



VIII KONGRES EKONOMISTÓW POLSKICH

# **SEKTOR FINANSOWY – DYLEMATY I KIERUNKI ROZWOJU**

redakcja naukowa  
**Stanisław Rudolf**



**Polskie Towarzystwo Ekonomiczne**

Warszawa 2008

Recenzentka tomu: Monika Marcinkowska

Recenzentki serii: Zofia Dach  
Eulalia Skawińska

Redaktor naukowy: Stanisław Rudolf

Polskie Towarzystwo Ekonomiczne serdecznie dziękuje  
za wsparcie finansowe publikacji pokongresowej, którego udzielili:  
Krajowy Depozyt Papierów Wartościowych S.A.  
Bank Gospodarki Żywnościowej S.A.  
AXA Życie Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.  
AXA Powszechne Towarzystwo Emerytalne S.A.  
AXA Towarzystwo Ubezpieczeń S.A.

© Copyright by Polskie Towarzystwo Ekonomiczne  
Warszawa 2008

ISBN 978-83-88700-22-4

Polskie Towarzystwo Ekonomiczne  
00-042 Warszawa, ul. Nowy Świat 49  
tel. (+48) 022 551 54 01  
e-mail: zk@pte.pl  
www.pte.pl

Projekt okładki: TECHNET Sp. z o.o.

Łamanie, druk i oprawa  
TECHNET Sp. z o.o.  
ul. Biskupińska 3A  
30-732 Kraków

Adam P. Balcerzak\*

## PAŃSTWO DOBROBYTU W KRAJACH UNII EUROPEJSKIEJ W LATACH 1995–2005: WNIOSKI DLA POLSKI

*„Dla gospodarki nie ma bardziej fundamentalnej kwestii niż rola, jaką odgrywa w niej państwo. Jak duża powinna być rola państwa w gospodarce rynkowej? Jakie powinny być zadania państwa, a ile może pozostać w gestii rynku i decyzji obywateli? W jaki sposób państwo powinno wypełniać swoją rolę? Francuski poeta Paul Valéry pisał, że »jeśli państwo jest silne – zmiażdży nas; jeżeli słabe – zginiemy«. Nikt nie poddaje w wątpliwość faktu, że państwo musi odgrywać istotną rolę w zorganizowanym społeczeństwie, które z kolei potrzebuje rządu. Kluczowym pozostaje pytanie o zakres roli państwa. Jak zwykle problem polega na znalezieniu optymalnego poziomu interwencji państwa w gospodarce rynkowej usytuowanego pomiędzy dwiema skrajnościami: gospodarką centralnie planowaną, w której wszystkie istotne decyzje gospodarcze należały do państwa, a zalecanym przez Adama Smitha leseferyzmem, który ograniczał rolę państwa do kilku podstawowych funkcji. Znalezienie właściwej równowagi pomiędzy tymi dwiema przeciwstawnymi koncepcjami powinno stać się celem ekonomistów oraz inteligentnych decydentów”.*<sup>1</sup>

Vito Tanzi

### 1. Wprowadzenie

Efektywność działań państwa w zakresie kształtowania warunków do budowania dobrobytu społecznego jest przedmiotem permanentnej polemiki wśród ekonomistów. Zagadnienie to jest także jedną z kluczowych kwestii dyskursu politycznego. Jest to widoczne w szczególności w toku każdej kolejnej kampanii wyborczej, gdzie głównym przedmiotem kontrowersji jest zarówno zasadność, jak i praktyczna

\* Mgr – Uniwersytet Mikołaja Kopernika w Toruniu, Katedra Ekonomii.

<sup>1</sup> V. Tanzi, *Gospodarcza rola rządu w XXI wieku*, Materiały i Studia Zeszyt 204, Narodowy Bank Polski, Warszawa 2006, s. 5.

możliwość realizacji wielu zadań państwa utożsamianych z ideą „państwa dobrobytu”. Zjawiska te nie omijają także polskiego rynku politycznego. Przedmiot tej dyskusji stanowi jedną z fundamentalnych kwestii dla krajów stojących wobec wyzwania nadrobienia zaległości rozwojowych.

W przypadku Polski środowiska o preferencjach etatystycznych wskazują na dużą liberalizację życia gospodarczego w Polsce, co według nich jest głównym źródłem patologii społeczno-gospodarczych i stanowi potencjalne źródło niestabilności społecznej. Wskazują oni, że w porównaniu z pozostałymi członkami Unii Europejskiej polskie państwo zaniedbuje podstawowe zadania zapewnienia najważniejszych dóbr publicznych, czego głównym przejawem są relatywnie niskie nakłady finansowe na poszczególne dziedziny życia społecznego. Na forum publicznym środowiska te stawiają tezę, iż ograniczanie zakresu kontroli państwa nad gospodarką ma znamiona działania antyspołecznego, tym samym jest ono nie do przyjęcia z perspektywy stwarzania warunków dla budowy dobrobytu społecznego. W konsekwencji postulują oni konieczność utrzymania, a nawet powrotu do bardziej aktywnej postawy państwa w sferze gospodarczej, co zazwyczaj utożsamiane jest z realizacją zdobyczy tradycyjnego państwa dobrobytu.

Środowiska sceptyczne wobec efektywności tzw. „dużego państwa” wskazują na nadmierny zakres działań państwa charakterystyczny dla państw realizujących ideę państwa dobrobytu. Według nich prowadzi ona do nadmiernej presji państwa na życie społeczno-gospodarcze. Bezpośrednim ekonomicznym efektem tego stanu rzeczy jest osłabienie indywidualnej przedsiębiorczości, stopniowe ograniczanie stopy prywatnych inwestycji i oszczędności, narastanie patologii społecznych o charakterze moralnego hazardu i nagromadzenia zjawisk poszukiwania i przechwytywania renty. W średnim i w długim okresie przekłada się to na ograniczanie wzrostu gospodarczego, co stanowi zagrożenie dla dobrobytu społecznego. W przypadku krajów posocjalistycznych zmagających się z koniecznością odbudowy efektywnego systemu instytucjonalnego utrzymująca się onnipotencja państwa może przyczyniać się do hamowania procesu budowy społeczeństwa obywatelskiego. Zjawisko to także stanowi istotny hamulec instytucjonalny modernizacji kraju.

