

ANNA OLSZAŃSKA
Uniwersytet Ekonomiczny
Wrocław

Sebastian Stępień:
**CYKL ŚWIŃSKI W ŚWIETLE ZMIAN NA GLOBALNYM
RYNKU MIĘSA WIEPRZOWEGO**

PWN, Warszawa 2015, 300 s.

Podjęty temat jest ważny zarówno od strony naukowej, jak i dla praktyków prowadzących działalność w sferze produkcji i handlu żywcem oraz mięsem wieprzowym, ale także – ze względu na silne związki pomiędzy poszczególnymi członami – dla całego agrobiznesu. W warunkach globalizacji współczesnej gospodarki niewątpliwie wymaga opracowania. Analizy tego rynku w Polsce wskazują, że po integracji z Unią Europejską nastąpiła synchronizacja kierunków zmian wielkości i cen skupu żywca wieprzowego z rynkami głównych producentów żywca wieprzowego. Wejście do wspólnego rynku Unii stworzyło całkiem nowy układ w konkurencji pomiędzy poszczególnymi krajami, decydujący zarówno o możliwościach eksportu, jak i wielkości produkcji w poszczególnych krajach Unii. Rynek unijny funkcjonuje bowiem szerzej, w określonej konfiguracji na globalnym rynku wieprzowiny. Liczne umowy międzynarodowe i coraz mniejsze ograniczenia w handlu międzynarodowym powodują, że konkurencja na tym rynku zaostrza się, a jego uczestnicy potrzebują coraz więcej informacji o układach sił i funkcjonowaniu rynku globalnego. Oceniana praca jest, w moim przekonaniu, pierwszą w Polsce tak kompleksową próbą analizy rynku żywca wieprzowego w skali światowej.

W części wstępnej monografii sprecyzowano cel główny, jakim jest „określenie tendencji w zakresie zmian podaży i cen żywca wieprzowego na świecie i w wybranych krajach. Jednocześnie podjęta została próba wyznaczenia zbieżności i rozbieżności cyklu świńskiego w skali globalnej i na poziomie rynków krajowych oraz pomiędzy państwami”. Wymienione cele szczegółowe wraz z hipotezami badawczymi tworzą zamysł konstrukcji pracy i analizowanych w niej problemów.

Monografia składa się z pięciu rozdziałów.

Rozdział pierwszy, pt. „Osobliwość koniunktury w rolnictwie na tle wahań ogólnogospodarczych” poświęcony został omówieniu dotychczasowego dorobku w za-

kresie cykliczności koniunktury w gospodarce. Na tym tle wskazano specyficzne cechy zmian koniunkturalnych w rolnictwie, przebiegających w dużym stopniu niezależnie od zmian w całej gospodarce. W rozdziale tym autor przedstawił rozwój poglądów na genezę i przyczyny wahań koniunkturalnych w gospodarce. W szczególności przytoczono poglądy W.S. Jevonsa, teorię innowacji J.A. Schumpetera, koncepcję niedostatecznej konsumpcji J.A. Hobsona, koncepcję wahań koniunkturalnych J.M. Keynesa (wskazującą na znaczenie sił łącznego popytu na kształtowanie podstawowych wartości makroekonomicznych). Zaprezentowane zostały istotne definicje i teorie cyklu gospodarczego A.F. Burnsa i W.C. Mitchella oraz I. Mintz, C.D. Romer, E.E. Kydlanda i E.C. Prescottta. Systematyczny przegląd ewolucji teorii związanych z wahaniami koniunkturalnymi w gospodarce połączono z krytyczną analizą autora. W kolejnych częściach tego rozdziału autor przedstawił mierniki wskazujące na zmiany koniunktury w gospodarce i możliwości łagodzenia zjawisk kryzysowych z wykorzystaniem instrumentów polityki gospodarczej państwa. W konkluzji stwierdzono, że w warunkach globalizacji i coraz silniejszych związków pomiędzy gospodarkami, poszczególne państwa mają niewielkie możliwości ograniczania cykliczności.

Kolejne podrozdziały dotyczyły specyficznych cech wyróżniających wahania cykliczne w rolnictwie. Zdaniem autora (i należy się z tym zgodzić), są nimi przede wszystkim znaczne wahania cen i dochodów w poszczególnych fazach cyklu koniunkturalnego. W dalszej części zostały także zaprezentowane chronologicznie koncepcje łączące koniunkturę w rolnictwie z kondycją całej gospodarki oraz analiza czynników wpływających na tę koniunkturę, w szczególności przepływ siły roboczej z przemysłu do rolnictwa w okresach recesji, co skutkuje spadkiem cen produktów rolnych. Współcześnie, jako główną przyczynę wahań koniunkturalnych wskazuje się globalizację gospodarki. Tezy te uzasadniają analizy przyczyn zmienności cen surowców rolnych na rynkach światowych.

