

Szanse i zagrożenia związane z przystąpieniem Polski do strefy euro w ujęciu regionalnym

P. Gajewski

K. Gawlikowska-Hueckel

S. Umiński

Plan prezentacji

- Uzasadnienie podjęcia tematu
 - Analizowane zagadnienie i struktura projektu
 - Dane statystyczne
 - Wyniki
 - Wnioski
-

Uzasadnienie

- ❑ Istnieją obawy, że niektóre regiony (szczególnie słabo rozwinięte tereny wschodnie) ucierpią na skutek wzmożonej konkurencji i drenażu zasobów
 - ❑ Wewnątrzregionalna koncentracja problemów jest groźna ze względu na implikacje społeczne (obawy społeczne)
 - ❑ Teoria ekonomii (i geografii ekonomicznej) oraz doświadczenia wskazują, że efekty przyjęcia euro mogą być przestrzennie zróżnicowane, przynajmniej w krótkim okresie (Begg, 2003)
 - ❑ Dotychczasowe analizy kosztów i korzyści przystąpienia Polski do strefy euro pomijały tematykę ewentualnego nierównomiernego ich rozłożenia na szczeblu regionalnym
-

Struktura projektu

- ❑ Województwa na tle strefy euro – struktura gospodarcza
 - ❑ Handel zagraniczny województw – otwartość i struktura
 - ❑ Zbieżność cykliczna województw z Polską i strefą euro
-

Dane

- ❑ WDB według 17 sekcji NACE (A-P), w latach 2003-2005, zdezagregowane do poziomu NUTS 2 (województwa) – GUS, dla strefy euro – Eurostat
 - ❑ Dane indywidualne dotyczące eksportu, zdezagregowane do poziomu województw – baza danych zespołu Gdańskiego
 - ❑ Dane dotyczące liczby pracujących, kwartalne za lata 1995-2007, zagregowane – BAEL
-

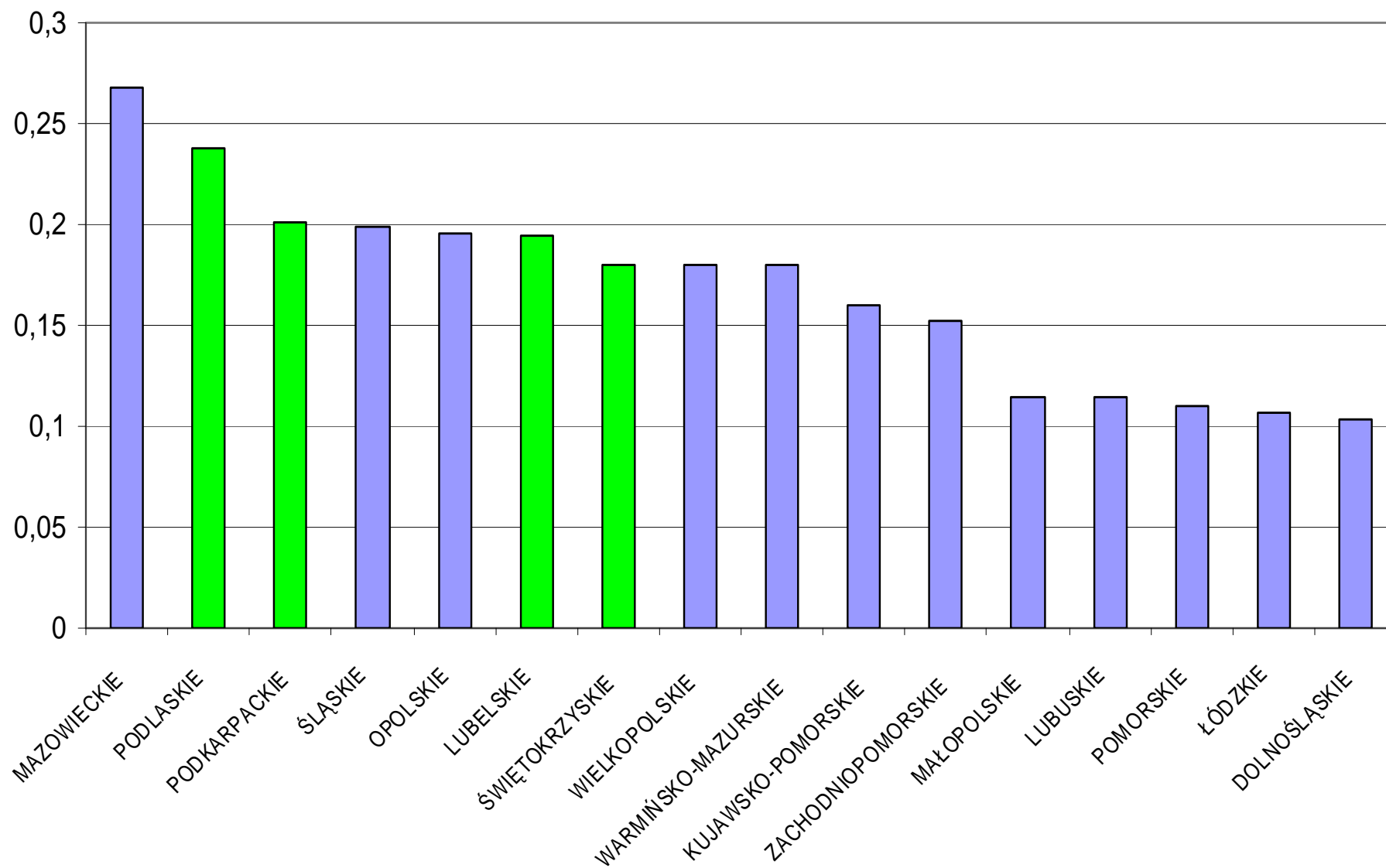
Indeks specjalizacji regionalnej Krugmana (1991)

$$K_{kl} = \sum_i |s_{ik}^s - s_{il}^s|, K \in \langle 0, 2 \rangle$$

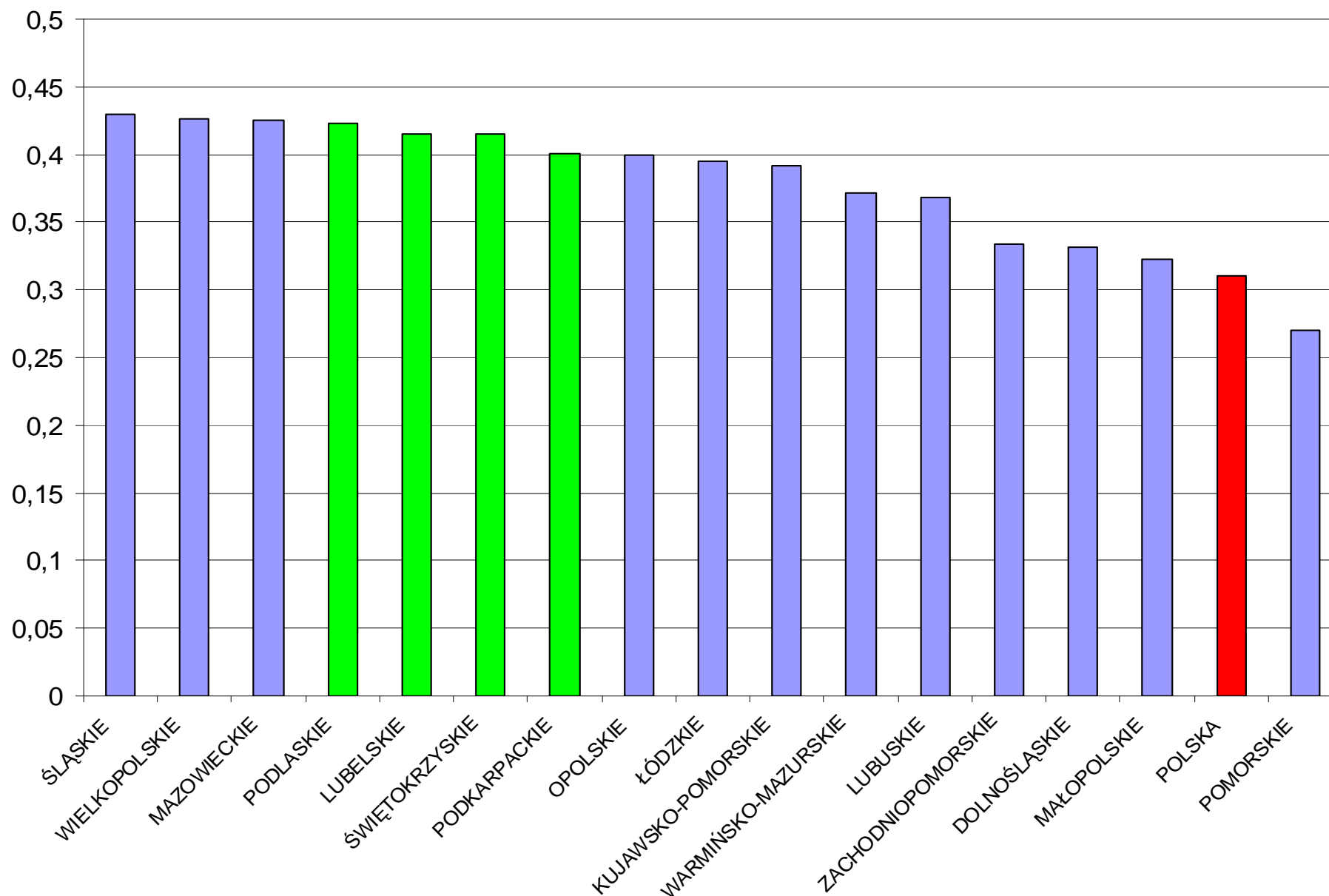
$s_{ik(l)}^s$ Udział WDB w gałęzi i , w regionie $k(l)$ w WDB ogółem regionu $k(l)$.

Np. jeżeli dwa regiony k i l mają identyczne struktury gałęziowe tworzenia wartości dodanej, wówczas $K_{kl}=0$.

