

JADWIGA SEREMAK-BULGE
Instytut Ekonomiki Rolnictwa
i Gospodarki Żywnościowej – PIB
Warszawa

JERZY REMBEZA
Instytut Hodowli i Aklimatyzacji Roślin
Bonin

ZMIANY CEN I RELACJI CENOWYCH NA PODSTAWOWYCH RYNKACH ŻYWNOŚCIOWYCH

Wstęp

Zainteresowanie funkcjonowaniem mechanizmu cenowego na rynku żywnościowym oraz tworzeniem cen detalicznych żywności i udziałem w niej poszczególnych uczestników łańcucha żywności zmienia się cyklicznie. Jest ono wprost proporcjonalne do siły protestów rolników w okresach spadków cen produktów rolniczych lub do siły niepokoju konsumentów w okresach wzrostu cen żywności. Temat ponownie stał się gorący w latach 2007-2009 z uwagi na destabilizację rynku żywnościowego zarówno na świecie, jak i w Unii Europejskiej, która przez wiele lat była oazą stabilizacji.

Mimo że w krajach o rozwiniętej gospodarce rynkowej problem relatywnego tanienia żywności i asymetrii zmian cen w łańcuchu żywnościowym jest dobrze rozpoznany przez ekonomistów rolnych i stanowi teoretyczne oraz praktyczne uzasadnienie dla Wspólnej Polityki Rolnej¹, istotnym wydawało się przebadanie, jak zmiana uwarunkowań rynkowych, a także procesy dostosowawcze podstawowych sektorów żywnościowych wpłynęły na proces transmisji cen i wysokość marż cenowych żywności.

W ramach wieloletniego programu badawczego w IERiGŻ podjęto tę problematykę w odniesieniu do podstawowych rynków rolnych, a więc rynku zbóż, mięsa oraz mleka. Punktem wyjścia była cenowa teoria marż, zgodnie z którą na cenę detaliczną, jaką płaci konsument, składa się cena surowca oraz marża zbytu, która stanowi różnicę między ceną płaconą przez konsumenta a ceną

¹ Dla zapewnienia szeroko rozumianego bezpieczeństwa żywnościowego i utrzymania produkcji rolnej na poziomie zapewniającym pełne zabezpieczenie zapotrzebowania społeczeństwa na zdrową i bezpieczną żywność, bez obawy zanieczyszczenia środowiska naturalnego i naruszenia równowagi ekosystemów, konieczny jest zwrot nadwyżki ekonomicznej, która jest z rolnictwa wyprowadzana przez mechanizm rynkowy deprecjonujący ceny rolne.

otrzymywaną przez producenta [7]. Przy tym, z marży zbytu wydzielono marżę handlową, która stanowi różnicę między ceną detaliczną a ceną zbytu, oraz marżę przetwórczą (w przypadku przetworzonych surowców rolniczych, które dominują w obrocie artykułami żywnościowymi) lub hurtową (w przypadku surowców rolniczych nie przetwarzanych).

Cena detaliczna = cena producenta + marża zbytu

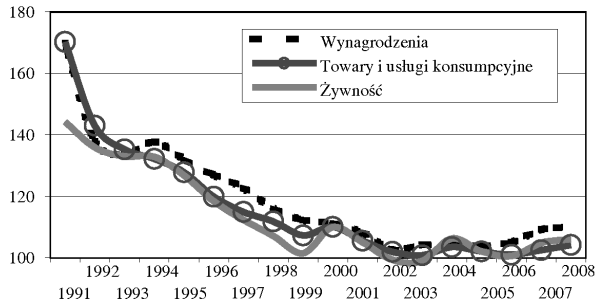
Marża zbytu = marża przetwórcza (hurtowa) + marża handlowa

Badania przeprowadzono dla lat 1990-2009 w oparciu o miesięczne notowania cen. Skupiono się na ocenie udziału marży producenta, marży przetwórczej oraz marży handlowej w cenie detalicznej wybranych przetworów. Tą ocenę poprzedziła analiza zagregowanych wskaźników zmian cen na poziomie producenta, zbytu i detalu na poszczególnych rynkach. Transmisję cen między poszczególnymi poziomami łańcucha dostaw na rynku mleka, mięsa i zbóż badano przy pomocy metody kointegracji oraz modeli VAR. Ze względu na dostępność danych, a także dla zapewnienia porównywalności, badania cen producenta ograniczono do miesięcznych notowań cen skupu oraz cen zbytu prowadzonych przez GUS, który jest także jedynym w Polsce źródłem notowań cen detalicznych żywności.

Zmiana rynkowych uwarunkowań produkcji rolniczej

Zmiana systemu gospodarczego oraz poddanie rynków rolno-żywnościowych działaniu mechanizmu rynkowego spowodowały znaczące zmiany w rynkowych uwarunkowaniach produkcji rolniczej. Żywność relatywnie staniała zarówno w stosunku do wynagrodzeń, jak i do cen towarów i usług konsumpcyjnych. Od 1990 r. aż do akcesji ceny detaliczne żywności rosły znacznie wolniej niż inflacja, przyczyniając się tym samym do jej ograniczania. Znacznie szybciej niż ceny żywności rosły też dochody konsumentów. W ciągu 14 lat tylko raz dynamika wzrostu cen detalicznych żywności przekroczyła inflację w reakcji na głęboki spadek produkcji w 1994 r. W pozostałych latach nominalne ceny żywności rosły znacznie wolniej. Do 2003 r. ceny żywności wzrosły 49-krotnie, podczas gdy inflacja i wynagrodzenia ponad 75-krotnie. W sumie w latach 1990-2003 realny indeks cen żywności wyniósł niespełna 65%. Jednocześnie, znacznie szybciej niż żywność, rosły w tym czasie realne dochody konsumentów. Wprawdzie w pierwszych pięciu latach po urynkowaniu dochody dyspozycyjne gospodarstw domowych realnie zmalały o ponad 10%, ale w następnych 9 latach zostały zwiększone o 1/3, o czym zdecydował przede wszystkim dynamiczny wzrost wynagrodzeń w sferze przedsiębiorstw. W sumie dochody dyspozycyjne w sektorze gospodarstw domowych² realnie wzrosły w latach 1990-2003 o ponad 19%.

