

**MINISTERUL EDUCAȚIEI, CERCETĂRII ȘI TINERETULUI
UNIVERSITATEA DIN CRAIOVA
FACULTATEA DE ECONOMIE ȘI ADMINISTRAREA AFACERILOR**

TEZĂ DE DOCTORAT

REZUMAT

TENDINȚE ÎN DINAMICA PRINCIPALILOR INDICATORI MACROECONOMICI ÎN CONTEXTUL INTEGRĂRII ROMÂNIEI ÎN UNIUNEA EUROPEANĂ

**CONDUCĂTOR ȘTIINȚIFIC,
Prof. univ. dr. Nicolae VASILESCU**

**DOCTORAND,
Dorel SĂVULEA**

**CRAIOVA
2008**

Aderarea României la Uniunea Europeană a reprezentat pentru întreaga societate românească un obiectiv strategic de maximă importanță, fiind susținut în mod constant de toate instituțiile statului, precum și de forțele politice, de societatea civilă în general.

Obiectivele majore în vederea integrării în structurile comunitare vizează consolidarea sistemului politic și a instituțiilor democratice, crearea unui climat economic și social care să ofere maximum de beneficii cetățenilor ei, eficientizarea structurilor și mecanismelor economiei de piață, întărirea cooperării politice, economice și culturale cu statele membre ale UE.

Evoluția societății românești în toate planurile, în perioada 2000-2006, confirmă consensul partenerilor sociali și partidelor politice realizat prin Strategia de dezvoltare economico-socială pusă în practică începând cu anul 2000.

La structurarea strategiei de dezvoltare a statisticii românești s-a luat în considerare faptul că eficiența sistemului statistic național este strict condiționată de mobilitatea și adaptabilitatea sa la cerințele majore ce decurg din evoluția socio-economică și politică a țării în noul context european și pentru adaptarea statisticii românești la cerințele de informații în concordanță cu standardele internaționale.

Astăzi, se poate afirma că sistemul statistic românesc a făcut eforturi deosebite și a obținut rezultate remarcabile în procesul de însușire și aplicare în practică a procedurilor și metodelor de culegere și prelucrare a datelor, precum și în cel de perfecționare a metodologiilor de determinare a indicatorilor statistici utilizate de Comunitatea Europeană sau de alte organisme și instituții internaționale.

Având în vedere aspectele menționate mai sus, se poate considera oportună elaborarea unei teze de doctorat care să evidențieze tendințele în dinamica principalilor indicatori macroeconomici în contextul integrării în Uniunea Europeană. Teza se încadrează în efortul sistemului statistic național de informare cât mai corectă și la timp a factorilor de decizie privind starea economică a României în procesul de aderare dar și evoluțiile post-aderare, având următoarele obiective principale:

- ✓ descrierea Sistemului Conturilor Naționale ca instrument de analiză și măsurare a indicatorilor macroeconomici;
- ✓ prezentarea metodologiei de calcul a indicatorilor macroeconomici în Sistemul Conturilor Naționale;
- ✓ prezentarea unor metode și tehnici moderne de prelucrare și analiză a datelor;
- ✓ descrierea principalelor programe aplicative folosite în prelucrarea și analiza datelor statistice;

- ✓ analiza statistică a dinamicii principalilor indicatori macroeconomici ai României în perioada 2000-2006;
- ✓ elaborarea de prognoze privind evoluția principalilor indicatori macroeconomici ai României după momentul aderării la UE;
- ✓ analiza principalelor corelații macroeconomice și a implicațiilor economico-sociale ale acestora;
- ✓ comparabilitatea internațională a principalilor indicatori economici.

Pentru realizarea acestor obiective teza a fost structurată în cinci capitole.

În prima parte sunt prezentate considerații generale privind sistemul indicatorilor macroeconomici precum și Sistemul Conturilor Naționale ca principal instrument de măsurare și analiză a acestora.

Elaborarea sistemului de indicatori macroeconomici, ca obiect al statisticii economice, s-a impus ca o necesitate în practica statistică, pentru a satisface cerințele caracterizării și analizei activității social-economice la diferite niveluri organizatorice și pe ansamblul economiei naționale.

