku 2008 powinien osiągnąć 53,8% średniej UE³³. Analogiczne dane dla Węgier wynoszą 49,8%, 61,3% oraz 64,2%. Dla porównania Estonia, Litwa i Łotwa w 1997 startowały odpowiednio z poziomu 38,4%, 37,2% i 33%, w 2004 osiągnęły 53,4%, 49% i 43,6%, podczas gdy prognozy dla tych krajów na 2008 wynoszą 74,3%, 60,1% i 59,4%. Słowacja i Republika Czeska zostały zaliczone do grupy krajów o średnim zakresie operacyjnej kontroli państwa nad gospodarką. PKB per capita w Republice Słowackiej wynosił w 1997 r. 47,4% średniej UE, w 2004 było to 54,4%, a prognozy na 2008 r. wskazują, że PKB per capita Słowacji osiągnie 64,3% średniej unijnej. Czechy rozpoczęły proces transformacji systemowej z najwyższego poziomu rozwoju gospodarczego wśród krajów posocjalistycznych. W 1997 r. ich PKB per capita stanowił 69,2% średniej unijnej, w 2004 było to 72,1%, natomiast prognoza na 2008 r. wynosi 80%. Tym samym przy utrzymaniu się powyższych tendencji, w roku 2010 Republika Czeska może zostać zdystansowana pod względem PKB per capita przez kraje nadbałtyckie, mimo że kraje te rozpoczynały transformację systemową z o połowę niższym poziomem rozwoju gospodarczego.

Powyższe dane wskazują, że obecnie Polska zajmuje przedostatnie, a Węgry osiągają najniższe tempo nadrabiania luki rozwojowej wśród krajów regionu Europy Środkowo-Wschodniej. Ponadto w zeszłym roku Węgry były krajem przeżywającym fale niepokojów społecznych, niespotykanych od początku transformacji.



Wykres 1. Średnia dynamika PKB w poszczególnych grupach krajów w roku 2004

Źródło: Obliczenia własne na podstawie *Europe in figures...*

³³ Ibidem.

Podsumowaniem niniejszej analizy było obliczenie średniego tempa wzrostu PKB w poszczególnych grupach typologicznych, co jest przedstawione na wykresie 1. Warto zauważyć, że gospodarki zakwalifikowane jako kraje o niskim stopniu operacyjnej kontroli państwa w 2004 r. osiągnęły niemal dwukrotnie wyższą dynamikę wzrostu PKB niż kraje zakwalifikowane do pozostałych trzech grup. W roku 2004 średnie tempo wzrostu PKB w grupie krajów o niskim zakresie kontroli operacyjnej państwa nad gospodarką wynosiło 5,85%, w grupie krajów o średnim zakresie kontroli 3,22%, w grupie krajów o wysokiej kontroli 3,08%. Podczas gdy w grupie krajów o najwyższym zakresie kontroli operacyjnej państwa nad gospodarką wynosiło ono tylko 2,96%³⁴. Wyniki te są zgodne z badaniami V. Tanzię wskazującymi, że po przekroczeniu określonej masy krytycznej zakresu interwencjonizmu państwowego dochodzi do wzrostu znaczenia czynników ograniczających tempo wzrostu gospodarczego³⁵.

ZAKOŃCZENIE

Wyniki zaprezentowane powyżej potwierdzają, że kraje charakteryzujące się wysokim zakresem operacyjnej kontroli państwa nad gospodarką nie są w stanie osiągnąć wysokiej dynamiki rozwoju gospodarczego. O ile w przypadku krajów wysoko rozwiniętych w krótkim, a czasami nawet w średnim okresie może to nie być uznawane za największy problem gospodarczy tych społeczeństw, o tyle w przypadku krajów stojących wobec wyzwania nadrobienia luki rozwojowej, taka sytuacja stanowi bezpośrednie zagrożenie dla ich stabilności społeczno-politycznej.

W przypadku Polski wyniki zaprezentowanej analizy mogą prowadzić do wniosku, że jeżeli nie nastąpi znaczące ograniczenie zakresu operacyjnej kontroli państwa nad gospodarką, można przewidywać, że nasz kraj będzie nadrabiał zaległości rozwojowe znacznie wolniej niż nasi sąsiedzi. Oznaczać to będzie relatywny spadek znaczenia gospodarczego Polski.

Przeprowadzone badanie wskazuje na istotny ujemny wpływ dużego zakresu operacyjnej kontroli państwa nad gospodarką na dynamikę wzrostu gospodarczego. Można więc uznać, że badanie to stanowi istotny argument na rzecz tezy mówiącej o malejącym znaczeniu operacyjnej kontroli państwa nad gospodarką dla kreowania dobrobytu społecznego. Co więcej, należy się

³⁴ Obliczenia własne na podstawie *Europe in figures...*

³⁵ V. Tanzi szacuje tą granicę jako udział sektora publicznego w PKB przekraczający około 30%. Zob. V. Tanzi, L. Schuknecht., *Reconsidering...*; V. Tanzi, *Gospodarcza rola...*

spodziewać, że zmiany związane z takimi megatrendami, jak globalizacja czy pojawienie się „nowej gospodarki” będą potęgowały to zjawisko.

Istotnym mankamentem przeprowadzonej analizy jest jej statyczny charakter. Tym samym kolejnym krokiem powinno być ich zdynamizowanie. Stanowiąc to będzie przedmiot dalszych badań.

THE ANALYSIS OF THE EXTENT OF OPERATIONAL STATE CONTROL IN THE EUROPEAN UNION COUNTRIES

SUMMARY

The presented empirical analysis concerns an operational control of government over the economy in the European Union and it touches the relation between the operational economic activity of government and the dynamics of economic growth.

In case of contemporary highly developed economies every government can utilise a wide range of fiscal instruments that can influence an economic process in the short term. As a result, the operational control of government over economy should be treated as a complex phenomenon. Thus, in case of international comparisons some tools of multidimensional analysis can be applied to measure it. In the presented study a synthetic measure of development was applied, as it enables to verify an extent of the operational economic activity of government in every country, to build a rating of the countries and to classify the countries into created typological groups.

The results of the empirical study show that the countries with high operational government control over economy tend to have lower dynamics of economic growth than the countries with a low short term economical activity of government. The economies that were classified as the countries with low operational economic control of government in the year 2004 obtained almost twice as high dynamics of GDP growth as the countries that were classified to the groups with middle, higher and the highest extant of economic control of government. As a result, it can be stated that the presented empirical study conveys an important contribution in favour of a notion that the operational control of government over economy is currently getting less effective in supporting an economic welfare of societies.