² Dochody dyspozycyjne gospodarstw domowych stanowią najszerszą kategorię ekonomiczną, z nich finansowane są wydatki na żywność. Obliczeń dokonano na podstawie danych makroekonomicznych.



Rys. 1. Wskaźniki zmian cen detalicznych i wynagrodzeń

Tabela 1

Bieżące wskaźniki zmian cen detalicznych i wynagrodzeń

Wyszczególnienie	1990-1994	1995-1999	2000-2003	2004-2008	1990-2008
Artykuły i usługi konsumpcyjne	2 988	211,2	119,3	114,0	8 586
Żywność i napoje bezalkoholowe	2 342	183,3	113,5	121,5	5 923
Wynagrodzenia brutto ^a	2 233	268,3	128,6	136,9	10 545

^a W sektorze przedsiębiorstw.

Źródło: Obliczenia własne na podstawie danych GUS.

Przyspieszenie dynamiki wzrostu cen detalicznych żywności nastąpiło dopiero po akcesji, kiedy pod wpływem dużych różnic cen między Polską a starymi krajami członkowskimi w momencie włączenia do jednolitego rynku europejskiego, szybko malejącego bezrobocia i szybszego wzrostu dochodów, a także destabilizacji rynku światowego i rekordowo wysokich cen zbóż i przetworów mlecznych w 2007 r., popyt na żywność znacząco wzrósł zarówno ze strony krajowych konsumentów, jak i eksporterów.

W latach 2004-2008 dynamika wzrostu cen detalicznych żywności wyniosła 21,5%, przy inflacji wynoszącej 14% i wzroście wynagrodzeń o 38%. W sumie realny wzrost cen detalicznych żywności wyniósł 106,5%, podczas gdy wynagrodzenia realnie wzrosły w tym czasie o 21%, a dochody dyspozycyjne o 19%.

Łącznie w latach 1990-2008 żywność realnie staniała o prawie 31%, podczas gdy dochody dyspozycyjne wzrosły o ponad 42%. Pozwoliło to zmniejszyć udział żywności w całkowitych wydatkach gospodarstw domowych prawie o połowę do około 26% w 2008 r.

Przyczyn znacznego spadku realnych cen żywności było kilka, a siła ich oddziaływania w poszczególnych podokresach była różna:

- w pierwszych latach transformacji ustrojowej (1990-94) podstawowe znaczenie miało urealnienie popytu spowodowane głębokim spadkiem wynagrodzeń i dochodów;

- po 1995 r. kluczową rolę odgrywał niski poziom dochodów i wyraźnie niższe tempo wzrostu dochodów niż PKB, przy rosnącym rozwarstwieniu zamożności konsumentów, dużej relatywnie skali ubóstwa i wysokim bezrobociu;
- w latach 2000-2003 najważniejsze było wyraźne spowolnienie tempa rozwoju gospodarczego kraju i wzrostu dochodów;
- po akcesji (2004-2008) czynnikiem dynamizującym wzrost cen żywności był przede wszystkim szybko rosnący eksport, ale także (choć w mniejszym stopniu), szybciej rosnące dochody.

Tabela 2

Realne wskaźniki zmian

Wyszczególnienie	1990-1994	1995-1999	2000-2003	2004-2008	1990-2008
Produkt krajowy brutto (PKB) ^a	95,9	132,7	111,2	129,7	183,4
Rolnicza produkcja globalna ^a	81,3	111,7	97,2	111,0	98,0
Dochody dyspozycyjne	89,6	126,9	105,0	119,0	142,1
Wynagrodzenia brutto	74,7	127,0	107,8	120,0	122,7
Ceny detaliczne żywności	78,4	86,8	95,2	106,5	69,0
Udział żywności w wydatkach % ^d	51 ^b	36 ^b	28 ^b	26 ^c	51-26

^a Ceny stałe.

^b Początek okresu.

^c Koniec okresu.

^d W budżetach rodzin.

Źródło: [1].

Jeszcze wolniej niż ceny detaliczne żywności rosły ceny towarowej produkcji rolniczej, od których, co gorsza, znacznie szybciej rosły ceny detaliczne środków produkcji nabywanych przez rolników. Szczególnie duże dysproporcje w dynamice wzrostu cen produktów rolnych, zarówno w stosunku do cen detalicznych żywności oraz środków produkcji, miały miejsce w pierwszej połowie lat 90. XX wieku. Wprawdzie w latach następnych różnice te malały, ale nadal rynkowe uwarunkowania produkcji rolniczej, aż do integracji, były bardzo niekorzystne.

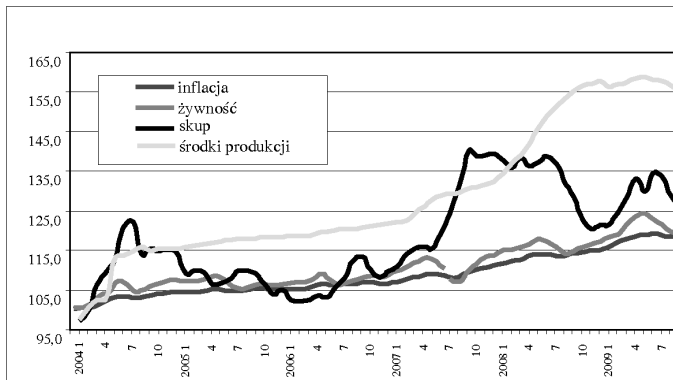
Tabela 3

Wskaźniki zmian cen otrzymywanych i płaconych przez rolników oraz cen detalicznych żywności

Wyszczególnienie	1990-1994	1995-1999	2000-2003	2004-2008	1990-2008
Ceny detaliczne żywności	2 342	211,2	119,3	121,5	5 923
Ceny otrzymywane przez rolników	1 424	152,9	109,7	132,1	3 155
Ceny płacone przez rolników	3 155	194,7	123,9	134,1	10 204
Indeks nożyc cen	45,1	78,6	88,6	98,5	-

Źródło: Obliczenia własne na podstawie danych GUS.