Calitatea acestor indicatori, care au un caracter de sinteză, influențează deciziile factorilor de conducere și, ca urmare, elaborarea sistemului de indicatori de statistică economică impune răspundere pentru știința și practica statistică, pentru a preveni efectele negative ce pot fi determinate de calitatea necorespunzătoare a indicatorilor elaborați.

La începutul primului capitol sunt evidențiate rolul și obiectivele principale ale macroeconomiei, se definesc agregatele macroeconomice precum și cerințele și principiile ce stau la baza sistemului de indicatori. De asemenea se fac referiri la clasificarea activităților din economia națională (CAEN).

Este prezentat Sistemul Conturilor Naționale (SCN) ca principal instrument de analiză și măsurare a indicatorilor macroeconomici. Pentru început se fac considerații asupra apariției și evoluției SCN, apoi sunt evidențiate funcțiile, principiile și particularitățile acestuia. Sunt detaliate principiile și procedeele specifice SCN, dar și aspecte legate de circuitul economic și modalitățile de agregare a activităților economice. Capitolul se încheie cu aspecte teoretice privind măsurarea rezultatelor activității economice și referiri la principalele grupe de conturi din cadrul SCN, în special la conturile macroeconomice, precum și la activitatea de implementare a Conturilor Naționale în România.

În capitolul al doilea sunt abordate principalele aspecte legate de metodologia de calcul a indicatorilor macroeconomici.

Se cunoaște faptul că în statistica internațională au funcționat două sisteme de calcul și evidență macroeconomică: Sistemul de Balanțe ale Economiei Naționale (SBEN) utilizat în

special de țările membre ale fostului CAER și Sistemul Conturilor Naționale (SCN) utilizat de majoritatea țărilor și care este în același timp adoptat de ONU și alte organizații internaționale. Cele două sisteme au același scop, respectiv sistematizarea proceselor economice din economia națională și măsurarea fenomenelor și proceselor din viața economico-socială pe ansamblul economiei. Cu toate acestea între cele două sisteme există deosebiri esențiale dintre care mai importantă este cea legată de interpretarea diferită a activității productive, interpretare determinată de concepția teoretică diferită pe care se bazează. SBEN consideră economia națională formată din sfera producției materiale și sfera nematerială și cuprinde în calcule numai bunurile materiale și serviciile de producție produse în sfera producției materiale, în timp ce SCN cuprinde în calcule toate rezultatele obținute în economia națională, deci inclusiv valoarea serviciilor nemateriale.

Pentru a evidenția mai bine deosebirile dintre cele două sisteme, în prima parte a capitolului este prezentată metodologia de calcul a indicatorilor macroeconomici în Sistemul Producției Materiale (SPM), cu o detaliere a modalităților de calcul a principalilor doi indicatori ai acestui sistem: produsul social și venitul național.

Partea a doua a capitolului cuprinde aspecte privind calculul indicatorilor macroeconomici în SCN. Calculele și analizele macroeconomice necesită informații sintetice referitor la activitatea economică desfășurată de agenții economici. Într-o formă agregată aceste informații sunt furnizate de sistemul conturilor macroeconomice care permite să se calculeze indicatori globali privind: producția de bunuri (materiale și servicii); veniturile create în activitatea de producție desfășurată de subiectele economice; repartitia veniturilor între participanții la producție și redistribuirea acestora prin mecanismul financiar; folosirea veniturilor în societate pentru consum și acumulare.

Aceste elemente evidențiate prin fluxurile materiale și financiare în conturi macroeconomice sunt sintetizate prin următorii indicatori principali: produs intern, produs național, venit național, venit disponibil, venit personal al populației, aceștia fiind indicatorii care exprimă rezultatele din economia națională.

Având în vedere faptul că cele două sisteme se bazează pe concepții teoretice diferite, se poate afirma că între ele există diferențe metodologice privind calculul indicatorilor. În acest context, ultima parte a capitolului face o serie de aprecieri și propuneri privind cele două sisteme.

