

ZAGADNIENIA DYDAKTYCZNE

Dariusz Błaszczuk *

EKONOMETRIA A ANALIZA RYNKÓW ZAGRANICZNYCH I PROGNOZOWANIE HANDLU ZAGRANICZNEGO

Celem artykułu jest ukazanie wzajemnych związków, jakie występują między trzema naukami podanymi w tytule. Związki te rozpatrywane będą z punktu widzenia cech wspólnych i różnic występujących w zadaniach stawianych przed wspomnianymi naukami, zakresem badań w ramach tych nauk oraz metod badań w nich stosowanych. Punktem wyjścia rozważań autora są definicje omawianych nauk.

I. Ekonometria

Ekonometria (gr. oikonomia - administracja, gospodarka; metron-miara) jest nauką społeczną, w której narzędzia teorii ekonomii, matematyki i wnioskowania statystycznego są wykorzystywane do uzyskania wiedzy na temat zjawisk i procesów ekonomicznych¹. Podobnie pojęcie ekonometrii rozumiał O. Lange², wg którego ekonometria to nauka zajmująca się ustalaniem za pomocą metod statystycznych konkretnych, ilościowych prawidłowości zachodzących w życiu gospodarczym. Na podstawie powyższych definicji można wy-

* Dr, adiunkt w Instytucie Ekonomiki i Polityki Handlu Zagranicznego SGPiS.

¹ A. S. G o l d b e r g, Teoria ekonometrii, Warszawa 1972, s. 504.

² O. L a n g e, Wstęp do ekonometrii, Warszawa 1961, s. 416.

przewodząc wniosek, że przed ekonometrią stawia się trzy następujące nierozdzielne zadania:

1) formułowanie praw związków i zależności, występujących w gospodarce, w języku matematycznym, co odpowiada w zasadzie nauce zwanej ekonomią matematyczną;

2) wycena (szacowanie i prognozowanie) za pomocą własnych metod (ekonometrycznych), siły oraz kierunków zależności i związków gospodarczych występujących we wcześniej wspomnianych prawach, a także weryfikacja uzyskanych wyników;

3) wykorzystanie w kierowaniu gospodarczym (planowaniu i zarządzaniu) wyników otrzymanych w pkt 1.

Informacji do podanej w pkt 2 wyceny siły i kierunków zależności i związków, istniejących w badanym wycinku gospodarki, dostarcza statystyka gospodarcza. Wynika stąd, że praktycznie rzecz biorąc, ekonometria może zajmować się wszystkimi dziedzinami życia gospodarczego, dla których istnieją odpowiednie (tj. wiarygodne, wystarczające) dane statystyczne.

Metoda badań w ekonometrii sprowadza się do modelowania zjawisk i zależności gospodarczych, a więc do budowy opisowych i optymalizacyjnych modeli ekonometrycznych, na której ostatnim, piątym etapie³ następuje ich wykorzystanie w praktyce.

Jak się wydaje, można wyodrębnić trzy zasadnicze kierunki tego wykorzystania, a mianowicie:

a) badanie przebiegu zjawisk w przeszłości w wielu okresach i/lub w wielu jednostkach przy badaniu przekrojowym;

b) badanie siły oraz kierunków związków i zależności między badanymi zmiennymi w przeszłości;

c) prognozowanie zjawisk i procesów gospodarczych na podstawie wyników badań z pkt a i b z ewentualnym wykorzystaniem wiedzy ekspertów (co wykracza poza zakres ekonometrii).

Na tej podstawie możemy wyprowadzić wniosek, że metody ekonometryczne mogą być, o ile będą odpowiednio wykorzystane, zasadniczą podstawą przy podejmowaniu wszelkich decyzji gospodarczych.

³ Z. P a w ł o w s k i, Ekonometria, Warszawa 1972, s 465.

