

Bartosz Totleben

Ekonomiczne i polityczne uwarunkowania upadłości państwa

Economic and political determinants of state failure

Rozprawa doktorska

Promotor:

dr hab. Katarzyna Szarzec, prof. nadzw. UEP

Katedra Makroekonomii i Badań nad Rozwojem

Poznań 2017

Rodzicom

Spis treści

Wstęp	5
Rozdział 1. Upadłość państwa.....	11
1.1. Cechy i funkcje współczesnego państwa	11
1.2. Rola państwa w gospodarce.....	18
1.3. Modele rozwoju i upadłości państwa.....	29
1.4. Konceptualizacja państw upadłych i ich klasyfikacja.....	39
Rozdział 2. Determinanty upadłości państwa.....	52
2.1. Determinanty ekonomiczne	52
2.2. Determinanty polityczne	65
2.3. Pozostałe determinanty.....	72
2.4. Podsumowanie	81
Rozdział 3. Identyfikacja czynników zwiększających zagrożenie wystąpienia upadłości państwa	83
3.1. Dobór obserwacji, zmiennych i wykorzystana metoda badawcza.....	83
3.2. Analiza przeżywalności państw	95
3.2.1. Determinanty ekonomiczne	95
3.2.2. Determinanty polityczne.....	105
3.2.3. Pozostałe determinanty	111
Rozdział 4. Determinanty upadłości państwa – analiza empiryczna	116
4.1. Dane i metoda badawcza	116
4.2. Klasyfikacja państw ze względu na wybrane czynniki – analiza dyskryminacyjna	125
4.3. Wpływ wybranych czynników na prawdopodobieństwo upadłości państwa – analiza logistyczna	133
4.4. Podsumowanie	141
Zakończenie	153

Aneks 1. Determinanty zagrożenia państwa upadłością– przegląd literatury.....	157
Aneks 2. Przyporządkowanie badanych państw do grup ze względu na wartości wybranych zmiennych	174
Bibliografia	182
Spis wykresów	202
Spis tabel	203
Spis rysunków.....	205
Summary	206

Wstęp

Refleksje nad procesami tworzenia i zasadami funkcjonowania państwa niemal od zawsze znajdują się w centrum wszelkich analiz zarówno z zakresu nauk ekonomicznych, jak również politycznych. Arystoteles [2003] już w IV w. p. n. e. podkreślał, iż zadaniem państwa jest zapewnianie bezpieczeństwa, wymiaru sprawiedliwości i wolności ekonomicznej. W XVII wieku Thomas Hobbes wskazywał na potrzebę istnienia silnej, scentralizowanej władzy, bez której nie jest możliwe efektywne gospodarowanie. Jego zdaniem państwo jest powoływane przez jednostki oczekujące bardziej dostatniego i szczęśliwego życia oraz „wydobycia z nędznego stanu wojny” [Hobbes 1651/1954, s. 147, 337-351]. Również w innych, przełomowych pracach odnaleźć można postulaty dotyczące szczególnej roli państwa w zapewnianiu warunków do gospodarowania, w tym ochrony własności i zapewniania wolności gospodarczej [por.: Locke 1690/1992; Smith 1776/2015; Say 1821/1960; Veblen 1904; Pigou 1912, 1920; Keynes 1936/2003; Friedman 1962/2008]. Pomimo znacznych różnic w postrzeganiu roli państwa w gospodarce, panuje zgoda, iż do jego podstawowych funkcji należy zapewnianie bezpieczeństwa i poszanowania praw własności.

Podjęta w dysertacji problematyka badawcza dotyczy uwarunkowań upadłości państwa i stanowi próbę zidentyfikowania ekonomicznych oraz politycznych czynników wpływających na prawdopodobieństwo jej wystąpienia. Pojęcie „państwo upadłe” po raz pierwszy zostało użyte dopiero pod koniec XX wieku przez G. Helmana i S. Ratnera [1992] jako określenie skutków kryzysu struktur państwowych. Trzy lata później wydano pierwszą książkową publikację poświęconą upadkowi i rozkładowi państwa [Zartman 1995]. Przedstawiono w niej upadłość państwa jako sytuację, w której główny ośrodek decyzyjny (władza) nie może wypełniać swoich podstawowych funkcji w wyniku problemów z uznawaniem jego zwierzchnictwa terytorialnego, brakiem wiarygodności państwa jako organizacji politycznej oraz nieefektywnej organizacji systemu społeczno-gospodarczego.

W literaturze spotyka się liczny zestaw, niekiedy wykluczających się, określeń na zawodność struktur państwowych, ze szczególnym rozróżnieniem stopnia rozkładu funkcji państwa. Do tych określeń, oprócz państw upadłych należą także: państwa słabe (ang. *weak states*), upadające (ang. *failing states*), zawodzące (ang. *failure states*), wrażliwe (ang. *vulnerable states*), kruche (ang. *fragile states*), dysfunkcjonalne (ang.

dysfunctional states), w kryzysie (ang. *crisis states*), bezrządne / w chaosie (ang. *chaos states*), załamane (ang. *collapsed states*) oraz powracające (ang. *recovering states*). Dokonując krytycznego przeglądu literatury, a także zestawiając poglądy na podstawowe zadania państwa z wykorzystywanymi powszechnie definicjami jego upadłości, w pracy przyjęto, iż **zjawisko upadłości państwa polega na nieposiadaniu przez organy rządzące realnej siły i legitymizacji do sprawowania władzy oraz braku zdolności do przymusu wykonywania aktów prawnych na terenie całego kraju.**

W polskiej literaturze termin „upadłość państwa” wykorzystywany jest jednak zarówno do określenia zawodności struktur państwowych (częściej), jak i jego niewypłacalności (rzadziej). Mariusz Muszyński [2013, s. 29] zwraca uwagę, iż „niewypłacalność państwa jest stanem, którego treścią jest brak zdolności finansowej państwa do regulacji jego zobowiązań finansowych. Jednak w przeciwieństwie do podmiotu prawa krajowego państwo nie upada wskutek niewypłacalności. **Upadek państwa jest bowiem możliwy wyłącznie w przypadku spełnienia przesłanek wskazanych w prawie międzynarodowym (podkr. BT), do których nie należą odmowa lub brak możliwości spłaty zobowiązań finansowych**”. Należy więc wyraźnie rozróżnić upadłość państwa, która jest przedmiotem niniejszej rozprawy, od jego niewypłacalności.

Na wagę omawianego problemu wskazują charakterystyki krajów zmagających się z zawodnością struktur państwowych. Według danych organizacji Fund for Peace, w 2015 roku 34 kraje (na 178 sklasyfikowanych) były uznawane jako upadłe bądź wysoce zagrożone upadłością. Stanowiły one niecałe 20% wszystkich ocenianych państw. Zamieszkiwane były przez ponad 1,28 mld ludzi (ok. 18% populacji świata), a średni PKB per capita był prawie 50-krotnie niższy niż w tzw. krajach stabilnych. Oczekiwana długość życia w momencie narodzin obywateli państw upadających jest aż o 30% niższa niż krajów stabilnych. Do państw upadłych napływa prawie połowa (47,2%) światowych środków dystrybuowanych w ramach oficjalnej pomocy rozwojowej [World Development Indicators]. Nie ulega również wątpliwości, iż upadłość państwa skutkuje skrajnie nieracjonalną alokacją dóbr, co przyczynia się do nieefektywnego wykorzystywania czynników produkcji [por. Olson 1965, 1993, 2000].

Na podstawie krytycznego przeglądu literatury wykazano, iż istnieje liczny zestaw czynników mogących warunkować upadłość państwa. Można je podzielić na

wiodące grupy, wśród których wyróżnia się czynniki ekonomiczne, polityczne oraz pozostałe (w tym geograficzne, historyczne oraz kulturowe).

Z wielu prac wynika, że wraz z poprawą sytuacji ekonomicznej spada zagrożenie wystąpienia upadłości państwa [Carment, Prest, Samy 2008; Bertocchi, Guerzoni 2012]. Wolnorynkowy system gospodarczy i demokracja nie zawsze są jednak skorelowane z rozwojem państwa [Sachs 2006], a więc upadłość może występować również w krajach o takiej charakterystyce. Z tym poglądem polemizuje m.in. Easterly [2008].

Na kluczową rolę instytucji ekonomicznych oraz politycznych w kontekście stabilności i upadłości państwa zwracają uwagę North, Wallis i Weingast [2009a] oraz Acemoglu i Robinson [2014]. W przeprowadzonych analizach wykazują, iż rolą państwa jest zapewnienie instytucji ekonomicznych i politycznych stymulujących rozwój gospodarczy. W przeciwnym wypadku następuje pogłębienie asymetrii dostępu do rent ekonomicznych, a w konsekwencji upadłość państwa. Z badań wynika także, że państwa doświadczające upadłości są bardziej narażone na powtórne problemy w tym zakresie [Chauvet, Collier 2005].

W literaturze przedmiotu stwierdza się, iż czynniki geograficzne nie mają bezpośredniego wpływu na upadanie państw [Vallings, Moreno-Torres 2005; Acemoglu, Robinson 2014]. Niekorzystne położenie geograficzne może być jednak barierą rozwoju gospodarczego [Sachs 2006], co zwiększa prawdopodobieństwo upadłości. Uwzględnienie przeszłości kolonialnej prowadzi do wniosku, że państwa będące byłymi koloniami brytyjskimi są mniej zagrożone upadłością, niż inne były kolonie [Collier, Sambanis 2005; Bertocchi, Guerzoni 2012]. Fernandez [2010] wykazuje z kolei, iż dominująca religia wpływa pośrednio na zagrożenie wystąpienia upadłości państwa.

W przytoczonych pracach badania koncentrują się głównie na procesie upadłości państwa w kontekście poszczególnych grup wymienionych czynników, bądź dotyczą zawężonego zakresu przestrzennego (głównie do państw z obszaru Afryki lub Afryki Subsaharyjskiej) albo czasowego. Mając na uwadze powyższe, w dysertacji podjęto próbę wypełnienia luki badawczej w analizach uwarunkowań upadłości państwa. Przeprowadzono badanie wpływu szerokiej grupy determinant na prawdopodobieństwo upadłości państwa dla ponad 50-letniego okresu badawczego oraz zakresu przestrzennego obejmującego 77 państw. Głównym celem pracy jest prezentacja oraz

ocena głównych przyczyn upadłości państwa, ze szczególnym uwzględnieniem czynników ekonomicznych oraz politycznych.

Głównemu celowi pracy zostały przyporządkowane następujące cele szczegółowe:

1. Identyfikacja zespołu cech charakterystycznych dla państw upadłych.
2. Dokonanie autorskiej klasyfikacji czynników determinujących upadłość państwa.
3. Wyznaczenie współzależności pomiędzy zidentyfikowanymi czynnikami a prawdopodobieństwem upadłości państwa.

Na podstawie krytycznego przeglądu literatury, celu głównego oraz celów szczegółowych przyjętych w pracy sformułowano trzy hipotezy badawcze:

Hipoteza 1: Czynniki ekonomiczne i polityczne determinują zagrożenie państwa upadłością.

Hipoteza 2: Prawdopodobieństwo upadłości państwa maleje wraz z poprawą sytuacji ekonomicznej.

Hipoteza 3: Prawdopodobieństwo upadłości państwa jest niższe w krajach demokratycznych.

Zakres czasowy pracy obejmuje lata 1960-2015. Początek okresu badawczego został wybrany z uwagi na wyjątkowy charakter i natężenie zmian gospodarczo-politycznych w okresie postkolonialnym. Przyjęcie tak długiego okresu badawczego pozwoliło na uzyskanie wyników odnośnie istotności, kierunku i siły wpływu poszczególnych determinant na zagrożenie wystąpienia upadłości państwa.

Zakres przestrzenny pracy został ograniczony do państw świata, które zostały utworzone w 1960 roku lub później, a ich populacja przekracza 0,5 miliona osób¹. Umożliwiło to porównanie uwarunkowań upadłości państwa w licznej grupie krajów. Ostatecznie badaniu poddano bowiem 77 państw, spośród których 17 sklasyfikowano jako upadłe w co najmniej jednym roku okresu badawczego.

Metodami wykorzystywanymi w pracy są zarówno metody jakościowe, jak i ilościowe. Aby zrealizować cele postawione w dysertacji dokonano krytycznej analizy literatury przedmiotu w zakresie roli państwa w gospodarce oraz czynników warunkujących upadłość państwa.

¹ Ograniczenie dotyczące populacji wynika z faktu, iż baza danych stanowiąca podstawę do klasyfikowania państw jako upadłe bądź nieupadłe obejmuje jedynie państwa o takiej charakterystyce.

Rozprawa została oparta na polsko- oraz anglojęzycznym zasobie bibliograficznym i obejmuje opracowania zwarte, analizy statystyczne, artykuły naukowe, a także raporty przygotowane przez instytucje rządowe i międzynarodowe. Dane ilościowe wykorzystane w badaniach mają charakter wtórny i pochodzą z zasobów Banku Światowego i Międzynarodowego Stowarzyszenia Rozwoju, Międzynarodowego Funduszu Walutowego, bazy Penn World Table, a także organizacji Center for Systemic Peace, Fund for Peace, Institute for Economics and Peace, Mo Ibrahim Foundation oraz kilkunastu innych źródeł.

Metody ilościowe opierają się na metodach statystycznych oraz ekonometrycznych. W celu wyznaczenia współzależności pomiędzy zidentyfikowanymi czynnikami a prawdopodobieństwem upadłości państwa, przeprowadzono badanie z wykorzystaniem statystycznej analizy przeżycia [Iqbal, Starr 2007] oraz analizy dyskryminacyjnej i modeli logitowych [King, Zeng 2001; Iqbal, Starr 2008; Howard 2010, 2016]. Wykorzystane metody umożliwiają ocenę kierunku i siły wpływu zidentyfikowanych determinant na zagrożenie państwa upadłością. W celu przetestowania wrażliwości uzyskanych parametrów, dokonano analiz porównawczych estymowanych modeli. Pozwoliło to na zidentyfikowanie zestawu czynników najlepiej opisującego zjawisko upadłości państwa oraz weryfikację postawionych hipotez badawczych.

Układ i treść dysertacji podporządkowane zostały realizacji celu głównego oraz celów szczegółowych, a także przedmiotowi badań. Zasadnicza część rozprawy składa się ze wstępu, czterech rozdziałów oraz zakończenia. Dodatkowo zawarto spis literatury wykorzystanej w pracy, spisy tabel i wykresów, a także dwa aneksy.

Celem **pierwszego rozdziału** jest identyfikacja zespołu cech charakterystycznych dla państwa, ze szczególnym uwzględnieniem państw upadłych. Na podstawie analizy literatury wyszczególniono także funkcje państwa w gospodarce. W oparciu o prace Northa, Wallisa i Weingasta [2009a] oraz Acemoglu i Robinsona [2014] sformułowano i zaprezentowano modele rozwoju i upadłości państwa. Dokonano również krytycznego przeglądu definicji upadłości państwa oraz zaprezentowano 9 klasyfikacji upadłości. Porównano ich budowę, a także obliczono współczynniki statystycznej korelacji pomiędzy nimi.

Drugi rozdział zawiera krytyczny przegląd literatury z zakresu determinant upadłości państwa. Zostały one podzielone na trzy kategorie: uwarunkowania ekonomiczne, polityczne oraz inne (w tym: geograficzne, historyczne i kulturowe).

Zidentyfikowane determinanty stanowią podstawę doboru zmiennych do badań statystyczno-ekonometrycznych prowadzonych w kolejnych częściach dysertacji.

Treść **trzeciego rozdziału** stanowi prezentacja wpływu wybranych czynników ekonomicznych, politycznych, geograficznych, historycznych oraz kulturowych na prawdopodobieństwo wystąpienia upadłości w państwach utworzonych w 1960 roku i później. Przeprowadzona w pierwszym rozdziale analiza umożliwiła przyjęcie definicji upadłości państwa wykorzystywanej w dysertacji oraz dokonanie jej operacjonalizacji. Zaprezentowano ogólną charakterystykę grupy badawczej z podziałem na wyznaczone wcześniej czynniki, a następnie zidentyfikowano zmienne warunkujące zagrożenie państwa upadłością w badanym okresie za pomocą estymacji statystycznej funkcji przeżycia.

W **rozdziale czwartym** wyznaczono współzależności pomiędzy zidentyfikowanymi czynnikami a prawdopodobieństwem wystąpienia upadłości państwa. Przeprowadzono analizę ilościową, aby na gruncie empirycznym zweryfikować postawione hipotezy badawcze. Wykorzystano analizę dyskryminacyjną, za pomocą której możliwe jest ustalenie wpływu wybranych czynników na prawdopodobieństwo upadłości państwa. W dalszej kolejności estymowano parametry modeli z wykorzystaniem regresji logistycznej. Pozwoliło to na wyodrębnienie grupy czynników, które wpływają na prawdopodobieństwo upadłości państwa, oraz określenie kierunku i siły wpływu. Następnie porównano wnioski wynikające z estymowanych modeli.

Autor chciałby podziękować przede wszystkim Promotorowi niniejszej pracy, dr hab. Katarzynie Szarzec, prof. nadzw. UEP, za konstruktywną krytykę, niezwykle cenne uwagi i komentarze oraz za osobiste zaangażowanie, bez których praca nie uzyskałaby obecnej formy. Podziękowanie kieruję również w stronę dr hab. Doroty Appenzeller, prof. nadzw. UEP, za liczne konsultacje empirycznej części pracy, dra hab. Dawida Piątka za wsparcie oraz niezliczone dyskusje, a w stronę dr Agnieszki Kukułki za merytoryczne wsparcie podczas przygotowywania ilościowej części badania. Osobne podziękowania składam wszystkim Pracownikom i Doktorantom Katedry Makroekonomii i Badań nad Rozwojem, których komentarze i wskazówki pozwoliły nadać pracy obecny kształt. Pełną odpowiedzialność za ostateczną treść pracy ponosi wyłącznie jej autor.

Rozdział 1. Upadłość państwa

1.1. Cechy i funkcje współczesnego państwa

Ewolucja poglądów na państwo ma charakter ciągły i niezakończony. Na przestrzeni dziejów można zaobserwować liczne formy państwa, różniące się stopniem skomplikowania aparatu państwowego oraz motywacją jego powoływania. Są to m.in.: struktury quasi-państwowe (organizacje powoływane w celu wykonywania określonych, prostych zadań, np. wczesna Mezopotamia), miasta-państwa (zrzeszające obywateli zamieszkujących miasto, np. greckie polis), monarchie (były ponadnarodowe połączone osobą władcy), aż po państwa narodowe, których podstawą jest zamieszkiwanie terytorium przez odrębny naród². Współczesne, nowoczesne państwa zaczęły powstawać około 400-500 lat temu w okresie konsolidacji monarchii szwedzkiej, hiszpańskiej i francuskiej. Impulsem do budowy sprawnych państw były zwykle wojny i względy bezpieczeństwa narodowego, co można obserwować chociażby na przykładach wojny secesyjnej, okresach dwóch wojen światowych oraz czasu zimnej wojny. Konsekwencją narastającego napięcia pomiędzy społeczeństwami oraz trwających konfliktów zbrojnych była potrzeba istnienia scentralizowanej władzy. Tylko silne i sprawne państwo było bowiem w stanie militarnie konkurować na arenie międzynarodowej [Porter 1994]. W literaturze można jednak spotkać poglądy o końcu ery państw narodowych na skutek postępującej globalizacji oraz powstawania korporacji ponadnarodowych, które swoją siłą ekonomiczną niejednokrotnie przewyższają niektóre państwa. Kontrola przepływu kapitału i jego konsekwencji (w postaci wpływu na sytuację ekonomiczną i polityczną) jest bardzo trudna, a niekiedy wręcz niemożliwa. Już w połowie lat osiemdziesiątych XX wieku Kalevi Holsti [1985] zwracał uwagę na możliwy kres państw narodowych (tzw. nekrologizm).

Zgodnie z tzw. „klasyczną definicją państwa”, autorstwa Georga Jellinka [1921, s. 81-86], państwo to korporacja osiadłego ludu, która jest wyposażona w bezpośrednią i samorodną władzę zwierzchnią. Jest to trójelementowa definicja państwa ujmująca jednocześnie terytorium, ludność oraz władzę. Państwo jest określonym stosunkiem woli panującego oraz jego poddanych, który opiera się na wspólnym dążeniu do utrzymania jedności reprezentowanej przez społeczność. Jako kryterium owej jedności przyjmuje się wspólnotę celów, która łączy całą zbiorowość (tzw. jedność

² Szerzej o ewolucji idei państwa, m.in.: Klima [2009].

teleologiczna). Państwo reprezentuje swoją wolę w postaci stanowionego i powszechnie przestrzeganego prawa [por. Sylwestrzak 2013, s. 282-285].

Na początku XX wieku niemiecki socjolog i ekonomista Max Weber prowadząc rozważania na temat państwowości, zdefiniował posiadanie władzy jako szansę, w ramach określonych stosunków społecznych, pozyskania dla własnych zamierzeń posłuchu w grupie, nawet wbrew woli jej członków. Wskazywał on, iż cechami charakterystycznymi władzy są jej wertykalność³ i asymetryczność⁴. Weber dokonuje również podziału rodzajów władzy, na podstawie którego następnie wskazuje fundamentalne zadania, jakie powinny być realizowane przez państwo. Wyróżnia on następujące rodzaje sprawowania władzy [Weber 2002, s. 161-192]:

- panowanie tradycyjne („władza tradycyjna”) – podstawa, na której wspiera się prawomocność panowania, a także podstawa wiary w ową prawomocność, jest oparta na „świętości odwiecznych porządków” (tj. „istniejących od zawsze”) i władzy pana. Przywilej sprawowania władzy przez pana (lub przez wielu panów) związany jest z tradycją. Charakterystycznym jest, iż panujący nie jest „przełożonym” obywateli, ale osobowym panem, zaś sztab administracyjny nie składa się z urzędników, lecz z osobistych sług. Ludzie podlegający takiemu panowaniu nie są więc „członkami” równorzędnego związku z panem, lecz jego poddanymi;
- panowanie charyzmatyczne („władza charyzmatyczna”) – władza oparta jest na charyzmie przywódcy. Charyzmę określa się jako uznawaną za niepowszechną cechę jakiejś osoby, z racji której uważana jest ona przez innych za obdarzoną nadprzyrodzonymi, nadludzkimi lub przynajmniej niezwykłymi siłami czy właściwościami. Posiadanie owej charyzmy czyni wybrane jednostki zdolnymi do podporządkowania sobie grup ludzi;
- panowanie legalne z biurokratycznym sztabem administracyjnym („władza legalna”) – jest to sposób sprawowania władzy przez określone organy, których zakres kompetencji i zadań jest ograniczony. Wykluczone jest równocześnie

³ Wertykalność władzy polega na wyróżnieniu dwóch stron w obowiązujących relacjach, wśród których wyróżnia się stronę aktywną (rządzącą, rozkazodawczą, zwierzchnią) oraz bierną. Strona bierna na mocy przepisów jest podległa wobec strony aktywnej i „daje posłuch jej rozkazom”.

⁴ Asymetryczność władzy oznacza, że możliwość wpływania na siebie dwóch elementów władzy (tj. rządzących i rządzonych) nie jest taka sama (jest asymetryczna), choć nigdy strona rządząca nie ma pełnego wpływu na zachowania rządzonych.

jakikolwiek zawłaszczenie stanowiska przez osobę, które je piastuje. Władza i jej zakres przyporządkowane są więc do stanowiska, nie zaś do konkretnej osoby.

Ostatni z wymienionych rodzajów władzy jest najistotniejszy z punktu widzenia współczesnej państwowości oraz efektywnego działania organów państwowych. Weber wskazuje, iż monopol na używanie siły na swoim terytorium jest fundamentalną i niezbywalną cechą państwa⁵. Władza, która posiada ów monopol, może być efektywnie stosowana w celu ochrony granic danej wspólnoty przed agresją ze strony innych jej członków bądź wtargnięciem kogoś z zewnątrz. Niezbędna jest również do nałożenia kontroli oraz ograniczeń na jednostki lub grupy jednostek, które używają (lub grożą użyciem) przemocy bądź dokonują oszustw w celu realizacji swoich partykularnych interesów. Sprawowanie władzy, szczególnie w przypadku stabilnej władzy politycznej, przybiera kształt wydawania rozkazów. Zwykle opatrzone są one dodatkowo informacją o karze jaka grozi za ich nieprzestrzeganie. Wykonywanie władzy politycznej staje się tym bezpieczniejsze, efektywniejsze i mniej kosztowne, im bardziej odwołuje się ono do zasad, które ją legitymizują. Innymi słowy, im społeczeństwo wykazuje większą świadomość celów rozkazów oraz zgadza się z nimi, tym większa skuteczność rządu (zgodnie z łacińską frazą: *Etsi coactus tamen volui* – mogę być przymuszony, ale w ostatecznym rozrachunku angażuję moją wolę).

W swoich rozważaniach Weber [1964, s. 154-156] podkreśla także korporacyjny charakter bardzo specyficznej organizacji, jaką jest państwo. Zwraca uwagę, iż w idealnym państwie istnieje restrykcyjny podział zakresu dozwolonych zachowań i obowiązków urzędników⁶, a także zbudowana jest hierarchiczna i wieloinstancyjna struktura. Podejmowanie decyzji odbywa się wyłącznie na podstawie obowiązujących przepisów i jest potwierdzone przez spisywane i archiwizowane dokumenty. Koncepcja ta całkowicie eliminuje elementy osobiste i emocjonalne w procesie sprawowania władzy i zarządzania państwem [Inglot-Brzęk 2009, s. 376].

Równie często w literaturze przedmiotu wykorzystuje się definicję państwa autorstwa Barry'ego Buzana [1991, s. 65-66]. Charakteryzuje on państwo jako

⁵ Jedynie państwo ma prawo do czasowego zezwolenia innym podmiotom (np. policji, wojsku, agencjom ochrony etc.) na stosowanie przymusu bezpośredniego, jak i natychmiastowego odebrania tego przywileju.

⁶ Szerzej o strukturze władzy w państwie (w tym zasadach podziału władzy) w: [Metelska-Szaniawska 2008, s. 121-128].

suwerenny podmiot, o którego istnieniu przesądzają trzy czynniki: podstawa fizyczna, instytucje państwa oraz idea państwa.

Do elementów podstawy fizycznej państwa Buzan zalicza jego (względnie stałą) ludność, terytorium rozumiane jako wyznaczony granicami fragment kuli ziemskiej będący pod jego kontrolą oraz posiadane surowce naturalne, które są niezbędne do suwerennego działania.

Kolejnym elementem, który wyróżnia Buzan, są instytucje państwa. Choć w literaturze przedmiotu zwraca się uwagę na niejednoznaczność pojęć i definicji [Ratajczak 2011, s. 31; Stankiewicz 2012, s. 42] wykorzystywanych w dyskusjach na temat instytucji⁷, możliwy jest wyraźny podział instytucji na te o charakterze formalnym oraz nieformalnym [Williamson 2000; Fiedor 2015, s. 91-97]. Instytucje państwa są instytucjami formalnymi i należy je utożsamiać z regułami zachowań stworzonymi przez państwo na mocy jego siły i autorytetu⁸. Nierozzerwalnie związane są więc ze stanowionym prawem. Douglass Cecil North [1990, s. 3] traktuje instytucje jako pewnego rodzaju „reguły gry” pomiędzy podmiotami gospodarującymi. Z kolei Hodgson [2006, s. 2] opisuje je jako „systemy ustalonych i powszechnie stosowanych reguł społecznych, które kształtują interakcje społeczne”. Do instytucji, w szerokim znaczeniu, zalicza nie tylko formalne reguły stanowione przez państwo, ale nawet takie czynniki jak: język, waluta oraz funkcjonujący system miar i wag. Elinor Ostrom [2008, s. 823] podkreśla, że „instytucje są niewidoczne” i stanowią swego rodzaju ukrytą wiedzę, w odróżnieniu od wiedzy wyraźnie sformułowanej i zapisanej, co dodatkowo utrudnia ich identyfikację i pomiar. Natomiast Janina Godłów-Legiędź [2010, s. 67] opisuje instytucje jako formalne ograniczenia kształtujące interakcje w społeczeństwie.

Postać instytucji państwa może być determinantą wzrostu i rozwoju gospodarczego oraz trwałości państwa (gdy stanowią źródło odpowiednich bodźców ekonomicznych), ale także – w sytuacji braku ich efektywności – może blokować wzrost gospodarczy i zwiększać zagrożenie utraty kontroli nad terytorium państwa przez władzę.

Trzecim czynnikiem, przesądzającym o istnieniu państwa jest idea państwa. Związana jest ona z celami, do realizacji których państwo zostało powołane. Stanowi

⁷ Szeroka analiza istoty instytucji i wykorzystywanych definicji w: Pańków [2014, s. 57-73].

⁸ Jak zauważa Mączyńska [2015, s. 18] państwo jest polityczno-instytucjonalną formą organizacji społeczeństwa oraz gospodarki.

także swoiste spoiwo, które łączy społeczność w ramach jednego państwa⁹. Idea państwa jest uwarunkowana m.in. instytucjami o charakterze nieformalnym: zaufaniem pomiędzy ludźmi, kapitałem społecznym, wspólnym uznawaniem i przestrzeganiem norm, jednolitym systemem wartości, kulturą oraz religią [por. Fukuyama 1996].

Szczególnym elementem instytucji nieformalnych jest kultura. W szerokim ujęciu, kultura określa sposób myślenia, odczuwania i reagowania. Obejmuje nie tylko działania i uczucia bardziej wysublimowane (tzw. „wyższe”), ale także całą sferę zwykłych, codziennych zachowań. Z kolei w wąskim znaczeniu kultura utożsamiana jest z cywilizacją i jej osiągnięciami lub pewnym „intelektualnym wyrefinowaniem”, którego przejawem są wykształcenie, sztuka oraz literatura. Można zatem stwierdzić, iż kultura jest pewnym niepisanym zbiorem zasad obowiązujących w grze społecznej i ekonomicznej. Fukuyama [2003, s. 169] definiuje ten zestaw nieformalnych wartości i norm etycznych wspólnych dla członków określonej zbiorowości jako kapitał społeczny. Bez względu jednak na przyjęty wymiar analizy, kultura jest zawsze zjawiskiem społecznym, ponieważ – przynajmniej do pewnego stopnia - jest wspólna dla ludzi żyjących w jednym środowisku społecznym [Noga 2014, s. 19-21]. Co istotne, kultury nie da się odgórnie zaplanować, ponieważ jednostki uczą się jej w trakcie procesu socjalizacji. Próby narzucania określonych ram kulturowych i społecznych, obserwowane m.in. w państwach kolonialnych (głównie w byłych koloniach francuskich), były nieefektywne i skazane na niepowodzenie. Należy również podkreślić, iż niekiedy przyczyny konfliktów pomiędzy jednostkami lub społeczeństwami nie leżą w sferze *stricte* ekonomicznej lub politycznej, ale wywodzą się z różnic w sposobie myślenia lub fundamentalnych przekonań [Hofstede, Hofstede, Minkov 2011, s. 20-21], a więc z kultury. Wilkin [2016, s. 79-97] dowodzi, iż kultura jest jednym z instytucjonalnych fundamentów gospodarki i państwa.

Zwraca się uwagę, iż nie tylko czynniki kulturowe, ale także te związane z tożsamością są źródłem różnic pomiędzy poszczególnymi krajami lub grupami wewnątrz kraju. Tożsamość należy rozumieć jako przynależność do pewnej grupy. Często jest ona pochodną języka, w którym porozumiewają się przedstawiciele danej społeczności, bądź też afiliacji religijnej. Jednocześnie źródeł różnic pomiędzy krajami i grupami należy upatrywać w sprzężeniu zwrotnym wyznawanych wartości oraz

⁹ Łoś-Nowak [2012, s. 522] podaje przykłady Indii, Rosji oraz USA, w których wspólna idea państwa połączyła wielonarodowe i wieloetniczne społeczności.

formalnych i nieformalnych instytucji [Hofstede, Hofstede, Minkov 2011, s. 36-39]. Easterly [2008, s. 72-74] stwierdza, że jednolita tożsamość wzmacnia zaufanie pomiędzy stronami transakcji, co z kolei prowadzi m.in. do zwiększonych obrotów handlowych i budowania sieci wzajemnych powiązań gospodarczych.

Różnice kulturowe pomiędzy członkami społeczności powodują, iż państwa mogą utknąć w tzw. „pułapce tożsamości kulturowej”. Jest to cecha charakterystyczna państw wielokulturowych, w których instytucje państwa osłabiają się bez silnej władzy centralnej. Efektywna i bezkonfliktowa współpraca między zbiorowościami wyznającymi różne systemy wartości jest bowiem trudniejsza niż między społeczeństwami, które wykazują cechy podobieństwa kulturowego [Wardin 2013, s. 40-42]. Zdarza się jednak, iż w czasie procesu tworzenia państwa lub zmieniania jego granic idea państwa schodzi niejako na dalszy plan, a decydujące znaczenie ma podstawa fizyczna. Wiele państw, które zostały utworzone w latach 60. XX wieku w czasie dekolonizacji Afryki, opisuje się jako „sztuczne” (ang. *artificial states*), tj. takie, w których podstawa terytorialna nie koresponduje z podziałem etnicznym [Alesina, Easterly, Matuszeski 2011, s. 246-247]. Jest to zaprzeczenie wspólnej idei państwa¹⁰. Granice zostały utworzone na skutek odgórnych decyzji o charakterze politycznym i ekonomicznym, co skutkuje współistnieniem wielu narodów, często skonfliktowanych ze sobą, w ramach jednego państwa.

Gianfranco Poggi [2010, s. 18-29] proponuje dodatkowe rozszerzenie definicji Buzana o kolejny czynnik wyróżniający państwo, tj. narodowość – ludność zamieszkująca dane terytorium powinna być zbiorowym bytem, wyróżniającym się na podstawie innej niż polityczna. Narodowość oznaczać może m.in. wspólne powiązania etniczne, posługiwanie się tym samym językiem, wyznawanie tej samej religii, wspólną spuściznę kulturową i instytucjonalną, a nawet poczucie wspólnego przeznaczenia. Instytucje nieformalne mają zatem istotne znaczenie dla trwałości państwa. Odgórne tworzenie „państw sztucznych”, które nie mają podstawy w narodzie, może skutkować osłabieniem idei państwa, a w konsekwencji problemami z właściwym

¹⁰ Jak zauważa Malinowski [1986, s. 39]: „wielkość zróżnicowań plemiennych i etnicznych jest charakterystycznym rysem rozwoju społecznego ludności Afryki, ponieważ podstawowym typem układu społecznego są formacje plemienne, zaś obowiązującym rodzajem świadomości społeczno-politycznej świadomość plemienia czy też klanu, a nie narodowa – jest całkowicie zrozumiałym, że liczne nie wygasłe od wielu lat antagonizmy i spory plemienne oraz etniczne występują ze zdwojoną siłą i natężeniem” [cytat za: Wardin 2013, s. 43].

funkcjonowaniem jego organów oraz integralnością terytorialną. Poggi zgadza się również z poglądami Webera i stwierdza, iż sprawowanie władzy na zasadach biurokratycznych oraz przez przypisywanie uprawnień do wykonywanej funkcji, a nie konkretnej osoby (władza legalna), jest najefektywniejszą formą współczesnych rządów. Jej najważniejszymi dystyngtywnymi cechami są: supremacja (pozycja dominująca względem innych rodzajów władzy) oraz ostateczność (rozumiana jako możliwość użycia przemocy fizycznej, która jest ostatecznym narzędziem w zarządzaniu relacjami między członkami społeczności).

Ugruntowana i stabilna władza polityczna jest podstawą funkcjonowania państwa jako systemu faktycznie regulującego stosunki społeczne. Posiada on następujące cechy [Oniszczyk 2011, s. 51]:

- terytorium państwa stanowi wyodrębniona granicami ukształtowanymi w procesie historycznym część obszaru kuli ziemskiej,
- władza organizuje ludzi – mieszkańców terenów wyodrębnionych granicami państwa (tzw. powszechność władzy państwowej),
- nadrzędna władza państwa jest elementem porządkującym działania ludzi,
- państwo nie podlega władzy innego państwa oraz sprawuje niepodzielne zwierzchnictwo nad swoim terytorium (suwerenność),
- zapewnia zorganizowanie i uporządkowanie działań ludzi dla realizacji przyjętych celów.

Warto zaznaczyć, iż na potrzeby prawa międzynarodowego stosuje się definicję zapisaną w 1. artykule Konwencji o Prawach i Obowiązках Państw (tzw. konwencja z Montevideo [1933]). Określono w niej cztery cechy, którymi musi charakteryzować się państwo. Są to: stała ludność, określone terytorium, władza oraz zdolność do wchodzenia w relacje z innymi krajami.

Z przytoczonych poglądów wynika, iż najefektywniejszą formą sprawowania władzy jest władza legalna, tj. oparta na zasadach biurokratycznych i przypisana do stanowisk, a nie konkretnych osób. Państwa powoływane są w celu usystematyzowania relacji pomiędzy członkami społeczności, a także pomiędzy całymi zbiorowościami. Jednocześnie nie rozstrzyga się, w jakim stopniu organy państwowe mogą (i powinny) ingerować w mechanizm rynkowy.

1.2. Rola państwa w gospodarce

Dyskusje ekonomiczne na temat państwa i jego roli skupiają się wokół dwóch głównych zagadnień. Po pierwsze, zadaje się pytania o motywacje i mechanizmy towarzyszące tworzeniu się państwa, tj. w jakim celu są one powoływane oraz w jaki sposób określa się relacje na linii obywatel-państwo (władza). Druga poruszana kwestia koncentruje się na funkcjach, które powinno spełniać już powołane państwo.

Pytania o podstawę powoływania państwa, a także o zakres jego obowiązków i uprawnień są przedmiotem badań przedstawicieli wielu dziedzin nauki, m.in. ekonomii, prawa, politologii, socjologii oraz filozofii. Szczególną rolę, z punktu widzenia niniejszej pracy, zajmują jednak zagadnienia związane z udziałem państwa w kreowaniu i kontrolowaniu sytuacji gospodarczej¹¹. Poglądy na temat powodów ingerencji państwa w mechanizm rynkowy, a także jej dozwolony zakres, są przedmiotem debat ekonomistów od wieków. W zależności od przyjętej perspektywy badawczej odmienne są objaśnienia mechanizmów tworzenia się państwa i jego struktur. Poszukuje się odpowiedzi na – niekiedy wręcz paradoksalne - pytania: dlaczego ludzie, jako wolne jednostki, dobrowolnie decydują się na powołanie państwa, które z definicji musi ograniczać ich wolność? Czy można zastąpić państwo innym tworem, który będzie spełniał swoje zadania z większą efektywnością i z mniejszą ingerencją w wolność jednostek? Czy rezygnacja z części wolności (jednego z podstawowych praw człowieka) może przynieść pozytywne skutki w wymiarze ekonomicznym, a także politycznym lub społecznym?

Odpowiedzi na tak postawione pytania należy szukać w ramach tzw. ekonomicznej teorii państwa [por. m.in. Hardin 1996, Moss 2010, Salavrakos 2012]. Mancur Olson [1993], amerykański ekonomista i socjolog, wprowadza do debat ekonomicznych termin „wędrującego bandyty” (ang. *roving bandit*), którym określa anarchistyczną grupę kontrolującą pewne, z reguły niewielkie obszarowo, terytorium. Charakterystycznymi cechami „wędrującego bandyty” są: brak poszanowania prawa, rozwiązywanie konfliktów z częstym uciekaniem się do przemocy i kradzieży oraz niszczenie cudzego mienia. Celem „wędrującego bandyty” jest więc zapewnienie sobie

¹¹ Stanisław Swadźba [2007, s. 380] zwraca uwagę, iż państwo od zawsze (w mniejszym lub większym stopniu) wywiera wpływ na gospodarkę. Początkowo działanie to miało charakter incydentalny, a z czasem przekształciło się w zorganizowaną działalność, której wyrazem stała się polityka ekonomiczna.

możliwie najwyższego poziomu użyteczności (rozumianej jako ekonomiczna miara zadowolenia), bez troszczenia się o konsekwencje w przyszłości. Co naturalne, istnienie owych anarchistycznych grup jest bardzo nietrwałe i ograniczone siłą podobnych grup.

Wyższy etap rozwoju społecznego stanowi państwo, które Olson nazywa „stacjonarnym bandytą” (ang. *stationary bandit*). Taka instytucja w scentralizowany i zinstytucjonalizowany sposób chroni swoich obywateli przed przemocą ze strony „wędrujących bandytów” i innych „stacjonarnych bandytów”, w zamian za możliwość czerpania zysków ekonomicznych. Olson [1993, s. 567] stwierdza wręcz, że „stacjonarny (osiadły) bandyta jednocześnie monopolizuje i racjonalizuje kradzież w postaci podatków”, zapewniając jednak w zamian bezpieczeństwo.

Ewolucja od „wędrującego bandyty” do „stacjonarnego bandyty” odbywa się stopniowo. Im większa jest świadomość rządzących o korzystnym wpływie utrzymywania bezpieczeństwa i zapewniania obywatelom swobody w wymianie towarów i dostępu do świadczeń, tym organizacja ma charakter bardziej „osiadły”. Olson podkreśla również, że jedynie państwo może być dostarczycielem tzw. dóbr wspólnych (używając zwrotu „*collective goods*”). Możliwa jest bowiem sytuacja, w której produkowanie (dostarczanie) pewnej grupy dóbr charakteryzuje się niższymi kosztami, gdy należy to do obowiązków państwa, a nie jest wynikiem działalności pojedynczych podmiotów. Wytwarzanie owych dóbr bez udziału państwa jest racjonalne jedynie w sytuacji, gdy cała społeczność przyczynia się do ich powstawania i czerpie korzyści z ich konsumpcji. W praktyce jednak, pomimo znacznych korzyści netto¹² osiągniętych ze współpracy całego społeczeństwa, pojedyncze jednostki nie mają interesu ekonomicznego w ich wytwarzaniu [Olson 1965, 2000]. Matematycznych dowodów na konieczność udziału państwa w zapewnianiu owych dóbr dostarcza Samuelson [1954, s. 387-388], który jako pierwszy wprowadza i definiuje używane do dziś pojęcie „dobra publicznego” (ang. *collective consumption good, public good*)¹³, czyli dobra niekonkurencyjnego w konsumpcji. Koszty wykluczenia pojedynczych osób z konsumpcji są zbyt wysokie, co stwarza pokusę nieuczestniczenia w procesie wytwarzania tych dóbr, a jedynie osiąganie zadowolenia z ich konsumpcji. Jest to tzw. „efekt gapowicza”¹⁴, którego negatywnym skutkiem przeciwdziała państwo

¹² Korzyści netto występują, gdy suma uzyskiwanych efektów przewyższa łączne koszty. Rozpatruje się nie tylko aspekty ekonomiczne, ale także społeczne.

¹³ Jako jedno z podstawowych dóbr publicznych wymienia obronę narodową.

¹⁴ Szerzej: por. Pasour [1981], Holcombe [1997].

(„stacjonarny bandyta”) – pobierając przymusowe podatki oraz finansując z nich wytwarzanie i dystrybuowanie podstawowych dóbr potrzebnych społeczeństwu.

Argumenty o korzyściach wynikających ze zrzeszania się grup ludzi w ustrukturyzowane zbiorowości są obecne od wieków w dyskusjach na gruncie ekonomicznym oraz politycznym. Jednym z pierwszych opracowań dotyczących roli państwa w gospodarce była *Polityka* Arystotelesa ze Stagiry [Arystoteles 2003]. Zwraca on uwagę, iż państwo jest naturalnym „tworem natury”, gdyż stoi ono zawsze powyżej jednostki. Pogląd ten uzasadnia faktem, iż poszczególne jednostki nigdy nie są i nie będą samowystarczalne, zaś państwo jako zbiór owych jednostek już może takowe być. Kategorycznie opowiada się jednak za prawem do posiadania majątku i odrzuca ideę „wspólności dóbr” jako niezgodną z naturą człowieka. Podkreśla również, iż jest to rozwiązanie o wiele bardziej efektywne ekonomicznie („Bo jeśli każdy troszczy się o swoje, nie będą sobie robić wzajemnie zarzutów i więcej też wytworzą, gdy każdy dla własnej korzyści pracuje” [Arystoteles 2013, s. 27])¹⁵. W „najlepszym państwie” główne działania rządzących koncentrują się wokół sił zbrojnych, „obradami nad tym, co pożyteczne” oraz wymiaru sprawiedliwości. Zadaniem państwa jest również zapewnianie wolności gospodarczej obywatelom, która znajduje swoje odzwierciedlenie w prawie do posiadania majątków ziemskich. Rolą państwa jest więc zaspokajanie i zabezpieczanie potrzeb materialnych obywateli [Justyńska, Justyński 2012, s. 21-24], co możliwe jest wyłącznie w warunkach braku wojny i poszanowania praw własności.

Tezę Arystotelesa o państwie jako tworze natury jednoznacznie odrzuca Thomas Hobbes, który stwierdza, że to członkowie społeczeństw świadomie decydują się na powoływanie państwa na drodze tzw. „umowy społecznej”. Hobbes podkreśla rolę szeroko pojętego bezpieczeństwa jako warunku niezbędnego do zapewniania i przestrzegania prawa naturalnego. Stan względnie stałego bezpieczeństwa może być utrzymywany jedynie na skutek umowy pomiędzy znaczną liczbą jednostek. Skupienie się dostatecznie licznej zbiorowości w celu zapewnienia sobie ochrony gwarantuje, iż „przyłączenie się do wroga niewielkiej liczby ludzi nie (będzie – BT) przeważało wyraźnie jego szans zwycięstwa” [Hobbes 1956]. Zapewnienie ochrony przez zbiorowość znacznie ogranicza więc występowanie niezorganizowanej przemocy.

¹⁵ Szerzej: [Arystoteles 2003]: Księga Druga, roz. 2. „Krytyka wspólności dóbr”. Por. także: [Zagóra-Jonszta 2007, s. 40-41].

W rozprawie filozoficznej *Lewiatan, czyli materia, forma i władza państwa kościelnego i świeckiego* zwraca on uwagę na potrzebę istnienia silnej, scentralizowanej i absolutystycznej formy rządów. Najczęściej spotykanym stanem natury jest „wojna wszystkich przeciw wszystkim”, a tylko silne rządy (silne państwo) jest w stanie uchronić obywateli od chaosu, anarchii i wojen domowych. Członkowie społeczeństwa świadomie rezygnują więc z części swojej wolności i powołują państwo, oczekując w zamian „wydobycie z nędznego stanu wojny”, a także możliwość bardziej dostatniego i szczęśliwego życia [Hobbes 1954, s. 147, 337-351].

Również John Locke w *Dwóch traktatach o rządzie* jednoznacznie opowiada się za wolnością jednostki oraz nieskrępowanym prawem do posiadania własnego majątku. Rolą państwa jest zabezpieczenie możliwości korzystania z tego prawa. Locke zwraca uwagę, iż w tzw. „stanie natury” każdy człowiek jest wolny, jednakże korzystanie ze swoich praw jest bardzo niepewne bez ochrony za strony państwa. Powołując państwo należy więc ograniczyć pewien zakres własnych wolności, w zamian za możliwość korzystania z pozostałej części. Postuluje obowiązek przekazania państwu monopolu na użycie siły, gdyż jest to skuteczniejszy mechanizm ochrony naturalnych wolności, niż system, w którym każda jednostka jest odpowiedzialna za ochronę wyłącznie siebie. Człowiek rezygnuje więc z przywileju karania innych i przekazuje to uprawnienie państwu, jednocześnie wspierając władzę wykonawczą społeczeństwa. Wynika z tego, że jednostki zmuszone są zrezygnować ze swojej naturalnej wolności (zabezpieczenia swojego losu) tak dalece, jak wymaga tego bezpieczeństwo, dobro i pomyślność wspólnoty. Locke [1992, s. 251-255] zwraca uwagę, iż jest to sprawiedliwe i konieczne, gdyż w ten sam sposób postępują wszyscy członkowie zbiorowości.

Znając przyczyny i skutki powstawania państwa należy także zadać pytanie o jego funkcje w gospodarce. Katarzyna Szarzec [2013], poddając analizie rolę państwa w gospodarce, wymienia główne przyczyny, dla których władza państwowa mogła ograniczać wolność gospodarczą jednostek na przestrzeni wieków. Po pierwsze, utrzymuje w ten sposób system naturalnej wolności (w myśl Adama Smitha) zapewniając sprawność funkcjonowania gospodarki wolnorynkowej. Po drugie – zgodnie z poglądami Friedricha Lista – większa ingerencja w gospodarkę (w tym w wolność jednostek) jest korzystna dla wzrostu bogactwa całego narodu, szczególnie w

przypadku państw, które nie wkroczyły na drogę industrializacji¹⁶. Na trzeci argument wskazuje Arthur Cecil Pigou, uzasadniając ingerencję państwa w gospodarkę istniejącymi ułomnościami (zawodnościami) rynku oraz powstawaniem nierówności społecznych. Na zupełnie odmienną rolę państwa w gospodarce wskazuje Karol Marks, zdaniem którego państwo jest jedynie „kategorią przejściową”, która zniknie, gdy ukształtuje się ustrój idealny – komunizm. Z kolei John Maynard Keynes rozpatrując rolę państwa wskazuje na konieczność korygowania mechanizmu rynkowego poprzez prowadzenie aktywnej polityki gospodarczej, co zwiększa zagregowany popyt w gospodarce i przyczynia się wzrostu poziomu życia ludności.

Twórca ekonomii klasycznej, Adam Smith, opublikował w 1776 roku dzieło pt. *Badania nad naturą i przyczynami bogactwa narodów*, które jest uznawane za pierwszy w historii traktat ekonomiczny [por. Bartkowiak 2008, s. 35-40]. Korzystając z dziedzictwa m. in. J. Locke'a¹⁷ (rolą rządzących jest ochrona życia, wolności i własności [Boaz 2005, s. 56]), formułuje on wnioski dotyczące pozytywnego wpływu wolności i prawa do własności na wzrost i rozwój gospodarczy. Smith traktuje system „naturalnej wolności” jako jedyny, uniwersalny ład społeczno-gospodarczy umożliwiający powiększenie bogactwa zarówno kraju, jak i jednostek. Wszyscy powinni być wolni w zakresie podejmowania decyzji, w szczególności tych o charakterze gospodarczym. Jedyne ograniczenia są możliwe w sytuacji, gdy prawa jednostki są atakowane i naruszane przez inne jednostki lub gdy dana jednostka sama narusza prawa innych. Smith kategorycznie odrzuca idee systemu merkantylistycznego¹⁸ i promuje system ekonomiczny oparty na wolności jednostki.

¹⁶ List uważa, iż jedynie państwo ma odpowiednią wizję przyszłego rozwoju i dlatego (w interesie całego narodu) ma prawo zachowywać się paternalistycznie i podejmować odpowiednie działania w tym zakresie. W jego ocenie państwo jest ważnym podmiotem inicjującym uprzemysłowienie gospodarki, bez udziału którego proces ten mogłyby się nie zacząć lub znacząco opóźnić.

¹⁷ J. Locke określał prawa poszczególnych jednostek do „swego życia, wolności i majątku” jako obiektywne i niezbywalne prawa natury. Zostały one nadane człowiekowi na mocy praw natury i żaden inny człowiek, ani tym bardziej państwo, nie mogą go tych praw pozbawić [Szarzec 2013]. Locke wskazywał, iż „każdy człowiek dysponuje własnością swojej osoby. (...) Cokolwiek zatem wydobyl on ze stanu ustanowionego i pozostawionego przez naturę, złączył ze swą pracą i przyłączył do tego, co jest jego własne, uczynił swą własnością” [Locke 1992, s. 181].

¹⁸ Por. Smith [2015] Księga IV: Rozdział 1. „O zasadzie systemu handlowego, czyli merkantylistycznego” i Rozdział 8. „Końcowe uwagi o merkantylizmie”. W poszczególnych rozdziałach Księgi IV Smith dowodzi, że zbyt duża ingerencja państwa (m.in. ograniczenie przywozu dóbr i premie

Człowiek jest egoistyczny ze swej natury, a jego zachowania przynoszą również korzyści całej gospodarce, dzięki działaniu tzw. „niewidzialnej ręki”¹⁹ (ang. *invisible hand*). Jak argumentuje Smith: „Nie od przychylności rzeźnika, piwowara czy piekarza oczekujemy naszego obiadu, lecz od ich dbałości o własny interes. Zwracamy się nie do ich humanitarności, lecz do egoizmu i nie mówimy im o naszych własnych potrzebach, lecz ich korzyściach”. Zadania państwa powinny więc ograniczać się do [Smith 2015, s. 343-487]:

- obrony społeczeństwa przed agresją zewnętrzną - poprzez finansowanie wojska,
- ochrony społeczeństwa przed nieuczciwymi działaniami innych jednostek, w tym działaniami zagrażającymi wolności – poprzez sprawny wymiar sprawiedliwości, m.in. sądownictwo i policję,
- dostarczania „urządzeń publicznych”²⁰, czyli dóbr niezbędnych i korzystnych dla części lub całego społeczeństwa, które jednak ze względu na swoją specyfikację nie mogą być dostarczane przez wolny rynek (z zysków ze sprzedaży tych dóbr nie jest możliwe pokrycie niezbędnych wydatków na ich wyprodukowanie i utrzymanie).

Smith podkreśla, iż realizowanie wszystkich wymienionych wyżej zadań jest korzystne dla całego społeczeństwa. Z tej właśnie przyczyny powinny być one wykonywane przez państwo, a finansowane przez wszystkich obywateli w sposób „najściślej dostosowany do ich możliwości”. Pozostałe kwestie społeczno-gospodarcze powinny być rozstrzygane wyłącznie przy udziale wolnego rynku. Należy podkreślić również, iż państwa i społeczeństwa relatywnie bogatsze skuteczniej wypełniają swoje zadania²¹. Oznacza to, że państwa o wyższych dochodach powinny – zgodnie z

eksportowe) przyczynia się do ograniczenia wzrostu bogactwa kraju. Krytykując merkantylizm zauważa m.in.: „Jedynym zadaniem i celem wszelkiej produkcji jest konsumpcja, a interesy producenta należy mieć na względzie o tyle tylko, o ile to może okazać się konieczne dla popierania interesów konsumenta. Zasada ta jest tak oczywista, iż byłoby rzeczą absurdalną próbować ją udowodnić. A jednak w systemie merkantylistycznym niemal zawsze poświęca się interesy konsumenta dla interesów producenta. System ten uważa, jak się zdaje, produkcję a nie konsumpcję, za ostateczny cel i przedmiot wszelkiej działalności przemysłowej i handlowej” [Smith 2015, s. 305].

¹⁹ Por. Giza [2012, s. 101-102; 2013, s. 55-59].

