

Czy w Polsce występuje efekt histerezy bezrobocia?***

Wstęp

Teoria ekonomii, w oparciu o koncepcję naturalnej stopy bezrobocia czy *NAIRU*, nie była w stanie wytłumaczyć przyczyn wysokiego i trwałego bezrobocia lat 80. XX wieku w krajach Europy Zachodniej. Nie można było również wyjaśnić różnic występujących między Europą a Stanami Zjednoczonymi (USA) w zakresie tendencji charakteryzujących bezrobocie. Pojawiła się zatem potrzeba stworzenia nowej teorii opisującej te wydarzenia – odpowiedzią na to zapotrzebowanie była koncepcja histerezy, zapożyczona z fizyki, zaproponowana przez [Blancharda i Summersa, 1986b].

Sytuacja, w jakiej znajduje się Polska, szczególnie w ostatnich latach, wykazuje pewne podobieństwa do wydarzeń, jakie miały miejsce w latach 80. ubiegłego wieku w krajach Europy Zachodniej. Mimo że proces transformacji w Polsce trwa już niemalże szesnaście lat, a wyniki gospodarcze wydają się wskazywać na to, że gospodarka się stabilizuje, stopa bezrobocia po okresie znacznego wzrostu, utrzymuje się nadal na wysokim poziomie. Nie ma wątpliwości, że jest to jeden z poważniejszych problemów społeczno-gospodarczych, z jakimi boryka się obecnie Polska.

Nad możliwością wystąpienia w Polsce histerezy bezrobocia zastanawiał się już w 1994 roku A. Wojtyła¹. Wydaje się, że w ostatnim okresie, szczególnie po roku 1998, zagadnienie to nabiera coraz większego znaczenia, potwierdzając trafność obaw A. Wojtyły. Z jednej strony stopa bezrobocia osiągnęła w 2002 roku rekordową wartość dla całego okresu transformacji 19,7% i mimo wysokiego tempa wzrostu gospodarczego notowanego w gospodarce polskiej w ostatnich latach jej spadek jest bardzo powolny (w III kwartale 2005 roku wyniosła 17,4%). Z drugiej strony badania prowadzone przez ekonomistów dotyczące szacowania stopy bezrobocia równowagi w Polsce wskazują, że po pierwsze jest ona wysoka, a po drugie, że od drugiej połowy lat 90. XX wieku następował jej wzrost.

Zasygnalizowane we wstępie argumenty wskazują, że prawdopodobne wydaje się być występowanie zjawiska histerezy bezrobocia w Polsce. Co za

* Autor jest pracownikiem Katedry Polityki Ekonomicznej Uniwersytetu Łódzkiego. Artykuł wpłynął do redakcji w lipcu 2006 r.

** Pierwotna wersja opracowania została przedstawiona na konferencji pt. *Wzrost gospodarczy, restrukturyzacja i bezrobocie w Polsce – ujęcie teoretyczne i praktyczne* zorganizowanej przez Instytut Ekonomii Uniwersytetu Łódzkiego w dniach 24-25 czerwca 2005 roku.

¹ Pytanie *Czy Polsce grozi efekt histerezy?* stanowiło tytuł artykułu opublikowanego w *Gospodarce Narodowej* [Wojtyła, 1994].

tym idzie, koncepcja histerezy może stać się przydatna w formułowaniu zaleceń co do sposobów i instrumentów wykorzystywanych do obniżania tak wysokiego i trwałego bezrobocia w polskiej gospodarce.

Niniejsze opracowanie stawia pytanie, czy w Polsce występuje efekt histerezy bezrobocia. W pierwszej części omówiono teoretyczne aspekty histerezy. Część drugą poświęcono prezentacji najnowszych teorii, które starają się wytłumaczyć przyczyny wysokiego bezrobocia w Europie. Trzecia część opisuje wyniki badań nad histerezą bezrobocia. W części czwartej zaprezentowano rozważania dotyczące możliwości wystąpienia histerezy w Polsce. W piątej części zastosowano metodę [Gordona, 1989] do statystycznej weryfikacji tej hipotezy. Ostatnia część zawiera podsumowanie i wnioski.

Histereza – zarys teoretyczny

Histereza jest słowem pochodzenia greckiego i oznacza „nadejść później”. Pojęcie histerezy związane jest przede wszystkim z naukami przyrodniczymi, a jej początki związane są z nazwiskami takich fizyków, jak Ewing i Kohlraush [Eberwein, et al., 2003]. W naukach ekonomicznych histereza znalazła zastosowanie przede wszystkim w badaniach nad problematyką zatrudnienia i bezrobocia oraz handlu międzynarodowego. [Nickell, 1993] w jednym ze swoich artykułów stwierdził, że ekonomiści, a w szczególności on, Layard i Jackman, „porwali” słowo histereza i wypaczyli jego znaczenie w stosunku do tego używanego w fizyce. Zasady histerezy na gruncie ekonomii zostały rozpoznane przez takich ekonomistów, jak Frisch, Kaldor czy Schumpeter na długo przed wzrostem zainteresowania tą tematyką w literaturze ekonomicznej lat 80. XX wieku. Istota histerezy sprowadza się do tego, że równowaga systemu nie zależy tylko od sił zewnętrznych, ale również od jego własnej historii [Wojtyna, 1994]. W odniesieniu do bezrobocia histereza oznacza, że bezrobocie będzie się utrzymywało na poziomie wywołanym przez oddziaływanie różnych impulsów nawet wówczas, gdy przestaną one występować.

Jak wskazują niektórzy autorzy, w literaturze nie ma zgodności co do jednolitej definicji histerezy. [Amable, et al., 1993] twierdzą, że ekonomiści w swoich badaniach w różny sposób rozumieją pojęcie histerezy, co za tym idzie definiują ją w różny sposób. W efekcie pojawia się brak spójności, gdyż ten sam termin jest używany dla różnych celów w obrębie tej samej dyscypliny naukowej. Niemniej autorzy wskazują, że histereza w badaniach zatrudnienia i bezrobocia rozumiana jest zazwyczaj na dwa sposoby:

- jako zależność od ścieżki, po której porusza się bezrobocie (*dependence on the path followed*), w której stan równowagi systemu uzależniony jest od ścieżki, po której system porusza się w kierunku stanu równowagi,
- jako długotrwałe efekty przejściowych działań (*permanent effects of transitory actions*), gdzie system pozostaje na ścieżce, na którą wszedł w związku z efektami zewnętrznymi, nawet jeśli ustaje oddziaływanie tych czynników.

[Blanchard i Summers, 1986b] stoją na stanowisku, że histereza powinna być rozważana tylko w przypadku, w którym występuje zależność między stanem równowagi a ścieżką dochodzenia do tego stanu. Niemniej zaznaczają, że będą traktować termin histereza w sposób bardziej obszerny, również w przypadkach, w których rzeczywista stopa bezrobocia oddziałuje na stopę bezrobocia równowagi. Tym samym zakładają, że wzrost rzeczywistej stopy bezrobocia może wpływać na podnoszenie się stopy bezrobocia w równowadze. W niniejszym opracowaniu histereza będzie rozumiana właśnie w taki sposób.

[Layard, Nickell i Jackman, 1991] wyróżniają dwa przypadki histerezy: pełną oraz częściową, utożsamianą często właśnie z uporczywością bezrobocia. Pełna histereza według ich definicji ma miejsce, jeśli poziom cen lub płac zależy od zmian w stopie bezrobocia bądź aktywności gospodarczej. Z kolei częściowa histereza oznacza, że zarówno poziom jak i zmiany w aktywności gospodarczej czy bezrobociu oddziałują na płace i ceny.

Hipoteza histerezy w badaniach nad problematyką bezrobocia wypełniła lukę teoretyczną w obliczu słabości dotychczasowej teorii ekonomii – procesy zachodzące na rynkach pracy w krajach Europy Zachodniej w latach 80. ubiegłego stulecia wskazywały na wzrost stopy bezrobocia równowagi. Dowodów na to dostarczała zarówno teoria (mimo wysokiej rzeczywistej stopy bezrobocia proces dezinflacji nie następował), jak również wyniki badań empirycznych. Teoria naturalnej stopy bezrobocia jak i *NAIRU*², oczywiście, dopuszcza możliwość ich zmian w czasie, niemniej przyczyn tych zmian upatruje się w czynnikach strukturalnych. Stanowisko takie przypisuje się grupie ekonomistów, których zwykło określać się mianem strukturalistów. Jak jednak wskazują [Blanchard i Summers, 1986a], przyczyny wzrostu stopy bezrobocia równowagi w latach 80. nie były związane z czynnikami strukturalnymi, lecz wynikały z tendencji zaistniałych w samym bezrobociu.

Histereza bezrobocia oznacza, że w krótkim okresie nie występuje jedna unikalna wartość *NSB/NAIRU*, do której gospodarka miałaby zmierzać³. Istnieje natomiast wiele stanów równowagi, których poziomy zależą od szoków, jakie oddziaływały na rzeczywiste zatrudnienie. Tego typu sytuację [Blanchard i Summers, 1988] nazywają kruchą równowagą (*fragile equilibrium*)⁴. Jeśli histereza występuje, oznacza to, że wysokość stopy bezrobocia równowagi w obecnym okresie zależy nie tylko od aktualnych czynników strukturalnych determinujących *NAIRU*, ale również od wcześniejszych tendencji w samym bezrobociu [Kwiatkowski, 2002a, s. 205]. Wynika z tego, że *NAIRU* podąża za rzeczywistą stopą bezrobocia, co można formalnie zapisać jako [Snowdon, et al., 1998, s. 341]:

² Omówienie teorii naturalnej stopy bezrobocia oraz *NAIRU* można znaleźć między innymi w: [Kwiatkowski, 2002a], [Kwiatkowski, 2002b], [Arendt, 2005].