W rozdziale drugim pt. „Teoretyczne podstawy cyklu świńskiego” autor skupia się na głównym temacie pracy, a mianowicie badaniach nad cyklami na rynku trzody chlewnej. Zjawisko to rozpoczęto analizować jeszcze w XIX w. Na szczególną uwagę, w kontekście współczesnych analiz, zasługują prace M. Ezekeiela oraz Coase’a i Fowlera, a zwłaszcza koncepcja teorematu pajęczyny, pozwalająca zrozumieć i wyjaśnić morfologię tych wahań. Przedstawione zostały także metody wyodrębniania i możliwości prognozowania cyklu świńskiego. Problem cykliczności na rynku żywca wieprzowego autor precyzyjnie zdefiniował i szeroko opisał, ale moim zdaniem, dla pogłębienia analiz w dalszej części pracy wskazane byłoby poświęcić więcej uwagi analizie i ocenie stosowanych metod statystycznych, w szczególności morfologii cyklu. Można było także szerzej uzasadnić wybór zastosowanej metody wyodrębniania cykli i porównać z innymi dostępnymi metodami badań cykliczności. Dyskusyjne może być więc założenie, że osłabienie trendu wzrostu pogłowia, produkcji czy cen świadczy o rozpoczęciu spadkowej fazy w cyklu koniunkturalnym. Takie założenia przyjmuje się, co prawda, w analizie koniunktury w całej gospodarce, ale cykle w rolnictwie mają swoją specyfikę. Zmniejszenie dy-

namiki wzrostu jest w mojej opinii sygnałem dochodzenia do optimum i raczej normalnym zjawiskiem, ale poprzedzającym dojście do wartości maksymalnej w cyklu (punktu przegięcia) i następnie początku fazy spadku i pogorszenia koniunktury. Okres zmniejszenia dynamiki wzrostu jest jednak nadal lokowany w tej samej fazie cyklu koniunkturalnego – fazie wzrostu produkcji, i z dużym prawdopodobieństwem – okresem dochodzenia do minimalnego poziomu cen skupu żywca. Zastosowanie metody wyodrębnienia cykli metodą indeksów o zmiennej podstawie (rok poprzedni=100) daje, co prawda, taką samą długość cyklu i możliwości dodatkowych obserwacji, ale optima przypadają na punkty przecięcia z osią czasu, więc interpretacja tak wyodrębnionych cykli jest jednak diametralnie inna niż wskazuje kształt wykresu. Celowe wydawałoby się także zamieszczenie ilustracji tabelarycznej cykliczności w skali światowej i na analizowanych rynkach, z opisem i analizą poszczególnych faz. Dotyczy to lokalizacji i określenia poszczególnych faz, punktów zwrotnych, amplitudy wahań itd. Można wtedy zaobserwować nie tylko związki pomiędzy cyklami w poszczególnych krajach, ale także w jakim kierunku zmieniają się te cykle. Jest to, według mnie, bardzo interesujący problem (może na następne badania i analizy?). W tym kontekście ograniczenie się do klasycznej analizy szeregów czasowych z zastosowaniem modelu multiplikatywnego (choć ta metoda także ma swoje wady i ograniczenia) daje, moim zdaniem, znacznie szersze możliwości analizy i porównań.

Podsumowując te części pracy, można stwierdzić, że zgromadzona literatura i systematycznie, a jednocześnie syntetycznie przedstawione teorie stanowią dobrą podstawę do dalszych analiz. W trakcie przygotowywania opracowania wykorzystano łącznie, co należy docenić, 496 pozycji źródłowych, z czego dużą część stanowiły źródła obcojęzyczne.