W przypadku krajów o relatywnie niskim poziomie PKB per capita cechą tego dyskursu jest częste ignorowanie poziomu rozwoju gospodarczego oraz pomijanie faktu, że kluczową kwestią polityki ekonomicznej takich krajów jest stworzenie jak najlepszych warunków dla szybkiej konwergencji gospodarczej. W polskim dyskursie, typowym dla rynku politycznego, powszechną praktyką środowisk proetatystycznych jest żądanie przekazywania przez państwo określonej części PKB na wskazane cele społeczne, gdzie jako punkt odniesienia przyjmuje się niemal zawsze znacznie bardziej rozwinięte gospodarczo kraje Unii Europejskiej. Poziom tej debaty jest także niezadowolający z powodu jej nadmiernej ideologizacji. Można przyjąć, że zjawisko to jest zrozumiałe w przypadku wyborczego dyskursu politycznego. Jednak w odniesieniu do polemiki naukowej fundamentalną kwestią jest wyeliminowanie takiej praktyki. Celem niniejszego artykułu jest próba skwantyfikowania zakresu

aktywności gospodarczej państwa utożsamianej z realizacją idei państwa dobrobytu w Polsce w porównaniu z pozostałymi krajami Unii Europejskiej z uwzględnieniem stopnia rozwoju gospodarczego tych krajów.

## 2. Rozwój i realizacja idei „państwa dobrobytu”

Druga połowa XX wieku była naznaczona bezprecedensowym wzrostem aktywności gospodarczej państw narodowych. W zasadzie do połowy lat trzydziestych zeszłego stulecia zarówno teoria, jak i praktyka ekonomii była zdominowana przez Smithowską ideę państwa minimalnego. Zmieniło się to diametralnie wraz z wybuchem wielkiego kryzysu lat 30., który stworzył sprzyjające warunki społeczno-polityczne do popularyzacji poglądów i postaw o charakterze etatystycznym i stał się podstawą dla przewartościowania dominującego paradygmatu w głównym nurcie ekonomii na rzecz teorii J.M. Keynesa<sup>2</sup>. Wskazywał on na konieczność odrzucenia praktyki gospodarczej typowej dla państwa o charakterze *laissez faire* i postulował przejęcie przez państwo głównej odpowiedzialności za makroekonomiczne zarządzanie gospodarką. Wielki kryzys stał się źródłem silnych argumentów wskazujących na istnienie licznych sfer działalności gospodarczej, w których możliwa jest, dotkliwa z perspektywy dobrobytu społecznego, zawodność mechanizmu rynkowego. W rezultacie zwolennicy wzrostu etatyzmu państwowego podkreślali zasadności zwiększenia aktywności państwa w celu ograniczenia tych zjawisk oraz minimalizacji ich negatywnych następstw. W konsekwencji tej zmiany teoretycznej oraz doświadczeń wielkiego kryzysu lat trzydziestych powojenna polityka gospodarcza w większości krajów została zdominowana przez zwolenników makroekonomii keynesowskiej, co przekładało się na powszechną tendencję do wzrostu aktywności gospodarczej państwa w całym zachodnim świecie. Bezpośrednim efektem tego była szybka ekspansja aktywności oraz rozmiarów państwa, co zaczęło także wiązać z umacnianiem się tendencji do realizacji idei państwa dobrobytu<sup>3</sup>.

Zmiana tego trendu na gruncie teoretycznym nastąpiła dopiero w latach 70. wraz z ekspansją monetaryzmu, a następnie rewolucją racjonalnych oczekiwań. Jednak w praktyce gospodarczej najważniejszym wyłomem w ogólnoswiatowej tendencji do wzrostu aktywności gospodarczej państwa były lata osiemdziesiąte XX wieku wraz z realizacją amerykańskiej reaganomiki oraz brytyjskiego thatcheryzmu<sup>4</sup>. W latach 90. XX wieku kraje te odnotowały niekwestionowany sukces gospodarczy, któ-

<sup>2</sup> J.M. Keynes, *Ogólna teoria zatrudnienia, procentu i pieniądza*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2003.

<sup>3</sup> V. Tanzi, L. Schuknecht, *Reconsidering the Fiscal Role of Government: The International Perspective*, „American Economic Review” 1997, Vol. 87, No. 2, s. 164–168.

<sup>4</sup> Zob. W. Bieńkowski, *Reaganomika i jej wpływ na konkurencyjność gospodarki amerykańskiej*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 1995. M. Belka, *Reaganomika. Sukces czy porażka?*, Instytut Nauk Ekonomicznych PAN, Wrocław–Warszawa–Kraków 1991.

ry został zbudowany na gruncie zmian strukturalnych przeprowadzonych w latach osiemdziesiątych. Z drugiej strony kraje, które nie były w stanie ponieść analogicznego wysiłku reformatorskiego, zmagaly się z długookresowym ograniczeniem dynamiki wzrostu. Zjawiska te doprowadziły do niemal powszechnej akceptacji poglądu, wskazującego na to, że bezrefleksyjna realizacja idei państwa dobrobytu, której główną konsekwencją jest powszechny wzrost aktywności gospodarczej państwa, może prowadzić do deformacji systemu gospodarczego oraz spadku jego międzynarodowej konkurencyjności. Tym samym zagraża ona wzrostowi gospodarczemu i budowaniu dobrobytu społecznego.

Wydaje się, że współczesny dorobek naukowy pozwala na postawienie tezy o wyłaniającym się konsensusie dotyczącym roli państwa w gospodarce oraz pożądanego zakresu realizacji filozofii państwa dobrobytu. Z jednej strony widać odrzucenie idei państwa minimalnego Adama Smitha, ale z drugiej strony coraz więcej ekonomistów podkreśla negatywne konsekwencje realizacji idei państwa dobrobytu przy pomocy powszechnej aktywizacji gospodarczej państwa. Liczna grupa ekonomistów podkreśla rosnące znaczenie państwa w budowaniu efektywnego systemu instytucjonalnego, który powinien stwarzać warunki dla niskich kosztów transakcyjnych, zapewniać ochronę praw własności, gwarantować sprawność rynków finansowych i stymulować innowacyjność gospodarki, co stanowi warunek długookresowego wzrostu gospodarczego. Z drugiej rośnie świadomość malejącej roli państwa w zakresie realizacji bezpośredniej operacyjnej kontroli nad gospodarką, co było charakterystyczne dla tradycyjnego państwa dobrobytu<sup>5</sup>. Wydaje się, że prowadzenie polityki gospodarczej uwzględniającej ten wypracowany konsensus będzie stwarzać dobre warunki dla długookresowego wzrostu gospodarczego.