Indeks Krugmana, benchmark: Polska



Indeks Krugmana, benchmark: strefa euro



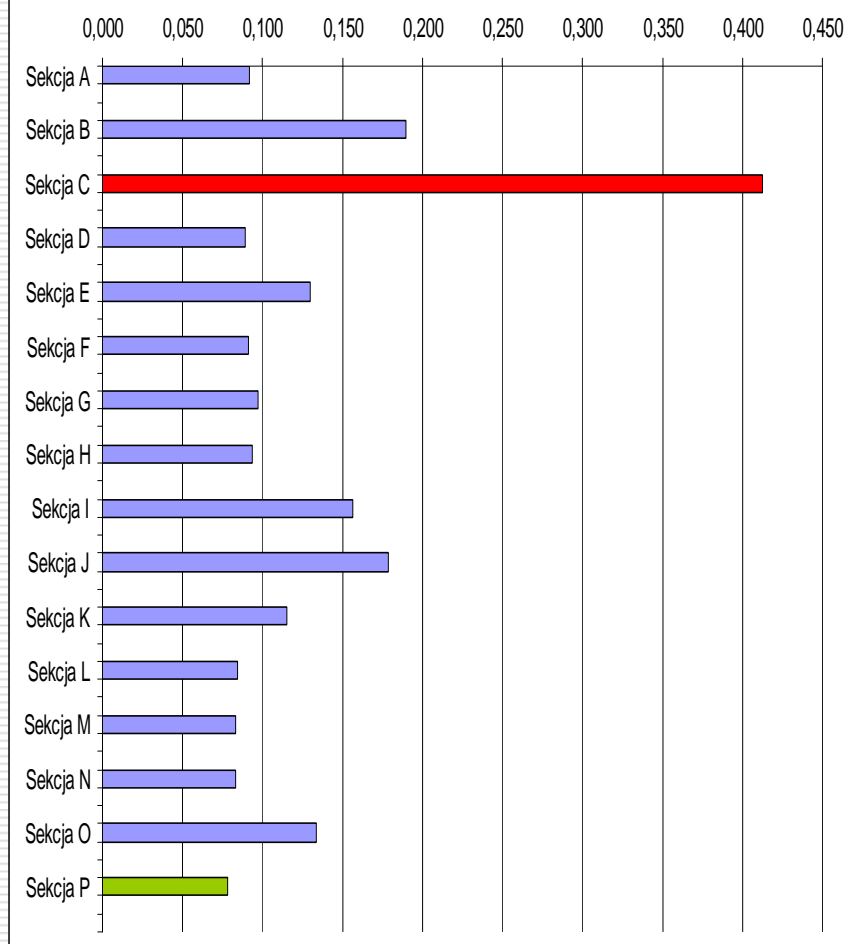
Indeks koncentracji gałęzi Herfindahl

$$H_i = \sum_k (s_{ik}^c)^2, H \in (0,1)$$

s_{ik}^c Udział wartości dodanej wytworzonej w branży i , w regionie k , w stosunku do wartości dodanej ogółem w branży i .

Np. gdyby cała wartość dodana gałęzi wytwarzana była w jednym regionie, wówczas udział dla tego regionu wynosiłby 1, dla pozostałych regionów byłby równy 0 i, w konsekwencji, H_i wyniósłby 1.

Herfindahl wg sekcji PKD



A - Rolnictwo, łowiectwo i leśnictwo

B - Rybactwo

C - Górnictwo

D - Przetwórstwo przemysłowe

E - Wytwarzanie i zaopatrywanie w energię elektryczną, gaz, wodę

F - Budownictwo

G - Handel hurtowy i detaliczny; naprawa pojazdów samochodowych, motocykli oraz artykułów użytku osobistego i domowego

H - Hotele i restauracje

I - Transport, gospodarka magazynowa i łączność

J - Pośrednictwo finansowe

K - Obsługa nieruchomości, wynajem i usługi związane z prowadzeniem działalności gospodarczej

L - Administracja publiczna i obrona narodowa; obowiązkowe ubezpieczenie społeczne i powszechne ubezpieczenie zdrowotne

M - Edukacja

N - Ochrona zdrowia i pomoc społeczna

O - Działalność usługowa komunalna, społeczna i indywidualna, pozostała

P - Gospodarstwa domowe zatrudniające pracowników

Struktury gospodarcze - podsumowanie

- ❑ Nie można potwierdzić hipotezy o znacznym ryzyku pogłębienia polaryzacji pod względem poziomu rozwoju gospodarczego
 - ❑ Relatywnie zbliżone do strefy euro struktury gospodarcze mają: Pomorskie, Małopolskie, Dolnośląskie, Zachodniopomorskie
 - ❑ Największe zagrożenie dotyczy: Śląskiego, Wielkopolskiego i Mazowieckiego
-

Dlaczego analiza handlu regionów?

- ❑ Zazwyczaj analizy handlu zagranicznego prowadzone są na poziomie kraju
 - ❑ Ciekawe obserwacje i wnioski na poziomie województw
 - ❑ Wbrew pesymistycznym scenariuszom, w warunkach członkostwa w UE – bardzo dynamiczne zmiany, szczególnie na poziomie województw
 - ❑ Różnią się województwa (profile konkurencyjności, napływ kapitału zagranicznego, struktura przemysłu, stopień rozwoju ...) → różne profile handlu zagranicznego
-

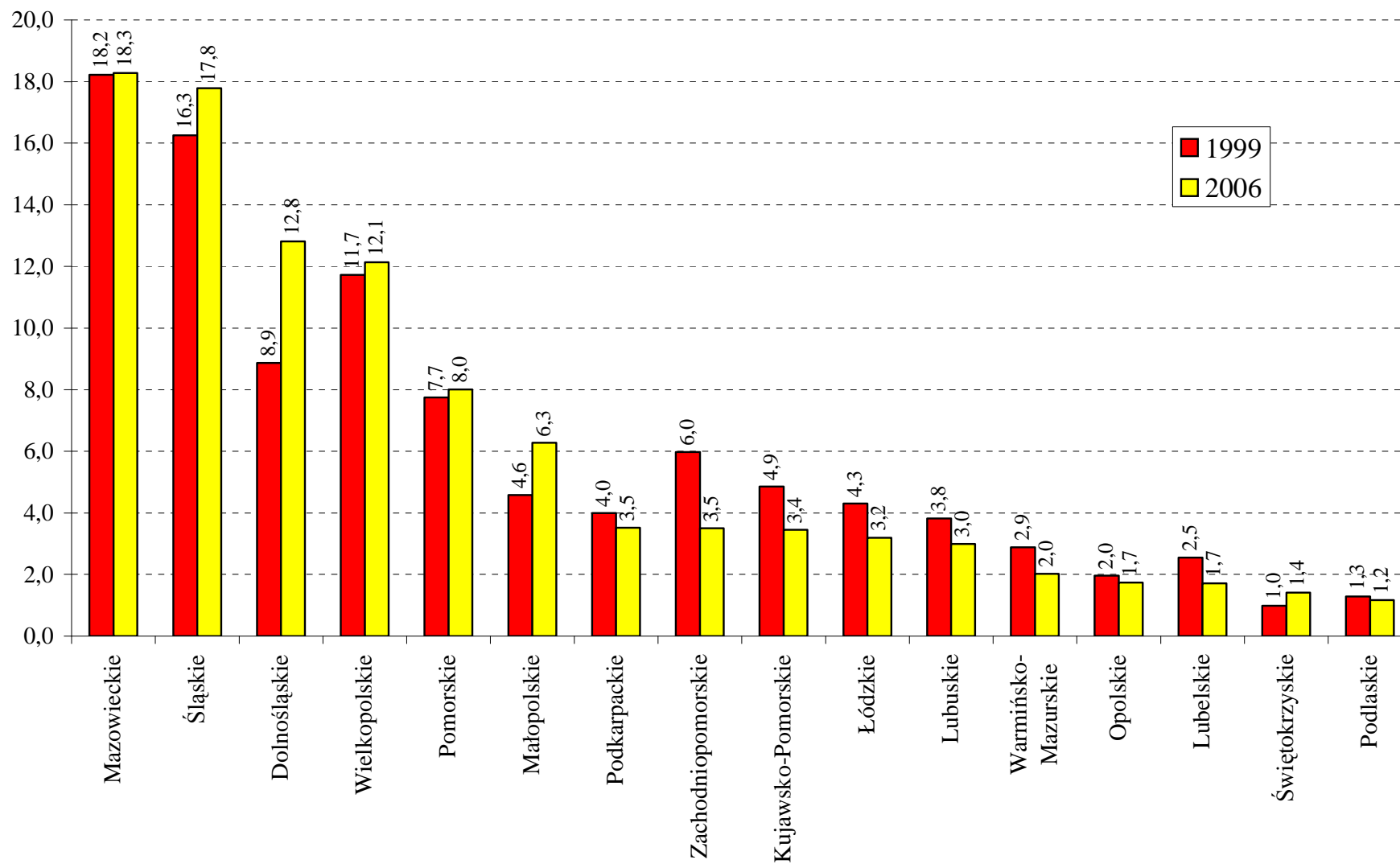
Wejście do strefy euro a HZ

- Różne stopnie „otwarcia” województw na HZ oraz różna ekspozycja na ryzyko handlowe
 - Różne „geograficzne profile handlowe”, odmienna intensywność powiązań handlowych
 - Przestrzenne zróżnicowanie skutków
-