²⁰ „Urządzenia publiczne” u Smitha należy rozumieć jako współczesne dobra publiczne. Szczególny nacisk kładzie on na dobra publiczne związane z transportem i handlem.

²¹ „Wysokie koszty broni palnej dają (...) oczywistą przewagę narodowi bogatemu i cywilizowanemu nad ubogim i barbarzyńskim. W czasach starożytnych bogate i cywilizowane narody z

argumentacją Smitha - być bezpieczniejsze i gwarantować wyższą jakość dóbr publicznych, niż państwa o niższych dochodach. Bogacenie się narodów jest więc sposobem na ograniczanie zagrożenia wybuchu wojny, m.in. dzięki zwiększonej możliwości finansowania wydatków przeznaczonych na wojsko.

Z tezami Smitha o konieczności zapewniania bezpieczeństwa i sprawiedliwości obywatelom zgadza się Friedrich List, odrzuca jednakże ideę *laissez-faire*²². Zdaniem Lista państwo ma obowiązek ingerować w gospodarkę w sytuacji, gdy występują różnice w poziomach rozwoju gospodarczego pomiędzy narodami, a także gdy brakuje potencjału produkcyjnego niezbędnego do przejścia na etap industrializacji. Uważa on bowiem, iż jedynie państwo ma odpowiednią wizję przyszłego rozwoju i dlatego (w interesie całego narodu) ma prawo zachowywać się paternalistycznie i podejmować odpowiednie działania w tym zakresie²³. W jego ocenie państwo jest ważnym podmiotem inicjującym uprzemysłowienie gospodarki, bez udziału którego ten proces mogłyby się nie zacząć lub znacząco opóźnić. Jako zachęty do długoterminowych inwestycji, które służą powiększaniu potencjału państwa, wymienia m.in. ochronę praw własności, ograniczanie niepewności w gospodarowaniu oraz gwarantowanie praw patentowych. List, podobnie jak Smith, zwraca także uwagę na rolę państwa w tworzeniu infrastruktury transportowej i systemu obronnego państwa²⁴ [Szarzec 2013, s. 40-59].

Arthur C. Pigou w *Ekonomii dobrobytu* uzasadnia ingerencję państwa w gospodarkę występującymi nieefektywnościami wolnego rynku, do których zalicza m.in. efekty zewnętrzne (ang. *external economies*), powstawanie monopolii oraz nierówności społeczne. Pigou traktuje jednak państwo nie jako ograniczające wolność

trudnością broniły się przed ludami ubogimi i barbarzyńskimi (...). Wynalazek broni palnej (...) z pewnością sprzyja zarówno utrwaleniu, jak i krzewieniu cywilizacji” [Smith 2015, s. 363]. Obecnie dostęp do broni palnej stał się niemal powszechny, zarówno w skali państw jak i pojedynczych osób [por. Cook i in. 2007], jednakże nadal sektor państwowy dostarcza broń o najwyższym stopniu zaawansowania technologicznego, co sprawia, że państwa relatywnie bogatsze wypełniają swoje zadania skuteczniej.

²² Szerzej o genezie koncepcji *laissez-faire* w: [Pęciak 2016].

²³ Zdaniem Lista istniejące bodźce wolnorynkowe zawodzą w rozpoczęciu procesu industrializacji. Dzieje się tak, ponieważ pojedyncze jednostki patrzą jedynie na indywidualne korzyści i brak im długookresowej perspektywy rozwoju.

²⁴ Odmienne jednak do Smitha, List dopuszcza finansowanie tych inwestycji poprzez zaciągnięcie długu publicznego. Powinien on jednak stanowić obciążenie bogatych, a nie klasy pracującej.

jednostek, ale jako wkraczające w sytuacji, gdy wolny rynek nie umożliwia efektywnego rozwiązania problemów. Dodatkowo proponuje on rozszerzenie roli państwa o możliwość decydowania w sprawie ograniczania dostępu do niektórych grup dóbr, które mogą być potencjalnie szkodliwe dla społeczeństwa. Do takich dóbr zalicza m.in. alkohol i hazard. Zgodnie z przyjętą argumentacją łatwy dostęp do tych dóbr w sposób bezpośredni zwiększa zapotrzebowanie na ich konsumpcję. Państwo powinno mieć więc możliwość wpływania na strukturę konsumpcji obywateli. Jego rolą jest zapewnienie łatwiejszego dostępu do dóbr społecznie pożądaných, takich jak: oświetlenie, mieszkania, nowe technologie etc., a ograniczanie swobodnego dostępu do dóbr szkodliwych [Pigou 1912, s. 20-23, Pigou 1920, s. 77].

Odmienne poglądy na temat roli państwa i funkcjonowania społeczeństw przedstawiają Karol Marks i Friedrich Engels. Zgodnie z postulatami klasyków socjalizmu państwo funkcjonujące w obecnej formie jest jedynie „kategorią przejściową”, która musi przeminąć. Marks wyróżnia dwie fazy rozwoju ustroju komunistycznego: fazę niższą i wyższą. Jako fazę niższą wymienia ustrój socjalistyczny, w którym zlikwidowane są zasadnicze cechy gospodarek kapitalistycznych, takie jak własność prywatna oraz mechanizm rynkowy, jednakże nawyki społeczne wciąż są charakterystyczne dla kapitalizmu. Jest to nieodzowny element transformacji ustroju kapitalistycznego w tzw. „fazę wyższą”, czyli komunizm, w którym zanikają wszystkie sprzeczności klasowe i egoistyczne zachowania, co spowoduje usunięcie wszelkich nierówności społecznych, ekonomicznych i politycznych. Jak zauważa Engels, wraz z upadkiem klas, nieuchronnie zginie również państwo. Organy rządzące w jeszcze istniejącym państwie powinny więc inicjować i wspierać możliwie pokojowe przejście od kapitalizmu do komunizmu, po czym ich rola w społeczeństwie komunistycznym (bezklasowym) sprowadzać się będzie do zarządzania i regulowania gospodarki [Szarzec 2013, s. 95-103].

Prace Johna Maynarda Keynesa stanowią przełomowy punkt w debatach na temat roli państwa w gospodarce. Zauważa bowiem, iż jednym z zadań państwa jest prowadzenie aktywnej polityki gospodarczej. Keynes w swoim opus magnum, *Ogólnej teorii zatrudnienia, procentu i pieniądza* z 1936 roku, nie odnosi się bezpośrednio do ram instytucjonalnych, które powinno wyznaczać państwo. Zwraca uwagę na niedostatki szkoły klasycznej między innymi w zakresie funkcjonowania rynków, automatycznych mechanizmów korygujących nierównowagę rynkową, czy znaczenia efektywnego popytu dla efektów gospodarczych. Keynes podkreśla, że teoretyczne

rozważania szkoły klasycznej są zgodne z faktyczną sytuacją gospodarczą jedynie przejściowo i w bardzo specyficznej sytuacji, jaką jest pełne wykorzystanie czynników produkcji. Z tego powodu odrzuca ideę *laissez-faire* i uzasadnia konieczność zwiększonej roli państwa w życiu społeczno-gospodarczym [por. Keynes 1926]. Nie neguje on jednak poglądów na wolność jednostek i prawa własności oraz wskazuje na gospodarcze korzyści płynące z utrzymywania pokoju [Keynes 1919]. Rola państwa jest znacząco rozszerzona w porównaniu do poglądów przedstawicieli szkoły klasycznej i obejmuje nie tylko zabezpieczenie podstawowych praw, ale również aktywną politykę gospodarczą państwa (zarówno fiskalną, jak i monetarną), w celu zwiększenia efektywnego popytu w warunkach niepełnego wykorzystania czynników produkcji [Keynes 2003].

Milton Friedman, jeden z największych współczesnych zwolenników wolności jednostek i wolnego rynku, zaznacza, że niemożliwe jest utrzymywanie absolutnej wolności, ponieważ w społeczeństwach występuje szerokie grono „niedoskonałych jednostek”, które mogą naruszać wolność innych. Podkreśla równocześnie, że decyzje podejmowane w wyniku swobodnych dyskusji pomiędzy wolnymi uczestnikami życia gospodarczego są efektywniejsze, niż te wynikające z odgórnie narzuconych przepisów. Z powodu niedostatków wynikających z absolutnej wolności konieczne jest ustanowienie rządu, jednakże jego rola musi pozostać ograniczona²⁵. Do podstawowych zadań rządu, w warunkach wolnego społeczeństwa, należą:

- ustanawianie i gwarantowanie skuteczności procedur, które pozwalają na modyfikację zasad obowiązujących w społeczeństwie,
- mediacja pomiędzy członkami społeczeństwa w sporach dotyczących treści obowiązujących zasad,
- kontrola przestrzegania zasad przez ludzi.

Rolą państwa (rządu) jest zapewnienie przestrzegania prawa i zachowania porządku publicznego (w tym ochrona poszczególnych obywateli przed przymusem ze

²⁵ Friedman ubolewa, że wraz z postępującym rozwojem społeczno-gospodarczym obywatele „stają się coraz mniej wolni ze względu na rozrost struktur państwowych i coraz bardziej rozszerzającą się kontrolę nad ich życiem” [Ptak 2008, s. 179-184]. Wolność, która pierwotnie była motorem napędowym rozwoju, jest zastępowana coraz większą liczbą nakazów i zakazów ze strony państwa. Jak pisał w jednym ze swoich esejów: „od początku naszej republiki (USA – BT) każde pokolenie jest lepiej wykształcone niż poprzednie i ma wyższy standard życia. W przypadku nadchodzącego pokolenia istnieje zagrożenie, że po raz pierwszy nie będzie to prawda” [Friedman 1993, s. 13, cytata za: Ptak 2008, s. 194].

strony innych obywateli), gwarantowanie skutecznej realizacji dobrowolnych transakcji pomiędzy obywatelami²⁶, określenie granic praw własności i ich egzekwowanie oraz realizacja polityki monetarnej [Friedman 2008, s. 63-72]. Nie ulega zatem wątpliwości, że korzyści wynikające z rezygnacji z nieznaczej części wolności w procesie tworzenia państwa zdecydowanie przewyższają ewentualne straty. Pogląd ten jest wspólny dla zdecydowanej większości szkół ekonomicznych²⁷. Dzieje się tak jedynie w państwach, które spełniają właściwe im funkcje i w których rząd nie nadużywa swojej władzy. Należy jednakże kontrolować cały proces tworzenia państwa oraz stanowienia prawa, gdyż rządzący mają naturalną tendencję do ciągłego zwiększania swych uprawnień, często kosztem wolności jednostek²⁸.

Robert E. Lucas Jr., uważany za „architekta współczesnej makroekonomii” [Chari 1998, za: Szarzec 2013, s. 187] oraz jeden z założycieli (obok Thomasa Sargenta oraz Neila Wallace’a) nowej szkoły klasycznej, wskazuje z kolei na rolę współczesnego państwa w prowadzeniu polityki gospodarczej. Lucas zwraca uwagę na niedoskonałości keynesowskich modeli makroekonomicznych i krytykuje posługiwanie się nimi (tzw. „krytyka Lucasa”²⁹). W sposób charakterystyczny dla przedstawicieli nowej ekonomii klasycznej wskazuje, iż gospodarki funkcjonują przy pełnym wykorzystaniu czynników produkcji, a ewentualne odchylenia od stanów równowagi spowodowane są szokami technologicznymi lub ingerencją państwa w mechanizm rynkowy. Zdaniem nowoklasyków prowadzenie dyskrecyjnej polityki gospodarczej jest nieskuteczne, gdyż podmioty formułują swoje oczekiwania w sposób racjonalny i uwzględniają decyzje rządzących w swoich oczekiwaniach [Lucas i Prescott 1971; Lucas 1982]. Polityka gospodarcza jest więc nieefektywna (ang. *policy-ineffectiveness hypothesis*³⁰).

²⁶ Szerzej o korzyściach płynących z systemu wolnorynkowego: por. [Friedman, Friedman 1980].

²⁷ Autor ma świadomość, iż istnieją koncepcje skrajnie anarchistyczne lub libertariańskie całkowicie negujące sens istnienia państwa, jednakże ich wpływ na kształtowanie rzeczywistości gospodarczej, politycznej i społecznej jest niewielki.

²⁸ Szersze omówienie koncepcji państwa-Lewiatana: por. [Buchanan 1975]. Krytyczne uwagi także: [Holcombe 2004].

²⁹ Lucas [1976] krytykuje modele keynesowskie zarzucając im stałość parametrów – nawet w przypadku zmiany prowadzonej polityki nie zmieniają się one w modelach. Posługiwanie się więc wiodącymi modelami (takimi jak IS-LM, czy AS-AD) jest niewłaściwe.

³⁰ Innym spotykanym terminem określającym nieefektywność polityki gospodarczej jest jej neutralność [Kiedrowska i Marszałek 2003, s. 79].

Rolą państwa jest zatem ustalanie „reguł działania”, a nie bezpośrednio prowadzenie tychże działań³¹.

Również w pracach przedstawicieli neokeynesizmu³² (m.in. Jamesa Tobina, Nicholasa G. Mankiwa) odnaleźć można postulaty dotyczące sposobów prowadzenia polityki fiskalnej i monetarnej. Odrzucają oni hipotezę o ciągłym oczyszczaniu się rynków, wskazując jednocześnie na występujące nominalne i realne sztywności płac i cen w krótkim okresie. Neokeynesiści odrzucają również hipotezę o całkowitej neutralności pieniądza. Dowodzą, iż polityka monetarna może być skuteczna w krótkim okresie³³, szczególnie w czasie kryzysu, gdy służy ona przełamaniu pesymistycznych oczekiwań podmiotów. Ich zdaniem dyskrejonalna polityka fiskalna jest przeważnie nieskuteczna [por. Szarzec 2013, s. 243]. Jednakże podobnie jak nowoklasycy, sugerują prowadzenie polityki fiskalnej na podstawie reguł. Głównym instrumentem powinny być automatyczne stabilizatory koniunktury. Rolą rządu jest więc ingerencja w gospodarkę obejmująca głównie zmianę rozwiązań prawnych i instytucjonalnych [por. Bludnik 2010].

Pozytywne aspekty wynikające ze zrzeszenia się jednostek w społeczeństwa (a w konsekwencji w państwa) i zapewniania wolności i bezpieczeństwa dzięki wspólnym wysiłkom zostały wykazane nie tylko w ramach przytoczonych już koncepcji teoretycznych, ale również we współczesnych badaniach o charakterze empirycznym³⁴. Jak konkluduje Jerzy Wilkin [2010, s. 27]: „państwo jest taką formą ograniczenia wolności, która w ostatecznym rachunku daje więcej bezpieczeństwa, ładu i innych korzyści niż życie w warunkach braku władzy i instytucjonalnego porządku”. Zadaniem dla rządzących i obywateli jest więc utrzymywanie państwa i prawa w takim stanie, aby ewentualne nadużycia i patologie miały charakter marginalny, a zapewniane wolności pozwalały na czerpanie korzyści (w tym korzyści ekonomicznych) przez całe społeczeństwo. Sprawnie działające państwo ustala, przestrzega i ochroni stosunki między wszystkimi podmiotami. Kieruje więc pewne „reguły gry”, których

³¹ Argumentów potwierdzających skuteczność stanowienia reguł zamiast dyskrejonalnej polityki makroekonomicznej dostarczają także przedstawiciele szkoły realnego cyklu koniunkturalnego: Kydland i Prescott [1977]. Por. także: Godłów-Legiędź [2010, s. 37-38].

³² Szerzej o ewolucji szkół keynesowskich, w tym o heterogeniczności neokeynesizmu (nowej ekonomii keynesowskiej) w: Bludnik [2010, s. 15-23].

³³ O nie neutralności pieniądza w krótkim okresie m.in. w: Akerlof i Yellen [1985].

³⁴ Szerzej o wynikach badań empirycznych w Rozdziale 2.

przestrzeganie prowadzi do zwiększonej efektywności alokacji zasobów w gospodarce. Przyczynia się długookresowo do rozwoju i wzrostu gospodarczego, a więc także do zapewnienia wyższego poziomu dobrobytu dla obywateli [Piątek, Szarzec 2008, s. 112-116].

1.3. Modele rozwoju i upadłości państwa

W literaturze przedmiotu wykorzystywane są często dwa modele rozwoju i upadłości państwa. Pierwszy z nich, autorstwa Douglasa C. Northa, Johna J. Wallisa i Barry'ego Weingasta [2009a], zaprezentowany został w *Violence and Social Orders*³⁵. Drugi z analizowanych modeli został przedstawiony przez Daron Acemoglu oraz Jamesa A. Robinsona [2014] w książce *Dlaczego narody przegrywają? Źródła władzy, pomysłowości i ubóstwa*³⁶. Autorzy przeprowadzają kompleksową analizę przyczyn, skutków oraz mechanizmów towarzyszących rozkwitowi oraz upadkowi państw.

North, Wallis i Weingast [2009a] przedstawiają proces ewolucji kształtu stosunków społecznych od czasów sprzed rewolucji neolitycznej do współczesności. Autorzy wyszczególniają trzy główne porządki społeczne:

- porządek plądrujący (ang. *foraging order*),
- porządek ograniczonego dostępu (ang. *limited access order*),
- porządek wolnego dostępu (ang. *open access order*).

W społecznościach plądrujących (opartych na zbieractwie oraz myślistwie) władza nie jest ustrukturyzowana. Celem działania poszczególnych jednostek jest zdobycie pożywienia, a rozwiązywanie sporów odbywa się głównie z użyciem przemocy.

Drugim typem porządku społecznego, który wykształcił się na skutek rewolucji neolitycznej jest porządek ograniczonego dostępu. Państwo, w którym taki porządek występuje nazywane jest „państwem naturalnym”³⁷. North, Wallis i Weingast wskazują,

³⁵ Pełny tytuł: *Violence and Social Orders: A Conceptual Framework for Interpreting Recorded Human History*. Zagadnienia te autorzy poruszają także m.in. w: [North i in. 2007; North, Wallis, Weingast 2009b].

³⁶ Publikacja stanowi podsumowanie poprzednich prac autorów [zob. także: Acemoglu 2005, Acemoglu i Robinson 2005; Acemoglu, Johnson, Robinson 2001, 2002, 2005].

³⁷ Autorzy wskazują, iż porządek ograniczonego dostępu jest „naturalnym” stanem, gdyż (1) jest to stan charakterystyczny dla nowo utworzonych państw, (2) funkcjonuje on przez większość historii ludzkości, (3) obecnie jest to najpowszechniejszy typ porządku społecznego. W „państwach naturalnych” żyje ok. 85% populacji świata [North, Wallis, Weingast 2009, s. xii].

iż przejście od koczowniczego trybu życia do trybu osiadłego i opartego na rolnictwie było możliwe dzięki ustanawianiu i utrzymywaniu lokalnych monopolii na użycie przemocy. Dominujące grupy (tzw. elity) tworząc podstawowe zasady funkcjonowania społeczeństw (w tym przede wszystkim kontrolując używanie przemocy), zwiększają stopień ochrony swoich praw własności. Prowadzi to do osiągnięcia większych zysków z podejmowanych działań (tworzą się renty), więc siła polityczna i ekonomiczna elit wzrasta. Uzyskane renty ekonomiczne wykorzystywane są do tworzenia i umacniania kolejnych sojuszy pomiędzy wiodącymi grupami interesu. Ich celem jest kreowanie takiego porządku społecznego, w którym zapewniają sobie przywileje oraz ograniczają innym podmiotom możliwość wpływania na życie gospodarcze i polityczne.

Na skutek tych procesów elity stają się odpowiedzialne za ochronę porządku prawnego, instytucjonalnego i ekonomicznego. Asymetryczny rozkład sił (szczególnie siły fizycznej) umożliwia elitom narzucenie określonych instytucji politycznych pozostałej części społeczeństwa. W ramach owych instytucji władza skupiona jest w rękach elit, nie występują także mechanizmy umożliwiające faktyczną kontrolę władzy i możliwość jej pokojowej zmiany. Dominujące koalicje biorą jednak odpowiedzialność za utrzymanie bezpieczeństwa, tj. ochronę przed zorganizowaną przemocą na terenie kraju, gdyż ewentualne konflikty i przemoc obniżają ekonomiczne renty elit czerpane w wyniku sprawowania władzy. Również konfrontacja pomiędzy elitami może narazić je na utratę części korzyści ekonomicznych, więc decydują się one częściej na współpracę niż na konkurowanie między sobą. Jeśli uzyskane renty są wystarczająco wysokie, każdy z członków dominującej koalicji uznaje, iż opłacalne ekonomicznie jest utrzymanie obecnego stanu i powstrzymanie się od przemocy. Niemniej jednak, zachwianie równowagi pomiędzy najsilniejszymi grupami może doprowadzić do konfliktów, chaosu oraz upadłości państwa.

Proces ewolucji w ramach porządku ograniczonego dostępu oparty jest na trzech występujących po sobie formach: kruchej państwa naturalnego (ang. *fragile natural state*), podstawowego państwa naturalnego (ang. *basic natural state*) oraz dojrzałego państwa naturalnego (ang. *mature natural state*).

Kruchy porządek ograniczonego dostępu jest charakterystyczny dla początkowego stadium formowania się państwa i instytucji w nim funkcjonujących. Dominujące grupy jedynie w niewielkim zakresie kontrolują zorganizowaną przemoc, a tworzone przez członków społeczności organizacje są bardzo słabe. W kruchych państwach naturalnych organy sprawujące władzę centralną nie posiadają efektywnego

monopolu na użycie przemocy. Na terenie kraju działa więc wiele organizacji, które wykorzystują siłę fizyczną w procesie kreowania własnych rent ekonomicznych. Pokój i bezkonfliktowa współpraca między wiodącymi organizacjami jest krótkotrwała, a każde zachwianie wypracowanej równowagi może doprowadzić do załamania się porządku społecznego i upadłości państwa.

Następnym stopniem ewolucji porządku ograniczonego dostępu jest podstawowe państwo naturalne, które formuje się, gdy elitom uda się zwiększyć siłę instytucji. Możliwe jest zatem utworzenie przez organy rządzące bardziej stabilnych struktur organizacyjnych. Wolność gospodarcza jest jednak nadal ograniczona, a korzystać z niej mogą jedynie organizacje powiązane z elitami [por. Legiędź 2015, s. 44-45]. Zdolność organów rządzących do kontrolowania sfery ekonomicznej i politycznej sprawia, iż zagrożenie wystąpienia upadłości jest znacznie ograniczone.

W dojrzałym państwie naturalnym mogą funkcjonować organizacje, które nie są ściśle powiązane z władzą, jednakże nadal występują wysokie bariery wejścia. Z uwagi na istnienie wielu współpracujących ze sobą podmiotów struktura instytucjonalna (organizacyjna) staje się znacznie bardziej złożona. Wymaga to szerszego gwarantowania praw własności, skutecznego działania wymiaru sprawiedliwości, a także sprawnego aparatu biurokratycznego. Nadal występują jednak duże dysproporcje w dostępie do rynków i możliwości sprawowania władzy. Odmienne jednak do kruchego i podstawowego porządku, możliwości te nie są ograniczone wyłącznie do elit sprawujących władzę, ale są także udziałem prywatnych elit dysponujących dużą siłą ekonomiczną.

Ostatnim stopniem ewolucji porządku społecznego jest porządek otwartego dostępu. W państwie otwartym kontrola przemocy odbywa się na innym poziomie i jest odmiennie umotywowana w porównaniu do porządku naturalnego. Społeczeństwo państwa otwartego jest w stanie utworzyć silną i scentralizowaną armię, która jest podporządkowana i służalcza wobec systemu politycznego. Co istotne, odchodzi się od ścisłej kontroli sfery ekonomicznej i politycznej, zezwalając na wolną konkurencję, swobodę prowadzenia działalności gospodarczej, a także aktywne uczestnictwo w życiu politycznym. Aby państwo ewoluowało z porządku ograniczonego dostępu do porządku otwartego, niezbędne jest spełnienie trzech warunków brzegowych:

- przestrzeganie prawa przez elity,
- częściowe utrzymanie uprzywilejowanej pozycji elit,

- konsolidacja kontroli nad organami dysponującymi siłą fizyczną (np. nad wojskiem, policją itp.).

W sytuacji, gdy wymienione wyżej warunki są spełnione, dominujące koalicje w ramach porządku ograniczonego dostępu mogą zwiększyć swoje renty zezwalając na konkurencję i zmniejszając stopień kontroli rynku. Przejście od państwa naturalnego do państwa otwartego następuje przy akceptacji dominujących elit, które tracąc swoją uprzywilejowaną pozycję zyskują możliwość kreowania większych rent ekonomicznych. Zagrożenie wystąpienia upadłości państwa niemal nie występuje, gdyż – jak stwierdzają North, Wallis i Weingast – w historii świata nie zdarzyło się, aby państwo otwarte zanotowało tak znaczący regres, aby powrócić do porządku ograniczonego dostępu. Przy jednoczesnym wspieraniu szeroko rozumianej sfery ekonomicznej i społecznej oraz ustanowieniu prawa ograniczającego nieuprawnione korzystanie z monopolu na użycie siły przez rządzących, możliwe jest utworzenie stabilnego państwa, które umożliwi wzrost i rozwój gospodarczy. Należy zaznaczyć również, iż w warunkach państwa otwartego, władza i kontrola nad siłami zbrojnymi przypisana jest do instytucji, nie zaś do konkretnej grupy czy osoby (co jest zgodnie z ideą władzy legalnej według Webera).

Również Acemoglu i Robinson [2014] przedstawiają kompleksowy opis mechanizmów towarzyszących tworzeniu i stabilizowaniu się państwa, a także jego ewentualnej upadłości. Zdaniem autorów członkowie społeczności tworząc (powołując) państwo ustalają „reguły gry” (w rozumieniu D. C. Northa [por. Acemoglu, Robinson 2008]) obowiązujące w ekonomicznych i politycznych działaniach. Podkreślają więc, iż czynniki instytucjonalne mają kluczowe znaczenie w procesie formowania się struktury państwa, a w konsekwencji także w osiągniętych efektach gospodarczych w długim okresie. Wskazują oni na współwystępowanie trzech elementów, które przesądzają o powiększaniu się bogactwa kraju i poziomu życia jego mieszkańców.

Pierwszym z tych elementów jest tzw. „dryf instytucjonalny”, który definiują jako sumę przeszłych zdarzeń, niekiedy o losowym i przypadkowym charakterze, prowadzącą do ukształtowania postaci otoczenia instytucjonalnego w danym kraju. Dryf instytucjonalny - zdaniem Acemoglu i Robinsona – nie ma z góry przypisanej drogi, co oznacza, iż początkowe warunki zastane w momencie tworzenia się państwa nie przesądzają o jego sukcesie (bądź porażce) w przyszłości. Do elementów dryfu zaliczają oni m.in. zaszłości historyczne, wcześniejsze sposoby sprawowania rządów, istniejące i przeszłe sojusze, bitwy i wojny, a nawet choroby. Co istotne, dryf

instytucjonalny nie musi mieć charakteru kumulatywnego z uwagi na występujące „punkty zwrotne”, które w relatywnie krótkim okresie mogą całkowicie odmienić postać kształtowanych reguł gry. Jako punkty zwrotne traktują oni wszystkie istotne wydarzenia (lub zbieg czynników), które zakłócają obowiązującą równowagę ekonomiczną i polityczną państwa (np. wojna, dojście do władzy radykalnych przywódców, epidemia). Mogą one więc dać początek gwałtownym zmianom w kierunku rozwoju narodu i państwa, które implikują osiągnięte wyniki gospodarcze w przyszłości³⁸.

Kolejnymi czynnikami, które zdaniem Acemoglu i Robinsona w głównej mierze wpływają na osiągnięte wyniki gospodarcze przez państwa są instytucje, które dzielą na instytucje polityczne oraz ekonomiczne. Instytucje polityczne rządzą bodźcami i inicjatywami w procesie wyboru i kształtowania „reguł gry” obowiązujących w społeczeństwie. Należą do nich m.in. sposób i częstotliwość wyboru władzy w państwie, a także zakres jej uprawnień, obowiązków i ponoszonych konsekwencji. Z kolei instytucje ekonomiczne określają dostęp obywateli do rynków oraz możliwość kreowania i korzystania z rent ekonomicznych.

Ustanowione instytucje polityczne mogą przyjmować charakter wyzyskujący (ang. *extractive political institutions* - wyzyskujące/wykluczające instytucje polityczne) lub włączający (ang. *inclusive political institutions* - włączające instytucje polityczne). Wyzyskujące instytucje polityczne charakteryzują się tym, iż dystrybucja władzy jest minimalna lub nie występuje wcale – władza sprawowana jest przez wąskie grupy interesu (elity), które zawłaszczają możliwość stanowienia prawa. Z tego powodu skala i zakres podejmowanych decyzji są nieograniczone. Tak sprawowana władza wyklucza kontrolę ze strony społeczeństwa, nie dostarcza również mechanizmów do jej

³⁸ Acemoglu i Robinson opisują przykład „czarnej śmierci” jako punktu zwrotnego, który zmienił ekonomiczny układ sił na kilka wieków. W połowie XIV wieku występowały jedynie nieznaczne różnice pomiędzy obowiązującymi „regułami gry” w Europie Zachodniej i na wschodzie kontynentu. Niemniej jednak, ówczesne prawo gwarantowało większą autonomię działań chłopom z Europy Zachodniej. „Czarna śmierć”, która znacznie ograniczyła liczbę ludności i w konsekwencji potencjał gospodarczy, przyniosła na zachodzie rozpad feudalizmu (co stanowiło podwaliny pod późniejszy rozwój gospodarczy), podczas gdy na wschodzie nastąpiła tzw. „druga pańszczyzna”. Implikacje tych zmian można zaobserwować również w odmiennym wykorzystaniu możliwości płynących z handlu transatlantyckiego przez państwa z większym zakresem wolności (np. Anglia) oraz mniejszym (np. Francja, Hiszpania). Skutkiem tego rewolucja przemysłowa wydarzyła się w Anglii, przynosząc jej kolejne wzmocnienie pozycji na arenie międzynarodowej.

pokojujowej zmiany. Z kolei włączające instytucje polityczne upowszechniają władzę w społeczeństwie i nakładają ograniczenia na rządzących – innymi słowy są pluralistyczne.

Podmioty mające realny wpływ na instytucje polityczne mają również narzędzia do wpływania na kształt instytucji ekonomicznych, które także można podzielić na wyzyskujące (ang. *extractive economic institutions* – wyzyskujące instytucje ekonomiczne) oraz włączające (ang. *inclusive economic institutions* – włączające instytucje ekonomiczne). Włączające instytucje ekonomiczne (gospodarcze) charakteryzują się zapewnieniem własności prywatnej obywatelom, przestrzeganiem prawa, dostarczaniem usług publicznych niezbędnych do działania wolnego rynku, a także zapewnieniem „równego boiska”, rozumianego jako równy dostęp do rynku, zarówno od strony popytowej, jak i podaźowej. Instytucje gospodarcze o charakterze wyzyskującym nie posiadają podanych wyżej właściwości.

Kształt instytucji, zarówno politycznych, jak i ekonomicznych, bezpośrednio związany jest z celami, które realizują organy rządzące. W przypadku wyzyskujących instytucji politycznych celem elit sprawujących władzę jest wyzysk oraz przejmowanie produkcji wytworzonej na terenie kraju w celu powiększania własnego bogactwa. Proces ten zapoczątkowany jest zwykle ustanowieniem wyzyskujących instytucji gospodarczych. Rządzący gwarantują większą wolność gospodarczą i ochronę praw własności dla siebie, podczas gdy reszcie społeczeństwa przysługują prawa ograniczone, na dodatek często łamane. Wykreowane renty ekonomiczne z działalności gospodarczej są zawłaszczane przez elity, co wpływa na obniżenie motywacji do podejmowania inicjatyw rynkowych przez obywateli. Równocześnie, dysproporcja posiadanych zasobów pomiędzy elitami a członkami społeczności nienależącymi do elit stale się powiększa³⁹.

Konsekwencją trwania wyzyskujących instytucji politycznych i ekonomicznych jest niska - z uwagi na brak gwarantowania praw własności - skłonność obywateli do podejmowania działań rynkowych. Relatywne obniżanie poziomu życia, stagnacja gospodarcza, a także wzrost dysproporcji dochodowych zwiększają niepokoje społeczne, które w konsekwencji mogą stanowić zagrożenie dla rządzących elit. Acemoglu i Robinson zwracają uwagę, iż wzrost gospodarczy może być obserwowany

³⁹ Dysproporcje powstają m.in. na skutek ustanawianych przez państwo monopolii, limitowaniu dostępu do określonych zawodów oraz ograniczaniu swobody działalności gospodarczej.

w państwach o wyzyskujących instytucjach. Warunkiem koniecznym jest jednak utrzymywanie wysokiej centralizacji władzy oraz siły państwa (możliwości permanentnej kontroli, zdolności do przymusu oraz wyzysku ekonomicznego). Za pomocą środków represji organy rządzące wymuszają na obywatelach świadczenie pracy, której efektem jest powiększanie produkcji krajowej, czyli wzrost gospodarczy. Wzrost ten jest jednak nietrwały, gdyż nie następuje postęp technologiczny, ani twórcza destrukcja⁴⁰. Utrzymywanie aparatu represji w długim okresie prowadzi do niezadowolenia społecznego i walk o kontrolę nad stanowieniem wyzyskujących instytucji politycznych i ekonomicznych, co z kolei doprowadzić może do wojny domowej i upadłości państwa.

Państwa, w których funkcjonują wyzyskujące instytucje polityczne i ekonomiczne, wpadają w tzw. „błędne koło” (ang. *vicious cycle*). Elity kształtujące wyzyskujące instytucje polityczne utrzymują także wyzyskujące instytucje ekonomiczne, co prowadzi do powiększania się ich bogactwa kosztem reszty obywateli. Dzięki temu elita może finansować prywatne grupy zbrojne, korumpować urzędników, czy wreszcie wzmacniać swoją władzę poprzez nielegalne wpływanie na wyniki wyborów. Ustanowione wyzyskujące instytucje polityczne kreują więc wyzyskujące instytucje ekonomiczne, które z kolei ugruntowują wyzyskujące instytucje polityczne (stąd mechanizm „błędne koła”). Zależność ta jest bardzo silna szczególnie w początkowym okresie istnienia państwa, gdy ustanowione instytucje nie są jeszcze silnie zakorzenione w prawie oraz świadomości obywateli. Ogranicza (lub wręcz uniemożliwia) to możliwość ewolucji instytucji politycznych i ekonomicznych w kierunku instytucji o charakterze włączającym, co przyczyniłoby się do zmniejszenia prawdopodobieństwa wystąpienia upadłości państwa [Acemoglu i Robinson 2014, s. 373-408].

Acemoglu i Robinson wskazują, iż upadłość państwa może wystąpić także w warunkach istnienia włączających instytucji politycznych, którym nie towarzyszą silne włączające instytucje ekonomiczne. Trwałe funkcjonowanie włączających (pluralistycznych) instytucji politycznych oraz wyzyskujących instytucji gospodarczych (przejawiających się zawłaszczaniem rent ekonomicznych przez grupy interesu) prowadzi do nasilenia się konfliktów w społeczeństwie. Skutkiem tego może być

⁴⁰ Procesy te mogą wpływać na kształt instytucji politycznych oraz zmieniać dystrybucję siły ekonomicznej w kraju. Z tego powodu są one blokowane przez rządzące elity.

ewolucja instytucji ekonomicznych w kierunku instytucji włączających, o ile społeczeństwo dysponuje odpowiednią siłą. Częściej jednak wybuchają lokalne konflikty, które prowadzą do upadłości państwa.

Zagrożenie wystąpienia upadłości państwa jest większe także w sytuacji, gdy funkcjonują włączające instytucje polityczne, które jednak są zbyt słabe, aby gwarantować instytucje ekonomiczne. W wypadku braku instytucji gospodarczych (brak gwarancji praw własności, brak kontroli nad warunkami rynkowymi itp.) państwo pogrąża się w chaosie i anarchii⁴¹ – następuje całkowity rozkład instytucji państwa i ostatecznie jego upadek.

Charakterystyka opisanych instytucji i długookresowe skutki ich funkcjonowania zostały przedstawione w Tabeli 1.

Tabela 1. Charakterystyka instytucji wg Acemoglu i Robinsona

Typ instytucji		Charakterystyka	Skutki
włączające	ekonomiczne	własność prywatna, praworządność, usługi publiczne, „równe boisko”	włączenie do władzy szerokich warstw społecznych, ograniczenie arbitralnego sprawowania władzy, bardziej równomierna dystrybucja zasobów
	polityczne	pluralizm, centralizacja władzy, monopol na użycie siły,	
wyzyskujące	ekonomiczne	ograniczona własność prywatna, brak praworządności, nierówny dostęp do gry rynkowej	koncentracja władzy w rękach nielicznej elity, która eksploatuje zasoby reszty społeczeństwa
	polityczne	absolutyzm, możliwa decentralizacja władzy, monopol na użycie siły	

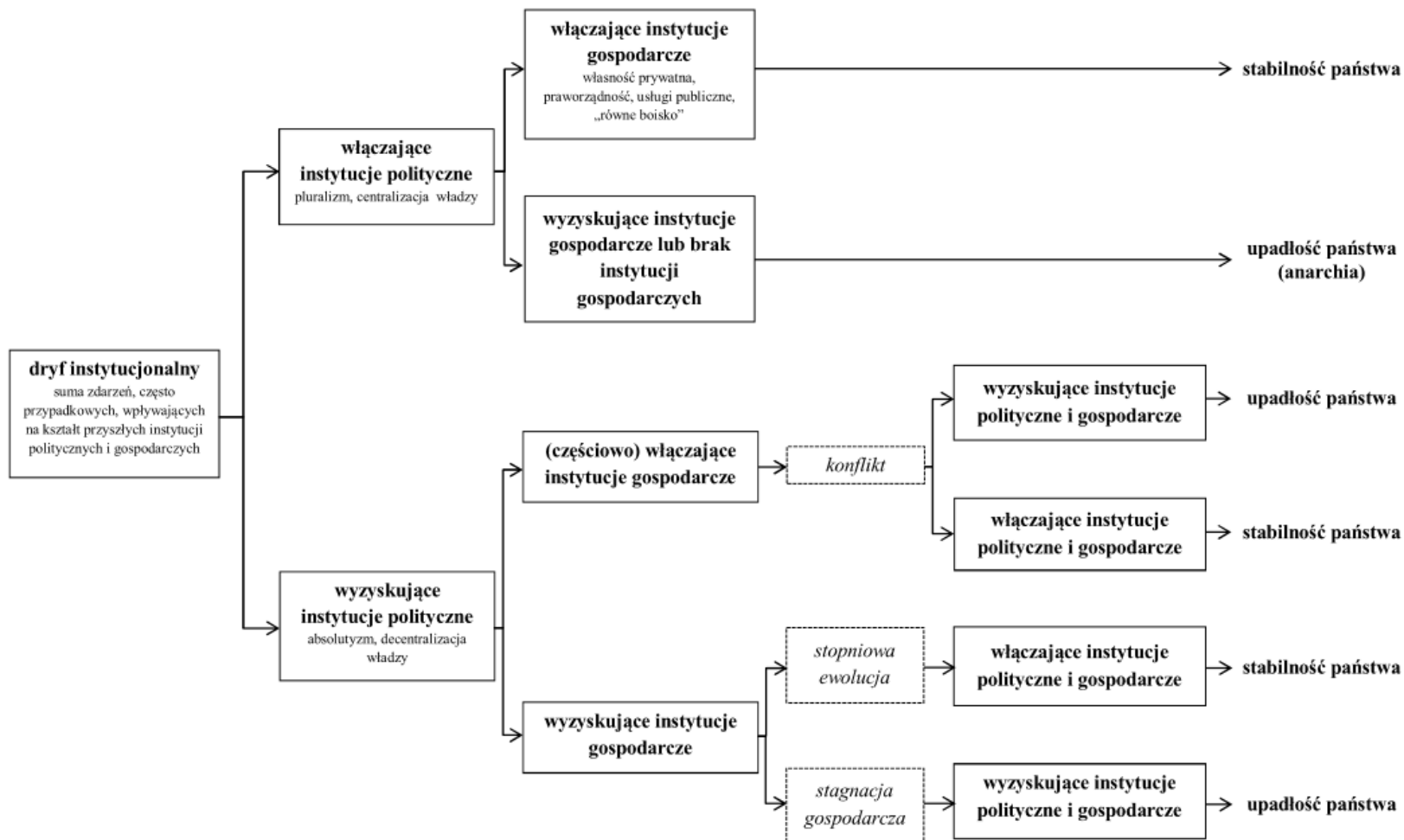
źródło: opracowanie własne na podstawie [Acemoglu, Robinson 2014].

Należy podkreślić, iż nie jest możliwe wydzielenie jednostronnego związku przyczynowo-skutkowego pomiędzy omawianymi instytucjami. W procesie tworzenia państwa pierwotnie ukształtowane instytucje polityczne kreują instytucje ekonomiczne,

⁴¹ Szarzec [2013, s. 248] zwraca uwagę, iż w państwa upadłe są świadectwem nieograniczonej wolności, która – z uwagi na słabość (lub rozkład) instytucji państwa nie jest chroniona. Prowadzi to do nadużyć urzędników, korupcji oraz rozwiązywania konfliktów z wykorzystaniem zorganizowanej przemocy.

jednakże w kolejnych latach występuje swoiste sprzężenie zwrotne. Instytucje polityczne i ekonomiczne wpływają na siebie wzajemnie, co umożliwia ich ewolucję i dostosowanie do panujących warunków.

Reasumując, w czasie dryfu instytucjonalnego tworzą się podstawy instytucji politycznych. W ramach określonej sytuacji politycznej, rządzący budują podwaliny pod instytucje gospodarcze, chociaż nie należy zapominać również o sprzężeniu zwrotnym pomiędzy instytucjami politycznymi i ekonomicznymi. Określona kombinacja owych instytucji wpływa na kształtowanie się ogólnej kondycji państwa (por. Rysunek 1), w tym szans na wzrost gospodarczy i stabilność państwa oraz zagrożenie anarchią, chaosem i upadkiem.



Rysunek 1. Schemat rozwoju i upadłości państwa według Acemoglu i Robinsona

Uwaga: W prostokątach z przerywanym obramowaniem (oraz kursywą) zaznaczono procesy modyfikujące lub wzmacniające postać instytucji politycznych i ekonomicznych.

źródło: opracowanie własne na podstawie [Acemoglu, Robinson 2014].

1.4. Konceptualizacja państw upadłych i ich klasyfikacja

Przyjmuje się, iż pojęcie upadłości państw zostało sformułowane po raz pierwszy w ostatniej dekadzie XX wieku przez Helmana i Ratnera [1992] dla określenia skutków kryzysu struktur państwowych [Roman 2014, s. 114]. Termin ten znalazł zastosowanie na szeroką skalę jako opis sytuacji, w której władze państwa przestają efektywnie kontrolować podległe im terytorium na rzecz grup interesu. Charakterystycznym jest, iż żadna ze skonfliktowanych grup (legalna władza oraz grupy opozycyjne) nie jest w stanie stworzyć i utrzymać efektywnie działającej władzy centralnej [Domisiewicz 2004, s. 53]. W miarę upływu czasu niektórzy autorzy zaczęli wykorzystywać pojęcia upadłości jako synonim słabości państwa⁴² [Lizak 2009, s. 386].

W literaturze spotyka się szeroki zestaw (niekiedy wykluczających się) określeń na zawodność struktur państwowych, ze szczególnym rozróżnieniem stopnia rozkładu funkcji państwa. Do tych określeń, oprócz państw upadłych należą także⁴³: państwa słabe (ang. *weak states*), upadające (ang. *failing states*), zawodzące (ang. *failure states*), wrażliwe (ang. *vulnerable states*), kruche (ang. *fragile states*), dysfunkcjonalne (ang. *dysfunctional states*), w kryzysie (ang. *crisis states*), bezzładne / w chaosie (ang. *chaos states*), załamane (ang. *collapsed states*) oraz powracające (ang. *recovering states*).

Na potrzeby projektu *Country Indicators for Foreign Policy* (CIFP) przygotowanego przez kanadyjski Carleton University przyjęto następujące definicje (uszeregowane według stopnia rozkładu funkcji państwa):

- państwa słabe – podatne na upadek lub kruchość (*fragility*) w związku z ograniczoną zdolnością rządu, stagnacją ekonomiczną lub brakiem możliwości zapewnienia bezpieczeństwa wewnętrznego i zewnętrznego;
- państwa kruche - niezapewniające podstawowego bezpieczeństwa obywatelom w granicach terytorium, a także nie mające wystarczającej siły instytucjonalnej do zaspokojenia podstawowych potrzeb społeczeństwa. Przejawiać się to może również brakiem legitymizacji politycznej do reprezentowania obywateli w kraju i za granicą;
- państwa upadające wykazujące wszystkie cechy państw kruchych, a także dodatkowo doświadczające zorganizowanej przemocy, w tym przemocy

⁴² Słabe państwo rozumiane jako podmiot, w którym administracja publiczna nie działa sprawnie, jednak nie nastąpił całkowity rozkład instytucji państwowych.

⁴³ Rozważania na temat definicji dotyczących słabości państwa w: [Wilkin 2013, s. 42-45].

motywowanej politycznie. Procesy mające na celu przywrócenie pokoju w tych państwach są słabe i nieskuteczne lub wcale nie występują;

- państwa upadłe - charakteryzują się permanentnymi konfliktami, kryzysami humanitarnymi, a także zapaścią ekonomiczną. Organy rządowe nie posiadają realnej siły i legitymizacji do sprawowania władzy oraz zdolności do przymusu wykonywania aktów prawnych na terenie całego państwa. Rządzenie ograniczone jest jedynie do poszczególnych regionów lub grup społecznych;
- państwa załamane - nie istnieje w nich żadna znacząca władza centralna. Funkcjonują one wyłącznie jako granice terytorialne, jednak nie posiadają żadnych cech umożliwiających faktyczne sprawowanie władzy;
- państwa powracające wykazujące cechy rozkładu państwa charakterystyczne dla państw kruchych, jednak zachodzą w nich faktyczne i (co najmniej częściowo) skuteczne procesy „budowania państwowości” [CIFP FAQ].

Bertocchi [2010] traktuje z kolei pojęcia państw upadłych, upadających, słabych oraz wrażliwych jako tożsame. Wskazuje ona, iż upadłość państwa przejawia się w następujących dysfunkcjach: niedostarczaniu dóbr publicznych, braku możliwości zaspokajania podstawowych potrzeb przez obywateli, niestabilności i słabej jakości rządu, permanentnym ubóstwie, braku fizycznej kontroli nad terytorium państwa, a także w wysokiej skłonności do konfliktów i wojen domowych.

Zgodnie z terminologią wykorzystywaną przez organizację Polska Pomoc (organ Ministerstwa Spraw Zagranicznych RP) państwa upadłe to te o najniższym dochodzie, słabych rządach, narażone na ciągłe konflikty i kryzysy, nie potrafiące odpowiedzieć i zareagować na trwające je problemy polityczne, a także nie będące w stanie spełnić oczekiwań obywateli i zapewnić im godziwych warunków życia. Jako terminy równoznaczne stosuje się określenia: państwa zawodzące, wrażliwe, kruche, w kryzysie [Polska Pomoc].

Lachowski [2012, s. 68-70] definiuje państwa upadłe (również: kruche, dysfunkcjonalne, w kryzysie, bezrządne) jako te, które nie wykonują przydzielonych im funkcji, w szczególności nie dostarczają dóbr politycznych. Następuje w nich tzw. „erozja zdolności państwowych” (rozumiana jako rozkład funkcji państwa), co skutkuje brakiem możliwości sprawowania efektywnej kontroli nad terytorium, a także niezdolnością do zapewnienia bezpieczeństwa wewnętrznego i zewnętrznego. Buzan [1991, s. 10] zwraca uwagę, iż słabe państwa charakteryzują się niskim poziomem

spójności społeczno-politycznej. Ponieważ nie udaje im się integracja społeczeństwa i rządu, typowe dla nich są autorytarny typ władzy i niestabilna polityka wewnętrzna.

Rotberg [2002, 2004] wyróżnia z kolei pewien zestaw sprawowanych funkcji właściwych dla silnego państwa (ang. *strong state*). Są to, w kolejności od najważniejszych, następujące zadania:

- zapewnianie bezpieczeństwa - ochrona granic przez inwazją zewnętrzną, ochrona struktur państwowych, zapobieganie zbrodniom i innym wykroczeniom przeciwko zdrowiu i życiu obywateli, a także dostarczanie mechanizmów umożliwiających rozwiązywanie konfliktów (w tym na linii obywatel-państwo) bez sięgania po broń lub inne formy przemocy fizycznej;
- dostarczanie dóbr politycznych – zapewnianie przewidywalnych, powszechnie znanych i usystematyzowanych metod orzekania w sporach, regulowanie norm i zwyczajów charakterystycznych dla danego społeczeństwa i ustroju, zapewnianie praworządności (ang. *rule of law*), gwarantowanie bezpieczeństwa i nienaruszalności umów majątkowych, ustanawianie wartości społecznych odpowiadających lokalnej wersji sprawiedliwości oraz umożliwianie wolnego, pełnego i otwartego uczestnictwa w procesach politycznych;
- dostarczanie dóbr publicznych – ze szczególnym uwzględnieniem dostępu do edukacji, opieki zdrowotnej, infrastruktury transportowej (dróg, kolei), a także sprawnego oraz stabilnego systemu monetarnego i bankowego.

Państwa słabe realizują jedynie częściowo, choć w większości, wymienione wyżej zadania, zaś państwa upadające i upadłe nie wykonują żadnych lub prawie żadnych zadań. Skrajnie negatywną odmianą państw upadłych są państwa załamane.

Państwa upadłe mogą doświadczać szerokiej gamy problemów natury ekonomicznej (wysoki odsetek obywateli żyjący poniżej progu ubóstwa, zapaść ekonomiczna, brak długookresowego wzrostu i rozwoju gospodarczego), politycznej (brak możliwości uczestnictwa obywateli w życiu publicznym, zawłaszczanie prawa do decydowania o państwie przez tzw. grupy interesu), militarnej (trwające wojny domowe, głównie o podłożu etnicznym, oraz agresja zewnętrzna), a także instytucjonalnej (niezdolność państwa do sprawowania rządów, brak praworządności i równości obywateli). Podsumowanie wybranych definicji stopnia rozkładu funkcji państwa przedstawiono w Tabeli 2.

Tabela 2. Zestawienie wybranych definicji państw według stopnia rozkładu jego funkcji

Stopień rozkładu funkcji państwa	Źródło				
	Rotberg [2002, 2004]	CIFP	Bertocchi [2010]	Polska Pomoc	Lachowski [2012]
państwa załamane (<i>collapsed states</i>)	Brak realizacji zadań państwa.	Brak znaczącej władzy centralnej. Wyłącznie granice terytorialne stanowią o państwie, rząd nie posiada żadnych cech umożliwiających rządzenie.	-	-	-
państwa upadające (<i>failing states</i>)	-	Wykazują cechy państw kruchych oraz doświadczają przemocy politycznej.	-	-	-
państwa powracające (<i>recovering states</i>)	-	Wykazują cechy państw kruchych, jednak pojawiają się procesy budowania państwowości.	-	-	-
państwa słabe (<i>weak states</i>)	Realizowanie większości zadań państwa.	Ograniczona zdolność rządzenia, występuje stagnacja ekonomiczna oraz brak bezpieczeństwa wewnętrznego i zewnętrznego. Zwiększona podatność na upadek lub kruchość.	Niedostarczanie dóbr publicznych oraz niezaspokajanie podstawowych potrzeb, słaba jakość rządzenia, trwały stan ubóstwa, brak kontroli nad terytorium, wysoka skłonność do konfliktów.	-	-

Stopień rozkładu funkcji państwa	Źródło				
	Rotberg [2002, 2004]	CIFP	Bertocchi [2010]	Polska Pomoc	Lachowski [2012]
państwa zawodzące (<i>failure states</i>)	-	-	synonim państw słabych: Niezapewnianie dóbr publicznych oraz niezaspokajanie podstawowych potrzeb, słaba jakość rządzenia, trwałe ubóstwo, brak kontroli nad terytorium, wysoka skłonność do konfliktów.	Najniższy dochód na mieszkańca, niezapewnienie godnych warunków życia, słabe rządy, narażenie na konflikty i kryzysy.	-
państwa wrażliwe (<i>vulnerability states</i>)	-	-			-
państwa upadłe (<i>failed states</i>)	Realizowanie mniejszej części zadań państwa lub całkowity brak realizacji tych zadań.	Występują konflikty, kryzysy, upadłość ekonomiczna. Rząd nie posiada realnej władzy na całym terytorium.			Niewykonywanie swoich funkcji, niedostarczanie dóbr politycznych, erozja zdolności państwowych (brak efektywnej kontroli nad terytorium, niezapewnianie bezpieczeństwa).
państwa kruche (<i>fragile states</i>)	-	Niezapewnianie bezpieczeństwa w granicach państwa, niezaspokajanie podstawowych potrzeb obywateli. Brak legitymizacji politycznej do reprezentowania obywateli.			
państwa w kryzysie (<i>crisis state</i>)	-	-	-		
państwa dysfunkcyjne (<i>dysfunctional states</i>)	-	-	-	-	

źródło: opracowanie własne na podstawie przeglądu literatury.

Z uwagi na opisane wcześniej bardzo znaczące różnice w definiowaniu państwa nie istnieje jedna ogólnie przyjęta klasyfikacja upadłości państw. Do pomiarów tego zjawiska wykorzystuje się szereg zmiennych z zakresu ekonomii, polityki, bezpieczeństwa obywateli, udziału w konfliktach zbrojnych, a także instytucji danego państwa. W publikacji przygotowanej przez Program Narodów Zjednoczonych ds. Rozwoju [UNDP 2009] wyróżniono 9 klasyfikacji służących mierzeniu wrażliwości (upadłości) państw. Należały do nich: *Bertelsmann Stiftung's Transformation Index*, *Country Indicators for Foreign Policy: Failed & Fragile States*, *Country Policy and Institutional Assessment*, *Fragile States Index*, *Global Peace Index*, *Index of African Governance*, *Index of State Weakness in the Developing World*, *State Fragility Index*, *Political Stability and Absence of Violence*. Dodatkowym zestawieniem wykorzystywanym w badaniach ekonomicznych, który określa stopień kontroli państwa nad swoim terytorium jest *Political Regime Characteristics and Transitions* (PRCT). Poniżej krótko opisano zakres rzeczowy każdego z wymienionych wskaźników, zakres czasowy, metodologię, a także podano najniżej (najgorzej) ocenione państwa.

