

I. BADANIA KONIUNKTURY W IRG SGH

Badania koniunktury gospodarczej metodą testu są prowadzone w celu uzyskania informacji o stanie gospodarki. Do głównych zalet tych badań należą szybkość pozyskiwania i aktualność informacji. Instytut Rozwoju Gospodarczego SGH rozpoczął badania koniunktury w 1986 roku, korzystając z doświadczeń wiodących europejskich ośrodków: ISCO (*Istituto Nazionale per lo Studio della Congiuntura*, obecnie ISAE) z Rzymu i IFO (*Institut für Wirtschaft*) z Monachium. Pierwszą partię 250 ankiet wysłano w sierpniu 1986 roku. Zapoczątkowały one regularne badania koniunktury w przemyśle przetwórczym, prowadzone początkowo tylko w przedsiębiorstwach publicznych. Transformacja systemu gospodarczego sprzyjała rozszerzeniu badań. Obecnie w IRG SGH prowadzone są badania koniunktury w: przemyśle przetwórczym, budownictwie, handlu, rolnictwie, bankowości i gospodarstwach domowych. W ponad 20-letniej historii badań koniunktury wysłaliśmy ponad milion ankiet.

Dane gromadzone w badaniach koniunktury są wykorzystywane zarówno do oceny bieżących zmian poziomów aktywności gospodarczej, jak również długookresowych trendów rozwojowych. W wyniku standaryzacji narzędzi badawczych dane mogą być również wykorzystywane do porównań międzynarodowych. Prace nad harmonizacją formularzy ankiet, używanych do badania koniunktury w krajach przechodzących transformację systemową, prowadzone były od początku lat 90-tych pod patronatem OECD i Unii Europejskiej (EUROSTAT). Znaczną aktywność w tej dziedzinie wykazywał także CIRET (*Centre for International Research on Economic Tendency Survey*), międzynarodowa organizacja, skupiająca główne światowe ośrodki badania koniunktury. W rezultacie szeregu roboczych dyskusji i spotkań ustalono standardowy układ kwestionariuszy ankiet do badania koniunktury w głównych dziedzinach aktywności gospodarczej¹. IRG SGH jest aktywnym członkiem CIRET.

Źródłem informacji są odpowiedzi ankietowanych podmiotów uczestniczących w badaniach dobrowolnie. Gwarantuje to niezależność pozyskiwanych informacji. Próba do badań dobierana jest losowo (po dokonaniu warstwowania w populacji generalnej) tak, aby zapewnić jej reprezentatywność ze względu na podstawowe cechy populacji. Pytania mają charakter jakościowy. Respondenci regularnie – comiesięcznie lub cokuwartalnie – dokonują oceny poszczególnych zmiennych charakteryzujących w sposób wielowymiarowy ich aktywność ekonomiczną. W ocenie posługują się skalą trójstopniową lub pięciostopniową. Dla większości pytań ankiety możliwe są następujące warianty odpowiedzi:

- stan normalny, typowy (brak zmian, =)
- poprawa sytuacji (wzrost, powyżej normy, więcej niż wystarczająco, +),
- pogorszenie sytuacji (spadek, poniżej normy, mniej niż wystarczająco, -).

W przypadku niektórych pytań dochodzi dodatkowy wariant – „nie dotyczy”.

Według powyższego schematu formułowane są odpowiedzi dotyczące zarówno sytuacji bieżącej, (zmian w ostatnich miesiącach – stan), jak i przewidywań co do (zmian w) najbliższej przyszłości.

Dla wszystkich pytań ankiety obliczane są statystyki bilansowe (saldo). Stanowią one różnice między odsetkami odpowiedzi stwierdzającymi poprawę sytuacji a odsetkami odpowiedzi

¹ Metodyka badań koniunktury i – w szczególności – obliczania wskaźników koniunktury jest opisana w dokumencie Komisji Europejskiej pt. *The joint harmonised EU programme of business and consumer surveys. User guide* (ostatnia wersja pochodzi z 21 marca 2014 r.). Program zharmonizowanych badań koniunktury został wprowadzony decyzją Komisji Europejskiej z dnia 15 listopada 1961 r. (ze zm.). Program nie obejmuje badań koniunktury w rolnictwie i handlu. Metodyka badań prowadzonych przez IRG SGH w tych działach gospodarki narodowej jest autorska.

wskazującymi na jej pogorszenie. Salda przybierają wartości z przedziału od -100 do +100. Na ich podstawie dokonywana jest ocena dynamiki poszczególnych zmiennych. Z wybranych sald tworzy się wskaźniki koniunktury, które pokazują ogólny obraz aktywności w danym obszarze gospodarki narodowej. Tak jak salda, wartości wskaźników koniunktury mieszczą się w przedziale od -100 do +100.

