

Maria Cieślak

Wyższa Szkoła Bankowa

KILKA REFLEKSJI NAD PROGNOZOWANIEM EKONOMICZNYM

Streszczenie: Autorka konfrontuje wizje przyszłości spotykane w literaturze pięknej z prognozami czynionymi na gruncie nauki, podkreślając, że te ostatnie pełnią ważną funkcję zmniejszania lęku przed przyszłością. Wskazuje różnice prognozowania w naukach ścisłych i społecznych. Apeluje o odpowiedzialność badaczy za rzetelność prognoz społecznych, zwłaszcza ekonomicznych, polegającą m.in. na ujawnianiu założeń przyjmowanych przy budowie prognoz i publikacji wyników prognozowania. Podaje klasyfikację metod prognozowania dokonaną przy przyjęciu podstawowych założeń prognostycznych.

Słowa kluczowe: wizje przyszłości w literaturze pięknej, prognozy w naukach ścisłych i społecznych, odpowiedzialność prognosty, klasyfikacja metod prognozowania.

Taka okoliczność jak dzisiejsza – 10. edycja konferencji poświęconej prognozowaniu ekonomicznemu¹ – daje okazję do zastanowienia się nad sensem przewidywań przyszłych zdarzeń w naukach społecznych. Chcę skorzystać z tej okazji.

Rozpocznę od własnych wspomnień, od uświadomienia sobie, dlaczego zajęłam się prognozowaniem. Niewątpliwie impuls ku temu dał profesor Zdzisław Hellwig, którego refleksje nad istotą prognozy i metodami prognozowania były inspiracją do zastanawiania się nad własnymi zainteresowaniami naukowymi. Ta inspiracja trafiła na podatny grunt, bowiem ciekawość świata, jego losów były we mnie już żywe dzięki zamięłowaniu do czytania „wszystkiego”, od Voltaire’a, Balzaca, George’a Wellsa (*Wehikuł czasu*), Huxleya (*Nowy wspaniały świat*), Orwella do Lema, Fukuyamy, Szymborskiej.

Pierwszą pozycją, która wciągnęła mnie w zastanawianie się nad przewidywaniem przyszłości, była francuska publikacja pochodząca z lat 60. XX wieku, poświęcona wizji Francji w roku 1985. Hasłem tej publikacji było: „aby ludzie byli zdrowi i szczęśliwi”. Zaskoczyło mnie, że można o przyszłości myśleć tak optymistycznie, że można pokazać cele i środki do nich wiodące, a przede wszystkim, że są ludzie, którzy wierzą, iż te piękne cele zostaną osiągnięte, że są w zasięgu naszych możliwości.

¹ Konferencja pn. „Prognozowanie w firmie” zorganizowana przez Katedrę Prognoz i Analiz Gospodarczych, Karpacz, 19-20 września 2012 r.

Za najważniejszą publikację prognostyczną uważam *Granice wzrostu*, książkę wydaną w Polsce w 1973 r., w rok po ukazaniu się jej oryginału, co odnotowuję, ponieważ w owych czasach wydawnictwa literatury zachodniej pojawiały się u nas najwcześniej w kilka lat po ich publikacji w kraju pochodzenia. Ta książka, dzięki wyłowieniu najważniejszych procesów zachodzących w świecie i ukazaniu ich przeszłości i perspektyw – konsekwencji dotychczasowych trendów rozwojowych, dzięki zastosowaniu określonej, jednolitej metody badawczej, w jasny i wyrazisty sposób pokazywała przyszłość świata. Przyszłość ta rysowała się ponuro, ale była rozpoznawalna, co już zmniejszało lęk. Na szczęście większość prognoz tam zaprezentowanych miała charakter ostrzegawczy i nie sprawdziła się, ale rola tej książki według mnie jest ogromna – to ona bowiem przyczyniła się do rozwijania myślenia o przyszłości całego świata, zwłaszcza tej odległej, pokazała, że takie myślenie może być racjonalne, chociaż niekoniecznie realistyczne, samo pokazanie możliwych wariantów przyszłości skłania do wymyślania i podejmowania środków dla niezrealizowania się niekorzystnych wariantów, a każda refleksja nad przyszłością pozwala lepiej zrozumieć teraźniejszość.