Po integracji wzrost cen otrzymywanych przez rolników wyraźnie wyprzedził podwyżki cen detalicznych żywności. Podwyżki cen skupu produktów rolniczych były tak wysokie, że prawie w pełni skompensowały znaczne w tym czasie podwyżki cen detalicznych środków produkcji, a wskaźnik nożyc cen wzrósł do 98,5 punktu.



Rys. 2. Skumulowane wskaźniki zmian cen (XII 2003=100)

Dynamika wzrostu cen środków produkcji w połowie 2007 r. wyprzedziła jednak wzrost cen produktów rolnych, których ceny zaczęły szybko maleć. W sumie, zmiany cen, jakie dokonały się w sektorze żywnościowym i jego otoczeniu od początku lat 90. XX wieku, były dla producentów rolnych niekorzystne, a krótkotrwała poprawa ich sytuacji po integracji nie była w stanie znacząco poprawić wydolności dochodowej gospodarstw rolnych.

Warto dodać, że relatywny spadek cen detalicznych żywności nastąpił przy niewielkim wzroście globalnej produkcji rolnictwa, co ograniczało krajową podaż żywności, która zwłaszcza na początku lat 90. XX wieku dostosowała się do obniżonego popytu krajowego. Przyrost produkcji globalnej rolnictwa, jaki nastąpił po głębokim załamaniu na początku transformacji ustrojowej, był na tyle słaby, że w ostatnim roku przed integracją była ona nadal o ponad 10% niższa niż w 1989 r. i – mimo przyspieszenia po integracji – jeszcze w 2008 r. nie zrównała się z produkcją globalną sprzed blisko 20 lat. Przy tym, w kolejnych latach słabemu wzrostowi produkcji globalnej towarzyszyły nierównowagi cząstkowe, powodowane dużą wahliwością plonów i zbiorów, głównie zbóż i ziemniaków. Prowadziło to do szoków podażowych i zwiększało wahania cen detalicznych żywności, a także naruszało długookresowe równowagi rynkowe i zmieniało relacje cen detalicznych poszczególnych grup żywności.

Producenci rolni pozostali najsłabszym ogniwem rynku żywnościowego, mimo że po destabilizacji światowego rynku żywnościowego i rekordowo wysokich cen zbóż oraz produktów mleczarskich w 2007 r. przez krótki czas wydawało się, iż era niskich cen zbóż i taniej żywności skończyła się.

Porównanie wskaźników zmian cen na poszczególnych poziomach łańcucha dostaw podstawowych rynków rolno-spożywczych potwierdza wolniejsze najczęściej tempo wzrostu cen skupu surowców rolniczych niż cen detalicznych ich przetworów. Wyjątkami było mleko i żywiec wołowy, gdzie ceny otrzymywane przez producenta rolnego rosły szybciej niż ceny detaliczne jego przetworów. Warto jednak zwrócić uwagę, że różnice w dynamice zmian cen na poszczególnych poziomach łańcucha dostaw są znacznie mniejsze w ramach jednego rynku niż wówczas, gdy porównujemy całe agregaty, jakimi są żywność, produkty sprzedawane przez rolników oraz kupowane przez nich. Istotne jest także ponadto, że na rynku mięsa, a zwłaszcza na rynku mleka, ceny zbytu rosły wyraźnie wolniej nie tylko w porównaniu z cenami detalicznymi, ale również z cenami skupu. Wskazuje to na słabą pozycję rynkową przetwórców, a także na zakłócenia w funkcjonowaniu mechanizmu rynkowego, co w dłuższej perspektywie jest niemożliwe do utrzymania. Na rynku zbóż odwrotnie – najsłabszą pozycję rynkową, mierzoną dynamiką wzrostu cen, mają producenci zbóż, podobnie jak w krajach o rozwiniętej gospodarce rynkowej.

Proste porównanie zagregowanych wskaźników zmian cen tylko ogólnie określa pozycję rynkową rolników. Bardziej wnikliwej oceny funkcjonowania mechanizmu cenowego na rynku żywnościowym dokonano na podstawie analizy zmian udziału rolników i pozostałych uczestników rynku w cenach detalicznych wybranych artykułów żywnościowych.

Tabela 4

Wskaźniki zmian cen na poszczególnych poziomach wybranych rynków rolnych

Wyszczególnienie	1991- -1994	1995- -1999	2000- -2003	2004- -2008	1991- -2008
			Rynek zbóż		
Ceny skupu pszenicy	322,8	166,0	113,2	144,3	875
Ceny zbytu przetworów zbożowych	305,8	218,2	113,1	124,1	936
Ceny detaliczne przetworów zbożowych	320,0	213,5	124,1	129,6	1099
			Rynek mleka		
Ceny skupu	438,1	221,5	117,5	143,8	1640
Ceny zbytu przetworów mlecznych	452,2	175,4	108,4	118,4	1018
Ceny detaliczne nabiału	487,0	205,8	114,0	123,6	1412
Ceny detaliczne masła	307,4	219,2	109,3	134,0	987
			Rynek mięsa		
Ceny skupu żywca wieprzowego	323,1	119,7	104,8	127,1	515
Ceny skupu żywca wołowego	416,4	145,9	99,5	158,2	957
Ceny skupu drobiu	348,6	125,0	101,1	115,0	506
Ceny zbytu przetworów mięsnych	281,2	140,0	108,0	115,4	491
Ceny detaliczne mięsa i jego przetworów	276,7	153,5	108,2	118,3	544
w tym: wieprzowiny	227,6	158,1	108,8	117,7	461
wołowiny	285,6	163,8	118,6	161,8	898
drobiu	245,9	126,0	94,3	110,5	323
przetworów mięsnych	317,0	154,7	111,4	117,8	643