³ Zdaniem [Layarda, et. al., 1994] histereza może występować jedynie w krótkim okresie i oznacza, że krótkookresowe *NAIRU* będą różniły się od *NAIRU* długookresowego, do którego dąży gospodarka.

⁴ W literaturze można spotkać się z opinią, że zjawisko histerezy jest niespójne z teorią naturalnej stopy bezrobocia czy *NAIRU*, gdyż kluczowe w teorii histerezy jest właśnie nieliniowe zachowanie zatrudnienia i bezrobocia oraz heterogeniczny sposób reakcji podmiotów na zakłócenia gospodarcze [Bludnik, 2004, s. 64].

$$U_{nt} - U_{nt-1} = \alpha(U_{t-1} - U_{nt-1}) \quad (1)$$

gdzie:

U_{nt} – NAIRU w okresie t ,

U_{nt-1} – NAIRU w okresie $t-1$,

U_{t-1} – rzeczywista stopa bezrobocia w okresie $t-1$.

Jeśli $U_{t-1} > U_{nt-1}$, to poziom NAIRU w okresie t będzie wyższy niż w okresie $t-1$. W sytuacji odwrotnej poziom NAIRU będzie się obniżał. Im bardziej wartość krótkookresowej stopy NAIRU jest bliższa, wartość stopy bezrobocia z poprzedniego okresu, tym histereza jest silniejsza [Cromb, 1993].

W literaturze przedmiotu wśród modeli wyjaśniających przyczyny histerezy bezrobocia najczęściej wskazuje się [Blanchard, Summers, 1986a]; [Wojtyna, 1994]; [Kwiatkowski, 2002a, s. 208-209]:

- model ubytku kapitału ludzkiego,
- model ubytku kapitału rzeczowego,
- oraz model insider-outsider⁵.

Ponadto, [Lilien, 1982] zaproponował czwarty model, w którym uporczywość bezrobocia jest rezultatem przesunięć międzysektorowych.

Model ubytku kapitału ludzkiego bazuje na założeniu, że bezrobotni tracą możliwość podtrzymywania swoich zdolności i umiejętności w okresie pozostawania bez pracy. Wydłużanie się tego okresu prowadzi w krańcowym przypadku do zaniku umiejętności oraz zniechęcenia do dalszego poszukiwania pracy, co w efekcie wpływa na redukcję efektywnej podaży pracy. Prowadzi to również do podejmowania przez długotrwale bezrobotnych decyzji „quasi-nieodwracalnych”, takich jak przechodzenie na wcześniejszą emeryturę.

W drugim modelu przyczyn histerezy bezrobocia upatruje się w ubytku kapitału rzeczowego, który następuje w wyniku negatywnych szoków oddziałujących na gospodarkę. Obniżony poziom kapitału prowadzi do spadku popytu na pracę, a tym samym do utrwalenia wysokiego poziomu bezrobocia.

Model systemu rokowań płacowych opiera się na założeniu, że zasób siły roboczej można podzielić na dwie grupy: tzw. insiderów, którzy dysponując siłą przetargową wpływają na poziom płac ustalanych w procesie negocjacji z przedsiębiorstwami oraz outsiderów, którzy nie mają wpływu na wysokość płac, gdyż nie biorą udziału w rokowaniach płacowych. W najprostszej postaci modelu do grupy insiderów zaliczają się pracownicy, natomiast grupę outsiderów stanowią bezrobotni. W tym ujęciu przyczyn braku możliwości obniżenia bezrobocia doszukuje się w sile przetargowej, jaką dysponują pracownicy zatrudnieni w przedsiębiorstwach – insiderzy.

⁵ Ze względu na ograniczony zakres opracowania zostaną zasygnalizowane wyłącznie najważniejsze cechy poszczególnych modeli. Ich szczegółowy opis można znaleźć między innymi w: [Bludnik, 2004], [Kwiatkowski, 2002a], [Wojtyna, 1994], [Blanchard, Summers, 1986a], [Blanchard, 1991], [Lindbeck, Snower, 1986], [Hargraves-Heap, 1980], [Sneessens, Dreze, 1986].

Zdaniem [Aghiona i Blancharda, 1994] ze względu na specyfikę krajów transformujących swoje gospodarki standardowe modele przyczyn histerezy mogą być nieodpowiednie dla tych krajów, co skłoniło ich do skonstruowania modelu równowagi wielopunktowej dla takich właśnie rynków pracy. Model zakłada występowanie więcej niż jednego stanu równowagi (stopy bezrobocia równowagi), uzależnionego od tego, w jaki sposób podmioty gospodarcze formułują swoje oczekiwania. Istotnym elementem mającym wpływ na stopę bezrobocia równowagi jest również szybkość i kierunek procesu restrukturyzacji gospodarki, przy czym prędkość restrukturyzacji jest ograniczona prędkością tworzenia miejsc pracy w sektorze prywatnym. Z modelu Aghiona i Blancharda płynie wniosek, że działania na rzecz przyspieszenia tworzenia miejsc pracy w sektorze prywatnym powinny, przynajmniej w początkowej fazie transformacji, dominować nad działaniami nastawionymi na przyspieszanie restrukturyzacji sektora państwowego. Zbyt wysokie tempo restrukturyzacji przedsiębiorstw państwowych może bowiem doprowadzić do wzrostu bezrobocia do poziomu, który wpłynie negatywnie na sam proces transformacji (oczywiście zbyt wolne tempo może prowadzić do takich samych rezultatów). Proces restrukturyzacji nie będzie postępował dopóki tworzone nowe miejsca pracy nie doprowadzą do obniżenia bezrobocia do niskiego poziomu. Natomiast jeśli bezrobocie jest wysokie, a na dodatek miejsca pracy w sektorze prywatnym powstają wolno, proces dostosowawczy może rozciągać się w czasie.

Hipoteza histerezy bezrobocia stanowi istotne implikacje dla polityki gospodarczej. Wskazuje bowiem na możliwości wykorzystania dobrze znanych instrumentów walki z bezrobociem przy jednoczesnym zmniejszeniu kosztów z tym związanych, wzmacniając ogólnie rzecz biorąc argumenty na rzecz bardziej aktywnej polityki gospodarczej [Wojtyna, 1994]. Jak wynika z hipotezy histerezy rosnąca rzeczywista stopa bezrobocia „pociąga” za sobą również stopę bezrobocia równowagi (por. równanie 1). Mechanizm ten działa również w przeciwnym kierunku. Zastosowanie przykładowo ekspansywnej polityki gospodarczej, które doprowadzi do spadku stopy bezrobocia wpłynie również na spadek *NAIRU*. Takie samo działanie na gruncie teorii *NSB/NAIRU* skutkowałoby wyłącznie przyspieszeniem procesów inflacyjnych, gdyż przy innych realnych warunkach niezmiennych stopa *NAIRU* pozostałaby na stałym poziomie. Nie można oczywiście odczytywać tego typu rozważań jako argumentu na rzecz nieograniczonego stosowania polityki pobudzania popytu agregatowego. [Brainard i Cutler, 1993] stoją na stanowisku, że zarówno polityka pieniężna jak i fiskalna nastawiona na stymulowanie popytu nie jest odpowiednim środkiem na wysokie bezrobocie. Według nich istnieje potrzeba prowadzenia polityki propodażowej nastawionej na ułatwianie przepływu zwalnianych pracowników między sektorami gospodarki. [Blanchard i Summers, 1986a] twierdzą, że ich model rokowań płacowych wyjaśniający przyczyny występowania histerezy bezrobocia wskazuje również, że polityka pobudzania popytu może mieć długotrwały wpływ na poziom bezrobocia. Według nich szoki popytowe indukowane za pomocą tego typu polityki mogą obniżać bezrobocie bez względu na źródło pierwotnego szoku, który doprowadził do wzrostu stopy bezrobocia. Analogiczne efekty mogą

zostać uzyskane dzięki pozytywnym szokom podażowym. Jednocześnie autorzy zastrzegają, że pozytywne efekty prowadzonej polityki mogą mieć miejsce tylko, jeśli podmioty gospodarcze nie będą w stanie przewidzieć posunięć polityków gospodarczych, czyli że polityka ta nie będzie antycypowana. Również [Lindbeck i Snower, 1988] twierdzą, że zarówno polityka popytowa jak i podażowa mogą oddziaływać długookresowo na poziom zatrudnienia, niemniej wskazują, że stymulowanie popytu na rynku dóbr i usług może być mniej efektywne i bardziej skomplikowane niż wynika to z tradycyjnego ujęcia keynesowskiego. Przede wszystkim, aby polityka pobudzania popytu agregatowego mogła mieć wpływ na zwiększenie zatrudnienia musi być spełniony podstawowy warunek – w gospodarce muszą występować niewykorzystane moce produkcyjne. Oddziaływanie tego typu polityki może zostać wzmocnione poprzez działania nastawione na usuwanie barier wejścia na rynek dla nowych przedsiębiorstw. Poza tym istotna z punktu widzenia redukcji bezrobocia jest struktura wydatków budżetowych. Jak wskazują autorzy lepsze efekty długookresowe zostaną osiągnięte, jeśli zwiększone wydatki publiczne zostaną przeznaczone na inwestycje w infrastrukturę a nie na pokrycie bieżących potrzeb konsumpcyjnych. Konkludując – polityka pobudzania popytu agregatowego, która oddziałuje na stronę podażową gospodarki powinna przynosić lepsze efekty w zakresie wzrostu zatrudnienia.