Powyższa teza uzyskuje silne wsparcie empiryczne, jest więc coraz szerzej akceptowana przez ekonomistów plasowanych w głównym nurcie ekonomii. Mimo tego ograniczenie bezpośredniej aktywności gospodarczej państwa charakterystycznej dla tradycyjnie pojmowanego państwa dobrobytu jest niezwykle trudne. Świadczy o tym bardzo wysoki średni udział sektora publicznego w PKB występujący w krajach europejskich. W 2005 r. w przypadku większości krajów Europy udział dochodów rządu w PKB przekraczał 40%, a w przypadku krajów skandynawskich był nawet zbliżony do 60%<sup>6</sup>.

Tym samym w niniejszym badaniu zweryfikowano rozmiary tradycyjnie pojmowanego państwa dobrobytu charakteryzującego się jego wysokim stopniem operacyjnej aktywności gospodarczej, co ma silne odzwierciedlenie w rozmiarach sektora publicznego danego państwa oraz jego strukturze finansów publicznych.

<sup>5</sup> W. Bieńkowski, *Globalization, Integration and Government's Competitiveness Policy*, „Optimum – Studia Ekonomiczne” 2004, No. 3 (23), s. 11–25.

<sup>6</sup> *Europe in figures, Eurostat Yearbook 2006*, Office for Official Publications of the European Communities, Luksemburg 2006.

### 3. Badanie empiryczne

W przeprowadzonym badaniu empirycznym została zastosowana metoda porządkowania liniowego w celu uzyskania rankingu państw, pozwalająca ocenić, które kraje charakteryzują się największymi rozmiarami państwa dobrobytu. Metoda ta została zastosowana ze względu na jej trzy następujące zalety:

- możliwość porządkowania i grupowania heterogenicznych podmiotów ze względu na zjawiska złożone;
- matematyczną prostotę metodologii oraz jednoznaczność interpretacji wyników;
- możliwość zastosowania wykorzystanej metody do analizy dynamicznej.

Badanie zostało przeprowadzone dla 27 członków Unii Europejskiej w oparciu o dane statystyczne publikowane przez Eurostat z lat 1995–2005 r.<sup>7</sup> Pierwsza część badania została poświęcona analizie dla 15 krajów Unii Europejskiej z przed rozszerzenia z 2004 r. dla całego wspomnianego okresu. W drugiej części przeprowadzono badanie dla wszystkich aktualnych 27 członków Unii Europejskiej. Jednak ze względu na dostępność danych analiza ta została przeprowadzona tylko dla lat 2000–2005.

Pierwszym etapem analizy była selekcja zmiennych diagnostycznych ze względu na kryteria merytoryczno-formalne, które umożliwiały określenie stopnia zaawansowania poszczególnych aspektów działalności państwa wynikających z realizacji tradycyjnie pojmowanej idei państwa dobrobytu. Wśród przyjętych kryteriów zostały uwzględnione: uniwersalność i mierzalność zmiennych, dostępność i jakość danych liczbowych w kolejnych latach, ekonomiczność i interpretowalność zmiennych oraz dokonano sprawdzenia sposobu oddziaływania zmiennych<sup>8</sup>. Na tym etapie zostały wybrane następujące zmienne, które następnie oceniono ze względu na kryterium wartości informacyjnej<sup>9</sup>:

- X1 Poziom długu sektora publicznego w relacji do PKB;
- X2 Pomoc sektorowa oraz pomoc państwa ad hoc jako procent PKB;
- X3 Ogólna produkcja sektora publicznego jako procent PKB;
- X4 Podatki nałożone na produkcję oraz import jako procent PKB;
- X5 Udział wydatków sektora publicznego w PKB;
- X6 Udział dochodów sektora publicznego w PKB;
- X7 Ogólna akumulacja kapitału brutto w sektorze publicznym jako procent PKB;
- X8 Subsidia wypłacane przez rząd jako procent PKB;
- X9 Udział ogólnych finalnych wydatków konsumpcyjnych rządu w PKB;

<sup>7</sup> *Europe in figures...*, op. cit.

<sup>8</sup> Do kryteriów tych należy zaliczyć: uniwersalność i mierzalność zmiennych, dostępność i jakość danych liczbowych, ekonomiczność i interpretowalność zmiennych oraz dokonano sprawdzenia sposobu oddziaływania zmiennych. Zob. A. Zeliaś (red.), *Taksonomiczna analiza przestrzennego zróżnicowania poziomu życia w Polsce w ujęciu dynamicznym*, Wydawnictwo Akademii Ekonomicznej, Kraków 2000, s. 37–38.

<sup>9</sup> Zob. W. Ostasiewicz (red.), *Statystyczne metody analizy danych*, Wydawnictwo Akademii Ekonomicznej im. Oskara Langego, Wrocław 1998, s. 115–117, 120–121.

- X10 Wydatki socjalne (inne niż transfery socjalne służące pomocy gospodarstwom domowym w trudnej sytuacji finansowej) wypłacane przez rząd jako procent PKB;
- X11 Wskaźnik nierówności w rozkładzie dochodu szacowany jako relacja dochodu rozporządzalnego osiąganego przez najwyższy kwintal (20% populacji z najwyższym dochodem) do dochodu rozporządzalnego osiąganego przez najniższy kwintal (20% populacji z najniższym dochodem).

Badania empiryczne z ostatnich lat pozwalają na stwierdzenie, że państwa o wyższym zakresie realizacji tradycyjnie pojmowanej idei państwa dobrobytu charakteryzują się wyższą poziomem krótkookresowej i średniookresowej aktywności gospodarczej, co przekłada się na bardziej ekspansywną politykę fiskalną<sup>10</sup>. W związku z tym można przyjąć, że wzrost wartości zmiennych od X1 do X10 jest jednoznaczny z wyższym zakresem rozwoju atrybutów tradycyjnego państwa dobrobytu w danej dziedzinie. Tym samym zmienne te stanowią stymulanty<sup>11</sup>. W przypadku zmiennej X11 opisującej nierówności rozkładu dochodu przyjmuje się, że jednym z ważnych celów państwa dobrobytu jest przeciwdziałanie wzrostowi nierówności w rozkładzie dochodu. Tym samym zmienna ta stanowi destymulantę<sup>12</sup>.