Bertelsmann Stiftung's Transformation Index (BTI) analizuje sytuację ekonomiczną, polityczną i instytucjonalną w 129 krajach i obejmuje państwa, które dokonały lub dokonują transformacji ustrojowej oraz państwa rozwijające się. Opublikowany został dla lat: 2003, 2006, 2008, 2010, 2012 oraz 2014. BTI składa się z dwóch sub-indeksów: *Status Index* oraz *Management Index*. Pierwszy z nich zawiera ocenę sytuacji ekonomiczno-politycznej, a za najwyższą wartość przyjmuje system demokratyczny z poszanowaniem prawa oraz gospodarkę rynkową zakotwiczoną w zasadach sprawiedliwości społecznej. Wymiar ekonomiczny jest opisywany przez stopień rozwoju ekonomicznego, organizację rynku i konkurencji, stabilność cen i waluty, przestrzeganie praw własności, sprawność systemu opieki społecznej, wyniki gospodarcze, a także zrównoważony wzrost. Analiza sytuacji politycznej prowadzona jest w następujących wymiarach: państwowości, możliwości udziału w życiu politycznym, przestrzeganiu prawa, stabilności instytucji demokratycznych oraz społecznej i politycznej integracji ludności. *Management Index* zawiera zaś ocenę jakości rządzenia (ang. *quality of governance*). Łączny wynik BTI dla kraju jest średnią arytmetyczną ocen transformacji politycznej i ekonomicznej ważoną jakością rządzenia. Wskaźnik jest zdominowany przez oceny eksperckie, jedynie część dotycząca jakości rządzenia zawiera 3 kryteria o charakterze ilościowym. Przyjmuje wartości od 1 do 10 (im wyższy wynik, tym ocena kraju lepsza). Do najniżej ocenionych państw

w 2014 roku należą: Somalia (ocena: 1,32), Erytrea (1,76), Korea Północna (1,98), Syria (2,18) oraz Birma (2,57).

Indeks *Country Indicators for Foreign Policy* (CIFP) przygotowany jest dla lat 2010-2012 z uwzględnieniem 200 krajów. Zakres rzeczowy CIFP obejmuje 9 kluczowych sektorów związanych ze stabilnością państwa. Należą do nich m.in.: rządzenie, gospodarka, bezpieczeństwo i przestępczość, rozwój społeczny, demografia oraz środowisko. Każdy z wymienionych obszarów jest oceniany w skali 1-9 (gdzie 1 otrzymuje kraj oceniony najwyżej w danym sektorze, a 9 – najniżej; pozostałe kraje otrzymują wartości pośrednie). W celu wyeliminowania wpływu szoków ekonomicznych, katastrof naturalnych i innych czynników zewnętrznych, do analiz wykorzystuje się średnie 5-letnie. Końcowa wartość CIFP jest średnią arytmetyczną ocen ze wszystkich sektorów. Wynik końcowy powyżej 6,5 oznacza, iż dany kraj funkcjonuje stosunkowo słabo w porównaniu do innych badanych państw. W ostatnim badanym roku najniżej oceniono: Somalię (7,81), Sudan Południowy (7,81), Republikę Środkowoafrykańską (7,17), Demokratyczną Republikę Kongo (7,09) oraz Afganistan (7,05).

Indeks *Country Policy and Institutional Assessment* (CPIA) przygotowywany jest przez Międzynarodowe Stowarzyszenie Rozwoju (IDA – *International Development Association*) – organ Banku Światowego. Zakres czasowy obejmuje lata 2005-2014. W tym zestawieniu ocenie podlegają jakość prowadzonej polityki i stosowane rozwiązania instytucjonalne jako środki wspierające zrównoważony rozwój, redukcję ubóstwa oraz wykorzystywanie pomocy rozwojowej. Główny nacisk położono na elementy znajdujące się bezpośrednio w zakresie kontroli państwa, nie zaś na wyniki tych działań (np. stopy wzrostu gospodarczego). Ostateczna wartość CPIA jest średnią arytmetyczną szesnastu wskaźników podzielonych na cztery sektory: zarządzanie w sektorze publicznym i jakość instytucji, zarządzanie gospodarką, polityka strukturalna oraz polityka na rzecz integracji społecznej. Każda z opisanych składowych przyjmuje wartości 1-6 (im wyższa wartość, tym lepsza ocena). Bank Światowy klasyfikuje państwa jako niestabilne, gdy spełniony jest jeden z dwóch warunków: (1) kraj znajduje się w dwóch dolnych kwintylach (lub nie jest notowany) w zestawieniu CPIA, (2) jest krajem o niskim dochodzie ze wskaźnikiem CPIA niższym niż 3,0. Najniżej ocenione kraje w 2014 roku to: Erytrea (1,99), Sudan Południowy (2,00), Sudan (2,42), Republika Środkowoafrykańska (2,43) oraz Gwinea Bissau (2,50).

Głównym założeniem przyjętym przy konstruowaniu *Fragile States Index* (FSI) jest fakt, iż nietrwałość struktur państwa może przejawiać się w różnorodny sposób i nie ma jednej uniwersalnej ścieżki upadłości. Analizie podlegają więc wybrane cechy państwowości, a do najczęstszych właściwości państw upadłych / kruchych⁴⁴ zalicza się: utratę kontroli nad terytorium państwa, brak monopolu na użycie siły, niezdolność do dostarczania dóbr publicznych i uczestnictwa w kontaktach międzynarodowych, a także erozję władzy niezbędnej do podejmowania decyzji na szczeblu centralnym. FSI publikowany jest corocznie od 2006 roku i zawiera ocenę (od 1 do 10 – im niższa wartość, tym wyższa ocena) dwunastu wskaźników podzielonych na trzy sektory: społeczny, polityczno-militarny i ekonomiczny. Ocena końcowa jest sumą wszystkich wskaźników (zawiera się więc w przedziale 12-120). Przyjęto, że państwo traktowane jest jako upadłe lub zagrożone upadłością jeśli wartość FSI przekracza 90 punktów. W 2015 roku najgorzej oceniono: Sudan Południowy (114,5), Somalię (114,0), Republikę Środkowoafrykańską (111,9), Sudan (110,8) oraz Demokratyczną Republikę Kongo (109,7).

Global Peace Index (GPI) mierzy skalę występowania tzw. „pokoju negatywnego”⁴⁵ w 162 krajach świata. Publikowany jest corocznie od 2008 roku. Do pomiaru GPI używa się 23 wskaźników ilościowych podzielonych na trzy kategorie: bieżące konflikty krajowe i międzynarodowe, bezpieczeństwo społeczne i publiczne oraz militaryzacja kraju. Każdy z wskaźników otrzymuje wartości 1-5 (niższa ocena oznacza bardziej bezkonfliktowe rozwiązania). Ostateczna wartość wskaźnika GPI jest średnią ważoną wszystkich mierników. Najwyższą łączną wagę otrzymują wskaźniki dotyczące bezpieczeństwa wewnętrznego. Do państw w największym stopniu dotkniętych brakiem pokoju zaliczono w 2015 r.: Syrię (3,64), Irak (3,44), Afganistan (3,43), Sudan Południowy (3,38) oraz Republikę Środkowoafrykańską (3,33).

Index of African Governance ocenia jakość rządzenia w 53 krajach afrykańskich. Opublikowany został dla lat: 2000, 2002 oraz 2005-2007. Ocenie podlega 56 wskaźników przyporządkowanych do pięciu sektorów dobrego rządzenia: bezpieczeństwa i ochrony; praworządności, transparentności i korupcji; przestrzegania praw człowieka; zrównoważonego rozwoju ekonomicznego oraz rozwoju społecznego.

⁴⁴ Do 2013 roku używano określenia *failed states*, od 2014 r. przyjęto *fragile states*.

⁴⁵ Pokój negatywny jest to występowanie przemocy (lub obawy przed przemocą) na terenie kraju. Pokojem pozytywnym nazywamy zaś wszystkie struktury i instytucje wspomagające budowę pokojowych (pozbawionych przemocy) społeczeństw.

Każdy ze wskaźników otrzymuje ocenę w przedziale 0-100 (im wyższa wartość, tym lepsza ocena). Ostateczna wartość IAG jest średnią ważoną wszystkich wskaźników. Do najsłabiej zarządzanych państw w ostatnim badanym roku należały: Somalia (16,3), Sudan (34,8), Czad (36,7), Demokratyczna Republika Kongo (37,3) oraz Wybrzeże Kości Słoniowej (42,7).

Zestawienie *Index of State Weakness in the Developing World* (ISWDW) opracowane zostało dla 141 państw rozwijających się, których populacja liczy więcej niż 100.000 mieszkańców. Zakres czasowy obejmuje jedynie 2007 rok. Analizie poddano 20 wskaźników podzielonych na cztery „koszyki”: ekonomia, polityka, bezpieczeństwo oraz dobrobyt społeczny. Koszyk ekonomiczny zawiera informacje o zdolności państwa do zapewnienia stabilnego wzrostu gospodarczego oraz niwelowania nierówności w podziale dochodu narodowego. W części związanej z zapleczem politycznym zmierzono jakość instytucji politycznych oraz stopień legitymizacji władzy. Bezpieczeństwo oceniane jest przez pryzmat zapewnienia fizycznego bezpieczeństwa swoim obywatelom, w tym przede wszystkim unikania wojen domowych i zewnętrznych oraz przestrzegania praw człowieka. Kategoria dobrobytu społecznego zawiera pomiar dostarczania przez państwo najważniejszych dóbr publicznych, m.in. dostępu do pożywienia i czystej wody, opieki zdrowotnej i edukacji. Wartości wszystkich koszyków poddano unitaryzacji⁴⁶, zaś finalna wartość indeksu jest ich średnią arytmetyczną. Najniżej oceniono Somalię (0,52), Afganistan (1,65) oraz Demokratyczną Republikę Kongo (1,67).

State Fragility Index (SFI) zawiera ocenę wrażliwości 167 państw, których populacja przekracza 500.000 ludzi. Zakres czasowy obejmuje lata 1995-2014 i jest to najdłuższy kompleksowy wskaźnik upadłości / wrażliwości państw prezentowany w dysertacji. Zestawienie to zostało podzielone na 4 kategorie: bezpieczeństwo, polityka, ekonomia oraz społeczeństwo, a w każdej z nich wyróżniono dodatkowo jej efektywność oraz legalność. W części związanej z bezpieczeństwem pod uwagę wzięto wojny, w których państwo uczestniczy (w tym wojny domowe), a także skalę terroru politycznego. Aspekt polityczny opisuje tryb zmiany władzy, a także stopień jej legitymizacji. Ekonomia została utożsamiona z PKB oraz udziałem produkcji w eksporcie. Ostatnia z opisywanych kategorii (bezpieczeństwo) kontrolowana jest za pomocą wskaźnika rozwoju społecznego (HDI) oraz śmiertelności niemowląt. Indeks

⁴⁶ Najwyższa wartość przyjmuje wartość 10, zaś najniższa 0.

przyjmuje wartości od 0 do 25, im wyższa wartość, tym stopień rozkładu funkcji państwa większy. W 2014 roku najgorzej oceniono Republikę Środkowoafrykańską (wartość indeksu 24), Sudan Południowy (24) oraz Demokratyczną Republikę Kongo (23).

Indeks PRCT (również znany jako część *Polity IV Project*) zawiera zestawienie wielu aspektów państwowości, m. in. skalę demokratyzacji oraz autokratyzacji systemu politycznego, informacje o konfliktach zbrojnych, przewrotach oraz wojnach domowych. Z punktu widzenia upadłości państw szczególne znaczenia ma jednak zmienna informująca o fragmentyzacji władzy, tj. sytuacji, gdy organy rządzące nie mają pełnej kontroli nad swoim terytorium. Zakres czasowy obejmuje lata 2000-2014, zaś ocenie poddano 167 państw. Indeks przyjmuje wartość 0, gdy nie występuje fragmentyzacja, 1 – gdy siły rządowe utraciły kontrolę nad maksymalnie 10% terytorium, 2 – w przypadku utraty 10-25% terytorium oraz 3 – w przypadku utraty kontroli nad 25-50% terytorium. W sytuacji, gdy państwo panuje na mniej niż połowie swojego terenu uznawane jest jako upadłe. W 2014 roku za takie państwa uważano: Republikę Środkowoafrykańską, Haiti, Libię, Sudan Południowy, Jemen oraz Bośnię.

Wskaźnik *Political Stability and Absence of Violence* (PSAV), który jest częścią bazy *Worldwide Governance Indicators* przygotowywanej przez Bank Światowy, mierzy zagrożenie niestabilnością polityczną lub przemocą motywowaną politycznie (w tym terroryzmem). Zakres czasowy obejmuje lata 1996, 1998, 2000 oraz 2001-2014. Zestawienie oparte jest na 31 indeksach opisujących w głównej mierze bezpieczeństwo obywateli. Szczególny nacisk położono na wojny domowe i zewnętrzne, napięcia etniczne i religijne oraz (nie)stabilność rządów. Im niższa finalna wartość indeksu, tym gorsza ocena państwa. W ostatnim roku najniżej oceniono Syrię (-2,76), Republikę Środkowoafrykańską (-2,67) oraz Sudan Południowy (-2,54).

W Tabeli 3. zaprezentowano podsumowanie opisanych klasyfikacji upadłości państwa, wymieniono lata objęte badaniem, liczbę krajów oraz liczbę obserwacji, a także wymieniono najgorzej ocenione kraje.

Tabela 3. Zestawienie wybranych klasyfikacji upadłości państw

Indeks	Lata	Liczba krajów (max)	Liczba obserwacji	Najniżej ocenione kraje (w ostatnim roku publikowanego indeksu)				
BTI	2003, 2006, 2008, 2010, 2012, 2014	129	745	1. Somalia	2. Erytrea	3. Korea Płn.	4. Syria	5. Birma
CIFP	2010-2012	201	601	1. Somalia	2. Sudan Płd.	3. Rep. Środkowoaf.	4. DR Kongo	5. Afganistan
CPIA	2005-2014	95	901	1. Erytrea	2. Sudan Płd.	3. Sudan	4. Rep. Środkowoaf.	5. Gwinea Bissau
FSI	2006-2015	178	1 743	1. Sudan Płd.	2. Somalia	3. Rep. Środkowoaf.	4. Sudan	5. DR Kongo
GPI	2008-2015	162	1 276	1. Syria	2. Irak	3. Afganistan	4. Sudan Płd.	5. Rep. Środkowoaf.
IAG	2000, 2002, 2005-2007	53	265	1. Somalia	2. Sudan	3. Czad	4. DR Kongo	5. Wybrzeże Kości Słoniowej
ISWDW	2007	141	141	1. Somalia	2. Afganistan	3. DR Kongo	4. Irak	5. Burundi
SFI	1995-2014	167	3 292	1. Rep. Środkowoaf.	2. Sudan Płd.	3. DR Kongo	4. Sudan	5. Afganistan
PRCT	2000-2014	168	2 480	Rep. Środkowoaf., Haiti, Libia, Sudan Południowy, Jemen, Bośnia i Hercegowina				
PSAV	1996, 1998, 2000, 2002-2014	215	3 270	1. Syria	2. Rep. Środkowoaf.	3. Sudan Płd.	4. Jemen	5. Somalia

źródło: opracowanie własne.

Najdłuższym szeregiem czasowym prezentowanych danych charakteryzują się *State Fragility Index* (SFI) obejmujący lata 1995-2014, a także wskaźnik *Political Stability and Absence of Violence* (PSAV) opisujący zagrożenie niestabilnością lub przemocą w latach 1996-2014, z wyłączeniem roku 1997, 1999 oraz 2001. Oba indeksy charakteryzują się również największą liczbą zgromadzonych obserwacji (odpowiednio: 3292 oraz 3270). Najniższymi atrybutami diagnostycznymi i porównawczymi charakteryzowały się wskaźniki *Index of African Governance* (IAG) oraz *Index of State Weakness in the Developing World* (ISWDW). IAG obejmuje jedynie państwa afrykańskie, co skutkuje ograniczeniem zakresu rzeczowego do 53 państw. ISWDW z kolei zawiera analizę dla 141 państw, jednak jedynie dla 2007 roku. Bez względu na przyjętą klasyfikację państw upadłych wśród najniżej ocenianych krajów najczęściej znajdowały się Somalia, Sudan Południowy oraz Demokratyczna Republika Kongo. Należy również podkreślić, iż problem upadłości dotyka szczególnie mocno państwa z Afryki Subsaharyjskiej oraz Bliskiego Wschodu.

W celu przeanalizowania skali różnic i podobieństw opisanych klasyfikacji utworzono macierz zawierającą dla każdej pary współczynnik korelacji liniowej Pearsona wraz z jego granicznym poziomem istotności statystycznej (patrz Tabela 4). Dodatkowo podano również liczbę wspólnych obserwacji. Wszystkie klasyfikacje zamieniono na stymulanty, więc wraz ze zbliżaniem się wartości korelacji liniowej do 1 rośnie współzależność badanych zestawień. Jedynie w czterech przypadkach nie zaobserwowano żadnej wspólnej pary obserwacji. Najliczniejsze pod tym względem okazały się pary: SFI-PSAV (2624 obserwacje), SFI-PRCT (2495 obserwacji) oraz PRCT-PSAV (2285 obserwacji). Analiza współczynników korelacji liniowej wykazała, iż wszystkie istotne statystycznie korelacje były dodatnie, zaś najwyższe współczynniki zaobserwowano przy parach CIFP-FSI (współczynnik korelacji +0,94 przy 468 wspólnych obserwacjach), CIFP-SFI (0,92; 497 obserwacji) oraz ISWDW-SFI (0,91; 112 obserwacji). Najniżej skorelowany z pozostałymi indeksami jest wskaźnik PRCT, prawdopodobnie z uwagi na jego charakter (przyjmuje wartości 0, 1, 2 lub 3)⁴⁷. Wysokie poziomy korelacji wskazują, iż analiza determinant upadłości państwa powinna charakteryzować się zbliżonymi rezultatami bez względu na przyjętą miarę i klasyfikację upadłości.

⁴⁷ Bank Światowy wykorzystuje w raporcie korelację liniową, jednak – zdaniem autora pracy – z uwagi na nieciągły charakter indeksu PRCT właściwe byłoby wykorzystanie korelacji rangowej.

Tabela 4. Macierz korelacji wybranych klasyfikacji sprawności państw

	BTI	CIFP	CPIA	FSI	GPI	IAG	ISWDW	SFI	PRCT	PSAV
BTI	1,00									
CIFP	0,83* (745 ; 0,000)	1,00								
CPIA	0,73* (278 ; 0,000)	0,68* (198 ; 0,000)	1,00							
FSI	0,83* (602 ; 0,000)	0,94* (468 ; 0,000)	0,62* (540 ; 0,000)	1,00						
GPI	0,63* (510 ; 0,000)	0,74* (480 ; 0,000)	0,43* (439 ; 0,000)	0,80* (1225 ; 0,000)	1,00					
IAG	0,83* (40 ; 0,000)	- (0 ; -)	0,72* (111 ; 0,000)	0,85* (90 ; 0,000)	- (0 ; -)	1,00				
ISWDW	0,83* (114 ; 0,000)	- (0 ; -)	0,75* (64 ; 0,000)	0,86* (112 ; 0,000)	0,68* (123 ; 0,000)	- (0 ; -)	1,00			
SFI	0,78* (745 ; 0,000)	0,92* (497 ; 0,000)	0,58* (650 ; 0,000)	0,87* (1394 ; 0,000)	0,72* (1123 ; 0,000)	0,81* (255 ; 0,000)	0,91* (128 ; 0,000)	1,00		
PRCT	0,23* (745 ; 0,000)	0,14* (495 ; 0,002)	-0,01 (650 ; 0,817)	0,25* (1394 ; 0,000)	0,34* (1117 ; 0,000)	0,51* (255 ; 0,000)	0,26* (128 ; 0,006)	0,25* (2459 ; 0,000)	1,00	
PSAV	0,62* (739 ; 0,000)	0,78* (495 ; 0,000)	0,42* (650 ; 0,000)	0,81* (1394 ; 0,000)	0,86* (1117 ; 0,000)	0,79* (255 ; 0,000)	0,67* (128 ; 0,000)	0,78* (2624 ; 0,000)	0,34* (2285 ; 0,000)	1,00

Uwaga: w nawiasach poniżej współczynnika korelacji podano kolejno: liczbę obserwacji oraz wartość p-value. Wszystkie klasyfikacje zamieniono na stymulanty. Gwiazdką (*) oznaczono współczynniki istotne statystycznie na poziomie ufności 99%.

źródło: opracowanie własne.

Rozdział 2. Determinanty upadłości państwa

2.1. Determinanty ekonomiczne

Z badań wynika, iż głównym czynnikiem ekonomicznym wpływającym na zagrożenie wystąpienia upadłości państwa jest poziom i dynamika produktu krajowego brutto (w tym PKB per capita). Collier [2000, s. 9-11; 2007, s. 17-35] wykazuje, iż każdy pięcioletni okres braku wzrostu gospodarczego lub występowania recesji gospodarczej zwiększa zagrożenie wybuchu wojny domowej o 14%. Jak argumentuje, w społeczeństwach, w których średni poziom dochodów jest niski, występują mniejsze koszty alternatywne wypowiedzenia posłuszeństwa władzy państwowej. Obserwuje się także pośredni wpływ poziomu PKB per capita na zagrożenie państwa upadłością. W gospodarkach występuje tendencja, iż wraz ze wzrostem dochodu narodowego rośnie również udział pobieranych podatków w relacji do produktu krajowego brutto⁴⁸. Dodatkowo, w krajach biednych wpływy z podatków pochodzą zwykle z pojedynczych sektorów lub gałęzi gospodarki (np. przemysł wydobywczy, eksport nieprzetworzonych surowców naturalnych, rolnictwo), które są pod kontrolą wąskiej grupy posiadającej siłę ekonomiczną oraz polityczną⁴⁹. Funkcjonujące wyzyskujące instytucje ekonomiczne⁵⁰ zwiększają zagrożenie wystąpienia negatywnych skutków szoków gospodarczych, gdyż wahania na rynkach pojedynczych dóbr mogą znaleźć swoje odzwierciedlenie w sytuacji gospodarczej całego kraju. Niższe wpływy do budżetu państwa z tytułu podatków ograniczają możliwość finansowania skutecznej obrony kraju, co z kolei zwiększa zagrożenie wybuchu konfliktu zarówno wewnętrznego, jak i zewnętrznego [Collier, Hoefler 2004], a więc także wystąpienia upadłości państwa.

Na szczególną rolę PKB per capita w determinowaniu zagrożenia upadłością państwa zwraca uwagę również Gilley [2006], który dokonuje analizy statystycznej sytuacji 72 państw z całego świata. W swoim badaniu poszukuje on czynników

⁴⁸ W bogatych państwach należących do Organizacji Współpracy Gospodarczej i Rozwoju (OECD) wpływy z podatków sięgają nawet 40% PKB, podczas gdy w krajach biednych udział ten nie przekracza 10% PKB.

⁴⁹ Siłę ekonomiczną należy rozumieć jako dostęp do zasobów (w tym głównie finansowych), który umożliwia kreowanie bieżącej sytuacji w kraju. Siła polityczna odnosi się do możliwości realnego wpływania na sposób stanowionej prawa oraz wybór organów rządzących.

⁵⁰ Ilekroć w niniejszym rozdziale mowa będzie o włączających (wyzyskujących) instytucjach ekonomicznych lub politycznych, rozumiane one będą tak, jak zaprezentowano w podrozdziale 1.3.

mogących wpływać na poziom legitymizacji władzy państwowej⁵¹, który jest mierzony m.in. za pomocą odpowiedzi respondentów w ramach badania *World Value Survey*⁵², a także informacji o przebiegu i wynikach wyborów parlamentarnych. Jak wynika z definicji przytoczonych w Rozdziale 1. niniejszej dysertacji, brak legitymizacji do sprawowania władzy jest warunkiem wystarczającym do wystąpienia upadłości państwa. Badania mające na celu zidentyfikowanie przyczyn braku legitymizacji władzy i jego konsekwencji mają zatem istotny wkład w poszukiwanie czynników wpływających na poziom zagrożenia państwa upadłością. Gilley wykazuje, iż wraz ze spadkiem poziomu produktu krajowego brutto na mieszkańca maleje również legitymizacja do sprawowania władzy przez rządzących. Dzieje się tak, ponieważ obniża się przeciętny poziom życia i wzrasta niezadowolenie społeczne. Co istotne, w państwach o relatywnie wyższym poziomie PKB per capita obserwuje się także wyższy poziom dobrobytu społecznego. Jest on związany ze wzrostem średniego poziomu konsumpcji, poprawą sytuacji zdrowotnej mieszkańców oraz ich lepszym wykształceniem [UNDP 1996]. Gilley wskazuje również, iż redukcja ubóstwa przyczynia się do wzrostu legitymizacji władzy. W warunkach wysokiego wzrostu gospodarczego oraz satysfakcjonującego i rosnącego poziomu życia mieszkańców zaufanie do władzy państwowej jest relatywnie wysokie, co przekłada się na niższe zagrożenie państwa upadłością. Poziom i tempo zmian produktu krajowego brutto należy więc uwzględniać w badaniach uwarunkowań upadłości państwa.

Howard [2008, s. 131-135] poszukując przyczyn upadłości państwa zwraca uwagę, iż w krajach o niskim poziomie produktu narodowego brutto per capita władze państwowe mają ograniczoną możliwość zagwarantowania dostępu do podstawowych dóbr publicznych z uwagi na niższe wpływy do budżetu, przede wszystkim z tytułu podatków. Ich niedostateczna ilość oraz jakość powoduje wzrost niezadowolenia w społeczeństwie oraz osłabienie władzy państwowej, w tym utratę legitymizacji do sprawowania władzy. W takich warunkach organy państwowe nie mają argumentów, aby powstrzymać narastające migracje zewnętrzne, których skutkiem jest obniżenie

⁵¹ Legitymizacja władzy (lub legitymizacja do sprawowania władzy) jest to „uprawnienie rządzących do podejmowania wiążących decyzji, przy równoczesnej aprobacie rządzonych” [Zieliński 2001].

⁵² W ramach *World Value Survey* przeprowadzane są ankiety dotyczące m.in. poglądów, wyznawanych wartości oraz sytuacji ekonomicznej respondentów. Badaniem objęto niemal 100 krajów, które zamieszkuje ok. 90% ludności całego świata.

wartości kapitału ludzkiego. Utrudnia to powstrzymanie procesu upadłości i rozpoczęcie obudowy państwowości w państwach wrażliwych i upadających. Także Doornbos [2002, s. 804] wskazuje, iż obniżenie zdolności do dostarczania podstawowych dóbr publicznych (w tym dostępu do pełnowartościowego jedzenia, picia oraz opieki zdrowotnej) jest przyczyną upadłości państwa⁵³. Niski poziom produktu krajowego brutto per capita jest więc istotnym czynnikiem wpływającym na zwiększanie prawdopodobieństwa wystąpienia upadłości państwa.

W trakcie rozważań na temat wpływu dochodu narodowego na zagrożenie państwa upadłością należy zwrócić także uwagę, iż nie tylko poziom oraz tempo wzrostu PKB per capita mają znaczenie. Jak wskazuje Gemechu [2009, s. 391, 399-400] przyczynę upadłości państwa mogą stanowić także dysproporcje w dochodach pomiędzy poszczególnymi grupami społecznymi⁵⁴. Badając uwarunkowania konfliktów wybuchających w tzw. Rogu Afryki (region obejmujący Dżibuti, Erytreę, Etiopię, Somalię oraz Sudan) wykazuje on, iż wraz ze wzrostem nierówności dochodowych pomiędzy klanami obserwuje się zwiększone zagrożenie wybuchu walk zbrojnych między nimi. Konflikty te są często inicjowane przez grupy nieposiadające wystarczającej siły ekonomicznej i politycznej do uczestnictwa w procesach gospodarczych. Fearon i Laitin [2003] również dowodzą, iż rosące dysproporcje w dochodach zwiększają zagrożenie upadłością państwa. Collier [2000, s. 10] stwierdza jednak, iż procesy doprowadzające do walk wewnętrznych mają zgoła odmienny przebieg. Według niego, wybuchające konflikty wewnętrzne nie są wzniecane przez biedne i wyzyskiwane grupy, a raczej należy je określić jako „gniew bogatych” (ang. *the rage of the rich*). Dowodzi on, że w przypadku występowania wewnętrznych napięć w społeczeństwie, jedynie dobrze zorganizowane i relatywnie bogatsze grupy interesu mają możliwość utworzenia i opłacenia zbrojnych oddziałów pozwalających na przejęcie władzy nad częścią lub całością terytorium państwa. Nie ulega więc wątpliwości, iż bez względu na mechanizmy prowadzące do wybuchu konfliktów wewnętrznych, rosące dysproporcje dochodowe mogą być przyczyną występowania upadłości państwa.

⁵³ Doornbos podkreśla, iż brak dostępu przez mieszkańców do dóbr publicznych jest także skutkiem wystąpienia upadłości państwa, co może utrudniać statystyczne wnioskowanie.

⁵⁴ Tematyka dysproporcji dochodowych poruszana jest również w: Therborn [2015, s. 104-110].

Rola produktu społecznego w procesie upadłości państwa jest przedmiotem nie tylko rozważań teoretycznych, ale również badań empirycznych. Esty i in. [1998] analizują zależność pomiędzy zestawem 75 czynników o charakterze ekonomicznym, politycznym oraz społeczno-demograficznym a zagrożeniem wystąpienia upadłości państwa. Wykazują oni, iż poziom PKB per capita jest jednym z czynników, które istotnie różnicują (dyskryminują) dwie grupy państw. Pierwszą z nich stanowią państwa upadłe i załamane, zaś drugą grupę (kontrolną) stanowią państwa, które nie doświadczyły upadłości⁵⁵. Ponadto udowadniają, iż istnieje zależność przyczynowo-skutkowa pomiędzy poziomem PKB per capita a zagrożeniem wystąpienia upadłości – im poziom dochodu narodowego jest niższy, tym prawdopodobieństwo upadłości wyższe.

Fearon i Laitin [2003] analizują przyczyny wybuchu 127 konfliktów zbrojnych od zakończenia drugiej wojny światowej do 1999 roku. Wykazują oni, iż poziom PKB per capita w statystycznie istotny sposób wpływa na zagrożenie wybuchu konfliktu zbrojnego, a więc także możliwość wystąpienia upadłości państwa. Wraz ze wzrostem poziomu produktu krajowego brutto, ryzyko wybuchu konfliktu wewnętrznego maleje. Autorzy jednocześnie dowodzą, iż prawdopodobieństwo upadłości w państwach, których PKB per capita jest niższe niż 1000\$, jest o 18-34% większe, niż w przypadku państw o dochodzie na mieszkańca powyżej tego poziomu. Na podstawie przeprowadzonego badania wykazują także, iż zapewnianie wzrostu i rozwoju gospodarczego jest warunkiem koniecznym i wystarczającym do minimalizowania zagrożenia upadłością państwa⁵⁶. W warunkach długotrwałego wzrostu i rozwoju gospodarczego wpływ czynników politycznych, w tym m.in. funkcjonującego systemu politycznego i przyjętych rozwiązań instytucjonalnych, staje się bowiem nieistotny statystycznie.

Iqbal i Starr [2007] prezentują wyniki badania ekonometrycznego obejmującego 162 państwa. Poddają w nim analizie wpływ szeregu zmiennych ekonomicznych i politycznych na zagrożenie wystąpienia upadłości państwa. Jako zmienne niezależne w badaniu wykorzystują: poziom produktu krajowego brutto, otwartość gospodarki

⁵⁵ Analiza uwarunkowań wzrostu i rozwoju gospodarczego w krajach Afryki Subsaharyjskiej w: [Swadźba 2017, .s. 147-153]. Szerzej o skali różnic pomiędzy efektami gospodarczymi (takimi jak PKB per capita oraz stopa wzrostu gospodarczego) w grupie państw upadłych i nieupadłych: [Totleben 2015, s. 99-101].

⁵⁶ Redukcja ubóstwa również przyczynia się do zmniejszenia zagrożenia państwa upadłością.

(liczoną jako łączny udział wartości importu i eksportu w PKB), wskaźnik systemu politycznego *Polity IV*, udział w konfliktach zbrojnych, występowanie zamieszek i protestów na terenie kraju oraz niestabilność polityczną. Zakres analizy obejmuje lata 1946-2000. Wykorzystując jako binarną zmienną zależną wskaźnik *Polity IV* (PRCT)⁵⁷ wykazują oni, iż prawdopodobieństwo wystąpienia upadłości państwa wzrasta wraz ze spadkiem poziomu PKB. Kraje o relatywnie niższych dochodach są więc bardziej narażone na upadłość. Jest to spowodowane charakterystycznym dla krajów biedniejszych wzrostem nierówności⁵⁸, a także niższym poziomem ogólnego dobrobytu społecznego. W kolejnym opublikowanym badaniu [Iqbal i Starr 2008] ponownie potwierdzają opisaną zależność pomiędzy poziomem PKB a zagrożeniem upadłością państwa.

Howard [2008] prowadzi badanie wpływu czynników ekonomicznych (m.in. poziomu produktu narodowego brutto per capita) oraz zmiennych politycznych (w tym: systemu politycznego, poziomu korupcji władzy i niestabilności politycznej) na zagrożenie państwa upadłością. Grupę poddaną badaniu stanowi 195 państw, zaś okres analizy obejmuje lata 1955-2000. Howard dowodzi, iż wzrost poziomu PNB per capita jest skorelowany z zagrożeniem upadłością. Wzrostowi PNB per capita o 1% towarzyszy bowiem spadek prawdopodobieństwa wystąpienia całkowitej upadłości państwa o 36,8% (w przypadku państw stabilnych) oraz 19,3% w przypadku państw upadających. Zgodnie z wnioskami sformułowanymi na podstawie opisanego badania, czynniki ekonomiczne odgrywają kluczową rolę w determinowaniu poziomu zagrożenia państwa upadłością.

Argumentów o potrzebie pogłębionej analizy statystycznej i ekonometrycznej czynników warunkujących zagrożenie upadłością państwa dostarczają także Carment, Prest oraz Samy [2008]. Według nich nie jest możliwe opisanie szczegółowego i uniwersalnego ciągu przyczynowo-skutkowego towarzyszącego upadłości państwa, niemniej jednak nie ma przeszkód, aby określić zestaw czynników zwiększających ogólne zagrożenie wystąpienia tego zjawiska. W tym celu przeprowadzają badanie ekonometryczne, w którym grupę badawczą stanowi 156 państw. Zakres czasowy obejmuje lata 2000-2005. Zakładając, że o zagrożeniu upadłością decydują przede

⁵⁷ Zob. także: podrozdział 1.4 (str. 48) oraz uwagi w przypisie 96., s. 120.

⁵⁸ Informacje o różnicowaniu dochodów w krajach Afryki Subsaharyjskiej w: [Tusińska 2017, s. 120-123].

wszystkim uwarunkowania ekonomiczne oraz polityczne, przyjmują do badania następujący zestaw zmiennych niezależnych: poziom PKB per capita (mierzony parytetem siły nabywczej), tempo wzrostu gospodarczego, otwartość gospodarki, wartość wskaźnika rozwoju społecznego HDI (ang. *Human Development Indicator*), system polityczny, a także przestrzeganie praw człowieka i zróżnicowanie etniczne. Autorzy wykazują, iż na zagrożenie państwa upadłością statystycznie istotnie wpływa poziom PKB per capita oraz tempo wzrostu gospodarczego. Im wyższe wartości wymienionych czynników, tym mniej prawdopodobne jest wystąpienie upadłości. Również poziom rozwoju gospodarczego kraju, mierzony indeksem HDI, jest pozytywnie i istotnie statystycznie skorelowany z ograniczaniem ryzyka upadłości państwa. W dalszym, rozszerzonym badaniu dostarczają oni kolejnych argumentów o istotnym statystycznie wpływie poziomu PKB per capita oraz skali ubóstwa na zagrożenie upadłością państwa [Carment i in. 2010].

Z ustaleniami tymi częściowo polemizują Bertocchi i Guerzoni [2012]. Poddając analizie 41 państw Afryki Subsaharyjskiej próbują oni znaleźć odpowiedź na pytanie o wpływ czynników ekonomicznych, historycznych oraz otoczenia instytucjonalnego na zagrożenie wystąpienia upadłości państwa. W badaniu wykorzystują zestaw 19 zmiennych niezależnych, do których zaliczają się m.in. poziom PKB per capita oraz tempo wzrostu gospodarczego, poziom inwestycji, posiadane zasoby naturalne, zróżnicowanie etniczne, poziom wolności osobistych, a także zmienne instytucjonalne (np. przestrzeganie prawa, możliwość udziału w życiu publicznym). Autorzy dowodzą, iż czynniki makroekonomiczne (w głównej mierze poziom PKB per capita oraz tempo wzrostu gospodarczego) wpływają na zagrożenie państwa upadłością – im przyjmują wyższe wartości, tym prawdopodobieństwo upadłości jest niższe. Zaznaczają jednocześnie, iż to nie czynniki makroekonomiczne odgrywają kluczową rolę w determinowaniu poziomu zagrożenia państwa upadłością, a otoczenie instytucjonalne. Włączające instytucje polityczne i ekonomiczne oddalają zagrożenie upadłością państwa, nawet w warunkach braku wzrostu gospodarczego⁵⁹.

Opisane wcześniej mechanizmy wpływu czynników ekonomicznych i politycznych na zagrożenie wystąpienia konfliktu zbrojnego są również analizowane

⁵⁹ Doornbos [2002, s. 804] wykazuje, iż skutki pogorszenia wyników ekonomicznych kraju zwiększają zagrożenie jego upadłością w większym stopniu w krajach o słabych instytucjach, niż w tzw. „krajach stabilnych”.

przez Sambanisa [2001]. Przeprowadza on badanie na grupie 161 państw, którego zakres czasowy obejmuje lata 1960-1999. Autor estymuje modele ekonometryczne, w których do zmiennych niezależnych należą m.in. poziom PKB per capita (jako miara rozwoju kraju)⁶⁰, system polityczny, zróżnicowanie etniczne, a także graniczenie z krajem, w którym trwa wojna. Wykazuje on, iż wyższy poziom produktu krajowego brutto per capita ogranicza napięcia wewnętrzne, co przekłada się na niższe zagrożenie wybuchem wewnętrznego konfliktu zbrojnego. Z uwagi na fakt, iż utrata kontroli nad terytorium państwa przez władze centralne jest równoznaczna z upadłością państwa, zasadne jest stwierdzenie, iż poziom dochodu narodowego na mieszkańca jest czynnikiem warunkującym zagrożenie upadłością⁶¹.

Prowadząc rozważania na temat ekonomicznych uwarunkowań upadłości państwa, należy również wskazać na konsekwencje jej wystąpienia. Na podstawie analizy upadłości państw w latach 1974-2001 Chauvet, Collier i Heoffler [2007] wykazują, iż zjawisko to generuje znaczne koszty ekonomiczne nie tylko dla państwa upadłego, ale także dla jego sąsiadów. Średni łączny koszt upadłości państwa to ok. pięciokrotność PKB w momencie upadłości. Dodatkowo, wystąpienie upadłości powoduje obniżenie tempa wzrostu gospodarczego o 3 punkty procentowe. Z kolei w państwach sąsiadujących z państwem upadłym notuje się niższe tempo wzrostu gospodarczego o 0,3-0,9 punktu procentowego.

Wśród czynników ekonomicznych wpływających na zagrożenie wystąpienia upadłości państwa należy wymienić również otwartość gospodarki⁶², która określana jest niekiedy jako miara integracji kraju z gospodarką światową [Vogiatzoglou i Nguyen 2016, s. 11]. Naturalnym jest, iż większość państw świata nie jest samowystarczalna. Z uwagi na brak lub ograniczony dostęp do poszczególnych surowców i zasobów (albo wysokie koszty ich pozyskiwania) nie są one w stanie wytwarzać i sprzedawać wystarczającej ilości towarów tak, aby uzyskać pełne korzyści związane z minimalizacją kosztów jednostkowych, specjalizacją oraz efektami skali. Wynika stąd potrzeba wymiany handlowej. Korzyści ze specjalizacji i wymiany handlowej rozważane są m.in. w kontekście przewag komparatywnych i absolutnych w

⁶⁰ Sambanis wykorzystuje także średnie zużycie energii na mieszkańca jako miarę rozwoju kraju.

⁶¹ Collier [2007, s. 27] szacuje, iż konsekwencją trwania konfliktu wewnętrznego jest spadek dochodu narodowego o 2,3% każdego roku.

⁶² Otwartość gospodarki to, o ile nie zaznaczono inaczej, łączny udział wartości importu i eksportu w produkcie krajowym brutto.

handlu [por. Ricardo 1971, s. 147-167]. Zgodnie z ustaleniami tzw. teorii przewag komparatywnych umożliwienie swobodnej wymiany handlowej (bez nadmiernej ochrony celnej) prowadzi do specjalizacji i optymalizacji produkcji, co przynosi pozytywne efekty gospodarcze dla wszystkich państw zaangażowanych w wymianę. Uczestnictwo w handlu międzynarodowym jest więc czynnikiem sprzyjającym osiągnięciu wyższych stóp wzrostu gospodarczego, co – jak wykazano w badaniu - redukuje zagrożenie upadłością państwa.

Nie ulega zatem wątpliwości, iż budowanie i podtrzymywanie wzajemnych relacji gospodarczych jest korzystne dla zapewnienia stabilności państwa [Sowell 2016, s. 153-165]. Esty i in. [1998] w przytoczonym wcześniej badaniu wskazują, iż warunkiem koniecznym do osiągnięcia korzyści z uczestnictwa w handlu międzynarodowym jest przestrzeganie ogólnie przyjętych norm, m. in. w zakresie dobrego rządzenia, jakości stanowionego prawa, czy też jego przestrzegania. Wykazano [Aaronson i Abouharb 2013, s. 29-31], iż w krajach będących członkami lub „obserwatorami” Światowej Organizacji Handlu⁶³ (ang. *WTO – World Trade Organization*)⁶⁴ notuje się poprawę jakości rządzenia. Wraz ze wzrostem udziału wymiany handlowej w produkcie krajowym brutto kraju obserwuje się wyższy poziom praworządności oraz poprawę gwarantowania praw własności, co jest niezbędne w zapewnianiu wolnej konkurencji. W opisanym wcześniej badaniu Esty i in. [1998] wykazują, iż większa otwartość gospodarki sprzyja obniżaniu zagrożenia państwa upadłością. Ekonometryczne dowody na pozytywny wpływ handlu zagranicznego dostarczają także Carment i in. [2010]. Iqbal i Starr [2007] wskazują na brak zależności pomiędzy wymianą handlową a zagrożeniem upadłością, jednakże w kolejnym, rozszerzonym badaniu [Iqbal i Starr 2008] potwierdzają hipotezę o pozytywnym wpływie handlu na redukcję zagrożenia upadłością. Również Carment, Prest i Samy [2008] wykazują, iż wzrost łącznego udziału eksportu i importu w produkcie krajowym brutto jest pozytywnie skorelowany ze zmniejszaniem zagrożenia państwa

⁶³ 40 państw należących do WTO przystąpiło do dobrowolnego porozumienia, w którym deklarują m.in. zapobieganie konfliktom oraz zwalczanie praktyk korupcyjnych. Kolejne 30 państw ma status „obserwatora” [WTO – stan na 2016 rok].

⁶⁴ Największą poprawę jakości rządzenia obserwuje się w przypadku krajów ubiegających się o członkostwo w WTO, ponieważ spełnienie norm jest warunkiem dołączenia do organizacji. Niemniej jednak, wśród państw-członków WTO również jest wykazywane poprawę jakości rządzenia.

upadłością. Z przytoczonych badań wynika, iż większa otwartość gospodarcza przyczynia się do obniżenia zagrożenia państwa upadłością.

Z powyższymi poglądami nie zgadzają się Reinert, Amaizo i Kattel [2007, s. 17-19]. Wskazują oni, że wpływ wymiany handlowej nie jest jednoznaczny. Uzależniony jest on bowiem od faktycznej siły organów rządzących. W krajach, w których władza centralna nie dysponuje wystarczającą siłą i legitymizacją do sprawowania władzy, występują liczne bariery w rozwoju handlu, m.in. z uwagi na brak przestrzegania prawa oraz niski poziom ochrony własności prywatnej. Korzyści płynące z handlu są więc również ograniczone. Cechą charakterystyczną gospodarek państw upadających jest brak odpowiedniej infrastruktury technicznej, niezbędnej do wytwarzania produktów mogących konkurować na międzynarodowych rynkach. Stanowi to istotną przeszkodę w zwiększaniu wolumenu wymiany handlowej. Autorzy podkreślają jednocześnie, iż możliwe jest zniesienie barier oraz wzrost wartości importu i eksportu w państwach upadających o słabej infrastrukturze. Zwykle nie towarzyszy temu jednak tworzenie wystarczającej ilości wysoko wynagradzanych miejsc pracy, aby móc zaobserwować pozytywne efekty w zmianie PKB, redukcję ubóstwa i zmniejszenie zagrożenia upadłością.

Istotny jest również fakt, iż za pomocą wymiany międzynarodowej możliwy jest realny wpływ na zmianę sytuacji wewnątrz kraju. Na przykład sankcje handlowe nakładane na kraje, w których funkcjonują wyzyskujące instytucje polityczne (jak np. brak przestrzegania praw człowieka), stanowią istotny środek nacisku na organy rządzące i bodziec do poprawy w tym aspekcie.

Próby poprawy sytuacji ekonomicznej w państwach upadających i upadłych dokonuje się także poprzez przekazywanie środków w ramach oficjalnej pomocy rozwojowej (ang. *ODA – official development assistance*)⁶⁵. Z uwagi na fakt, iż pomimo wsparcia wspólnoty międzynarodowej nie obserwuje się znacznej poprawy w państwach upadłych⁶⁶, podejmuje się liczne badania zmierzające do wyjaśnienia tego

⁶⁵ Zgodnie z raportem fundacji Fund for Peace w 2015 roku 34 państwa (na 178 sklasyfikowanych, 19% badanej grupy) są uznawane jako upadłe lub wysoce zagrożone upadłością. Do tych państw napływa ok. 47% światowych środków dystrybuowanych w ramach oficjalnej pomocy rozwojowej.

⁶⁶ Moyo [2009] stwierdza, iż środki pochodzące z oficjalnej pomocy rozwojowej uwięziły państwa afrykańskie w „spirali korupcji, niskiego wzrostu gospodarczego oraz biedy”. Wykazuje ona, iż pomimo otrzymania przez państwa afrykańskie znacznych środków w ramach bezpośredniej pomocy

fenomenowi. Collier i Hoefler [2002] poddają analizie 27 państw zmierzających do odbudowy instytucji państwa po zakończonym konflikcie zbrojnym. Wykazują, iż zdolność państwa do czerpania korzyści ze środków przekazywanych w ramach oficjalnej pomocy rozwojowej jest uzależniona od postaci instytucji funkcjonujących w państwie. W warunkach włączających instytucji (zarówno ekonomicznych, jak i politycznych) zdolność absorpcji środków pomocowych jest większa, niż w warunkach instytucji wyzyskujących⁶⁷. Autorzy dowodzą także, iż największe korzyści dla państwa przyjmującego pomoc obserwuje się w pierwszych latach po ustabilizowaniu pokoju. Czaplicka [2007] wskazuje dodatkowo, iż poziom absorpcji środków pomocowych oraz skala ich wpływu na poprawę warunków życia ludności zależy od systemu politycznego funkcjonującego w kraju, do którego one napływają. W przypadku państw niedemokratycznych otrzymywane wsparcie w ramach oficjalnej pomocy rozwojowej jest często marnotrawione z uwagi na zawłaszczanie środków przez organy rządzące oraz grupy interesu. W konsekwencji następuje więc zwiększenie siły ekonomicznej (a w konsekwencji także siły politycznej) rządzących elit. Jednocześnie nie obserwuje się poprawy warunków życia obywateli lub poprawa ta jest nieznaczna.

Na niejednoznaczny wpływ przekazywanej pomocy zagranicznej wskazuje również Baliaoune-Lutz [2009]. Oprócz bezpośredniego przekazywania środków pieniężnych, państwa upadające mogą otrzymywać również pomoc w postaci grantów lub dofinansowania zmierzającego do zwiększenia efektywności wykorzystania posiadanych zasobów naturalnych, np. ropy naftowej, diamentów, srebra, złota itp. Powoduje to ukierunkowanie produkcji i eksportu w kierunku jednego sektora lub jednej gałęzi gospodarki. W sytuacji, gdy instytucje państwa nie są wystarczająco silne, zwiększa to narażenie gospodarki na szoki egzogeniczne. Utrudnione jest także wzmocnianie struktur państwowych z uwagi na brak bodźców do zmian. Baliaoune-Lutz wskazuje, iż wpływ pomocy rozwojowej na wzrost i rozwój gospodarczy jest niższy w krajach upadających, niż w państwach stabilnych.

finansowej, liczba osób żyjących za mniej niż dolara dziennie podwoiła się na przestrzeni ostatnich dwudziestu lat.

⁶⁷ Burnside i Dollar [2000, s. 847] wskazują, iż pomoc rozwojowa ma pozytywny wpływ na wzrost gospodarczy w krajach rozwijających się, które prowadzą odpowiednią politykę fiskalną, monetarną oraz handlową. Efekty te nie występują (lub są słabe) w przypadku krajów prowadzących złą politykę. Autorzy nie definiują jednak cech „dobrej” oraz „złej” polityki.

Zagrożenia płynące z napływu oficjalnej pomocy rozwojowej dostrzegają także Feeny i McGillivray [2010]. Na podstawie modelu ekonometrycznego wykazują zależność pomiędzy pomocą rozwojową, strukturą budżetu państw otrzymujących wsparcie, a zagrożeniem upadłością państwa. Nie ulega wątpliwości, iż napływ środków w ramach ODA podwyższa poziom zagregowanej konsumpcji w gospodarce, a także przyczynia się do zwiększenia inwestycji. Jednakże towarzyszy temu zmniejszenie wpływów do budżetu państwa z tytułu podatków, gdyż środki pomocy rozwojowej są często z nich zwolnione. Negatywne efekty po stronie dochodów podatkowych są silniejsze w państwach upadających, których struktura produkcji jest mniej zróżnicowana. Państwa te są również bardziej narażone na niestabilność polityczną i negatywne szoki makroekonomiczne po ograniczeniu lub zaprzestaniu przekazywania środków w ramach oficjalnej pomocy rozwojowej.

Oznacza to, iż sam fakt przekazywania ODA nie przyczynia się do zmniejszenia zagrożenia upadłością. Wręcz przeciwnie, w warunkach wyzyskujących instytucji politycznych i ekonomicznych, zagrożenie to może zostać podwyższone. Liczni autorzy [Brautigam i Knack, 2004; Knack 2004; Ear 2007] wskazują bowiem, iż otrzymywanie pomocy zagranicznej może opóźniać niezbędne reformy ekonomiczne i polityczne z uwagi na brak bodźców do zmian.

Na poziom ryzyka wystąpienia upadłości państwa wpływa również zagrożenie tzw. „klątwą surowcową”. Termin ten został użyty po raz pierwszy przez Auty’ego [1993] jako określenie niższego tempa wzrostu gospodarczego w krajach opartych o eksploatację złóż naturalnych⁶⁸. Do tego grona zaliczył wszystkie państwa, które jednocześnie spełniają dwa kryteria: co najmniej 8% PKB wytwarzane jest przez sektor wydobywczy oraz co najmniej 40% eksportu pochodzi ze sprzedaży surowców naturalnych. Liczne prace [m.in. Auty 1994; Sachs, Warner 1995; Mehlum, Moene, Torvik 2006] wskazują, iż w krajach, które w znacznej mierze są uzależnione od eksportu surowców naturalnych, obserwuje się na relatywnie niższe stopy wzrostu gospodarczego i słabszy rozwój gospodarczy.

⁶⁸ Z klątwą surowcową nierozzerwalnie wiąże się pojęcie „choroby holenderskiej” (ang. *Dutch disease*). Termin ten został po raz pierwszy użyty przez *The Economist* w 1977 roku jako opis regresu gospodarczego po odkryciu dużych złóż surowców naturalnych. Wykazano, iż odkryciu ogromnych złóż gazu ziemnego w Holandii pod koniec lat 50. XX wieku towarzyszył m.in. niemal pięciokrotny wzrost stopy bezrobocia (z 1,1% do ponad 5%) [The Economist 2014].

Występowanie „klątwy surowcowej” jest więc kolejnym czynnikiem ekonomicznym, który może wpływać na zagrożenie państwa upadłością. Moore [1998, 2001] dowodzi, iż zyski osiągnane przez państwo z tytułu eksploatacji złóż surowców naturalnych i ich sprzedaży poza granice kraju mogą prowadzić do wybuchu lokalnych konfliktów. Jest to spowodowane faktem, iż zyski płynące z handlu surowcami naturalnymi poprawiają zwykle warunki życia jedynie członków nielicznych grup interesu, co zwiększa dysproporcje dochodowe wewnątrz kraju. Szczególnie zagrożone są państwa, w których nie wykształciły się włączające instytucje ekonomiczne i polityczne oraz te, które charakteryzują się niskim poziomem rozwoju gospodarczego. Klare [2001] dodaje również, iż autorytarna władza może wykorzystywać wpływy osiągnane z wydobycia surowców naturalnych do finansowania i wzmacniania swoich rządów. W długim okresie powoduje to zwiększone napięcia społeczne i podwyższa zagrożenie wystąpienia upadłości państwa⁶⁹.

Collier i Hoefler [2004] dokonują empirycznej weryfikacji przedstawionego mechanizmu. Badaniem obejmują 161 państw w latach 1960-1999, poszukując przyczyn wybuchu 79 wojen domowych, które miały miejsce w tym analizowanym okresie. Autorzy wykazują, iż poziom zagrożenia państwa upadłością jest istotnie statystycznie skorelowany z występowaniem „klątwy surowcowej”. Uzależnienie gospodarki od eksportu surowców naturalnych, w połączeniu z funkcjonowaniem wyzyskujących instytucji politycznych, zwiększa zagrożenie wystąpienia upadłości. Wśród pierwotnych przyczyn autorzy wymieniają „chciwość rządzących” w czerpaniu korzyści z eksploatacji złóż⁷⁰, a także rozczarowanie obywateli wynikające z wysokich dysproporcji dochodowych oraz braku praw politycznych. Identycznie wnioski formułuje Wardin [2013] podkreślając, iż zwiększone prawdopodobieństwo wystąpienia upadłości państwa w związku z zagrożeniem „klątwą surowcową” jest szczególnie silne w państwach afrykańskich, gdyż charakteryzują się one niską jakością

⁶⁹ De Soysa [2002] analizując przyczyny wybuchu konfliktów w latach 1989-1999 wskazuje, iż państwa, których gospodarki uzależnione są od eksportu surowców naturalnych, są statystycznie bardziej narażone na wybuch konfliktu wewnętrznego i upadłość.