Przyczyny wysokiego bezrobocia w krajach europejskich

[Blanchard, 1997] stwierdził, że jego wiara w teorię pełnej histerezy zmalała, niemniej podkreślił, że nadal uważa, iż istnieją dowody wskazujące na występowanie upórcożywości bezrobocia. Również [Krugman, 1994] wskazuje, że hipoteza histerezy jest intelektualnie interesująca, niemniej wydaje mu się, że jest ona skuteczna w wyjaśnieniu minionych okresów wysokiego bezrobocia, przykładowo z czasów Wielkiego Kryzysu, natomiast jej przydatność do opisu obecnej sytuacji, nawet w krajach europejskich, jest niejasna, gdyż brakuje dowodów empirycznych na jej istnienie. Z tego powodu pojawiają się nowe modele teoretyczne tłumaczące przyczyny wysokiego bezrobocia w krajach Europy Zachodniej.

Ciekawą propozycję w tym zakresie wysunął [Minford, 2005]. Jego model nawiązuje do teorii histerezy bezrobocia, przy czym koncepcja ta zakłada występowanie w gospodarkach trzech poziomów stopy bezrobocia równowagi: niskiego i wysokiego, które są stabilne oraz niestabilnego poziomu pośredniego. Mechanizm funkcjonowania takiego modelu jest następujący: negatywny szok prowadzi do nasilenia żądań pracowników dotyczących zwiększenia zakresu ochrony rynku pracy, czego efektem jest pogorszenie sytuacji na tym rynku co nakręca spiralę kolejnych żądań itd. Proces zakończy się, kiedy bezrobocie ustali się na nowym, wysokim poziomie równowagi. Kolejny szok negatywny może wytrącić rynek pracy z równowagi – jeśli jest on wystarczająco silny będzie skutkował w zmianie nastawienia społeczeństwa i zażądaniu wprowadzenia reform polegających na zmniejszeniu protekcjonizmu na rynku pracy,

które to reformy ostatecznie doprowadzą do spadku bezrobocia do pierwotnego poziomu równowagi.

[Minford, 2005] testując swój model teoretyczny dla 12 krajów OECD uzyskał wynik mówiący, że wszystkie kraje europejskie poddane analizie wykazały się tendencją do poruszania między niskim i wysokim poziomem bezrobocia równowagi. Jedynie Stany Zjednoczone odpowiadały modelowi z jedną równowagą, chociaż rezultat ten nie był jednoznaczny. Zdaniem Minforda różnica między krajami europejskimi a USA wynika z różnic w elastyczności żądań socjalnych w reakcji na szoki – obywatele Stanów Zjednoczonych są raczej przeciwni interwencjom państwa w rynek pracy, co jest wynikiem ich głębokiej wiary w sprawne funkcjonowanie gospodarki rynkowej. Działania mające na celu przeciwdziałanie występowaniu w krajach europejskich wysokiego bezrobocia (tożsamego w modelem potrójnej równowagi) powinny opierać się na położeniu nacisku na edukację ekonomiczną obywateli. Skoro społeczeństwa nauczyły się, że nieracjonalne jest, poprzez swoje żądania doprowadzić do wzrostu inflacji, te same efekty można osiągnąć w zakresie rynku pracy. Taki proces uczenia się następuje, ale niestety jest to uczenie się na błędach – dobra atmosfera do wprowadzania reform pojawia się bowiem zazwyczaj w okresie, w którym gospodarka osiągnęła wysoki poziom bezrobocia równowagi.

[Jackman, 1998] wskazuje, że popularnym sposobem wytłumaczenia wysokiego bezrobocia w krajach europejskich jest powiązanie sytuacji rynku pracy nie z recesjami gospodarczymi, ale ze zmianami technologicznymi. Coraz większe zastosowanie technologii informacyjnych i telekomunikacyjnych (ICT – Information and Communication Technologies) powoduje wzrost wydajności wykształconych pracowników, którzy posiadają umiejętność obsługi komputera oraz spadek wydajności pracowników gorzej wykształconych. Jeśli wzrost popytu na wysoko wykształconą siłę roboczą nie jest zaspokajany przez podaż pracy, wtedy powinno dojść do relatywnego wzrostu płac w tym segmencie rynku. Jednak, jak wskazują dane, tego typu mechanizm w Europie nie wystąpił.

Zdaniem [Jackmana, 1998] sytuację w Europie może dobrze opisywać model „sklerozy” bezrobocia⁶, w którym zakłada się, że rząd dysponuje instrumentami mogącymi poprawić sytuację pracowników (mogą to być rozwiązania dotyczące płacy minimalnej, zwiększające bezpieczeństwo zatrudnienia, siłę związków zawodowych, itp.). Użycie tych instrumentów w krótkim okresie może przełożyć się na redukcję bezrobocia, niemniej w długim okresie najprawdopodobniej będzie skutkowało jego wzrostem. Formalnie, stopa bezrobocia w modelu dana jest wzorem:

⁶ [Balakrishnan i Michelacci, 2001] używając metodologii SVAR i posługując się kwartalnymi danymi z lat 1972-1989 dla USA, Wielkiej Brytanii, Francji, Niemiec i Hiszpanii analizowali, czy różnice w bezrobociu między Stanami Zjednoczonymi a Europą wynikają z różnic w szokach czy też z reakcji na nie. Wyniki wykazały, że gospodarka Stanów Zjednoczonych szybciej dostosowywała się do szoków, a kraje europejskie może charakteryzować „skleroza” w ujęciu dynamicznym, nawet jeśli przepływy na rynku pracy w stanie równowagi wydają się być znaczne. Również [Leon-Ledesma, 2002b] wskazuje, że europejskie rynki pracy dostosowują się znacznie wolniej do szoków niż rynek USA.

$$u_t = u_{nt} - s_t + as_{t-1} \quad (2)$$

gdzie s oznacza instrumenty wykorzystanie przez rząd do prowadzenia polityki.

Równanie (2) implikuje, że instrument wprowadzony w okresie t spowoduje natychmiastowy spadek stopy bezrobocia, natomiast jego oddziaływanie w dłuższej perspektywie jest uzależnione od wartości parametru a . Jeśli $a < 1$ to, przy danej funkcji reakcji polityki, model zbiega do stabilnego stanu równowagi. Natomiast przypadek, w którym $a > 1$ oznacza występowanie „sklerozy” i długookresowym efektem netto wprowadzenia instrumentu poprawiającego sytuację pracowników jest wzrost bezrobocia. W takim przypadku otrzymuje się dynamiczny układ równań dla u i s , na podstawie których można analizować efekty potencjalnych decyzji politycznych. Jeśli lekarstwem na wzrost bezrobocia będzie dalsze zwiększanie zakresu interwencji, to gospodarka znajdzie się w błędnym kole wzrostu bezrobocia i interwencji na rynku pracy. Oczywiście taka sytuacja nie może trwać w nieskończoność, co oznacza, że w którymś momencie rząd musi podjąć alternatywną decyzję: czy stabilizować poziom interwencji czy też wprowadzić reformę i go obniżyć. Rozwiązanie pierwsze, zgodnie z przewidywaniem modelu, doprowadzi do stabilizacji stopy bezrobocia na stosunkowo wysokim poziomie, podczas gdy rozwiązanie drugie będzie skutkowało spadkiem bezrobocia w okresie długim, przy czym początkowo stopa bezrobocia wzrośnie.

Jak przewiduje [Jackman, 1998], ze względu na koszty, jakie pociąga za sobą ingerowanie w rynek pracy, kraje europejskie będą zmuszone do ustabilizowania poziomu interwencji. Niemniej twierdzi, że działania rządów w przeszłości tak osłabiły siły rynkowe, że Europa skazana jest na wysokie bezrobocie. W innym swoim artykule [Jackman, 2002], analizując determinanty bezrobocia w krajach europejskich, doszedł do wniosku, że przyczyny związane są z popytową, a nie podaźową stroną gospodarki. Jego zdaniem na europejskich rynkach pracy po prostu brakuje możliwości znalezienia zatrudnienia, gdyż rządy państw zamiast wspierać tworzenie nowych miejsc pracy, poprzez redukcję barier przedsiębiorczości (w formie zmniejszania pozapłacowych kosztów pracy, czy tworzenia prawa ułatwiającego rozpoczynanie działalności gospodarczej) stosowały politykę protekcji miejsc pracy już istniejących. Stąd, zdaniem autora, aktywna polityka rynku pracy nie rozwiąże problemu bezrobocia w tych krajach, gdyż nie likwiduje jego przyczyn.

Natomiast zdaniem [Blancharda, 2005] reformy rynku w krajach europejskich są wymuszane przez proces deregulacji⁷ rynku dóbr i rynku finansowego, a fakt, że jest on kierowany przez Komisję Europejską zwiększa prawdopodobieństwo odniesienia sukcesu. Wiele krajów europejskich w latach 90. XX wieku stosowało strategię „wzrostu tworzącego miejsca pracy”, co oznaczało, że rządy wywierały presję na przedsiębiorstwa, aby te utrzymywały dotychczasowy poziom zatrudnienia i minimalizowały liczbę zwolnień, co *de facto*

⁷ Blanchard pod pojęciem deregulacji rozumie lepszą regulację.

ograniczało wzrost produktywności. Stąd autor stawia tezę, że wraz ze wzrostem poziomu produkcji w Europie powinna również rosnać produktywność. Z kolei większa konkurencja na rynku dóbr, będąca efektem deregulacji, doprowadzi do wzrostu płac realnych i prawdopodobnie do spadku bezrobocia. Wstępne wyniki badań Blancharda wskazują, że deregulacja może częściowo tłumaczyć wcześniejszy wzrost i niedawny spadek bezrobocia w krajach europejskich. Ostatecznie Blanchard konkluduje, że Europa będzie kontynuowała proces reform w kierunku bardziej efektywnego modelu europejskiego charakteryzującego się wysokim, w porównaniu do Stanów Zjednoczonych, poziomem ochrony socjalnej, a zmiana w kierunku modelu amerykańskiego raczej nie jest możliwa. Działania podejmowane przez rządy krajów europejskich nastawione są raczej na reformowanie instytucji rynku pracy tak, aby uczynić je bardziej wydajnymi, dzięki czemu ograniczone zostaną koszty zniekształceń systemu zabezpieczenia społecznego⁸.