Capitolul al treilea cuprinde o analiză statistică detaliată a tendințelor principalilor indicatori macroeconomici în perioada 2000-2006 precum și predicții privind evoluția acestora în perioada de după aderarea la Uniunea Europeană.

Pentru început sunt prezentate o serie de metode statistice avansate folosite în determinarea și analiza tendințelor previzionale. Astfel, se prezintă atât teoretic cât și practic

metoda ajustării exponențiale, modelul linear și cel nelinear în determinarea și analiza trendului, precum și determinarea previziunilor sezoniere cu ajutorul variabilelor indicatoare.

Implementarea acestor metode este realizată comparativ, cu Microsoft Excel și programul de analiză și prelucrare statistică MINITAB, punându-se în evidență avantajele celui din urmă.

Se cunoaște faptul că orice program economic cuprinde un set de măsuri politice destinat a realiza principalele obiective ale politicii macroeconomice, care - în mod obișnuit - sunt următoarele: creșterea economică, ocuparea forței de muncă, stabilitatea prețurilor și îmbunătățirea balanței de plăți externe.

Aceste obiective sunt cuantificate prin patru variabile fundamentale, denumite și variabile macroeconomice cheie, prin care se măsoară, corelează și analizează performanțele oricărei economii: ritmul de creștere a PIB, rata șomajului, rata inflației și soldul contului curent al balanței de plăți.

Cele patru variabile permit evaluarea principalelor dezechilibre macroeconomice interne și externe, monitorizarea schimbărilor ce au avut loc în economie și formularea politicilor corespunzătoare în scopul atingerii obiectivelor viitoare.

În cadrul acestui capitol, se face o analiză a dinamicii PIB și a elementelor sale componente din metoda utilizării finale și se stabilește aportul componentelor la dinamica generală a acestui indicator.

Urmează determinarea trendurilor empirice și previzionale ale PIB-ului și a componentelor sale, apoi o analiză a tendințelor previzionate în perioada de după aderarea la Uniunea Europeană.

Inflația este analizată în detaliu, ea fiind o problemă complexă de analiză macroeconomică și una dintre cele mai importante forme ale dezechilibrului economico-social. Pentru început sunt abordate caracteristici, forme și consecințe ale acestui indicator, urmând o prezentare a metodologiei de măsurare a procesului inflaționist.

Analiza preliminară a dinamicii inflației se face atât pe total cât și pe elemente de structură, utilizându-se diferite metode de măsurare. Procesul se continuă cu determinarea și analiza trendului inflației în perioada 2000-2006 și se încheie cu aprecieri privind predicția ratei inflației după 1 ianuarie 2007.

Similar se procedează cu șomajul, acesta fiind definit în literatura de specialitate ca o stare negativă a economiei, concretizată într-un dezechilibru structural și funcțional al pieței muncii.

Sunt prezentate cauzele, consecințele și normele metodologice de calcul ale ocupării și șomajului. Se efectuează o analiză a dinamicii ocupării și șomajului, atât pe total cât și pe

sexe și medii de rezidență. Determinarea și analiza trendurilor este urmată de aprecieri privind predicția ratei șomajului până în 2010.

Balanța de plăți externe constituie unul din instrumentele cele mai importante aflate la dispoziția organelor de conducere ale unei țări pentru modelarea și conducerea politicii comerciale interne și externe. Sunt prezentate concepte, definiții și structura balanței de plăți, precum și aspecte metodologice privind calculul elementelor sale componente - contul curent și contul de capital.

Analiza dinamicii balanța de plăți a României, arată o deteriorare a soldului contului curent, fapt ce influențează negativ nivelul Produsului Intern Brut.

După determinarea și analiza trendurilor componentelor balanței de plăți se efectuează predicții pentru următorii patru ani de după aderare și se analizează aportul componentelor la dinamica generală a contului curent.

Partea finală a capitolului evidențiază principalele corelații între variabilele macroeconomice-cheie.

Astfel, corelația dintre rata șomajului și PIB este analizată prin prisma legii lui Okun, obținându-se un rezultat interesant, și anume faptul că în România în perioada 2000-2006 legea lui Okun nu s-a respectat. Se arată de asemenea modul cum se pot face previziuni asupra ratei șomajului în funcție de nivelul PIB-ului.