Kluczowe znaczenie miały też dla mnie publikacje Alвина Tofflera *Szok przyszłości* (1975), a zwłaszcza *Trzecia fala* (1986). Ta ostatnia, pokazując historię świata jako proces nieustających zmian, w których daje się wyróżnić wielkie fale – falę rolnictwa, uprzemysłowienia i ową „trzecią”, wtedy nadchodzącą, przede wszystkim wyraziście pokazała nieuchronność, a zarazem tylko chwilowe „okropieństwa” tego, co nowe. W przedmowie do *Trzeciej fali* Wiktor Osiatyński napisał: „Kryzys. Kryzys gospodarczy. Kryzys społeczny. Kryzys szkolnictwa. Kryzys rodziny. Kryzys wszystkiego. [...] przywrócić żywotność i potęgę przemysłowej Ameryce [...]”. Tak myślała większość Amerykanów, „a tymczasem Alvin Toffler mówi, żeby niczego nie odbudowywać ani nie przywracać. Żeby na przemysłową Amerykę po prostu machnąć ręką [...]. Bo przecież na gruzach industrialnej Ameryki może powstać zupełnie nowe społeczeństwo” (Przedmowa, s. 7). Wprawdzie Alvin Toffler niezupełnie wierzył, że ludzkość wykorzysta szansę, jaką daje cywilizacja trzeciej fali, ale wiarę w tę szansę starał się upowszechniać, bo uważał, że jest ona niezbędna, by losy świata potoczyły się lepiej niż bez niej.

Pragnę podkreślić, że te naukowe lub paronaukowe wizje świata podane w tych i w wielu innych publikacjach, tutaj nieprzytoczonych, były dla mnie mniej zatrważające niż te, które można znaleźć w literaturze pięknej. Wielka literatura światowa pełna jest przerażenia światem, który ogląda z perspektywy jednostki, bowiem to jednostka leży w centrum uwagi pisarza. Jednostka jest porażona zachodzącymi zmianami, gubi się w nich, świat widzi jako zbiór tajemnych mocy szarpiących podstawą jej istnienia, chwieją się wartości, obyczaje, świat wydaje się bez zasad, tajemniczy, nierozpoznawalny, groźny. Taki świat jawi się u Dostojewskiego, Kafki, także u Miłosza, który należy do nielicznych polskich pisarzy podejmujących problematykę metafizyczną. Zatem lektury publikacji pokazujących przyszłość, pisane przy użyciu aparatu naukowego, pełniły dla mnie ważną funkcję – zmniejszania lęku przed przyszłością, godzenia się na nadchodzące zmiany i oswojania z nimi.

Jak jednak przejść od wielkich i dalekich wizji przyszłości do prognozowania, i to prognozowania ekonomicznego? Lektury tekstów dotyczących istoty prognozowania w ogóle, a także prognozowania społecznego, w tym ekonomicznego, nie wzmacniały wiary w skuteczność prognozowania. Z natury rzeczy pojawia się w tych rozważaniach analizowanie różnic między naukami społecznymi i ścisłymi. Uświadomienie sobie głębokich i podstawowych różnic nie uchroniło przedstawicieli nauk społecznych przed próbami przenoszenia aparatu badawczego nauk ścisłych na te ostatnie. Wiara, że zastosowanie matematyki, statystyki pozwoli „uściślić” nauki społeczne, w drugiej połowie XX wieku była ogromna, wygasa jednak stopniowo, nie przynosząc tym naukom nowego paradygmatu, takiego, który pozwoliłby na objaśnienie zjawisk społecznych na tyle pełne, by dać podstawy prognozowaniu. Ekonomia przejęła od fizyki wiele, próbowała tworzyć teorie na wzór fizycznych, np. teorię równowagi, a jednym z ważniejszych „przeniesień” było przejście od ujęć w skali makro do ujęć w skali mikro. To fizycy uznali, że świat można poznać tylko przez badanie świata mikro, przeszli więc od praw formułowanych w skali makro, takich jak prawa Newtona, teoria Einsteina, do teorii mikro, których ukoronowaniem, jak dotąd, jest teoria kwantów, ujęta obecnie w tzw. modelu standardowym. Fizycy dostrzegli w modelu standardowym pewną lukę – model działał przy założeniu, że cząsteczki nie mają masy. Problemy z masą znikają, gdy założy się istnienie jeszcze jednego pola kwantowego. Szkołki fizyk – Peter Higgs – w latach 60. XX wieku zaproponował, by przyjąć, że istnieje pole kwantowe wypełniające cały Wszechświat, a z tym polem związana jest pewna cząsteczka elementarna nadająca masę. Tę cząsteczkę nazwano bozonem Higgsa, potem „boską cząsteczką”, wreszcie po prostu higgsem; należało ją odnaleźć, by dopełnić lukę w modelu standardowym. W tym celu zbudowano Wielki Zderzacz Hadronów w CERN i w 2012 r. wykryto – najprawdopodobniej – higgsa. Zdaniem fizyków to odkrycie jest na miarę przewrotu kopernikańskiego.