⁷⁰ Spór o kontrolę nad surowcami naturalnymi (głównie ropą naftową) pomiędzy klanami i elitami doprowadził m.in. do wojny domowej w Sudanie [Prunier, Gisselquist 2003]. W wyniku całkowitego upadku struktur państwowych, na drodze secesji zostało utworzone nowe państwo – Sudan Południowy.

rządów. Nie bez znaczenia jest fakt, iż afrykańskie złoża surowców naturalnych są jednymi z ostatnich łatwo dostępnych do eksploatacji.

Z czerpaniem zysków z wydobycia surowców wiąże się także zjawisko pogoni za rentą (ang. *rent-seeking*). Jest ono określane jako naturalne dążenie podmiotów gospodarczych (w tym przede wszystkim: osób fizycznych, przedsiębiorstw, organizacji, grup interesu) do uzyskiwania korzyści materialnych z prowadzonych działań. Pogoń za rentą może przybierać zarówno formy legalne (jak np. konkurencja oraz lobbing) oraz nielegalne (w tym korupcja, przemyt, funkcjonowanie w tzw. „szarej strefie”) [Krueger 1974, s. 291].

Khan [2000] dowodzi, iż pogoń za rentą statystycznie częściej przybiera nielegalną postać (w tym nawet zbrojnej walki pomiędzy grupami interesu) w państwach posiadających znaczne złoża ropy naftowej. Doornbos [2002] wskazuje z kolei, iż większe prawdopodobieństwo wybuchu wewnętrznego konfliktu zbrojnego o dostęp do zasobów występuje w państwach o słabej władzy centralnej. Jako przykład wybuchu takiego konfliktu podaje się m.in. wojnę w Sierra Leone, która rozpoczęła się 1991 roku. Zawłaszczenie przez grupy interesu eksportu surowców naturalnych (głównie diamentów) spowodowało wzrost ich siły ekonomicznej, a w konsekwencji także siły politycznej. Spór o możliwość czerpania korzyści z eksploatacji złóż zakończył się krwawą wojną domową (śmierć poniosło ponad 100 tys. osób) i w konsekwencji upadłością państwa [Reno 2003].

Rolą organów rządzących jest więc skonstruowanie takiego systemu prawnego, który wspiera legalną konkurencję pomiędzy uczestnikami gry rynkowej. Jednocześnie należy ograniczać możliwości nielegalnego wpływania poszczególnych grup na sposób tworzenia warunków rynkowych [Woźniak 2008].

Reasumując, wzrost zagrożenia wystąpienia zjawiska upadłości państwa może być determinowany liczną grupą czynników ekonomicznych, do których należą między innymi:

- poziom produktu krajowego brutto (w tym PKB per capita),
- stopa wzrostu gospodarczego,
- otwartość gospodarki,
- wartość środków otrzymywanych w ramach oficjalnej pomocy rozwojowej i efektywność ich wykorzystania,
- forma konkurencji ekonomicznej pomiędzy podmiotami.

2.2. Determinanty polityczne

Kolejną analizowaną grupą determinant są te o charakterze politycznym, wśród których należy wymienić: system polityczny (sposoby wybierania i wpływania na organy rządzące), stanowione prawo i poziom jego przestrzegania, a także postać i siła instytucji.

Jednym z kluczowych czynników politycznych wpływających na zagrożenie upadłością państwa jest system polityczny rozumiany jako ogół rozwiązań instytucjonalno-prawnych określający sposób wyboru oraz stanowienia władzy ustawodawczej i wykonawczej. Esty i in. [1998] wskazują, iż wystąpienie upadłości państwa jest statystycznie mniej prawdopodobne w państwach demokratycznych. Według autorów badania istnieją dwa warunki konieczne, które są niezbędne do określenia systemu funkcjonującego w danym państwie jako demokratycznego. Pierwszym z nich jest możliwość legalnego rywalizowania o władzę publiczną w ramach wyborów powszechnych (tzw. bierne prawo wyborcze), zaś drugim – istnienie prawnie usankcjonowanych mechanizmów zapewniających zinstytucjonalizowaną kontrolę nad organami władzy wykonawczej. Autorzy wskazują, iż w warunkach funkcjonowania systemu demokratycznego, politycy zainteresowani reelekcją w kolejnych wyborach zmuszeni są do podejmowania takich decyzji, które im to umożliwią. Zobligowani są więc do reagowania na potrzeby zgłaszane przez społeczeństwo i rozwiązywanie problemów wyborców. Wiąże się to z obniżeniem poziomu niezadowolenia w społeczeństwie, łagodzeniem napięć politycznych i etnicznych, a także ograniczeniem skali przemocy⁷¹. Mechanizmy te nie występują w systemach autorytarnych z uwagi na inne cele organów rządzących. W warunkach funkcjonowania systemów niedemokratycznych, grupy interesu stanowiące władzę częściej skupiają swe działania na utrzymywaniu władzy oraz kreowaniu rent ekonomicznych. Demokratyczny system polityczny jest więc negatywnie skorelowany z zagrożeniem wystąpienia upadłości państwa.

Sambanis [2001] dowodzi, iż w krajach demokratycznych prawdopodobieństwo wybuchu wojny domowej, a w konsekwencji całkowitej upadłości państwa, jest niższe,

⁷¹ Zwracają także uwagę, iż wpływ systemu politycznego na zagrożenie upadłością państwa można również analizować równoległe z otwartością gospodarki, a nawet śmiertelnością noworodków. Udowadniają, iż system demokratyczny zapewniający włączające instytucje ekonomiczne (z większym udziałem eksportu i importu w PKB) oraz odpowiedni poziom opieki zdrowotnej (z niższą obserwowaną śmiertelnością) towarzyszy niższemu zagrożeniu państwa upadłością.

niż w krajach charakteryzujących się władzą autorytarną. King i Zeng [2001] dokonując analizy 195 państw w latach 1955-1998 wykazują, iż istnieje istotna statystycznie zależność pomiędzy systemem politycznym a zagrożeniem upadłością. System demokratyczny obniża, a autorytarny podwyższa ryzyko wystąpienia upadłości państwa. Co więcej, kraje częściowo demokratyczne (tj. takie, w których nie wszystkie instytucje mają charakter właściwy dla demokracji) są bardziej narażone na upadłość, niż kraje w pełni demokratyczne oraz w pełni autorytarne.

Z poglądami o istnieniu zależności pomiędzy systemem politycznym a zagrożeniem upadłością państwa nie zgadza się Elgström [2002]. Wskazuje on, iż nie jest możliwe określenie statystycznie istotnej zależności przyczynowo-skutkowej pomiędzy przyjętym system politycznym a rozwojem ekonomicznym zapewniającym stabilność polityczną. Nie ulega wątpliwości, iż demokracja wspiera rozwój gospodarczy, jednakże może być on ograniczany lub wręcz niwelowany przez inne czynniki (np. czynniki geograficzne oraz historyczne). Według Elgströma demokratyczny system polityczny nie jest więc ani warunkiem koniecznym, ani wystarczającym do zapewnienia stabilności państwa i uniknięcia upadłości. Fearon i Laitin [2003] wskazują z kolei, iż system polityczny nie ma wpływu na zagrożenie upadłością, jeśli państwo zapewnia wzrost i rozwój gospodarczy. W warunkach braku rozwoju gospodarczego prawdopodobieństwo upadłości państwa jest jednak wyższe w państwach rządzonych autorytarnie.

Badaniem związku pomiędzy poziomem demokracji a zagrożeniem wystąpienia zorganizowanej przemocy na terenie kraju zajmują się Koonings i Kruijt [2004]. Również oni wykazują, iż przyjęty system polityczny nie jest wiodącym czynnikiem decydującym o poziomie zagrożenia utratą przez państwo monopolu na użycie siły, czyli *de facto* o wystąpieniu upadłości państwa. Znacznie bardziej istotne jest, czy organy rządzące posiadają legitymizację do sprawowania władzy oraz dysponują odpowiednimi instrumentami gwarantującymi zdolność rządzenia. Carment, Prest i Samy [2008] dostarczają ekonometrycznych dowodów na brak zależności pomiędzy funkcjonującym systemem politycznym a zagrożeniem państwa upadłością. Podkreślają oni, iż czynniki ekonomiczne (takie jak m.in. tempo wzrostu gospodarczego oraz wskaźnik rozwoju społecznego) odgrywają kluczową rolę w determinowaniu zagrożenia wystąpienia upadłości państwa. Czynniki polityczne nie są statystycznie istotne.

Odmianą argumentację przytacza Howard [2008], który dowodzi, iż poziom zagrożenia państwa upadłością jest uzależniony od przyjętego systemu politycznego. Opisane wyżej czynniki, jak legitymizacja do sprawowania władzy, posiadanie właściwych instrumentów, czy zdolność zapewniania długotrwałego i stabilnego rozwoju gospodarczego, zawsze są wynikiem przyjętego systemu politycznego. W państwach, w których funkcjonują demokratyczne lub chociaż częściowo demokratyczne rządy, częściej zapewniane są włączające instytucje ekonomiczne i polityczne. Możliwość swobodnego reprezentowania swoich poglądów oraz stworzenie systemu bodźców stymulującego wzrost gospodarczy zwiększa stabilność państwa, a więc obniża zagrożenie wystąpienia jego upadłości. Pogląd ten znajduje odzwierciedlenie w wynikach badań ekonometrycznych przeprowadzonych przez Iqbala i Starra [2007, 2008]. Wykazują oni bowiem, iż wpływ systemu demokratycznego (mierzonego wartością indeksu *Polity IV*) na zagrożenie upadłością państwa jest statystycznie istotny. Podobnie jak przytoczeni wcześniej King i Zeng [2001] dowodzą, iż wpływ ten nie ma charakteru liniowego. Funkcja prawdopodobieństwa upadłości państwa ze względu na funkcjonujący system polityczny jest niemal „U-kształtna”, tzn. państwa o silnie demokratycznych oraz silnie autorytarnych rządach upadają rzadziej, niż państwa, w których rządy nie są w pełni demokratyczne lub autorytarne. Podkreślić jednak należy, iż w pełni demokratyczny system polityczny obniża zagrożenie upadłością bardziej, niż system całkowicie autorytarny. Wskazują oni także, iż kraje, w który dokonała się transformacja ustroju politycznego (od systemu autorytarnego do systemu demokratycznego) są bardziej narażone na upadłość w początkowych latach funkcjonowania nowego systemu politycznego. Również Carment i in. [2010] dostarczają ekonometrycznych dowodów na negatywną zależność pomiędzy poziomem indeksu *Polity IV* a zagrożeniem upadłością państwa. Kraje rządzone w sposób demokratyczny są więc mniej narażone na upadłość w porównaniu z państwami autorytarnymi.

Wpływ systemu politycznego na zagrożenie upadłością państwa obserwowany jest także w pośredni sposób. W poprzednim podrozdziale opisano ekonomiczne mechanizmy transponujące uzależnienie od surowców naturalnych („klątwe surowcową”) na zagrożenie państwa upadłością. Również czynniki polityczne, w tym głównie system polityczny, wpływają na poziom tego zagrożenia. Prawdopodobieństwo upadłości państwa z powodu walk o możliwość czerpania korzyści finansowych z eksploatacji złóż surowców naturalnych jest bowiem wyższe w krajach rządzonych

autorytarnie [Moore 1998; Klare 2001; Collier, Hoefler 2004]. Państwa demokratyczne gwarantują system polityczny umożliwiający pokojowe rozwiązywanie problemów ekonomicznych, w tym regulacji dotyczących zjawiska pogoni za rentą (*rent seeking*). Skuteczniej chronią także prawa własności, co bez wątpienia jest szczególnie istotne w omawianym kontekście. Nie dochodzi więc do walk zbrojnych pomiędzy grupami zainteresowanymi czerpaniem korzyści z eksploatacji surowców naturalnych, a raczej do ekonomicznej rywalizacji pomiędzy uczestnikami gry rynkowej. Systemy autorytarne, oparte na władzy jednostki lub grup interesu, nie dostarczają takich mechanizmów. Co więcej, organy rządzące często same uczestniczą w walkach o surowce nie chcąc rezygnować z generowanej renty ekonomicznej. Konflikty o dostęp do złóż surowców naturalnych pomiędzy grupami interesu dysponującymi potencjałem militarnym doprowadziły do upadłości m.in. Sierra Leone⁷² [por. Reno 2013] oraz Sudanu [por. Prunier i Gisselquist 2003].

Przyczyn upadłości państwa należy upatrywać więc także w słabych⁷³, szczególnie formalnych, instytucjach (ang. *weak institutions*) oraz w ich złej postaci (ang. *bad institutions*). Z uwagi na ograniczoną możliwość realizacji zamierzeń politycznych i gospodarczych, wśród państw charakteryzujących się słabymi instytucjami obserwuje się większe zagrożenie utraty kontroli nad częścią terytorium na rzecz grup interesu. Elity i owe grupy dysponują bowiem wystarczającym zapleczem ekonomicznym (finansowym) i militarnym, aby móc przeciwstawić się centralnym organom rządzącym. Ottaway i Mair [2004, s. 2-4] zwracają uwagę, iż najważniejszym czynnikiem zapobiegającym upadłości państwa w warunkach słabych instytucji jest zapewnienie bezpieczeństwa wewnętrznego i kontrola granic. O ile to możliwe, powinno to nastąpić z wykorzystaniem lokalnego potencjału militarnego. Jeśli środki te okazują się niewystarczające, niezbędne jest udzielenie pomocy ze strony organizacji

⁷² Wśród pierwotnych przyczyn upadłości Sierra Leone wyróżnia się także celowe dążenie grup interesu do decentralizacji ośrodków posiadających monopol na użycie siły. Doprowadziło to do rozpadu społeczeństwa, a w konsekwencji uniemożliwiło stanowienie władzy na terenie kraju.

⁷³ Należy rozdzielić dwa wymiary państwowości: siłę państwa oraz zakres jego funkcji. „Słabe państwo” (posiadające słabe instytucje) to takie, które nie jest zdolne do planowania oraz realizowania zamierzonych działań politycznych i gospodarczych, a także do egzekwowania prawa [Fukuyama 2005, s. 26]. Z uwagi na zakres funkcji państwa wyróżnia się m.in. te, które sprawują jedynie niezbędne funkcje (tzw. państwo minimalne, np. Korea Południowa) oraz te, które aktywnie uczestniczą w procesach gospodarczych (np. państwa skandynawskie – Finlandia i Szwecja).

międzynarodowych. Niemniej jednak, głównym celem działań powinno być w pierwszej kolejności przywrócenie bezpieczeństwa, a dopiero później wdrażanie reform gospodarczych stymulujących wzrost i rozwój gospodarczy oraz zmierzających do odbudowy państwowości.

Również Rajan [2011] formułuje zbliżone wnioski na podstawie analizy sytuacji polityczno-ekonomicznej w państwach, w których zakończył się konflikt zbrojny. Według niego, od siły instytucji państwa zależy jego sytuacja w pierwszych latach po zakończonym konflikcie. Nawet wprowadzenie włączających instytucji politycznych (z wolnymi, demokratycznymi wyborami) nie gwarantuje uniknięcia upadłości. Brak silnego otoczenia instytucjonalnego⁷⁴ w naturalny sposób prowadzi do nierównomiernego rozkładu władzy ekonomicznej. Dzieje się tak, ponieważ zwykle w wyborach po konflikcie wygrywają te partie, które wcześniej miały dostęp do władzy. W krajach zrujnowanych po wojnie, jedynie nieliczne grupy (elity) posiadają wystarczające środki finansowe, aby przekonać społeczeństwo do głosowania na siebie. Nie występują więc bodźce do zmiany kształtu i wzmacniania instytucji politycznych. Bertocchi i Guerzoni [2012] podkreślają, iż złe i słabe instytucje są pierwotną i kluczową przyczyną upadłości państwa.

Słabe instytucje państwa doprowadziły do upadłości m.in. Somali i Demokratycznej Republiki Kongo. W wyniku zbrojnego zamachu stanu została ustanowiona w Somali władza dyktatorska, która zawłaszczyła władzę polityczną na wiele lat. Wprowadzone reformy gospodarcze, takie jak próba ustanowienia quasi-socjalistycznego ustroju gospodarczego, znacznie osłabiły potencjał ekonomiczny kraju i sprawiły, że Somalia jest obecnie jednym z najbiedniejszych państw świata, a instytucje państwa są w całkowitym rozpadzie [Clarke i Gosende 2003]. Z kolei obalenie autorytarnych rządów prezydenta Mobutu w Demokratycznej Republice Kongo doprowadziło, przy bardzo słabych instytucjach politycznych państwa, do kolejnej walki o władzę. Przerodziła się ona w wojnę domową i skutkowałą całkowitą upadłością państwa [Lemerchand 2003].

Zasadny jest zatem wniosek, iż jedynie udostępnienie licznym grupom obywateli możliwości aktywnego udziału w procesach gospodarczych i legalnego kreowania rent ekonomicznych prowadzi do rozwoju społeczno-gospodarczego oraz

⁷⁴ Szerzej o korzyściach płynących z silnej i sprawnej władzy centralnej w: [Wilkin 2013, s. 24-28].

zmniejsza zagrożenie państwa upadłością. Potrzebna do tego jest silna władza („silne państwo”), która będzie dysponowała wystarczającą legitymizacją do przeprowadzenia reform gospodarczych.

Negatywny wpływ słabych instytucji państwa jest szczególnie często obserwowany w krajach, które są zagrożone wystąpieniem „klątwy surowcowej”. W sytuacji, gdy organy państwowe nie dysponują wystarczająco silnymi instytucjami, zagrożenie konfliktem na tle dostępu do surowców jest większe [Doorbos 2002, Wardin 2013]. Dzieje się tak, ponieważ w państwach dotkniętych „klątwą surowcową” proces kreowania rent ekonomicznych jest zwykle ograniczony do pojedynczych gałęzi gospodarki związanych z wydobywaniem i handlem surowcami naturalnymi. Silne instytucje gwarantują ustanowienie takich praw i reguł, które są ogólnie przestrzegane i akceptowane, obniżają więc znacznie prawdopodobieństwo wybuchu konfliktu o dostęp do surowców. Bardziej utrudnione jest pokojowe rozwiązywanie sporów w warunkach słabych instytucji państwa. Wynika stąd wniosek, iż posiadanie i korzystanie ze złóż surowców naturalnych może mieć pozytywny skutek dla rozwoju gospodarczego i stabilności państwa, jeśli funkcjonują silne instytucje określające dostęp do kreowania rent. W warunkach słabych instytucji lub - w skrajnej sytuacji - ich braku, „klątwa surowcowa” podwyższa zagrożenie państwa upadłością.

Od siły instytucji zależy także wpływ otwartości gospodarki na prawdopodobieństwo upadłości państwa. Słabe instytucje państwa nie gwarantują równomiernego dostępu do rynku wszystkim obywatelom, co przekłada się na wzrost dysproporcji dochodowych. Powoduje to wzrost niezadowolenia społecznego i podwyższa poziom prawdopodobieństwa wystąpienia upadłości państwa. Zwiększanie otwartości gospodarki na handel zagraniczny przynosi korzyści jedynie przy silnych i ugruntowanych instytucjach zarówno formalnych, jak i nieformalnych [Reinert, Amaizo, Kattel 2007, s. 17-19].

Wśród instytucji wpływających na zwiększone zagrożenie upadłością państwa wskazuje się w głównej mierze: nieprzestrzeganie praw człowieka, permanentną korupcję, a także niską jakość rządzenia. Państwa o relatywnie słabszych instytucjach charakteryzują się bowiem wyższym poziomem korupcji. Ograniczona możliwość legalnej konkurencji ekonomicznej i politycznej sprzyja wzrostowi niezadowolenia społecznego, wybuchom protestów, a w konsekwencji może doprowadzić do obniżenia siły państwa i jego upadłości. Zagrożenie wybuchu zamieszek jest również większe w krajach, w których nie jest możliwe legalne demonstrowanie swoich poglądów i

faktyczne wpływanie na organy rządzące, a więc w państwach o wyzyskujących instytucjach politycznych, np. rządzonych autorytarnie [Howard 2008].

Niezadowolenie społeczne wynikające z długotrwanie funkcjonujących instytucji wyzyskujących (zarówno ekonomicznych, jak i politycznych), nierównomiernego dostępu do rent, a także słabości państwa powoduje w konsekwencji niestabilność polityczną. Do najczęstszych jej symptomów należą liczne protesty (w tym przybierające konfrontacyjny charakter)⁷⁵, zamieszki oraz konflikty pomiędzy grupami społecznymi. Można więc stwierdzić, iż pomiędzy słabymi instytucjami państwa a niestabilnością polityczną występuje sprzężenie zwrotne. Słabe instytucje są zarówno przyczyną, jak i skutkiem napięć społecznych.

Jak zwracają uwagę Fearon i Laitin [2003], niestabilność polityczna w relatywnie dużej skali powoduje dezorganizację i chaos oraz obniża zdolność organów państwowych do wypełniania swoich funkcji. W takich warunkach rosną napięcia społeczne oraz pojawiają się silne tendencje separatystyczne, najczęściej motywowane chęcią uzyskiwania większych rent ekonomicznych. Skutkuje to obniżonym poziomem legitymizacji do sprawowania władzy przez organy rządzące i przyczynia się bezpośrednio do zwiększonego zagrożenia upadłością państwa⁷⁶ [Gilley 2006]. Williams [2009] wskazuje z kolei, iż niestabilność polityczna (szczególnie związana z przemocą) wynika z niskiej zdolności organów rządzących do sprawowania efektywnej kontroli nad przestrzeganiem prawa. Nie ulega wątpliwości, iż wszechobecna przemoc zwiększa zagrożenie upadłością państwa [Englehart 2007].

Możliwe jest zaobserwowanie szczególnego charakteru zmian politycznych w XX wieku. Kraje rozwinięte ekonomicznie niejako „uczyły się” reguł wolnego rynku oraz demokracji, jednocześnie tłumiąc jakiegokolwiek próby inicjowania tych procesów w państwach od nich zależnych, szczególnie w swoich koloniach. Implikuje to znaczne opóźnienie w formowaniu efektywnych i demokratycznych rządów. Nie ulega

⁷⁵ Podkreślić również należy, iż w państwach, w których władza ograniczona jest do wąskiej grupy osób, nie występują mechanizmy zapewniające bezkonfliktowe rozwiązywanie problemów, co zwiększa zagrożenie zbrojnego przejścia władzy nad częścią terytorium państwa przez grupy interesu [Ottaway, Mair 2004]. Ponadto wiele państw, szczególnie nowoutworzonych, zmaga się z brakiem przygotowania lokalnych przywódców lub elit politycznych do przejścia rządów i efektywnego sprawowania władzy [Englehart 2007, s. 145-149].

⁷⁶ Ekonometrycznych dowodów na wpływ niestabilności politycznej na zwiększone zagrożenie upadłością państwa dostarczają: Iqbal i Starr [2007], Howard [2008] oraz Carment i in. [2010].

wątpliwości, iż czynniki polityczne (ze szczególnym uwzględnieniem instytucji państwa i systemu politycznego) odgrywają znaczącą rolę w kształtowaniu się skali zagrożenia upadłością państwa.

Jak wynika z przytoczonych argumentów, rolą organów rządzących jest kreowanie i wspieranie takich instytucji, które redukują negatywne skutki nieuczciwej pogoni za rentą na rzecz efektywności ekonomicznej i powszechnie uznanych w społeczeństwie zasad podziału [Woźniak 2008, s. 245]. Jak już wcześniej zauważono, skala i zakres dostępu do procesu kreowania rent ekonomicznych jest jednym z czynników, który determinuje zagrożenie państwa upadłością. Wielu autorów [m.in. Sala-i-Martin 1997; Weingast 1997; de Soto 2002; Piątek 2016] wskazuje na znaczną rolę czynników instytucjonalnych w kreowaniu długotrwałego wzrostu i rozwoju gospodarczego. Funkcjonujące instytucje, które chronią własność prywatną i zapewniają równość wobec prawa, przyczyniają się do zmniejszania niepewności i kosztów transakcyjnych, co z kolei jest źródłem wzrostu gospodarczego i wysokiego poziomu życia [North 1988, s. 10].

2.3. Pozostałe determinanty

Wśród pozostałych czynników mających wpływ na poziom prawdopodobieństwa wystąpienia upadłości państwa należy wymienić jego historię (w tym dziedzictwo systemu prawnego), uwarunkowania geograficzne, a także postać instytucji nieformalnych (w tym dominującą religię).

W rozważaniach na temat czynników warunkujących upadłość państwa szczególną uwagę należy zwrócić na także tzw. dryf instytucjonalny (por. Rysunek 1, str. 38), który definiowany jest jako suma przeszłych zdarzeń (niekiedy o charakterze losowym) wpływająca na obecny kształt instytucji. Do elementów dryfu zaliczyć można m.in. historię państwa i ludności zamieszkującej jego terytorium, dziedzictwo kulturowe, jak również zmiany klimatu i warunków środowiskowych, które determinują kształt społeczeństwa i jego instytucji.

Jak wskazano w poprzednim rozdziale, dryf instytucjonalny ma wpływ na kształtowanie się instytucji państwa, a w konsekwencji na osiągnięte efekty gospodarcze oraz stabilność aparatu państwowego. Zdarzenia przeszłe zdają się mieć szczególne znaczenie w kontekście nowoutworzonych państw oraz drogi, jaką musiały one przebyć od momentu uzyskania niepodległości. Państwa postkolonialne (zyskujące suwerenność w wyniku ustania relacji kolonialnej) muszą mierzyć się z szeregiem barier i wyzwań,

stanowiących przeszkody w kształtowaniu trwałych i silnych instytucji gwarantujących stabilność państwa.

Pierwszą z omawianych barier jest skupienie aparatu władzy w rękach pojedynczych przywódców lub uprzywilejowanych grup. W takiej sytuacji następuje odrzucenie władzy legalnej kosztem władzy charyzmatycznej (w rozumieniu Webera), często motywowanej przemocą lub zagrożeniem jej użycia. Długotrwałe utrzymywanie wyzyskujących instytucji politycznych skutkuje m.in. asymetrycznym rozkładem rent – zarówno politycznych, jak również ekonomicznych. Jak wykazano, w długim okresie zwiększa to zagrożenie państwa upadłością.

Drugą z wymienianych barier jest niska sprawność aparatu biurokratycznego wynikająca z nieustannego konfliktu interesów pomiędzy grupami zainteresowanymi dostępem do władzy i rent ekonomicznych. Nieujednolicone prawnie metody rozwiązywania takich sporów oraz częste uciekanie się do przemocy sprawia, iż niemożliwe jest zaistnienie odpowiednich warunków do wzrostu gospodarczego i trwałej poprawy warunków życia ludności, które przyczyniłyby się do zmniejszenia zagrożenia wystąpienia upadłości w państwach o takiej charakterystyce.

Sachs [2006, s. 193-195] analizując sytuację postkolonialną państw skupia swoją uwagę na państwach afrykańskich, ze szczególnym uwzględnieniem Afryki Subsaharyjskiej⁷⁷. Wskazuje, iż wyzysk państw afrykańskich przez państwa tzw. „Zachodu” trwał wiele setek lat, począwszy od handlu niewolnikami (XVI wiek) do brutalnych rządów kolonialnych (do lat 60. XX wieku). Jak konkluduje, po zakończeniu ery kolonialnej „Afryka bynajmniej nie wyszła wzmocniona pod względem gospodarczym; nie miała też wykształconych obywateli i przywódców, podstawowej infrastruktury i publicznej opieki zdrowotnej. Granice nowych państw, które uzyskały niezależność, przebiegały wzdłuż linii, które kiedyś arbitralnie wytyczyły ówczesne imperia kolonialne, rozdzielając zupełnie dowolnie grupy etniczne, ekosystemy, działy wodne i złoża zasobów naturalnych”. Istniejące do dziś podziały i wybuchające konflikty są więc skutkiem zarówno procesów kolonizacyjnych, jak i późniejszej, często chaotycznej, dekolonizacji. Horowitz [1985, s. 5] podkreśla iż „w wielu byłych państwach kolonialnych niepodległość utorowała drogę zamieszkom na tle etnicznym”. Wszechobecna przemoc, której dopuszczają się liczne grupy zbrojne

⁷⁷ Zgodnie z metodologią Programu Narodów Zjednoczonych ds. Rozwoju, do Afryki Subsaharyjskiej zalicza się 46 państw leżących na południe od Sahary.

próbujące zawłaszczyć część rent ekonomicznych, oraz wieloletnie opóźnienia w stymulowaniu rozwoju gospodarczego sprawiają, że kraje postkolonialne szczególnie mocno narażone są na całkowity rozkład instytucji państwa i wystąpienie upadłości.

Poziom zagrożenia państw postkolonialnych upadłością zależy od tego, które państwo stanowiło władzę kolonialną w przeszłości. Sposoby sprawowania nadzoru przez władze tych państw lub ich wysłanników znacząco się bowiem różniły między sobą. Jedną z głównych osi podziału jest podejście do tworzenia prawa, które można podzielić na tzw. „oddolne stanowienie prawa” oraz „odgórne stanowienie prawa”.

Oddolna ewolucja prawa związana jest z tradycją prawa zwyczajowego i pochodzi z Anglii, skąd w naturalny sposób została rozszerzona na byłe kolonie brytyjskie. Zgodnie z tym podejściem, sędziowie są niezależnymi fachowcami, którzy orzekają na podstawie podobnych przypadków, które zdarzyły się w przeszłości (precedensów). W przypadku, gdy sporna sytuacja wydarza się po raz pierwszy i nie można skorzystać z wiążącego precedensu (tzw. „sprawa jeszcze nierozpoznana”, *case of first impression*), sędziowie orzekają na podstawie poczucia sprawiedliwości charakterystycznego dla danej wspólnoty lub poprzez analogię do podobnych spraw. Jest to tak zwane prawo precedensowe (ang. *common law*). Zasady prawne powstają więc w reakcji na otaczającą rzeczywistość i szybciej są adoptowane do nowych sytuacji.

Tradycja odgórnego stanowienia prawa jest z kolei związana z prawem cywilnym i pochodzi od Napoleona, stąd jej szczególna rola w byłych koloniach francuskich i hiszpańskich. Zgodnie z nią, prawo jest stanowione przez odpowiednie organy (legislatorów) z przewidywaniem każdej sytuacji, która może się wydarzyć. Rolą sędziów jest odniesienie sytuacji będącej przedmiotem sporu do spisanego wcześniej prawa.

Porównując oba podejścia do tworzenia prawa należy zwrócić uwagę, iż systemowi z tradycyjnym prawem cywilnym brakuje sprzężenia zwrotnego, które charakteryzuje prawo zwyczajowe. W związku z tym „prawo cywilne mniej przystaje do rzeczywistości i ma problem w adaptowaniu się do nowych sytuacji, w miarę jak zmienia się społeczeństwo (...)” [Easterly 2008, s. 84-85]. Oddolne podejście do prawa jest bardziej korzystne dla rozwoju niż podejście odgórne. Należy więc oczekiwać, iż państwa, w których funkcjonował lub funkcjonuje system prawa cywilnego, są bardziej narażone na wystąpienie upadłości w porównaniu do państw z systemem prawa zwyczajowego.

Fenwick [2009] porównując byłe kolonie brytyjskie i francuskie⁷⁸ zwraca uwagę, iż główny cel przyświecający państwom-kolonizatorom był zawsze taki sam bez względu na to, które państwo stanowiło władzę kolonialną. Tym celem było osiągnięcie korzyści ekonomicznych. Niemniej jednak metody, którymi się posługiwano w trakcie realizacji tego zadania, były bardzo zróżnicowane. Brytyjski system zarządzania koloniami był nastawiony na wydobywanie surowców oraz tworzenie rentownych przedsiębiorstw. Z kolei system francuski w znacznej mierze został oparty na próbie zacieśniania więzów ekonomicznych, politycznych i kulturowych. Wielka Brytania nigdy nie zamierzała dążyć w takim stopniu do asymilacji ludności zamieszkującej tereny kolonii.

Próba odgórnego narzucenia europejskiej wizji budowy społeczeństwa w koloniach była w obciążona bowiem dużym ryzykiem niepowodzenia z uwagi na brak spójności instytucji formalnych (prawa) oraz nieformalnych (zwyczajów, kultury). Również inni badacze podkreślają przewagę brytyjskiego systemu zarządzania koloniami nad systemami innych krajów, objawiającą się w lepszych efektach gospodarczych [Lee, Schultz 2012], rozwoju państwa [Lange, Mahoney, vom Hau 2006] oraz jego stabilności [Pureza i in., 2007; Karadeli 2009, s. 114-116]. Wskazuje się także, iż państwa, które uzyskały niepodległość na drodze ustania relacji kolonialnej, są bardziej narażone na upadłość, z uwagi na nagłe obniżenie siły państwa, a także na brak wystarczającego potencjału militarnego do zapewnienia bezpieczeństwa wewnętrznego oraz zewnętrznego [Fearon 1998].

Należy podkreślić, iż państwa postkolonialne (szczególnie leżące na południe od Sahary) osiągały w pewnych okresach wysokie tempo wzrostu gospodarczego [por. Sender 1999 za: Di John 2008, s. 23]. Spuścizna prawna z okresu ucisku kolonialnego, bez wątpienia nadal ma wpływ na proces kreowania rent i trwałość państwa w długim okresie [Lockwood 2005, s. 70; Di John 2008, s. 23-24]. Ponadto, Sulkowski [2011, s. 283] wyróżnia dziedzictwo systemu kolonialnego jako jeden z czterech głównych czynników wpływających na niestabilność państw afrykańskich⁷⁹.

Kolejną grupą uwarunkowań wpływających na zagrożenie państwa upadłością, są determinanty kulturowe, również będące elementem dryfu instytucjonalnego.

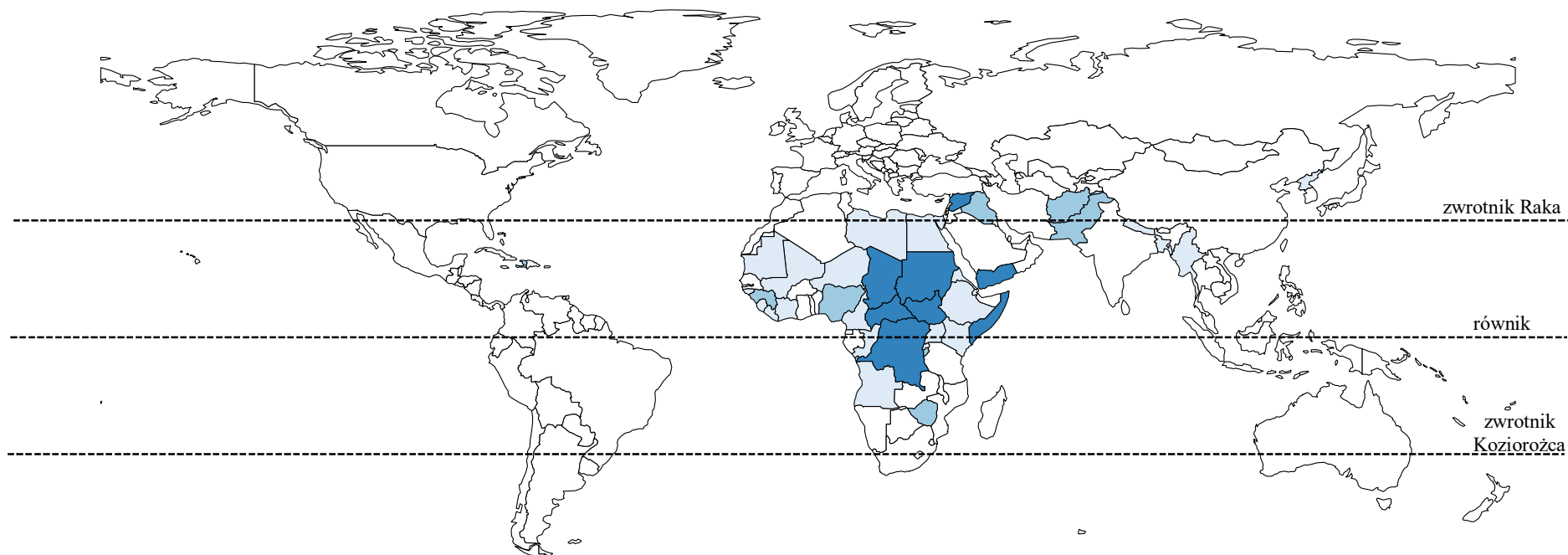
⁷⁸ W analizie wykorzystuje wielokrotne studium przypadku, porównując Kenię (byłą kolonię brytyjską) i Senegal (byłą kolonię francuską).

⁷⁹ Do pozostałych zalicza zakończenie zimnej wojny i walki ideologicznej supermocarstw, demokratyzację państw „Trzeciego Świata” oraz wysokie tempo procesu globalizacji.

Czynniki te są trudne do wykorzystania w badaniach ilościowych, ponieważ opisują bardzo złożone, niekiedy nieuchwytnie, zjawisko.

Reasumując, funkcjonujące włączające instytucje ekonomiczne (takie jak: równomierny dostęp do rynku i procesu kreowania rent) częściej wykształcają się w państwach, których społeczeństwa wykazują większe podobieństwa kulturowe. Konsekwencje ich funkcjonowania (w postaci trwałego rozwoju gospodarczego) zmniejszają zagrożenie państwa upadłością. Wysokie zróżnicowanie etniczne, częste konflikty, brak wzajemnego zaufania i funkcjonujące instytucje o charakterze wyzyskującym zwiększają prawdopodobieństwo wystąpienia upadłości państwa [por. także: Jacoby 2005; Desment, Ortuño-Ortín, Wacziarg 2015].

W rozważaniach na temat czynników warunkujących upadanie państwa przytacza się również argumenty o dużym wpływie środowiska naturalnego oraz czynników klimatycznych. Nie ma żadnych wątpliwości, że państwa położone w okolicy równika charakteryzują się statystycznie mniej sprawnymi instytucjami niż te leżące bliżej zwrotnika Raka bądź Koziorożca (patrz Rysunek 2). Nie świadczy to jednak o istnieniu jakiegokolwiek zależności przyczynowo-skutkowej w tym zakresie bądź jej braku.



Rysunek 2. Mapa świata z zaznaczonymi państwami upadłymi i upadającymi zgodnie z *Fragile State Index*

Uwaga: kolor ciemnoniebieski oznacza bardzo wysokie zagrożenie upadłością, niebieski – wysokie zagrożenie, a kolor jasnoniebieski – zagrożenie upadłością (zgodnie z metodologią Fragile State Index)

źródło: opracowanie własne na podstawie Fund for Peace.

Wśród badaczy nie ma również zgody co do postaci i siły wpływu mechanizmów transponujących zastane warunki klimatyczne na zagrożenie upadłością państwa. Istnieją analizy podkreślające całkowity brak wpływu klimatu na sprawność instytucji, efektywne rządzenie oraz zagrożenie upadłością [Acemoglu i Robinson 2014, s. 63-71; Gil 2015, s. 96], jak również wskazujące, że warunki klimatyczne są silnie powiązane z niestabilnością polityczną [m.in.: Smith i Vivekananda 2007]. Bezsprzecznie jednak na sytuację ekonomiczno-polityczną państwa wpływ ma nie sam klimat, ale fakt oraz tempo jego zmian. Mazo [2009, s. 100-101] zauważa, iż w krajach biednych zmiany klimatyczne, takie jak na przykład wzrost średniorocznej temperatury, powodują obniżenie stopy wzrostu gospodarczego. Owa zmiana stanowi bowiem egzogeniczny szok dla gospodarki, którego absorpcja trwa statystycznie dłużej w krajach o niższych dochodach na mieszkańca. Na niekorzyść państw relatywnie biedniejszych wpływa także fakt, iż są one oparte w większej mierze na produkcji silnie uzależnionej od warunków pogodowych (większy udział rolnictwa w PKB). Opisana relacja pomiędzy klimatem a efektami gospodarczym nie występuje w krajach rozwiniętych.

Zmiany klimatyczne są więc przeszkodą (obok m.in. wysokiego tempa wzrostu populacji, niskiej jakości służby zdrowia, wykluczenia ekonomicznego), z którą muszą mierzyć się państwa leżące w regionach o przeciętnie niskim produkcie na mieszkańca. Państwa upadające, z powodu słabej jakości instytucji objawiającej się niewłaściwym zarządzaniem państwem oraz niską zdolnością do rozwiązywania problemów na płaszczyźnie ogólnokrajowej (takich jak absorpcja szoków związanych ze zmiennością warunków klimatycznych), są bardziej narażone na postępującą degradację funkcji państwa, niż państwa stabilne [Battaglini, Scheffran 2011, s. 28-30].

Fetzek i Mazo [2014, s. 143-144] zwracają uwagę także na pośredni wpływ zmian klimatycznych. W określonych przypadkach mogą one przyczyniać się do występowania lokalnych niedostatków wody, jedzenia i innych zasobów naturalnych, co z kolei może stanowić przyczynę wewnętrznych napięć. W raporcie *A Climate of Conflict*, przygotowanym przez brytyjską organizację pozarządową *International Alert* [Smith, Vivekananda 2007], zawarto stwierdzenie, iż postępujące zmiany klimatyczne przyczyniają się do destabilizacji światowego ekosystemu, co z kolei zwiększa

zagrożenie klęskami naturalnymi⁸⁰. Ich konsekwencją jest przejściowy lub trwały brak dostępu do odpowiedniej ilości pożywienia. Powoduje to niekiedy masową i często niekontrolowaną migrację, która z kolei skutkuje wzrostem ryzyka wystąpienia konfliktów. Szacuje się, że nawet 66% populacji świata zamieszkuje w krajach, w których istnieje wysokie ryzyko destabilizacji państwa jako konsekwencji przeobrażania się klimatu.

Kluczowym aspektem jest więc zdolność państwa do zaadoptowania się do zmiennych warunków klimatycznych. Ponieważ obserwuje się wysoką korelację pomiędzy niską zdolnością do adaptacji oraz słabością instytucji, często niezbędna jest pomoc zewnętrzna [Smith, Vivekananda 2008, s. 1-13]. W państwach upadających społeczeństwa często nie mają możliwości wywierania presji na rządzących, gdyż funkcjonujące instytucje ekonomiczne i polityczne o charakterze wyzyskującym ograniczają ich prawa w tym zakresie. Z tego powodu koalicje będące przy władzy nie są zainteresowane reformami (zwiększaniem możliwości adaptacji do zmian klimatu), a jedynie powiększaniem własnych rent. W długim okresie skutkuje to znacznym wzrostem prawdopodobieństwa wybuchu konfliktu zbrojnego oraz ostateczną upadłością państwa. Gdy społeczeństwo posiada wystarczającą siłę polityczną i ekonomiczną, rządzący zmuszeni są do wprowadzania zmian i innowacji, co powiększa zdolność do absorpcji szoków zewnętrznych związanych ze zmianą klimatu oraz pozwala oddalić zagrożenie wybuchu konfliktu [Smith, Vivekananda 2009, s. 9-10]. Tematyka wpływu klimatu i jego zmian na zagrożenie konfliktem zbrojnym jest poruszona także w badaniach ekonometrycznych. Udowodniono, iż wzrost temperatury o 1 stopień Celsjusza może zwiększać prawdopodobieństwo wybuchu wojny w krajach afrykańskich nawet o 4,5% [Burke i in., 2009, s. 20670-20671].

Należy także wspomnieć, iż konsekwencją wojen niemal zawsze jest dewastacja środowiska naturalnego. W krajach, które posiadają jedynie niewielkie ilości zasobów naturalnych w momencie wybuchu konfliktu, obserwuje się proporcjonalnie znacznie większy ubytek surowców, niż w krajach posiadających większe złoża. Patel i Sondorp [2003, s. 139-140] zwracają uwagę, iż dewastacja środowiska naturalnego utrudnia procesy odbudowy i wzmacniania struktur państwowych na terenach pokonfliktowych. Procesy zmierzające do zwiększenia zdolności reagowania na zmiany klimatu przez

⁸⁰ Szerzej o bezpośrednim i pośrednim wpływie katastrof naturalnych na wyniki ekonomiczne państw: Kukulka [2016].

organy rządzące oraz społeczeństwa są ze swej natury długie i kosztowne. Proces zmian struktury produkcji w kierunku zwiększenia racjonalności w wykorzystaniu środowiska (w tym ograniczenia emisji produktów spalania paliw kopalnych, zmniejszenia wycinki lasów i marnotrawienia wody) jest czaso- i kapitałochłonny. Jednakże, według szacunków, znacznie korzystniejsze z ekonomicznego punktu widzenia jest przeciwdziałania zmianom klimatycznym, niż ponoszenie ich kosztów [Dutt, Gaioli 2007, s. 4239-4241]. Jak wynika z raportu przygotowanego dla rządu Wielkiej Brytanii (tzw. „raport Sterna”), negatywne skutki zmian klimatu mogą prowadzić do utraty 5% PKB rocznie, a w długim okresie nawet do 20% PKB rocznie, podczas gdy koszty niezbędnych programów obniżających tempo zmian klimatycznych i ograniczających powstałe w ich wyniku ryzyka gospodarcze nie powinny przekroczyć 1% światowego PKB [Stern 2007, s. vi], jeśli owe programy zostaną wprowadzone odpowiednio wcześniej. Zmiany klimatyczne i zdolność do adaptacji wpływają więc na wyniki ekonomiczne państw, co z kolei determinuje zagrożenie wystąpienia upadłości.

Sachs [2009, s. 74-87] zwraca uwagę na zagrożenia wynikające z postępujących w coraz szybszym tempie zmian klimatycznych i środowiskowych wywołanych działalnością człowieka. Należą do nich m.in. przeobrażanie obszarów lądowych, zwiększanie stężenia dwutlenku węgla (i związany z nim wzrost średniorocznej temperatury na Ziemi, tzw. „efekt cieplarniany”), zużywanie surowców w szybszym tempie, niż możliwe jest ich odtworzenie oraz wyniszczenie licznych gatunków zwierząt. Sachs nazywa przejściowe sukcesy ekonomiczne wynikające z uprzemysłowienia gospodarek „paradoksem bogacenia się”, gdyż często towarzyszy im załamanie światowego systemu ekologicznego. Wraz ze wzrostem światowego PKB w długim okresie może nastąpić więc gwałtownie obniżenie średniego poziomu życia mieszkańców naszej planety.

Kolejną grupą czynników determinujących zagrożenie państwa upadłością są instytucje nieformalne, które związane są z tożsamością, kulturą i religią⁸¹. Inglehart [2003] analizuje 65 państw należących do kilku „kręgów kulturowych”. Państwa poddane badaniu zostały podzielone na następujące kręgi: kraje historycznie katolickie, kraje prawosławne, kraje historycznie protestanckie, państwa islamskie, a także kraje konfucjańskie. Autor wykazuje, iż dziedzictwo kulturowe jest przyczyną różnic w

⁸¹ Liczne artykuły przedstawiające wpływ kultury na efekty gospodarcze zostały przedstawione w książce *Kultura ma znaczenie* [Harrison, Huntington 2003].

poziomie kapitału społecznego, jak również rozwoju gospodarczego. Kulturę utożsamia, przynajmniej częściowo, z wyznawaną religią lub jej dziedzictwem obserwowanym w tradycyjnych zachowaniach przedstawicieli danej społeczności. Słuszne jest więc analizowanie różnic w postaci instytucji nieformalnych pomiędzy państwami na podstawie wiodącej w danym kraju religii.

Można także stwierdzić, iż czynniki kulturowe, w tym religia [Fernandez 2010], mogą wpływać na wartości realne oraz na zagrożenie konfliktami wewnętrznymi i zewnętrznymi, a w konsekwencji na prawdopodobieństwo wystąpienia upadłości państwa. Nieustannie trwające walki o dystrybucję zysków prowadzone między grupami etnicznymi w Afryce utrudniły nie tylko faktyczną i skuteczną demokratyzację afrykańskich państw, ale także uniemożliwiły zapewnienie trwałego rozwoju gospodarczego z uwagi [Easterly 2008, s. 108].

2.4. Podsumowanie

W literaturze przedmiotu odnaleźć można wiele publikacji naukowych i raportów przygotowywanych przez organizacje międzynarodowe, których celem jest próba zidentyfikowania czynników wpływających na zagrożenie państwa upadłością. Wskazuje się w nich wiodącą rolę dwóch grup uwarunkowań: ekonomicznych oraz politycznych.

Przeprowadzony krytyczny przegląd literatury prowadzi do wniosku, iż badania na temat przyczyn upadłości państwa można podzielić na dwie grupy ze względu na wykorzystane metody. Pierwszą z nich stanowią analizy studium przypadku (*case study*), a drugą prace oparte na metodach statystycznych oraz ekonometrycznych [Howard 2008, s. 125].

W badaniach typu studium przypadku szczegółowo analizuje się sytuację państwa, które doświadczyło upadłości. Główną zaletą badań *case study* jest fakt, iż możliwe jest uchwycenie możliwie pełnej specyfiki omawianego problemu. W takich badaniach uwzględnia się nie tylko dane statystyczne, ale przede wszystkim bezpośrednie obserwacje, raporty, a także rozmowy i wywiady z przedstawicielami lokalnej społeczności oraz organów rządzących. Każda upadłość państwa jest wprawdzie ze swej natury aktem jednostkowym i niepowtarzalnym, jednakże możliwe jest zidentyfikowanie grupy czynników i procesów, które mogą istotnie wpływać na prawdopodobieństwo jej wystąpienia. Badania studium przypadku, a szczególnie

wielokrotnego studium przypadku⁸², pozwalają na porównanie przyczyn wystąpienia upadłości w poszczególnych państwach, a więc także na określenie podobieństw i różnic pomiędzy analizowanymi krajami na dużym poziomie szczegółowości⁸³.

Odmienną specyfiką charakteryzują się rozważania bazujące na analizach statystycznych i ekonometrycznych. W pracach tego typu dokonuje się krytycznego przeglądu literatury w celu określenia zależności przyczynowo-skutkowych charakterystycznych dla procesu upadłości państwa, a także identyfikuje się zestaw zmiennych najczęściej wykorzystywanych w badaniach ilościowych. W następnej kolejności poddaje się empirycznej weryfikacji wpływ poszczególnych zmiennych na prawdopodobieństwo wystąpienia upadłości państwa lub też na poziom sprawności aparatu państwowego. Do głównych zalet prowadzenia badań opartych na analizach ekonometrycznych należy możliwość włączenia do modeli danych statystycznych dla wielu państw jednocześnie. Możliwa jest także weryfikacja istotności wpływu licznego zbioru zmiennych na zagrożenie wystąpienia upadłości państwa.

Na podstawie licznych artykułów naukowych oraz raportów organizacji międzynarodowych można stwierdzić, iż czynniki ekonomiczne oraz polityczne determinują poziom zagrożenia państwa upadłością. Ich rola jest dominująca nad pozostałymi czynnikami, gdyż zapewnienie efektywnie funkcjonujących włączających instytucji ekonomicznych oraz politycznych skutecznie niweluje negatywny wpływ innych uwarunkowań, takich jak geografia, historia oraz kultura.

Łączny przegląd badań został umieszczony w Aneksie 1.

⁸² Wielokrotne studium przypadku jest to metoda badawcza, w której analizie poddaje się więcej niż jeden przypadek, co stanowi podstawę do formułowania wspólnych, przekrojowych wniosków dla całej badanej grupy [Yin 2015, s. 50]. Wyróżnia się prace będące analizą przekrojową i zawierające osobną prezentację pojedynczych przypadków (np. poszukiwanie odpowiedzi o przyczyny upadłości państwa na podstawie rozłącznych analiz różnych krajów), jak również przekrojowe analizy wielu przypadków jednocześnie (np. poszukiwanie uwarunkowań upadłości w wyselekcjonowanej grupie krajów).

⁸³ O metodologii prowadzenia badań typu *case study*, a także o ich walorach poznawczych w: [Lechman 2014].

Rozdział 3. Identyfikacja czynników zwiększających zagrożenie wystąpienia upadłości państwa

3.1. Dobór obserwacji, zmiennych i wykorzystana metoda badawcza

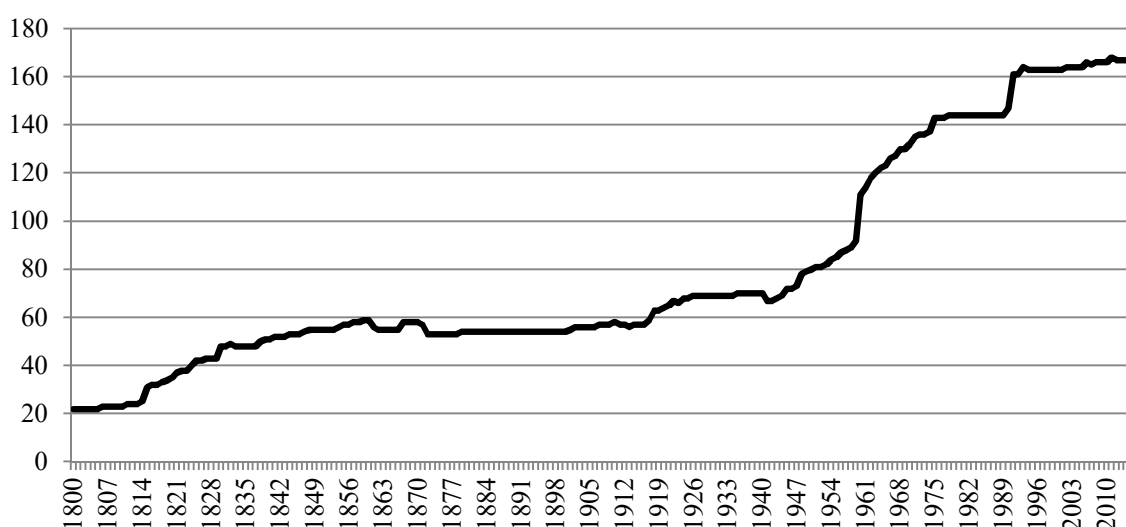
W ramach niniejszej dysertacji przeprowadzone zostanie badanie z wykorzystaniem metod statystycznych oraz ekonometrycznych. Na podstawie jednokrotnego studium przypadku nie byłoby bowiem uzasadnione formułowanie wniosków dla całej populacji z uwagi na niepowtarzalny charakter każdej upadłości. Wykonanie wielokrotnego studium przypadku jest z kolei niemożliwe z uwagi na fakt, iż tego typu analizy prowadzone są zwykle przez zorganizowane grupy badaczy dysponujące znacznymi środkami finansowymi. Z tych względów zdecydowano się na przeprowadzenie badania przekrojowego z wykorzystaniem narzędzi statystycznych i ekonometrycznych, co umożliwi równoczesne poddanie analizie licznego zbioru zmiennych dla wielu państw świata. Aby takie badanie mogło być wykonane należy określić, które czynniki mogą wpływać na poziom zagrożenia państwa upadłością, a także czy istnieje zależność przyczynowo-skutkowa⁸⁴ pomiędzy nimi a faktem wystąpienia upadłości. Zmienne, które zostały zidentyfikowane jako istotne w determinowaniu poziomu prawdopodobieństwa wystąpienia upadłości państwa (por. Rozdział 2) będą wykorzystane w badaniach ilościowych przedstawionych w kolejnych częściach dysertacji.