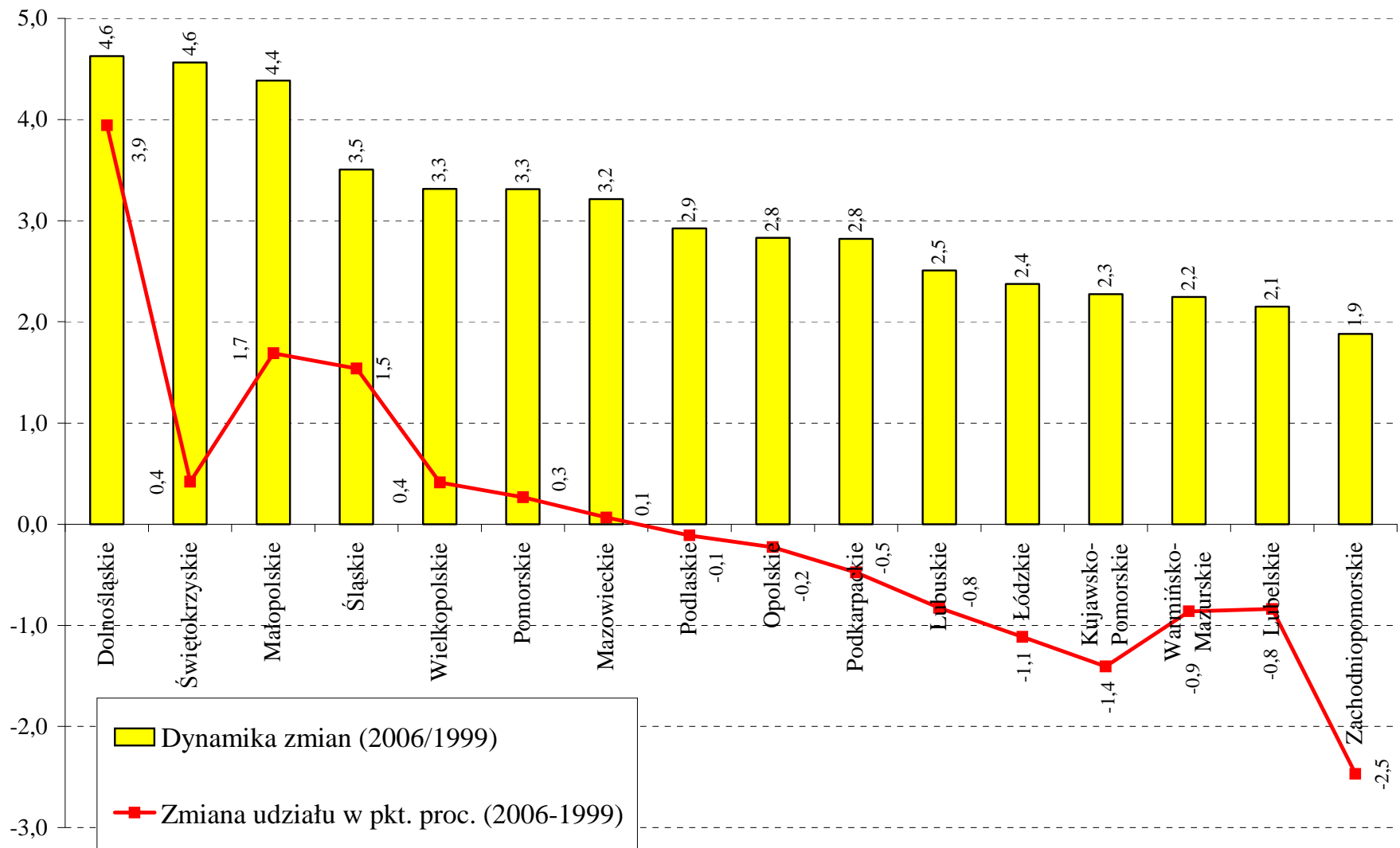
Aspekty teoretyczne

- ❑ Analizy HZ regionów – *in statu nascendi*
 - ❑ Opracowania dla HZ regionów USA i Kanady
 - ❑ Głównie analizy wpływu eksportu na zatrudn.
 - ❑ Problem z teorią bazy eksportowej
 - ❑ Mnożnik HZ dla gospodarek regionalnych
 - ❑ Struktura regionalnego eksportu:
(non)tradables, art. rolne
 - ❑ Analizy regionalnego HZ w ocenie konkurencyjności
 - ❑ Problemy *border effect* oraz *home bias*
-

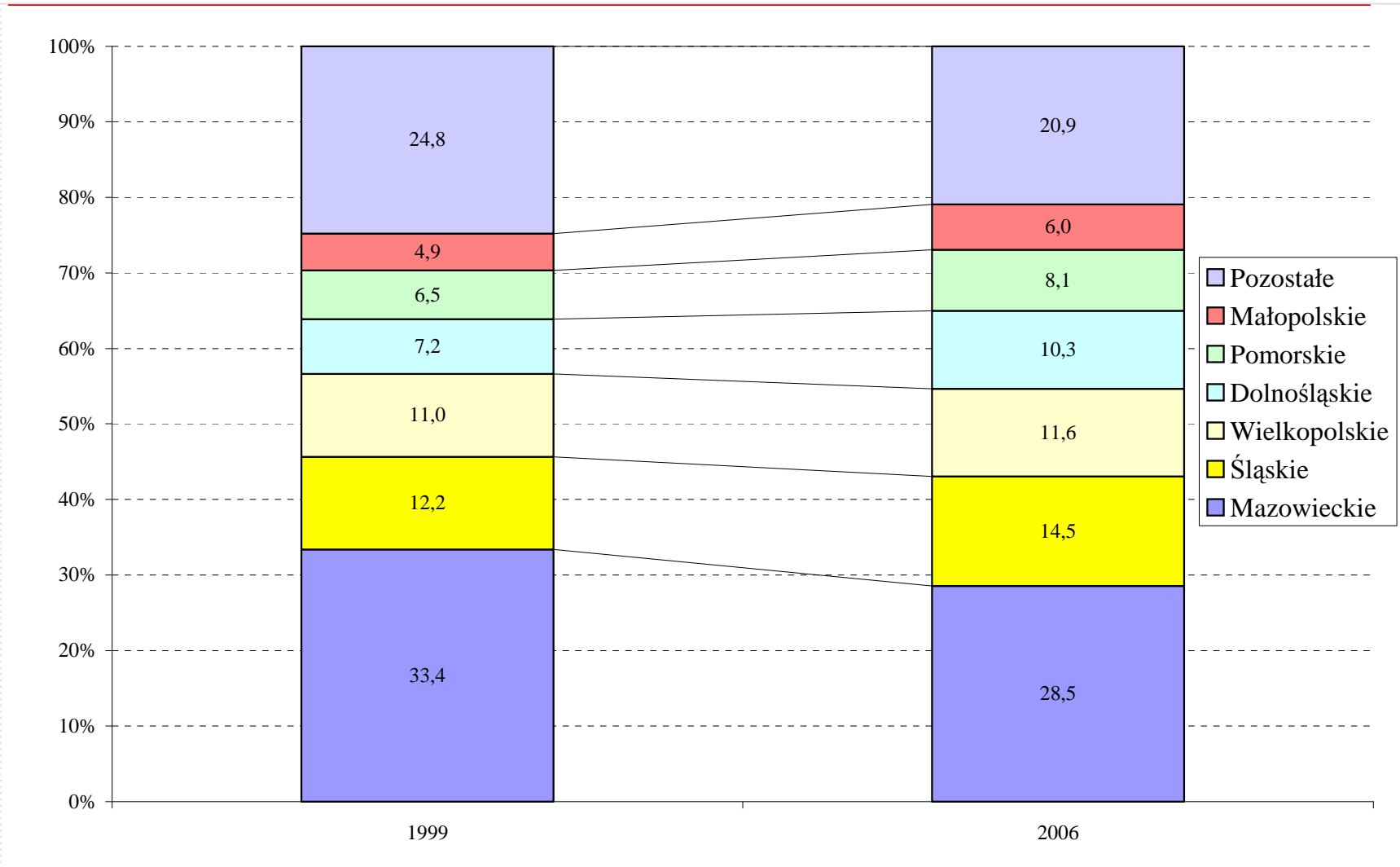
Udziały województw w eksporcie Polski (%)



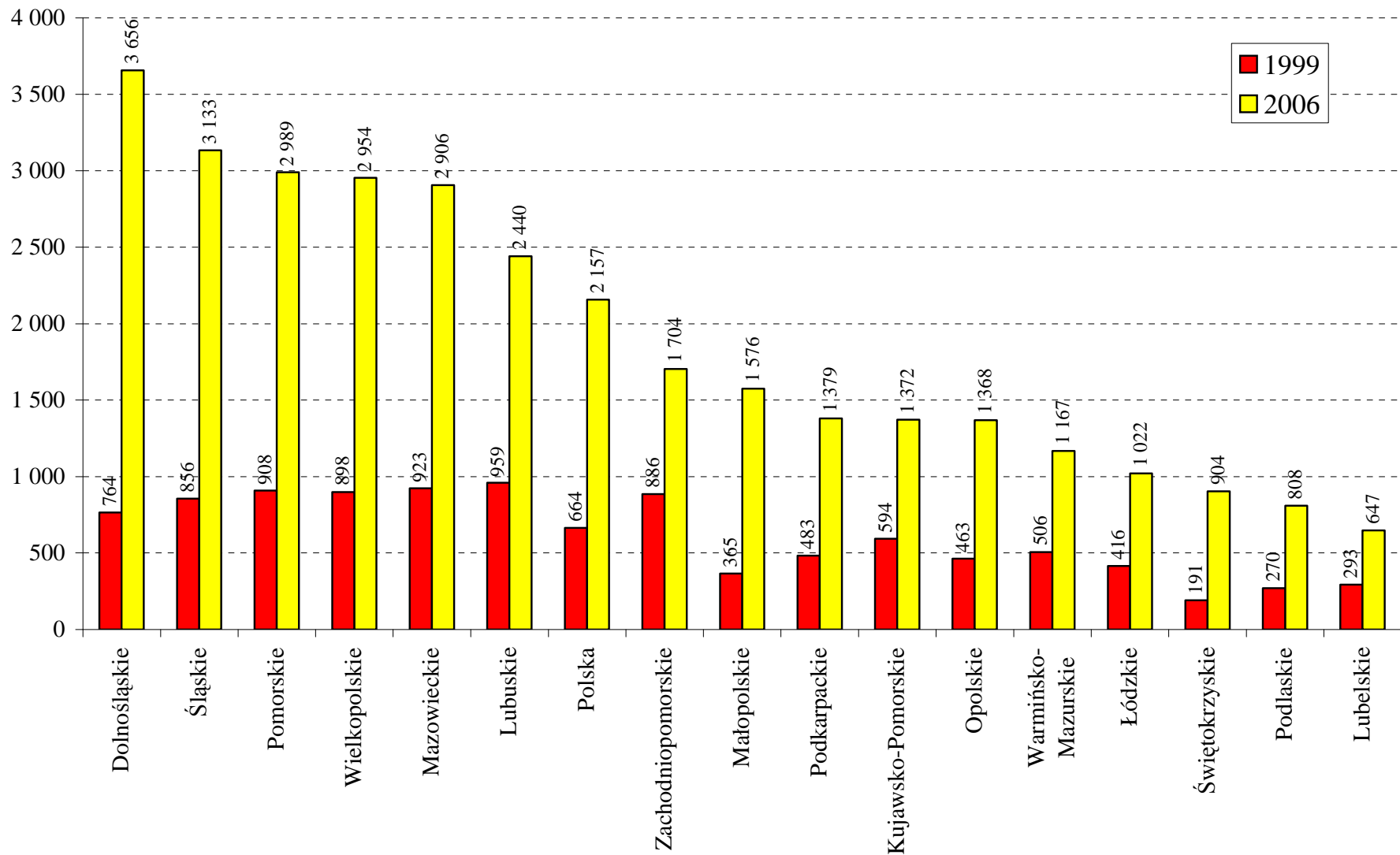
Dynamika zmian eksportu województw w latach 1999-2006