La stabilirea corelației dintre rata inflației și PIB se definesc concepte precum creștere economică inflaționistă și neinflaționistă, deflație, dezinflație și se analizează legătura dintre cei doi indicatori în contextul acestor concepte.

Corelația dintre rata șomajului și rata inflației se efectuează din perspectiva curbei lui Phillips. După ce sunt prezentate o serie de considerații teoretice precum și cele două forme ale acestei curbe, se elaborează curba pentru România ce pune în evidență o legătură inversă între acești indicatori.

Analiza acestor corelații macroeconomice, arată că ele pot fi un instrument foarte puternic în luarea unor decizii la nivel macroeconomic de către factorii de conducere.

Capitolul al patrulea este dedicat comparabilității internaționale a indicatorilor macroeconomici. Asigurarea comparabilității indicatorilor valorici și stabilirea ținând cont de ei a unor indicatori expresivi, face posibilă compararea nivelurilor de dezvoltare economică a țărilor respective, a evidențierii decalajelor existente între ele, cât și a evidențierii deosebirilor și asemănarilor existente în structura și dimensiunea economică.

Pentru realizarea de comparații trebuie găsită o bază comună de comparație, respectiv transformarea în aceeași monedă. Astfel, până în momentul actual au fost folosite două metode

de transformare: utilizarea cursului de schimb al monedei naționale și evaluarea parității puterii de cumpărare a valurilor țărilor care se compară, metode ce sunt detaliate în lucrare.

Sunt prezentate cele două programe de comparare utilizate în practica internațională - Programul Internațional de Comparare și Programul European de Comparare - precum și etapele procesului de comparare. Există mai multe tipuri de comparare, iar după 1990, România a fost inclusă în cadrul mai multor programe de comparare bilaterale și multilaterale.

Introducerea monedei unice presupune determinarea agregatelor economice în euro, iar la compararea unei țări UE cu o țară din afara grupului se poate aplica standardizarea puterii de cumpărare.

Dacă se dorește compararea rezultatelor activității economice între țări care au aplicat sisteme diferite de calcule macroeconomice trebuie avut în vedere, atât exprimarea în aceeași valută a indicatorilor care se compară cât și faptul că aceste calcule se fundamentează pe concepții diferite. Este cazul Sistemului Producției Materiale, aplicat în țările cu planificare centralizată și Sistemul Conturilor Naționale, utilizat în țările cu economie de piață. Deosebirea de fond între indicatorii calculați în cele două sisteme este generată de concepția teoretică care fundamentează sfera de cuprindere a indicatorilor.

Compararea PIB între țări în curs de dezvoltare și țări dezvoltate ridică o serie de probleme suplimentare. Această problemă derivă din structura economică și socială diferită a țărilor în curs de dezvoltare, față de țările dezvoltate.

Ultimul capitol al tezei cuprinde concluzii generale și sugestii.

Astfel, este sintetizată evoluția principalelor variabile macroeconomice cheie (PIB, inflația, șomajul și deficitul de cont curent) în perioada 2000-2006 prin raportarea la programele de preaderare și a criteriilor de la Maastricht.

Predicțiile acestor indicatori în perioada de după aderare, vor fi analizate în contextul Programului de Convergență (ianuarie 2007) elaborat de Guvernul României, pe fondul existenței unui orizont previzional.

Prezenta lucrare realizează un studiu al dinamicii principalilor indicatori macroeconomici ai României înainte de data aderării la Uniunea Europeană (1 ianuarie 2007) dar și o serie de previziuni privind evoluția acestora pe perioada 2007-2010.

Teza de doctorat are o structură concisă și coerentă, îmbinând aspectele metodologice cu cele aplicative.

Analizele efectuate arată că în plan macroeconomic, s-a consolidat procesul de stabilizare, în principal prin efortul orientat în domeniul politicilor publice naționale care au

beneficiat de sprijinul organismelor financiare internaționale, având ca efect creșterea credibilității internaționale a țării și stimularea atractivității mediului economic intern pentru comunitatea internațională de afaceri. Macrostabilizarea s-a realizat pe fondul unei creșteri economice reale neîntrerupte - uneori cea mai ridicată din zona noastră geografică - și al unui permanent proces de dezinflație.