Na podstawie przeprowadzonej w poprzednich rozdziałach analizy cech i zadań państwa oraz wiodących koncepcji we współczesnej literaturze, w dysertacji przyjęto [za: CIFP], iż **zjawisko upadłości państwa polega na nieposiadaniu przez organy rządzące realnej siły i legitymizacji do sprawowania władzy oraz braku zdolności do przymusu wykonywania aktów prawnych na terenie całego kraju**. Brak dostatecznej kontroli nad terytorium pogarsza efektywność systemu ekonomicznego oraz osłabia poziom gwarantowanych praw własności. Prowadzi to w długim okresie do

⁸⁴ Reilly [2008] zwraca uwagę, iż określenie zależności przyczynowo-skutkowej jest wyjątkowo trudne w badaniach nad przyczynami upadłości państwa. Jak argumentuje, w procesie upadłości często nie jest możliwe określenie precyzyjnego momentu, od którego państwo należy traktować jako upadłe. Jednocześnie, z uwagi na wyjątkową dynamikę zmian w okresie upadłości, niekiedy nie jest możliwe odróżnienie przyczyn od skutków. W związku z powyższym należy ze szczególną ostrożnością określać ewentualny związek przyczyna-skutek, a wnioski płynące z badań empirycznych powinny być uzupełnione kompleksowymi rozważaniami teoretycznymi.

obniżenia tempa wzrostu i rozwoju gospodarczego, a także do pogorszenia warunków życia większości obywateli.

Zakres i skala występowania państw upadłych na mapie świata wykazują znaczne zróżnicowanie na przestrzeni ostatnich dwóch stuleci. Na początku XIX wieku istniały 22 państwa o ludności powyżej 500 tysięcy, zaś sto lat później już 54. U progu XXI wieku klasyfikowano już 163 autonomiczne państwa spełniające wymienione kryterium mieszkańców. Oznacza to ponad siedmiokrotny wzrost liczby państw na przestrzeni 200 lat. Tak gwałtowne zmiany nie mają precedensu w najnowszej historii świata. Ogólna liczba państw na świecie w latach 1800-2015 została przedstawiona na wykresie 1.



Wykres 1. Liczba państw na świecie w latach 1800-2015

Uwaga: Uwzględniono państwa o ludności powyżej 0,5 mln.

źródło: opracowanie własne na podstawie *Center for Systemic Peace*.

Zauważalna jest tendencja do zwiększania się liczby państw na świecie. Wskazać należy jednak dwa szczególne okresy, które charakteryzują się największą dynamiką zmian. Pierwszy z nich stanowią lata po zakończeniu drugiej wojny światowej, a którego kulminacyjnym momentem jest początek lat 60. XX wieku. W tym czasie nastąpiła tzw. „dekolonializacja Afryki” – państwa europejskie przestały sprawować władzę nad koloniami, w skutek czego zostało utworzonych wiele nowych państw, które w większości zyskały pełną autonomię. Drugi okres wzmożonych ruchów państwowotwórczych przypada na przełom lat 80. i 90. XX wieku, w czasie których dokonywała się transformacja ustrojowa (w tym rozbięcie bloków komunistycznych i utworzenie - lub przywrócenie autonomii - kolejnych państw). Zmiany te w oczywisty sposób wymusiły na rządzących konieczność zbudowania od podstaw struktur

państwowych. Efekty owych procesów są zróżnicowane, co znalazło swoje odzwierciedlenie również w częstotliwości występowania upadłości państw. Nie wszystkie kraje, które uzyskały autonomiczną władzę, potrafiły zbudować sprawny i stabilny system gwarantujący możliwość utrzymania faktycznej kontroli nad swoim terytorium.

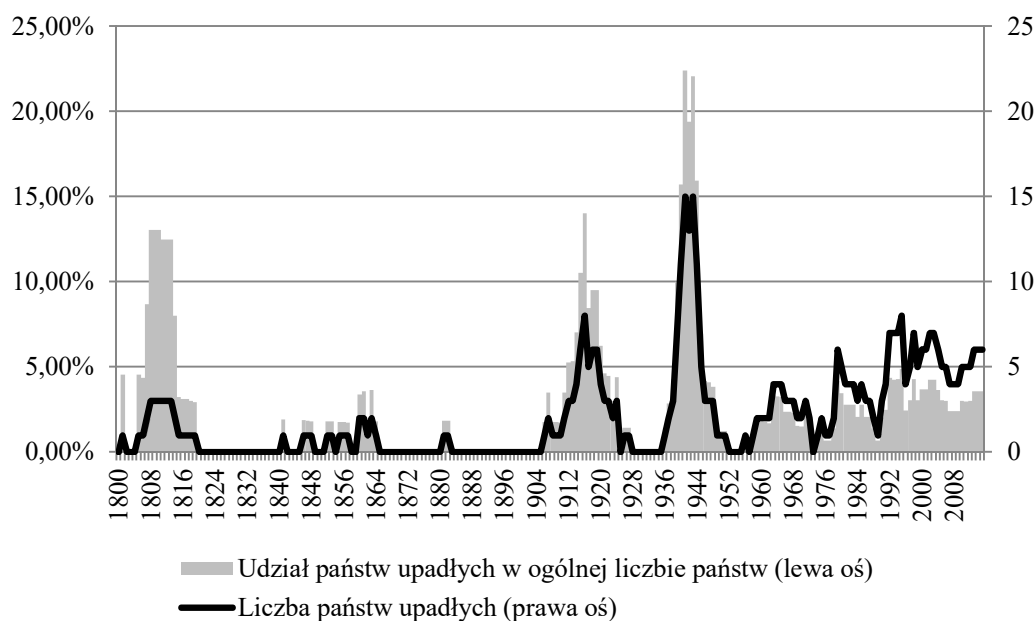
Zgodnie z metodologią *Center for Systemic Peace*, państwa, których instytucje nie funkcjonują prawidłowo podzielić można na trzy grupy:

- państwa w czasie transformacji ustrojowej,
- państwa, które utraciły kontrolę nad swoim terytorium na skutek interwencji zewnętrznej,
- państwa, w których władza centralna przejściowo lub stale nie sprawuje realnej kontroli nad swoim terytorium – określane również mianem anarchii lub bezkrólewia - *interregnum*.

Skalę występowania państw upadłych (tj. tych, w których władza utraciła zdolność do sprawowania kontroli nad swoim terytorium)⁸⁵ w latach 1800-2015 przedstawiono na Wykresie 2. Zaprezentowano łączną liczbę państw upadłych o ludności powyżej 0,5 mln, a także procentowy udział takich państw w ogólnej liczbie państw na świecie.

Występowanie państw upadłych w latach 1800-2015 można podzielić na trzy okresy: bardzo niskiej lub zerowej częstotliwości upadłości państw (do początku XX wieku), dużej dynamiki zmian (tj. gwałtownego wzrostu i późniejszego spadku) w czasie obu wojen światowych, a także permanentnego utrzymywania się upadłości po zakończeniu drugiej wojny światowej.

⁸⁵ Opisane kryterium identyfikacji państw upadłych zastosowano także w: Iqbal, Star [2007].



Wykres 2. Skala występowania zjawiska upadłości państw w latach 1800-2015

Uwaga: Uwzględniono państwa o ludności powyżej 0,5 mln.

źródło: opracowanie własne na podstawie *Center for Systemic Peace*.

Zaznaczyć należy, iż czas ciągłego występowania państw upadłych od lat 60. ubiegłego wieku jest stanem, który nie ma precedensu w analizowanym okresie. Naturalnym wydaje się więc postawienie pytania o uwarunkowania zaobserwowanej zmiany. Z uwagi na fakt, iż okres lat 60. XX wieku jest przełomowy pod względem tworzenia się nowych państw oraz stanowi początek okresu permanentnego występowania państw upadłych, w analizie czynników zwiększających zagrożenie upadłością uwzględniono wszystkie państwa utworzone w 1960 roku lub później. Zakres czasowy prowadzonego badania jest zróżnicowany dla poszczególnych państw i obejmuje lata od jego utworzenia do wystąpienia upadłości lub do 2015 roku, jeśli upadłość nie wystąpiła.

Przyjęcie wymienionych kryteriów pozwoliło na wyodrębnienie grupy 77 państw, które zostały poddane badaniu. Wśród nich zidentyfikowano 17 państw upadłych, tj. takich, w których upadłość zanotowano w co najmniej jednym roku oraz 60 państw nieupadłych. Pełna lista państw, wraz z oznaczonym horyzontem czasowym, znajduje się w Tabelach 5 i 6. Na Rysunku 3 zaprezentowano mapę świata z zaznaczonymi państwami (z podziałem na upadłe oraz nieupadłe), które zostały objęte badaniem.

Tabela 5. Lista państw upadłych utworzonych w 1960 roku i później

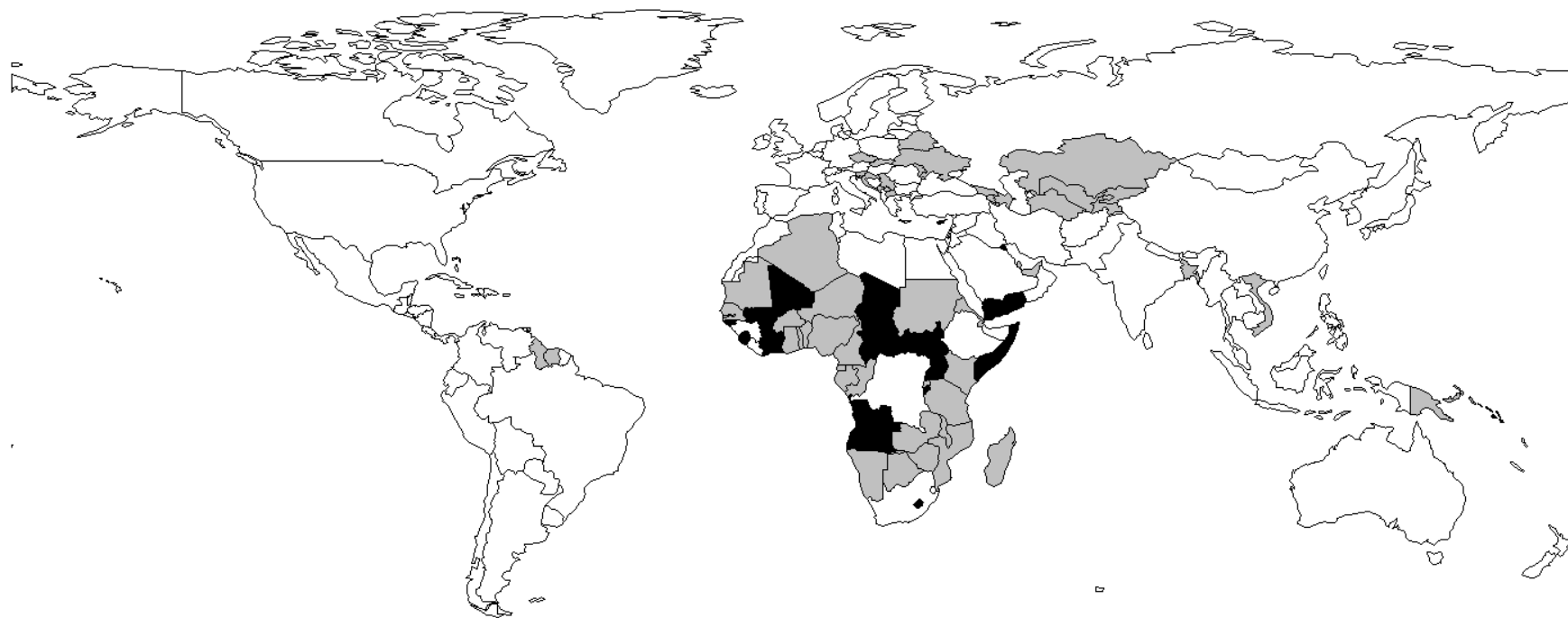
Kraj	Zakres czasowy badania	Bezpośrednia przyczyna upadłości
Angola	1975 - 1992	Czasowa utrata kontroli nad terytorium w czasie transformacji ustrojowej na skutek walk zbrojnych.
Burundi	1962 - 1993	Wybuch wojny domowej po zamachu stanu.
Cypr	1960 - 1963	Wybuch wojny z Turcją.
Czad	1960 - 1979	Wybuch wojny domowej.
Gwinea Bissau	1974 - 1998	Wybuch wojny domowej.
Jemen	1990 - 2014	Wybuch wojny domowej.
Komory	1975 - 1995	Zamach stanu oraz walki zbrojne.
Kuwejt	1963 - 1990	Inwazja Iraku na Kuwejt oraz zamach stanu.
Lesoto	1966 - 1998	Pucz po wyborach parlamentarnych i zbrojna interwencja RPA, Botswany.
Mali	1960 - 2012	Utrata kontroli nad częścią terytorium państwa na skutek jednostronnego ogłoszenia niepodległości przez Narodowy Ruch Wyzwolenia Azawadu (nieuznanego przez rząd Mali oraz społeczność międzynarodową).
Republika Środkowoafrykańska	1960 - 2013	Wybuch wojny domowej oraz wojskowa interwencja Francji.
Sierra Leone	1961 - 1997	Zamach stanu oraz wybuch zbrojnego konfliktu wewnętrznego.
Somalia	1960 - 1991	Wybuch wojny domowej oraz utrata kontroli nad niemal całym terytorium.
Sudan Południowy	2011 - 2013	Nieudany zamach stanu, który przerodził się w zbrojny konflikt wewnętrzny.
Uganda	1962 - 1979	Wybuch wojny domowej oraz zajęcie części terytorium przez Tanzanię.
Wybrzeże Kości Słoniowej	1960 - 2002	Nieudany zamach stanu skutkujący wybuchem wojny domowej.
Wyspy Salomona	1978 - 2000	Zamach stanu, w konsekwencji którego interweniowały międzynarodowe siły pokojowe.

źródło: opracowanie własne na podstawie *Center for Systemic Peace*.

Tabela 6. Lista państw nieupadłych utworzonych w 1960 roku i później

Kraj	Zakres czasowy badania	Kraj	Zakres czasowy badania
Algieria	1962 - 2015	Malawi	1964 - 2015
Armenia	1991 - 2015	Mauretania	1960 - 2015
Azerbejdżan	1991 - 2015	Mauritius	1968 - 2015
Bahrajn	1971 - 2015	Mołdawia	1991 - 2015
Bangladesz	1972 - 2015	Mozambik	1975 - 2015
Benin	1960 - 2015	Namibia	1990 - 2015
Białoruś	1991 - 2015	Niger	1960 - 2015
Botswana	1966 - 2015	Nigeria	1960 - 2015
Burkina Faso	1960 - 2015	Papua Nowa Gwinea	1975 - 2015
Chorwacja	1991 - 2015	Republika Zielonego Przylądka	1975 - 2015
Czarnogóra	2006 - 2015	Ruanda	1961 - 2015
Czechy	1993 - 2015	Senegal	1960 - 2015
Dżibuti	1977 - 2015	Serbia i Czarnogóra	2003 - 2006
Erytrea	1993 - 2015	Słowacja	1993 - 2015
Fidżi	1970 - 2015	Słowenia	1991 - 2015
Gabon	1960 - 2015	Suazi	1968 - 2015
Gambia	1965 - 2015	Sudan	2011 - 2015
Ghana	1960 - 2015	Surinam	1975 - 2015
Gruzja	1991 - 2015	Tadżykistan	1991 - 2015
Gujana	1966 - 2015	Tanzania	1961 - 2015
Gwinea Równikowa	1968 - 2015	Timor Wschodni	2002 - 2015
Kamerun	1960 - 2015	Togo	1960 - 2015
Katar	1971 - 2015	Trinidad i Tobago	1962 - 2015
Kazachstan	1991 - 2015	Turkmenistan	1991 - 2015
Kenia	1963 - 2015	Ukraina	1991 - 2015
Kirgistan	1991 - 2015	Uzbekistan	1991 - 2015
Kongo (Brazzaville)	1960 - 2015	Wietnam	1976 - 2015
Kosowo	2008 - 2015	Zambia	1964 - 2015
Macedonia	1991 - 2015	Zimbabwe	1970 - 2015
Madagaskar	1960 - 2015	Zjednoczone Emiraty Arabskie	1971 - 2015

źródło: opracowanie własne na podstawie *Center for Systemic Peace*.



Rysunek 3. Mapa świata z zaznaczonymi państwami objętymi badaniem

Uwaga: Czarnym kolorem oznaczono państwa upadłe poddane badaniu, szarym – państwa nieupadłe poddane badaniu, a białym – państwa, które nie zostały poddane badaniu.

Źródło: opracowanie własne na podstawie *Center for Systemic Peace*.

W nawiązaniu do koncepcji teoretycznych zaprezentowanych w Rozdziale 1. oraz przeglądu literatury przedstawionym w Rozdziale 2., w niniejszej części zostanie poddany badaniu liczny zestaw zmiennych. W pierwszej kolejności przeprowadzona zostanie analiza ekonomicznych determinant upadłości państwa, wśród których wymienić należy:

- początkowy PKB per capita,
- średni PKB per capita w badanym okresie,
- średnie tempo wzrostu gospodarczego,
- średni udział importu w PKB,
- średni udział eksportu w PKB.

Drugą grupę uwarunkowań, które zostaną poddane badaniu, stanowią czynniki o charakterze politycznym. Należą do nich:

- system polityczny, który ukształtował się w pierwszym roku istnienia państwa,
- system polityczny w ostatnim roku badania,
- przeszłość kolonialna (określenie, czy badane państwo było w przeszłości kolonią innego państwa, a jeśli tak, to którego).

Ostatnią grupę stanowią następujące determinanty:

- sposób uzyskania niepodległości (w tym: formowanie państwa, dekolonizacja, secesja oraz podział państwa),
- występowanie zagrożenia klątwą surowcową,
- dominująca religia (katolicyzm, islam, prawosławie, protestantyzm, hinduizm oraz inne, w tym lokalne i ludowe wierzenia)

W Tabeli 7. zawarto podział zmiennych ze względu na typ (ekonomiczne, polityczne, pozostałe), pełną nazwę zmiennej oraz jej skróconą wersję wykorzystywaną w ekonometrycznej części badania, opis zmiennej wraz z przyjmowanymi wartościami oraz źródło.

Do podziału zmiennych na przedziały wykorzystano oprogramowanie IBM SPSS Statistics 23.0.0 (licencja dostarczona przez Uniwersytet Ekonomiczny w Poznaniu), pozostałe obliczenia zaś za pomocą programu Statistica 12 (nr seryjny licencji: JPZP507D692014AR-Z). Wszystkie wartości zmiennych są aktualne na dzień 18 lipca 2016 roku.

Tabela 7. Opis zmiennych wykorzystanych w badaniu

Typ zmiennej	Nazwa zmiennej	Oznaczenie zmiennej	Opis	Źródło
Ekonomiczna	początkowy PKB per capita	wdi_pkbpc_pocz	produkt krajowy brutto (liczony jako suma wartości dodanej plus podatki minus subsydia) podzielony przez liczbę mieszkańców w połowie roku wyrażony w cenach stałych (dolary amerykańskie z 2010 roku)	Bank Światowy, World Development Indicators
	średni PKB per capita	wdi_pkbpc_sr		
	średnie tempo wzrostu gospodarczego	wdi_pkbpc_wz_sr	średnie tempo wzrostu gospodarczego w całym okresie badawczym, liczone jako średnia procentowa zmiana produktu krajowego brutto na mieszkańca	
	średni udział importu w PKB	import_sr	średnia relacja wartości dóbr importowanych do PKB w całym okresie badawczym	
	średni udział eksportu w PKB	eksport_sr	średnia relacja wartości dóbr eksportowanych do PKB w całym okresie badawczym	
Polityczna	początkowy system polityczny	sys_pol_pocz	system polityczny oceniany w skali od -10 do +10, gdzie -10 oznacza, iż system polityczny ma cechy wyłącznie autorytarne, a +10 cechy w pełni demokratyczne	Center for Systemic Peace, Polity IV Project (Political Regime Characteristics and Transitions)
	końcowy system polityczny	sys_pol_konc		
	przeszłość kolonialna	kolonia	zmienna określająca, czy państwo było w przeszłości kolonią innego państwa, a jeśli tak, to którego z wymienionych: Wielkiej Brytanii, Francji, Portugalii, Belgii, Hiszpanii, Włoch Jako kolonizatora rozumie się państwo lub imperium, które było odpowiedzialne za ukształtowanie państwa i jego rozwój, zanim stało się ono niepodległe.	Issue Correlates of War Project

Typ zmiennej	Nazwa zmiennej	Oznaczenie zmiennej	Opis	Źródło
Pozostałe	sposób uzyskania niepodległości	typ_niepodleglosc	zmienna określająca sposób uzyskania niepodległości przez państwo przyjmująca wartości: (1) formowanie państwa, rozumiane jako powstanie niezależnego państwa na bazie innego państwa lub połączenia grup plemiennych, (2) dekolonizacja, rozumiana jako ustąpienie stosunku kolonialnego, tj. ustanie sprawowania pełnej kontroli nad państwem przez inne państwo (do tej grupy należą obok „tradycyjnych” kolonii także protektoraty, czy państwa wchodzące w skład imperium), (3) secesja – ustanowienie na części terytorium państwa nowego, niepodległego państwa w sytuacji, gdy państwo pierwotnie zarządzające terytorium nie przestało istnieć lub przekształciło się w inne, (4) podział państwa – ustanowienie na całym terytorium kilku nowych państw w sytuacji, gdy państwo pierwotnie zarządzające terytorium przestało istnieć.	
	występowanie zagrożenia kłatwą surowcową	klatwa_surowce	występowanie zagrożeniem kłatwą surowcową, tj. sytuacji w której średnioroczne dochody branży wydobywczej przekraczają 25% PKB lub ponad 25% średniorocznego eksportu stanowią surowce	Sialitskaya [2013]
	dominująca religia	religia	określenie, która religia spośród wymienionych wyznawana jest przez większość społeczeństwa: katolicyzm, islam, prawosławie, protestantyzm, hinduizm, inna (w tym lokalne i ludowe wierzenia)	World Religion Dataset, National Religion Dataset The World Factbook

Źródło: opracowanie własne.

W celu zidentyfikowania czynników, które w sposób istotny statystycznie wpływają na prawdopodobieństwo upadłości państw, należy posłużyć się modelem z binarną zmienną zależną. W badanej grupie państw znajdują się cztery typy państw:

- państwa upadłe, które obecnie nie istnieją,
- państwa, które doświadczyły upadłości, jednakże wciąż istnieją,
- państwa, które nie doświadczyły upadłości, a już nie istnieją,
- państwa, które nie doświadczyły upadłości i wciąż istnieją.

Dla większości państw nie jest więc możliwe ostateczne określenie ich statusu— z faktu, iż do tej pory nie odnotowano upadłości nie wynika, iż owa upadłość nigdy nie nastąpi. Zróznicowany jest również horyzont czasowy badań dla poszczególnych krajów ze względu na odmienne lata utworzenia państwa i jego ewentualnej upadłości. Wymienione aspekty nie stanowią problemu, gdy w badaniu wykorzystana zostaje tzw. analiza przeżycia (ang. *survival analysis*). Termin ten nie jest precyzyjnie zdefiniowany [Miller, Gong, Muñoz 1981, s. 1], jednakże w ogólnym podejściu analizę przeżycia traktuje się jako typ analizy danych związanych z czasem, który upływa od stricte określonego momentu początkowego do wystąpienia konkretnego zdarzenia opisywanego jako moment końcowy [Collett 2004, s. 1]. Początkowo analiza przeżycia stosowana była głównie w naukach medycznych jako źródło informacji na temat wpływu określonych czynników na przeżywalność osobników. Stopniowo zaczęto wykorzystywać ją także w naukach technicznych (występujące warianty to np. analiza niezawodności oraz rozkład czasów życia obiektów), a także częściowo w naukach społecznych, w tym ekonomicznych [Balicki 2006, s. 20-25]⁸⁶. Zasadne jest więc zastosowanie opisanej metody analizy danych do sprawdzania czynników wpływających na ewentualne wystąpienie upadłości państwa.

Kluczowy podział w analizie przeżycia sprowadza się do różnicowania tzw. „obserwacji uciętych” (tj. takich, co do których nie ma pewności jak zakończy się proces) i tzw. „obserwacji kompletnych”, tj. takich, w których owa pewność jest. W badaniu państw upadłych obserwacjami uciętymi nazywa się więc te obserwacje, dla których nie odnotowano upadłości w badanym okresie. Obserwacja jest więc niejako ucinana w ostatnim roku badania. Obserwacje kompletne to z kolei obserwacje, w

⁸⁶ Na przykład Santarelli [2000] poszukuje odpowiedzi na pytanie o czynniki różnicujące prawdopodobieństwo przetrwania firm, biorąc pod uwagę szereg zmiennych o charakterze mikro- i makroekonomicznym.

których jest pewność jak zakończył się proces (tj. czy i kiedy wystąpiła upadłość państwa). Jest ona kompletna, ponieważ można określić rok rozpoczęcia (rok utworzenia państwa) oraz zakończenia obserwacji (pierwszy rok upadłości lub rok, w którym państwo przestało istnieć). Odnosząc się do prezentowanego badania, państwo „przeżywa”, gdy w analizowanym horyzoncie czasowym nie nastąpi jego upadłość.

W przygotowanym badaniu wykorzystano najważniejsze elementy analizy przeżycia z uwagi na realizację głównego celu rozprawy, jakim jest ocena głównych przyczyn upadłości państwa ze szczególnym uwzględnieniem czynników ekonomicznych i politycznych. Dla poszczególnych zmiennych procedura badawcza obejmuje kolejno:

- stworzenie tablicy przeżycia pozwalającej określić liczbę państw upadłych oraz nieupadłych według wybranego kryterium podziału,
- utworzenie krzywych prawdopodobieństwa upadłości (na podstawie krzywych przeżycia⁸⁷) ze względu na wartości badanej zmiennej z wykorzystaniem estymatora Kaplana-Meiera [1958]⁸⁸,
- sformułowanie najważniejszych wniosków.

Z uwagi na fakt, iż graficzne i tabelaryczne przedstawienie zależności prawdopodobieństwa wystąpienia upadłości państwa od czasu oraz przyjmowanych wartości przez zmienną ciągłą jest nieczytelne, wszystkie zmienne ciągłe zostały poddane kategoryzacji i podzielono je na 4 grupy. Podziału dokonano niezależnie od siebie ze względu na odchylenie standardowe oraz liczebność przedziałów.

Kategoryzacja ze względu na odchylenie standardowe pozwala utworzyć cztery grupy, przyjmujące następujące wartości:

- 1 - dla pierwotnych wartości mniejszych o więcej niż jedno odchylenie standardowe od średniej,
- 2 - dla pierwotnych wartości mniejszych o nie więcej niż jedno odchylenie standardowe od średniej,
- 3 - dla wartości większych maksymalnie o jedno odchylenie standardowe od średniej,

⁸⁷ Prawdopodobieństwo upadłości wynosi $p=1-u$, gdzie u – estymowane prawdopodobieństwo przeżycia na podstawie funkcji przeżycia i estymatora Kaplana-Meiera.

⁸⁸ Wykorzystanie estymatora Kaplana-Meiera sugerowane w: Kalbfleisch, Prentice [1980, s. 10-15].

- 4 - wartości większe od średniej o ponad jedno odchylenie standardowe.

Kategoryzacji ze względu na liczebność przedziałów dokonano tak, aby utworzyć cztery grupy (analogicznie jak przy kategoryzacji ze względu na odchylenie standardowe) zawierające możliwie taką samą liczbę obserwacji. Utworzone grupy również przyjmują wartości z zakresu 1-4, gdzie 1 oznacza grupę z 25% najmniejszych wartości, zaś 4 grupę z 25% najwyższych wartości. W przypadku, gdy zmienna źródłowa zawiera względnie dużą liczbę obserwacji o tych samych wartościach możliwe jest uzyskanie mniejszej liczby przedziałów. Jeśli zaś w punkcie podziału znajduje się wiele takich samych wartości, wszystkie obserwacje zostaną umieszczone w jednym przedziale, co z kolei może skutkować faktem, iż finalnie otrzymane przedziały nie będą równe. Również występujące braki danych zaburzają proces podziału zmiennej ciągłej. W przypadkach, gdy podział ze względu na odchylenie standardowe powoduje wyodrębnienie jednej bardzo licznej grupy oraz pozostałych o niewielkiej liczbie obserwacji, do analizy wybrano jedynie podział gwarantujący względnie równą liczebność przedziałów.

Podział państw do grup ze względu na przyjmowane wartości został zaprezentowany w Aneksie 2.

3.2. Analiza przeżywalności państw

3.2.1. Determinanty ekonomiczne

Wśród czynników ekonomicznych potencjalnie mogących mieć wpływ na upadłość państwa wyróżnić należy przede wszystkim produkt krajowy brutto na mieszkańca, średnią stopę wzrostu gospodarczego, wielkość importu i eksportu.

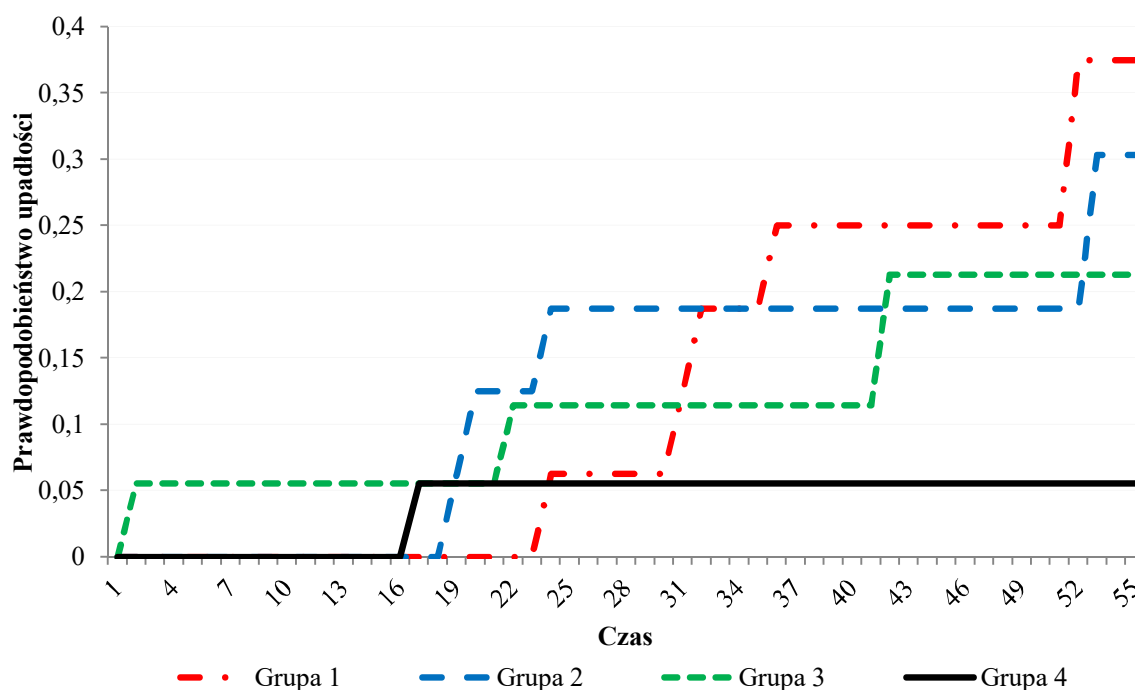
Rozkład produktu krajowego brutto per capita (zarówno wartości początkowej, jak i średniej dla całego okresu badawczego) jest niesymetryczny. Zdecydowana większość państw (ponad 65%) mieści się w przedziale pomiędzy wartością średnią i minus jednym odchyleniem standardowym. Jest to spowodowane występowaniem kilku obserwacji odstających, dla których PKB per capita znacznie przekracza 20000 USD\$ w cenach z 2010 roku. Do tej grupy obserwacji należą: Bahrajn, Katar oraz Zjednoczone Emiraty Arabskie. Zasadne jest więc dokonanie analizy jedynie na podstawie podziału gwarantującego równą liczebność przedziałów.

Tabela 8. Tablica przeżycia ze względu na początkowy PKB per capita

Zmienna: początkowy PKB per capita (wdi_pkbpc_pocz)					
Kryterium podziału	Przyjmowane wartości	Zakres	Państwa upadłe	Państwa nieupadłe	SUMA
równe percentyle	1	$\leq 520,40$	5 (29,4%)	12 (70,6%)	17
	2	$(520,4 ; 1100,19>$	4 (23,5%)	13 (76,5%)	17
	3	$(1100,19 ; 2802,22)$	3 (16,7%)	15 (83,3%)	18
	4	$\geq 2802,22$	1 (4,8%)	20 (95,2%)	21
	b/d		4 (100%)	0	4
	SUMA			17 (22,1%)	60 (77,9%)

Źródło: opracowanie własne.

W Tabeli 8. zaprezentowano liczebności grup ze względu na skategoryzowaną wielkość PKB per capita w pierwszym roku po utworzeniu państwa, a także jego status (upadłe lub nieupadłe). W przypadku braku obserwacji w danym roku, do analizy wybrano rok następny itd. Wyniki jednoznacznie wskazują, iż państwa o niższym poziomie PKB per capita doświadczały upadłości relatywnie częściej, niż państwa bogatsze. Zależność ta występuje dla wszystkich wyróżnionych grup dochodowych. W przypadku czterech państw (Cypr, Kuwejt, Somalia, Uganda) występują braki danych, tj. w całym okresie badawczym nie zanotowano żadnej wartości badanej zmiennej. Wszystkie te państwa doświadczyły upadłości.



Wykres 3. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od pocz. PKB per capita

Źródło: opracowanie własne.

Przeprowadzona analiza przeżycia wykazała, iż występuje znacznie zróżnicowanie pomiędzy grupami dochodowymi. Państwa o najwyższym inicjalnym poziomie PKB per capita upadają najrzadziej, a ich prawdopodobieństwo ich upadłości w ciągu 55 lat (długość horyzontu czasowego badania) wynosi 5%. Znacznie wyższym prawdopodobieństwem upadłości charakteryzują się państwa biedniejsze (37,5% dla grupy pierwszej oraz 30% dla grupy drugiej). Interesujące jest jednak, iż wszystkie państwa z pierwszej grupy nie doświadczały upadłości przez pierwsze 24 lata swojego istnienia, a po tym czasie zagrożenie upadłością gwałtownie wzrasta.

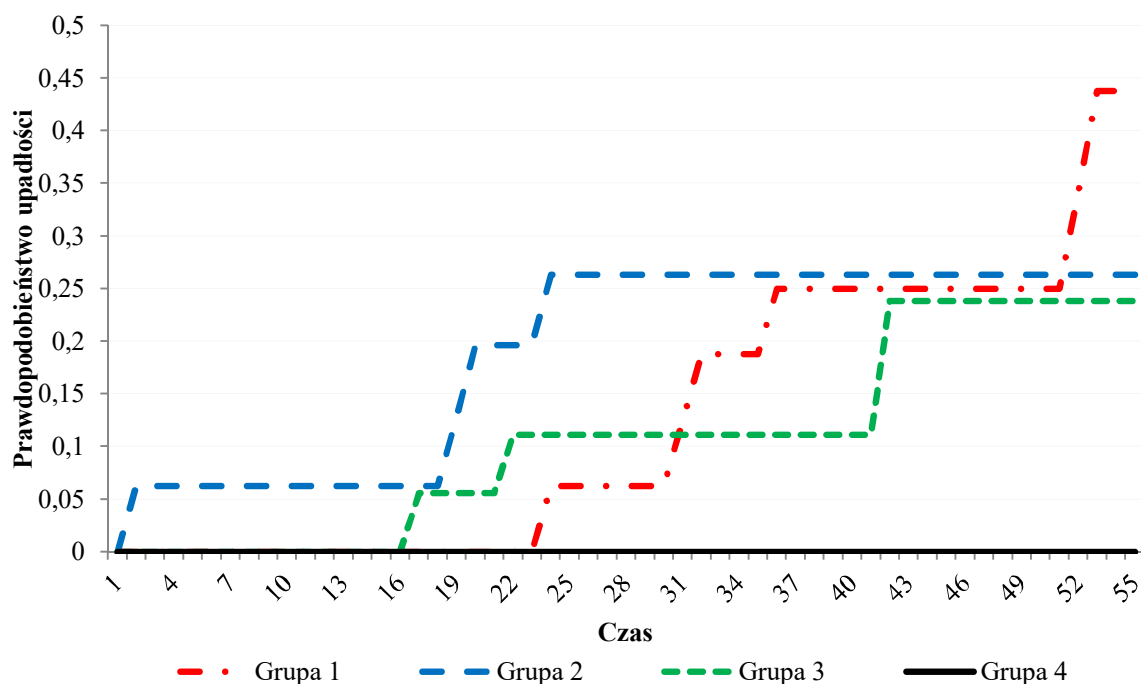
Kolejną zmienną opisującą sytuację ekonomiczną badanych państw jest średni PKB per capita w całym horyzoncie czasowym. Podobnie jak w przypadku początkowego produktu krajowego brutto na mieszkańca, rozkład jest niesymetryczny, więc do analizy wybrano państwa skategoryzowane tak, aby liczebność przedziałów była zbliżona.

Tabela 9. Tablica przeżycia ze względu na średni PKB per capita

Zmienna: średni PKB per capita (wdi_pkbpc_sr)					
Kryterium podziału	Przyjmowane wartości	Zakres	Państwa upadłe	Państwa nieupadłe	SUMA
równe percentyle	1	$\leq 619,69$	6 (35,3%)	11 (64,7%)	17
	2	$(619,69 ; 1235,42>$	4 (25%)	12 (75%)	16
	3	$(1235,42 ; 3573,23)$	3 (15%)	17 (85%)	20
	4	$\geq 3573,23$	0	20 (100%)	20
	b/d		4 (100%)	0	4
	SUMA			17 (22,1%)	60 (77,9%)

Zródło: opracowanie własne.

Wnioski płynące z tablicy przeżycia (por. Tabela 9) są analogiczne do konkluzji wynikających z analizy początkowych poziomów PKB per capita. Różnice pomiędzy poszczególnymi grupami są bardzo wyraźne. Najwięcej państw upadłych zanotowano w grupie najbiedniejszej (upadło 6 z 17 państw, co stanowi 35% grupy), a także w grupie drugiej (upadło 4/16 państw, 25%). Z kolei w grupie dwudziestu najbogatszych państw nie stwierdzono żadnej upadłości.



Wykres 4. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od średniego PKB per capita

Źródło: opracowanie własne.

Z uwagi na fakt, iż żadne państwo należące do najbogatszej grupy nie doświadczyło upadłości, statystyczne prawdopodobieństwo upadłości w całym badanym okresie wynosi 0%. Wraz ze spadkiem średniego poziomu PKB per capita następuje znaczny wzrost zagrożeniem upadłością. Prawdopodobieństwo, iż państwo należące do grupy o najniższych dochodach upadnie w ciągu 55 lat (maksymalny czas wynikający z horyzontu czasowego badania) wynosi aż 44% (dla grupy drugiej jest to 26%, zaś dla grupy trzeciej 24%). Stwierdzić należy zatem, iż wyższy poziom PKB per capita (zarówno wartość średnia, jak i początkowa) sprzyja zwiększeniu prawdopodobieństwa przeżycia państwa, co dowodzi o zasadności wykorzystywania zmiennych ekonomicznych w badaniu.

Ostatnią badaną zmienną powiązaną z PKB per capita jest średnia stopa wzrostu gospodarczego w badanym okresie. Przyjmuje ona zarówno wartości ujemne (w sytuacji gdy początkowy PKB per capita jest wyższy niż końcowy), jak i dodatnie (gdy PKB per capita wzrósł w badanym okresie). Najwyższe średnie stopy wzrostu zanotowano w Gwinei Równikowej (średnio ponad 9% w latach 1968-2015), Serbii i Czarnogórze (6,8% w okresie 2003-2006) oraz Botswanie (5,6% w latach 1966-2015). Żadne z tych państw nie doświadczyło upadłości. W grupie państw o najniższych wartościach średniej stopy wzrostu znalazły się następujące kraje: Sudan Południowy

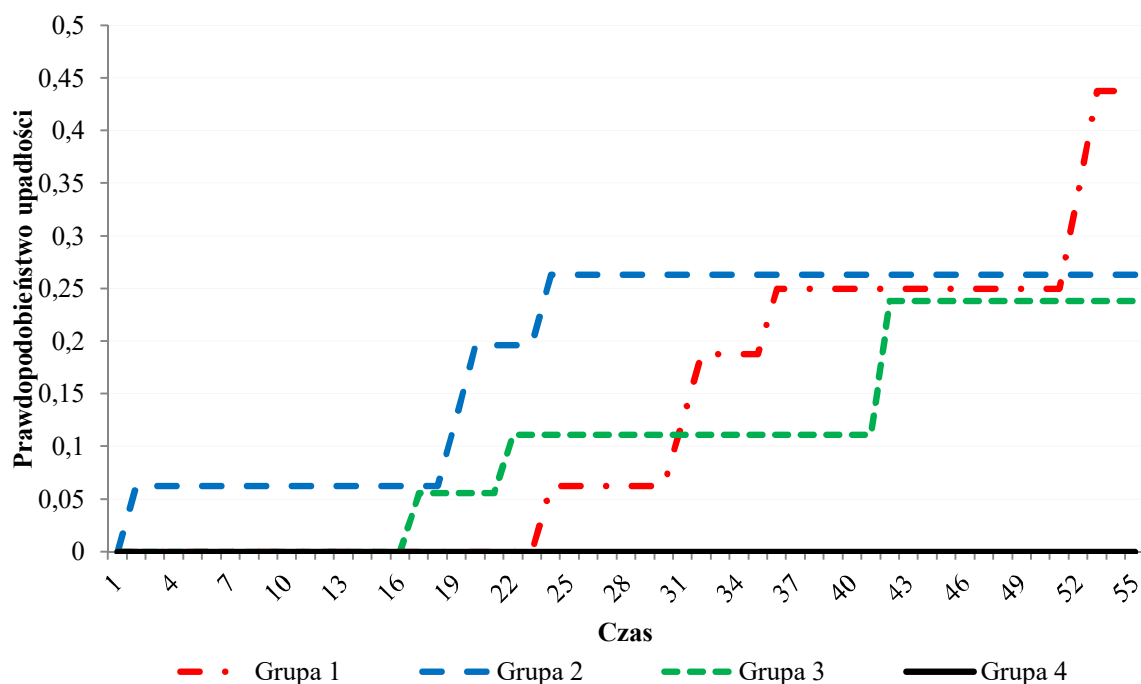
(-48% w latach 2011-2013), Zjednoczone Emiraty Arabskie (-2,4% w okresie 1971-2015) oraz Ukraina (-1% w latach 1991-2015). Rozkład średnich wartości stopy wzrostu jest zbliżony do normalnego, więc w analizie wykorzystano oba kryteria podziału (odchylenie standardowe oraz równe percentyle).

Tabela 10. Tablica przeżycia ze względu na średnią stopę wzrostu PKB per capita

Zmienna: średnia stopa wzrostu gospodarczego (wdi_pkbpc_wz_sr)					
Kryterium podziału	Przyjmowane wartości	Zakres	Państwa upadłe	Państwa nieupadłe	SUMA
odchylenie standardowe	1	$\leq -4,48\%$	1 (100%)	0	1
	2	$(-4,48\% ; 1,14\%>$	7 (25%)	21 (75%)	28
	3	$(1,14\% ; 6,77\%)$	5 (11,9%)	37 (88,1%)	42
	4	$\geq 6,77\%$	0	2 (100%)	2
	b/d		4 (100%)	0	4
	SUMA			17 (22,1%)	60 (77,9%)
równe percentyle	1	$\leq 0,17\%$	7 (36,8%)	12 (63,2%)	19
	2	$(0,17\% ; 1,55\%>$	1 (5,3%)	18 (94,7%)	19
	3	$(1,55\% ; 2,87\%)$	4 (20%)	16 (80%)	20
	4	$\geq 2,87\%$	1 (6,7%)	14 (93,3%)	15
	b/d		4 (100%)	0	4
	SUMA			17 (22,1%)	60 (77,9%)

Zródło: opracowanie własne.

Analiza tablic przeżycia (por. Tabela 10) prowadzi do zbliżonych wniosków przy wykorzystaniu obu kryteriów podziału. Biorąc pod uwagę wartości zmiennej podzielonej zarówno według odchylenia standardowego, jak i równych percentyli, należy stwierdzić, iż średnia stopa wzrostu gospodarczego jest w dużej mierze powiązana w upadaniem państw. Spośród państw notujących niższe przeciętne stopy wzrostu (grupa 1 i 2) upadłości doświadczyło relatywnie więcej państw, niż w przypadku krajów rozwijających się szybciej (grupy 3 i 4).



Wykres 5. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od średniego tempa wzrostu gospodarczego

Uwaga: Państwa podzielono na grupy zgodnie z kryterium równych percentyli.

Źródło: opracowanie własne.

Analiza Wykresu 5. przedstawiającego zależność prawdopodobieństwa wystąpienia upadłości państwa od czasu istnienia państwa prowadzi do sformułowania wniosku o pozytywnym wpływie relatywnie wysokiego tempa wzrostu gospodarczego na obniżanie prawdopodobieństwa upadłości. Przez cały okres badawczy w żadnym kraju z grupy 4 nie zanotowano upadłości. Kraje notujące niższe tempa wzrostu (grupy 1-3) charakteryzują się znacznie wyższym prawdopodobieństwem upadłości w ciągu całego okresu badawczego. Najbardziej zagrożone upadłością w ciągu 55 lat są państwa o najniższych stopach wzrostu gospodarczego (prawdopodobieństwo wynosi 43,8%). Kraje z grupy 2 i 3 upadały w ciągu całego okres badawczego z prawdopodobieństwem wynoszącym ok. 25%. Zestawiając otrzymane wyniki z wnioskami płynącymi z analizy początkowego i średniego poziomu PKB per capita należy stwierdzić, iż czynniki ekonomiczne związane z produkcją w istotny sposób różnicują prawdopodobieństwo upadłości państwa. Kraje relatywnie bogatsze oraz o wyższych stopach średniego wzrostu gospodarczego „przeżywają” częściej, niż kraje biedniejsze i rozwijające się wolniej.

Kolejnym analizowanym aspektem ekonomicznym warunkującym prawdopodobieństwo upadłości państwa jest wymiana handlowa. W badaniu posłużono się wielkością importu w odniesieniu do PKB oraz eksportem w odniesieniu do PKB.

Wartość importu danego kraju w relacji do jego PKB jest jednym z czynników wskazującym powiązania gospodarcze z innymi krajami. Wśród badanych państw najniższym średnim importem charakteryzowały się Zambia (12,33% PKB), Sudan (14,39% PKB), Nigeria (19,2% PKB) oraz Bangladesz (19,49% PKB). Największą wartość importowanych dóbr i usług w relacji do PKB odnotowano w Lesoto (120% PKB), Timorze Wschodnim (102% PKB) oraz Gwinei Równikowej (96,95% PKB). Dla czterech państw zidentyfikowano braki danych, są to Uganda, Somalia, Kuwejt oraz Cypr – wszystkie te kraje należą do grupy państw, które upadły w badanym okresie czasowym.

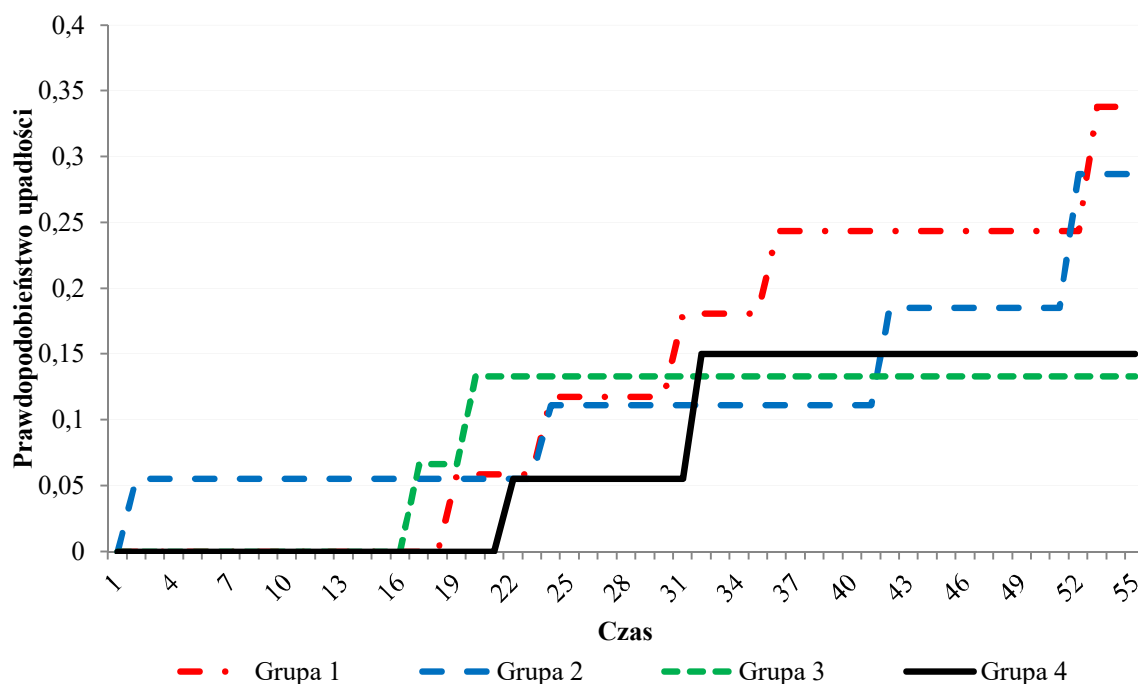
Tabela 11. Tablica przeżycia ze względu na średnią wielkość importu w relacji do PKB

Zmienna: średnia wielkość importu w relacji do PKB (import_sr)					
Kryterium podziału	Przyjmowane wartości	Zakres	Państwa upadłe	Państwa nieupadłe	SUMA
odchylenie standardowe	1	<=24,30%	3 (37,5%)	5 (62,5%)	8
	2	(24,30% ; 44,79%>	7 (22,6%)	24 (77,4%)	31
	3	(44,79% ; 65,26%)	2 (8,3%)	22 (91,7%)	24
	4	>=65,26%	1 (10%)	9 (90%)	10
	b/d		4 (100%)	0	4
	SUMA			17 (22,1%)	60 (77,9%)
równe percentyle	1	<=30,6%	5 (27,8%)	13 (72,2%)	18
	2	(30,6% ; 40,79%>	4 (22,2%)	14 (77,8%)	18
	3	(40,79% ; 55,57%)	2 (11,8%)	15 (88,2%)	17
	4	>=55,57%	2 (10%)	18 (90%)	20
	b/d		4 (100%)	0	4
	SUMA			17 (22,1%)	60 (77,9%)

Źródło: opracowanie własne.

Z uwagi na fakt, iż rozkład badanej zmiennej jest zbliżony do normalnego w tablicy przeżycia przedstawiono oba kryteria podziału (Tabela 11). Jednakże bez względu na wybraną metodą podziału zmiennej, wnioski są podobne. Im wyższa średnia wartość importu w relacji do PKB tym państwa upadały rzadziej. Spośród grup o najniższym poziomie importu upadało 27,8% (grupa 1) oraz 22,2% państw (grupa 2). Zaznaczyć należy równocześnie, iż nawet bardzo wysokie wskaźniki importu nie gwarantowały uniknięcia upadłości. Wśród krajów z grupy charakteryzującej się

najwyższym udziałem sprzedanych dóbr i usług za granicę do wytworzonego produktu krajowego brutto upadły dwa państwa (Lesoto oraz Wyspy Salomona), co stanowiło 10% liczebności grupy 4.



Wykres 6. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od średniej wartości importu

Uwaga: Państwa podzielono na grupy zgodnie z kryterium równych percentyli.

Źródło: opracowanie własne.

Utworzone krzywe prawdopodobieństwa upadłości wyraźnie wskazują na zróżnicowane szanse przeżycia państwa w zależności od wielkości importu. W początkowym okresie istnienia państwa (ok. 30 lat) wartości prawdopodobieństwa są względnie zbliżone, jednakże w późniejszym czasie różnice stają się coraz większe. Finalnie, prawdopodobieństwo upadłości państw o najniższych wskaźnikach importu (grupy 1 i 2) w ciągu całego okresu badania wynosi odpowiednio 29% i 33%, podczas gdy państwa z grup 3 i 4 wykazują znacznie niższe prawdopodobieństwo upadłości (ok. 15%).

Kolejnym analizowanym wskaźnikiem jest wielkość eksportu do PKB. W badanym horyzoncie czasowym najniższe wartości eksportu zanotowano w państwach, które importowały najwięcej, a więc w Timorze Wschodnim (eksport stanowił 7,81% PKB) oraz Sudanie (9,29% PKB). Państwa eksportujące relatywnie najwięcej to: Gwinea Równikowa (99,08% PKB), Bahrajn (77,31% PKB) oraz Słowacja (72,98%). Zaznaczyć należy, iż główne źródło dochodów z tytułu eksportu w Gwinei Równikowej

oraz Bahrajnie stanowi ropa naftowa⁸⁹. Z uwagi na fakt, iż rozkład badanej zmiennej jest zbliżony do normalnego w tablicy przeżycia przedstawiono oba kryteria podziału.