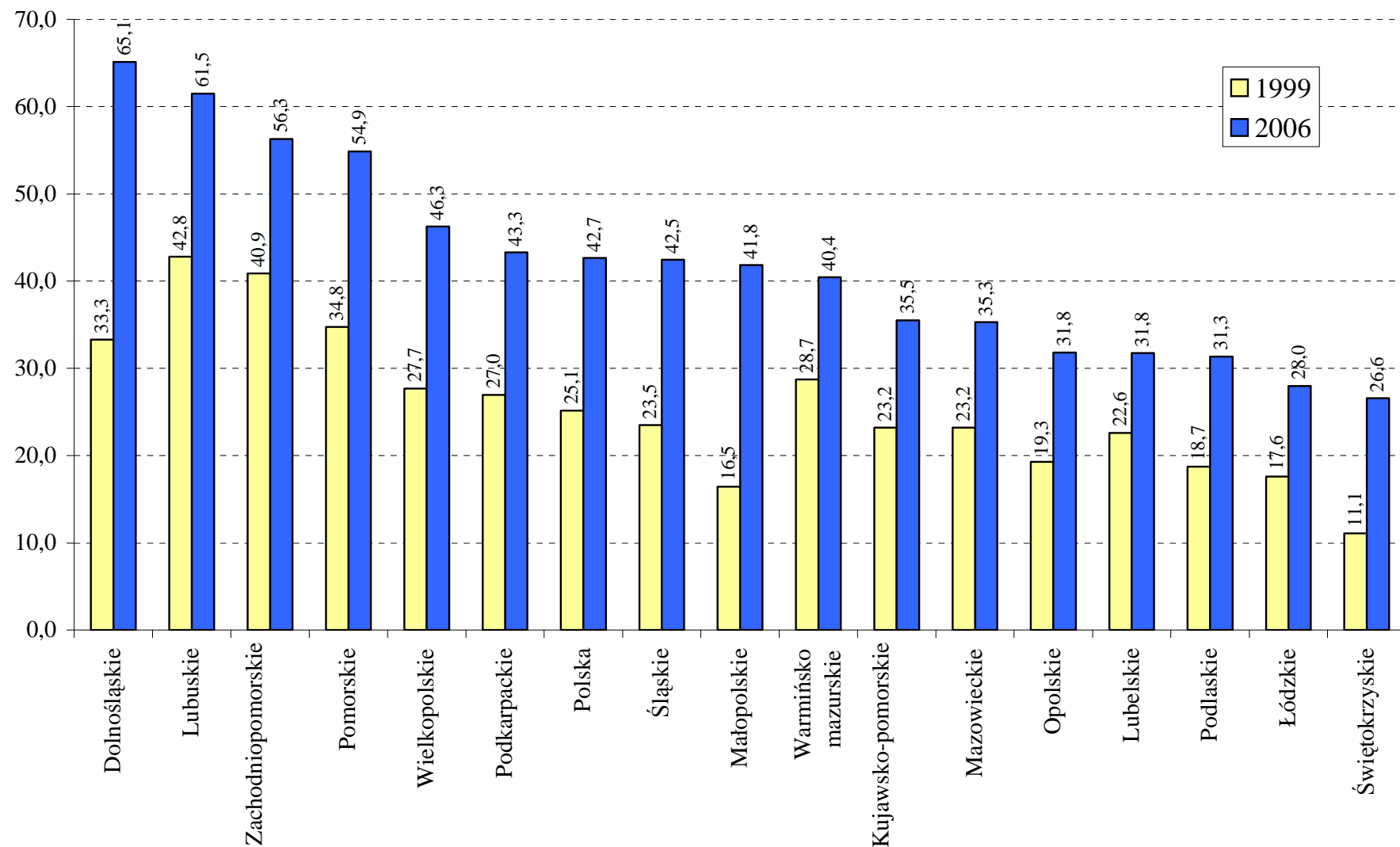
Udział województw w HZ Polski (suma wartości eksportu i importu) (%)



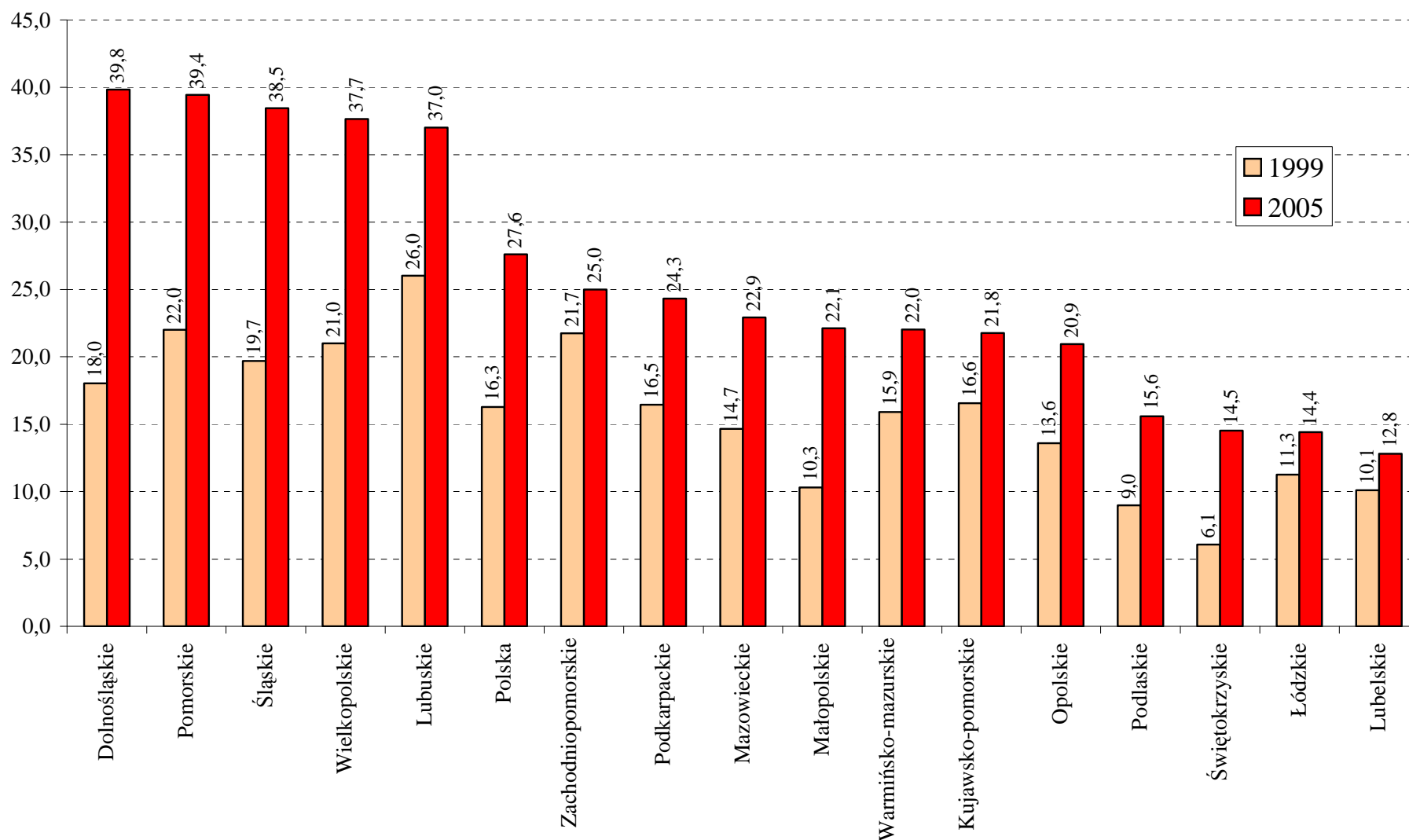
Eksport *per capita* (euro)



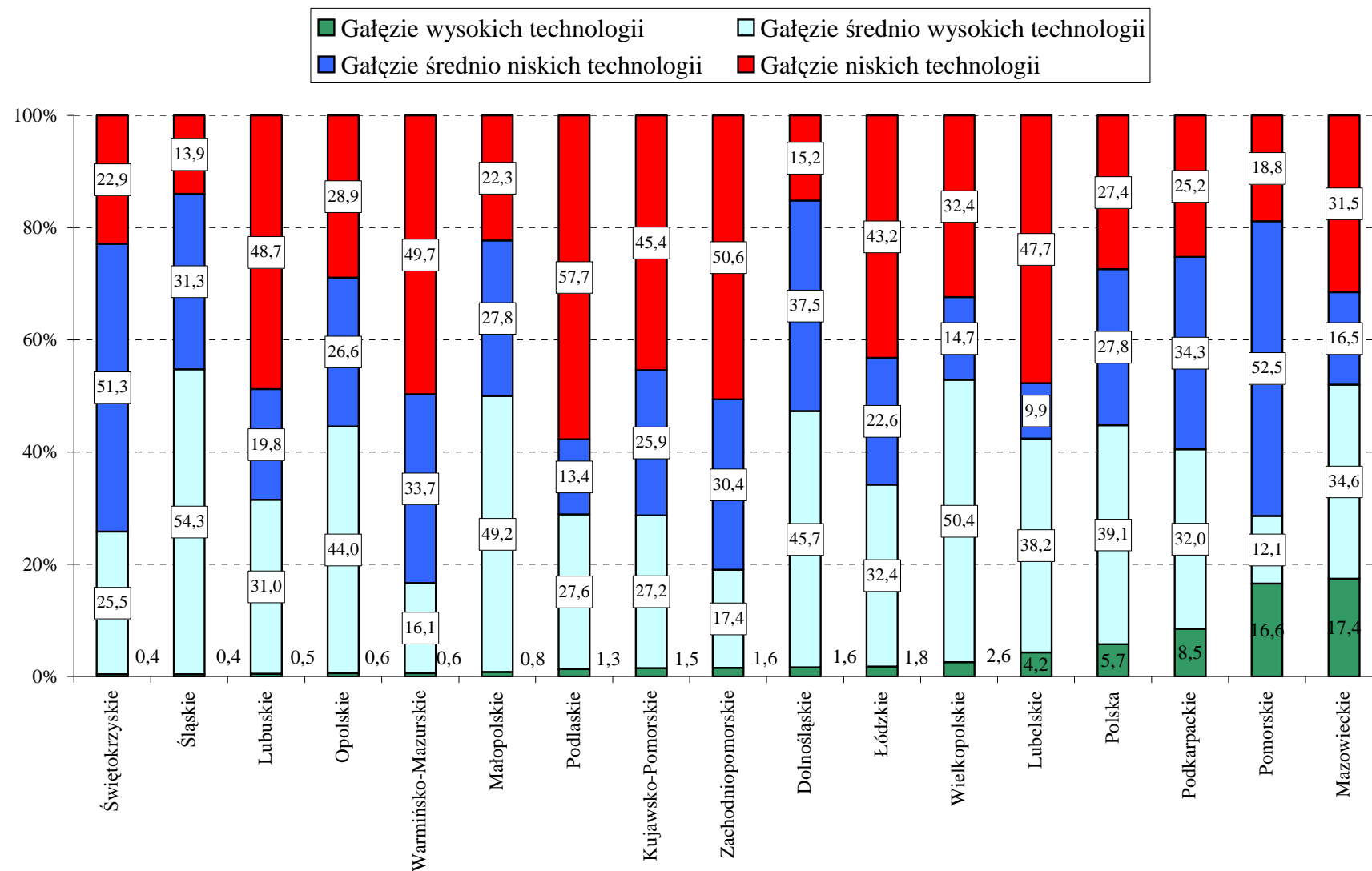
Relacja wartości eksportu do produkcji sprzedanej przemysłu (%)