Według kryterium ważności informacyjnej zmienne diagnostyczne powinny charakteryzować się dużą zmiennością przestrzenną, ważnością oraz niską korelacją. Pierwsze kryterium oznacza, że zmienne nie powinny być do siebie podobne pod względem informacji o obiektach. Zmienność przestrzenna cech może być oceniona przy wykorzystaniu współczynnika zmienności. Eliminuje się cechy, dla których wartość współczynnika będzie niższa od przyjętej wartości progowej. Z badania zostały wyeliminowane zmienne, dla których wartość współczynnika zmienności była niższa bądź równa 10%. Zmienne spełniają kryterium ważności, jeżeli trudno osiągać wysokie wartości. Do oceny tego stosuje się współczynnik asymetrii, który dla cech ważnych jest dodatni. W przypadku rozkładu cechy lewostronnie asymetrycznego można mówić o niskim różnicowaniu badanych obiektów przez daną cechę, ponieważ większość obiektów łatwo osiąga wysoki stopień nasycenia. Silna korelacja między wykorzystanymi zmiennymi diagnostycznymi jest niepożądana, gdyż oznacza to powtarzanie się informacji. W takiej sytuacji sporządzany jest wybór zmiennych reprezentantek. W badaniu jako progowy poziom współczynnika korelacji przyjęto  $r = 0,8$ .

<sup>10</sup> W. Rutkowski, *Państwo dobrobytu a efektywność gospodarcza*, „*Ekonomista*” 2006, nr 3.

<sup>11</sup> Zmienną jest stymulantą, jeśli dla każdych dwóch jej wartości  $x_{ij}, x_{jk}$  odnoszących się do obiektów  $A_i, A_k$  zachodzi  $x_{ij} > x_{jk} \Rightarrow A_i > A_k$  przy czym  $>$  oznacza, że obiekt  $A_i$  jest preferowany nad  $A_k$ . Natomiast zmienną nazywamy destymulantą, jeśli dla każdych dwóch jej wartości  $x_{ij}, x_{jk}$  odnoszących się do obiektów  $A_i, A_k$  zachodzi  $x_{ij} > x_{jk} \Rightarrow A_i < A_k$  przy czym  $<$  oznacza, że obiekt  $A_k$  jest preferowany nad  $A_i$ . M. Waleśiak *Uogólniona miara odległości w statystycznej analizie wielowymiarowej*, Wydawnictwo Akademii Ekonomicznej im. Oskara Langego, Wrocław 2002, s. 16–19.

<sup>12</sup> Zmienną jest destymulantą, jeżeli dla każdych dwóch jej wartości  $x_{ij}^D, x_{jk}^D$  odnoszących się do obiektów  $A_i, A_k$  zachodzi  $x_{ij}^D > x_{jk}^D \Rightarrow A_i < A_k$ , gdzie  $<$  oznacza, że obiekt  $A_k$  jest preferowany nad  $A_i$ . *Ibidem*, s. 16.

W przypadku badania w ujęciu dynamicznym zbiory wybranych zmiennych dla poszczególnych lat mogą różnić się od siebie. Ostateczny wybór zmiennych diagnostycznych został dokonany w oparciu o częstotliwość ich pojawiania się w zbiorach wybranych cech dla całego przyjętego okresu<sup>13</sup>.

Spośród powyższych zmiennych powyższe kryteria wartości informacyjnej wypełniły następujące zmienne: X1, X2, X4, X8, X9, X11, które ostatecznie zostały wykorzystane w badaniu empirycznym.

Następnie doprowadzono powyższe zmienne do porównywalności przy pomocy procedury normalizacji wykorzystującej średnią arytmetyczną i odchylenie standardowe. Dzięki temu uzyskano zmienne o średniej równej 0 i wariancji równej 1. Dla zmiennych będących stymulantami zastosowano formułę 1:

$$x_{ij} := \frac{x_{ij} - \bar{x}_j}{s_j} \quad (1)$$

gdzie:

$x_{ij}$  – wartość  $j$ -tej zmiennej dla  $i$ -tego obiektu,  
 $\bar{x}_j$  – średnia arytmetyczna  $j$ -tej zmiennej,  
 $s_j$  – odchylenie standardowe  $j$ -tej zmiennej.

Dla zmiennych będących destymulantami w procesie normalizacji wykorzystano formułę 2:

$$x_{ij} := \frac{\bar{x}_j - x_{ij}}{s_j} \quad (2)$$

gdzie:

$x_{ij}$  – wartość  $j$ -tej zmiennej dla  $i$ -tego obiektu,  
 $\bar{x}_j$  – średnia arytmetyczna  $j$ -tej zmiennej,  
 $s_j$  – odchylenie standardowe  $j$ -tej zmiennej.

Kolejnym krokiem badania było uporządkowanie badanych obiektów ze względu na przyjęty zestaw cech. W przypadku przeprowadzonego badania została wykorzystana metoda wzorca rozwoju<sup>14</sup>. W metodzie tej wyznacza się zmienną syntetyczną będącą odległością badanych obiektów od abstrakcyjnego obiektu  $z_0 = [z_{01}, z_{02}, \dots, z_{0p}]$ , który w przypadku stymulant obejmuje najwyższe wartości zmiennych i stąd nazwany jest także górnym biegunem rozwoju.

Współrzędne wzorca wyznaczone są w oparciu o następującą procedurę (3) i (4):

$$x_{0j} = \max_i x_{ij} \quad \text{dla} \quad j \in S \quad (3)$$

<sup>13</sup> A. Zeliaś (red.), *Taksonomiczna analiza...*, op. cit., s. 133.