Conform previziunilor realizate, economia României va prezenta și în viitor un trend ascendent, dar menținerea acestuia va depinde de continuarea reformelor structurale, reducerea ineficienței în economie și a deficitelor cvasifiscale, cu alte cuvinte a îndeplinirii criteriilor de convergență nominală prevăzute prin Tratatul de la Maastricht.

CUPRINSUL TEZEI DE DOCTORAT

INTRODUCERE	1
CAPITOLUL I	
CONSIDERAȚII GENERALE PRIVIND SISTEMUL INDICATORILOR	
MACROECONOMICI	6
1.1 Noțiuni fundamentale	6
1.1.1 Indicatorii macroeconomici – terminologie, concepte și definiții	7
1.1.2 Principalele caracteristici ale sistemului de indicatori	10
1.1.3 Clasificarea activităților economice	13
1.2 Sistemul Conturilor Naționale (SCN) – instrument de măsurare și analiză a indicatorilor macroeconomici	15
1.2.1 Considerații generale privind Sistemul Conturilor Naționale	15
1.2.2 Funcțiile, principiile și particularitățile Sistemului Conturilor Naționale	19
1.2.3 Circuitul economic și modalitățile de agregare a activităților în SCN	25
1.2.4 Grupele de conturi din cadrul SCN	31
1.2.5 Elaborarea Conturilor Naționale pentru România	40
CAPITOLUL II	
PROBLEME METODOLOGICE PRIVIND CALCULUL ȘI ANALIZA	
INDICATORILOR MACROECONOMICI	45
2.1 Calculul indicatorilor macroeconomici în Sistemul Producției Materiale (SPM) ...	45
2.1.1 Sistemul balanțelor economiei naționale și indicatorii sintetici care exprimă rezultatele activității economice	45
2.1.2 Metodologia de calcul a produsului social și venitului național	49
2.2 Calculul indicatorilor macroeconomici în Sistemul Conturilor Naționale (SCN) ...	55
2.2.1 Determinarea indicatorilor macroeconomici prin metoda agregării	55
2.2.2 Determinarea indicatorilor macroeconomici prin metoda input-output	66
2.3 Aprecieri și propuneri privind metodologia de calcul aferentă celor două sisteme .	85
CAPITOLUL III	
ANALIZA STATISTICĂ A TENDINȚELOR PRINCIPALILOR	
INDICATORI MACROECONOMICI ÎN CONTEXTUL INTEGRĂRII	
ROMÂNIEI ÎN U.E.	87
3.1 Metode și tehnici evolute de analiză a tendințelor previzionale	87
3.2 Retrospectiva principalilor indicatori macroeconomici ai României, realizați în perioada 2000-2006 și elaborarea predicțiilor pentru orizontul 2007-2010	108
3.2.1 Dinamica Produsului Intern Brut	110
3.2.2 Dinamica inflației	128
3.2.3 Dinamica șomajului	155
3.2.4 Tendințe în dinamica indicatorilor balanței de plăți	184
3.3 Corelațiile principalilor indicatori macroeconomici și implicațiile economico-sociale ale acestora	210
3.3.1 Regresia și corelația lineară	210
3.3.2 Corelația dintre rata inflației și PIB	216
3.3.3 Corelația dintre șomaj și PIB	221
3.3.4 Corelația dintre șomaj și rata inflației	227

CAPITOLUL IV	
COMPARABILITATEA INTERNAȚIONALĂ A INDICATORILOR	
MACROECONOMICI	232
4.1 Considerații generale	232
4.2 Evaluarea indicatorilor macroeconomici într-o valută unică	233
4.3 Programe și procedee de comparare a indicatorilor macroeconomici	235
4.4 Paritatea puterii de cumpărare în condițiile extinderii U.E.	240
4.5 Comparații între țări cu sisteme și nivele diferite de dezvoltare	241
CAPITOLUL V	
CONCLUZII GENERALE.....	244
ANEXE	249
BIBLIOGRAFIE	268