Z kolei [Baker i Schmidt, 1999] twierdzą, że wysoki poziom bezrobocia w Europie jest wynikiem polityki makroekonomicznej nastawionej na ograniczenie popytu globalnego, której skutki poprzez efekt *spill over* są transmitowane do innych krajów. Zdaniem autorów restrykcyjna polityka fiskalna i pieniężna prowadzona w krajach europejskich oddziaływała bezpośrednio na ich PKB i zatrudnienie, jak i w sposób pośredni, ze względu na znaczny stopień integracji rynków, wpływała na te wielkości w innych krajach. Oddziaływanie pośrednie zachodziło poprzez kanał rynku produktów, rynek kapitałowy i walutowy. Z tego powodu [Baker i Schmidt, 1999] stoją na stanowisku, że sytuacja gospodarcza w krajach, będących głównymi partnerami w handlu zagranicznym, ma duże znaczenie dla kondycji i poziomu zatrudnienia w danym kraju, a ignorowanie efektu *spill over* powoduje, że nie dostrzega się jednego z podstawowych czynników determinujących wysokość krajowych stóp bezrobocia.

Histereza bezrobocia – wyniki badań

Analiza wyników badań zagranicznych, dotyczących problematyki histerezy bezrobocia nie pozwala na udzielenie jednoznacznej odpowiedzi na pytanie, czy mamy do czynienia z tym zjawiskiem w Europie, na co uwagę zwracał [Krugman, 1994]. Wyniki te jednomyślnie potwierdzają brak histerezy w Stanach Zjednoczonych, natomiast w przypadku krajów europejskich są one niejasne⁹.

[Jacobson, et. al., 1997] na podstawie danych kwartalnych dla Danii (1971-1990), Norwegii (1967-1990) i Szwecji (1965-1990) wykazali, że jedynym wspólnym źródłem histerezy w krajach skandynawskich są szoki oddziałujące na proces ustalania płac. Zdaniem autorów tylko szoki podażowe lub struk-

⁸ Jak wskazuje Blanchard istnieją przykłady krajów w Europie – chociażby Holandii czy Szwecji, które pokazują, że jest możliwe utrzymanie niskiego poziomu bezrobocia przy równoczesnym zapewnieniu szerokiego zakresu opieki socjalnej.

⁹ Omówienie wyników kilku innych badań nie prezentowanych w niniejszym opracowaniu zawarte są w: [Johansen, 2002], [McDonald, 2002].

turalne, takie jak zmiany w technologii, podaży pracy lub w mechanizmie negocjacji płacowych powodują permanentne zmiany w bezrobociu, podczas gdy szoki popytowe, wynikające z cykliczności gospodarki mają jedynie skutki przejściowe. Wyniki empiryczne ich badań potwierdziły teoretyczne założenia modelu, a autorzy wyciągnęli wniosek, że bezrobocie wydaje się zależeć w długim okresie od zmian technologicznych i tych zachodzących po stronie podaży pracy. Natomiast stwierdzili, że w przeciwieństwie do modeli teoretycznych, brak jest empirycznego dowodu na to, że przejściowe szoki popytowe oddziałują na uporczywość bezrobocia.

Również [Leon-Ledesma, 2002a] uzyskał wynik wskazujący na występowanie histerezy bezrobocia – wykorzystując prosty model insider-outsider, na podstawie kwartalnych danych dla 12 krajów OECD¹⁰ stwierdził brak histerezy w Australii, Danii, Portugalii i USA, natomiast w pozostałych przypadkach właściwości statystyczne modelu nie pozwoliły mu odrzucić hipotezy o istnieniu histerezy. W kolejnym swoim artykule [Leon-Ledesma, 2002b] analizując bezrobocie z poszczególnych stanach USA oraz 12 krajach Unii Europejskiej (z wyłączeniem Luksemburga, Grecji i Danii z UE15) stwierdził brak histerezy w USA, natomiast jej występowanie w UE.

Natomiast [Camarero, et. al., 2006] twierdzą, że przeważające w literaturze dowody empiryczne na występowanie histerezy bezrobocia wynikają ze słabości testów wykorzystywanych do sprawdzania tej hipotezy – stąd jej przyjęcie lub odrzucenie zależy w znacznej mierze od tego, z jakiego testu się skorzysta. W ich badaniach, w których testowali występowanie histerezy *versus* naturalnej stopy bezrobocia, zastosowanie testu pierwiastka jednostkowego wskazywało na istnienie histerezy, podczas gdy wkomponowanie zmian strukturalnych do testów stacjonarności pozwoliło na odrzucenie tej hipotezy. Autorzy stwierdzili, że bezrobocie zachowuje się zgodnie z teorią strukturalistyczną, która zakłada, że większość szoków jest przejściowa, niemniej czasami zdarza się, że szoki, przede wszystkim powiązane z recesjami, mogą prowadzić do zmian w stopie bezrobocia równowagi.

Z podobną sytuacją spotkała się [Johansen, 2002] – zastosowanie testów dla danych agregatowych dla poszczególnych krajów (badala 19 krajów na podstawie danych z lat 1961-1998) wskazywało na występowanie histerezy, natomiast rezultat uległ zmianie, gdy dopuściła wystąpienie zmian strukturalnych. Również przeprowadzenie testów na danych panelowych kazało odrzucić istnienie histerezy, chociaż wyniki wykazały wysoki stopień uporczywości bezrobocia w badanej próbie.

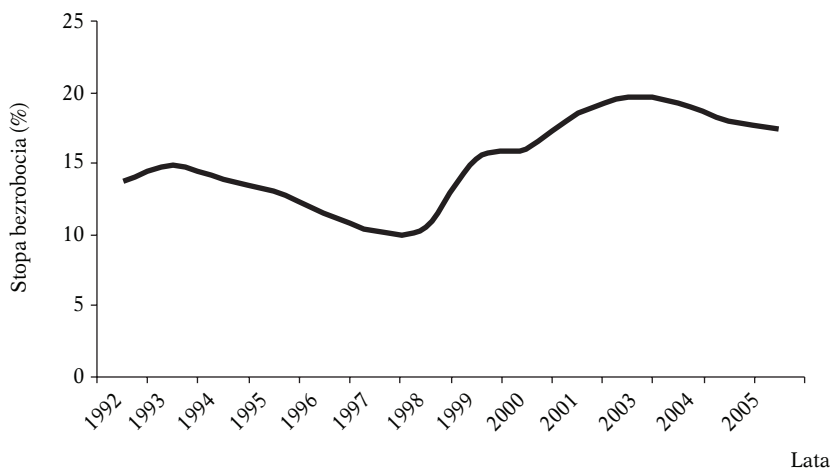
[Strazicich, et. al, 2001] zdołali odrzucić hipotezę o występowaniu histerezy w badanych przez nich 17 krajach OECD (dla danych z lat 1955-1999) dopiero przy zastosowaniu testów panelowych, gdyż włączenie zmian strukturalnych do testu LM nadal dawało wyniki potwierdzające istnienie histerezy, z wyjątkiem Australii i Finlandii.

¹⁰ Były to: Australia, Kanada, Dania, Hiszpania, Francja, Wielka Brytania, Włochy, Japonia, Holandia, Portugalia, USA i Niemcy Zachodnie.

Histereza w Polsce?

W Polsce bezrobocie jest jednym z poważniejszych problemów społeczno-ekonomicznych a histereza może wskazać pewne możliwości w zakresie jego złagodzenia, oczywiście pod warunkiem, że efekt histerezy jest obecny w polskiej gospodarce. Co więc przemawia za występowaniem histerezy bezrobocia w Polsce?

Wykres 1. Stopa bezrobocia BAEL w Polsce w latach 1992-2005



Źródło: opracowanie własne na podstawie *Aktywność ekonomiczna ludności w latach 1992-2001 (2002)*, GUS Warszawa, *Biuletyn Statystyczny* za lata 2001-2005

Stopa bezrobocia jest wysoka pomimo znaczącego wzrostu gospodarczego w ostatnich latach (3,5% w 2003 roku, 5,3% w 2004 roku i 3,2%¹¹ w 2005 roku). Wzrost stopy bezrobocia w początkowym okresie transformacji był w zasadzie naturalną konsekwencją wprowadzanych reform i przekształceń w strukturze gospodarki – bezrobocie stało się jawne (pod koniec lat 80. ubiegłego wieku stopa bezrobocia ukrytego była szacowana na poziomie 20-30% [Czyżewski, 2002]). Niemniej po okresie spadku stopy bezrobocia w latach 1994-1997, począwszy od roku 1998 nastąpił jej znaczny wzrost, do poziomu 19,7% w 2002 roku, po czym stopa bezrobocia zaczęła powoli się obniżać do poziomu 17,4% w III kwartale 2005 roku (wykres 1).