II. Analiza rynków zagranicznych

Analiza rynków zagranicznych, to oparte na naukowych podstawach rozpoznanie struktury i mechanizmów określonego rynku zagranicznego oraz ocena stanu i rozwoju jego elementów⁴. Jest to więc nauka zajmująca się poznawaniem stanu, struktury, mechanizmów i rozwoju rynków zagranicznych (geograficznych, towarowych, geograficzno-towarowych). Nie precyzując pojęcia rynku zagranicznego możemy stwierdzić, że zakres badań analizy rynków zagranicznych jest znacznie mniejszy aniżeli ekonometrii, w której przypomnijmy, przedmiotem badania może być każde zjawisko i każda dziedzina gospodarki światowej. Podkreślić jednak należy, że nie wszystkie rynki zagraniczne (będące wg definicji przedmiotem badań w ramach analizy rynków zagranicznych) są jednakowo ważne z punktu widzenia kierowania handlem zagranicznym określonego kraju. Zakres badań analizy rynków zagranicznych może, w związku z tym - lub nie - ograniczyć się do rynków zagranicznych istotnych dla badanego kraju. W tym drugim przypadku zakres badań analizy rynków zagranicznych w zasadzie pokrywa się z pojęciem gospodarki światowej pomniejszonej o rynek krajowy. Z punktu widzenia celu analizy rynków zagranicznych uzasadnione jest jednak przyjęcie węższego zakresu badań, obejmującego jedynie rynki zagraniczne ważne dla gospodarki określonego kraju, w okresie badanym lub w przyszłości.

W przytoczonej wyżej definicji nie precyzuje się metod badania, nakładając na nie jedynie warunek, aby były one oparte na naukowych podstawach. W literaturze przedmiotu na ogół wyodrębnia się trzy grupy metod badania rynków zagranicznych, a mianowicie:

- a) metody statystyczne;
- b) metody ekonometryczne;
- c) metody intuicyjne (ekspertów).

Jak widać, metody ekonometryczne, a więc wywodzące się z ekonometrii stanowią jedynie jedne z możliwych metod stosowanych przy analizie rynków zagranicznych. Podkreślić przy tym należy,

⁴ B. Skórkowska, S. Mynarski, Z Matkowski, Analiza rynków zagranicznych, Warszawa 1979, s. 284.

że coraz częściej mówi się o metodach mieszanych, leżących na pograniczu dowolnych dwu z wymienionych wyżej grup metod, a nawet o metodach badań kompleksowych, obejmujących wszystkie trzy grupy metod "czystych".

Główne zadania stawiane przed analizą rynków zagranicznych to:

a) badanie struktury poszczególnych rynków zagranicznych (tj. rozmiarów, dynamiki, charakterów uczestników konkurencji, wahań podaży, popytu oraz cen);

b) diagnoza poszczególnych rynków zagranicznych (tj. wyjaśnienie ich historii i aktualnego stanu);

c) prognoza rozwoju poszczególnych rynków zagranicznych.

Przy pewnych założeniach upraszczających, które jednakże są do przyjęcia, w przypadku stosowania w analizie konkretnego rynku zagranicznego (geograficznego, towarowego, geograficzno-towarowego) metod (modeli) ekonometrycznych - poszczególne zadania stawiane przed analizą rynków zagranicznych można utożsamić z odpowiednimi kierunkami wykorzystania modeli ekonometrycznych, a mianowicie:

a) badanie struktury rynku z badaniem przebiegu zjawisk w przyszłości;

b) diagnozę rynku z badaniem zależności między zmiennymi, oraz

c) prognozę rynku z prognozowaniem zjawisk i procesów.

Podsumowując powyższe, można stwierdzić, że analiza rynków zagranicznych w gospodarce socjalistycznej jest niezbędną podstawą do budowy planu handlu zagranicznego, a następnie prawidłowej jego realizacji.

III. Prognozowanie handlu zagranicznego

Prognozowanie handlu zagranicznego, to sporządzanie najbardziej prawdopodobnego obrazu przyszłego kształtowania się wymiany dóbr i usług badanego kraju z jego otoczeniem zagranicznym, przy pomocy metod naukowych, na podstawie zaobserwowanych tendencji rozwojowych oraz przypuszczalnego wzajemnego oddziały-

wania czynników ją kształtujących⁵. Definicja ta podaje, że prognozowanie handlu zagranicznego, podobnie jak i analiza rynków zagranicznych, opierać się musi na metodach naukowych. Co do rodzajów metod badania przy prognozowaniu handlu zagranicznego możemy więc stwierdzić, że są one identyczne, jak w przypadku analizy rynków zagranicznych, z której historycznie rzecz biorąc, planowanie i prognozowanie handlu zagranicznego bezpośrednio się wywodzą. W efekcie, metody ekonometryczne są jedynie jednymi z trzech grup metod badania, jakie stosuje się w prognozowaniu handlu zagranicznego.