Ceny i marże cenowe oraz transmisja cen

Badanie marż w łańcuchu żywnościowym jest zagadnieniem skomplikowanym ze względu na to, że surowce rolnicze z reguły podlegają przetwarzaniu i różnicowaniu w procesie dostosowań do wymagań konsumenta. Poważny problem metodyczny stanowi analiza udziału surowca rolnego w cenach detalicznych ze względu na ogromną różnorodność przetworów i ich zróżnicowanie jakościowe, spowodowane różną zawartością surowca w produkcie końcowym, stosowanymi dodatkami itd. Ponadto dynamicznie zmieniająca się struktura sprzedaży sprawia, że GUS często dokonuje zmian w doborze reprezentantów uwzględnianych w badaniach cenowych. Rodzi to problemy z porównywalnością produktów i cen. Na rynku mięsa dodatkowym problemem jest różny udział poszczególnych wyrębów w tuszy, których ceny istotnie różnią się od siebie³. Poważnie utrudnia to analizę udziału surowców rolnych w cenach detalicznych artykułów żywnościowych. Dla uniknięcia tych problemów analizę marż cenowych i transmisji cen na podstawowych rynkach rolno-żywnościowych przeprowadzono więc w odniesieniu do wybranych reprezentantów, a na rynku mięsa uwzględniono także koszyki produktów⁴.

Rynek mleka

Analizę udziału marży producenta, marży przetwórczej i marży handlowej w cenach detalicznych przetworów mlecznych przeprowadzono dla mleka spożywczego, twarogu tłustego, śmietany o zawartości 18% tłuszczu, sera Gouda, oraz masła extra, uwzględniając zużycie mleka surowego do wytworzenia jednostki produktu finalnego⁵.

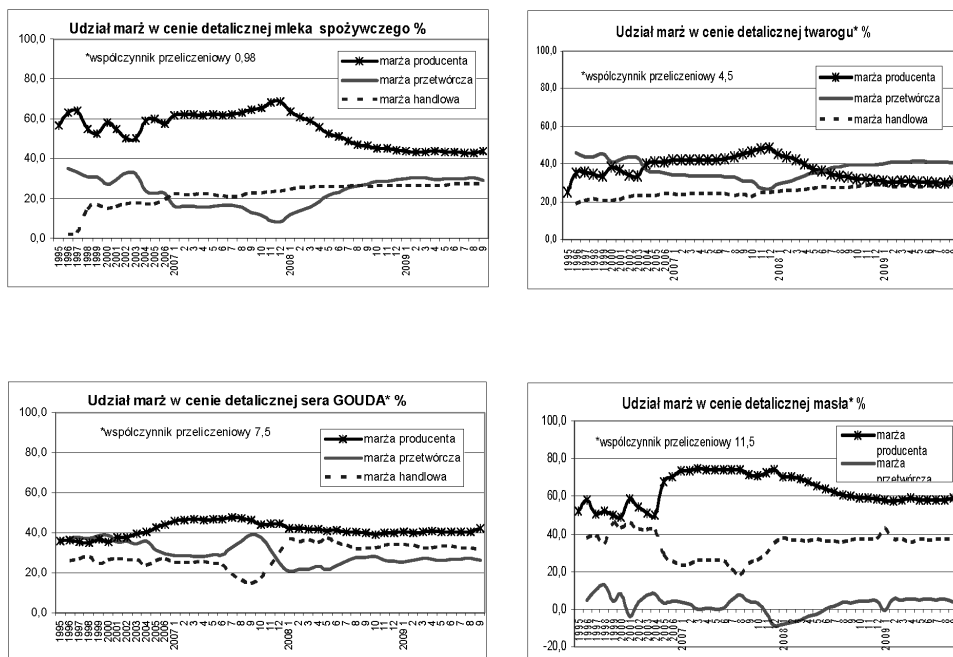
Analiza udziału cen skupu oraz marży handlowej i marży przetwórczej w cenach detalicznych przetworów mlecznych wskazuje, że do końca 2007 roku udział marży producenta w cenach detalicznych przetworów mlecznych wzrastał kosztem przetwórców z około 15-30% do 50% (twaróg tłusty, śmietana, ser Gouda) i 70% (mleko spożywcze, masło). Udział marży przetwórczej w cenie detalicznej zmalał w tym czasie z około 30-45% do 22-27% (twaróg tłusty, ser Gouda, śmietana) i poniżej 10% w przypadku mleka spożywczego. Od początku 2008 r. miał miejsce proces odwrotny: marże przetwórcze rosły kosztem marż producenta. Marże handlowe w tym czasie systematycznie wzrastały z około 15-20% (mleko, twaróg, śmietana) na początku lat 90. do 27-31% w latach 2007-2009. W przypadku sera Gouda wzrost udziału marży handlowej

³ W USA udział cen żywca w cenach detalicznych mięsa ocenia się na podstawie średniej ważonej ceny z 30 wyrębów.

⁴ Ceny koszyków tworzą nadając odpowiednie wagi produktom. I tak, dla koszyka wieprzowego przyjęto: schab 60%, boczek 40%; dla koszyka wołowego: szponder 50%, rostbef 20%, wołowina bez kości 30%; dla koszyka przetworów: kielbasa zwyczajna 40%, kielbasa toruńska 5%, parówki 20%, baleron 10%, szynka wieprzowa 20%, salceson 5%.

⁵ Przy obliczaniu udziału cen skupu w cenie detalicznej przyjęto następujące współczynniki przedstawiające zużycie surowca na jednostkę produktu finalnego: mleko spożywcze 0,98, śmietana 3, masło 11,5, twaróg 4,5, ser dojrzewający 7,5.

był niewielki, bo z 27 do 33%, ponieważ już na początku lat 90. była ona znacznie wyższa niż dla innych przetworów. Udział marż handlowych w cenie detalicznej masła wynosił 37-40%, z wyjątkiem lat 2005-2007, kiedy zmalał do około 20-25%.