Zmiany w rzeczywistej stopie bezrobocia oddziaływały również na stopę bezrobocia równowagi. Badania dotyczące szacowania tej stopy bezrobocia bazujące na modelach opartych na równowadze napływów i odpływów z bezrobocia prowadzili [Socha i Sztanderska, 2000], [Góra, 2002] oraz [Kwiatkowski, et. al., 2002]. W zasadzie wszystkie wyniki analiz, za wyjątkiem badań Góry, wskazywały na spadkową tendencją w stopie bezrobocia równowagi po 1993

¹¹ *Produkt krajowy brutto w 2005 roku szacunek wstępny*, GUS, Warszawa 30.01.2006.

roku, natomiast w 2000 roku nastąpił jej znaczący wzrost do poziomu 13,18% (tablica 1).

Tablica 1

Szacunki stopy bezrobocia równowagi w Polsce w latach 1992-2000

Wyszczególnienie	1992	1993	1994	1995	1996	1997	1998	1999	2000
wg Góry	12,5	12,1	9,3	9,6	10,0
wg Kwiatkowskiego et al.		13,06	13,35	11,26	9,46	8,54	7,39	.	13,18
wg Sochy i Sztanderskiej	CEPR	11,4	14,9	14,1	12,4	10,2	9,4	9,3	.
	DHP	11,9	14,8	14,5	12,8	10,9	10,1	8,3	.
	G	10,9	12,8	12,4	10,7	9,7	9,3	9,0	.

CEPR – stopa bezrobocia w równowadze wyznaczona według formuły CEPR; DHP- stopa bezrobocia w równowadze wyznaczona według formuły Darby'ego, Haltiwangera i Planta; G- stopa bezrobocia w równowadze wyznaczona według formuły Gaertnera (omówienie poszczególnych metod zawiera [Socha, Sztanderska, 2000]).

Źródło: [Socha i Sztanderska, 2000], [Góra, 2002] oraz [Kwiatkowski, et. al., 2002]

Na wzrost stopy bezrobocia równowagi w ostatnich latach wskazują również wyniki badań [BRE Banku S.A., 2002] oraz [Gradzewicza i Kolasy, 2004]. Oszacowanie *NAIRU* uzyskane przez BRE BANK S.A. dla lat 1995-2002 wskazywało, że *NAIRU* w okresie od I kwartału 1996 roku do I kwartału roku 2002 rosło nieustannie, w tempie rocznym około 1 punktu procentowego, utrzymując się poniżej rzeczywistej stopy bezrobocia, z wyjątkiem lat 1998-2000. Z kolei Gradzewicz i Kolasa w oparciu o metodę [Elmeskova, 1993] wykazali, że *NAWRU* (*Non Accelerating Wage Rate of Unemployment*) po okresie obniżania się, od 1998 roku cechowało się tendencją wzrostową (zastosowanie filtru Hodricka-Prescotta, wymusiło dobranie końcowej wartości *NAWRU* tak, aby średnie *NAWRU* w 2002 roku wynosiło około 16%).

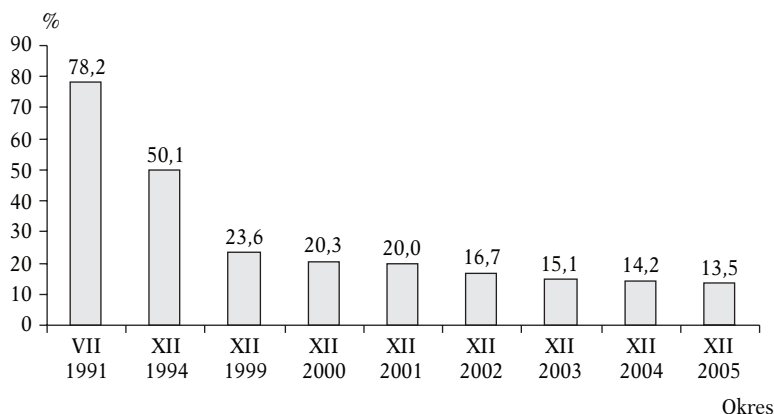
Jak wskazuje [Kwiatkowski, 2004] bezrobocie w Polsce charakteryzuje stag-nacyjny charakter wynikający z niskiej rotacji bezrobotnych – wzrost bezrobocia w latach 1998-2002 nie wynikał z napływu osób do zasobu bezrobocia, ale z wydłużeniem się przeciętnego okresu pozostawania bezrobotnym. W związku z tym autor stawia tezę, że wysoka stopa bezrobocia długookresowego przyczynia się do histerezy bezrobocia.

Przytoczone rezultaty badań stanowi dowód, że stopa bezrobocia równowagi w Polsce w ostatnich latach rosła. Z jednej strony może to wskazywać na występowanie efektu histerezy, skoro *NAIRU* podążało za rzeczywistą stopą bezrobocia. Z drugiej jednak strony, w oparciu o podejście strukturalistyczne, można podejrzewać, że wzrost stopy bezrobocia równowagi wynikał ze zmian w jej strukturalnych determinantach. Rozważania te są istotne również ze względu na fakt planowanego wstąpienia Polski do Unii Gospodarczej i Walutowej. [Cobham i Williams, 1998] zauważają, że w krajach przygotowujących się do przystąpienia do UGiW, co wiąże się z koniecznością wypełnienia kryteriów konwergencji z Maastricht, histereza może prowadzić do wystąpienia długo-

trwałego kosztu wstąpienia w postaci wzrostu *NAIRU* w wyniku działań dezinflacyjnych. Koszty te, według autorów, nie wystąpią jeśli będzie spełniony jeden z trzech poniższych warunków: oczekiwania będą w pełni racjonalne, oczekiwania będą dostosowywały się natychmiastowo, stopa inflacji równa jest średniej stopie inflacji w UGiW, w związku z czym nie ma potrzeby prowadzenia polityki dezinflacyjnej.

[Blanchard i Summers, 1986a] stali na stanowisku, że system zasiłków dla bezrobotnych nie wpływa znacząco na wzrost bezrobocia, niemniej w oparciu o modele płacy progowej można wykazać, że wzrost hojności systemu zasiłków prowadzi do wydłużenia okresu poszukiwania pracy przez bezrobotnych. Jak pokazują dane dotyczące liczby osób pobierających zasiłki w Polsce, udział bezrobotnych z prawem do zasiłku w ogóle bezrobotnych spadł znacząco w stosunku do początkowych lat transformacji i ustabilizował się na poziomie około 14% (wykres 2). Tendencja ta może stanowić ilustrację tezy, że w systemie zasiłków w ostatnich latach nie pojawiła się tendencja do wzrostu hojności systemu.

Wykres 2. Bezrobotni z prawem do zasiłku jako % ogółu bezrobotnych (stan w końcu okresu)



Źródło: [Bochenek, 2004], *Miesięczna informacja o bezrobociu w Polsce*

Kolejnym czynnikiem, który mógł wpływać na wartość *NAIRU* w Polsce jest poziom uzwiązkowienia, chociaż jak wskazują [Blanchard i Summers, 1986a] pracownicy dysponują siłą przetargową podczas negocjacji płacowych również w sytuacji, w której związki zawodowe by nie istniały. Biorąc pod uwagę skalę przemian, jakie nastąpiły w strukturze własnościowo-podmiotowej w gospodarce polskiej na przestrzeni ostatniego dziesięciolecia, wydaje się mało prawdopodobne, aby za wzrost stopy bezrobocia równowagi odpowiedzialny był ten czynnik. Hipotezę tę potwierdzają wyniki badania przeprowadzonego przez CBOS, w którym przynależność do związków zawodowych zadeklarowało 8% ankietowanych (3% do NSZZ „Solidarność”, 2% do związku zrzeszonego w OPZZ, 3% do pozostałych związków zawodowych). Oczywiście poziom uzwiązkowienia jest różny w zależności od sektora własności: do związków

zawodowych należy 33% pracowników instytucji i zakładów państwowych, 19% pracowników spółek z udziałem publicznym i prywatnym i tylko 3% pracowników sektora prywatnego (poza rolnictwem).

W oparciu o model rokowań płacowych wskazuje się, że przy wysokiej stopie bezrobocia, szczególnie jeśli wysoki odsetek bezrobotnych stanowią bezrobotni długookresowo, rośnie siła przetargowa insiderów, co powinno przekładać się na wzrost płacy realnej w gospodarce. Analiza danych dotyczących przeciętnego miesięcznego wynagrodzenia brutto w polskiej gospodarce wskazuje, że w okresie, w którym wystąpiła druga fala bezrobocia wzrosło ono w latach 1995-2004 realnie o 32,1%, przy czym w latach 2000-2004 zanotowano jedynie 8,1% wzrost. W tych samych okresach PKB wzrosło o, odpowiednio, 43,9% i 12%. Jednakże należy zauważyć, że wzrost ten nie był procesem ciągłym, a co więcej w początkowych latach XXI wieku wynosił od 0,7% do 3,4% rocznie (tablica 2).

Tablica 2

Tempo wzrostu przeciętnego miesięcznego wynagrodzenia realnego brutto w Polsce w latach 1997-2004

1998	1999	2000	2001	2002	2003	2004
103,3	104,7	101,0	102,5	100,7	103,4	101,5

Źródło: *Mały Rocznik Statystyczny 2005* (www.stat.gov.pl)

W roku 2004 przeciętne miesięczne wynagrodzenie brutto wzrosło o 1,5% i nie wydaje się, aby wynikało to z umocnienia pozycji przetargowej pracowników, czy też związków zawodowych, biorąc pod uwagę, że tempo wzrostu PKB w tym roku osiągnęło 5,3%.