W podanej wyżej definicji precyzyjnie podany jest zakres badań prognozowania handlu zagranicznego. Jest to bowiem wartość wymiany dóbr i usług badanego kraju z zagranicą. Na wartość tę składają się wielkości eksportu i importu poszczególnych dóbr i usług oraz ich ceny. Na każdą z tych zmiennych wpływają czynniki wewnętrzne i zewnętrzne. Jeśli przyjmiemy, że czynniki zewnętrzne badane są w ramach analizy rynków zagranicznych, to możemy stwierdzić, że zakres badań prognozowania handlu zagranicznego jest większy (dokładnie o czynniki wewnętrzne) od zakresu badań analizy rynków zagranicznych. W zależności od szerokości badania tych czynników wewnętrznych będzie on bliższy lub dalszy zakresowi badań ekonometrii, który, przypomnijmy, obejmuje wszelkie możliwe dziedziny gospodarowania.

Jeśli chodzi o zadania stawiane przed prognozowaniem handlu zagranicznego, to również podane są one w przytoczonej wyżej definicji. Jest to mianowicie sporządzenie najbardziej prawdopodobnego obrazu przyszłego kształtowania się wymiany dóbr i usług badanego kraju z zagranicą. W sytuacji, gdy prognozowanie handlu zagranicznego odbywa się przy wykorzystaniu metod ekonometrycznych, zadania te odpowiadają, formalnie rzecz biorąc, trzeciemu kierunkowi wykorzystania modeli ekonometrycznych, tj. prognozowaniu zjawisk i procesów gospodarczych. Należy jednak pamiętać, że sporządzenie naukowej prognozy bez wcześniejszego badania (a więc w tym przypadku pkt a i b kierunków wykorzystania modeli ekonometrycznych) nie jest możliwe. W efekcie, zadania sta-

⁵ D. Rosati, R. Kowalska, R. Michalski, Planowanie i prognozowanie handlu zagranicznego, Warszawa 1977, s. 34.

wiane przed prognozowaniem pokrywają się ze wszystkimi trzema kierunkami wykorzystania modeli ekonometrycznych, a więc jak stwierdziliśmy wcześniej, z zadaniami stawianymi przed analizą rynków zagranicznych.

Z powyższych rozważań wynika, że w gospodarce socjalistycznej prognozowanie handlu zagranicznego powinno być organiczną częścią procesu planowania handlu zagranicznego, czy jak to nazywa Z. Czerwiński, procesu planistyczno-prognostycznego⁶. Jest to bowiem jeden ze sposobów zbierania informacji do podjęcia decyzji, przy czym rola prognozowania handlu zagranicznego rośnie, gdy zwiększa się ilość i zakres oddziaływania czynników nie kontrolowanych przez władzę gospodarczą.

IV. Podsumowanie

Spośród trzech rozważanych przez autora nauk, ekonometria charakteryzuje się, jak starano się wykazać, najszerszymi zadaniami, do których, przypomnijmy, należą: formułowanie praw i zależności ekonomicznych w języku matematycznym, wycena ilościowa i weryfikacja tych praw i zależności oraz wykorzystanie wyników badań w planowaniu i zarządzaniu gospodarczym w drodze badania zjawisk i zależności w przeszłości oraz ich prognozowania na przyszłość. Analiza rynków zagranicznych i prognozowanie handlu zagranicznego, przed którymi stoją zadania badania i prognozowania rozwoju rynków zagranicznych i krajowego, mają natomiast zakres odpowiadający trzeciemu rodzajowi zadań stawianych przed ekonometrią.