W kolejnym rozdziale autor przedstawia tendencje na światowym rynku wieprzowiny. Omówione zostały następujące zagadnienia: uwarunkowania produkcji wieprzowiny na świecie, światowa podaż żywca wieprzowego i udziały w niej poszczególnych największych producentów, zmiany cykliczne pogłowia i produkcji wieprzowiny w skali globalnej, związki pomiędzy podażą a cenami światowymi żywca wieprzowego i zbóż. W analizie rynku wieprzowiny, z punktu widzenia popytu na ten rodzaj mięsa w poszczególnych regionach świata, przedstawiono czynniki wpływające na poziom spożycia i zmiany w zapotrzebowaniu na wieprzowinę. Kolejne podrozdziały zawierały analizę światowych cen wieprzowiny i ich cykliczności w kontekście cyklicznych zmian pogłowia i produkcji wieprzowiny. Końcowa część rozdziału poświęcona była danym dotyczącym handlu zagranicznego. W moim przekonaniu, podstawowym utrudnieniem prowadzonych tu analiz są możliwości zgromadzenia wystarczająco szczegółowych i kompletnych danych. Zbyt wysoki poziom agregacji danych stwarza istotne problemy w wyodrębnieniu poszczególnych faz cyklu. Znacznie lepsze efekty daje wykorzystanie danych miesięcznych, do których jednak autor nie miał dostępu. Kolejny problem w analizach danych dotyczących rynku światowego polega na tym, że następuje zsumowanie danych pochodzących z różnych krajów, gdzie na poziom produkcji i cen wpływa-

ją, mimo globalizacji gospodarek, nieco odmienne czynniki. Powoduje to, prawdopodobnie, w wielu przypadkach spłaszczenie cyklu. Nie udało się także zgromadzić dla każdego analizowanego zagadnienia danych obejmujących cały analizowany w pracy okres (1990-2012). Uważam, że układ tej części pracy mógłby być trochę inny. Zwłaszcza punkt zatytułowany „Reakcja podaży na zmianę cen żywca wieprzowego i zbóż” zawiera faktycznie tylko analizy relacji cen żywca do cen pasz, zaś ceny wieprzowiny omówione zostały dopiero w podrozdziale 3.4. Zmiany pogłowia trzody na świecie mają marginalne znaczenie ze względu na różne technologie chowu i związany z tym czas trwania tuczu oraz zróżnicowanie preferencji co do masy ubijanych sztuk, na co słusznie zwraca uwagę autor na s. 80. Logicznie byłoby, moim zdaniem, zachowanie następującej kolejności analiz: zmiany pogłowia w skali światowej oraz poszczególnych krajach; wielkości i tendencje zmian w światowej produkcji wieprzowiny wraz ze zmianami ich struktury; analiza zmian światowych i regionalnych cen skupu oraz ich cykliczności, a na końcu skonfrontowanie uzyskanych wyników dotyczących wielkości pogłowia i produkcji wieprzowiny z cenami skupu podstawowych surowców paszowych.

Przyjęta koncepcja wyliczania cen światowych ma niewątpliwie swoje uzasadnienie i jest właściwa. Określone są one jako średnia cen dwunastu największych eksporterów wieprzowiny na świecie. Interesująca na tym tle byłaby analiza zmienności cen giełdowych wieprzowiny (z giełdy, na której koncentruje się handel tymi kontraktami). Czy także w tym przypadku występuje zjawisko cykliczności i jaki jest związek cen giełdowych ze światową podażą wieprzowiny?

Mimo wskazanych kwestii dyskusyjnych, a w sumie – raczej przyszłych problemów badawczych dotyczących tego rozdziału, uważam, że przedstawia on możliwie obiektywnie obraz zmian koniunktury na tym rynku i oceniam go jako bardzo wartościowy z badawczego punktu widzenia i realizacji założonego celu pracy. Określone zostały kierunki zmian w strukturze produkcji wieprzowiny na świecie i regiony, gdzie widoczne jest wyraźne zwiększenie produkcji. W krajach rozwijających się związane jest to niewątpliwie ze wzrostem liczby zamieszkałej tam ludności, ale także wzrostem dochodów, które przyczyniają się do zwiększonej konsumpcji mięsa. Największy producent wieprzowiny na świecie – Chiny – jest nadal głównym importerem wieprzowiny. Za istotne czynniki ograniczające wzrost produkcji autor uznał m.in.: wysokie koszty produkcji, ograniczenia w produkcji pasz, przepisy związane z ochroną środowiska i jakością żywności, zmiany stylu odżywiania, procesy koncentracji i globalizacji rynków. Analiza danych statystycznych wykazała, że na rynku żywca, mimo dużych zmian w produkcji rolnej, nadal mają miejsce 3-4 letnie wahania koniunkturalne. Stwarza to niewątpliwie napięcia na rynku, ale także okazje dla producentów innych gatunków mięs, gdzie cykl produkcyjny jest znacznie krótszy. Cykle w skali globalnej nie wykazują jednak tak ścisłych związków między wielkością produkcji a cenami skupu, głównie ze względu na znaczny poziom agregacji danych.