Rys. 3. Udział marż w cenach detalicznych wybranych przetworów mlecznych

Źródło: Obliczenia własne na podstawie danych GUS.

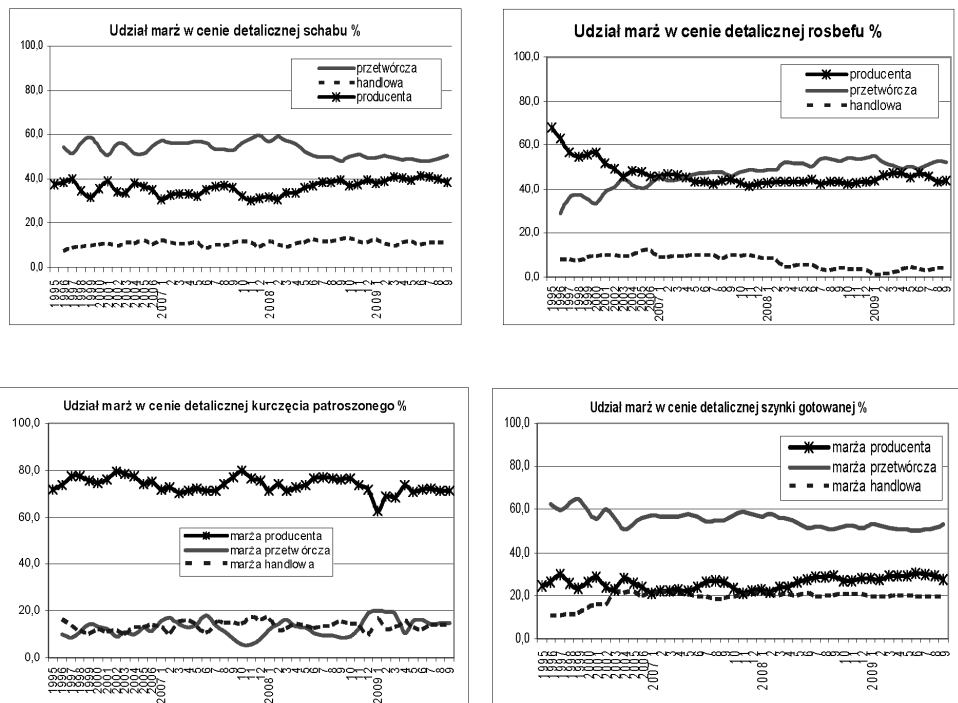
W trzecim kwartale 2009 r., podobnie jak przed 2004 r., udział marży producenta w cenach detalicznych większości przetworów mlecznych wahał się od 30-42%, a udział marży przetwórczej i handlowej wynosił od 27-31%. Wyjątkiem było masło, gdzie udział marży producenta dochodził do 60%, a udział marży przetwórczej wahał się w granicach 5%, podczas gdy udział marży handlowej przekraczał 37%.

Analiza transmisji cen potwierdziła, że impulsy cenowe na rynku mleka przebiegają przede wszystkim w górę kanałów rynkowych. Z tym, że o ile zmiany cen skupu relatywnie szybko przenoszone są przez zakłady przetwórcze na ceny zbytu mleka, śmietany i serów (w większości przypadków reakcja widoczna była w ciągu 1-2 miesięcy, a po 3-4 miesiącach osiągała swoje apogeum), to w przypadku masła i OMP ceny zbytu kształtowane są głównie przez czynniki pozasurowcowe. Zmiany cen zbytu były szybko i silnie przenoszone na ceny detaliczne, natomiast zmiany cen detalicznych bardzo słabo wpływały na zmiany cen zbytu. Ułatwia to handlowi utrzymywanie marż detalicznych w przypad-

ku wzrostu cen zbytu przez zakłady przetwórcze. Zakładom przetwórczym trudno natomiast przechwycić przynajmniej część cenowych korzyści wynikających ze wzrostu popytu na produkty mleczne. Ceny masła utraciły w latach 1996-2008 znaczenie dla kształtowania cen skupu mleka, natomiast ceny mleka w proszku znaczenie to zachowały.

Rynek mięsa

Analizę udziału marży producenta, marży przetwórczej i marży handlowej w cenach detalicznych mięsa i jego przetworów przeprowadzono dla schabu, rostbefu, wołowiny bez kości, tuszki kurczęcia oraz szynki wieprzowej gotowanej, uwzględniając ceny skupu żywca wieprzowego, wołowego i drobiu, oraz współczynniki wydajności poubojowej⁶.



Rys. 4. Udział marż w cenach detalicznych wybranych przetworów mięsnych

Analiza udziału cen skupu oraz marży handlowej i marży przetwórczej w cenach detalicznych mięsa surowego i jego przetworów wskazuje, że rynek mięsa od rynku mleka różni się przede wszystkim znacznie niższym udziałem marży handlowej w cenach detalicznych. Ponadto wahania marż na rynkach poszczególnych produktów są niewielkie, aczkolwiek różnią się między sobą. Duże

⁶ Współczynniki wydajności ubojowej wynoszą: dla wieprzowiny – 0,78, dla wołowiny – 0,52, dla drobiu – 0,755.

różnice w wielkości poszczególnych marż, mierzone ich udziałem w cenie detalicznej, dotyczą przetworów, a zwłaszcza tuszek kurcząt.

Udział marży handlowej w cenach detalicznych mięsa surowego waha się w granicach 10-14%, z wyjątkiem wołowiny (poniżej 10%). Wzrost cen skupu bydła i cen zbytu wołowiny był bowiem tak duży, że handlowcy dla utrzymania sprzedaży, przy niskim zainteresowaniu krajowych konsumentów tym gatunkiem mięsa, ograniczyli marżę handlową do 3-7% w latach 2007-2009. Jeśli chodzi natomiast o przetwory mięsne, udział marży handlowej jest wyższy o ponad 5% niż w przypadku surowych mięs i w przypadku szynki gotowanej waha się od 2003 r. wokół 20%.