Raz w roku, na jego początku, dokonywana jest rewizja danych za rok poprzedzający, uwzględniająca ankiety, które zostały nadesłane po dniu zamknięcia badania za dany okres (tj. dokonania agregacji danych i obliczenia wartości sald).

II. BADANIE KONIUNKTURY W ROLNICTWIE

Badanie koniunktury w rolnictwie jest prowadzone przez Instytut Rozwoju Gospodarczego Szkoły Głównej Handlowej od kwietnia 1992 r. Autorem projektu badania jest profesor Eugeniusz Gorzelak, który był kierownikiem badania do końca 2012 r. W latach 2007-2013 współautorem badania był mgr Zdzisław Zimny. Po śmierci Profesora obowiązki kierownika przejął dr Konrad Walczyk. Instytut jest jednym z trzech ośrodków na świecie, prowadzących tego typu badanie.

Badanie odbywa się w cyklu kwartalnym: w styczniu (I kwartał), kwietniu (II kwartał), lipcu (III kwartał) i październiku (IV kwartał). Podstawą badania jest ankieta wysyłana do ośrodków doradztwa rolniczego. Eksperti rolni w nich zatrudnieni, znając swe środowisko, rozprawiają ankiety wśród rolników i wypełnione odsyłają do Instytutu, gdzie dokonywana jest analiza merytoryczna. Przedmiotem badania są:

- przychody pieniężne gospodarstw rolnych,
- oszczędności,
- zadłużenie,
- zakupy nawozów mineralnych,
- zakupy pasz treściwych,
- zakupy środków ochrony roślin,
- inwestycje w maszyny i urządzenia,
- inwestycje w budynki i budowle,
- dostępność kredytów preferencyjnych,
- zamiar zaciągnięcia kredytu,
- fakt zaciągnięcia kredytu preferencyjnego i rynkowego,
- nastroje (perspektywy gospodarstwa rolnego).

Raz w roku pytamy rolników o:

- znaczenie dopłat bezpośrednich (w styczniu),
- przeznaczenie środków pomocowych (w kwietniu),
- skutki anomalii pogodowych (w grudniu).

Syntetyczną miarą koniunktury w rolnictwie jest wskaźnik koniunktury. Jest on obliczany na podstawie dwóch wskaźników cząstkowych: wskaźnika wyrównanych przychodów pieniężnych i wskaźnika zaufania. Pierwszy z nich liczony jest jako średnia arytmetyczna z sald pytań o osiągnięte i przewidywane przychody pieniężne gospodarstw rolnych z dwóch ostatnich badań z osobna. Wskaźnik zaufania oblicza się na podstawie odpowiedzi rolników na pytanie dotyczące perspektyw dalszego gospodarowania. Brzmi ono: „Jak rolnicy patrzą w przyszłość swego gospodarowania?”. Zaproponowane zostały trzy możliwe odpowiedzi: „z zaufaniem”, „z obawą” i „ze strachem”. Dwie odpowiedzi skrajne otrzymały wagi +1 i -1, odpowiedź pośrednia – wagę -0,1. Ogólny wskaźnik koniunktury jest średnią arytmetyczną z dwóch wskaźników składowych, przy czym udział wskaźnika

wyrównanych przychodów pieniężnych w ogólnym wskaźniku koniunktury jest dwukrotnie większy od udziału wskaźnika zaufania.