<sup>14</sup> Zob. W. Ostasiewicz (red.), *Statystyczne metody analizy danych*, Wydawnictwo Akademii Ekonomicznej im. Oskara Langego, Wrocław 1998, s. 88–96.

gdzie  $S$  oznacza zestandaryzowany zbiór stymulant.

$$x_{0j} = \min_i x_{ij} \text{ dla } j \in D \quad (4)$$

gdzie  $S$  oznacza zestandaryzowany zbiór destymulant.

Analogicznie współrzędne antywzorca wyznacza się następująco:

$$x_{1j} = \min_i x_{ij} \text{ dla } j \in S \quad (5)$$

$$x_{1j} = \min_i x_{ij} \text{ dla } j \in D \quad (6)$$

Odległość poszczególnych obiektów od wzorca wyznaczana jest według wzoru (7):

$$d_{i0} = \sqrt{\sum_{j=1}^p (x_{ij} - x_{0j})^2} \quad i = 1, 2, \dots, n; \quad j = 1, 2, \dots, p \quad (7)$$

Miara rozwoju powstaje w wyniku przekształcenia zmiennej syntetycznej według formuły (8):

$$d_i = 1 - \frac{d_{i0}}{d_0}, \quad (8)$$

gdzie  $d_0 = \bar{d}_0 + 2S_d$ , a  $\bar{d}_0$  i  $2S_d$  to odpowiednio średnia arytmetyczna i odchylenie standardowe zmiennej  $d_{i0}$  wyznaczane ze wzorów (9) i (10):

$$\bar{d}_0 = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^n d_{i0} \quad (9)$$

$$S_d = \sqrt{\frac{1}{n} \sum_{i=1}^n (d_{i0} - \bar{d}_0)^2} \quad (10).$$

W efekcie zastosowania powyższej metody uzyskuje się miernik, który z prawdopodobieństwem bliskim jedności przyjmuje wartości z przedziału  $[0;1]$ . Im wartość uzyskanego miernika jest bliższa 1, tym dany obiekt jest bardziej podobny do obiektu-wzorca. Należy jednak wskazać, że prezentowana miara rozwoju może przyjąć wartości ujemne, co oznacza, że badany obiekt jest zdecydowanie gorszy od pozostałych pod względem stopnia rozwoju analizowanego zjawiska złożonego<sup>15</sup>.

<sup>15</sup> Ibidem.

Wyniki przeprowadzonego badania: miarę rozwoju państwa dobrobytu oraz ranking dla 15 krajów tzw. starej Unii Europejskiej dla lat 1995–2005 przedstawione zostały na wykresie 1 i w tabeli 1, natomiast wyniki dla aktualnych 27 członków Unii dla lat 2000–2005 przedstawia wykres 2 i tabela 2. Uzyskane rankingi porządkują kraje Europy pod względem zakresu realizacji idei tradycyjnie rozumianego państwa dobrobytu w kolejności od kraju o najwyższym jego zakresie do kraju o najniższym zakresie aktywności państwa na tym polu.

#### 4. Wnioski

Wyniki zaprezentowane w tabeli 1 oraz na wykresie 1 pokazują względną stabilność w czasie rankingu zakresu zaawansowania państwa dobrobytu w krajach europejskich. Potwierdza to, iż mimo że w ostatnich latach znaleziono wiele dowodów empirycznych potwierdzających nieefektywność wysokiej aktywności gospodarczej państwa typowej dla tradycyjnego państwa dobrobytu, ograniczenie jej stanowi bardzo duże wyzwanie społeczno-polityczne.

W przypadku analizowanej piętnastki najbardziej rozwiniętych krajów Unii Europejskiej szczególnie przypadek w tej kwestii stanowiła gospodarka Irlandii. Irlandia w ostatnich dekadach dokonała bardzo dużego wysiłku w dziedzinie reform strukturalnych zmierzających do ograniczenia zakresu aktywności gospodarczej państwa. W rezultacie tego kraj ten przesunął się z siódmej pozycji w roku 1995 na pozycję 14 od roku 1998. Mniejszy zakres rozwoju państwa dobrobytu odnotowano tylko w Luksemburgu, który jednak ze względu na swoje rozmiary i warunki społeczne stanowi wyjątkowy i nieporównywalny przypadek. Na podkreślenie zasługuje także fakt, że w relacji do pozostałych krajów piętnastki w kolejnych latach Irlandia w dalszym ciągu ograniczała zakres aktywności gospodarczej typowy dla państwa dobrobytu. Należy przy tym podkreślić, że kraj ten stanowi przykład największego sukcesu pod względem nadrobienia dużych zaległości gospodarczych oraz pełnego wykorzystania potencjału, jaki gwarantowała integracja ze strukturami gospodarki europejskiej.

W przypadku analizowanego rankingu sporym zaskoczeniem mogą być pozycje osiągane przez kraje skandynawskie, a w szczególności Finlandię, które tradycyjnie traktowane są jako kolebka idei państwa dobrobytu. Tymczasem w badaniu tym Finlandia uplasowała się w kolejnych latach pod koniec pierwszej dziesiątki, a w przypadku Danii i Szwecji w ostatnich latach prowadzonego badania widać wysiłki w kierunku ograniczenia zakresu państwa dobrobytu. Może to wskazywać, że nawet w krajach, w których idea państwa dobrobytu jest bardzo głęboko zakorzeniona w świadomości społecznej, następuje stopniowe odchodzenie od tradycyjnej wysokiej aktywności gospodarczej państwa prowadzonej głównie przy pomocy narzędzi fiskalnych.