Czy ekonomia, przechodząc od analiz makro- do mikroekonomicznych, doczeka się odkrycia cząstki Higgsa? Czy dotychczasowe teorie wskazują na istnienie takiej cząstki? Chodzi o to, czy kolejne teorie dają coraz lepsze objaśnienie świata ekonomii, takie, które będą mogły stać się podstawą prognozowania? Czy taką „cząstkę Higgsa” zawiera koncepcja Kahnemana o nieracjonalności ludzkich zachowań, o tym, że ludzie podejmują decyzje, kierując się intuicją, emocjami, a nie chłodnymi kalkulacjami? Co dla ekonomii wynika z tej koncepcji? Zauważmy, że w fizyce nie ma odrębnej gałęzi zajmującej się prognozowaniem. Prognozuje się tam na podstawie praw nauki, które nieustannie są weryfikowane, modyfikowane, obalane i formułowane na nowo, dając coraz pełniejsze wyjaśnienie rzeczywistości fizycznej.

Wspomniałam wcześniej, że przyglądanie się przyszłości pozwala lepiej rozumieć terażniejszość. Czy wiedząc, że ludzkość przechodziła „wielkie fale”, obecnie spodziewamy się kolejnej, następnej po owej „trzeciej”, o której mówił Toffler? Czy są już sygnały, które ją zapowiadają? Pytanie o nadchodzący kryzys gospodarczy jest tylko najprostszym z rodzących się obecnie i dziś stosunkowo łatwo na nie odpowiedzieć. Tak, będzie kryzys, bo ludzie już weń uwierzyli. Dlaczego Polska łagodnie

przeszła przez kryzys z 2008 r.? Bo Polacy uwierzyli, że „będzie lepiej”, a tak się stało, ponieważ nastąpiła ważna zmiana polityczna. Ten obecnie nadchodzący kryzys może przyspieszyć nadejście „czwartej fali”, w której nastąpią zasadnicze przeobrażenia życia społecznego. Sygnały są już widoczne, a wśród nich warto wspomnieć o ruchach anti-ACTA i Occupied Wall Street. Oba charakteryzują się tym, że nie mają reprezentacji, przywództwa i nie używają przemocy. Ruch anti-ACTA zakwestionował prawo własności, z kolei ruch Occupied Wall Street chce innego urzędnika świata, przede wszystkim świata finansów. Bódcami dla tego ostatniego są narastające zróżnicowania dochodów, ponoszenie kosztów kryzysu nie przez tych, którzy kryzys wywołali, deficyt pracy, zwłaszcza dla młodych, i zapowiadany brak pracy, znacznie dotkliwszy niż obecnie odczuwany, uznawanie nieustającego wzrostu gospodarczego za nierealny, a zatem i rosnący dobrobyt przyszłych pokoleń oraz podobne, zatrważające zjawiska. Czy odpowiedzi na te wizje przyszłości będą zawierały na przykład kultywowanie cnoty umiaru, przeformułowanie działania instytucji finansowych, zastąpienie demokracji pośredniej demokracją bezpośrednią? Albo w przeciwieństwie do już obserwowanej tendencji zmierzającej ku demokracji bezpośredniej powstanie rząd światowy (regionalny), który podejmie wyzwania globalne?

Wydawałoby się, że odpowiedzi na te pytania nie mają znaczenia dla prognozowania ekonomicznego wtedy, gdy horyzont prognozy sięga najwyżej kilku lat. A jednak nawet stopniowe, a zwłaszcza gwałtowne zmiany muszą w takim prognozowaniu być brane pod uwagę.