Największy udział w cenie detalicznej surowego mięsa wieprzowego i wołowiny mają marże przetwórcze, których udział waha się od 44 do 59%. Jeszcze wyższe udziały mają marże przetwórcze w cenach detalicznych przetworów, np. w przypadku szynki wieprzowej wynosi ona od 71 do 79%. Jedynie w przypadku tuszek kurcząt udział marży przetwórczej jest znacząco niższy i nie odbiega od wielkości marży handlowej.

Udział marży producenta w cenie detalicznej schabu w zależności od fazy cyklu świńskiego wynosił od 33 do 41%. Udział marży producenta w cenie detalicznej wołowiny zmalał w ciągu 20 lat o około 5 punktów procentowych do około 33% w odniesieniu do wołowiny bez kości i 43% do rostbefu. Udział cen skupu w cenie detalicznej tuszki kurcząt jest 2-krotnie większy niż w przypadku wołowiny i wieprzowiny i wahał się od 65 do 79%, kosztem marży przetwórczej, której udział waha się od kilku do kilkunastu procent. Tak wysokiego udziału cen skupu w tuszce kurczęcia nie wyjaśnia niższy stopień przetworzenia. Wydaje się, że może to być także efektem strategii stosowanej przez firmy przetwórcze, która zasada się na konkurencji cenowej oraz bardziej rozwiniętej integracji pionowej.

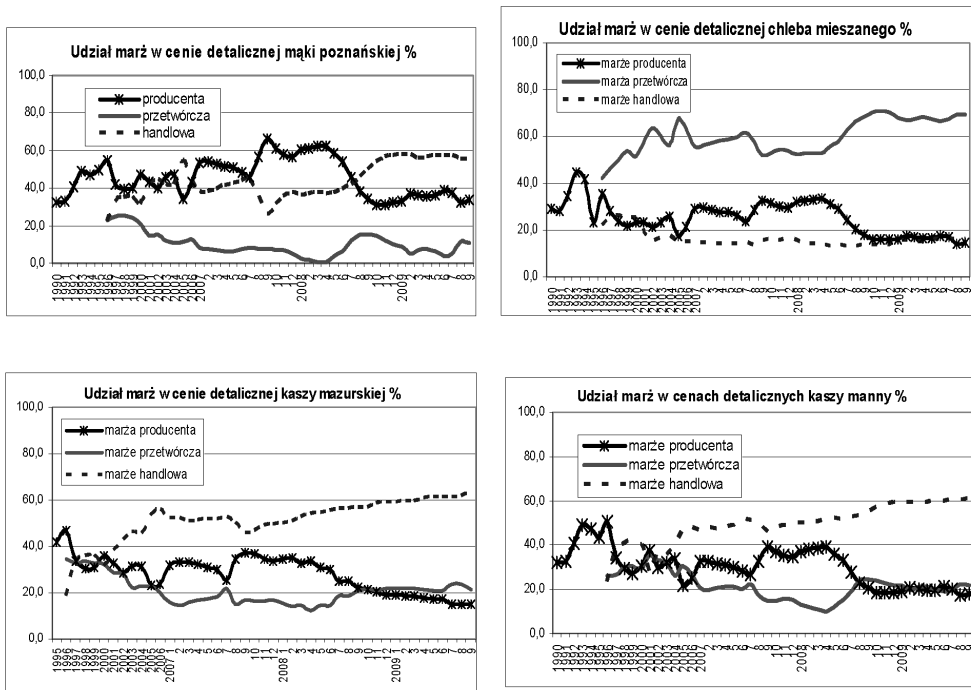
Analiza transmisji cen na rynku produktów mięsnych wskazuje, że dominującym kierunkiem przepływu impulsów cenowych jest transmisja w górę kanałów rynkowych, od cen surowca poprzez ceny przetworów na poziomie zakładów przetwórczych, aż po ceny detaliczne. Zmiany cen na wyższym poziomie rynku praktycznie w ogóle nie miały wpływu na zmiany cen na poziomie niższym. Zdecydowana większość zmienności cen zbytu produktów mięsnych kształtowana była przez zmiany cen żywca wieprzowego. Już w pierwszym miesiącu obserwowano wyraźną reakcję cen zbytu, która w kolejnych dwóch miesiącach ulegała wzmocnieniu, a po 4 miesiącach impuls cenowy wygasł. Reakcja cen koszyka wołowego na ceny skupu bydła była słabsza i trwała krócej.

Reakcja cen detalicznych na zmiany cen na poziomie zakładów przetwórczych była zróżnicowana w zależności od segmentu produktów. Najszybszą i najsilniejszą reakcję obserwowano w przypadku koszyka produktów wołowych (1 miesiąc). Wolniejszą reakcję obserwowano w przypadku koszyka przetworów mięsnych (3 miesiące). Najwolniejszą reakcję wykazywał koszyk produktów wieprzowych. Jednym z możliwych wytłumaczeń jest powiązanie cen detalicznych wieprzowiny z cenami mięsa drobiowego. Generalnie stwierdzo-

no jednak, że wpływ cen skupu na ceny detaliczne mięsa i jego przetworów uległ wyraźnemu osłabieniu. O ile w latach 1996-2001 przenoszenie cen skupu żywca na ceny detaliczne wieprzowiny oraz wołowiny było bardzo wyraźne, to w latach 2002-2008 reakcja ta była bardzo słabo zaznaczona.

Rynek zbóż

Analizę udziału marży producenta, marży przetwórczej i marży handlowej w cenach detalicznych przetworów zbożowych przeprowadzono dla mąki poznańskiej, kaszy manny, kaszy mazurskiej oraz chleba mieszanego, uwzględniając ceny skupu pszenicy, jęczmienia i żyta oraz współczynnik wydajności przemiałowej⁷.



