



04.03.2016

NIESMAK

P O Z O S T A Ł

GRZEGORZ ZATRYB  GŁÓWNY STRATEG

Rzadko bywa, aby publikacja danych kwartalnych o PKB stała się tematem numer jeden. Zwłaszcza gdy mówimy o polskim PKB. To powinno cieszyć, gdyż poziom wiedzy ekonomicznej sporej rzeszy Polaków pozostawia wiele do życzenia. Nic w tym dziwnego. Większość z nas dorastała i wychowywała się w poprzednim systemie, w którym nikomu na takiej edukacji nie zależało, a codzienne doświadczenia z pozoru wymykało się teoriom ekonomicznym. Zresztą, wracając do statystyki produktu krajowego, wiedza na jej temat była zupełną fanaberią w sytuacji, gdy ceny były ustalane centralnie, a statystyki państwowe służyły machinie propagandy. W zeszłym tygodniu okazało się, że niestety próbuje się znowu zaprzęć dane statystyczne do szerzenia jedynej słusznej linii. Jeszcze wówczas kandydatka na premiera, p. Beata Szydło podnosiła, że statystykami garnka się nie napełni. Co prawda ówczesna premier skontrowała, że w rządzeniu krajem czasem warto odejść od kuchni i spojrzeć szerzej, ale faktem jest, że bardzo dobre dane o wzroście gospodarczym w Polsce zupełnie nie pasowały do obrazu Polski w ruinie. Poczytny dziennik ogólnokrajowy, z mocnym działem gospodarczym, w końcu obalił mit „Zielonej wyspy”. Zrobił to w stylu pamiętnej publikacji o odkryciu śladów trotylu w wiadomym Tupolewie (notabene był to ten sam dziennik). Pisząc o stylu mam na myśli dotarcie do ciekawej informacji a następnie opublikowanie jej bez elementarnego zrozumienia sensu tej informacji i opatrzenie absurdalnym komentarzem.

Doskonale rozumiem, że koncepcja odsezonowania szeregu czasowego nie należy do kanonu wiedzy powszechnej. To nie najłatwiejsza, a czasami niezwykle skomplikowana technika statystyczna. Upraszczając zagadnienie, odsezonowanie PKB polega na wyeliminowaniu wahań wynikających z różnego poziomu aktywności gospodarczej w różnych porach roku. Na przykład zimą rolnictwo czy budownictwo wytwarzają znacznie mniej niż latem, zaś miejscowości o charakterze turystycznym słabiej wiosną i jesienią. I tak dalej. Interpretując dane statystyczne należy zachować czujność i wiedzieć co się interpretuje. W opisywanej wyżej wpadce poważnej gazety zabrakło zrozumienia, że szereg odsezonowany powstaje poprzez przetworzenie danych pierwotnych skomplikowanym modelem ilościowym ale dane wejściowe pozostają te same. Zmiana dynamik PKB kw/kw w IV kw. 2012 i I kw. 2013 z odpowiednio +0,1% do -0,3% i z +0,3% do -0,1% w szeregu odsezonowanym nie wynikała ze zmiany wartości dóbr i usług wytworzonych w tym czasie ale ze zmiany parametrów modelu służącego do wyrównywania sezonowego. Nie można wykluczyć, że kolejna weryfikacja modelu spowoduje, że rzekoma recesja zniknie. Albo pogłębi się. Nie ma to jednak większego znaczenia. W momencie publikowania tych danych szeregi odsezonowane dawały odczyty dodatnie bo tak wynikało z ówczesnego modelu.

To, co jest naprawdę ważne, to roczne zmiany PKB, które ze swojej natury są odporne na wahania sezonowe. W ich przypadku porównuje się dane z tych samych okresów czy też pór roku, jak pokazywałem w przykładzie wyżej. Tu nic się nie zmieniło. Recesja nie pojawiła się. Niestety, sensacyjny artykuł spowodował lawinę komentarzy, powiększających igłę do rozmiaru wideł. Znalazłem nawet wypowiedź doktora nauk ekonomicznych i europośla, który wyjaśnił, dlaczego dane podawane przez poprzedni rząd były nieprawdziwe i z czego wynika fakt, że PKB był niższy, niż przekonywał nas wówczas rząd Tuska. Otóż, żeby nie pozostawić żadnych wątpliwości, powtarzam, wartość PKB wytworzonego w IV kw. 2012 i I kw. 2013 nie uległa zmianie. GUS nie dokonał żadnej korekty. Pan doktor nie ma błędnego pojęcia o czym pisze.

GUS szybko zareagował na economic fiction ale temat poszedł w świat. Przypomina mi to anegdotę, w której po przyjęciu gospodarze dzwonią do jednego z gości i proszą go, aby więcej już do nich nie przychodził, bo podczas jego wizyty zginął pierścionek gospodyni. Gdy zaskoczony gość zareagował zaprzeczeniami, gospodarze odpowiedzieli: „Tak, wiemy, że nie wzięłeś tego pierścionka. Znalazł się w końcu. Ale niesmak pozostał”.