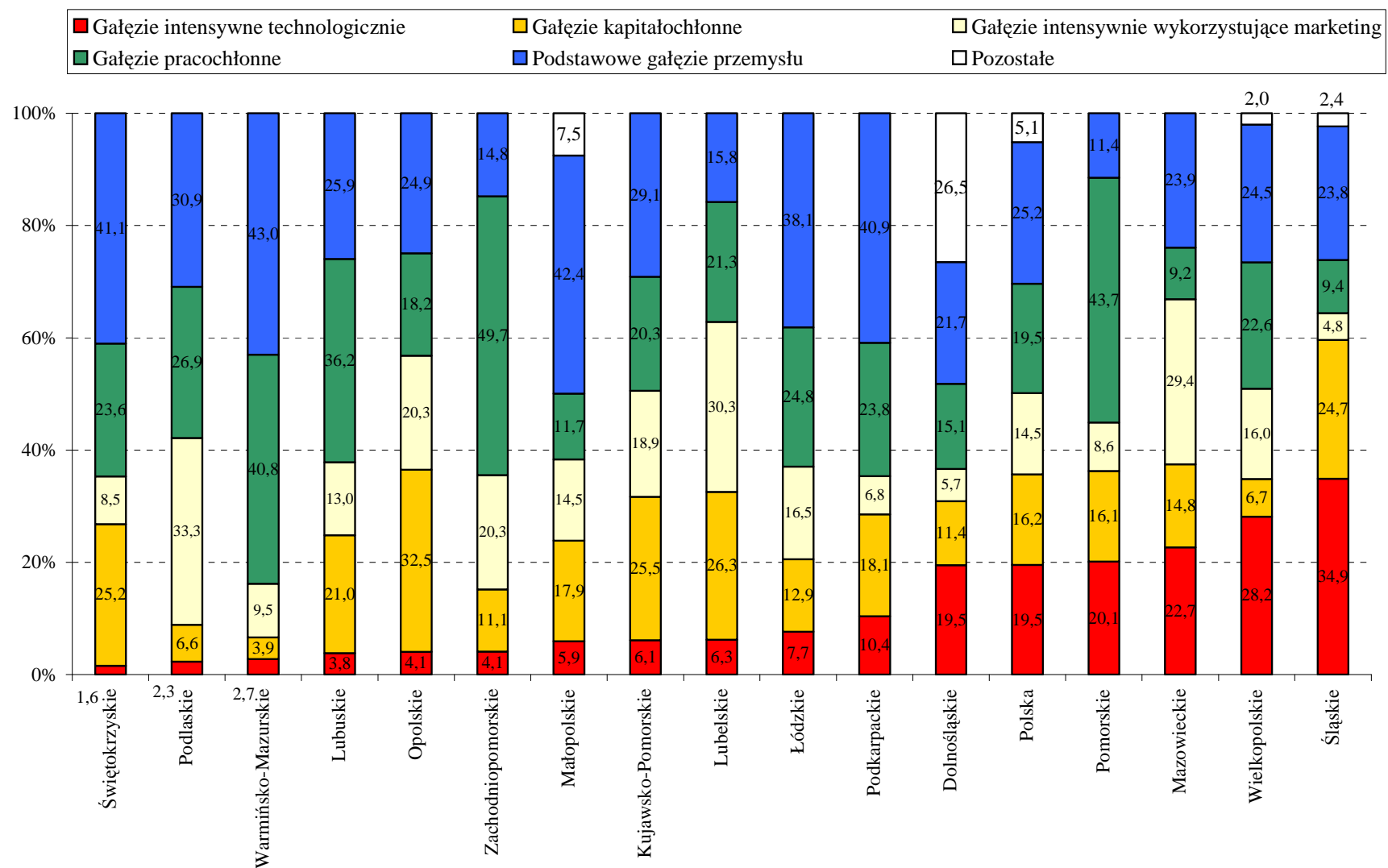
Relacja wartości eksportu do PKB w roku 1999 oraz 2005 (%)



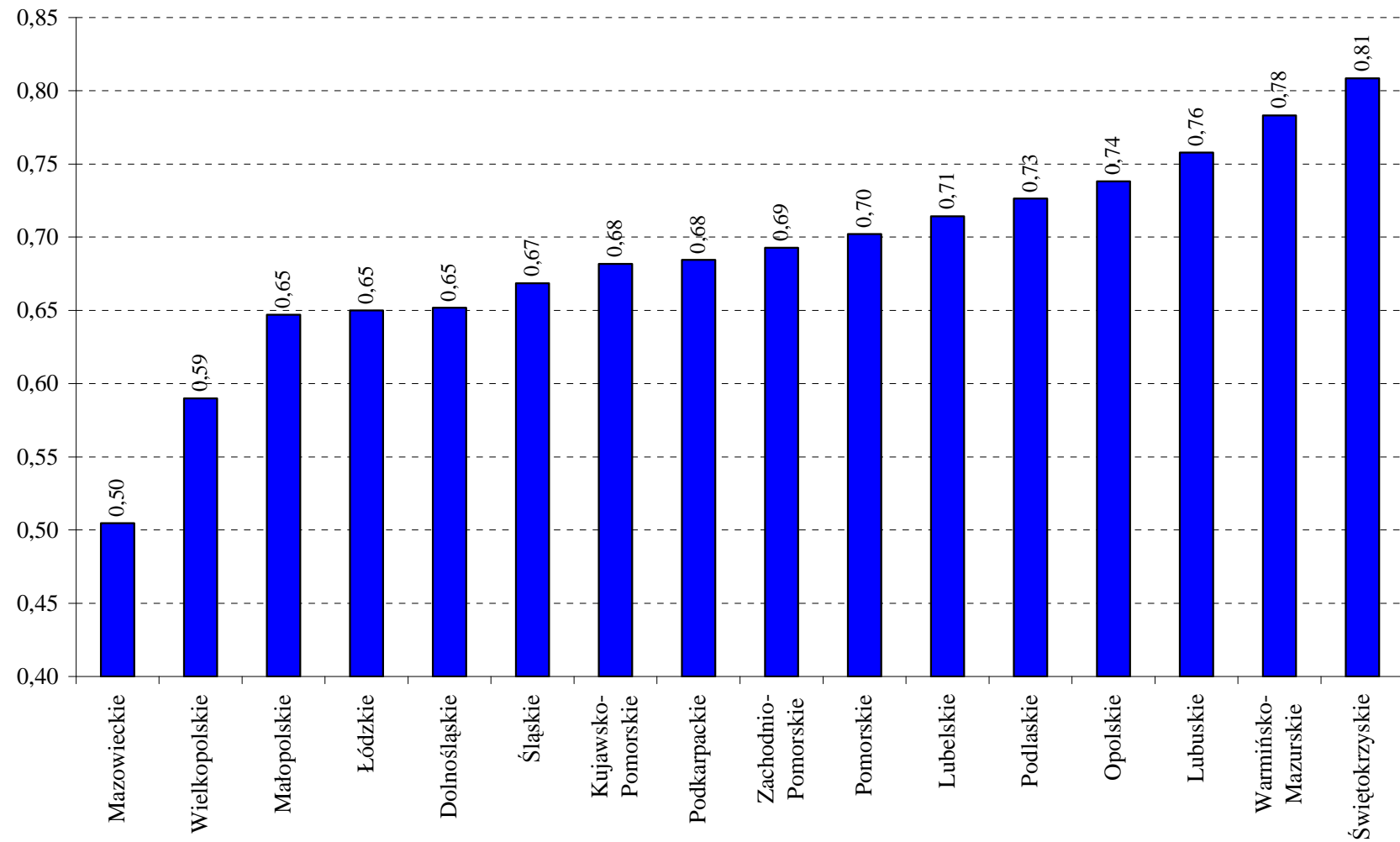
Eksport według intensywności czynników produkcji w 2006 roku – klasyfikacja OECD