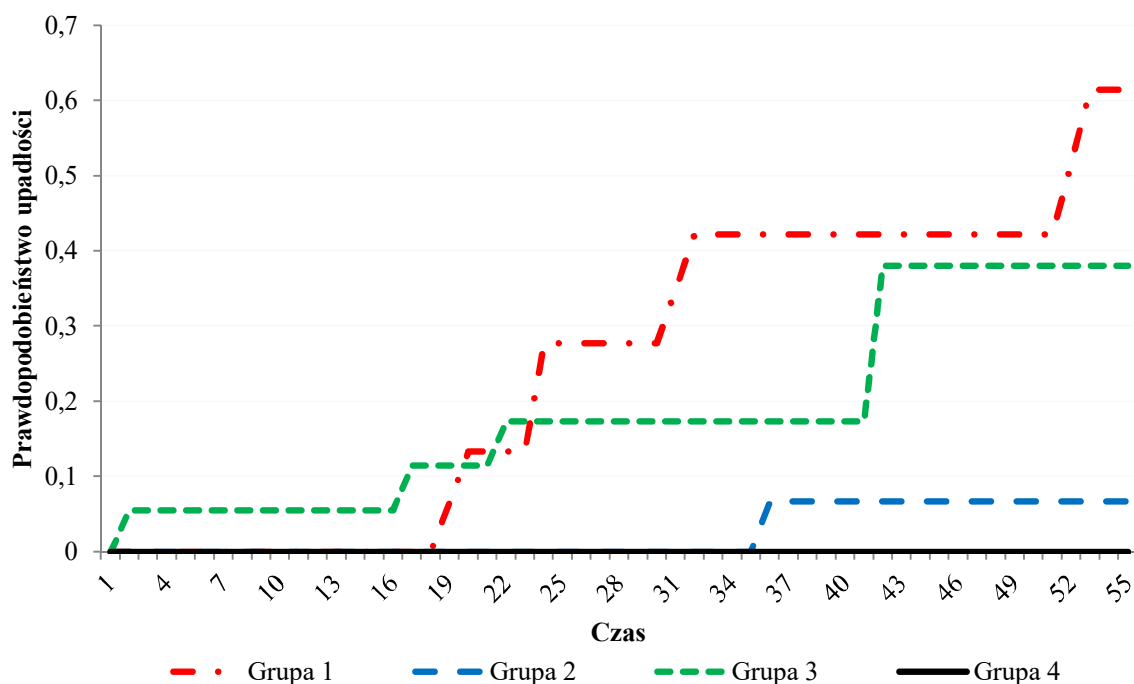
Tabela 12. Tablica przeżycia ze względu na średnią wielkość eksportu w relacji do PKB

Zmienna: średnia wielkość eksportu w relacji do PKB (eksport_sr)					
Kryterium podziału	Przyjmowane wartości	Zakres	Państwa upadłe	Państwa nieupadłe	SUMA
odchylenie standardowe	1	<=16,72%	4 (36,4%)	7 (63,6%)	11
	2	(16,72% ; 35,36%>	5 (17,9%)	23 (82,1%)	28
	3	(35,36% ; 54%)	4 (19%)	17 (81%)	21
	4	>=54%	0	13 (100%)	13
	b/d		4 (100%)	0	4
	SUMA			17 (22,1%)	60 (77,9%)
równe percentyle	1	<-20,47%	8 (44,4%)	10 (55,6%)	18
	2	(20,47% ; 30,74%>	1 (5,3%)	18 (94,7%)	19
	3	(30,74% ; 47,36%)	4 (22,2%)	14 (77,8%)	18
	4	>=47,36%	0	18 (100%)	18
	b/d		4 (100%)	0	4
	SUMA			17 (22,1%)	60 (77,9%)

Zródło: opracowanie własne.

Bez względu na wybrane kryterium podziału zmiennej możliwe jest wskazanie wyraźnej tendencji: państwa o wyższym relatywnym eksporcie upadały rzadziej, niż państwa mniej powiązane gospodarczo z innymi krajami w tym względzie. W grupie 4 (średnia wartość eksportu powyżej 47% PKB) nie zanotowano żadnego państwa doświadczającego upadłości. Wśród państw o gospodarkach najmniej otwartych na eksport upadło z kolei 8 państw, co stanowiło aż 44% całej grupy. Analogicznie do obserwacji dotyczących importu, nie odnotowano żadnych obserwacji dla czterech państw: Ugandy, Somalii, Kuwejt i Cypru. Wszystkie doświadczyły upadłości.

⁸⁹ Szerzej o uzależnieniu państwa od wpływów z tytułu handlu surowcami w rozdziale 2. oraz podrozdziale 3.2.3.



Wykres 7. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od średniej wartości eksportu

Uwaga: Państwa podzielono na grupy zgodnie z kryterium równych percentyli.

Źródło: opracowanie własne.

Zależność prawdopodobieństwa upadłości od czasu trwania państwa nie jest jednoznaczna. Państwa z grupy o najniższym eksporcie upadały zdecydowanie najczęściej, stąd najmniejsza szansa na przeżycie całego okresu badawczego. Prawdopodobieństwo, iż państwo znajdujące się w grupie 1. upadnie w trakcie okresu badawczego wynosi aż 61,5%. Z uwagi na fakt, iż żadne państwo przyporządkowane do grupy 4. nie upadło (por. Tabela 12), prawdopodobieństwo upadłości wynosi 0% bez względu na czas trwania. Wśród państw z grupy 2. i 3. prawdopodobieństwo upadłości w ciągu całego okresu badawczego wynosi odpowiednio 6,7% i 38,02%.

3.2.2. Determinanty polityczne

Do drugiej grupy czynników poddanych analizie należą czynniki polityczne, do których zalicza się system polityczny przyjęty po utworzeniu państwa, system polityczny w ostatnim roku badania i przeszłość kolonialną. System polityczny w określa zasady funkcjonowania społeczeństwa oraz możliwość weryfikacji i ewentualnej zmiany rządzących. Wśród państw, które odzyskały niepodległość w procesie dekolonizacji bardzo istotne znaczenie ma kraj kolonizujący. Kolonizator niejako narzuca kolonom swój system prawny, wyznawane wartości, a także zasady organizowania gospodarczych aspektów działalności społeczeństwa. W przeprowadzonym badaniu porównano, czy przeżywalność państw utworzonych po 1960 roku jest zróżnicowana ze względu na opisane kryteria.

Pierwszym z analizowanych czynników jest system polityczny, który państwo przyjęło w pierwszym roku po jego utworzeniu. Zgodnie z przedstawioną na początku niniejszego rozdziału charakterystyką zmiennych indeks systemu politycznego przyjmuje wartości od -10 (system posiada wszystkie cechy systemu autokratycznego) do +10 (pełna demokracja). Wśród badanych państw można zaobserwować swoistą równowagę. Bez względu na przyjęte kryterium podziału zmiennych, wszystkie grupy są równe pod względem liczebności. Do najbardziej autokratycznych państw w momencie utworzenia (wskaźnik indeksu politycznego równy -10) należą Bahrajn oraz Katar. Wszystkie cechy systemu demokratycznego przyjęły z kolei państwa utworzone po rozpadzie Czechosłowacji. Wśród państw demokratycznych wyróżnić należy także Fidżi, Lesoto, Mauritius oraz Czarnogórę (indeks systemu politycznego równy +9).

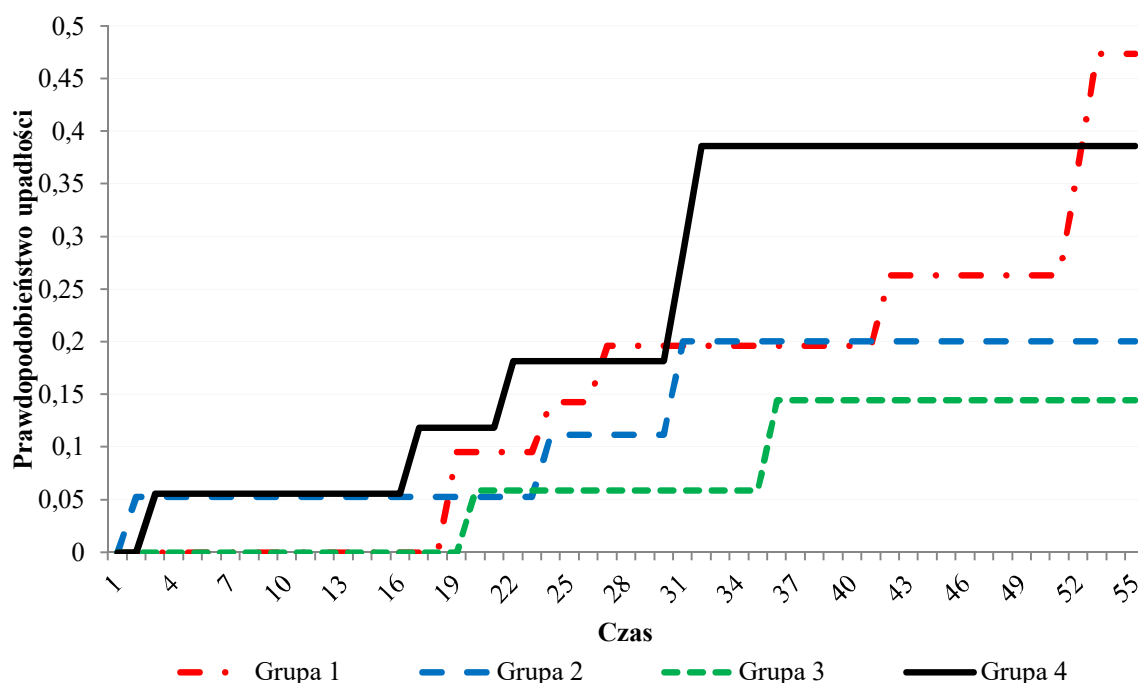
Tabela 13. Tablica przeżycia ze względu na początkowy system polityczny

Zmienna: początkowy system polityczny (sys_pol_pocz)					
Kryterium podziału	Przyjmowane wartości	Zakres	Państwa upadłe	Państwa nieupadłe	SUMA
odchylenie standardowe / równe percentyle	1	<=-7	7 (33,3%)	14 (66,7%)	21
	2	<-6 ; 0>	3 (15,8%)	16 (84,2%)	19
	3	<1 ; 6>	2 (10,5%)	17 (89,5%)	19
	4	>=7	5 (27,8%)	13 (72,2%)	18
	SUMA			17 (22,1%)	60 (77,9%)

Zródło: opracowanie własne.

Na podstawie analizy sporządzonej tablicy przeżycia należy stwierdzić, iż z uwagi na przyjęte kryterium najczęściej upadały kraje o charakterze skrajnie

niedemokratycznym (33,% państw z grupy 1) oraz maksymalnie demokratycznym (27,8% państw z grupy 4). Wśród państw o początkowym systemie politycznym znajdującym się pomiędzy opisanymi skrajnościami częstość upadłości jest niższa nawet o połowę i w grupie 2 i 3 wynosi odpowiednio 15,8% oraz 10,5%. Przyjęcie skrajnie autokratycznego lub demokratycznego systemu politycznego powoduje konieczność nagłego dostosowania systemu prawnego oraz ewentualnej reorganizacji społeczeństwa, co jest szczególnie trudne na początku istnienia państwa z uwagi na jego bardzo niską sprawność instytucjonalną. Jak wskazano w Tabeli 13. państwa należące do grupy 2 i 3 względem badanej zmiennej upadają rzadziej, a więc przyjęcie „nieskrajnego” systemu politycznego jest bardziej zasadne w kontekście przeżywalności państwa i jego ewentualnej upadłości.



Wykres 8. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od początkowego systemu politycznego

Źródło: opracowanie własne.

Zaprezentowany powyżej wykres zawierający krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa ze względu na opisywaną zmienną potwierdzają wnioski płynące z analizy tablic przeżycia. Najwyższym prawdopodobieństwem upadłości w ciągu całego okresu badawczego charakteryzują się państwa skraje autokratyczne (48% dla grupy 1) oraz demokratyczne (39% dla grupy 4). Co istotne, prawdopodobieństwo upadłości w ciągu pierwszych 15 lat jest stosunkowo niskie (poniżej 10%) bez względu na początkowy system polityczny. Kluczowy zdaje się być okres pomiędzy 16. a ok. 30.-

35. rokiem od utworzenia państwa, kiedy obserwować można najmocniejsze spadki prawdopodobieństwa przeżycia. Szanse upadłości w ciągu całego okresu badawczego państw z grupy 2. i 3. są niskie i wynoszą odpowiednio 21% oraz 14%.

Kolejną zmienną, która zdaje się mieć istotne znaczenie w kontekście zagrożenia upadłością państwa jest końcowy system polityczny, rozumiany jako system polityczny w ostatnim roku badania (tj. w ostatnim roku przed upadłością w przypadku państw, które owej upadłości doświadczyły lub w 2015 roku w przypadku państw, które nie przejawiały symptomów upadłości). Po zastosowaniu obu kryteriów podziału należy zaobserwować, iż dzielenie państw ze względu na odchylenie standardowe powoduje utworzenie jednej bardzo licznej grupy (37 państw w grupie 3.), co może prowadzić do błędów w procesie interpretowania otrzymanych wyników. Dokonanie podziału ze względu na równe percentyle pozwoliło utworzyć cztery grupy, dla których możliwe jest zaobserwowanie wyraźnych tendencji w kwestii narażenia na upadłość państwa.

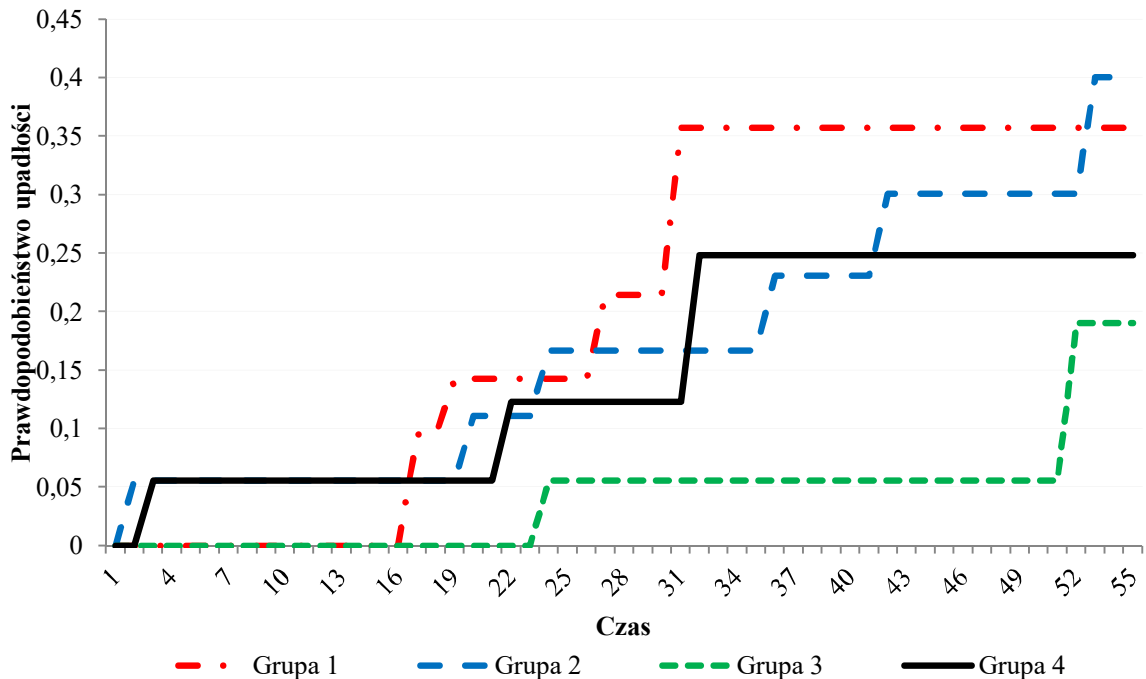
Tabela 14. Tablica przeżycia ze względu na końcowy system polityczny

Zmienna: końcowy system polityczny (sys_pol_konc)					
Kryterium podziału	Przyjmowane wartości	Zakres	Państwa upadłe	Państwa nieupadłe	SUMA
odchylenie standardowe	1	≤ -5	6 (31,6%)	13 (68,4%)	19
	2	$< -4 ; 2 >$	2 (20%)	8 (80%)	10
	3	$< -3 ; 8 >$	9 (24,3%)	28 (75,7%)	37
	4	≥ 9	0	11 (100%)	11
	SUMA			17 (22,1%)	60 (77,9%)
równe percentyle	1	≤ -4	6 (27,3%)	16 (72,7%)	22
	2	$< -3 ; 4 >$	6 (33,3%)	12 (66,7%)	18
	3	$< 5 ; 7 >$	2 (10,5%)	17 (89,5%)	19
	4	≥ 8	3 (16,7%)	15 (83,3%)	18
	SUMA			17 (22,1%)	60 (77,9%)

Zródło: opracowanie własne.

Otrzymane wyniki (por. Tabela 14) wskazują, iż końcowy system polityczny w znacznym stopniu różnicuje zagrożenie upadłością państwa. Analizując rozkład zmiennej przy zastosowaniu podziału na równe percentyle należy stwierdzić, iż kraje należące do grup mniej demokratycznych (tj. grupa 1. i 2.) upadały relatywnie częściej, niż państwa należące do dwóch pozostałych grup. Wśród grupy państw, w których funkcjonuje system polityczny o przeważających cechach autorytarnych, znalazło się 6 państw upadłych, co stanowi 27,3% liczebności całej grupy. W grupie 2., do której

przyporządkowano państwa z systemami politycznymi nieznacznie autorytarnymi oraz demokratycznymi, również upadło 6 państw (33,3% grupy). W grupach wykazujących więcej cech demokratycznych, tj. grupie 3. i 4. odnotowano odpowiednio 2 (10,5% grupy) i 3 (16,7%) państwa upadłe.



Wykres 9. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od systemu politycznego w ostatnim roku badania

Uwaga: Państwa podzielono na grupy zgodnie z kryterium równych percentyli.

Źródło: opracowanie własne.

Przedstawione na Wykresie 9. krzywe prawdopodobieństwa upadłości potwierdzają przedstawione powyżej wnioski. Największe prawdopodobieństwo upadłości państw, w większości analizowanego okresu badawczego, charakteryzuje państwa z grupy 1. oraz 2. Prawdopodobieństwo upadłości w ciągu całego okresu badawczego wynosi odpowiednio 36% oraz 41%, a najniższe przyrosty owego prawdopodobieństwa zaobserwować można pomiędzy 15 a 30-35 rokiem badania. Największą szansą „przeżycia” na przestrzeni horyzontu czasowego cechuje państwa z grupy 3. (wskaźnik systemu politycznego w przedziale od +5 do +7).

Ostatnim badanym czynnikiem politycznym jest przeszłość kolonialna państwa, tj. rozróżnienie czy państwo było kolonią innego państwa, a jeśli tak, to którego. Państwo kolonizujące narzuca system prawny swojej kolonii w celu zabezpieczenia swoich interesów. Pozostałości po obowiązujących przepisach prawnych można odnaleźć na wiele lat po dokonaniu dekolonizacji państwa. Ok. 70% badanych państw

(tj. 54 kraje) ma za sobą przeszłość kolonialną. Wśród badanych państw największą liczbą posiadanych kolonii cechowała się Wielka Brytania (24) oraz Francja (29). Pozostałe kraje mają marginalny udział w procesie kolonizacyjnym, a należą do nich Portugalia (4), Hiszpania (4), Belgia (2) oraz Włochy (1).

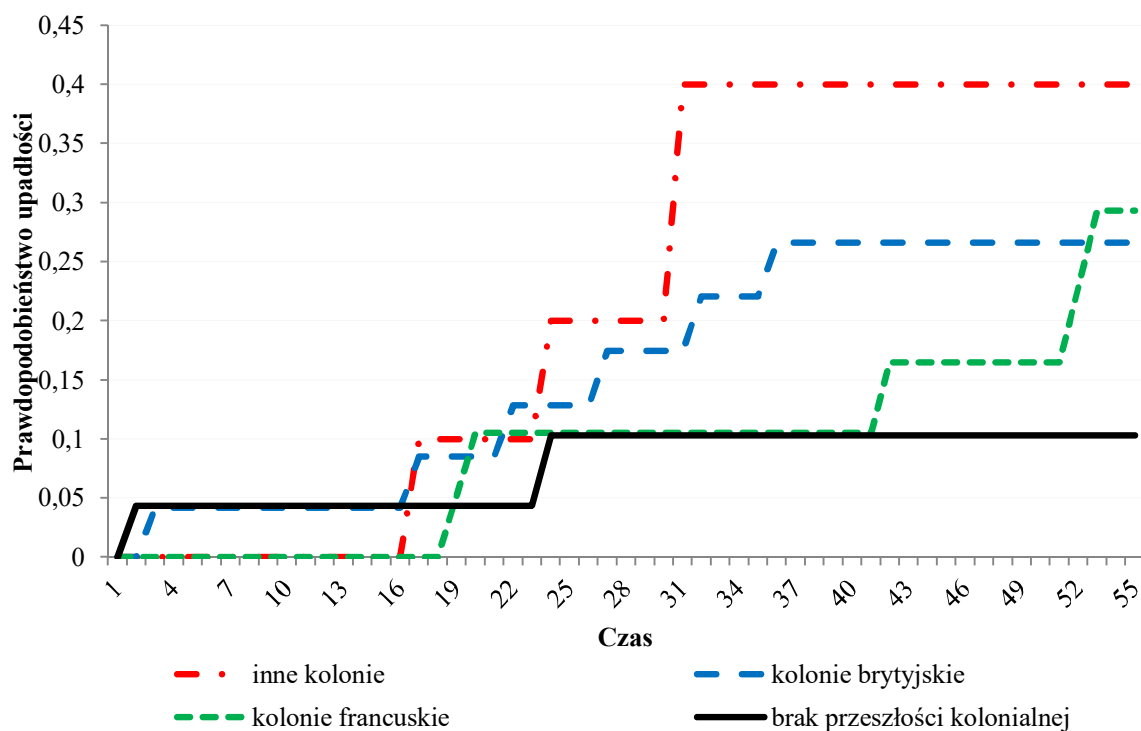
Tabela 15. Tablica przeżycia ze względu na przeszłość kolonialną

Zmienna: przeszłość kolonialna (kolonia)					
Państwo kolonizujące	Państwa upadłe		Państwa nieupadłe		SUMA
Wielka Brytania	6 (25%)	15 (27,8%)	18 (75%)	39 (72,2%)	24
Francja	5 (26,3%)		14 (73,7%)		19
Portugalia	2 (50%)		2 (50%)		4
Belgia	1 (50%)		1 (50%)		2
Hiszpania	0		4 (100%)		4
Włochy	1 (100%)		0		1
brak przeszłości kolonialnej	2 (8,7%)		21 (91,3%)		23
SUMA	17 (22,1%)		60 (77,9%)		77

Zródło: opracowanie własne.

Dane zawarte w znajdującej się powyżej tablicy przeżycia wskazują na znaczną dysproporcję w częstości występowania upadłości państw ze względu na przeszłość kolonialną. Państwa, które uzyskały niepodległość w procesie dekolonizacji, upadały relatywnie częściej (27,8%) niż te, które stały się niezależne na drodze innych przemian (8,7%)⁹⁰. Wśród byłych kolonii upadło względnie najwięcej państw będących wcześniej pod protektorem włoskim (100%) oraz portugalskim i belgijskim (50%), jednakże z uwagi na niewielką ilość obserwacji nie jest możliwe sformułowanie bezspornych wniosków. Były kolonie najbardziej aktywnych państw w procesie kolonizacyjnym, tj. Wielkiej Brytanii i Francji upadały z podobną częstością (ok. 25%) w badanym horyzoncie czasowym.

⁹⁰ Szerzej o zależności pomiędzy przeżywaniem państwa a sposobem uzyskania niepodległości w podrozdziale 3.2.3.



Wykres 10. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od przeszłości kolonialnej

Źródło: opracowanie własne.

Zależność prawdopodobieństwa upadłości państwa od czasu ma charakter względnie stały w całym okresie badawczym. Najmniejsza szansa na przeżycie dotyczy państw przyporządkowanych do grupy „inne kolonie” (tj. były kolonie portugalskie, belgijskie, hiszpańskie oraz włoskie), jednakże z uwagi na jej niską liczebność (10 państw) oraz dużą heterogeniczność, nie jest możliwe wysnuwanie jednoznacznych wniosków. Najniższym prawdopodobieństwem wystąpienia upadłości w trakcie całego okresu badawczego (ok. 10%) cechują się państwa, które nie były koloniami przed odzyskaniem niepodległości. Zagrożenie upadłością jest podobne w przypadku byłych kolonii brytyjskich i francuskich, jednakże państwa będące pod protektorem Wielkiej Brytanii upadały szybciej (znaczące wzrosty zagrożenia upadłością już od 16. roku istnienia państwa), niż zarządzane przez Francję (wzrosty dopiero po 40 latach od odzyskania niepodległości).

3.2.3. Pozostałe determinanty

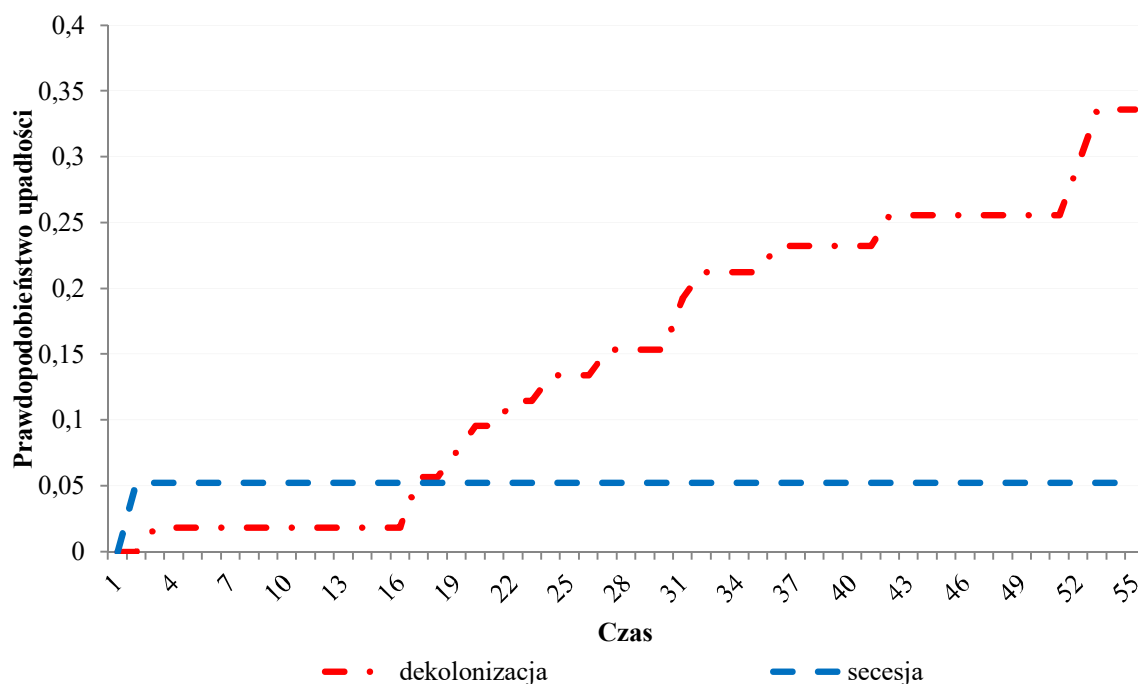
W poprzednich fragmentach rozdziału przedstawiono analizę zależności przeżywalności państw ze względu na zamienne o charakterze ekonomicznym oraz politycznym. W niniejszej części badania zostaną poddane czynnikom o charakterze historycznym, geograficznym oraz kulturowym. Pierwszym z analizowanych czynników jest sposób uzyskania niepodległości przez państwo. Może odbywać się ono w procesie formowania nowego państwa, ustania relacji kolonialnych, secesji lub podziału państwa. Najliczniejszą grupą stanowią państwa pokolonizacyjne (54 państwa z 77 badanych, 70%), a także utworzone na drodze secesji (19/77, 25%). Liczebność pozostałych grup jest znikoma.

Tabela 16. Tablica przeżycia ze względu na sposób uzyskania niepodległości

Zmienna: sposób uzyskania niepodległości (typ_niepodleglosc)					
Sposób uzyskania niepodległości	Państwa upadłe		Państwa nieupadłe		SUMA
Formowanie państwa	1 (100%)	17 (28,8%)	0	59 (71,2%)	1
Dekolonizacja	15 (27,8%)		39 (72,2%)		54
Secesja	1 (5,26%)		18 (94,74%)		19
Podział państwa	0		2 (100%)		2
b/d	0		1 (100%)		1
SUMA	17 (22,1%)		60 (77,9%)		77

Zródło: opracowanie własne.

Jak wspomniano powyżej, jedynie dwie grupy są wystarczająco liczne, aby móc formułować wnioski na podstawie ich obserwacji. Grupa państw, które uzyskały niepodległość w skutek ustania zależności kolonialnych, liczy 54 państwa. Państwa upadłe stanowią 27,8% tej grupy, co oznacza, iż upadło 15 z nich. Pośród państw zyskujących niezależność w drodze secesji upadło tylko 1 z 19 państw, tj. Sudan Południowy. Podział państwa odnotowano jedynie w przypadku Czechosłowacji, a oba państwa utworzone po jej rozpadzie nie doświadczyły upadłości w trakcie okresu badawczego. Formowanie państwa dotyczyło jedynie Jemenu, który upadł w 2014 roku. Zauważyć należy więc, że państwa będące byłymi koloniami upadają relatywnie częściej, niż państwa nie mające przeszłości kolonialnej.



Wykres 11. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od sposobu uzyskania niepodległości

Źródło: opracowanie własne.

Wyprowadzone krzywe prawdopodobieństwa upadłości są silnie skorelowane z przedstawioną wyżej analizą tablic przeżycia. Pośród państw, które uzyskały niepodległość na drodze secesji upadło jedno państwo, stąd zależność prawdopodobieństwa upadłości od czasu jest stała w większości okresu badawczego. Państwa będące byłymi koloniami upadały znacznie częściej, a zwiększone zagrożenie upadkiem można obserwować już od 15. roku istnienia państwa. Prawdopodobieństwo, iż państwo utworzone na drodze dekolonizacji upadnie w ciągu całego okresu badawczego wynosi 34%, podczas gdy państwa utworzone w czasie secesji upadają z prawdopodobieństwem wynoszącym ok. 5%.

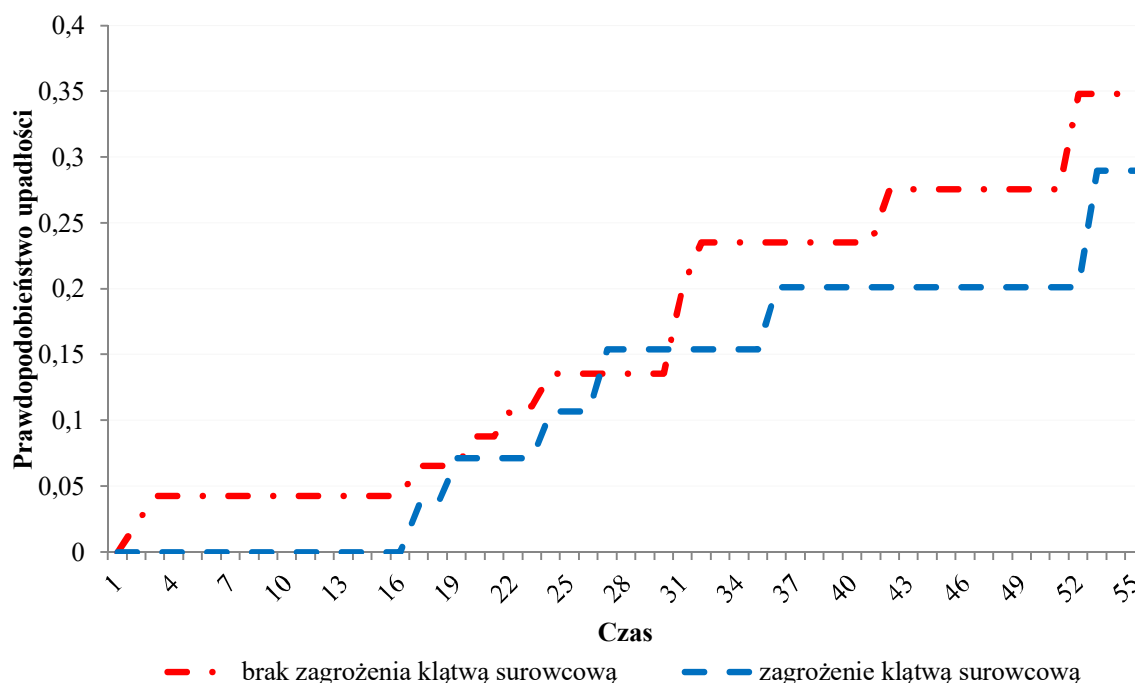
Zagrożenie wystąpieniem klątwy surowcowej jest kolejną zmienną poddaną badaniu. Owa sytuacja występuje, gdy spełniony jest co najmniej jeden warunek: (1) średnioroczne dochody branży wydobywczej przekraczają 25% PKB lub (2) co najmniej 25% średniorocznego eksportu stanowią surowce. Spośród państw objętych analizą 30 z nich jest zagrożonych wystąpieniem klątwy surowcowej, co stanowi 39% badanej grupy.

Tabela 17. Tablica przeżycia ze względu na występowanie zagrożenia kłątą surowcową

Zmienna: zagrożenie kłątą surowcową (klatwa_surowce)			
Występuje zagrożenie kłątą surowcową	Państwa upadłe	Państwa nieupadłe	SUMA
nie	11 (23,4%)	36 (76,6%)	47
tak	6 (20%)	24 (80%)	30
SUMA	17 (22,1%)	60 (77,9%)	77

Źródło: opracowanie własne.

Na podstawie danych zawartych w tablicy przeżycia (por. Tabela 17) należy stwierdzić, iż fakt ewentualnego wystąpienia kławy surowcowej nie różnicuje w znaczący sposób państw zagrożonych oraz niezagrażonych upadłością. Spośród 30 państw zagrożonych kłątą surowcową upadło 6 z nich (20%), podczas gdy w grupie krajów, w których nie występuje owe zagrożenie symptomy upadłości zaobserwowano w 11 z nich (23,4%). Relatywnie częściej upadały więc państwa, gdzie zagrożenie kłątą surowcową nie występuje, jednakże różnica częstości występowania upadłości państwa jest niewielka.



Wykres 12. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od występowania zagrożenia kłątą surowcową

Źródło: opracowanie własne.

Zaprezentowane na wykresie krzywe prawdopodobieństwa upadłości potwierdzają wnioski płynące ze stworzonych tablic przeżycia. Nie jest możliwe określenie wyraźnych różnic pomiędzy grupą państw zagrożonych wystąpieniem klątwy surowcowej oraz grupą państw niezagrożonych. Oznacza to, iż uwarunkowań upadłości państw należy poszukiwać w innych obszarach, niż w zbytnim uzależnieniu gospodarki od wpływów pochodzących z handlu surowcami naturalnymi.

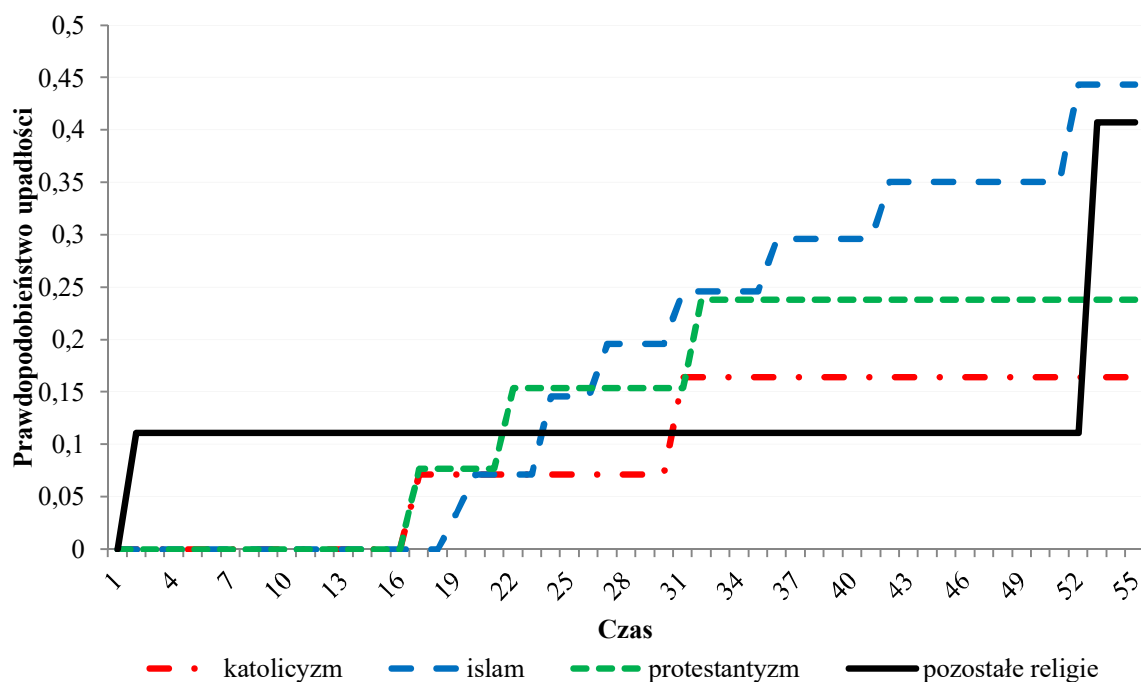
Ostatnią z analizowanych zmiennych jest religia dominująca w danym państwie. Wyznawana religia w istotny sposób determinuje zachowania całej ludności, szczególnie w sytuacji, gdy zdecydowana większość społeczeństwa wyznaje tę samą religię. Pośród 77 państw utworzonych w 1960 roku i później zidentyfikowano 30 z nich, w których dominującą religią jest islam (39%). W 15 państwach wiodącą religią jest katolicyzm (19,5%), a w 13 protestantyzm (16,9%). Stosunkowo dużą liczebnością (9 państw) charakteryzuje się także grupa „inne religie”, wśród których przeważają ludowe wierzenia.

Tabela 18. Tablica przeżycia ze względu na dominującą religię

Zmienna: religia dominująca (religia)			
Religia dominująca	Państwa upadłe	Państwa nieupadłe	SUMA
Katolicyzm	2 (13,3%)	13 (86,7%)	15
Islam	9 (30,0%)	21 (70,0%)	30
Prawosławie	1 (12,5%)	7 (87,5%)	8
Protestantyzm	3 (23,1%)	10 (76,9%)	13
Hinduizm	0	2 (100%)	2
Inna	2 (22,2%)	7 (77,8%)	9
SUMA	17 (22,1%)	60 (77,9%)	77

Źródło: opracowanie własne.

Na podstawie zaprezentowanej powyżej tablicy przeżycia stwierdzić należy, iż najczęściej upadały państwa, w których dominującą religią jest islam. W 9 państwach zaobserwowano symptomy świadczące o braku kontroli państwa nad swoim terytorium, co stanowi 30% liczebności grupy państw, w których islam jest religią wiodącą. Wśród państw, w których dominującą religią są odłamy chrześcijańskie upadłość obserwowana jest rzadziej. Upadło 6 na 36 państw, w tym 3 gdzie dominował protestantyzm (23,1% grupy państw protestanckich), 2 katolicyzm (13,3%) oraz jeden kraj prawosławny (12,5%). Nie zaobserwowano upadłości w krajach, w którym hinduizm jest wiodącą religią.



Wykres 13. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od dominującej religii

Źródło: opracowanie własne.

Na wykresie powyżej przedstawiono zależność pomiędzy prawdopodobieństwem upadłości państwa a czasem jego istnienia, w zależności od dominującej religii. Z uwagi na niską liczebność państw upadłych na wykresie nie ujęto grup państw, w których wiodącą religią było prawosławie i hinduizm. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości wskazują, iż zagrożenie wzrasta regularnie w przypadku państw z dominującym islamem już od 16. roku od utworzenia państwa. U kresu okresu badawczego wynosi ono już 44,4%. Najniższe prawdopodobieństwo wystąpienia upadłości w trakcie całego okresu badawczego charakteryzuje grupę państw o dominującym wyznaniu katolickim i wynosi jedynie 16,4%. Wyznawana religia w znacznym stopniu różnicuje więc zagrożenie upadłością państwa w całym horyzoncie czasowym badania.

Rozdział 4. Determinanty upadłości państwa – analiza empiryczna

4.1. Dane i metoda badawcza

Proces empirycznej weryfikacji istotności, siły i kierunku wpływu wybranych zmiennych na zagrożenie wystąpienia upadłości państwa został podzielony na dwie części. W badaniu ekonometrycznym posłużono się metodami wielowymiarowej analizy danych: w pierwszym kroku analizą dyskryminacyjną, w drugim zaś regresją logistyczną. Zmienna objaśniana wykorzystana w badaniu jest zmienną binarną, określającą fakt wystąpienia upadłości państwa w analizowanym w horyzoncie czasowym (lata 1960-2015). Pomimo tego, iż każda upadłość państwa jest aktem swoistym i niepowtarzalnym, to w skali badanych państw możliwe jest wyznaczenie pewnych prawidłowości. Wykorzystanie dwóch metod umożliwia porównanie otrzymanych współczynników funkcji oraz skuteczności klasyfikacji⁹¹. Przeprowadzona analiza służy realizacji części głównego celu pracy w zakresie oceny przyczyn upadłości państwa, ze szczególnym uwzględnieniem czynników o charakterze ekonomicznym oraz politycznym. Za pomocą analizy dyskryminacyjnej oraz regresji logistycznej możliwa jest empiryczna weryfikacja postawionych w pracy hipotez badawczych.

Problem dyskryminacji (rozumianej jako podział na grupy) został po raz pierwszy przedstawiony i częściowo rozwiązany przez Fishera [1936]. Zasadniczy postęp w rozwiązywaniu problemów klasyfikacyjnych (dyskryminacyjnych) nastąpił jednak dzięki pracom Walda [1944, 1950]⁹². Analiza dyskryminacyjna stanowi grupę metod wykorzystywanych w taksonomii. Problem klasyfikacji traktuje się jako próbę konstruowania takiej reguły decyzyjnej, która umożliwia rozpoznanie poszczególnych obserwacji (zjawisk lub obiektów) jako należących do jednej z kilku rozłącznych populacji, grup, kategorii, klas etc. W literaturze pojęcia dyskryminacji i klasyfikacji często są używane zamiennie⁹³, co przyjęto również w niniejszej pracy.

⁹¹ Równoległe wykorzystywanie analizy dyskryminacyjnej oraz regresji logistycznej w badaniach ekonomicznych: Jagiełło [2013].

⁹² Szersze ujęcie historycznych aspektów rozwijania i wykorzystywania analizy dyskryminacyjnej: Krzyśko [1982, s. 5-6].

⁹³ Możliwe jest również używanie dyskryminacji i klasyfikacji jako pojęć o różnych znaczeniach [por. Grabiński, Wydymus, Zeliaś 1989, s. 9]. Wiśniewska [2012, s. 65] traktuje pojęcie dyskryminacji

W celu przeprowadzenia analizy niezbędne jest określenie zestawu pojęć, które są wykorzystywane w tego typu badaniach. Przedmiotem klasyfikacji są obiekty oznaczone jako ω_i ($i=1,2,\dots,N$ określa numer obiektu), a każdy z obiektów opisany jest za pomocą K zmiennych (cech), oznaczanych jako x_1, x_2, \dots, x_K . Zmienne charakteryzujące obiekty nazywane są zmiennymi niezależnymi, diagnostycznymi, dyskryminującymi, opisowymi lub dyskryminantami [Wiśniewska 2012, s. 62-84]. W prezentowanych rozważaniach obiektami są państwa, które pochodzą z dwóch grup, zgodnie z wybranym wcześniej kryterium. W prowadzonej analizie tym kryterium jest fakt wystąpienia (bądź nie) upadłości państwa. Implikuje to wyróżnienie dwóch rozłączonych grup:

- π_1 – grupy państw, które doświadczyły upadłości w badanym horyzoncie czasowym;
- π_2 – grupy państw, w których nie odnotowano oznak upadłości.

Celem analizy dyskryminacyjnej jest zbudowanie takiej funkcji, dzięki której możliwe jest przyporządkowanie obiektów ω_i do jednej z dwóch grup (π_1, π_2) na podstawie wartości zmiennych dyskryminacyjnych (x_1, x_2, \dots, x_K). Funkcję tę określa się jako funkcję dyskryminacyjną. Główne założenia przyjmowane przy jej budowie są następujące [Krzyśko 1982, s. 19]:

- zmienne dyskryminacyjne mają wielowymiarowy rozkład normalny,
- występuje tzw. podzielność zmiennych, tj. systematyczna różnica wartości średnich pomiędzy grupami,
- macierze kowariancji zmiennych diagnostycznych są w obu grupach takie same.

Zaletą stosowania funkcji dyskryminacyjnej jest fakt, iż estymowana liniowa funkcja dyskryminacji może być wykorzystywana do klasyfikacji obiektów z dobrym rezultatem nawet wtedy, kiedy nie wszystkie z założeń są spełnione [Domański, Misztal 1998, s. 96]. Wiśniewska [2012, s. 85] zauważa jednak, iż jednym z podstawowych założeń jest brak współliniowości wykorzystanych zmiennych niezależnych.

W procesie budowy funkcji dyskryminacyjnej wykorzystano sekwencyjną metodę doboru zmiennych, stosując metodę selekcji (tzw. metoda regresji krokowej „w przód”). Na podstawie analizy literatury w zakresie determinant upadłości państwa skonstruowano model wyjściowy, a następnie rozszerzano go dodając kolejne zmienne

jako podział przestrzeni dyskryminacyjnej na podzbiory, a klasyfikację jako określanie przynależności obiektów do wyróżnionych grup (klas) na podstawie wartości zmiennych dyskryminacyjnych.

dyskryminacyjne⁹⁴. W dalszym postępowaniu określono wartość krytyczną funkcji dyskryminacyjnej⁹⁵. Obiekty, dla których estymowana wartość funkcji jest niższa niż wartość krytyczna zalicza się do grupy pierwszej, zaś wszystkie pozostałe do grupy drugiej [Witkowska 2002, s. 85-90]. W celu określenia trafności klasyfikacji na podstawie skonstruowanych modeli wykorzystano wartość tzw. „zliczeniowego R^2 ”, zwanego także współczynnikiem trafnych (poprawnych) klasyfikacji (ang. *hit ratio*). Z uwagi na fakt, iż zmienna zależna przyjmuje jedynie dwie wartości (0 lub 1), a na podstawie estymowanej funkcji dyskryminacji przyporządkowuje się obserwacje do dwóch grup, możliwe jest wyznaczenie liczby trafnych klasyfikacji. Za taką klasyfikację uważa się sytuację, gdy rzeczywista przynależność jest zgodna z przyporządkowaniem na podstawie funkcji dyskryminacji. Stąd stosunek trafnych klasyfikacji do łącznej liczby obserwacji nazywany jest zliczeniowym R^2 [Maddala 2008, s. 377-379]. Zestawiając rzeczywistą przynależność oraz przyporządkowanie (klasyfikację) do grupy za pomocą funkcji dyskryminacji sporządza się macierz klasyfikacji. Umożliwia to określenie liczby prawidłowo oraz nieprawidłowo przyporządkowanych obserwacji. Postać macierzy klasyfikacji została zaprezentowana w Tabeli 19.

Tabela 19. Schemat macierzy klasyfikacji dla dwóch populacji

		Rzeczywista przynależność		
		0	1	SUMA
Klasyfikacja na podstawie funkcji	0	n_{00}	n_{01}	$n_{00} + n_{01}$
	1	n_{10}	n_{11}	$n_{10} + n_{11}$
	SUMA	$n_{00} + n_{10}$	$n_{01} + n_{11}$	$n_{00} + n_{01} + n_{10} + n_{11}$

Źródło: opracowanie własne.

Zliczeniowy R^2 oblicza się następująco:

$$\text{zliczeniowy } R^2 = \frac{n_{00} + n_{11}}{n_{00} + n_{01} + n_{10} + n_{11}}$$

⁹⁴ Odminnym podejściem jest metoda eliminacji (tzw. metoda regresji krokowej „w tył”), polegająca na konstrukcji modelu zawierającego wszystkie zmienne, a następnie ich stopniowe usuwanie w celu uzyskania najlepszego możliwego dopasowania modelu do danych empirycznych [Gantar 1998, s. 57 za: Witkowska 2002, s. 90].

⁹⁵ Wartość krytyczną funkcji dyskryminacyjnej jest równa ilorazowi liczebności grupy, w której zaobserwowano badane zjawisko, oraz liczebności wszystkich badanych obiektów. W przypadku równej ilości obiektów w grupach wartość ta wynosi 0,5.

Zliczeniowy R^2 przyjmuje wartości od 0 do 1, gdzie 0 oznacza brak trafnych klasyfikacji, zaś 1 – wszystkie klasyfikacje prawidłowe. Wyższe wartości zliczeniowego R^2 oznaczają więc większą zdolność modelu do prawidłowego klasyfikowania państw. Z uwagi na fakt, iż wielu praktyków uważa, że o jakości modelu decyduje trafność klasyfikacji uzyskanych na jego podstawie [Dudek i Dybciak 2006, s. 88], w dalszych analizach zliczeniowy R^2 stanowić będzie wiodącą miarę oceny jakości funkcji dyskryminacyjnej.

Drugim narzędziem wykorzystanym w procesie weryfikowania siły, kierunku i istotności wpływu wybranych zmiennych na zagrożenie państwa upadłością jest model logitowy. Zmienną objaśnianą w modelu również jest zmienna binarna. Za jego pomocą możliwe jest określenie czynników, które zwiększają (bądź zmniejszają) prawdopodobieństwo wystąpienia określonego zjawiska.

Formalnie model logitowy przyjmuje postać:

$$\log \frac{P_i}{1-P_i} = \beta_0 + \sum_{j=1}^k \beta_j x_{ij} + u_i \quad (1)$$

gdzie: P_i – prawdopodobieństwo wystąpienia i -tego zjawiska, β_j – parametr funkcji, u_i – składnik losowy.

Funkcja regresji przyjmuje z kolei postać:

$$y_i^* = \beta_0 + \sum_{j=1}^k \beta_j x_{ij} + u_i \quad (2)$$

gdzie: y_i^* – zmienna niezależna (zmienna ukryta),

Lewa strona równania (1) jest logarytmem ilorazu szans (ang. *odds ratio*), czyli stosunkiem prawdopodobieństwa (szansy), że $y_i=1$ do prawdopodobieństwa, że $y_i=0$. Jeśli wartość ilorazu szans dla danej zmiennej jest większa od 1, oznacza to, iż wraz ze wzrostem wartości zmiennej objaśniającej rośnie prawdopodobieństwo wystąpienia badanego zjawiska. Jeśli iloraz szans jest mniejszy od jedności, to wraz ze wzrostem wartości tej zmiennej prawdopodobieństwo wystąpienia badanego zjawiska spada. Maksymalizacja funkcji wiarygodności (maksymalizacja dopasowania) opiera się na metodach tradycyjnie wykorzystywanych przy estymacji nieliniowej [Maddala 2008, s. 371-374]. Za pomocą funkcji (2) możliwe jest zaklasyfikowanie obiektów do jednej z dwóch grup. W przypadku grup o równej liczebności punkt krytyczny wynosi 0. Oznacza to, że zależna zmienna zero-jedynkowa y_i przyjmuje wartości:

$$y_i=1 \text{ gdy } y_i^*>0,$$

$$y_i=0 \text{ w pozostałych przypadkach.}$$

W niniejszej pracy oszacowanie trafności klasyfikacji odbywać się będzie z wykorzystaniem zliczeniowego R^2 .

Celem badania ekonometrycznego było zidentyfikowanie zależności pomiędzy czynnikami wybranymi na podstawie krytycznego przeglądu literatury a prawdopodobieństwem upadłości państwa. Pierwotnie analizie poddano 77 państw utworzonych w roku 1960 i później, których populacja przekraczała 500 tysięcy mieszkańców. Uzasadnienie doboru państw, ich listę, zakres czasowy oraz klasyfikację na państwa upadłe oraz nieupadłe przedstawiono w Rozdziale 3. Wśród całej grupy badawczej zidentyfikowano 17 państw upadłych, tj. takich, które doświadczyły upadłości w co najmniej jednym roku swojego istnienia. W pozostałych 60 państwach nie zanotowano symptomów upadłości od momentu utworzenia państwa do 2015 roku.

Z wykorzystaniem analizy dyskryminacyjnej i regresji logistycznej poddano weryfikacji następujące hipotezy badawcze:

- Hipoteza 1.: Czynniki ekonomiczne i polityczne determinują zagrożenie upadłością państwa.
- Hipoteza 2.: Prawdopodobieństwo upadłości państwa maleje wraz z poprawą sytuacji ekonomicznej.
- Hipoteza 3.: Prawdopodobieństwo upadłości państwa jest niższe w krajach o ustroju demokratycznym.

Zmienna zależna wykorzystana w badaniach ma charakter dychotomiczny (przyjmuje wartości zero lub jeden) i określa, czy poszczególne państwa upadły, bądź nieupadły w badanym horyzoncie czasowym. Pochodzi ona z bazy *Political Regime Characteristics and Transitions (Polity IV)*⁹⁶ udostępnianej przez *Center for Systemic Peace*. Jej wykorzystanie rekomendują m.in. Iqbal i Starr [2007, 2008] oraz Marshall [2008]. Zmienna zależna przyjmuje zatem następujące wartości:

- $y = 0$, gdy w żadnym roku od utworzenia państwa do końca okresu badawczego nie zaobserwowano upadłości państwa,
- $y = 1$, gdy w co najmniej jednym roku zaobserwowano upadłość państwa.

⁹⁶ W bazie danych *Political Regime Characteristics and Transitions* wyróżnia się państwa, których struktury funkcjonują prawidłowo (wartości od -10 do +10), państwa w trakcie transformacji ustrojowej (wartość zmiennej: -88), a także zmienne określające zewnętrzną ingerencję w instytucje państwa (wartość: -66) oraz brak scentralizowanej władzy (-77).

Zestaw zmiennych niezależnych wykorzystanych w badaniu obejmuje 27 zmiennych o charakterze ilościowym oraz jakościowym. Ich pełen opis oraz podstawowe statystyki opisowe zawarto w Tabelach 20 i 21. Zmienne te opisują ogólną sytuację ekonomiczną, polityczną oraz geograficzno-historyczno-kulturową analizowanych państw w badanym okresie. Wśród zmiennych poddanych badaniu wyróżnić należy zmienne:

- ekonomiczne:
 - początkowy, średni oraz końcowy PKB per capita,
 - początkowa, średnia oraz końcowa wartość importu (udział w PKB),
 - początkowa, średnia oraz końcowa wartość eksportu (udział w PKB),
 - początkowa, średnia oraz końcowa wartość stopy wzrostu gospodarczego,
 - średnia inflacja w badanym okresie,
- polityczne:
 - początkowa, średnia oraz końcowa wartość indeksu opisującego system polityczny (*Polity IV*),
 - przeszłość kolonialna, rozumiana jako fakt utworzenia państwa na skutek ustania relacji kolonialnych (dodatkowo wyróżnia się także, czy państwo jest byłą kolonią brytyjską, francuską, bądź inną),
 - sztuczność granic,
- pozostałe:
 - występowanie tzw. „klątwy surowcowej” (z podziałem na sektor paliw oraz innych surowców),
 - dominująca religia (w tym: katolicyzm, islam oraz inne).

Wszystkie zaprezentowane obliczenia wykonano z wykorzystaniem pakietu STATA.