Wyniki badania są obliczane w następujących przekrojach:

- położenie gospodarstwa rolnego (wyróżniamy pięć makroregionów: północny z ośrodkiem w Gdańsku, zachodni – we Wrocławiu, środkowozachodni – w Poznaniu, środkowowschodni – w Warszawie i południowy – w Krakowie),
- jego wielkość (cztery grupy obszarowe: do 7 ha użytków rolnych; 7,1-15 ha; 15,1-50 ha i powyżej 50 ha);
- wiek kierującego gospodarstwem (cztery grupy wiekowe: do 30 lat, 31-45, 46-60 i powyżej 60 lat),
- jego wykształcenie (trzy grupy rolników: z wykształceniem podstawowym, średnim i wyższym),
- rodzaj działalności wg klasyfikacji PKD 2007 (pięć grup: uprawa roślin innych niż wieloletnie, uprawa roślin wieloletnich, chów i hodowla zwierząt, działalność mieszana, działalność inna).

III. BADANIE KONIUNKTURY W PRZEMYSŁE PRZETWÓRCZYM

Badanie koniunktury w przemyśle przetwórczym prowadzone jest co miesiąc. Przedmiotem badania są:

- wielkość produkcji,
- zamówienia ogółem,
- zamówienia eksportowe,
- zapasy,
- ceny,
- zatrudnienie,
- sytuacja finansowa przedsiębiorstw,
- sytuacja gospodarcza Polski.

Raz na kwartał, w miesiącach: styczeń, kwiecień, lipiec i październik, badaniu poddawane są:

- wykorzystanie mocy produkcyjnych,
 - bariery działalności gospodarczej,
 - konkurencyjność towarów zagranicznych na rynku krajowym,
- zaś w miesiącach: luty, maj, sierpień i listopad:
- wielkość produkcji na eksport,
 - konkurencyjność polskich towarów na rynkach zagranicznych,
 - korzyści z produkcji eksportowej,
 - przeciętny jednostkowy koszt produkcji.

Dwa razy w roku – w kwietniu i październiku – przedmiotem oceny są:

- wydatki inwestycyjne,
- zamierzenia inwestycyjne,
- czynniki ograniczające inwestycje.

Obliczone salda ważone są wielkością zatrudnienia.

Syntetyczną miarą koniunktury w przemyśle przetwórczym jest wskaźnik koniunktury. Do końca 2012 r. był liczony jako średnia ruchoma sald stanu i przewidywań produkcji z ostatnich trzech miesięcy. Od stycznia 2013 r. wskaźnik jest liczony metodą unijną, jako średnia arytmetyczna trzech sald: przewidywań produkcji, stanu zamówień i stany zapasów ze znakiem ujemnym.

Wyniki badania są obliczane w następujących przekrojach:

- forma własności (publiczna i prywatna),
- rodzaj prowadzonej działalności (główne grupy przemysłowe: półprodukty, dobra inwestycyjne, dobra konsumpcyjne trwałego użytku, nietrwałe dobra konsumpcyjne),
- wielkość zatrudnienia (do 50 pracowników, 51-250, 251-500, powyżej 500 pracowników),
- miejsce prowadzenia działalności (wg makroregionów NUTS 1).

IV. BADANIE KONIUNKTURY W BUDOWNICTWIE

Badania koniunktury w budownictwie rozpoczęto w IV kwartale 1993 roku. Początkowo obejmowało one wyłącznie przedsiębiorstwa sektora prywatnego. Począwszy od II kwartału 1994 roku badanie obejmuje również sektor publiczny.

Badanie prowadzone jest co kwartał (w styczniu, kwietniu, lipcu i październiku). Ankietowani odpowiadają na pytania o:

- wielkość produkcji,
- poziom zatrudnienia,
- ceny świadczonych usług,
- zamówienia ogółem,
- zamówienia eksportowe,
- sytuację finansową,
- wykorzystanie mocy produkcyjnych,
- inwestycje,
- bariery działalności gospodarczej,
- ogólną sytuację gospodarczą,
- ogólną sytuację budownictwa na tle gospodarki.

Tak jak w badaniu koniunktury w przemyśle salda ważone są wielkością zatrudnienia.

Syntetyczną oceną koniunktury w budownictwie jest wskaźnik koniunktury obliczany jako średnia arytmetyczna sald odpowiedzi na pytania o: stwierdzone zmiany portfela zamówień i przewidywane zmiany poziomu zatrudnienia.