Ciekawe spojrzenie na siłę przetargową pracowników zawiera opracowanie [Grosfeld i Nivet, 1999], którzy wykorzystując dane ze 173 dużych przedsiębiorstw państwowych sektora produkcyjnego przeprowadzili badania dotyczące zmian w mechanizmie ustalania płac na początku okresu transformacji (lata 1988-1994). Analiza wykazała, że płace reagowały w mniejszym stopniu na spadek produktywności niż na jej wzrost. Co ciekawe, w przedsiębiorstwach, które zanotowały spadek produktywności, płace w ogóle nie reagowały na te zmiany, natomiast w tych, w których produktywność wzrosła dało się zauważyć silną, dodatnią zależność między produktywnością a zmianą poziomu płac. Badania potwierdziły hipotezę, że mechanizm negocjacji płacowych zależy od formy własności przedsiębiorstwa: największą część korzyści płynących ze wzrostu produktywności zdołali wywalczyć pracownicy przedsiębiorstw państwowych, w firmach poddanych procesowi komercjalizacji wzrost produktywności przełożył się w mniejszym zakresie na wzrost płac, co potwierdza tezę, że likwidacja rad zakładowych osłabiła pozycję insiderów, natomiast w przedsiębiorstwach sprywatyzowanych nie zanotowano żadnej zależności między produktywnością a płacami.

Wśród innych przyczyn wysokiego poziomu bezrobocia wskazuje się również rozwiązania wynikające z wysokiego stopnia regulacji rynku pracy, które

powodują, że rynek ten cechuje się niską elastycznością. Analiza stopnia regulacji rynku pracy prowadzona przez OECD pokazuje, że wbrew powszechnym opiniom stopień regulacji polskiego rynku pracy w porównaniu do krajów „piętnastki” UE jest niewysoki, głównie za sprawą niskiego poziomu regulacji dotyczącego zatrudniania pracowników w niepełnym wymiarze czasu pracy. Natomiast na stosunkowo wysokim poziomie kształtuje się stopień regulacji w zakresie zwolnień grupowych [Kryńska, 2004]. [Boeri, 2001] oraz [Boeri i Terrell, 2002] uważają, że próba wytłumaczenia wysokiego i trwałego bezrobocia w krajach środkowowschodniej Europy w oparciu o nieelastyczność rynku pracy napotyka na poważne trudności.

Przytoczone argumenty wydają się zaprzeczać tezie, że wzrost stopy bezrobocia równowagi jest skutkiem zmian czynników realnych, które ją kształtują. Tym samym prawdopodobne wydaje się, że w Polsce może występować efekt histerezy.

Wyniki badań przeprowadzonych przez [Leon-Ledesma i McAdama, 2003] pokazują, że w krajach przechodzących transformację co prawda pełna histereza nie występuje, to jednak bezrobocie wydaje się charakteryzować równowagą wielopunktową, szczególnie w Czechach, Słowacji i na Litwie. Szoki, jakie oddziaływały na gospodarki środkowoeuropejskie powodowały, że stopa bezrobocia równowagi przesuwała się na coraz wyższe poziomy.

Z kolei [Camarero, et. al., 2005] badali występowanie zjawiska histerezy bezrobocia w krajach, które w maju 2004 roku wstąpiły do Unii Europejskiej (z wyjątkiem Cypru). Analiza dotyczyła lat 1991-2003. Uzyskane wyniki pozwoliły na wyciągnięcie wniosku, że w analizowanych krajach histereza nie występuje, natomiast *NAIRU* podlega zmianom na skutek występowania przemian strukturalnych. Autorzy oszacowali również wartości *NAIRU* dla poszczególnych krajów¹². Najwyższe stopy *NAIRU* charakteryzowały Polskę i Słowację, najniższe – Węgry, Słowenię i Czechy, przy czym w przypadku Węgier i Słowenii *NAIRU* wykazywało tendencję spadkową natomiast w Czechach rosło. Analizując szybkość procesów dostosowawczych na rynkach pracy autorzy uzyskali wynik mówiący, że w krajach o wyższym poziomie opieki socjalnej oraz płacy minimalnej (takich jak Polska, Malta, Słowenia i Czechy) dostosowania zachodzą dłużej. Najszybciej rynek pracy dostosowuje się w krajach Bałtyckich, zaś uporczywość bezrobocia w największym zakresie dotyczy Polski i Słowenii.

Podobne wyniki dotyczące wartości *NAIRU* w nowych krajach członkowskich UE uzyskał [Pallis, 2006] – wykazały one, że kraje te charakteryzują się wyższym przeciętnym poziomem naturalnej stopy bezrobocia niż UE 15 (jej średnia wartość dla UE 15 wyniosła 7,8%, a dla UE 25 8,74%)¹³. Istotnym wnioskiem płynącym z analizy Pallisa jest to, że poszczególne gospodarki cha-

¹² Pierwszym krokiem tej procedury było wyznaczenie dla każdego kraju punktów zwrotnych w tendencji stóp bezrobocia – na tej podstawie wyróżniono kraje, w których miał miejsce jeden punkt zwrotny (Węgry), dwa (Czechy, Słowacja i Słowenia), trzy (Estonia, Litwa, Malta i Polska) i cztery w przypadku Łotwy.

¹³ Najniższe wartości *NAIRU* osiągnęły Węgry (4,7%), natomiast najwyższe Polska (18,2%) i Słowacja (16,1%).

rakteryzują się różnym stopniem wrażliwości w relacjach wymiennosci inflacji i bezrobocia, w związku z tym możliwość zastosowania wspólnej polityki w tych krajach wydaje się wątpliwa ze względu na to, że jej efekty byłyby różne w poszczególnych krajach.

Na znaczne różnice między Polską, Czechami, Słowacją i Węgrami w zakresie bezrobocia zwracają uwagę także [Adamczyk i Włodarczyk, 2006] analizując bezrobocie transformacyjne w tych krajach¹⁴. Przede wszystkim jedynie na Węgrzech stopa bezrobocia była dodatnio skorelowana ze stopą bezrobocia krajów UE i OECD – tylko na Węgrzech po okresie recesji zanotowano spadek stopy bezrobocia i to poniżej poziomu notowanego w UE i OECD (dla roku 2003). Również struktura bezrobocia na Węgrzech odbiega *in plus* od sytuacji w pozostałych trzech analizowanych krajach¹⁵. Co więcej Węgry, jako jedyny kraj, zanotowały wzrost wartości wskaźnika aktywności zawodowej, chociaż w tym zakresie ich osiągnięcia są nienajlepsze, gdyż nadal jest to najniższa wartość tego wskaźnika wśród badanych krajów. Ciekawe tendencje w bezrobociu zachodziły również w Czechach – na początku okresu transformacji cechowały się one najniższą stopą bezrobocia z analizowanych krajów (4,4% w 1993 roku), ale począwszy od lat 1997-1998 nastąpiło odwrócenie trendu i stopa bezrobocia uległa podwojeniu.

Zdaniem [Adamczyka i Włodarczyka, 2006] Węgry w efekcie największego, w porównaniu do pozostałych badanych krajów, spadku zatrudnienia na początku okresu transformacji zdołały zmienić strukturę zatrudnienia na bardziej proefektywnościową, co umożliwiło ograniczenie bezrobocia poniżej średniego poziomu w OECD i UE.

Histeresa – ujęcie modelowe

Występowanie histerezy może być badane w różny sposób¹⁶. W niniejszym opracowaniu została wykorzystana metoda przedstawiona przez Gordona [1989], której autor użył do weryfikacji hipotezy histerezy dla pięciu krajów (Francji, Niemiec, Stanów Zjednoczonych, Japonii i Wielkiej Brytanii) na podstawie danych z lat 1873-1986 (ze względu na brak danych na temat bezrobocia Gordon posłużył się wartością produktu krajowego). Wyniki jego badań nie potwierdziły występowania pełnej histerezy w analizowanych krajach.

Metoda Gordona bazuje na koncepcji krzywej Phillipsa wspartej oczekiwaniami, na podstawie której szacuje się stopę bezrobocia *NAIRU*.

Krzywa Phillipsa ma postać:

$$\pi_t = \alpha\pi_{t-1} + \beta(U_t - U_{nt}) + \varepsilon_t \quad (3)$$

¹⁴ Zdaniem autorów bezrobocie w krajach przechodzących transformację systemową cechuje się inną specyfiką niż bezrobocie w krajach o zstałym systemie gospodarki rynkowej.

¹⁵ Węgry zanotowały najniższe stopy bezrobocia wśród osób młodych w wieku 15-24 lat (ponad trzykrotnie niższa w 2003 roku w porównaniu do Polski), oraz wśród bezrobotnych długookresowo.

¹⁶ [Eberwein, et al., 2003] omawia kilka wykorzystywanych w praktyce metod.

gdzie:

π_t – stopa inflacji w okresie t ,

U_t – rzeczywista stopa bezrobocia w okresie t ,

ε_t – składnik losowy.

Hipoteza histerezy zakłada, że *NAIRU* w okresie bieżącym zależy od przeszłych wartości stopy bezrobocia. Upraszczając, można przyjąć, że *NAIRU* w okresie t zależy od rzeczywistej stopy bezrobocia z okresu poprzedniego ($t - 1$) oraz determinant mikroekonomicznych, charakteryzowanych przez zmienną Z_t , co można zapisać jako:

$$U_{nt} = \eta U_{t-1} + \gamma Z_t \quad (4)$$

Podstawiając równanie (4) do równania (3) w miejsce zmiennej U_{nt} i odpowiednio przekształcając otrzymujemy:

$$\pi_t = \alpha \pi_{t-1} + \beta(1 - \eta)U_t + \beta\eta \Delta U_t - \beta\gamma Z_t + \varepsilon_t \quad (5)$$

Pełna histereza występuje, jeśli $\eta = 1$. W tym przypadku unikalna, krótkookresowa wartość *NAIRU* nie występuje, a procesy inflacyjne zależą wyłącznie od tempa zmian stopy bezrobocia, a nie jego poziomu. W przypadku, gdy $\eta < 1$ występuje uporczywość bezrobocia, a inflacja zależy zarówno od zmian stopy bezrobocia, jak i jej poziomu. Podejście to jest zbieżne z definicją stosowaną przez [Layarda, Nickella i Jackmana, 1991].