Tabela 20. Opis zmiennych wykorzystanych w badaniu

Zmienna	Oznaczenie zmiennej	Opis	Źródło
Upadłość	upadlosc	Zmienna zależna 1 – państwo upadło w okresie od początku swojego istnienia do 2015 roku 0 – państwo nie upadło w okresie od początku swojego istnienia do 2015 roku	Political Regime Characteristics and Transitions (<i>Polity IV</i>)
PKB per capita (początkowy)	pkb_pocz	PKB per capita w USD'2010 – wartość w pierwszym roku po utworzeniu państwa	World Development Indicators, WorldBank
PKB per capita (średni)	pkb_sr	PKB per capita w USD'2010 – średnia wartość w badanym horyzoncie czasowym	
PKB per capita (końcowy)	pkb_konc	PKB per capita w USD'2010 – wartość w ostatnim roku horyzontu czasowego	
Import (początkowy) jako % PKB	import_pocz	Stosunek wartości importu do PKB w pierwszym roku po utworzeniu państwa	
Import (średni) jako % PKB	import_sr	Średni stosunek importu do PKB w badanym horyzoncie czasowym	
Import (końcowy) jako % PKB	import_konc	Stosunek wartości importu do PKB w ostatnim roku horyzontu czasowego	
Eksport (początkowy) jako % PKB	eksport_pocz	Stosunek wartości eksportu do PKB w pierwszym roku po utworzeniu państwa	
Eksport (średni) jako % PKB	eksport_sr	Średni stosunek eksportu do PKB w badanym horyzoncie czasowym	
Eksport (końcowy) jako % PKB	eksport_konc	Stosunek wartości eksportu do PKB w ostatnim roku horyzontu czasowego	
Stopa wzrostu gospodarczego (początkowa)	wzr_gosp_pocz	Stopa wzrostu gospodarczego w pierwszych trzech latach horyzontu czasowego	
Stopa wzrostu gospodarczego (średnia)	wzr_gosp_sr	Średnia stopa wzrostu gospodarczego w badanym horyzoncie czasowym	
Stopa wzrostu gospodarczego (końcowa)	wzr_gosp_konc	Stopa wzrostu gospodarczego w ostatnich trzech latach horyzontu czasowego	
Średni inflacja	inflacja_sr	Średnia wartość inflacji (CPI) w badanym horyzoncie czasowym	
Indeks systemu politycznego (początkowy) ¹	sys_pol_pocz	Wartość indeksu systemu politycznego w pierwszym roku po utworzeniu państwa	Political Regime Characteristics and Transitions (<i>Polity IV</i>)
Indeks systemu politycznego (średni)	sys_pol_sr	Średnia wartość indeksu systemu politycznego w badanym horyzoncie czasowym	

Zmienna	Oznaczenie zmiennej	Opis	Źródło
Indeks systemu politycznego (końcowy)	sys_pol_konc	Wartość indeksu systemu politycznego w ostatnim roku horyzontu czasowego	Political Regime Characteristics and Transitions (<i>Polity IV</i>)
Przeszłość kolonialna	przeszlosc_kolon	1 – Państwo zostało utworzone na skutek dekolonizacji 0 – Utworzone w inny sposób	Issue Correlates of War (ICOW) Project
Była kolonia brytyjska	kolonia_bryt	1 – Państwo było kolonią brytyjską; 0 – nie było kolonią brytyjską	
Była kolonia francuska	kolonia_franc	1 – Państwo było kolonią francuską; 0 – nie było kolonią francuską	
Inna była kolonia	kolonia_inna	1 – Państwo było inną kolonią ; 0 – nie było inną kolonią	
Sztuczność granic	sztuczne_granice	Państwo posiada sztuczne granice	Alesina, Easterly, Matuszeski [2011]
Kłątwa surowcowa (ogółem)	klatwa_surowc	1 - Państwo zagrożone jest występowaniem klątwy surowcowej 0 – brak zagrożenia wystąpienia klątwy surowcowej	Sialitskaya [2013]
Kłątwa surowcowa (paliwa)	klatwa_paliwa	1 - Państwo zagrożone jest występowaniem klątwy surowcowej ze względu na uzależnienie od paliw kopalnych 0 – brak zagrożenia klątwą surowcową ze względu na uzależnienie od paliw kopalnych	
Kłątwa surowcowa (minerały)	klatwa_mineral	1 - Państwo zagrożone jest występowaniem klątwy surowcowej ze względu na uzależnienie od minerałów 0 – brak zagrożenia klątwą surowcową ze względu na uzależnienie od minerałów	
Dominująca religia katolicka	religia_katolik	1 – dominująca religia w państwie to katolicyzm ; 0 – w przeciwnym wypadku	World Religion Database
Dominująca religia islamska	religia_islam	1 – dominująca religia w państwie to islam ; 0 – w przeciwnym wypadku	
Inna dominująca religia	religia_inna	1 – dominująca religia w państwie jest inna niż katolicyzm lub islam ; 0 – w przeciwnym wypadku	

¹Indeksu systemu politycznego przyjmuje wartości od -10 do +10, im mniejsza wartość tym ustroj wykazuje więcej cech autokratycznych, im wyższa wartość tym więcej demokratycznych.

Źródło: zestawienie własne.

Tabela 21. Statystyki opisowe zmiennych wykorzystanych w badaniu

Zmienna	Obserwacje	Średnia	Odchylenie standardowe	Min	Max
pkb_pocz	73	4647,745	14212,17	189,074	105514
pkb_sr	73	4846,19	10611,08	279,098	70230,13
pkb_konc	73	5672,92	10703,84	320,688	75117,36
import_pocz	76	0,407	0,277	0,074	1,932
import_sr	73	0,453	0,203	0,123	1,201
import_konc	76	0,493	0,227	0,121	1,252
eksport_pocz	76	0,314	0,209	0,049	1,241
eksport_sr	73	0,356	0,190	0,078	0,991
eksport_konc	76	0,382	0,224	0,065	0,98
wzr_gosp_pocz	68	-0,016	0,111	-0,479	0,146
wzr_gosp_sr	69	0,017	0,029	-0,043	0,152
wzr_gosp_konc	68	0,019	0,051	-0,141	0,112
inflacja_sr	68	34,944	87,492	0,105	620,28
sys_pol_pocz	77	0,025	6,529	-10	10
sys_pol_sr	77	-0,722	5,712	-10	10
sys_pol_konc	77	1,922	6,507	-10	10
przeszlosc_kolon	77	0,701	0,461	0	1
kolonia_bryt	77	0,312	0,466	0	1
kolonia_franc	77	0,247	0,434	0	1
kolonia_inna	77	0,143	0,352	0	1
sztuczne_granice	77	0,104	0,307	0	1
klatwa_surowc	77	0,390	0,491	0	1
klatwa_paliwa	77	0,273	0,448	0	1
klatwa_mineral	77	0,143	0,352	0	1
religia_katolik	77	0,195	0,399	0	1
religia_islam	77	0,390	0,491	0	1
religia_inna	77	0,415	0,496	0	1

Zródło: obliczenia własne.

4.2. Klasyfikacja państw ze względu na wybrane czynniki – analiza dyskryminacyjna

W kolejnej części zaprezentowane zostaną wyniki przeprowadzonej analizy dyskryminacyjnej. Parametry oszacowane za pomocą tej metody zostały przedstawione w Tabelach 22, 23 oraz 24. Wszystkie otrzymane współczynniki są współczynnikami standaryzowanymi. Oznacza to, że możliwe jest porównywanie bezwzględnej siły wpływu zmiennych niezależnych (dyskryminacyjnych), bez względu na jednostki, w których są one wyrażone.

Dodatkowo, w zestawieniu ujęto wartość zliczeniowego R^2 oraz wartość prawdopodobieństwa, która nie daje podstawy do odrzucenia hipotezy zerowej o braku łącznego wpływu zmiennych wykorzystanych w modelu na zmienną zależną (wartość $\text{prob}>F$).

Na podstawie analizy literatury przedmiotu w zakresie przyczyn upadłości państwa ustalono, iż czynniki polityczne są pierwotną przyczyną kształtowania się sytuacji ekonomicznej⁹⁷. W odniesieniu do owych ustaleń w pierwszych estymowanych modelach przyjęto zmienne polityczne (początkową, średnią oraz końcową wartość indeksu opisującego system polityczny) jako zmienne kontrolne (patrz: modele 2-12). Model (1) stanowi podstawę do porównań z kolejno estymowanymi modelami.

⁹⁷ Por. podrozdział 1.3.

Tabela 22. Wyniki estymacji - analiza dyskryminacyjna (cz. 1)

Zmienna		Oznaczenie modelu					
		(1)	(2)	(3)	(4)	(5)	(6)
System polityczny (Polity IV)	początkowy	1,15**	0,98	-0,10*	1,15*	-0,24	0,74
	średni	-2,09	-1,53*	-0,59*	-2,09**	-0,49	-1,95**
	końcowy	0,684*	0,38	-0,39	0,68	-0,11	1,17*
Przeszłość kolonialna			0,48			0,37	0,09
Była kolonia brytyjska				0,13			
Była kolonia francuska				0,17			
Inna była kolonia				0,40			
Sztuczność granic					0,03		
PKB per capita	początkowy					-0,28	
	średni					-0,40	
	końcowy					-0,48*	
Import (%PKB)	początkowy						0,04
	średni						0,32
	końcowy						-0,66
Export (%PKB)	początkowy						
	średni						
	końcowy						
Stopa wzrostu gospodarczego	początkowa						
	średnia						
	końcowa						
Średnia inflacja							
„Klątwa surowcowa”	ogółem						
	paliwa						
	surowce						
Dominująca religia	katolicyzm						
	islam						
	inna						
stała							
Zliczeniowy R ²		0,805	0,805	0,818	0,805	0,805	0,792
prob > F		0,099	0,107	0,213	0,183	0,107	0,254

Uwaga: Wszystkie otrzymane współczynniki są współczynnikami standaryzowanymi.

*, **, *** oznaczono istotność statystyczną na poziomie odpowiednio 10%, 5% oraz 1%.

Źródło: obliczenia własne.

Tabela 23. Wyniki estymacji - analiza dyskryminacyjna (cz. 2)

Zmienna		Oznaczenie modelu					
		(7)	(8)	(9)	(10)	(11)	(12)
System polityczny (Polity IV)	początkowy	0,61	0,44	0,62	0,86	0,84	0,90
	średni	-1,40*	-1,11*	-1,78	-1,39	-1,33	-1,19
	końcowy	0,66	0,55	0,75	0,20	0,14	0,30
Przeszłość kolonialna		0,09	-0,09	0,11	0,51	0,52	0,55
Była kolonia brytyjska							
Była kolonia francuska							
Inna była kolonia							
Sztuczność granic							
PKB per capita	początkowy						
	średni						
	końcowy						
Import (%PKB)	początkowy						
	średni						
	końcowy						
Export (%PKB)	początkowy	0,11					
	średni	-0,21					
	końcowy	-0,56					
Stopa wzrostu gospodarczego	początkowa		0,26				
	średnia		-0,24				
	końcowa		-0,67***				
Średnia inflacja				-0,34			
„Kłątwa surowcowa”	ogółem				-0,39		
	paliwa					-0,41	
	surowce					-0,27	
Dominująca religia	katolicyzm						-0,19
	islam						0,32
	inna						
stała							
Zliczeniowy R ²		0,792	0,823	0,823	0,818	0,831	0,818
prob > F		0,074	0,006	0,536	0,128	0,171	0,185

Uwaga: Wszystkie otrzymane współczynniki są współczynnikami standaryzowanymi.

*, **, *** oznaczono istotność statystyczną na poziomie odpowiednio 10%, 5% oraz 1%.

Źródło: obliczenia własne.

Tabela 24. Wyniki estymacji - analiza dyskryminacyjna (cz. 3)

Zmienna		Oznaczenie modelu					
		(13)	(14)	(15)	(16)	(17)	(18)
System polityczny (Polity IV)	początkowy	0,04					0,28
	średni		-0,40		-0,39	-0,17	-0,58
	końcowy			0,04			0,13
Przeszłość kolonialna							
Była kolonia brytyjska		0,11	0,11	-0,12	-0,07	-0,25	-0,59
Była kolonia francuska		0,33	0,32	0,27	0,30	0,18	-0,01
Inna była kolonia		0,78**	0,51	0,58**	0,57	0,50*	0,22
Sztuczność granic							0,30
PKB per capita	początkowy	-0,17					0,34
	średni		0,05		-0,06	-0,12	-1,39
	końcowy			-0,18			1,19
Import (%PKB)	początkowy	0,49			0,22	0,10	0,11
	średni		0,61*				1,49
	końcowy			0,31			-0,89
Export (%PKB)	początkowy	-0,72					0,02
	średni		-0,96**		-0,69*	-0,58**	-1,76
	końcowy			-0,51			0,65
Stopa wzrostu gospodarczego	początkowa	0,15					0,32
	średnia		0,10		0,09		-0,02
	końcowa			-0,81***		-0,81***	-1,02
Średnia inflacja							-0,01
„Klątwa surowcowa”	ogółem						
	paliwa						-0,15
	surowce						0,21
Dominująca religia	katolicyzm	-0,28	-0,13	-0,39	-0,23	-0,44	-0,28
	islam	0,62*	0,33	0,23	0,19	0,01	0,16
	inna						
stała							
Zliczeniowy R ²		0,848	0,879	0,879	0,879	0,909	0,951
prob > F		0,155	0,038	0,002	0,080	0,001	0,196

Uwaga: Wszystkie otrzymane współczynniki są współczynnikami standaryzowanymi.

*, **, *** oznaczono istotność statystyczną na poziomie odpowiednio 10%, 5% oraz 1%.

Źródło: obliczenia własne.

W pierwszej grupie (modele 2-12) zawarto modele, w których do dyskryminant należą zmienne polityczne oraz dodatkowo jeden zestaw zmiennych określający pojedyncze uwarunkowanie (PKB per capita, import, eksport etc.). Na podstawie modelu (2) należy wskazać, iż uwzględnienie przeszłości kolonialnej nie zmienia poprawności klasyfikacji (wartość zliczeniowego R^2 się nie zmienia), zaś zdolność dyskryminacyjna ulega nieznacznemu pogorszeniu w porównaniu z modelem (1) zawierającym jedynie zmienne polityczne. Parametr przy zmiennej określającej przeszłość kolonialną jest dodatni (0,48), co oznacza, iż kraje utworzone na skutek ustania relacji kolonialnych są bardziej narażone na upadłość niż kraje, które nie doświadczyły kolonializmu. Parametr ten jest jednak nieistotny statystycznie na poziomie ufności 90%. W modelu (3) uwzględniono wpływ poszczególnych państw-kolonizatorów na zagrożenie upadłością państwa. Otrzymane parametry dla wpływu kolonialnego Wielkiej Brytanii, Francji oraz innych państw (odpowiednio: 0,13; 0,17; 0,40) wskazują, iż fakt bycia w przeszłości kolonią przyczynia się do zwiększenia zagrożenia upadłością państwa. Wpływ ten jest nieznacznie mniejszy w przypadku byłych kolonii brytyjskich, niż w przypadku Francji oraz wyraźnie słabszy niż w przypadku innych państw kolonizujących (Portugalii, Belgii, Hiszpanii oraz Włoch). Wszystkie oszacowane parametry są nieistotne statystycznie. Współczynnik poprawnych klasyfikacji jest większy (0,818) niż w modelu wyjściowym (1), jednakże zdolność dyskryminacyjna jest niższa. Kolejny model (4) uwzględnia obok zmiennych politycznych również „sztuczność granic”. Porównując specyfikację tego modelu oraz modelu wyjściowego (1) należy stwierdzić, iż fakt występowania sztucznych granic jedynie w niewielkim stopniu przyczynia się do zwiększenia zagrożenia upadłością państwa. Dodatkowo uwzględnienie tej zmiennej nie poprawia dopasowania modelu, a obniża zdolność dyskryminacyjną.

W modelu (5) uwzględniono trzy zmienne opisujące produkt krajowy brutto per capita – wartość w pierwszym roku istnienia państwa, średnią wartość w badanym okresie, a także wartość w ostatnim roku badania. Otrzymane parametry (wynoszące odpowiednio: -0,28 ; -0,40 ; -0,48) wskazują, iż państwa, które są relatywnie bogatsze (bez względu na przyjętą zmienną) charakteryzują się niższym zagrożeniem upadłością państwa, jednakże jedynie parametr stojący przy zmiennej określającej końcową wartość PKB per capita jest istotny statystycznie. Zdolność dyskryminacyjna modelu jest niższa, zaś wartość zliczeniowego R^2 nie zmieniła się w porównaniu do modelu wyjściowego.

W kolejnych dwóch modelach (6-7) pod uwagę wzięto polityczne zmienne kontrolne oraz dane dotyczące odpowiednio importu i eksportu w relacji do PKB. Podobnie jak w modelu (5), w badaniu posłużono się wartościami początkowymi, średnimi oraz końcowymi. Analiza modelu (6), zawierającego dane dotyczące importu, ukazuje wpływ na upadłość państwa w przeciwnych kierunkach: wyższe początkowe oraz średnie wartości importu zwiększają zagrożenie wystąpienia upadłości państwa (współczynniki odpowiednio: 0,04 oraz 0,32), podczas gdy wzrost końcowej wartości obniża zagrożenie (współczynnik: -0,66). Statystyki modelu wskazują na pogorszenie dopasowania (zliczeniowy $R^2=0,792$), niższą zdolność dyskryminacyjną modelu, a wszystkie zmienne związane z importem są nieistotne statystycznie. Z kolei model (7), w którym uwzględniono dane dotyczące relacji eksportu do PKB, charakteryzuje się wyższą zdolnością dyskryminacyjną, a jego współczynnik poprawnych klasyfikacji wynosi 79,2%. Otrzymane współczynniki stojące przy dyskryminantach związanych z eksportem są nieistotne statystycznie. Wskazują jednak, iż wyższa relatywna wartość eksportu obniża zagrożenie upadłością państwa (dla wartości średnich i końcowych). Współczynnik stojący przy początkowych wartościach eksportu jest dodatni i przyjmuje najmniejsze bezwzględne wartości ze wszystkich otrzymanych.

Model (8) rozszerzono względem modelu wyjściowego o początkowe, średnie oraz końcowe stopy wzrostu gospodarczego⁹⁸. Otrzymany model charakteryzuje się największym współczynnikiem poprawnych klasyfikacji ze wszystkich dotąd omawianych (zliczeniowy $R^2=0,823$) oraz największą zdolnością dyskryminacyjną. Uwzględnienie zmiennych dotyczących wzrostu gospodarczego w znaczący sposób poprawia więc skuteczność analizy dyskryminacji. Analiza otrzymanych współczynników stojących przy dyskryminantach wskazuje, iż wyższa stopa wzrostu gospodarczego (średnia oraz końcowa) obniża prawdopodobieństwo wystąpienia symptomów upadłości państwa. W przypadku wartości początkowych występuje przeciwna zależność. Ostatni z modeli uwzględniających zmienne ekonomiczne (9), zawiera obok zmiennych kontrolnych zmienną opisującą średni poziom inflacji w badanym okresie. Uwzględnienie tej zmiennej w bardzo dużym stopniu obniżyło

⁹⁸ Analiza różnych długości średnich dotyczących początkowej oraz końcowej stopy wzrostu gospodarczego wykazała, iż dopasowanie modelu jest największe, gdy uwzględnione zostaną trzy pierwsze lata (dla początkowej stopy wzrostu) oraz trzy ostatnie lata (dla końcowej stopy wzrostu).

zdolność dyskryminacyjną modelu (wartość $\text{prob} > F = 0,536$), co sprawia, iż nie jest możliwe wnioskowanie na podstawie estymowanych współczynników.

Kolejną grupę modeli (10-12) stanowią modele, w których obok zmiennych kontrolnych posłużono się także zmiennymi dotyczącymi uwarunkowań geograficznych oraz kulturowych. Modele zawierające analizę wpływu „klątwy surowcowej” na upadłość państwa (10-11) są lepiej dopasowane niż model wyjściowy (1). Wartości zliczeniowego R^2 wynoszą odpowiednio: 0,818 oraz 0,831, zaś wartość parametru określającego ich zdolność dyskryminacyjną wynosi 0,128 oraz 0,171. Niemniej jednak, wszystkie otrzymane współczynniki są ujemne, bez względu czy „klątwe surowcową” rozpatruje się łącznie, czy też z podziałem na „klątwe” w sektorze paliw i innych surowców. Oznacza to, że kraje, które są bogate w złoża naturalne i mocno gospodarczo od nich uzależnione wykazują mniejszą tendencję do upadłości. Nie przekreśla to jednocześnie występowania negatywnych efektów „klątwy”, ponieważ w badaniu nie weryfikowano wpływu uzależnienia od surowców na wyniki gospodarcze.

W ostatnim modelu (12) dołączono do analizy zmienną dotyczącą dominującej religii. Otrzymane wyniki wskazują, iż kraje, w których dominującą religią jest katolicyzm są mniej zagrożone upadłością państwa niż kraje z przewagą wyznawców islamu. Wartość zliczeniowego R^2 jest wyższa niż w modelu wyjściowym, zaś zdolność dyskryminacyjna jest niższa. Zmienne dotyczące dominującej religii są nieistotne statystycznie na poziomie ufności 90%.

Kolejne trzy modele estymowane z wykorzystaniem analizy dyskryminacyjnej (13-15) zawierają odpowiednio: początkowe, średnie oraz końcowe wartości zmiennych o charakterze ekonomicznym oraz politycznym. Dodatkowo uwzględniono przeszłość kolonialną, z podziałem na byłe mocarstwa sprawujące kontrolę na danym terenie, oraz dominującą religię⁹⁹. Wnioski płynące z analizy modelu (13) są następujące: wyższe wartości PKB per capita oraz większa relacja eksportu do PKB zmniejszają zagrożenie upadłością, zaś wyższe uzależnienie gospodarki od importu zwiększa to zagrożenie. Przeszłość kolonialna zwiększa zagrożenie upadłością państwa (wpływ ten jest jednakże najniższy w przypadku byłych kolonii brytyjskich). Co zaskakujące, wyższa początkowa stopa wzrostu gospodarczego charakteryzuje kraje bardziej narażone na upadłość. Na podstawie modelu (14), uwzględniającego wartości średnie, możliwe jest

⁹⁹ W budowie modeli 13-15 pominięto „klątwe surowcową”. Uwzględnienie owych zmiennych w znaczący sposób obniżało łączną istotność dyskryminant.

sformułowanie zbliżonych wniosków. Jedyne wyjątki stanowią przeciwny znak parametru przy PKB per capita. Współczynniki stojące przy relacji importu oraz eksportu do PKB są istotne statystycznie. Łączna zdolność dyskryminacyjna modelu jest bardzo wysoka, zaś zliczeniowy R^2 wynosi niespełna 0,88. Ostatni z tej grupy - model (15) - zawiera dane dotyczące czynników obserwowanych na końcu okresu badawczego. W porównaniu do modeli (13) i (14) zmieniają się na ujemne wartości parametrów stojące przy PKB per capita oraz stopie wzrostu gospodarczego (jest ona istotna statystycznie). Oznacza to, iż kraje o niższym poziomie PKB per capita i notujące niższe stopy wzrostu w końcowym okresie badania są bardziej zagrożone upadłością.

Ostatnią grupę stanowią modele wybrane na podstawie poprzednich analiz. Wykorzystano w nich te zmienne, które w największym stopniu wpływały na wartość zmiennej zależnej, a także te, które w znaczący sposób podwyższały dopasowanie modelu. W rezultacie otrzymano modele (16) i (17). Różnią się między sobą jedynie użyciem zmiennej dotyczącej stopy wzrostu gospodarczego – w pierwszym z nich wykorzystano wartość średnią, w drugim wartość końcową. Poza tym, w konstruowaniu modeli uwzględniono: średnią wartość indeksu systemu politycznego, przeszłość kolonialną, średni PKB per capita, początkową wartość importu, średnią wartość eksportu oraz dominującą religię. Podobnie jak w przypadku modeli (13) - (15) pominięcie zmiennych dotyczących występowania „klątwy surowcowej” znacząco poprawiało statystyki modeli. Otrzymany model (17) jest najlepiej dopasowanym modelem ze wszystkich dotychczas estymowanych, gdyż poprawnie zaklasyfikowano ponad 90% krajów stanowiących grupę badawczą (wartość zliczeniowego R^2 wynosi 0,909). Model ten charakteryzuje się również najwyższą zdolnością dyskryminacyjną.

W trakcie analiz estymowano również model (18) zawierający wszystkie zmienne. Jego dopasowanie do danych empirycznych było bardzo wysokie, jednakże z uwagi na wysoki poziom wartości „ $\text{prob} > F$ ” nie jest możliwe formułowanie wniosków na poziomie istotności mniejszym niż 0,1.

4.3. Wpływ wybranych czynników na prawdopodobieństwo upadłości państwa – analiza logistyczna

W kolejnym kroku badaniu poddano ten sam zestaw państw i zmiennych wykorzystując modele logitowe, w celu określenia wpływu poszczególnych czynników na prawdopodobieństwo upadłości państwa. W Tabelach (25, 26, 27) przedstawiono wyniki estymacji modeli, wraz z wartością zliczeniowego R^2 oraz poziomem prawdopodobieństwa, które nie dają podstaw do odrzucenia hipotezy zerowej o braku wpływu badanych zmiennych (wartość $\text{prob} > \chi^2$) na zagrożenie państwa upadłością. Hipoteza ta (H_0) brzmi: wszystkie współczynniki stojące przy zmiennych są równe 0. Dodatkowo zaznaczono poziom istotności statystycznej wykorzystanych zmiennych niezależnych oraz stałej. Dla wybranych modeli, cechujących się najwyższym dopasowaniem oraz istotnością, obliczono iloraz szans (ang. *odds ratio*), aby wskazać wpływ zmiennych na prawdopodobieństwo wystąpienia upadłości państwa (Tabela 28). Wartości ilorazu szans większe niż 1 wskazują, iż wraz ze wzrostem wartości zmiennej niezależnej wzrasta również prawdopodobieństwo wystąpienia upadłości państwa. Jeśli iloraz szans jest mniejszy od jedności, to wzrost wartości zmiennej niezależnej jest skorelowany ze spadkiem zagrożenia upadłością państwa.

Wykorzystując regresję logistyczną estymowano kolejne 18 modeli (19-36). Podobnie jak w przypadku analizy dyskryminacyjnej, zmienne polityczne przyjęto jako zmienne kontrolne (modele 20-30), stąd model (19) jest modelem wyjściowym i stanowi podstawę do porównań.

Tabela 25. Wyniki estymacji – model logitowy (cz. 1) – parametry funkcji

Zmienna		Oznaczenie modelu					
		(19)	(20)	(21)	(22)	(23)	(24)
System polityczny (Polity IV)	początkowy	0,11*	0,10	0,10	0,11*	0,10	0,09
	średni	-0,25**	-0,20	-0,21*	-0,25**	-0,26	-0,34**
	końcowy	0,07	0,03	0,04	0,07	0,09	0,16*
Przeszość kolonialna			1,09				
Była kolonia brytyjska				0,86			
Była kolonia francuska				1,03			
Inna była kolonia				1,54			
Sztuczność granic					0,10		
PKB per capita	początkowy					-0,00**	
	średni					0,01**	
	końcowy					-0,01***	
Import (%PKB)	początkowy						0,00
	średni						0,01
	końcowy						-0,03
Export (%PKB)	początkowy						
	średni						
	końcowy						
Stopa wzrostu gospodarczego	początkowa						
	średnia						
	końcowa						
Średnia inflacja							
„Kłątwa surowcowa”	ogółem						
	paliwa						
	surowce						
Dominująca religia	katolicyzm						
	islam						
	inna						
stała		-1,72***	-2,45***	-2,46***	-1,73***	-0,25	-1,71*
Zliczeniowy R ²		0,571	0,610	0,636	0,571	0,836	0,740
prob > chi ²		0,093	0,101	0,110	0,079	0,000	0,144

Uwaga: *, **, *** oznaczono istotność statystyczną na poziomie odpowiednio 10%, 5% oraz 1%.

Źródło: obliczenia własne.

Tabela 26. Wyniki estymacji – model logitowy (cz. 2) – parametry funkcji

Zmienna		Oznaczenie modelu					
		(25)	(26)	(27)	(28)	(29)	(30)
System polityczny (Polity IV)	początkowy	0,07	0,10	0,05	0,10	0,10	0,11*
	średni	-0,34**	-0,44*	-0,21*	-0,26**	-0,26**	-0,25**
	końcowy	0,16	0,14	0,07	0,05	0,05	0,06
Przeszłość kolonialna							
Była kolonia brytyjska							
Była kolonia francuska							
Inna była kolonia							
Sztuczność granic							
PKB per capita	początkowy						
	średni						
	końcowy						
Import (%PKB)	początkowy						
	średni						
	końcowy						
Export (%PKB)	początkowy	0,02					
	średni	-0,01					
	końcowy	-0,07*					
Stopa wzrostu gospodarczego	początkowa		0,02				
	średnia		-0,19				
	końcowa		-0,15*				
Średnia inflacja				-0,00			
„Kłątwa surowcowa”	ogółem				-0,53		
	paliwa					-0,73	
	surowce					-0,45	
Dominująca religia	katolicyzm						-0,58
	islam						0,22
	inna						
stała		-0,52	-2,43***	-1,73***	-1,51***	-1,45***	-1,71***
Zliczeniowy R ²		0,767	0,794	0,617	0,610	0,610	0,597
prob > chi ²		0,010	0,002	0,347	0,087	0,181	0,090

Uwaga: *, **, *** oznaczono istotność statystyczną na poziomie odpowiednio 10%, 5% oraz 1%.

Źródło: obliczenia własne.

Tabela 27. Wyniki estymacji – model logitowy (cz.3) – parametry funkcji

Zmienna		Oznaczenie modelu					
		(31)	(32)	(33)	(34)	(35)	(36)
System polityczny (Polity IV)	początkowy	0,03					
	średni		-0,38**		-0,56**	-0,66**	-0,93**
	końcowy			0,04			
Przeszłość kolonialna							
Była kolonia brytyjska		-0,35	0,41	-4,72		-0,80	
Była kolonia francuska		0,65	1,10	4,56*		2,05	
Inna była kolonia		4,26	4,49	14,74		0,22	
Sztuczność granic							
PKB per capita	początkowy	-0,00					
	średni		-0,00				
	końcowy			-0,00*			-0,00
Import (%PKB)	początkowy	0,02			0,07*	0,11*	0,14**
	średni		0,33				
	końcowy			0,10*			
Export (%PKB)	początkowy	-0,01					
	średni		-0,09		-0,22***	-0,31**	-0,27*
	końcowy			-0,08			
Stopa wzrostu gospodarczego	początkowa	0,05					
	średnia		0,04				
	końcowa			-1,03**	-0,43**	-0,59**	-0,75**
Średnia inflacja							
„Kłątwa surowcowa”	ogółem						
	paliwa						
	surowce						
Dominująca religia	katolicyzm	-2,56	-3,08	-14,06			-1,87
	islam	1,54	0,69	-2,54			2,42
	inna						
stała		-2,25	-2,19	-0,56			0,23
Zliczeniowy R ²		0,758	0,848	0,954	0,864	0,894	0,939
prob > chi ²		0,063	0,003	0,000	0,026	0,357	0,000

Uwaga: *, **, *** oznaczono istotność statystyczną na poziomie odpowiednio 10%, 5% oraz 1%.

Źródło: obliczenia własne.

Pierwszą grupę modeli (20-30) stanowią modele uwzględniające zmienne kontrolne oraz dodatkowo zmienne dotyczące jednego zestawu czynników (np. import w relacji do PKB, eksport w relacji do PKB, stopa wzrostu gospodarczego, dominująca religia). Model (20) został rozszerzony względem modelu wyjściowego (19) o zmienną binarną dotyczącą przeszłości kolonialnej. Wykorzystanie tej zmiennej podwyższyło wartość zliczeniowego R^2 do poziomu 0,610 (w modelu wyjściowym: 0,571), jednakże obniżyło łączną istotność statystyczną zmiennych niezależnych. Wartość „ $\text{prob} > \chi^2$ ” wynosi 0,101 (wobec 0,093 w modelu wyjściowym), co sprawia, iż nie ma podstaw do odrzucenia hipotezy zerowej o braku wpływu zmiennych niezależnych na prawdopodobieństwo upadłości. Żaden z otrzymanych współczynników nie jest istotny statystycznie na poziomie ufności 90%. Również wykorzystanie zmiennych dotyczących krajów stanowiących w przeszłości władzę kolonialną (model 21) nie umożliwia formułowania istotnych statystycznie wniosków. Niemniej jednak, otrzymane współczynniki są dodatnie, co wskazuje na zwiększone prawdopodobieństwo upadłości państwa w przypadku byłych kolonii. W kolejnym modelu (22) uwzględniono dodatkowo zmienną dotyczącą sztuczności granic, która okazała się dodatnio skorelowana z prawdopodobieństwem upadłości. Nie jest jednak istotna statystycznie.

Model (23) stanowi pierwszy z grupy modeli uwzględniających obok zmiennych kontrolnych również zmienne o charakterze ekonomicznym. Włączenie do analiz danych dotyczących początkowego, średniego oraz końcowego PKB per capita sprawia, iż model łącznie jest istotny statystycznie na poziomie ufności 99%, zaś zliczeniowy R^2 rośnie do poziomu 0,836. Wszystkie otrzymane parametry przy zmiennych ekonomicznych są istotne statystycznie, lecz ich znaki są przeciwne. Początkowy oraz końcowy PKB per capita jest ujemnie skorelowany z prawdopodobieństwem upadłości, zaś wartość średnia jest skorelowana dodatnio. Oznacza to, iż kraje relatywnie biedniejsze (w momencie utworzenia oraz pod koniec okresu badawczego) są bardziej narażone na upadłość państwa. Do kolejnego modelu (24), obok zmiennych kontrolnych, dołączono zmienne dotyczące relacji wartości importu do PKB. Wartość zliczeniowego R^2 wzrosła do 74%, lecz otrzymane współczynniki są nieistotne statystycznie. Model (25) zawierający zmienne dotyczące relacji wartości eksportu do PKB charakteryzuje się wyższą łączną istotnością statystyczną modelu. Współczynnik stojący przy zmiennej dotyczącej końcowej relacji eksportu do PKB jest ujemny oraz istotny statystycznie. Oznacza to, iż państwa, które w większym stopniu uczestniczą w

międzynarodowej wymianie handlowej eksportując dobra i usługi, są mniej narażone na upadłość państwa, niż państwa z niższym udziałem eksportu w PKB.

Dołączenie do modelu wyjściowego (19) zmiennych związanych z początkową, średnią oraz końcową stopą wzrostu gospodarczego poprawiło trafność klasyfikacji (zliczeniowy $R^2=0,794$) oraz zwiększyło łączną istotność statystyczną modelu (patrz model 26). Zmienna dotycząca końcowej stopy wzrostu gospodarczego jest istotna statystycznie i ujemna, co oznacza, iż czynniki ekonomiczne mogą mieć charakter wyprzedzający względem upadłości państwa. Obniżenie stopy wzrostu gospodarczego może być więc symptomem zbliżającej się upadłości

Rozszerzenie modelu wyjściowego o dane dotyczące inflacji (model 27) obniżyło jego łączną istotność – nie ma podstaw do odrzucenia hipotezy o braku wpływu zmiennych niezależnych na zagrożenie upadłością państwa. Jednocześnie, współczynnik stojący przy zmiennej „średnia inflacja” jest nieistotny statystycznie na poziomie ufności 90%. Dołączenie do modelu wyjściowego zmiennych dotyczących „klątwy surowcowej” (28-29) spowodowało nieznaczne podwyższenie wartości zliczeniowego R^2 (do poziomu 0,610), jednakże zmienne niezależne są nieistotne statystycznie. Ostatni z opisywanej grupy, model (30) uwzględnia obok zmiennych kontrolnych również zmienne dotyczące dominującej religii. Parametry stojące przy tych zmiennych są nieistotne statystycznie, jednakże łączna istotność modelu pozwala na formułowanie wniosków na poziomie ufności 90%. Również wartość zliczeniowego R^2 jest wyższa niż w przypadku modelu wyjściowego (19) i wynosi 0,597.

Drugą grupę stanowią modele (31-33), w których uwzględniono odpowiednio: warunki początkowe, średnie oraz końcowe oraz przeszłość kolonialną i dominującą religię jako zmienne opisujące tzw. dryf instytucjonalny w danym państwie. W modelu (31) żadna ze zmiennych niezależnych nie okazała się istotna statystycznie, zaś cały model wyróżnia najniższy współczynnik poprawnych klasyfikacji. Model (32), zawierający średnie wartości charakteryzuje się wyższym zliczeniowym R^2 (0,848) niż model wyjściowy (19). Jedyną zmienną istotną na poziomie ufności 90% jest średnia wartość indeksu systemu politycznego (wartość parametru: -0,38). Państwa, które w trakcie okresu badawczego cechowały się wyższym poziomem demokratyzacji były mniej narażone na upadłość, niż państwa bardziej autokratyczne. Na podstawie modelu (33) zawierającego wartości zmiennych niezależnych w ostatnich latach okresu badawczego możliwe jest najlepsze dopasowanie wartości rzeczywistych i estymowanych za pomocą modelu. Wartość zliczeniowego R^2 wynosi ponad 0,95.

Analiza parametrów przy zmiennych wskazuje, iż państwa, które w ostatnim roku okresu badawczego miały wyższy PKB per capita są mniej narażone na upadłość, podobnie jak państwa notujące wyższe stopy wzrostu gospodarczego. Również większy udział wartości eksportu w PKB obniża zagrożenie wystąpienia upadłości państwa. Odwrotna relacja występuje dla udziału wartości importu w PKB. Przeszłość kolonialna wpływa na prawdopodobieństwo upadłości państwa. Państwa będące byłymi koloniami brytyjskimi są mniej narażone na upadłość, niż inne były kolonie, jednak jedynie wartość parametru dla byłych kolonii francuskich jest istotna. Dominująca religia jest nieistotna statystycznie.

Ostatnią grupę modeli (34) – (36) stanowią modele, do budowy których wykorzystano zmienne poprawiające właściwości modeli wykorzystanych wcześniej. Na podstawie analizy uzyskanych parametrów funkcji należy wskazać, iż wyższe końcowe wartości PKB per capita, jak i wyższe stopy wzrostu gospodarczego przyczyniają się do obniżenia zagrożenia upadłości państwa. Wartość parametru przy początkowym udziale importu w PKB jest istotna statystycznie we wszystkich modelach i przyjmuje wartości dodatnie, tzn. im wyższy początkowy import, tym większe zagrożenie upadłością państwa. Również parametry stojące przy średnich wartościach eksportu są istotne statystycznie, jednakże przyjmują one wartości ujemne. System polityczny także ma wpływ na zagrożenie wystąpienia upadłości. Im bardziej demokratyczne państwo na przestrzeni całego okresu badawczego, tym prawdopodobieństwo wystąpienia symptomów upadłości jest niższe. Zarówno uwzględnienie przeszłości kolonialnej, jak i dominującej religii podwyższa wartości zliczeniowego R^2 , jednakże uzyskane parametry nie są istotne statystycznie. Należy podkreślić także, iż jedynie model (35) nie daje podstaw do odrzucenia hipotezy o braku istotności parametrów stojących przy zmiennych niezależnych.

W kolejnym kroku obliczono ilorazy szans (ang. *odds ratio*) dla modeli o najwyższym udziale poprawnego przyporządkowania wartości wynikających z modelu do danych rzeczywistych. Wybrano jedynie te modele, które są łącznie istotne statystycznie. Ostatecznie do dalszej analizy zakwalifikowano modele: 31, 32, 33, 34 oraz 36. Wyznaczone wartości ilorazów szans zaprezentowano w Tabeli 28. Należy zaznaczyć, iż najwyższym poziomem współczynnika poprawnych klasyfikacji, przy jednoczesnej istotności większości z estymowanych parametrów charakteryzuje się model (36). Prawidłowo przyporządkowano 93,9% obserwacji. Łączna istotność statystyczna parametrów została potwierdzona na poziomie ufności 99%.

Tabela 28. Wyniki estymacji – model logitowy – ilorazy szans (*odds ratio*)

Zmienna		Oznaczenie modelu				
		(31)	(32)	(33)	(34)	(36)
System polityczny (<i>Polity IV</i>)	początkowy	1,026				
	średni		0,683**		0,570**	0,395**
	końcowy			1,044		
Przeszłość kolonialna						
Była kolonia brytyjska		0,703	1,508	0,009		
Była kolonia francuska		1,920	3,018	95,569*		
Inna była kolonia		70,813	89,504	>1000		
Sztuczność granic						
PKB per capita	początkowy	0,999				
	średni		0,999			
	końcowy			0,998*		0,997
Import (%PKB)	początkowy	1,023			1,075*	1,155**
	średni		1,033			
	końcowy			1,106*		
Export (%PKB)	początkowy	0,991				
	średni		0,909		0,804***	0,762*
	końcowy			0,926		
Stopa wzrostu gospodarczego	początkowa	1,053				
	średnia		1,042			
	końcowa			0,356**	0,653**	0,470**
Średnia inflacja						
Kłątwa surowcowa	ogółem					
	paliwa					
	surowce					
Dominująca religia	katolicyzm	0,774	0,046	0,000		0,154
	islam	4,656	2,004	0,079		11,261
	inna					
stała		0,105	0,112	0,571		1,257
Zliczeniowy R ²		0,758	0,848	0,954	0,864	0,939
prob > chi ²		0,063	0,003	0,000	0,026	0,000

Uwaga: *, **, *** oznaczono istotność statystyczną na poziomie odpowiednio 10%, 5% oraz 1%.

Źródło: obliczenia własne.

4.4. Podsumowanie

W przeprowadzonym badaniu z wykorzystaniem analizy dyskryminacyjnej określono kierunek i statystyczną istotność wpływu wybranych czynników na zagrożenie upadłością państwa. Na podstawie modelu charakteryzującego się najwyższym współczynnikiem poprawnych klasyfikacji (model 17) możliwe jest sformułowanie następujących wniosków dotyczących wpływu zmiennych ekonomicznych, politycznych oraz pozostałych (w tym geograficznych, historycznych, kulturowych) na zagrożenie wystąpienia upadłości państwa:

- 1) Kraje o niższym średnim PKB per capita w badanym okresie są bardziej zagrożone upadłością.
- 2) Kraje, których gospodarki rozwijały się szybciej (tj. notowały wyższe średnie stopy wzrostu gospodarczego), są mniej narażone na upadłość państwa.
- 3) Kraje, które od początku swojego istnienia charakteryzowały się wysokim poziomem importu w relacji do PKB są bardziej zagrożone upadłością.
- 4) W państwach, których średni poziom eksportu w relacji do PKB jest wyższy, zagrożenie upadłością maleje.
- 5) Wraz ze wzrostem wartości indeksu systemu politycznego *Polity IV* maleje prawdopodobieństwo upadłości państwa, tj. kraje, których system polityczny wykazuje więcej cech systemu demokratycznego, są mniej zagrożone upadłością.
- 6) Fakt utworzenia państwa na drodze ustania stosunku kolonialnego (dekolonizacji) zwiększa zagrożenie upadłością państwa dla wszystkich byłych kolonii, z wyjątkiem byłych kolonii brytyjskich.
- 7) Dominująca religia wpływa na zagrożenie upadłością; państwa, w których dominuje katolicyzm, są mniej narażone na upadłość, podczas gdy kraje, w których większość wyznaje islam są narażone bardziej.

Na podstawie uzyskanych wyników można wnioskować, iż czynniki ekonomiczne (takie jak PKB per capita oraz stopa wzrostu gospodarczego), polityczne (system polityczny) oraz geograficzno-kulturowe (przeszłość kolonialna, dominująca religia) warunkują zagrożenie upadłością państwa. Zaznaczyć należy, iż jedynie zmienne dotyczące przeszłości kolonialnej, eksportu oraz końcowej stopy wzrostu gospodarczego są istotne statystycznie na poziomie ufności wynoszącym 90%.

Wykorzystanie regresji logistycznej umożliwiło z kolei określenie siły, kierunku oraz istotności statystycznej wpływu zmiennych niezależnych na zagrożenie upadłością państwa. Dodatkowo, wyznaczenie współczynników tzw. ilorazu szans pozwoliło na określenie skali wpływu zmian poszczególnych zmiennych na zmianę prawdopodobieństwa upadłości państwa. Na podstawie modelu o najlepszym stopniu dopasowania (model 36) sformułowano następujące wnioski:

- 1) Końcowa wartość PKB per capita nie jest istotna statystycznie, jednakże estymowany parametr wskazuje, iż kraje relatywnie bogatsze są mniej zagrożone upadłością państwa.
- 2) Wartość stopy wzrostu gospodarczego (mierzona zmianą PKB per capita) jest istotna statystycznie. Obniżenie tempa wzrostu gospodarczego w ostatnich latach okresu badawczego o 1 punkt procentowy przyczynia się do wzrostu zagrożenia upadłością państwa o 53%.
- 3) Wymiana handlowa jest czynnikiem determinującym prawdopodobieństwo upadłości państwa. Wysokie uzależnienie gospodarki od importowanych produktów może wpływać na wzrost zagrożenia upadłością, podczas gdy wyższe wartości eksportu zmniejszają zagrożenie upadłością.
- 4) Początkowa relacja importu do PKB jest istotna statystycznie, zaś wzrost udziału importu w PKB o 1 punkt procentowy podwyższa zagrożenie upadłością państwa o 15,5%.
- 5) Średnia relacja eksportu do PKB w całym okresie badawczym jest istotna statystycznie. Zmniejszenie wartości eksportu o 1 punkt procentowy podwyższa prawdopodobieństwo upadłości państwa o 23,8%.
- 6) Średnia wartość oceny systemu politycznego *Polity IV* jest statystycznie istotna, a jej spadek o 1 punkt powoduje wzrost prawdopodobieństwa wystąpienia upadłości państwa o 60,5%. Państwa, w których funkcjonują systemy mniej demokratyczne są bardziej zagrożone upadłością.
- 7) Dominująca religia nie jest istotna statystycznie, niemniej jednak kraje, w których dominującym wyznaniem jest katolicyzm są mniej narażone na upadłość niż kraje, w których dominują muzułmanie.

W trakcie prowadzonej analizy dokonano porównanie estymowanych modeli, otrzymanych z wykorzystaniem dwóch metod: analizy dyskryminacyjnej oraz regresji logistycznej. Zestawienie wyników, a także ich graficzna prezentacja znajdują się

poniżej. Z uwagi na wysoki stopień dopasowania oraz łączną statystyczną istotność do porównania wybrano modele (17) oraz (36).

Tabela 29. Porównanie wyników estymacji – modele (17) oraz (36)

Zmienna		Oznaczenie modelu	
		(17) analiza dyskryminacyjna	(36) model logitowy, <i>odds ratio</i>
System polityczny (<i>Polity IV</i>)	średni	-0,17	0,395**
Była kolonia brytyjska		-0,25	
Była kolonia francuska		0,18	
Inna była kolonia		0,50*	
PKB per capita	średni	-0,12	
	końcowy		0,997
Import (%PKB)	początkowy	0,10	1,155**
Export (%PKB)	średni	-0,58**	0,762*
Stopa wzrostu gospodarczego	końcowa	-0,81**	0,470**
Dominująca religia	katolicyzm	-0,44	0,154
	islam	0,01	11,261
stała			1,257
Zliczeniowy R ²		0,909	0,939
Liczba obserwacji		66	66

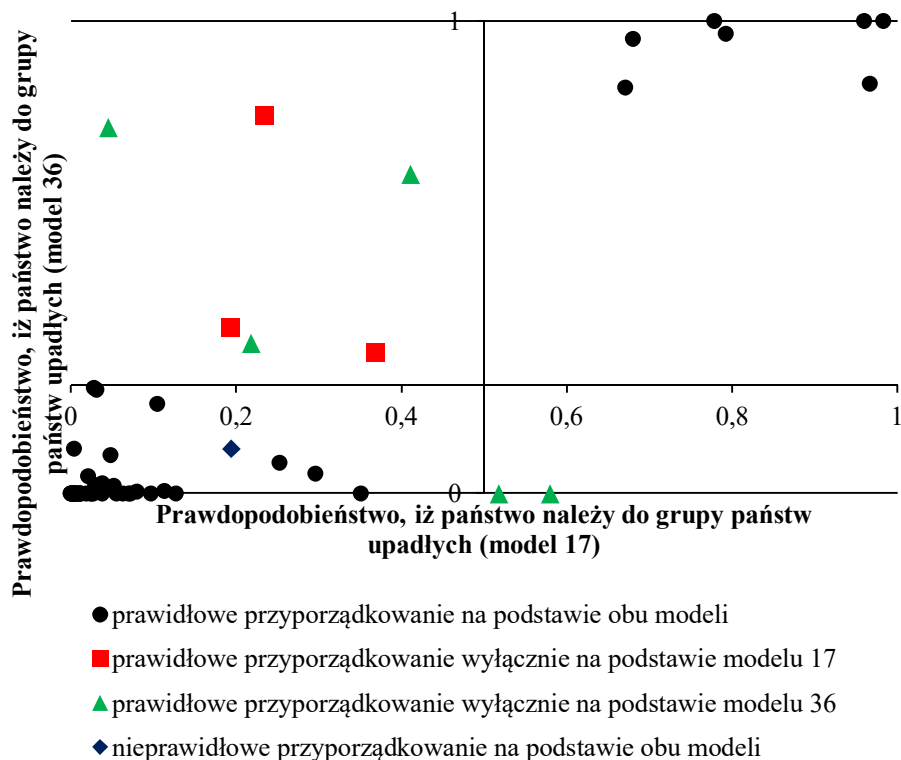
Uwaga: *, **, *** oznaczono istotność statystyczną na poziomie odpowiednio 90%, 95% oraz 99%.

Źródło: obliczenia własne.

Do ostatecznej analizy wykorzystano 66 z 77 pierwotnie wybranych obserwacji. Jest to spowodowane brakiem kompletu danych dla 6 krajów, w których odnotowano upadłość (Cypru, Kuwejt, Wysp Salomona, Somalii, Sudanu Południowego oraz Ugandy) oraz dla 5 krajów, w których nie zaobserwowano symptomów upadłości (Timoru Wschodniego, Erytrei, Gujany, Kosowa oraz Papui Nowej Gwinei). Wybrane do porównania modele wskazują identyczne kierunki wpływu badanych zmiennych niezależnych na zagrożenie upadłością państwa. Z uwagi na różnice w procesie

estymacji nie jest możliwe bezpośrednie porównanie siły wpływu. Na podstawie analizy otrzymanych parametrów należy wskazać, iż (bez względu na przyjętą metodę) demokratyczny system polityczny zmniejsza zagrożenie upadłością państwa. Wskazuje na to ujemna wartość parametru przy zmiennej w przypadku analizy dyskryminacyjnej, a także mniejsza od jedności wartość ilorazu szans w modelu logitowym. Wyższy PKB per capita zmniejsza zagrożenie upadłością. Wskazać należy również na powiązanie pomiędzy wymianą handlową a upadłością – im relacja importu do PKB wyższa oraz im stosunek eksportu do PKB niższy, tym zagrożenie upadłością jest większe. Wraz ze zwiększeniem stopy wzrostu gospodarczego maleje zagrożenie upadłością, szczególnie dla wartości z końca okresu badawczego. Potwierdzenie w wynikach badania znalazł również fakt, iż państwa o dominującej religii katolickiej są mniej narażone na upadłość, niż państwa islamskie.

Na Wykresie 14. przedstawiono graficzne porównanie wyników otrzymanych za pomocą obu metod. W celu zwiększenia przejrzystości prezentowanych danych, na wykresie zaznaczono wartość prawdopodobieństwa, z jakim można przyporządkować obserwacje do odpowiednich grup (państw upadłych lub nieupadłych) z wykorzystaniem modeli analizy dyskryminacyjnej oraz regresji logistycznej. Z uwagi na fakt, iż występuje znaczna różnica pomiędzy liczebnością grupy państw upadłych i nieupadłych w analizowanej grupie, w trakcie analizy dyskryminacyjnej nadano obserwacjom odpowiednie wagi tak, aby próba została zbilansowana. Wartość krytyczna prawdopodobieństwa dzieląca przyporządkowanie do grupy państw upadłych oraz nieupadłych wynosi zatem 0,5. Proces estymacji parametrów w regresji logistycznej nie zawierał nadawania wag, stąd wartość krytyczna pomiędzy poszczególnymi grupami jest równa udziałowi państw upadłych w ogólnej liczbie badanych państw i wynosi 0,23. W pierwszej ćwiartce układu kartezyjskiego zaznaczono państwa, które zostały przyporządkowane jako upadłe na podstawie obu analizowanych modeli – z wykorzystaniem analizy dyskryminacyjnej (model 17) oraz regresji logistycznej (model 36). Druga ćwiartka zawiera obserwacje przyporządkowane jako upadłe na podstawie regresji logistycznej oraz jako nieupadłe na podstawie analizy dyskryminacji. W trzeciej ćwiartce znajdują się państwa, które zostały sklasyfikowane jako nieupadłe na podstawie obu modeli. Z kolei w czwartej ćwiartce znajdują się państwa, które zostały przyporządkowane jako upadłe na podstawie analizy dyskryminacji oraz jako nieupadłe na podstawie regresji logistycznej.



Wykres 14. Porównanie wyników estymacji – modele (17) oraz (36)

Źródło: opracowanie własne

Spośród 66 analizowanych krajów, 57 (86,36%) zostało prawidłowo zaklasyfikowanych na podstawie obu modeli. Pięć państw (7,58%) zostało poprawnie przydzielonych do poszczególnych grup (upadłe oraz nieupadłe) na podstawie modelu z wykorzystaniem regresji logistycznej, błędnie zaś na podstawie analizy dyskryminacji. Są to: Lesoto, Wybrzeże Kości Słoniowej, Republika Południowej Afryki, Algieria oraz Surinam. Kolejne 3 państwa (4,55%) poprawnie sklasyfikowano na podstawie analizy dyskryminacji, a błędnie na podstawie regresji logistycznej. Są to Malawi, Burkina Faso oraz Niger. Jedyne państwo (1,52%), które zostało błędnie przyporządkowane (jako nieupadłe) na podstawie obu modeli to Mali. Prawdopodobieństwa, z jakimi możliwe jest przyporządkowanie poszczególnych państw do grupy państw upadłych wraz z oceną poprawności klasyfikacji zawarto w Tabeli 30.