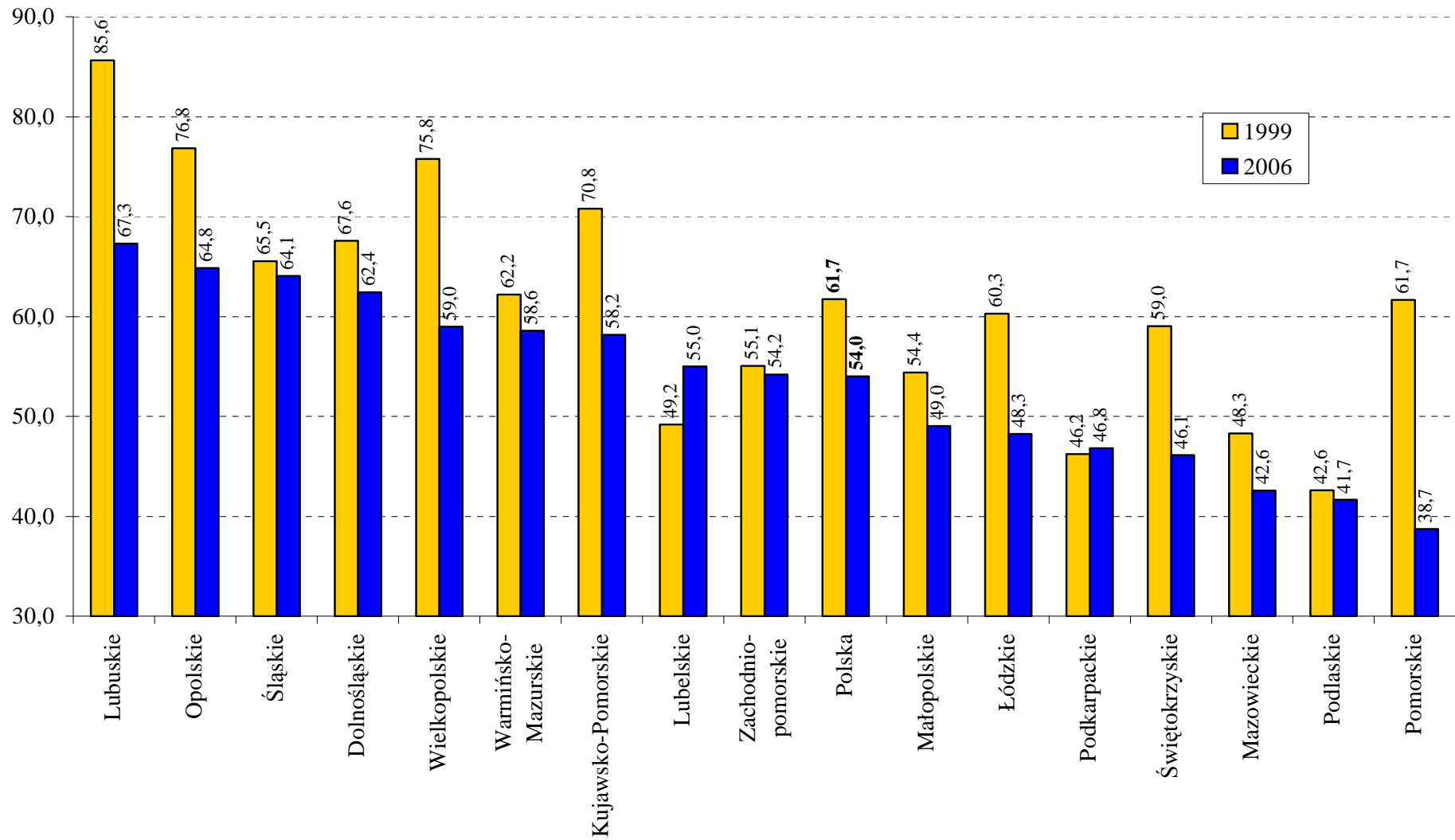
Eksport według intensywności czynników produkcji w 2006 roku – klasyfikacja WIFO1



Wsp. Clarka struktury produktowej eksportu względem struktury eksportu Polski (2006)



Udział krajów strefy euro w eksporcie woj. ogółem (%)



Intensywność powiązań eksportowych do strefy euro

	1999	2000	2001	2002	2003	2004	2005	2006
Dolnośląskie	1,09	1,20	1,27	1,30	1,29	1,28	1,24	1,16
Kujawsko-Pomorskie	1,15	1,11	1,08	1,06	1,03	1,02	1,07	1,08
Lubelskie	0,80	0,82	0,82	0,86	0,88	0,95	0,92	1,02
Lubuskie	1,39	1,33	1,32	1,29	1,28	1,25	1,27	1,25
Łódzkie	0,98	0,95	0,94	0,97	0,97	0,97	0,93	0,89
Małopolskie	0,88	0,88	0,87	0,88	0,86	0,86	0,90	0,91
Mazowieckie	0,78	0,75	0,74	0,72	0,67	0,68	0,75	0,79
Opolskie	1,25	1,25	1,20	1,19	1,19	1,19	1,21	1,20
Podkarpackie	0,75	0,75	0,79	0,82	0,85	0,87	0,88	0,87
Podlaskie	0,69	0,78	0,75	0,78	0,84	0,88	0,94	0,77
Pomorskie	1,00	0,95	0,83	0,74	0,70	0,72	0,65	0,72
Śląskie	1,06	1,11	1,16	1,18	1,22	1,16	1,17	1,19
Świętokrzyskie	0,96	0,89	0,97	0,95	0,97	0,94	0,92	0,85
Warmińsko-Mazurskie	1,01	0,99	1,01	1,06	1,13	1,13	1,13	1,08
Wielkopolskie	1,23	1,22	1,21	1,22	1,19	1,12	1,09	1,09
Zachodniopomorskie	0,89	0,85	0,89	0,94	0,97	0,99	0,99	1,00

Handel zagraniczny - podsumowanie

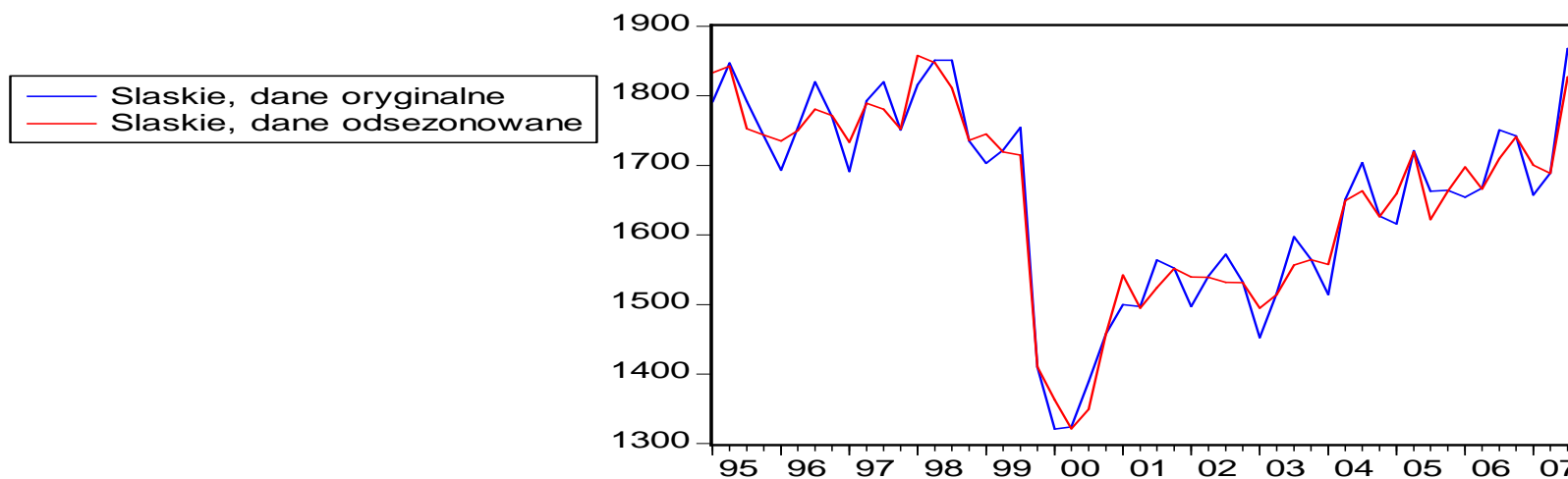
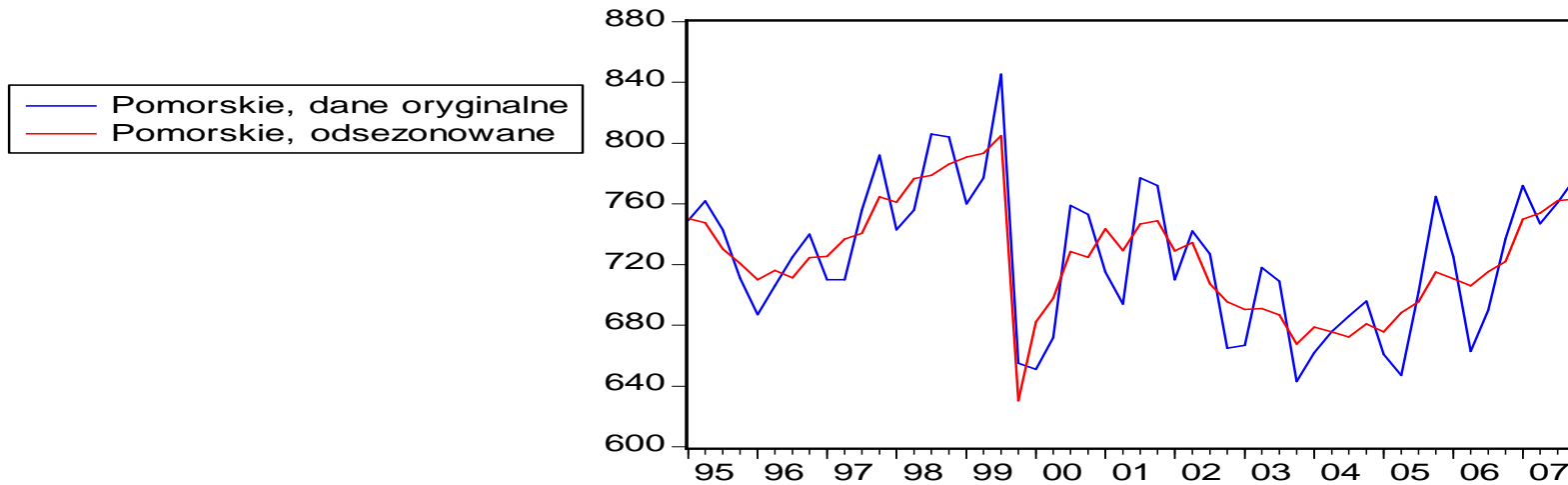
- „Bardzo” różne profile handlowe województw, stopień otwarcia, intensywność powiązań z UE i ze strefą euro
- Rozkład skutków wejścia do eurolandu w przestrzeni
- Nowa geografia ekonomiczna → wzrost skali produkcji → pogłębienie polaryzacji „profilu” handlowych → ciążenie ku bliskiej zagranicy
- Monitoring atrakcyjności inwestycyjnej regionów (FDI jako stymulator zmian)
- **„Kto zyska, kto straci, kto jest predystynowany” – OTO JEST PYTANIE**

- 1. Kryterium otwartości (eksport *per capita*):** Dolnośląskie, Śląskie, Pomorskie, Wielkopolskie, Mazowieckie oraz Lubuskie
- 2. Kryterium otwartości (eksport w produkcji sprzed. i PKB):** Dolnośląskie, Lubuskie, Pomorskie, Wielkopolskie, Zachodniopomorskie oraz Śląskie
- 3. Silne powiązania eksportowe z UE:** Dolnośląskie, Opolskie, Śląskie, Lubuskie, Wielkopolskie, Małopolskie oraz Warmińsko-Mazurskie
- 4. FDI w eksporcie:** Lubuskie, Wielkopolskie, Śląskie, Mazowieckie oraz Dolnośląskie
- 5. Podobieństwo struktury eksportu do Polski ogółem:**
Wielkopolskie i Mazowieckie
- 6. Niski stopień koncentracji produktowej eksportu:**
Opolskie, Lubelskie, Lubuskie, Mazowieckie, Kujawsko-Pomorskie i Łódzkie