Przekonanie o zawodności prognoz ekonomicznych jest dość ugruntowane, nie wiadomo nawet, czy obecne prognozy są bardziej trafne niż niegdysiejsze wróżby i prococtwa. Zatem zasadne jest pytanie – czy należy nadal uprawiać prognozowanie ekonomiczne? Moja odpowiedź brzmi TAK. TAK, dlatego przede wszystkim, że jest na nie zapotrzebowanie, istniejące od zarania dziejów człowieka i raczej wzmagające się niż wygasające. Widocznie przewidywanie przyszłości dawało korzyści praktyczne i ewolucyjne, wskazanie nawet tylko kierunku zmian pozwala na skupienie wysiłków na wybranej dziedzinie czy dziedzinach, nie zaś na wszystkich. Po drugie, prognozowanie jest działalnością intelektualną, ćwiczącą nasz umysł i chociażby dlatego warto je uprawiać. Z tego, że część prognoz jest nietrafnych, nie należy wyciągać wniosku, że wszystkie zawiodły. Warto pamiętać, że kto przepowiada koniec świata, ma rację tylko raz.

Należy jednak starać się o rzetelność tego działania. Widzę tu dwa aspekty. Pierwszy – ujawniać założenia przyjmowane przy opracowywaniu prognozy. Jeśli chcemy wzorować się na fizykach, to zauważmy, że każda teoria jest opatrzona założeniami („ciało spadające w próżni...”). Spróbujmy i my podawać założenia, chociaż nam przyjdzie to trudniej niż fizykom. Po drugie publikujmy prognozy. Nie wystarczy wymyślić nowej metody prognozowania i podać przemawiających za nią argumentów natury teoretycznej, wynikających z nauk pokrewnych, zwykle statystyki, albo i z ekonomii – co robimy rzadziej, tj. nie odwołujemy się do istoty

zjawiska prognozowanego. Prognozowanie jest działaniem praktycznym, więc ostatecznym rozstrzygnięciem o dobroci metody jest doświadczenie. Poddawajmy się testowi praktyki i wyciągajmy z niego wnioski.

Uważam, że metody prognozowania warto podzielić na trzy grupy:

- prognozowanie przez analogię z przeszłością obiektu, dla którego opracowujemy prognozę; prognozę otrzymuje się jako przeniesienie przeszłości zmiennej prognozowanej w jej przyszłość,
- prognozowanie przez analogię z przeszłością innych obiektów; prognozę otrzymuje się jako przeniesienie przeszłości tej samej zmiennej lub różnych zmiennych z kilku, wybranych ze względu na pewne kryterium obiektów, do obiektu będącego przedmiotem zainteresowań prognosty,
- prognozowanie z wykorzystaniem wiedzy o istocie przewidywanych zjawisk i intuicji.

Podstawą wyodrębnienia tych grup są fundamentalne założenia leżące u podstaw konstrukcji prognozy. W przypadku pierwszej grupy założenie może być sformułowane w dwojaki sposób: zbiór czynników oddziałujących na zmienną prognozowaną jest stały w czasie i sposób oddziaływania czynników nie ulega zmianie albo – zbiór czynników i ich oddziaływania zmienia się w przyszłości, ale sama zmienna prognozowana zachowa swą autonomię. Inaczej mówiąc i sprowadzając to założenie do jego istoty – zmienna prognozowana zachowuje się zgodnie z właściwym jej prawem.

W przypadku drugiej grupy zakładamy, że co najmniej niektóre obiekty, spośród zbioru obiektów o takim samym charakterze, przeszły drogę rozwoju, jaka czeka obiekt, dla którego sporządzamy prognozę. Abstrahujemy tu – podobnie jak w przypadku grupy pierwszej – od zmienności otoczenia w przyszłości, od zmiany zbioru czynników i ich oddziaływań.

W przypadku trzeciej grupy brak jest ogólnego założenia. Każdy badacz na swój sposób wykorzystuje swą wiedzę, doświadczenie dla formułowania hipotez o przyszłości. Powinien więc za każdym razem podać, przy jakich założeniach to czyni.

SOME REMARKS ON THE ECONOMIC FORECASTING

Summary: The authoress confronts future's visions done by belles-lettres and scientific forecasts emphasizing the role of the latter in diminishing the fear of future. She points out essential differences between forecasting made by exact and social sciences. She demands that social and, especially, economic forecasters should be more responsible for the quality of forecasts, what may be achieved, among other things, by revealing assumptions accepted for constructing forecasts and publication of the results of forecasting. The authoress gives the classification of forecasting methods based on general forecasting assumptions.

Keywords: visions of future done by belles-lettres and forecasting made by exact and social sciences, responsibility of forecasters, classification of forecasting methods.