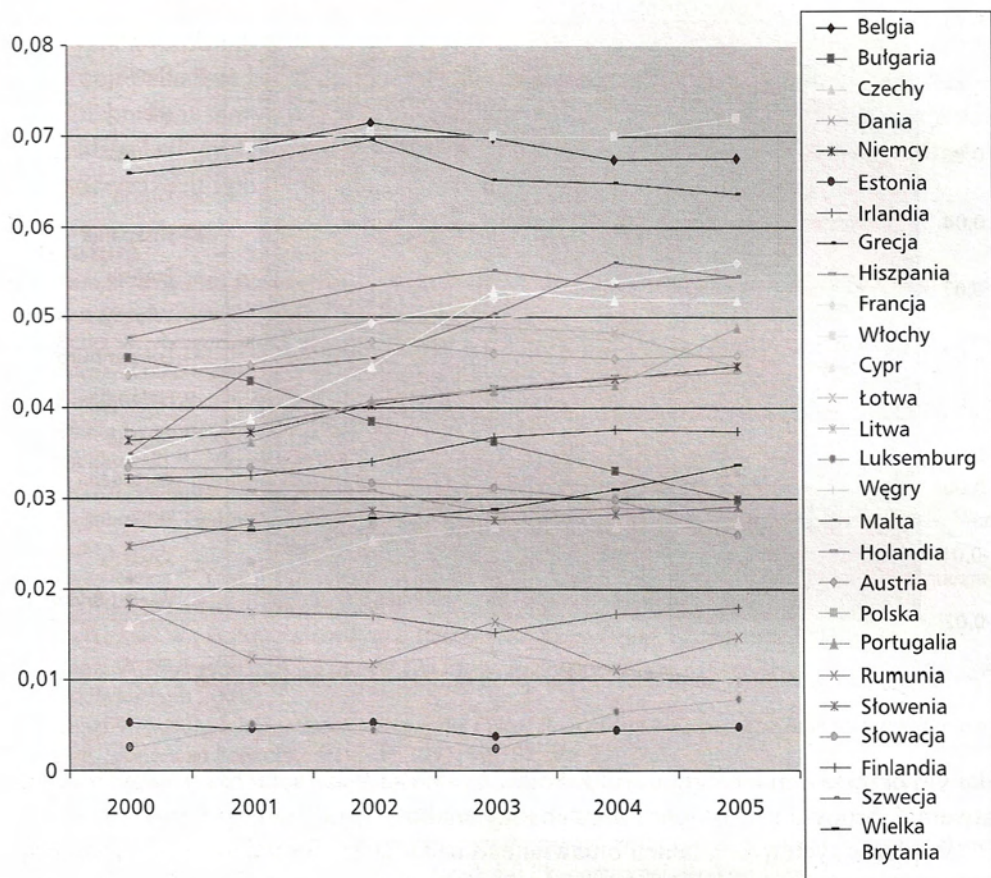
W przypadku drugiego rankingu zaprezentowanego w tabeli 2 i na wykresie 2 obejmującego także tzw. nowych członków Unii Europejskiej na szczególną uwagę zasługują państwa nadbałtyckie na czele z Estonią, która uplasowała się na końcu

**Tabela 1.** Taksonomiczna miara rozwoju państwa dobrobytu w krajach Unii Europejskiej dla 15 starych krajów Unii Europejskiej w latach 1995–2005

|                 | 1995    |         | 1996    |         | 1997    |         | 1998    |         | 1999    |         | 2000    |         | 2001    |         | 2002    |         | 2003    |         | 2004    |         | 2005    |         |
|-----------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
|                 | miara   | pozycja | miara   | pozycja | miara   | pozycja | miara   | pozycja | miara   | pozycja | miara   | pozycja | miara   | pozycja | miara   | pozycja | miara   | pozycja | miara   | pozycja | miara   | pozycja |
| Belgia          | 0,0559  | 1       | 0,0574  | 1       | 0,0590  | 1       | 0,0613  | 1       | 0,0626  | 1       | 0,0607  | 2       | 0,0603  | 2       | 0,0620  | 1       | 0,0615  | 2       | 0,0577  | 2       | 0,0574  | 2       |
| Dania           | 0,0365  | 5       | 0,0363  | 5       | 0,0375  | 5       | 0,0407  | 5       | 0,0418  | 5       | 0,0404  | 5       | 0,0391  | 5       | 0,0410  | 5       | 0,0406  | 6       | 0,0389  | 6       | 0,0342  | 9       |
| Niemcy          | 0,0194  | 12      | 0,0214  | 13      | 0,0235  | 10      | 0,0268  | 9       | 0,0295  | 9       | 0,0304  | 9       | 0,0303  | 9       | 0,0326  | 9       | 0,0349  | 8       | 0,0337  | 8       | 0,0345  | 8       |
| Irlandia        | 0,0304  | 7       | 0,0257  | 9       | 0,0226  | 11      | 0,0191  | 14      | 0,0171  | 14      | 0,0131  | 14      | 0,0117  | 14      | 0,0108  | 14      | 0,0096  | 14      | 0,0087  | 14      | 0,0084  | 14      |
| Grecja          | 0,0402  | 3       | 0,0427  | 3       | 0,0454  | 3       | 0,0486  | 3       | 0,0526  | 3       | 0,0603  | 3       | 0,0596  | 3       | 0,0610  | 3       | 0,0586  | 3       | 0,0564  | 3       | 0,0544  | 3       |
| Hiszpania       | 0,0194  | 13      | 0,0216  | 12      | 0,0223  | 13      | 0,0252  | 11      | 0,0266  | 10      | 0,0269  | 11      | 0,0242  | 12      | 0,0236  | 12      | 0,0220  | 12      | 0,0197  | 13      | 0,0185  | 13      |
| Francja         | 0,0250  | 10      | 0,0276  | 8       | 0,0317  | 6       | 0,0345  | 6       | 0,0364  | 6       | 0,0374  | 7       | 0,0372  | 7       | 0,0407  | 6       | 0,0441  | 5       | 0,0446  | 4       | 0,0459  | 4       |
| Włochy          | 0,0484  | 2       | 0,0500  | 2       | 0,0531  | 2       | 0,0593  | 2       | 0,0615  | 2       | 0,0611  | 1       | 0,0608  | 1       | 0,0615  | 2       | 0,0625  | 1       | 0,0612  | 1       | 0,0623  | 1       |
| Luksemburg      | -0,0073 | 15      | -0,0073 | 15      | -0,0063 | 15      | -0,0050 | 15      | -0,0052 | 15      | -0,0024 | 15      | -0,0002 | 15      | -0,0014 | 15      | -0,0033 | 15      | -0,0024 | 15      | -0,0022 | 15      |
| Holandia        | 0,0308  | 6       | 0,0304  | 6       | 0,0304  | 7       | 0,0326  | 7       | 0,0333  | 8       | 0,0308  | 8       | 0,0303  | 8       | 0,0323  | 10      | 0,0339  | 10      | 0,0332  | 10      | 0,0332  | 10      |
| Austria         | 0,0278  | 8       | 0,0284  | 7       | 0,0286  | 8       | 0,0326  | 8       | 0,0363  | 7       | 0,0377  | 6       | 0,0378  | 6       | 0,0395  | 7       | 0,0394  | 7       | 0,0369  | 7       | 0,0364  | 7       |
| Portugalia      | 0,0216  | 11      | 0,0224  | 11      | 0,0225  | 12      | 0,0240  | 12      | 0,0264  | 11      | 0,0279  | 10      | 0,0291  | 10      | 0,0328  | 8       | 0,0346  | 9       | 0,0333  | 9       | 0,0386  | 6       |
| Finlandia       | 0,0252  | 9       | 0,0255  | 10      | 0,0263  | 9       | 0,0254  | 10      | 0,0260  | 12      | 0,0256  | 12      | 0,0250  | 11      | 0,0259  | 11      | 0,0289  | 11      | 0,0273  | 11      | 0,0263  | 11      |
| Szwecja         | 0,0371  | 4       | 0,0387  | 4       | 0,0406  | 4       | 0,0446  | 4       | 0,0459  | 4       | 0,0406  | 4       | 0,0423  | 4       | 0,0443  | 4       | 0,0464  | 4       | 0,0438  | 5       | 0,0439  | 5       |
| Wielka Brytania | 0,0179  | 14      | 0,0178  | 14      | 0,0185  | 14      | 0,0194  | 13      | 0,0199  | 13      | 0,0210  | 13      | 0,0196  | 13      | 0,0205  | 13      | 0,0216  | 13      | 0,0215  | 12      | 0,0231  | 12      |