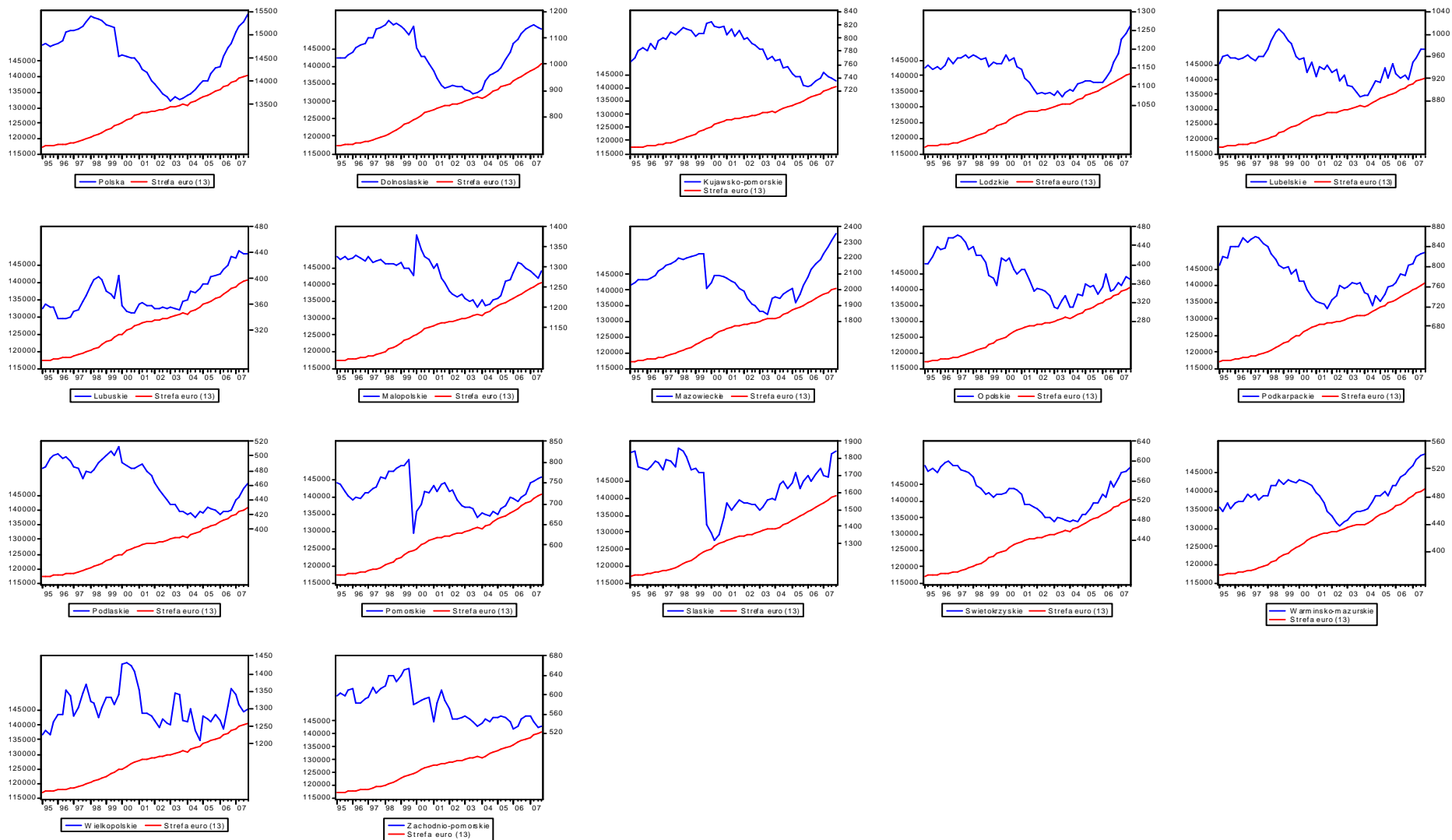
Zbieżność cykliczna

- Dane dotyczące produkcji przemysłowej – roczne, 1995-2006, kwartalne od 2001
 - Dane dotyczące PKB – roczne, 1995-2005
 - Dane dotyczące pracujących – kwartalne, 1995-2007. Słaba jakość...
-

Problemy z danymi



Zatrudnienie w województwach i strefie euro

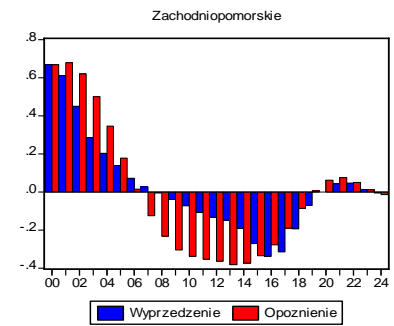
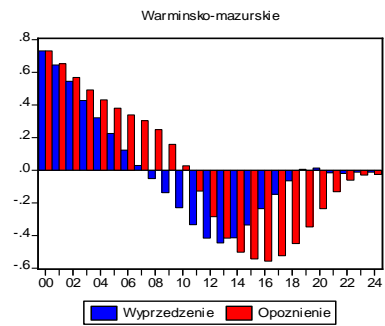
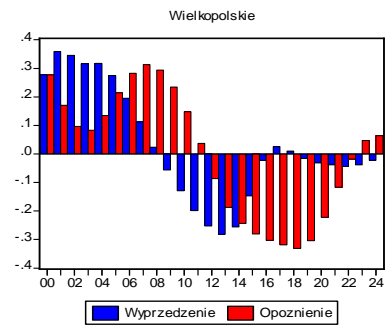
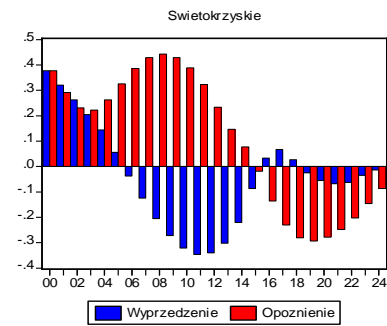
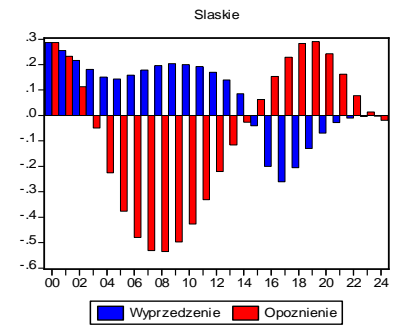
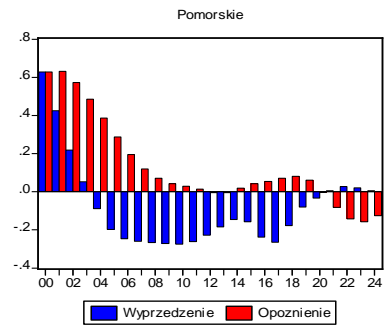
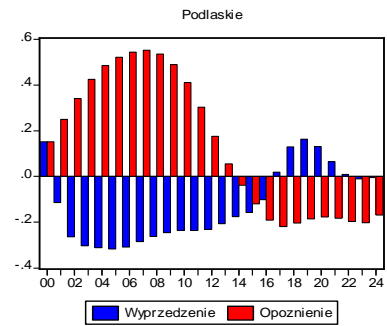
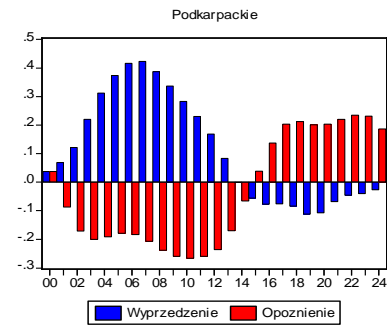
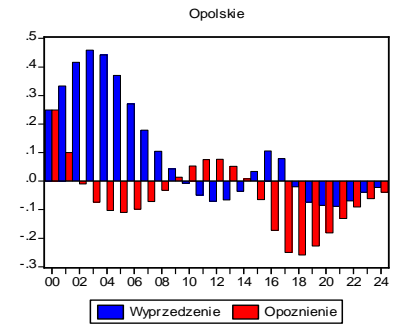
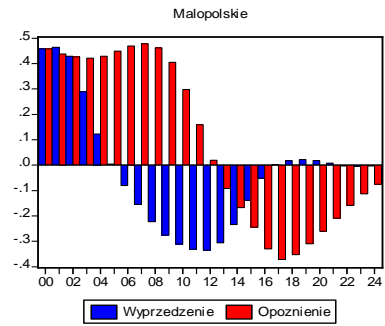
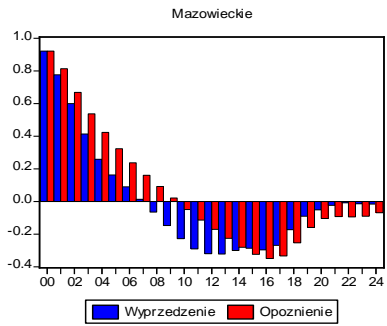
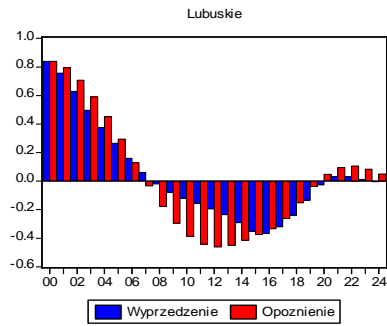
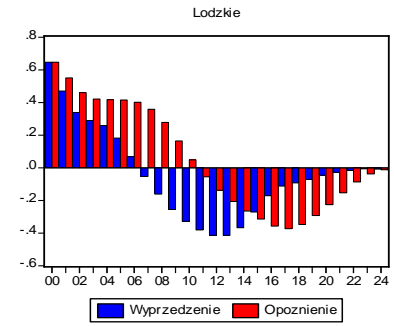
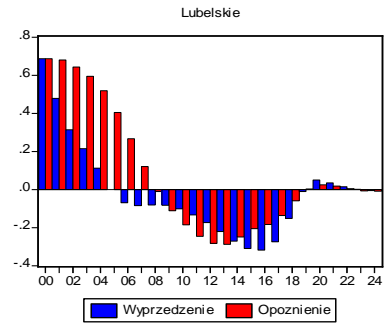
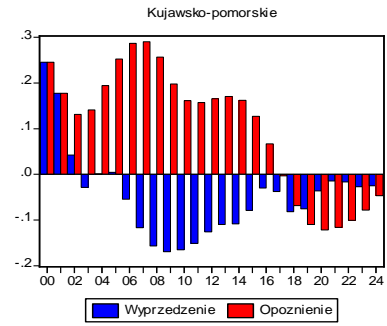
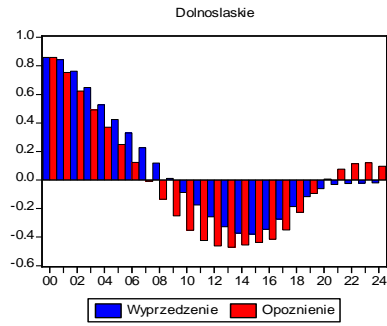