Wyniki badania są obliczane w następujących przekrojach:

- forma własności (publiczna i prywatna),
- wielkość zatrudnienia (do 20 pracowników, 21-100, powyżej 100 pracowników),
- gałąź produkcji budowlano-montażowej (PKD 41, PKD 42, PKD 43),
- miejsce prowadzenia działalności (wg makroregionów NUTS 1),
- rok założenia przedsiębiorstwa (istniejące przed 1990 r. i powstałe w latach 1990-2005).

V. BADANIE KONIUNKTURY W HANDLU

Badanie koniunktury w handlu wewnętrznym prowadzone jest nieprzerwanie od października 1993 roku. Co kwartał (w styczniu, kwietniu, lipcu i październiku) przedmiotem badania są:

- zmiany ogólnej sytuacji przedsiębiorstw,
- sytuacja finansowa przedsiębiorstw,
- zapasy,
- zakupy od dostawców krajowych,
- zakupy od dostawców zagranicznych,
- zatrudnienie,
- ceny,

- konkurencja pomiędzy przedsiębiorstwami,
- ilość (wolumen) sprzedawanych towarów,
- powierzchnia magazynowa,
- ocena ogólnej sytuacji przedsiębiorstw,
- czynniki ograniczające polepszenie sytuacji przedsiębiorstw.

Syntetyczną oceną koniunktury w handlu jest wskaźnik koniunktury liczony metodą IRG według następującego wzoru:

$$\frac{M + N - J}{3}$$

gdzie:

M – saldo zmian w wielkości sprzedaży w handlu w kolejnych 6 miesiącach następujących po miesiącu, w którym przeprowadzono badanie;

N – saldo zakupów towarów od dostawców krajowych i zagranicznych razem, dokonywanych przez przedsiębiorstwa handlowe w kolejnych 6 miesiącach następujących po miesiącu, w którym przeprowadzono badanie;

J – saldo odpowiedzi na pytanie o stan zapasów w miesiącu, w którym przeprowadzono badanie.

Wyniki badania są obliczane w następujących przekrojach:

- charakter prowadzonej działalności (hurt, detal),
- wielkość ośrodków, w których prowadzą swoją działalność (wieś, małe miasto, średnie miasto, duże miasto),
- wielkość zatrudnienia (do 20 osób, 21-50, 51-100, powyżej 100 osób),
- branże działalności handlowej (grupy towarowe).

VI. BADANIE KONDYCJI GOSPODARSTW DOMOWYCH

Badanie kondycji gospodarstw domowych prowadzone jest przez Instytut Rozwoju Gospodarczego Szkoły Głównej Handlowej (IRG SGH) co kwartał od 1990 r. Badanie to zostało zapoczątkowane i było prowadzone w latach 1990-2003 przez prof. dr hab. Katarzynę Duczkowską-Małysz i prof. dr hab. Jerzego Małysza, którzy opracowali autorską ankietę prasową wykorzystywaną do badania opinii gospodarstw domowych w latach 1990-95.

W latach 1990-1995 do badania wykorzystywano ankietę zamieszczaną w tygodniku „Kobieta i Życie”. Na początku 1996 r. kwestionariusz ankiety został zharmonizowany z testem konsumenckim stosowanym w krajach Unii Europejskiej. Do 1999 r. publikowany był on w tygodniku „Tina”. Od 2000 r. ankietę prasową zastąpiła ankietą pocztową, rozsyłaną do reprezentatywnej próby. Obecna ankietę zawiera 15 pytań stałych (które pochodzą z kwestionariusza UE). Dodatkowo w ankiecie zamieszczone są pytania specjalne, które odnoszą się do bieżących zjawisk ekonomicznych, istotnych z punktu widzenia zachowań gospodarstw domowych. Ponadto zawiera ona 7 pytań metrycznych odnośnie cech gospodarstwa domowego.

Pytania zamieszczone w ankiecie odnoszą się do ocen bieżącej sytuacji gospodarstwa domowego (w większości przypadków w porównaniu do sytuacji sprzed 12 miesięcy) i sytuacji przyszłej, w następnych 12 miesiącach. Ankietę przeprowadzana jest zawsze w pierwszym miesiącu kwartału (styczeń, kwiecień, lipiec, październik).