Źródło: obliczenia własne, na podstawie *Europe in figures – Eurostat yearbook 2006*.

**Wykres 1.** Taksonomiczna miara rozwoju dla 15 tzw. „starych” krajów Unii Europejskiej w latach 1995–2005

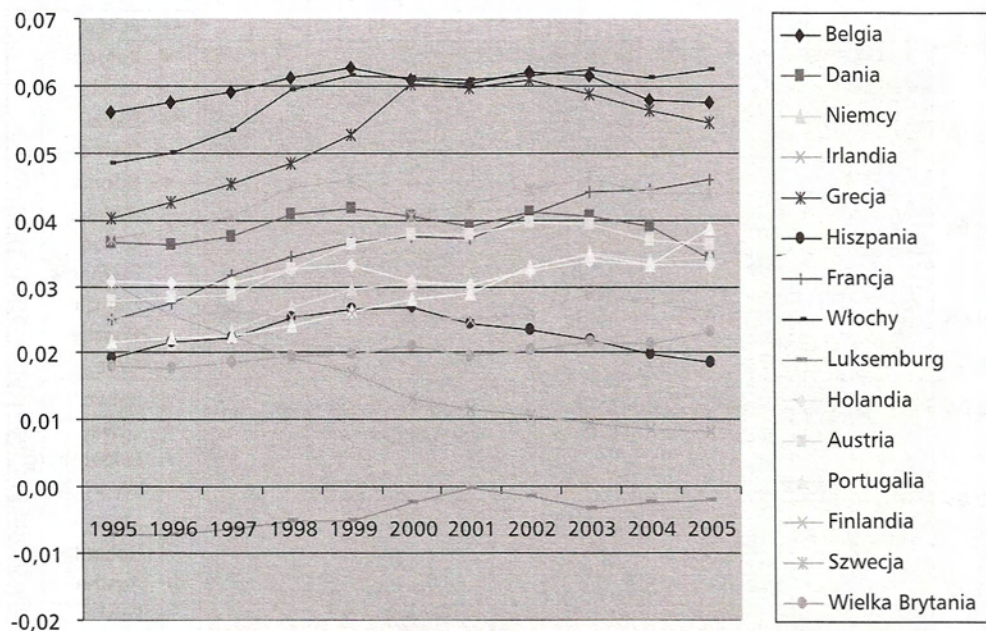


Źródło: obliczenia własne, na podstawie *Europe in figures – Eurostat yearbook 2006*.

prezentowanego zestawienia. Należy podkreślić, że kraje te mimo pojawiających się głosów o groźbie przegrzania ich gospodarek stanowią przykład wyjątkowych sukcesów pod względem korzystania z efektów konwergencji. Wyniki, zgodnie z którymi kraje nadbałtyckie corocznie plasują w końcówce omawianego rankingu, wpisują się w nurt badań empirycznych wskazujących na to, że ograniczenie zakresu aktywności gospodarczej państwa jest jednym z elementów sprzyjających podniesieniu dynamiki wzrostu gospodarczego. Kwestia ta jest szczególnie istotna w przypadku krajów stojących wobec konieczności nadrobienia wieloletnich zaległości rozwojowych.

W tym kontekście dostrzegalny jest także duży wysiłek Bułgarii, która jeszcze w 2000 r. zajmowała bardzo wysoką 6 pozycję wśród 27 krajów Unii Europejskiej, wskazującą na wysoki stopień aktywności gospodarczej państwa. Jednak w całym ba-

**Wykres 2.** Taksonomiczna miara rozwoju państwa dobrobytu dla 27 członków Unii Europejskiej w latach 2000–2005



Źródło: obliczenia własne, na podstawie *Europe in figures – Eurostat yearbook 2006*.

danym okresie kraj ten ograniczał zakres aktywności fiskalnej utożsamianych z państwem dobrobytu i w ostatnim roku analizy znalazł się już na 17 pozycji.

W pierwszych trzech latach omawianego badania Polska zajęła 20 miejsce osiągając miarę stopnia rozwoju państwa dobrobytu niewiele ustępującą znacznie bardziej rozwiniętym krajom, jak np. Wielka Brytania czy Finlandia. Ponadto w drugiej połowie analizowanego okresu można mówić o tendencji do zwiększania aktywności gospodarczej państwa, podczas gdy bezpośredni konkurenci Polski byli w stanie utrzymać względną stabilność w tym zakresie, jak to było w przypadku Czech, lub też przeprowadzili reformy skutkujące ograniczeniem tradycyjnego państwa dobrobytu, jak to było w przypadku Słowacji. Badanie to pozwala na stwierdzenie, że sugestie zwolenników większego etatyzmu, iż polskie państwo w porównaniu z wieloma krajami Unii Europejskiej zbyt mocno ograniczyło zakres swojej aktywności w życiu gospodarczym, nie mają pokrycia w faktach. Wyniki powyższej analizy wskazują raczej, że zakres wpływu polskiego państwa na procesy ekonomiczne należy do wyższych w Europie. Jest to szczególnie widoczne, jeżeli porównamy go z pozostałymi krajami będącymi na podobnym do Polski stopniu rozwoju gospodarczego i stanowiącymi najbliższych konkurentów międzynarodowych Polski zarówno w sensie geograficznym, jak i w odniesieniu do atrakcyjności inwestycyjnej.