Opierając się na metodzie Gordona, na podstawie danych kwartalnych za lata 1995-2004 zostały oszacowane parametry równania (5) (w nawiasach podano wartości statystyki t -Studenta):

$$\pi_{Bt} = \underset{(0,74)}{0,85} + \underset{(40,20)}{0,92}\pi_{Bt-1} - \underset{(-1,47)}{0,34} (1 - \underset{(5,10)}{0,88})U_t - \underset{(-1,47)}{0,34} \cdot \underset{(5,10)}{0,88} \Delta U_t \quad (6)$$

$$R^2 = 0,991, R^2 \text{ skorygowany} = 0,99 \text{ DW} = 1,75$$

gdzie π_{Bt} – inflacja bazowa „netto” po wyłączeniu cen żywności i paliw w okresie t , a wyraz wolny pełni funkcję wyrażenia $\beta\gamma Z_t$ (oznacza to *de facto* przyjęcie założenia, że w badanym okresie mikroekonomiczne realne determinanty stopy bezrobocia pozostawały niezmiennione).

Wartość η oszacowana na podstawie równania (6) wynosi 0,88, czyli jest bliska jedności, co może wskazywać na występowanie w gospodarce polskiej histerezy bezrobocia. Przeprowadzona weryfikacja hipotezy o wartości parametru, w której hipoteza zerowa ma postać $H_0: \eta = 1$, natomiast hipoteza alternatywna $H_1: \eta < 1$ wykazała, że nie ma podstaw do odrzucenia hipotezy zerowej (wartość statystyki t wyniosła -0,0236 w porównaniu z wartością krytyczną testu na poziomie istotności 0,05 równą -2,028), co jest równoznacznie ze stwierdzeniem, że nie istnieją podstawy do odrzucenia hipotezy, że w Polsce występuje

przypadek pełnej histerezy bezrobocia. Niemniej wyniki analizy należy interpretować z dużą ostrożnością przynajmniej z dwóch względów. Po pierwsze, oszacowany model wykazuje się słabością wynikającą z faktu, że parametr β jest statystycznie nieistotny¹⁷. Po drugie, jest to tylko jedna z możliwych metod weryfikacji hipotezy badawczej i może się okazać, że jak wskazywali [Camarero, et. al., 2006], testy wykorzystane w tym podejściu są za słabe, aby odrzucić istnienie histerezy bezrobocia w Polsce. W związku z tym wydaje się konieczne przeprowadzenie bardziej szczegółowej analizy tego zjawiska przy uwzględnieniu większej liczby zróżnicowanych metod ilościowych.

Niemniej już na tym etapie prac wydaje się, że histereza jest obiecującą koncepcją, mogącą wytłumaczyć przyczyny występowania wysokiego bezrobocia w Polsce, a kanałem poprzez który oddziałuje na polski rynek pracy jest, zdaniem autora niniejszego opracowania, kanał kapitału ludzkiego. Z jednej strony, jak wskazuje [Kwiatkowski, 2004], bezrobocie ma charakter stagnacyjny, a znaczą część zasobu bezrobocia stanowią bezrobotni długookresowo. Z drugiej strony coraz większe nasycenie gospodarki technologiami informacyjnymi i telekomunikacyjnymi powoduje zjawisko wykluczenia cyfrowego. Zjawisko to na rynku pracy przejawia się w tym, że pracodawcy zgłaszają popyt na pracowników posiadających umiejętność obsługi komputera i Internetu i jeśli pracownicy takich umiejętności nie posiadają, co potencjalnie najczęściej dotyka osób w wieku powyżej 40 czy 50 lat, to pracodawcy mogą stosować wobec nich swego rodzaju dyskryminację. Oznacza to, że pracownicy tacy są bardziej narażeni na zwolnienie, a trafiając do zasobu bezrobocia ich szanse na ponowne znalezienie pracy drastycznie maleją¹⁸. Stąd zagadnienie kapitału ludzkiego w tłumaczeniu przyczyn histerezy bezrobocia w Polsce nabiera istotnego znaczenia, gdyż problem utraty, a właściwie braku tego kapitału dotyczy nie tylko bezrobotnych, ale również osób zatrudnionych.

Wnioski

Histereza bezrobocia stanowi jeden z możliwych sposobów wytłumaczenia przyczyn wzrostu stopy bezrobocia równowagi w Polsce w ostatnich latach. Badanie przeprowadzone w niniejszym opracowaniu dowiodło, że w oparciu o metodę [Gordona, 1989] nie ma podstaw do odrzucenia hipotezy o występowaniu w Polsce pełnej histerezy bezrobocia.

Niemniej, jak zostało już zauważone, do tego stwierdzenia należy podchodzić z dużą ostrożnością. Po pierwsze, w opracowaniu zastosowano tylko jedną metodę weryfikacji hipotezy badawczej, wykorzystując test, który może być zbyt

¹⁷ Chociaż [Gajda, 2002, s. 72] wskazuje, że w przypadku kiedy ocena parametru jest znacząca, choć mało istotna, a ponadto pozostaje w zgodzie z teorią ekonomiczną, związaną z nią zmienną można pozostawić w oszacowanym równaniu.

¹⁸ Dotychczas nie ma danych potwierdzających istnienie takiego mechanizmu w Polsce, ale są już prowadzone badania, które umożliwią weryfikację tej hipotezy (badania te prowadzi IPiSS w projekcie ITQUAL nr F0030d1, finansowanym w ramach Inicjatywy Wspólnotowej Equal z Europejskiego Funduszu Społecznego).

słaby, aby odrzucić hipotezę o istnieniu histerezy. Po drugie, okazało się, że ze statystycznego punktu widzenia zastosowany model nie jest w pełni zadowalający. Po trzecie wreszcie, możliwość występowania histerezy bezrobocia została wywiedziona metodą nie wprost – charakterystyka wybranych czynników strukturalnych wykazała, że jest mało prawdopodobne, aby ich zmiany przyczyniły się do wzrostu *NAIRU*. Nie została jednak przeprowadzona analiza przyczyn histerezy na podstawie znanych w literaturze modeli teoretycznych, chociaż obiecujące wydaje się połączenie zmian zachodzących na rynku pracy z modelem ubytku kapitału ludzkiego. Biorąc pod uwagę możliwość występowania histerezy w połączeniu z sytuacją w jakiej znajduje się Polska, potencjalnie najkorzystniejsze wydają się być postulaty [Lindbecka i Snowera, 1988]. Zastosowanie polityki pobudzania popytu, która oddziaływałaby na podażową stronę gospodarki z jednej strony powinno doprowadzić do spadku bezrobocia (zarówno bezrobocia rzeczywistego, jak i bezrobocia równowagi), a z drugiej do wzmocnienia potencjału gospodarczego Polski.

Konkludując, można stwierdzić, że niniejsze opracowanie stanowi zasygnalizowanie problematyki, natomiast ostateczne jej rozstrzygnięcie wymaga dokładnych dalszych badań, wykorzystujących szeroką gamę dostępnych metod ilościowych. Niemniej już na tym etapie histereza wydaje się być obiecującą koncepcją, która może wyjaśnić przyczyny występowania wysokiego bezrobocia w Polsce.

Bibliografia

- Arendt Ł., [2005], *Próba oszacowania NAIRU dla Polski*, „Gospodarka Narodowa”, nr 5-6, s. 1-23.
- Adamczyk A., Włodarczyk R.W., [2006], *Bezrobocie transformacyjne w Polsce, Czechach, Słowacji i na Węgrzech*, [w:] *Wzrost gospodarczy, restrukturyzacja i rynek pracy w Polsce. Ujęcie teoretyczne i empiryczne*, (red.), S. Krajewski, P. Kaczorowski, Wydawnictwo UŁ, Łódź, s. 9-34.
- Aghion P., Blanchard O., [1994], *On the Speed of Transition in Central Europe*, NBER Macroeconomics Annual, s. 283-320.
- Amable B., Henry J., Lordon F., Topol R., [1993], *Unit-Root in the Wage-price Spiral Is Not Hysteresis in Unemployment*, „Journal of Economic Studies”, Vol. 20, No. 1/2, s. 123-135.
- Baker D., Schmidt J., [1999], *The Macroeconomic Roots of High European Unemployment: the Impact of Foreign Growth*, artykuł prezentowany na konferencji *Creating Competitive Capacity: Reassessing the Role of the U.S. and German Labor Market Institutions in the New Economy*, Washington D.C.
- Balakrishnan R., Michelacci C., [2001], *Unemployment dynamics across OECD countries*, „European Economic Review”, Vol. 45, s. 135-165.
- Blanchard O., [1991], *Wage Bargaining and Unemployment Persistence*, „Journal of Money, Credit, and Banking Lecture”, Vol. 23, No. 3, s. 277-292.
- Blanchard O., [1997], *Is There a Core of Usable Macroeconomics?*, „American Economic Review”, Vol. 87, No. 2, s. 244-246.
- Blanchard O., [2005], *Ekonomiczna przyszłość Europy*, „Gospodarka Narodowa”, nr 11-12, s. 89-112.
- Blanchard O., Summers L.H., [1986a], *Hysteresis and the European Unemployment Problem*, NBER Working Paper 1950.
- Blanchard O., Summers L.H., [1986b], *Hysteresis in Unemployment*, NBER Working Paper 2035.
- Blanchard O., Summers L.H., [1988], *Beyond the Natural Rate Hypothesis*, „American Economic Review”, Vol. 78, No. 2, s. 182-187.