W odróżnieniu od pozostałych badań prowadzonych przez IRG SGH skala odpowiedzi na pytania z testu konsumenckiego jest pięciostopniowa. W celu obliczenia salda odpowiedzi są ważone. Polega to na przyjęciu dla poszczególnych pytań wagi 1,0 dla wariantu „bardzo pozytywnego”, wagi 0,5 dla „pozytywnego”, 0,5 dla „negatywnego”, 1,0 dla wariantu „bardzo negatywnego”. Pozostałe warianty mają wagę 0,0. W tabeli poniżej przedstawiono zestawienie wag poszczególnych wariantów odpowiedzi. Ponadto, w celu zapewnienia reprezentatywności wyników w skali kraju, jednostkowe odpowiedzi są ważone według cech respondenta. Jako cechy wagowe przyjęto wiek i wykształcenie respondenta.

Polskie społeczeństwo charakteryzuje się stosunkowo stabilnym pesymizmem. Interpretacja wyników badania kondycji gospodarstw powinna odnosić się w dużym stopniu również do zmian wskaźników bilansowych w czasie, a nie jedynie ich znaku i poziomu. Przykładowo, zmniejszenie ujemnej statystyki bilansowej w czasie należy interpretować jako poprawę nastrojów (i na odwrót).

Na podstawie 4 sald prognostycznych obliczany jest syntetyczny wskaźnik sytuacji gospodarstw domowych – „Wskaźnik Kondycji Gospodarstw Domowych IRG SGH” (IRGKGD), który jest średnią arytmetyczną z sald: oceny przyszłej sytuacji finansowej, oceny przyszłej ogólnej sytuacji ekonomicznej, oczekiwanej zmiany poziomu bezrobocia ze znakiem ujemnym, oceny przyszłej skłonności do oszczędzania.

Pytanie	Warianty odpowiedzi / wagi					
	1	2	3	4	5	6
1	1,0	0,5	0,0	-0,5	-1,0	0,0
2	1,0	0,5	0,0	-0,5	-1,0	0,0
3	1,0	0,5	0,0	-0,5	-1,0	0,0
4	1,0	0,5	0,0	-0,5	-1,0	0,0
5	1,0	0,5	0,0	-0,5	-1,0	0,0
6	1,0	0,5	0,0	-0,5	-1,0	0,0
7	1,0	0,5	0,0	-0,5	-1,0	0,0
8	1,0	0,0	-1,0	0,0	-	-
9	1,0	0,5	0,0	-0,5	-1,0	0,0
10	1,0	0,5	-0,5	-1,0	0,0	-
11	1,0	0,5	-0,5	-1,0	0,0	-
12	-1,0	-0,5	0,0	0,5	1,0	0,0
13	1,0	0,5	-0,5	-1,0	0,0	-
14	1,0	0,5	-0,5	-1,0	0,0	-
15	1,0	0,5	-0,5	-1,0	0,0	-

VIII. BAROMETR KONIUNKTURY IRG SGH

Syntetyczną miarą koniunktury w gospodarce polskiej jest barometr IRG SGH, obliczany jako średnia ważona z sześciu wskaźników koniunktury. Od lat stosowane jest podejście, zgodnie z którym wskaźnikowi koniunktury w przemyśle przetwórczym oraz wskaźnikowi kondycji gospodarstw domowych przypisuje się wagi dwukrotnie większe niż każdemu z pozostałych wskaźników. Te dwa wskaźniki mają zatem wagi po 2/8, a pozostałe po 1/8.

Jak wspomniano, większość wskaźników jest obliczana pod koniec pierwszego miesiąca kwartału. Z tego powodu, iż ostateczne wyniki badania koniunktury w rolnictwie znane są dopiero pod koniec drugiego miesiąca kwartału, wartość barometru liczona jest dwukrotnie: wstępnie, w I połowie

drugiego miesiąca kwartału bez uwzględnienia wskaźnika koniunktury rolnej, i ostatecznie, w trzecim miesiącu kwartału z uwzględnieniem tego wskaźnika. Z kolei badanie sektora bankowego jest prowadzone *ex post*, więc na potrzeby barometru wykorzystujemy kombinację wskaźnika bieżącego i prognostycznego.