Przeprowadzona analiza pokazuje, że sąsiednie kraje będące bezpośrednimi konkurentami Polski charakteryzują się niższymi konsekwencjami fiskalnymi związanymi z realizacją tradycyjnie pojmowanej idei państwa dobrobytu bądź ponoszą znaczny wysiłek reformatorski w kierunku ich ograniczenia. Utrzymanie zdiagnozowanej tendencji oznaczać będzie obniżanie się średnio- i długookresowej konkurencyjności Polski. Tym samym wysoki poziom aktywności fiskalnej państwa stanowi jedną z dziedzin będących najważniejszym wyzwaniem społeczno-politycznym na drodze do modernizacji i podnoszenia dobrobytu społecznego w Polsce.

## Literatura

1. *Europe in figures, Eurostat Yearbook 2006*, Office for Official Publications of the European Communities, Luksemburg 2006.
2. Belka M., *Reaganomika. Sukces czy porażka?*, Instytut Nauk Ekonomicznych PAN, Wrocław–Warszawa–Kraków 1991.
3. Bieńkowski W., *Globalization, Integration and Government's Competitiveness Policy*, Optimum – Studia Ekonomiczne 2004, No. 3 (23).
4. Bieńkowski W., *Reaganomika i jej wpływ na konkurencyjność gospodarki amerykańskiej*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 1995.
5. Keynes J.M., *Ogólna teoria zatrudnienia, procentu i pieniądza*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa 2003.
6. Ostasiewicz W. (red.), *Statystyczne metody analizy danych*, Wydawnictwo Akademii Ekonomicznej im. Oskara Langego, Wrocław 1998.
7. Rutkowski W., *Państwo dobrobytu a efektywność gospodarcza*, Ekonomista 2006, nr 3.
8. Tanzi V., *Gospodarcza rola rządu w XXI wieku*, Materiały i Studia Zeszyt 204, Narodowy Bank Polski, Warszawa 2006.
9. Tanzi V., Schuknecht L., *Reconsidering the Fiscal Role of Government: The International Perspective*, „American Economic Review” 1997, Vol. 87, No. 2.
10. Waleśiak M., *Uogólniona miara odległości w statystycznej analizie wielowymiarowej*, Wydawnictwo Akademii Ekonomicznej im. Oskara Langego, Wrocław 2002.
11. Zeliaś A. (red.), *Taksonomiczna analiza przestrzennego zróżnicowania poziomu życia w Polsce w ujęciu dynamicznym*, Wydawnictwo Akademii Ekonomicznej, Kraków 2000.

## (Streszczenie)

Rola państwa w gospodarce jest jednym z najważniejszych przedmiotów polemiki wśród ekonomistów. Dyskusja ta obraca się wokół zakresu pożądanej ekonomicznej aktywności państwa oraz zazwyczaj dotyczy wielkości tzw. „państwa dobrobytu”. Niestety ulega ona często ideologizacji i charakteryzuje się słabym zakorzenieniem w analizie empirycznej. Artykuł ten stanowi próbę częściowego wypełnienia tej luki.

Artykuł przedstawia wyniki dynamicznej taksonometrycznej analizy rozmiarów „państwa dobrobytu” w państwach członkowskich Unii Europejskiej w latach 1995–2005 z uwzględnieniem ich poziomu rozwoju gospodarczego. W przeprowadzonej analizie empirycznej wykorzystano metodę porządkowania liniowego. Celem badania było zweryfikowanie stopnia rozmiarów tradycyjnie definiowanego państwa dobrobytu w poszczególnych krajach oraz dokonanie oceny wpływu jego rozmiarów na możliwości rozwojowe tych krajów.

Szczególną uwagę poświęcono krajom, które w analizowanym dziesięcioleciu dokonały największego postępu w nadrabianiu zaległości rozwojowych. Przeprowadzone badanie empiryczne wykazało, że były to kraje o najmniejszych rozmiarach tradycyjnego państwa dobrobytu. Tymczasem Polska została zakwalifikowana do grupy krajów o najwyższych rozmiarach państwa dobrobytu w relacji do

poziomu rozwoju gospodarczego. Oznacza to, że długookresowe utrzymanie wysokiego tempa wzrostu gospodarczego, niezbędnego do ograniczenia luki rozwojowej Polski, wymaga głębokiej reformy strukturalnej naszego kraju.

### **Welfare State in European Union Countries between 1995 and 2005: Motions for Poland**

#### **(Summary)**

The role of government is one of the most important subjects of discussions among economists. This polemic tends to deal with an extent of desirable economic activity of government and it usually touches sizes of so called welfare state. Unfortunately, this discussion is often too ideological and it usually lacks sufficient empirical support. This paper aims at partial fulfilling this gap.

It presents results of dynamic taxonomic analysis of the extent of traditional welfare state in case of member countries of the European Union in the years 1995–2005. The analysis takes into consideration levels of development of the countries. In case of presented empirical investigation a procedure of linear ordering was utilized. The aim of the investigation was to measure the sizes of traditionally defined welfare state in all countries and to assess an influence of these sizes on their development dynamics.

The special attention was given to the underdeveloped countries that were able to reduce significantly their development gap to the highly developed countries. The presented investigation has proved that they were the countries with the lowest extent of traditional welfare state. However, Poland was classified to a group of countries with the biggest extent of welfare state in relation to their economic development. It means that keeping long term high level of GDP growth, which is necessary for reducing the development gap of Poland, requires a profound structural reform of our country.

**Słowa kluczowe:** analiza taksonometryczna, metoda porządkowania liniowego, nadrobienie luki rozwojowej, państwo dobrobytu, wzrost gospodarczy