Również zakres badań ekonometrii jest, jak stwierdził autor wcześniej, szerszy niż zakres prognozowania handlu zagranicznego, który obejmuje jedynie dziedziny bezpośrednio związane z wymianą gospodarczą badanego kraju z zagranicą, a tym bardziej szerszy niż zakres analizy rynków zagranicznych, który obejmuje jedynie elementy zewnętrzne, wpływające na handel zagraniczny badanego kraju.

Natomiast analiza rynków zagranicznych i prognozowanie hand-

⁶ Z. C z e r w i ń s k i, Prognoza, plan, prawdopodobieństwo, "Ekonomista" 1975, nr 1, s. 27-43.

lu zagranicznego wykorzystują w swoich badaniach znacznie szerszy arsenał metod niż ekonometria. Oprócz wykorzystywanych w ekonometrii metod ekonometrycznych, polegających na budowie opisowych i optymalizacyjnych modeli ekonometrycznych, pozostałe nauki stosują m. in. metody statystyczne, polegające na wyznaczaniu wskaźników i współczynników⁷ oraz metody ekspertów, polegające na wykorzystaniu wiedzy i doświadczenia wybranych osób⁸.

Z powyższego wynika, że istnieją pewne wspólne pola omawianych trzech nauk. W trosce o ich prawidłowy rozwój należy jednoznacznie sprecyzować zadania i zakres badań każdej z nauk. Autor w tej dziedzinie proponuje, aby traktować ekonometrię jako naukę podstawową, dostarczającą wiedzy na temat metod ekonometrycznych, które powinny być wykorzystywane w ogóle w kierowaniu gospodarczym, na przykładach zastosowań szczegółowych, w tym przypadku w planowaniu i zarządzaniu handlem zagranicznym. Tym samym, analiza rynków zagranicznych i prognozowanie handlu zagranicznego powinny zrezygnować zupełnie z zajmowania się metodami ekonometrycznymi, statystycznymi (które powinny, per analogiam, znaleźć się w statystyce), oraz z ekspertów (co powinno znaleźć się w odrębnym przedmiocie - ekspertologii). Analiza rynków zagranicznych i prognozowanie handlu zagranicznego powinny natomiast zająć się faktycznie badaniem i prognozowaniem rynków: zagranicznych i krajowego, korzystając z wymienionych metod naukowych. W takiej sytuacji w ekonometrii znalazłyby się jedynie wybrane, klasyczne przykłady zastosowań metod ekonometrycznych do analizy rynków zagranicznych i prognozowania handlu zagranicznego, a w konsekwencji przykłady ich zastosowań w kierowaniu handlem zagranicznym.

⁷ S. S z u l c, Metody statystyczne, Warszawa 1968, s. 738.

⁸ Ekspertnyje ocenki w nauczno-techniczeskom prognozirowaniji, Kijów 1974.

Dariusz Błaszczuk

ECONOMETRICS AND ANALYSIS OF FOREIGN MARKETS
AND FOREIGN TRADE FORECASTING

The aim of this paper is to describe correlations between econometrics, foreign markets analysis and foreign trade forecasting. These correlations are analyzed from the angle of common features and differences, which appear in tasks posed before the above mentioned sciences, scope of studies within the framework of these sciences as well as of research methods applied by them. The starting point for the analysis is definition of the sciences in question.

The performed analysis reveals that econometrics is characterized with the widest scope of tasks and researches which include: formulation of economic laws and relationships in the mathematical language, estimation and quantitative verification of these laws and relationships as well as utilization of research findings in the economic management. Foreign markets analysis and foreign trade forecasting, on the other hand, have a more narrow scope of tasks and research area, which, firstly, correspond to the third area of econometric researches, and secondly, they encompass only those areas which are directly connected with trade exchange of a given country under review with abroad (with respect to foreign trade forecasting) as well as chosen external elements affecting foreign trade of a given examined country (with respect to foreign markets analysis).

On the other hand, foreign markets analysis and foreign trade forecasting employ a wider diversification of methods in their researches than econometrics. Apart from econometric methods, these sciences use statistical or experts methods, which should be taught as separate subjects (e. g. Statistics, and "Expertology").