- Bludnik I., [2004], *Keynesistowskie teorie histerezy*, „Gospodarka Narodowa”, nr 11-12, s. 49-68.
- Bochenek M., [2004], *Cienie przekształceń systemowych polskiej gospodarki*, referat nadesłany na Ogólnopolską Konferencję Naukową *Gospodarka Polski po 15 latach transformacji*, Kraków 20-22 września 2004.
- Boeri T., [2001], *Transition with Labour Supply*, IZA Discussion Paper No. 257.
- Boeri T., Terrell K., [2002], *Institutional Determinants of Labour Reallocation in Transition*, „Journal of Economic Perspectives”, 16, s. 51-76.
- Brainard L.S., Cutler D.M., [1993], *Sectoral Shifts and Cyclical Unemployment Reconsidered*, „The Quarterly Journal of Economics”, Vol. 108, No. 1, s. 219-243.
- BRE Bank S.A., [2002], „Miesięczny Przegląd Makroekonomiczny” nr 27, listopad.
- Camarero M., Carrion-i-Silvestre J.L., Tamarit C., [2005], *Unemployment Dynamics and NAIRU Estimates for Accession Countries: a Univariate Approach*, „Journal of Comparative Economics”, Vol. 33, issue 3, s. 584-603.
- Camarero M., Carrion-i-Silvestre J.L., Tamarit C., [2006], *Testing for hysteresis in unemployment in OECD countries. New evidence using stationarity panel tests with breaks*, „Oxford Bulletin of Economics and Statistics”, Vol. 68, issue 2, s. 167-182.
- Cobham D., Williams S., [1998], *Hysteresis, the Phillips curve and the Costs of Monetary Union*, „Applied Economic Letters”, Vol. 5, s. 477-480.
- Cromb R., [1993], *A Survey of Recent Econometric Work on the NAIRU*, „Journal of Economic Studies”, Vol. 20, No. 1-2, s. 27-51.
- Czyżewski A.B., [2002], *Wzrost gospodarczy a popyt na pracę*, „Bank i Kredyt”, nr 11-12, s. 123-133.
- Eberwein C.J., Handa J., Mikhail O., [2003], *The Measurement of Persistence and Hysteresis in Aggregate Unemployment*, <http://econwpa.wustl.edu:80/eps/mhet/papers/0311/0311002.pdf>.
- Elmeskov J., [1993], *High and persistent unemployment: assessment of the problem and its causes*, OECD Economics Department Working Paper No. 132.
- Gajda J., [2002], *Ekonometria praktyczna*, Absolwent, Łódź.
- Gordon R.J., [1989], *Hysteresis in History: Was There Ever a Phillips Curve?*, „American Economic Review”, Vol. 79, No. 2, s. 220-225.
- Góra M., [2002], *Rynek pracy w Polsce: diagnoza i propozycje poprawy sytuacji*, [w:] *Wzrost gospodarczy, restrukturyzacja i bezrobocie w Polsce*, Katedra Ekonomii UŁ, Łódź, s. 283-305.
- Gradzewicz M., Kolasa M., [2004], *Szacowanie luki popytowej dla gospodarki polskiej przy wykorzystaniu metody VECM*, „Bank i Kredyt”, nr 2, s. 14-30.
- Grosfeld I., Nivet J-F., [1999], *Insider Power and wage setting In transition: Evidence from a panel of large Polish firms, 1988-1994*, „European Economic Review”, Vol. 43, s. 1137-1147.
- Hargraves-Heap S.P., [1980], *Choosing the Wrong „Natural” Rate: Accelerating Inflation or Decelerating Employment and Growth*, „The Economic Journal”, 90, s. 611-620.
- Jackman R., [1998], *European Unemployment: Why is it so High and What Should be Done about it?*, [w:] *Unemployment and the Australian Labour Market*, G. Debelle, J. Borland, Reserve Bank of Australia and CEPR, s. 39-63.
- Jackman R., [2002], *Determinants of Unemployment in Western Europe and possible Policy Responses*, paper presented at UNECE's 5th Spring Seminar, Geneva.
- Jacobson T., Vredin A., Warne A., [1997], *Common trends and hysteresis in Scandinavian unemployment*, „European Economic Review”, Vol. 41, s. 1781-1816.
- Johansen K., [2002], *Hysteresis in Unemployment: Evidence from Norwegian Countries*, Norwegian University of Economics Working Paper No. 6.
- Krugman P., [1994], *Past and Prospective Causes of High Unemployment*, Federal Reserve Bank of Kansas City Economic Review, 4th quarter, s. 23-43.
- Kryńska E., [2004], *Państwo na rynkach pracy zintegrowanej Europy*, [w:] *Proces globalizacji gospodarki – udział krajów w jej korzyściach i kosztach*, (red.), M. Klamut, Wydawnictwo AE im. Oskara Langego we Wrocławiu, Wrocław, s. 217-230.
- Kwiatkowski E., [2002a], *Bezrobocie. Podstawy teoretyczne*, PWN, Warszawa.

- Kwiatkowski E., [2002b], *Strukturalne determinanty naturalnej stopy bezrobocia*, „Bank i Kredyt”, nr 11-12, s. 149-155.
- Kwiatkowski E., [2004], *Integracja z Unią Europejską a rynek pracy w Polsce*, „Gospodarka Narodowa”, nr 4, s. 81-94.
- Kwiatkowski E., Kucharski L., Tokarski T., [2002], *Bezrobocie i zatrudnienie a PKB w Polsce*, „Ekonomista” nr 3, s. 329-346.
- Layard R., Nickell S., Jackman R., [1991], *Unemployment. Macroeconomic Performance and the Labour Market*, Oxford University Press.
- Layard R., Nickell S., Jackman R., [1994], *The Unemployment Crisis*, Oxford University Press.
- Leon-Ledesma M.A., [2002a], *Non-linearities and Hysteresis in OECD Unemployment*, University of Kent Working Paper.
- Leon-Ledesma M.A., [2002b], *Unemployment hysteresis in the US States and the EU: a panel approach*, „Bulletin of Economic Research” 54:2, s. 95-103.
- Leon-Ledesma M.A., McAdam P., [2003], *Unemployment, Hysteresis and Transition*, European Central Bank Working Paper No. 234.
- Lilien D.M., [1982], *Sectoral Shifts and Cyclical Unemployment*, „The Journal of Political Economy”, Vol. 90, No. 4, s. 777-793.
- Lindbeck A., Snower D., [1986], *Wage Setting, Unemployment and Insider Outsider Relations*, „American Economic Review”, Vol. 76, s. 235-239.
- Lindbeck A., Snower D., [1988], *Long-term Unemployment and Macroeconomic Policy*, „American Economic Review”, Vol. 78, No. 2, s. 38-43.
- McDonald I.M., [2002], *Equilibrium Unemployment: Theory and Measurement in Australia Using the Phillips Curve*, „The Economic Record”, Vol. 78, No. 243, s. 451-470.
- Minford P., [2005], *Europe's Unemployment: can the Vicious Circle be Broken?* artykuł prezentowany na konferencji *Political Economy and Social Policy of Western Europe*, Indiana University.
- Nickell S., [1993], *Unemployment Revisited*, „Journal of Economic Studies”, Vol. 20, No. 1/2, s. 136-140.
- Pallis D., [2006], *The Trade-Off between Inflation and Unemployment in the New European Union Member-States*, „International Research Journal of Finance and Economics”, 1, s. 80-88.
- Sneessens H., Dreze J., [1986], *A Discussion of Belgium Unemployment Combining Traditional Concepts and Disequilibrium Econometrics*, „Economica”, Supplement, Vol. 53, s. 89-119.
- Snowdon B., Vane H., Wyncarczyk P., [1998], *Współczesne nurty teorii makroekonomii*, PWN, Warszawa.
- Socha M., Sztanderska U., [2000], *Strukturalne podstawy bezrobocia w Polsce*, PWN, Warszawa.
- Strazicich M.C., Tieslau M., Lee J., [2001], *Hysteresis in unemployment? Evidence from panel unit root test with structural change*, maszynopis, University of North Texas.
- Wojtyna A., [1994], *Czy Polsce grozi efekt histerezy?*, „Gospodarka Narodowa”, nr 9, s. 1-10.

IS THERE AN ‘UNEMPLOYMENT HYSTERESIS’ EFFECT IN POLAND?

Summary

The study sets out to determine if it is possible to speak of an “unemployment hysteresis” effect in Poland. The paper uses two research methods: a descriptive analysis of structural factors that may be responsible for changes in the Non-Accelerating Inflation Rate of Unemployment (NAIRU) in Poland; and the Gordon method (1989), on the basis of which the author checks the hypothesis about the existence of unemployment hysteresis in Poland.

The analysis showed that structural changes were unlikely to contribute to an increase in NAIRU. On the basis of the Gordon model the author demonstrated that there was no reason to reject the hypothesis about the occurrence of "full unemployment hysteresis" in Poland. Even though the results obtained by the author do not clearly confirm that Polish unemployment is indeed characterized by hysteresis, it seems that this lag effect may explain why Poland still suffers from high unemployment, the author notes. The hysteresis effect is primarily due to the outflow of labor and an insufficient level of human capital in the Polish economy.