Rys. 5. Udział marż w cenach detalicznych wybranych przetworów zbożowych

Podział marż między uczestników rynku zbóż istotnie różni się od rynku mleka oraz mięsa. Obserwuje się wyraźne zróżnicowanie wielkości marż między poszczególnymi produktami, a także znacznie wyraźniejszy spadek udziału producentów w cenie detalicznej przetworów zbożowych.

Z analizy udziału marż w cenie detalicznej przetworów zbożowych wynika, że najsilniej zmalał udział marży producenta zbóż w cenach detalicznych pieczywa, bo z 38 do 17%, przede wszystkim na rzecz marży przetwórczej. Jej udział w cenie detalicznej wzrósł z 42% w połowie lat 90. XX wieku do prawie 70% w II półro-

⁷ Przyjęty współczynnik wydajności przemiałowej wyniósł 0,72.

czu 2008 i w 2009 r., pod wpływem rosnących kosztów przede wszystkim przetwórstwa wtórnego (w tym głównie energii i kosztów pracy), wzrostu wartości dodanej oraz zmiany struktury sprzedaży, gramatury produktów finalnych i związanych z tym ukrytych podwyżek cen⁸. Natomiast udział marży handlowej w cenie detalicznej chleba mieszanego zmalał w tym czasie z 22-25% do 13-17%.

W przypadku mąki i kaszy głównym składnikiem ceny detalicznej stała się marża handlowa, której udział wzrósł w latach 1990-2009 z 18-23% do ponad 60%, kosztem surowca rolniczego i/lub marży przetwórczej. Udział cen skupu w cenach detalicznych mąki pozostał na poziomie około 33%, a w cenach detalicznych kasz zmniejszył się o połowę, do kilkunastu procent. Udział marży przetwórczej w cenach detalicznych kasz zmalał z ponad 30 do około 20%, a w cenach mąki z ponad 20 do poniżej 10%. Tak niski udział marży przetwórczej w cenie detalicznej mąki (poniżej 10% w latach 2007-2009), która jest głównym produktem młynarstwa, świadczy o wyraźnie pogarszającej się opłacalności pierwotnego przetwórstwa zbóż i słabej pozycji rynkowej firm młynarskich.

Bardzo duże różnice w wielkości marży handlowej między poszczególnymi artykułami zbożowymi wskazują, że detaliści stosują bardzo zróżnicowaną politykę cenową. W stosunku do bardzo często kupowanego chleba skłonni są zadowolić się bardzo niską marżą, kompensując to wysoką sprzedażą. Natomiast w stosunku do znacznie rzadziej kupowanej mąki czy kaszy, marża handlowa jest kilkakrotnie większa.

Analiza transmisji cen na poszczególnych poziomach rynku zbóż i ich przetworów dowodzi, że ceny zbóż nie reagują na zmiany cen przetworów zbożowych. Potwierdza to hipotezę, że ceny zbóż kształtowane są przede wszystkim przez uwarunkowania rynku międzynarodowego, a nie krajowego rynku produktów zbożowych. Ceny zbóż wywierają natomiast silny wpływ na ceny produktów zbożowych. W odniesieniu do mąki, impuls ze strony cen pszenicy uwidaczniał się już w pierwszym miesiącu i ulegał wzmocnieniu w ciągu kolejnych dwóch miesięcy, a po około 4 miesiącach szok cenowy na rynku pszenicy praktycznie w całości był przenoszony na ceny mąki. Nieco wolniej przenoszone były impulsy pomiędzy ceną kaszy a ceną jęczmienia.

We wszystkich analizowanych przypadkach stwierdzono impulsy przebiegające od cen hurtowych do cen detalicznych produktów zbożowych. Najszybciej oddziaływały one na ceny chleba, wolniej na ceny mąki, a najwolniej na ceny kaszy. Nie wykazano natomiast reakcji odwrotnej, tzn. wpływu cen detalicznych na ceny zbytu. Na podstawie uzyskanych wyników nie można mówić więc o wiodącej roli handlu detalicznego w kształtowaniu cen produktów zbożowych.

Biorąc pod uwagę skrajne poziomy rynku, można stwierdzić, że ceny pszenicy relatywnie szybko przenoszone są na ceny detaliczne chleba. W pierwszym miesiącu po wystąpieniu szoku cenowego na rynku pszenicy reakcja ta jest co prawda jeszcze bardzo słaba, ale w ciągu kolejnych miesięcy szybko rośnie. Po

⁸ Ukryte podwyżki cen związane ze zmniejszaniem gramatury wypiekanych wyrobów, zmianą nazwy i użytymi dodatkami związanymi z wyższymi cenami.

około 6 miesięcy szok na rynku zbóż był niemal w całości przeniesiony na ceny detaliczne chleba. W półrocznej perspektywie zmiany cen chleba w większości kształtowane były przez zmiany cen pszenicy. Porównanie wyników za podokresy 1996-2001 oraz 2002-2008 nie wskazuje na większe zmiany w procesie transmisji pomiędzy cenami chleba a cenami pszenicy. Jednak zauważalne jest nieco wolniejsze przenoszenie impulsów cenowych w drugim podokresie, a także nieco mniejszy udział zmian cen pszenicy w zmianach cen chleba. Można z tego wnioskować, że w trakcie badanego okresu wzrósł udział pozasuwrowcowych czynników kształtujących zmiany cen chleba.