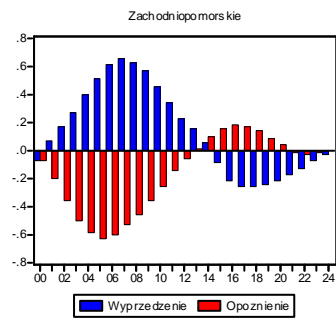
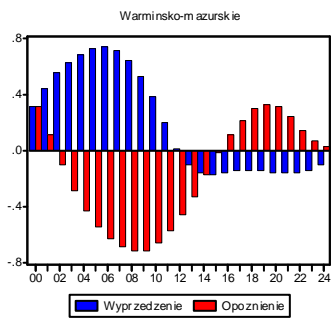
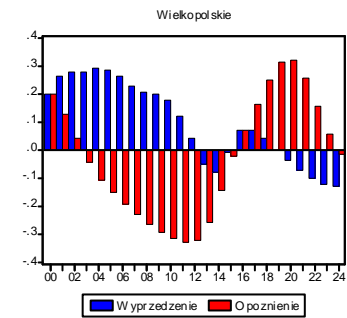
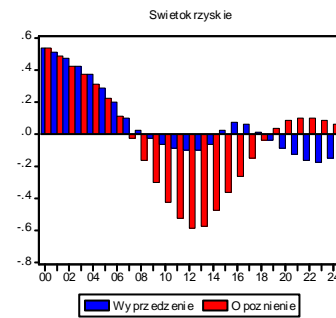
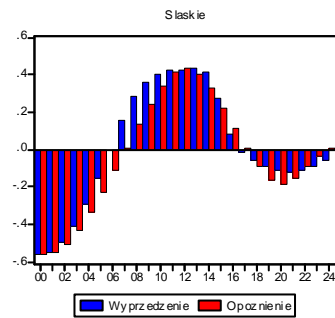
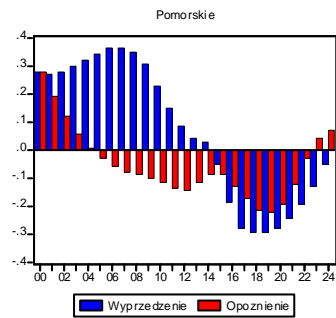
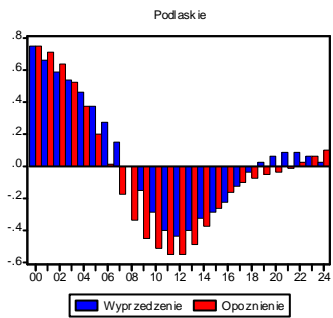
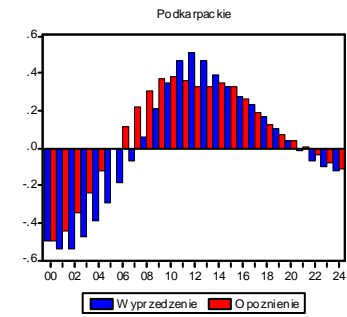
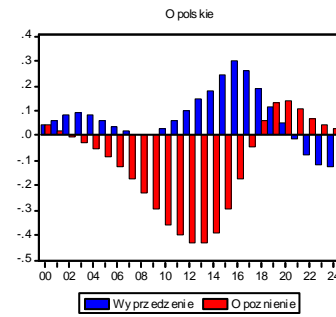
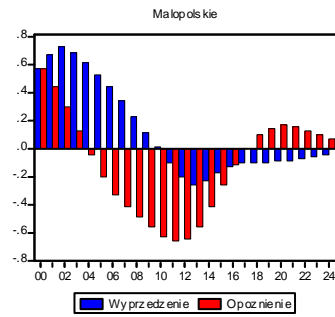
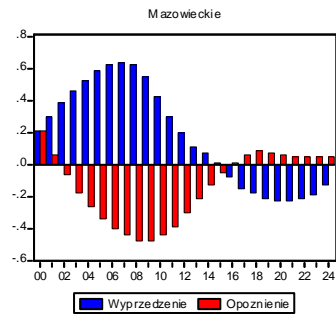
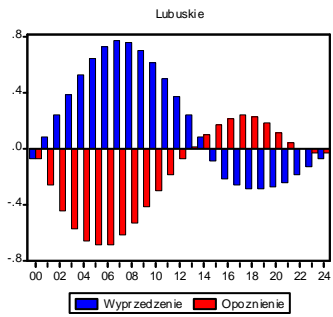
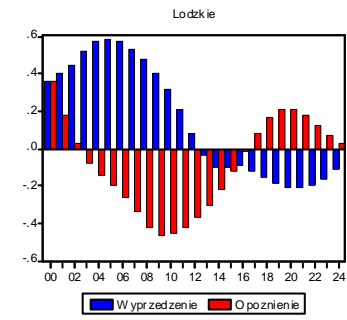
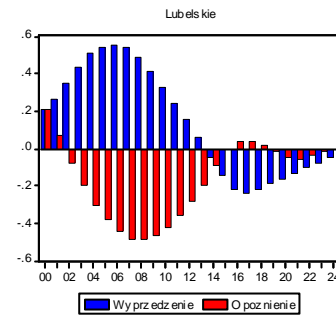
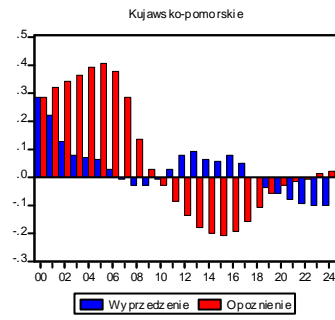
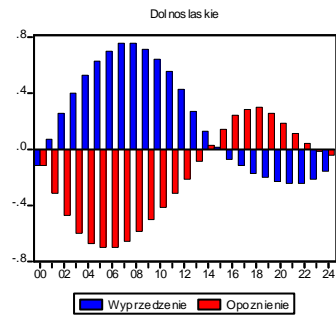
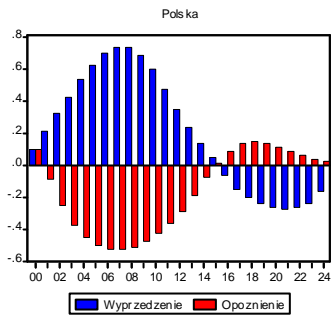
Zbieżność cykliczna – etapy

- Odsezonowanie danych
 - Ustalenie stopnia zintegrowania szeregów czasowych
 - Wyodrębnienie komponentu cyklicznego filtrem C-F
 - Analiza cross-korelacji
-

Korelacje równoczesne cyklicznych komponentów zatrudnienia między poszczególnymi województwami, Polską i strefą euro

	EUR	PL	DOL	KPM	LBL	LOD	LUB	MAZ	MLP	OPO	PDK	PDL	POM	SLA	SWK	WLP	WMZZPM	
EUR	1																	
PL	0,09	1																
DOL	-0,12	0,859	1															
KPM	0,282	0,246	-0	1														
LBL	0,207	0,687	0,56	-0,03	1													
LOD	0,355	0,648	0,45	0,57	0,34	1												
LUB	-0,08	0,839	0,87	0,01	0,7	0,4	1											
MAZ	0,212	0,92	0,7	0,31	0,58	0,61	0,71	1										
MLP	0,572	0,459	0,51	0,01	0,19	0,35	0,29	0,45	1									
OPO	0,041	0,249	0,25	0,21	-0	0,32	-0,05	0,17	0,49	1								
PDK	-0,5	0,037	0,15	0,21	-0,2	0	0,02	-0,12	-0,28	-0,1	1							
PDL	0,746	0,153	-0,1	0,13	0,46	0,34	-0	0,24	0,27	-0	-0,4	1						
POM	0,275	0,627	0,29	0,12	0,7	0,23	0,51	0,67	0,09	-0,2	-0,2	0,29	1					
SLA	-0,55	0,288	0,15	-0,23	0,34	-0,25	0,37	0,27	-0,5	-0,3	0,08	-0,3	0,56	1				
SWK	0,534	0,377	0,22	0,53	0,03	0,6	-0,03	0,36	0,67	0,69	0,01	0,28	0,07	-0,55	1			
WLP	0,197	0,277	0,35	0,41	-0,2	0,57	0,06	0,17	0,56	0,49	0,29	-0	-0,3	-0,66	0,69	1		
WMZ	0,315	0,73	0,68	0,11	0,45	0,73	0,57	0,67	0,66	0,35	-0,2	0,36	0,17	-0,23	0,45	0,58	1	
ZPM	-0,07	0,667	0,63	-0,12	0,69	0,15	0,83	0,6	0,11	-0,2	-0,2	0,11	0,56	0,52	-0,3	-0,2	0,5	1





Zbieżność cykliczna – podsumowanie (ostrożne)

- ❑ Cykl w Polsce wyprzedzający względem strefy euro
 - ❑ Związek między konwergencją strukturalną a cykliczną - nieistotny
 - ❑ Województwa: kujawsko-pomorskie, małopolskie, podlaskie i świętokrzyskie – zsynchronizowane ze strefą euro podobnie lub bardziej niż z Polską
 - ❑ Największe ryzyko procykliczności polityki pieniężnej EBC: w województwach: śląskim i podkarpackim
-

Wnioski

- ❑ **Nie można jednoznacznie wskazać województw, które w największym stopniu skorzystają z akcesji Polski do strefy euro, ani województw, które poniosą największe koszty – akcesja do strefy euro nie musi spowodować wzrostu regionalnego zróżnicowania poziomu rozwoju gospodarczego w Polsce**
 - ❑ Największym ryzykiem wystąpienia szoków asymetrycznych obarczone jest województwo śląskie
 - ❑ Województwa położone w zachodniej i północnej części kraju mają (na ogół) strukturę produkcji bliższą strukturze w strefie euro, ale ich cykle nie wydają się być w wysokim stopniu zsynchronizowane ze strefą euro
-

Wnioski, c.d.

- ❑ Z drugiej strony, województwa zachodnie, a także województwo śląskie – mają szansę odnieść największe korzyści, biorąc pod uwagę ich aktualną otwartość oraz względnie korzystną strukturę eksportu
 - ❑ W relatywnie niekorzystnej sytuacji zdaje się być województwo podkarpackie – ze względu na odległą od strefy euro strukturę gospodarczą i jednocześnie niski poziom otwartości
-