Przedmiotem rozważań autora w kolejnym rozdziale jest koniunktura na głównych rynkach wieprzowiny na świecie. Należą do nich: rynek chiński, amerykański,

krajów UE, rosyjski oraz brazylijski. Rozdział zawiera wiele ciekawych informacji na temat specyfiki funkcjonowania tych rynków, co wraz z przeprowadzoną analizą danych statystycznych ilustruje ich funkcjonowanie. Uważam jednak, że dostępność danych statystycznych na temat rynku wieprzowiny w Unii Europejskiej daje znacznie większe możliwości przeprowadzania analiz niż pokazano w pracy (być może o zakresie prowadzonych analiz zadecydowało dążenie do zachowania odpowiednich proporcji pomiędzy omawianymi krajami).

W następnej części rozdziału autor określił powiązania między poszczególnymi rynkami, wskazując na synchronizację w ich funkcjonowaniu w poszczególnych regionach, omówił także wahania sezonowe cen skupu na wybranych rynkach. Rozdział ten stanowi wartościową i ważną merytorycznie oraz naukowo część recenzowanej monografii. Niewątpliwym dokonaniem autora w tej części pracy jest wykazanie synchronizacji w funkcjonowaniu rynków wieprzowiny pomiędzy krajami, gdzie powstały możliwości rozwoju takich więzi integracyjnych. Takie relacje stwierdzono w przypadku sześciu, na dwunastu, głównych producentów wieprzowiny na świecie. Dla pozostałych krajów nie udało się znaleźć takich powiązań. Do krajów tych, co nie jest zaskoczeniem, zaliczono między innymi Chiny.

W ostatnim rozdziale recenzowanej pracy wskazano dostępne instrumenty ograniczania wahań koniunkturalnych na rynku wieprzowiny, a w szczególności narzędzia zarządzania ryzykiem w produkcji rolnej, oraz korzyści, jakie daje rozwój więzi integracyjnych w agrobiznesie. Omówiono sposoby ograniczania ryzyka cenowego między innymi poprzez system ubezpieczeń oraz zawieranie transakcji na giełdach towarowych. Nie każdy z tych mechanizmów jest dostępny dla wszystkich producentów. Możliwości ich stosowania zwiększają się wraz ze wzrostem skali produkcji i rozwojem gospodarczym kraju. Przegląd dostępnych metod ograniczania ryzyka cenowego uzupełniono oceną ewentualnego ich wykorzystania w poszczególnych krajach. W krajach europejskich rozwijają się głównie różne formy integracji pionowej i poziomej. Tworzenie takich związków, o różnych formach prawnych, znacznie zwiększa siłę oddziaływania na cały łańcuch produkcji i handlu wieprzowiną, wpływa także na zmniejszenie cykliczności produkcji i cen. Jest to głównie efekt zmniejszenia niepewności co do przyszłych warunków sprzedaży żywca. W krajach Ameryki Północnej i części krajów Ameryki Południowej rozwinął się system ubezpieczeń. W rozwiniętych gospodarkach rynkowych popularne stają się zabezpieczenia transakcji rzeczywistych poprzez zawieranie kontraktów terminowych oraz opcji na giełdzie towarowej. Jest to instrument dedykowany głównie bardzo dużym producentom żywca i przetwórcom. Na giełdzie towarowej wielkość kontraktów jest na ogół dość duża, a raczej nie dopuszcza się handlowania pojedynczymi kontraktami.

Cykle koniunkturalne w produkcji wieprzowiny nasilają niepewność zarówno w sferze produkcji żywca, jak i w sferze przetwórstwa oraz handlu. Ograniczenie skali tych zjawisk byłoby ze wszech miar korzystne i jest możliwe do osiągnięcia, o czym świadczy przykład niektórych krajów europejskich. Analizy cykli świńskich i cykliczności cen oraz sezonowości podaży i cen w poszczególnych państwach są dostępne dla każdego producenta trzody. Szczególnie dane krajowe, np. w przypad-

ku Polski, są dostępne prawie w czasie rzeczywistym. Znając prawidłowości zmian, można lepiej planować produkcję i w efekcie zwiększać dochody z tytułu prowadzonej działalności. Wielu jednak producentów, w myśl koncepcji Ezekiela, nadal kieruje się przesłankami naiwnymi lub adaptacyjnymi.

Temat pracy i zakres analizy zostały nakreślone ambitnie i konsekwentnie realizowane w kolejnych częściach książki. Konstrukcja pracy, wybór omawianych zagadnień i założona kolejność prowadzonych analiz pozwalają na spójną i wyczerpującą analizę tematu. Gratuluję autorowi podjęcia tak ambitnego i trudnego tematu i mam nadzieję, że kolejne opracowania będą jeszcze bardziej interesujące z naukowego i praktycznego punktu widzenia.

Zaakceptowano do druku – Accepted for print: 01.12.2016.