Podsumowanie i wnioski

1. Poddanie sektora żywnościowego działaniu mechanizmu rynkowego doprowadziło do realnego potania żywności, co wyrażało się nie tylko wolniejszym wzrostem cen detalicznych żywności, ale przede wszystkim spadkiem udziału wydatków na żywność w całkowitych wydatkach konsumentów.
2. Realny spadek cen produktów rolniczych był znacznie głębszy niż cen detalicznych żywności. Co ważniejsze, towarzyszył mu wzrost cen środków produkcji. Duże dysproporcje między dynamiką wzrostu cen produktów sprzedawanych przez rolników i płaconych przez nich miały miejsce we wszystkich analizowanych okresach z wyjątkiem lat 2004-2008, kiedy podwyżki cen surowców rolniczych prawie w całości skompensowały wzrost cen detalicznych środków produkcji, aczkolwiek mijały się one w czasie. Głębokie spadki cen, zwłaszcza zbóż i żywca wieprzowego, będące głównie wynikiem cyklicznych wahań podaży, przy ograniczonym popycie powodowały, że cały agregat cen rolnych rósł znacznie wolniej niż środki produkcji, których ceny rosły także szybciej niż inflacja. Jest to podstawowa przyczyna niewydolności dochodowej większości gospodarstw rolnych i konieczności wspierania dochodów rolniczych.
3. Analiza zmian cen na poszczególnych poziomach rynków potwierdziła malejący udział cen skupu w cenach detalicznych jedynie na rynku zbóż, w tym przede wszystkim w odniesieniu do cen pieczywa. Na rynku mięsa od połowy lat 90. udział cen skupu w cenach detalicznych nie zmieniał się, z wyjątkiem wołowiny. Na rynku mleka udział producentów mleka pozostał wysoki, mimo spadków cen skupu, jakie następowały od początku 2008 r.
4. Okresowy wzrost udziału marży producenta w cenach detalicznych przetworów mlecznych dowodzi, że funkcjonowanie mechanizmu rynkowego na tym rynku było zakłócone realizowaną polityką cenową, WPR oraz wsparciem koniecznych procesów restrukturyzacyjnych. Odejście od rynkowego wsparcia, rozwiązanie problemów związanych z jakością mleka oraz przejście do nowego etapu procesu restrukturyzacji mleczarstwa prowadzi do zwiększenia płynności przesyłania impulsów cenowych między poszczególnymi poziomami rynku mleka. Potwierdza to spadek udziału cen skupu w cenach detalicznych przetworów mlecznych w latach 2008-2009.
5. Systematycznie wzrastający udział marż handlowych w cenach detalicznych przetworów mlecznych oraz artykułów zbożowych, kosztem głównie marż

- przetwórczych, potwierdza słabnącą pozycję rynkową przede wszystkim przetwórców mleka oraz pierwotnego przetwórstwa zbóż.
6. Analiza powiązań pomiędzy cenami na podstawowych rynkach rolno-spożywczych pozwoliła pogłębić charakterystykę tych rynków w Polsce. Na podstawowych rynkach rolno-żywnościowych zdecydowanie dominują przepływy impulsów cenowych od cen surowców, poprzez ceny zbytu zakładów przetwórczych, aż po ceny detaliczne. Przypadki, w których stwierdzano również transmisję cen w odwrotnym kierunku, były rzadkie. Wpływ cen surowców rolnych na ceny detaliczne produktów rolno-spożywczych uległ w badanym okresie wyraźnemu osłabieniu. W przypadku części produktów nastąpił co prawda wzrost marż cenowych, jednak jedynie w odniesieniu do produktów mleczarskich stwierdzano wyraźne zaburzenia w procesach transmisji cen, które mogą wynikać z odchylenia w funkcjonowaniu rynków od warunków konkurencyjnych.
 7. W świetle uzyskanych wyników można stwierdzić, że w perspektywie półrocznej wzrost cen skupu wieprzowiny o 1% prowadzi do wzrostu cen detalicznych koszyka wieprzowego o około 0,1%, analogiczny wzrost cen skupu mleka powoduje wzrost cen masła o około 0,5%, a wzrost cen pszenicy o 1% skutkuje 0,15% wzrostem cen detalicznych chleba.
 8. Ponadto warto dodać, że w latach 1996-2008 nastąpił wzrost wrażliwości cen produktów rolnych w Polsce na zmiany cen na rynkach zagranicznych. Widoczne to było zarówno w przypadku rynków zbóż, jak i żywca wieprzowego. Akcesja Polski do Unii Europejskiej miała wyraźny wpływ na transmisję cen pomiędzy rynkiem krajowym a rynkami zagranicznymi. Wyraźnie wzrosła wrażliwość rynków krajowych na ceny notowane w krajach UE, z tym, że z reguły impulsy cenowe przebiegały z rynków zagranicznych do Polski. Odwrotne słabe przepływy impulsów obserwowano tylko w przypadku rynku wieprzowiny.

Literatura:

1. Ewolucja rynku mięsnego i jej wpływ na proces transmisji cen. PW 2005-2009, nr 73. IERIGŻ-PIB, Warszawa 2007.
2. Ewolucja rynku zbożowego i jej wpływ na proces transmisji cen. PW 2005-2009, nr 38. IERIGŻ-PIB, Warszawa 2006.
3. Rembeza J., Seremak-Bulge J.: Ewolucja podstawowych rynków rolnych i jej wpływ na proces transmisji cen w latach 1990-2008. PW 2005-2009, nr 131. IERIGŻ-PIB, Warszawa 2009.
4. Rozwój rynku mleczarskiego i zmiany jego funkcjonowania w latach 1990-2005. PW 2005-2009, nr 21. IERIGŻ-PIB, Warszawa 2005.
5. Rozwój rynku ryb i zmiany jego funkcjonowania w latach 1990-2007. PW 2005-2009, nr 97. IERIGŻ-PIB, Warszawa 2008.
6. Rynek ziemniaka i ewolucja jego funkcjonowania oraz wpływ na proces transmisji cen. PW 2005-2009, nr 53. IERIGŻ-PIB, Warszawa 2006.
7. Tomek W.G., Robinson K.L.: Kreowanie cen artykułów rolnych. PWN, Warszawa 2001.
8. Welfe A.: Ekonometria - metody i ich zastosowanie. PWE, Warszawa 2001.