Tabela 30. Ocena trafności klasyfikacji z wykorzystaniem modeli analizy dyskryminacyjnej oraz regresji logistycznej

Kraj	Państwo upadłe	Prawdopodobieństwo wystąpienia upadłości		Poprawna klasyfikacja	
		(model 17)	(model 36)	(model 17)	(model 36)
Algieria	nie	0,58	0	nie	tak
Angola	tak	0,967	0,868	tak	tak
Armenia	nie	0,063	0	tak	tak
Azerbejdżan	nie	0,127	0	tak	tak
Bahrajn	nie	0,004	0	tak	tak
Bangladesz	nie	0,08	0,004	tak	tak
Benin	nie	0,01	0	tak	tak
Białoruś	nie	0,006	0	tak	tak
Botswana	nie	0	0	tak	tak
Burkina Faso	nie	0,194	0,351	tak	nie
Burundi	tak	0,793	0,974	tak	tak
Chorwacja	nie	0,003	0	tak	tak
Czad	tak	0,779	1	tak	tak
Czarnogóra	nie	0,01	0	tak	tak
Czechy	nie	0,001	0	tak	tak
Dżibuti	nie	0,031	0,22	tak	tak
Fidżi	nie	0,002	0	tak	tak
Gabon	nie	0,07	0	tak	tak
Gambia	nie	0,048	0,081	tak	tak
Ghana	nie	0,253	0,065	tak	tak
Gruzja	nie	0,01	0	tak	tak
Gwinea Bissau	tak	0,68	0,963	tak	tak
Gwinea Równikowa	nie	0,002	0	tak	tak
Jemen	tak	0,671	0,86	tak	tak
Kamerun	nie	0,03	0,017	tak	tak
Katar	nie	0,019	0	tak	tak
Kazachstan	nie	0,027	0	tak	tak
Kenia	nie	0,03	0,003	tak	tak
Kirgistan	nie	0,024	0	tak	tak
Komory	tak	0,983	1	tak	tak
Kongo (Brazzaville)	nie	0,113	0,005	tak	tak
Lesoto	tak	0,045	0,776	nie	tak
Macedonia	nie	0,003	0	tak	tak
Madagaskar	nie	0,055	0	tak	tak
Malawi	nie	0,234	0,8	tak	nie

Kraj	Państwo upadłe	Prawdopodobieństwo wystąpienia upadłości		Poprawna klasyfikacja	
		(model 17)	(model 36)	(model 17)	(model 36)
Mali	tak	0,194	0,094	nie	nie
Mauretania	nie	0,012	0	tak	tak
Mauritius	nie	0,006	0	tak	tak
Mołdawia	nie	0,003	0	tak	tak
Mozambik	nie	0,025	0	tak	tak
Namibia	nie	0,001	0	tak	tak
Niger	nie	0,369	0,3	tak	nie
Nigeria	nie	0,072	0	tak	tak
Republika Środkowoafrykańska	tak	0,218	0,319	nie	tak
Republika Zielonego Przylądka	nie	0,351	0	tak	tak
Ruanda	nie	0,296	0,042	tak	tak
Senegal	nie	0,097	0	tak	tak
Serbia i Czarnogóra	nie	0,003	0	tak	tak
Sierra Leone	tak	0,96	1	tak	tak
Słowacja	nie	0	0	tak	tak
Słowenia	nie	0	0	tak	tak
Suazi	nie	0,038	0,022	tak	tak
Sudan	nie	0,021	0,037	tak	tak
Surinam	nie	0,518	0	nie	tak
Tadżykistan	nie	0,105	0,19	tak	tak
Tanzania	nie	0,004	0,094	tak	tak
Togo	nie	0,012	0	tak	tak
Trinidad i Tobago	nie	0,004	0	tak	tak
Turkmenistan	nie	0,001	0	tak	tak
Ukraina	nie	0,038	0	tak	tak
Uzbekistan	nie	0,028	0,223	tak	tak
Wietnam	nie	0,008	0	tak	tak
Wybrzeże Kości Słoniowej	tak	0,411	0,676	nie	tak
Zambia	nie	0,052	0,016	tak	tak
Zimbabwe	nie	0,003	0	tak	tak
Zjednoczone Emiraty Arabskie	nie	0,006	0	tak	tak

Uwaga: Wartość krytyczna w modelu 17 (analiza dyskryminacyjna) wynosi 0,5. Wartość krytyczna w modelu 36 (model logitowy) wynosi 0,23. Szarym tłem oznaczono prawidłowe przyporządkowanie na podstawie modelu.

Źródło: obliczenia własne.

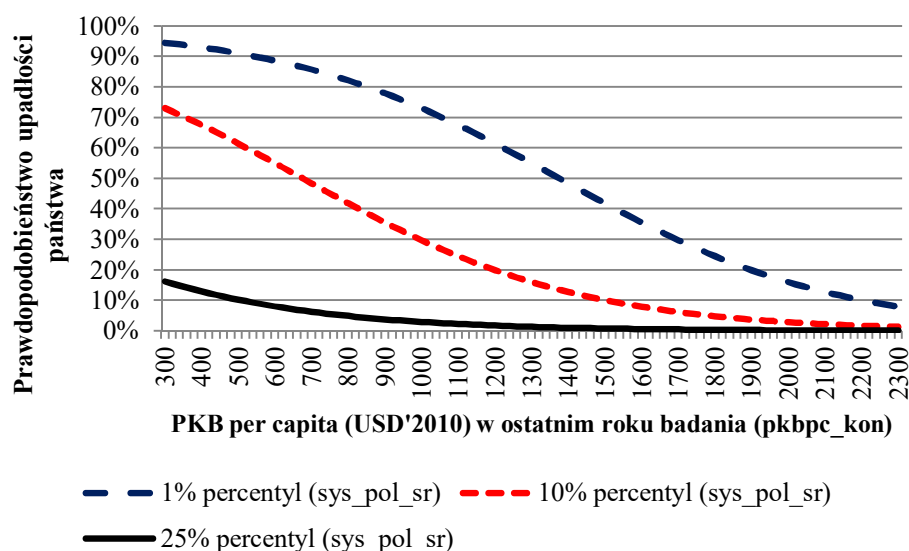
Uzyskane modele charakteryzowały się wysokim poziomem prawidłowych klasyfikacji – za ich pomocą możliwe było właściwe przyporządkowanie ponad 90% krajów objętych analizą. Na podstawie uzyskanych wyników możliwe jest zweryfikowanie hipotez badawczych postawionych na początku badania.

Hipoteza 1., zgodnie z którą czynniki ekonomiczne i polityczne determinują zagrożenie upadłością państwa, **została zweryfikowana pozytywnie**. Świadczą o tym istotne statystycznie parametry stojące przy zmiennych określających system polityczny, wartość eksportu i importu w relacji do PKB, a także stopy wzrostu gospodarczego. Z uwagi na fakt, iż Hipoteza 1. została pozytywnie zweryfikowana, zasadne jest poddanie weryfikacji kolejnych hipotez. Doprecyzowują one bowiem kierunek wpływu wybranych czynników ekonomicznych i politycznych na zagrożenie upadłością państwa.

Hipoteza 2. brzmi następująco: „prawdopodobieństwo upadłości państwa maleje wraz z poprawą sytuacji ekonomicznej”. Została ona **zweryfikowana pozytywnie**, z uwagi na istotne statystycznie oraz ujemne współczynniki stojące przy stopach wzrostu gospodarczego. Podkreślić należy również, iż zmienne dotyczące poziomów PKB per capita są negatywnie skorelowane z zagrożeniem państwa upadłością – im sytuacja ekonomiczna państwa jest lepsza, tym zagrożenie upadłością mniejsze.

Na Wykresie 15. zaprezentowano zależność pomiędzy prawdopodobieństwem upadłości państwa (szacowanym zgodnie z modelem 36) a PKB per capita w ostatnim roku badania. Z uwagi na fakt, iż czynniki ekonomiczne i polityczne są od siebie wzajemnie zależne, określono poziom prawdopodobieństwa dla trzech podgrup: (1) gdy wskaźnik systemu politycznego przyjmuje wartość -10, co odpowiada pierwszemu percentylowi grupy badawczej, (2) wskaźnik systemu politycznego jest równy -8 (tj. 10. percentyl próby) oraz (3) wartość wskaźnika wynosi -5,16 (25. percentyl)¹⁰⁰.

¹⁰⁰ Pozostałe wartości zmiennych niezależnych są równe ich medianom, tj. import_pocz=33,87, eksport_sr=30,74, wzr_gosp_konc=3,18, religia_katolik=0, religia_islam=0.



Wykres 15. Zależność pomiędzy PKB per capita a prawdopodobieństwem upadłości państwa

Uwagi: Prawdopodobieństwo upadłości państwa wyznaczono z wykorzystaniem modelu 36. Zmienne niezależne (poza końcowym PKB per capita oraz wartością indeksu systemu politycznego) przyjmują wartości równe swoim medianom.

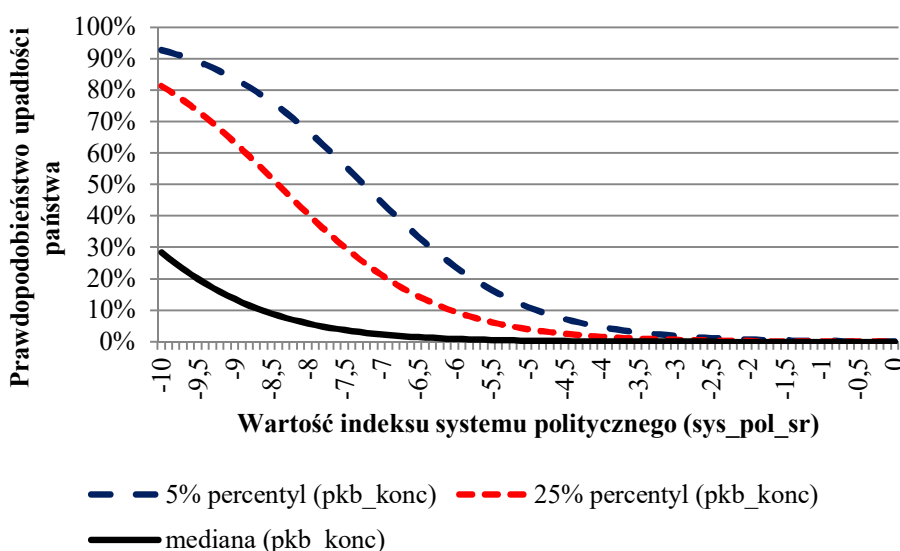
Źródło: opracowanie własne.

Wraz ze wzrostem poziomu PKB per capita w ostatnim roku badania zagrożenie wystąpienia upadłości maleje. W przypadku podgrupy (1) prawdopodobieństwo upadłości spada poniżej 50%, gdy PKB per capita jest wyższe, niż 1380 USD oraz poniżej 10%, gdy PKB per capita wynosi ok. 2220 USD. W podgrupie (2) wartości te wynoszą odpowiednio 680 USD oraz 1520 USD. W podgrupie (3) najwyższe prawdopodobieństwo upadłości państwa wynosi 16%. Poniżej 10% spada w sytuacji, gdy końcowe PKB per capita jest wyższe niż 500 USD.

Zaobserwować można więc znaczące różnice w oszacowanych wartościach prawdopodobieństwa. Wyższy poziom zagrożenia upadłością państwa jest skorelowany z niższym produktem krajowym brutto per capita. Dzieje się tak, ponieważ w państwach o wysokim poziomie dochodu narodowego występują większe koszty wypowiedzenia posłuszeństwa władzy centralnej. Zadowolenie społeczne jest na wyższym poziomie, a ilość i jakość dostarczanych dóbr publicznych istotnie redukują zagrożenie niestabilnością polityczną i masowymi protestami. Dodatkowo, państwa o wyższym poziomie PKB per capita czerpią większe wpływy z tytułu podatków, dzięki którym możliwe jest finansowanie sił porządkowych zapewniających bezpieczeństwo wewnętrzne (brak wojen domowych i zorganizowanej przemocy na terenie kraju) oraz ochroną przed agresją zewnętrzną.

Hipoteza 3, zgodnie z którą prawdopodobieństwo upadłości państwa jest niższe w krajach demokratycznych, **została zweryfikowana pozytywnie**. Współczynnik stojący przy zmiennej określającej system polityczny jest istotny statystycznie oraz ujemny. Oznacza to, iż wraz ze zwiększeniem ilości cech demokratycznych systemu politycznego, zagrożenie państwa upadłością maleje. Państwa demokratyczne są więc mniej zagrożone upadłością, niż państwa autorytarne.

Na Wykresie 16. zaprezentowano zależność pomiędzy system politycznym a prawdopodobieństwem upadłości państwa. Oszacowano zagrożenie wystąpienia upadłości uwzględniając trzy hipotetyczne przypadki: (1) państwo o najniższym dochodzie na mieszkańca, w których końcowe PKB per capita wynosi 409 USD - jest to granicą piątego percentyla w próbie, (2) państwo, którego PKB per capita jest równy 819 USD (25. percentyl próby) oraz (3) gdy PKB per capita wynosi 1722 USD (mediana)¹⁰¹.



Wykres 16. Zależność pomiędzy system politycznym a prawdopodobieństwem upadłości państwa

Uwagi: Prawdopodobieństwo upadłości państwa wyznaczono z wykorzystaniem modelu 36. Zmienne niezależne (poza końcowym PKB per capita oraz wartością indeksu systemu politycznego) przyjmują wartości równe swoim medianom.

Źródło: opracowanie własne.

Wraz z przyrostem wartości systemu politycznego *Polity IV* (wraz ze wzrostem ilości cech demokratycznych systemu) można zaobserwować znaczny spadek zagrożenia wystąpienia upadłości. Prawdopodobieństwo wystąpienia badanego zjawiska jest, bez względu na PKB per capita, niższe niż 50% dla państw, których

¹⁰¹ Pozostałe zmienne niezależne przyjmują wartości równe ich medianom, por. przypis 100.

ocena systemu politycznego jest wyższa od -7,2. Jeśli wartość *Polity IV* jest wyższa od -4,8, to prawdopodobieństwo spada poniżej 10%. Dla państw z systemem politycznym przyjmującym więcej cech systemu demokratycznego niż autokratycznego (tj. dla dodatnich wartości *Polity IV*), prawdopodobieństwo upadłości jest niższe niż 0,12%.

Analiza Wykresu 16. wskazuje na występowanie znacznych różnic w zagrożeniu wystąpienia upadłości państwa w zależności od przyjętego systemu politycznego. Państwa demokratyczne są znacznie mniej zagrożone upadłością niż państwa autorytarne. Jak wykazano w Rozdziale 2., jest to spowodowane w głównej mierze sposobem stanowienia i wykonywania prawa przez organy rządzące. W warunkach systemu autokratycznego obywatele nie mają wystarczającej siły ekonomicznej i politycznej z uwagi na funkcjonujące instytucje o charakterze wyzyskującym, aby wywierać presję na rządzących. Przyczynia się to do opóźniania wprowadzania niezbędnych reform. Z kolei istniejące sprzężenie zwrotne pomiędzy obywatelami a organami rządzącymi, które jest charakterystyczne dla państw demokratycznych, gwarantuje szybsze dostosowywanie prawa do zmieniających się warunków. Wykazano również, iż demokratyczny system polityczny zapewnia większą efektywność wykorzystywania posiadanych zasobów, ogranicza zjawisko nielegalnej pogoni za rentą oraz gwarantuje prawa własności.

Uzyskane w procesie badań empirycznych wyniki w większości są zgodne z pracami innych autorów na temat uwarunkowań upadłości państwa. Czynniki polityczne, które Acemoglu i Robinson [2006] oraz North, Wallis i Weingast [2009a], uważają za przyczynę kształtowania się sytuacji ekonomicznej i, w dalszej perspektywie, stabilności państwa okazały się istotne statystycznie. Nie ulega zatem wątpliwości, że na sprawność instytucjonalną państwa ma wpływ system polityczny (w tym przyjęte rozwiązania w zakresie dostępu do władzy, jej kontroli, a także możliwości ewentualnej pokojowej zmiany). Szereg czynników ekonomicznych również istotnie statystycznie determinuje zagrożenie państwa upadłością. O ile w literaturze przedmiotu istnieje zgoda co do pozytywnego wpływu wysokiego poziomu PKB per capita i szybkiego tempa wzrostu gospodarczego na zmniejszenie zagrożenia upadłości państwa [Carment, Prest, Samy 2008; Bertocchi, Guerzoni 2012; Easterly 2013], o tyle kwestie związane z wymianą handlową są wciąż nierozstrzygnięte. Otrzymane w trakcie badania wnioski potwierdzają wyniki otrzymane m.in. Sowell [2016], zgodnie z którymi wymiana międzynarodowa umacnia pozycję państwa na arenie międzynarodowej, co w konsekwencji obniża zagrożenie upadłością. Nie

znaleziono dowodów na poparcie twierdzenia o możliwych negatywnych skutkach wymiany międzynarodowej [Baliamoune-Lutz 2009], szczególnie w kontekście sytuacji państw wrażliwych i upadających. Na szczególną uwagę zasługuje także analiza wpływu czynników historycznych, w tym przeszłości kolonialnej, na zagrożenie upadłością. W przeprowadzonym badaniu wykazano, iż fakt bycia byłą kolonią zwiększa zagrożenie państwa upadłością, a siła owego wpływu zależy od państwa-kolonizatora. Twierdzenia o negatywnych konsekwencjach chaotycznej dekolonizacji, o których pisał Sachs [2006] znajdują więc potwierdzenie w danych empirycznych. Liczne badania wskazujące na wyższość brytyjskiego systemu kolonialnego, w tym ze względu na oddolne tworzenie prawa i większy stopień dopasowania przepisów do warunków lokalnych [por. Easterly 2008; Karadeli 2009; Lee, Schultz 2012], również zostały potwierdzone. Teoretyczne rozważania Di Johna [2008] o wpływie spuścizny prawnej i kulturowej z okresu kolonialnego na stabilność państwa, są zgodne z otrzymanymi wynikami empirycznymi. Co zastanawiające, nie znaleziono dowodów na poparcie tezy o negatywnym wpływie tzw. „klątwy surowcowej” na zagrożenie upadłością państwa, na co wskazywali m.in. Klare [2001] oraz Collier, Hoeffler [2004]. Zagadnienie to wymaga dalszych, szczegółowych analiz.

Wpływ czynników kulturowych, w tym religii jest zgodny z wynikami badań m.in. Jacoby’ a [2005], Fernandez [2010] oraz Desmenta, Ortuño-Ortina i Wacziarga [2015].

Zakończenie

Celem niniejszej pracy była prezentacja i ocena głównych przyczyn upadłości państwa, ze szczególnym uwzględnieniem czynników ekonomicznych oraz politycznych. Omawianie uwarunkowań upadłości nie było jednak możliwe bez określenia roli współczesnego państwa w gospodarce. Na podstawie krytycznego przeglądu literatury stwierdzono, iż należy wyróżnić kilka jego podstawowych zadań. Pierwszym i najważniejszym z nich jest zapewnienie bezpieczeństwa ludziom żyjącym na terytorium danego państwa, zarówno w kontekście ograniczania zorganizowanej przemocy, jak również ochrony granic zewnętrznych. Niezbędna jest więc zdolność organów rządzących do utrzymywania monopolu na używanie przemocy na terenie kraju. Kolejne zadania państwa koncentrują się wokół tworzenia i utrzymywania systemu społeczno-gospodarczego, który umożliwi swobodną wymianę dóbr i usług pomiędzy jednostkami (tzw. włączające instytucje ekonomiczne) oraz gwarantuje możliwość wpływania na bieżącą i przyszłą sytuację polityczną (tzw. włączające instytucje polityczne). Państwa, które nie zapewniają włączających instytucji, częściej doświadczają upadłości rozumianej jako brak realnej siły i legitymizacji do sprawowania władzy ze strony rządzących oraz brak zdolności do przymusu wykonywania aktów prawnych na terenie całego kraju.

Dokonując krytycznego przeglądu literatury stwierdzono, iż możliwe jest wyróżnienie trzech głównych grup czynników wpływających na poziom zagrożenia państwa upadłością. Są to czynniki ekonomiczne, polityczne oraz pozostałe (w tym geograficzne, historyczne, kulturowe). Do grupy czynników ekonomicznych należą poziom i stopa wzrostu produktu krajowego brutto per capita, wartość wymiany handlowej oraz zagrożenie wystąpienia tzw. klątwy surowcowej. Wśród zidentyfikowanych czynników politycznych wyróżniono z kolei system polityczny funkcjonujący w danym kraju oraz przeszłość kolonialną. Ostatnią grupę czynników stanowią pozostałe czynniki, wśród których wymienia się sposób, w jaki państwo zostało utworzone (np. secesja, podział, dekolonizacja), fakt posiadania tzw. „sztucznych granic” oraz dominującą religię.

Na podstawie tych ustaleń przeprowadzono statystyczną i ekonometryczną analizę mającą na celu weryfikację hipotez postawionych w pracy. Badanie uzupełniające zidentyfikowaną lukę badawczą w zakresie potrzeby łącznej analizy licznego zestawu determinant z kilku kategorii w długim horyzoncie czasowym

pozwoiliło na rozpoznanie oraz opisanie uwarunkowań upadłości państwa. Na podstawie badania 77 państw, które zostały utworzone w 1960 roku i później, wykazano, iż czynniki ekonomiczne, polityczne oraz geograficzne, historyczne i kulturowe mają wpływ na poziom zagrożenia państwa upadłością.

Dowiedziano, że poziom PKB per capita determinuje zagrożenie państwa upadłością, a wraz z jego wzrostem (zarówno biorąc pod uwagę wartości w ostatnim roku badania, jak i średnie) prawdopodobieństwo wystąpienia upadłości spada. Państwa, w których mieszkańcy mają zapewniony dostęp do podstawowych dóbr publicznych, są mniej narażone na próby nielegalnego przejęcia władzy przez grupy interesu. Również wraz ze zwiększaniem się średniego tempa wzrostu gospodarczego obserwuje się spadek zagrożenia upadłością. Otrzymane wyniki potwierdzają wnioski płynące z krytycznego przeglądu literatury, zgodnie z którym wyższy poziom PKB per capita, a także wyższe stopy wzrostu gospodarczego są pozytywnie skorelowane z ograniczaniem zagrożenia upadłością. Dowiedziano także, iż skala wymiany handlowej wpływa na prawdopodobieństwo wystąpienia upadłości. Państwa, które na początku swojego istnienia charakteryzowały się relatywnie wysokimi wartościami importu (w relacji do PKB) są bardziej zagrożone upadłością z uwagi na fakt, iż wzrost i rozwój gospodarczy uzależniony jest od relacji z innymi państwami. Z kolei wyższe wartości eksportu skorelowane są z mniejszym ryzykiem wystąpienia upadłości, z powodu konieczności respektowania międzynarodowych norm, które sprzyjają także osiągnięciu wyższych stóp wzrostu gospodarczego. Wpływ klątwy surowcowej okazał się nieistotny statystycznie.

Empirycznie wykazano także, że funkcjonujący system polityczny jest związany z prawdopodobieństwem wystąpienia upadłości. Wprowadzie rozwiązania instytucjonalne przyjęte w momencie tworzenia państwa nie są statystycznie istotne, jednakże system polityczny funkcjonujący w kolejnych latach wpływa na zagrożenie upadłością – im posiada on więcej cech systemu demokratycznego, tym prawdopodobieństwo upadłości jest niższe. Wynika to z faktu, iż system polityczny nie tylko determinuje sposób wyboru i kontroli władzy, ale także określa metody rozwiązywania sporów pomiędzy jednostkami. W państwach, w których system polityczny wykazuje więcej cech systemu demokratycznego, rzadziej dochodzi do masowych protestów, prób zbrojnego zamachu stanu i innych działań mających na celu obalenie władzy. Demokratyczny system polityczny zmniejsza zatem zagrożenie państwa upadłością.

Otrzymane wyniki wskazują również, że przeszłość kolonialna, dominująca religia oraz fakt posiadania sztucznych granic nie wpływają bezpośrednio na zagrożenie wystąpienia upadłości państwa. Jak wynika z przeglądu literatury, państwa, które w przeszłości były koloniami europejskich mocarstw, nie zmieniają swoich instytucji nawet po uzyskaniu pełnej autonomii. Szczególny wpływ na zagrożenie upadłością ma system prawny. Wskazuje się, że były kolonie brytyjskie są mniej narażone na upadłość z uwagi na oddolny system tworzenia prawa, który oparty jest na precedensach, a w konsekwencji bardziej dostosowany do lokalnego pojmowania sprawiedliwości. Z kolei kolonie, w których funkcjonował i funkcjonuje nadal system prawa cywilnego (odgórny sposób tworzenia prawa polegający na spisaniu w aktach prawnych wszystkich wykroczeń i przestępstw oraz określeniu wysokości kar za ich popełnienie) są bardziej narażone na upadłość. Wpływ dominującej religii nie jest jednoznacznie określony, niemniej jednak państwa, w których większość obywateli wyznaje wiarę chrześcijańską (katolicką, protestancką, prawosławną), statystycznie częściej zapewniają włączające instytucje ekonomiczne i polityczne, co obniża zagrożenie upadłością. W państwach, gdzie dominuje wyznawanie islamu, obserwuje się z kolei większe ograniczenia wolności osobistych (wyzyskujące instytucje), stąd zagrożenie upadłością jest większe. Fakt posiadania przez państwo sztucznych granic (tj. takich, które są wydzielone arbitralnie, mają charakter zbliżony do liniowego oraz nie korespondują z podziałem etnicznym oraz językowym grup zamieszkujących dane terytorium) zwiększa zagrożenie państwa upadłością z uwagi na możliwe konflikty wewnętrzne, a także brak wspólnej idei państwa (w rozumieniu Barrego Buzana). Brak statystycznej istotności wymienionych zmiennych może wynikać z faktu, iż są one wzajemnie powiązane z przyjętymi rozwiązaniami instytucjonalnymi i systemem politycznym, który (jak opisano powyżej) wpływa na zagrożenie upadłością.

Wnioski sformułowane na podstawie badań są w zdecydowanej większości zgodnie z przeprowadzonym przeglądem literatury oraz badaniami ilościowymi innych autorów w zakresie relacji pomiędzy czynnikami ekonomicznymi, politycznymi, geograficznymi, historycznymi i kulturowymi a zagrożeniem państwa upadłością. Na ich podstawie potwierdzono wszystkie postawione w dysertacji hipotezy.

Ustalenia płynące z niniejszej pracy mogą być przyczynkiem do dalszych badań. Szczególnie interesujące wydaje się być rozszerzenie testów ekonometrycznych o test przyczynowości w sensie Grangera, co pozwoliłoby na określenie relacji przyczynowo-skutkowej pomiędzy analizowanymi czynnikami a prawdopodobieństwem wystąpienia

upadłości państwa. Zasadne wydaje się również być przeprowadzenie analizy interakcji pomiędzy czynnikami ekonomicznymi oraz politycznymi, aby określić czy ich łączny wpływ na zagrożenie państwa upadłością jest istotny statystycznie. Z kolei przeprowadzenie analiz typu *case study* pozwoliłoby zweryfikować otrzymane wyniki oraz uwzględnić lokalną specyfikę procesu upadłości, która często jest pomijana w analizach ilościowych z uwagi na wykorzystywanie zagregowanych danych.

Na podstawie otrzymanych wyników badań ekonometrycznych możliwe jest sformułowanie zaleceń i rekomendacji dla wielu instytucji międzynarodowych zajmujących się wspieraniem państw zagrożonych upadłością. Pomoc oferowana tym państwom powinna równolegle obejmować sferę ekonomiczną oraz polityczną. Najważniejszym celem jest wspieranie wzrostu i rozwoju gospodarczego, co w konsekwencji obniża prawdopodobieństwo wystąpienia upadłości państwa. Działania te powinny również obejmować procesy na rzecz zapewniania i gwarantowania pokoju, gdyż w warunkach braku bezpieczeństwa nie jest możliwe zbudowanie fundamentów stabilnego państwa. Społeczność międzynarodowa powinna wspierać proces ewolucji instytucji państwa w kierunku instytucji o charakterze włączającymi, jednakże zawsze uwzględniając lokalne uwarunkowania. Próby zastosowania w państwach o słabych instytucjach rozwiązań przyjętych w krajach wysokorozwiniętych (np. bezpośrednie przeniesienie europejskiego prawa cywilnego do afrykańskich kolonii) przyczyniły się bowiem do zwiększenia zagrożenia wystąpienia ich upadłości z uwagi na odmienną postać instytucji formalnych i nieformalnych. Niezbędne jest zatem zbudowanie takiego otoczenia instytucjonalnego, które zapewnia obywatelom możliwość uczestnictwa w procesach ekonomicznych i politycznych (tzw. włączające instytucje ekonomiczne i polityczne). Jednocześnie pożądanym jest przyjęcie i utrzymywanie systemu prawnego odpowiadającego lokalnej specyfice.

Aneks 1. Determinanty zagrożenia państwa upadłością– przegląd literatury

Źródło	Opis	Najważniejsze wnioski
Acemoglu, Robinson [2006]	Skonstruowanie teoretycznego modelu opisującego wpływ systemu politycznego na rozwój technologii i instytucji.	<ul style="list-style-type: none"> • System polityczny wpływa na kształtowanie instytucji ekonomicznych. W systemach autorytarnych podział rent ekonomicznych jest nierównomierny, co w długim okresie wywołuje niezadowolenie społeczne i osłabia instytucje państwa.
Alesina, Easterly, Matuszeski [2011]	Stworzenie definicji „państwa sztucznego”. Identyfikacja 13 państw istniejących obecnie i spełniających kryteria państwa sztucznego: Czad, Ekwador, Erytrea, Gwatemala, Gwinea Równikowa, Jordania, Mali, Maroko, Namibia, Niger, Pakistan, Sudan, Zimbabwe.	<ul style="list-style-type: none"> • Utworzenie tzw. „sztucznych państw” (tj. takich, w których granice państw nie odpowiadają podziałom etnicznym) prowadzi do napięć na tle etnicznym i religijnym, a w konsekwencji upadłością instytucji państwa.
Baliamoune-Lutz [2009]	<p>Ekonometryczna analiza wpływu instytucji, handlu zagranicznego oraz jedności społecznej na poziom PKB per capita.</p> <p>Zmienna zależna: PKB per capita. Zakres przestrzenny: 29 państw zagrożonych upadłością (zgodnie z metodologią CPIA).</p> <p>Zakres czasowy: 1999-2002. Zmienne niezależne: współczynnik piśmienności, rozwój sektora finansowego, otwartość gospodarki, wskaźnik jedności (spójności) społecznej oraz etnicznej, system polityczny.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Otrzymywanie oficjalnej pomocy rozwojowej poprzez handel międzynarodowy może powodować koncentrację eksportu w ramach jednej gałęzi. Zwiększa się przez to narażenie na szoki egzogeniczne i utrudnione jest wzmocnienie struktur państwowych.

Źródło	Opis	Najważniejsze wnioski
Bertocchi, Guerzoni [2012]	<p>Badanie ekonometryczne wpływu czynników ekonomicznych, historycznych oraz instytucji na zagrożenie upadłością państwa.</p> <p>Zmienna zależna: binarna zmienna na podstawie CPIA. Zakres przestrzenny: 41 krajów Afryki Sub-Saharyjskiej. Zakres czasowy: 1992-2007. Zmienne niezależne: poziom inwestycji, oczekiwana długość życia, otwartość gospodarki, PKB per capita, poziom inflacji, przeszłość kolonialna, „<i>rule of law</i>”, tempo wzrostu gospodarczego, wolności osobiste, wydatki rządowe, występowanie „klątwy surowcowej”.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Nieprawidłowe funkcjonowanie instytucji państwa jest pierwotną przyczyną jego upadłości. • PKB per capita, tempo wzrostu gospodarczego oraz poziom inwestycji są ujemnie skorelowane z zagrożeniem upadłością. • Przeszłość kolonialna nie ma wpływu na zagrożenie upadłością
Burke i in. [2009]	<p>Ekonometryczne badanie wpływu zmian klimatycznych na zagrożenie wybuchu wojny domowej.</p> <p>Zmienna zależna: trwająca wojna domowa. Zakres przestrzenny: kraje afrykańskie. Zakres czasowy: 1981-2002.</p> <p>Zmienne niezależne: średnioroczna temperatura, suma opadów, dochód per capita, system polityczny.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Wzrost średniorocznej temperatury o 1 stopień Celsjusza zwiększa prawdopodobieństwo wybuchu wojny w krajach afrykańskich o 4,5% w danym roku oraz o 0,9% w roku następnym.

Źródło	Opis	Najważniejsze wnioski
Carment i in. [2010]	<p>Raport z badania, którego celem było stworzenie modelu wczesnego ostrzegania o zagrożeniu upadłości państwa.</p> <p>Ekonometryczne badanie wpływu szeregu zmiennych na zagrożenie upadłością państwa.</p> <p>Zmienna zależna: CIFP. Zakres przestrzenny: wszystkie kraje.</p> <p>Zakres czasowy: zróżnicowany (w zależności od analizowanego kraju). Zmienne niezależne: ponad 70 zmiennych (głównie o charakterze ekonomicznym i politycznym).</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Negatywnie skorelowane z upadłością państwa są: poziom PKB per capita, stabilność polityczna, wskaźnik demokratyzacji (<i>Polity IV</i>) oraz otwartość gospodarki. • Pozytywnie skorelowane z upadłością są: wydatki rządowe na zbrojenia oraz wskaźnik ubóstwa.
Carment, Prest, Samy [2008]	<p>Ekonometryczne badanie wpływu wybranych czynników na wrażliwość (<i>fragility</i>) państwa.</p> <p>Zmienna zależna: CIFP. Zakres przestrzenny: 156 krajów z całego świata. Zakres czasowy: 2000-2005. Zmienne niezależne: HDI, otwartość gospodarki, PKB per capita, przestrzeganie praw człowieka, system polityczny, tempo wzrostu gospodarczego.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Czynniki ekonomiczne wpływają na zagrożenie upadłością państwa. Wraz ze wzrostem poziomu PKB per capita, tempa wzrostu gospodarczego oraz otwartości gospodarki maleje zagrożenie upadłością. • Wysoka wartość indeksu HDI obniża zagrożenie upadłością. • System polityczny oraz przestrzeganie praw człowieka nie wpływają na zagrożenie upadłością.

Źródło	Opis	Najważniejsze wnioski
Chauvet, Collier, Hoeffler [2007]	<p>Ekonometryczne badanie skutków upadłości państwa.</p> <p>Zmienna zależna: koszt upadłości (rozumiany jako obniżenie tempa wzrostu gospodarczego oraz obniżenie poziomu PKB per capita). Zakres przestrzenny: 23 państwa upadające (<i>failing states</i>). Zakres czasowy: 1974-2001. Zmienne niezależne: opóźniony dochód per capita, sąsiedowanie z państwami upadłymi lub w stanie wojny, poziom skolaryzacji, poziom inwestycji (w relacji do PKB), system polityczny.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Upadłość państwa generuje koszty ekonomiczne dla tego państwa oraz jego sąsiadów (tzw. „efekty zewnętrzne”). • Średni koszt upadłości państwa to ok. pięciokrotność początkowego PKB (w momencie upadłości). • Średnio upadłość państwa powoduje obniżenie tempa wzrostu gospodarczego o ok. 3 p. proc. • Upadłość państwa powoduje obniżenie tempa wzrostu gospodarczego w krajach sąsiednich o 0,3-0,9 p. proc.
Clarke, Gosende [2003]	<p>Studium przypadku (<i>case study</i>) - analiza przyczyn upadłości Somalii.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Zdobyć władzy dyktatorskiej w wyniku zbrojnego zamachu stanu doprowadziło do wieloletniego zawłaszczenia władzy politycznej. • Wprowadzone reformy gospodarcze, wprowadzające ustrój quasi-socjalistyczny, znacznie osłabiły potencjał ekonomiczny kraju.
Collier [2007]	<p>Opis i analiza przyczyn braku rozwoju gospodarczego w państwach biednych pomimo międzynarodowej pomocy i wsparcia. Autor wyróżnia 60 takich państw, które są zamieszkiwane przez ok. miliard osób.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Czynniki ekonomiczne (w tym poziom i tempo wzrostu PKB per capita) odgrywają kluczową rolę w utrzymywaniu bezpieczeństwa i stabilności państwa. • Każdy pięcioletni okres stagnacji lub recesji gospodarczej zwiększa zagrożenie wystąpienia wojny domowej o 14%.

Źródło	Opis	Najważniejsze wnioski
Collier, Hoeffler [2002]	<p>Ekonometryczne badanie wpływu pomocy zagranicznej oraz reform politycznych na wzrost gospodarczy w krajach po zakończonym konflikcie zbrojnym.</p> <p>Zmiennie zależne: wielkość przekazywanej pomocy rozwojowej (ODA) w relacji do PKB, „punkt nasycenia” (ang. <i>saturation point</i>) określający graniczny poziom absorpcji środków z ODA. Zakres przestrzenny: 62 kraje (w tym 27, które doświadczyły konfliktu zbrojnego). Zakres czasowy: 4-letnie okresy z lat 1966-1998. Zmiennie niezależne: dochód per capita, wartość indeksu CPIA, wielkość ODA w relacji do PKB, jakość rządzenia, czas trwania konfliktu, region geograficzny.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Zdolność absorpcji środków przekazywanych w ramach oficjalnej pomocy rozwojowej zależy od instytucji funkcjonujących w państwie. • Wraz z poprawą jakości rządzenia (mierzonej indeksem CPIA) następuje wzrost możliwości absorpcji środków przekazywanych w ramach ODA. • Wzrost indeksu CPIA o jednostkę zwiększa możliwość absorpcji środków o ok. 3% PKB.
Collier, Hoeffler [2004]	<p>Ekonometryczne badanie przyczyn wybuchu wojen domowych.</p> <p>Zmienna zależna: binarna zmienna określająca trwającą wojnę domową. Zakres przestrzenny: 161 krajów, w których zaobserwowano 79 wojen domowych. Zakres czasowy: 1960-1999. Zmiennie niezależne: wielkość eksportu nieprzetworzonych surowców naturalnych (w relacji do PKB), wskaźnik skolaryzacji, PKB per capita, system polityczny, liczba lat pokoju i wojny poprzedzająca wybuch konfliktu, czynniki geograficzne (np. ukształtowanie terenu), zróżnicowanie etniczne i religijne.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Niedemokratyczne rządy w połączeniu z uzależnieniem gospodarki od wydobywania surowców naturalnych w długim okresie zwiększają zagrożenie upadłością państwa.

Źródło	Opis	Najważniejsze wnioski
Czaplicka [2007]	Opis rodzajów prowadzonej polityki wspierania rozwoju gospodarczego w państwach Afryki Subsaharyjskiej.	<ul style="list-style-type: none"> • W przypadku niedemokratycznych rządów, otrzymywane wsparcie w postaci oficjalnej pomocy rozwojowej jest marnotrawione i służy poprawie sytuacji materialnej rządzących elit, a nie obywateli.
de Soysa [2002]	<p>Ekonometryczna analiza wpływu uzależnienia gospodarki od eksportu surowców naturalnych na zagrożenie wybuchu wojny domowej.</p> <p>Zmienna zależna: binarna zmienna określająca wystąpienie wojny domowej. Zakres przestrzenny: 138 krajów. Zakres czasowy: 1989-1999. Zmienne niezależne: dochód per capita, wielkość populacji kraju, zróżnicowanie etniczno-językowe, poziom demokratyzacji (Polity IV), stopa wzrostu gospodarczego, posiadanie i handel surowcami naturalnymi.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Państwa, których gospodarki uzależnione są od eksportu ropy naftowej są bardziej narażone na wybuch wojny domowej i upadłość państwa
Di John [2008]	Przegląd literatury z zakresu konceptualizacji państwa upadłego (<i>failed states</i>) oraz przyczyn i skutków występowania upadłości.	<ul style="list-style-type: none"> • Przeszłość kolonialna oraz sposób dekolonizacji mają wpływ na proces kreowania i podziału rent, a także na trwałość państwa w długim okresie.
Doornbos [2002]	Teoretyczny opis przyczyn załamania państwowości (<i>state collapse</i>) zawierający także wyszczególnienie przyczyn upadłości w wybranych krajach (m.in. Demokratycznej Republice Kongo, Ugandzie, Somalii, Sierra Leone, Liberii, Rwandzie).	<ul style="list-style-type: none"> • Zbrojna walka o dostęp do zasobów naturalnych, przy jednoczesnej słabości instytucji państwa, prowadzi do jego upadłości. • Ustanowienie granic w postkolonialnym świecie bez uwzględnienia podziałów etnicznych powoduje wzrost napięć i konfliktów wewnętrznych. • Niezdolność państwa do zapewniania podstawowych dóbr publicznych prowadzi do zwiększonego zagrożenia upadłością.

Źródło	Opis	Najważniejsze wnioski
Easterly [2008]	Analiza przyczyn różnic pomiędzy krajami o wyższych i o niższych dochodach na mieszkańca. Próba odpowiedzi na pytanie, dlaczego kraje, które otrzymywały pomoc finansową (m.in. od Banku Światowego oraz Międzynarodowego Funduszu Walutowego) nie zaczęły rozwijać się szybciej, a warunki życia ludności nie poprawiły się.	<ul style="list-style-type: none"> • Przeszłość kolonialna wpływa na zagrożenie upadłością państwa z uwagi na przyjęty system prawny. • Byłe kolonie brytyjskie charakteryzują się „oddolnym tworzeniem prawa”, co zmniejsza zagrożenie upadłością. • Byłe kolonie francuskie i hiszpańskie charakteryzują się „odgórnym tworzeniem prawa”. Prawo cywilne jest mniej adekwatne do zwyczajów panujących w państwach afrykańskich, co zwiększa zagrożenie upadłością. • Konflikty na tle religijnym w państwach afrykańskich uniemożliwiają osiągnięcie długotrwałego rozwoju. Brak silnej, scentralizowanej władzy powoduje dalsze osłabianie instytucji państwa.
Elgstrom [2002]	Teoretyczna analiza mechanizmów wpływu demokratycznego systemu politycznego na rozwój państwa.	<ul style="list-style-type: none"> • Nie jest możliwe jednoznaczne określenie związku pomiędzy przyjętym systemem politycznym a rozwojem państwa. • Demokratyczny system polityczny nie jest warunkiem wystarczającym (ani koniecznym) do zapewnienia stabilności państwa.
Englehart [2007]	Statystyczna analiza czynników zwiększających zagrożenie upadłości państwa i rozpadu jego struktur (<i>state failure and collapse</i>) wraz z studium przypadku (<i>case study</i>) Somalii oraz Afganistanu.	<ul style="list-style-type: none"> • W państwach, w których władza należy do wąskiej grupy osób, nie występują mechanizmy umożliwiające bezkonfliktowe rozwiązywanie problemów. Wszechobecna przemoc zwiększa zagrożenie upadłością państwa.

Źródło	Opis	Najważniejsze wnioski
Esty i in. [1998]	<p>Statystyczna analiza różnic pomiędzy grupą państw upadających i załamanych (failure state and collapsed state) a grupą kontrolną. Wykazanie statystycznie istotnych różnic pomiędzy średnimi wartościami zmiennych w grupie badawczej i kontrolnej.</p> <p>Zakres przestrzenny: 166 krajów. Zakres czasowy: 1955-1994.</p> <p>Zmienne wykorzystane w badaniu: 617 zmiennych o charakterze ekonomiczno-środowiskowym, politycznym oraz demograficzno-społecznym.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Większa otwartość gospodarki (liczona jako łączny udział wartości importu i eksportu w PKB) sprzyja obniżaniu zagrożenia upadłością państwa. • Poziom PKB per capita statystycznie istotnie dyskryminuje grupę badawczą na państwa upadłe i pozostałe państwa (również: udział wydatków rządowych w PKB, udział inwestycji w PKB) • Demokratyczny system polityczny jest skorelowany z niższym zagrożeniem upadłością.
Fearon [1998]	<p>Teoretyczna analiza przyczyn występowania i eskalacji konfliktów zbrojnych na tle etnicznym.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Państwa, które uzyskały niepodległość na drodze dekolonizacji, są bardziej narażone na upadłość z uwagi na nagłe obniżenie siły państwa, a także brak wystarczającego potencjału militarnego.
Fearon, Laitin [2003]	<p>Ekonometryczne badanie przyczyn wybuchu wojen domowych.</p> <p>Zmienna zależna: binarna zmienna określająca trwającą wojnę domową. Zakres przestrzenny: 161 krajów. Zakres czasowy: 1945-1999. Zmienne niezależne: dochód per capita, populacja, system polityczny, niestabilność polityczna, zróżnicowanie etniczne oraz religijne, udział terenów górskich w powierzchni kraju, eksport ropy naftowej (zmienna binarna).</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Czynniki polityczne (w tym brak demokracji) nie wpływają na zagrożenie upadłości państwa, jeśli państwo zapewnia wzrost i rozwój gospodarczy. • Czynniki ekonomiczne są główną determinantą zagrożenia wybuchem wojny domowej i upadłości państwa. • Zagrożenie wybuchem wojny domowej (rebelią, powstaniem) jest większe w krajach biedniejszych (z wyższymi wskaźnikami ubóstwa), o większej populacji, charakteryzujących się niestabilnością polityczną.

Źródło	Opis	Najważniejsze wnioski
Feeny, McGillivray [2010]	Statystyczne badanie wpływu wielkości otrzymywanej pomocy rozwojowej na strukturę budżetu państwa, wraz z budową szczegółowego modelu dla Papui Nowej Gwinei.	<ul style="list-style-type: none"> • Napływ bezpośredniej pomocy rozwojowej podwyższa poziom konsumpcji oraz inwestycji, obniża jednak wpływy z podatków do budżetu państwa. Występuje tzw. „efekt zastępowania” wpływów budżetowych (rząd nie gromadzi rezerw, ponieważ stale otrzymuje pieniądze w ramach pomocy zagranicznej). • W państwach upadających negatywne efekty związane ze zmniejszonymi wpływami podatkowymi są większe. • Państwa upadająca są bardziej narażone na niestabilność po ograniczeniu napływów bezpośredniej pomocy rozwojowej.
Fenwick [2009]	Porównanie brytyjskiego oraz francuskiego modelu zarządzania koloniami, wraz ze studium porównawczym Kenii i Senegalu.	<ul style="list-style-type: none"> • Przeszłość kolonialna wpływa na zagrożenie upadłością państwa. • Byłe kolonie brytyjskie są mniej narażone na upadłość, w porównaniu do kolonii francuskich.
Fernandez [2010]	Przegląd literatury z zakresu wpływu uwarunkowań kulturowych na wyniki ekonomiczne (w tym wzrost gospodarczy, redystrybucję dochodów, udział kobiet na rynku pracy) oraz stabilność instytucji państwa.	<ul style="list-style-type: none"> • Czynniki kulturowe, w tym religia, mogą wpływać na wartości realne, takie jak tempo wzrostu gospodarczego. • Czynniki kulturowe mogą także wpływać na zagrożenie konfliktami wewnętrznymi i upadłością.
Fetzek, Mazo [2014]	Teoretyczny opis wpływu zmian klimatycznych (w tym rosnącej średniorocznej temperatury powietrza) na zagrożenie wybuchu konfliktu zbrojnego.	<ul style="list-style-type: none"> • Postępujące zmiany klimatyczne przyczyniają się do destabilizacji ekologicznej. Problemy z dostępem do podstawowych zasobów naturalnych (w tym wody pitnej i jedzenia) mogą stanowić przyczynę napięć wewnętrznych.

Źródło	Opis	Najważniejsze wnioski
Gemechu [2009]	Analiza źródeł konfliktów w krajach wieloetnicznych na przykładzie państw z tzw. Rogu Afryki (Dżibuti, Erytrea, Etiopia, Somalia, Sudan).	<ul style="list-style-type: none"> • U źródeł konfliktów pomiędzy grupami etnicznymi leży chęć przejęcia władzy politycznej oraz kontroli nad bogactwami naturalnymi. • Systematyczne pogłębianie dysproporcji dochodowych pomiędzy klanami prowadzi do walk pomiędzy nimi.
Gil [2015]	Analiza przyczyn, korelatów oraz skutków upadania państw, a także skuteczności reakcji społeczności międzynarodowej. Książka zawiera również opis mechanizmów, które doprowadziły do upadłości (lub znacznego osłabienia struktur) następujących państw: Somali, Pakistanu, Kolumbii, Wysp Salomona oraz Bośni i Hercegowiny.	<ul style="list-style-type: none"> • Do podstawowych przyczyn upadania państwa należy zaliczyć: <ul style="list-style-type: none"> • niedopasowanie instytucji państwa do specyfiki społeczno-politycznej (w tym do podziałów etnicznych), • brak kontynuacji rządów (np. obalenie słabej demokracji, słabnięcie rządów autorytarnych), • walkę o władzę z pobudek surowcowych, • ekstremalne zawłaszczenie sektora publicznego, co radykalizuje postawy społeczne, • pogorszenie sytuacji makroekonomicznej.
Gilley [2006]	Statystyczna analiza uwarunkowań poziomu legitymizacji władzy. Zmienna zależna: poziom legitymizacji władzy państwowej (mierzony m.in. za pomocą danych pochodzących z <i>World Values Survey</i> oraz informacji o przebiegu wyborów parlamentarnych). Zakres przestrzenny: 72 państwa. Zakres czasowy: nie podano. Zmiennie niezależne: zestaw 62 zmiennych o charakterze ekonomicznym, politycznym oraz społecznym.	<ul style="list-style-type: none"> • Czynniki ekonomiczne (takie jak: poziom i wzrost PKB per capita oraz skala redukcji ubóstwa) wpływają na możliwość utraty legitymizacji do sprawowania władzy. • Wśród czynników politycznych skorelowanych z legitymizacją do sprawowania władzy należy wymienić: jakość rządzenia, otrzymywanie pomocy zagranicznej, stabilność polityczną oraz system polityczny.

Źródło	Opis	Najważniejsze wnioski
Howard [2008]	<p>Badanie ekonometryczne przyczyn upadłości państwa (<i>state failure</i>).</p> <p>Zmienna zależna: wartość indeksu <i>State Failure Task Force</i>.</p> <p>Zakres przestrzenny: 195 krajów. Zakres czasowy: 1955-2000.</p> <p>Zmienne niezależne: graniczenie z państwem, w którym trwa wojna, korupcja, niestabilność polityczna (zamieszki, strajki, demonstracje), PNB per capita, system polityczny.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • System polityczny wpływa na zagrożenie upadłością państwa: autorytaryzm je zwiększa, a demokracja obniża. • Wskaźnik korupcji wśród władzy jest pozytywnie skorelowany z zagrożeniem upadłością państwa. • Niestabilność polityczna sprzyja upadłości państwa. • Im wyższy poziom PNB per capita, tym niższe zagrożenie upadłością.
Huria [2008]	<p>Opis skutków wystąpienia upadłości państwa (<i>failed state</i>) z podziałem na skutki dla państwa upadającego oraz państw graniczących z nim.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Państwa, które graniczą z państwami upadłymi lub upadającymi są bardziej narażone na upadłość państwa (efekt zarażania).
Iqbal, Starr [2007]	<p>Ekonometryczne badanie przyczyn upadłości państwa.</p> <p>Zmienna zależna: binarna zmienna opracowana na podstawie indeksu Polity IV (wartości -66 oraz -77 świadczą o upadłości państwa). Zakres przestrzenny: 162 kraje. Zakres czasowy: 1946-2000. Zmienne niezależne: niestabilność polityczna (konflikty, zamieszki, protesty), otwartość gospodarki, PKB, przechodzenie transformacji ustrojowej, system polityczny.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Poziom demokratyzacji (mierzony indeksem <i>Polity IV</i>) wpływa ujemnie i nieliniowo na prawdopodobieństwo upadłości państwa. • Kraje, które przechodzą transformację ustrojową są bardziej narażone na upadłość. • Niestabilność polityczna jest dodatnio skorelowana z prawdopodobieństwem upadłości. • Wraz ze wzrostem poziomu PKB zagrożenie upadłością maleje. • Otwartość gospodarki nie jest powiązana z upadłością państwa.

Źródło	Opis	Najważniejsze wnioski
Iqbal, Starr [2008]	<p>Ekonometryczne badanie przyczyn upadłości państwa.</p> <p>Zmienna zależna: binarna zmienna opracowana na podstawie indeksu <i>Polity IV</i> (wartości -66 oraz -77 świadczą o upadłości państwa). Zakres przestrzenny: 106 krajów. Zakres czasowy: 1946-1999. Zmienne niezależne: otwartość gospodarki, PKB, populacja, system polityczny.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Wyższy PKB oraz wyższa otwartość gospodarki sprzyjają ograniczeniu zagrożenia upadłością państwa. • Wraz ze wzrostem populacji rośnie zagrożenie upadłością. • Wpływ systemu politycznego (mierzonego indeksem <i>Polity IV</i>) jest Ukształtny. Państwa o silnie demokratycznych lub silnie autorytarnych rządach upadają rzadziej, niż państwa, których rządy nie są w pełni demokratyczne lub autorytarne. • Możliwe jest przenoszenie napięć i konfliktów od sąsiednich państw („efekt zarażania”).
Karadeli [2009]	<p>Teoretyczna analiza przyczyn upadłości państwa (<i>failed states</i>) wraz ze skróconym studium przypadku (case study) Burundi, Rwandy, Demokratycznej Republiki Kongo oraz Republiki Środkowoafrykańskiej.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Byłe kolonie brytyjskie charakteryzują się większą stabilnością, niż byłe kolonie francuskie.
Khan [2000]	<p>Opis mechanizmu pogoni za rentą (rent-seeking) z podziałem na legalną oraz nielegalną formę. Analiza skutków dla gospodarki i społeczeństwa.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Proces nielegalnej pogoni za rentą (rent-seeking) statystycznie częściej występuje w krajach posiadających złoża ropy naftowej. • Prawdopodobieństwo, że proces pogoni za rentą przybierze postać walki zbrojnej jest większe w państwach posiadających dostęp do złóż ropy naftowej.

Źródło	Opis	Najważniejsze wnioski
King, Zeng [2001]	<p>Badanie ekonometryczne przyczyn upadłości państwa (<i>state failure</i>).</p> <p>Zmienna zależna: binarna zmienna określająca upadłość państwa oparta na <i>State Failure Task Force</i>. Zakres czasowy: 1955-1988. Zakres przestrzenny: 195 krajów. Zmienne niezależne: 1231 zmiennych o charakterze politycznym, socjologicznym, ekonomicznym, kulturowym oraz demograficznym.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Wysoka śmiertelność noworodków jest skorelowana z zagrożeniem upadłością państwa. • System polityczny wpływa na zagrożenie upadłością państwa: autorytaryzm je wzmacnia, a demokracja osłabia. • Kraje częściowo demokratyczne (tj. takie, w których nie wszystkie instytucje mają charakter właściwy dla demokracji) są bardziej narażone na upadłość, niż kraje w pełni demokratyczne.
Klare [2001]	<p>Analiza roli kontrolowania i pozyskiwania surowców naturalnych w możliwości kreowania rent politycznych, a w konsekwencji zwiększania zagrożenia wybuchu konfliktu.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Autorytarna władza wykorzystuje wpływy z wydobycia surowców naturalnych do finansowania swoich rządów, co w długim okresie zwiększa napięcia społeczne i zagrożenie upadłością państwa.
Knack [2001]	<p>Ekonometryczne badanie wzajemnego wpływu pomocy rozwojowej oraz jakości rządzenia (<i>quality of governance</i>).</p> <p>Zmienne wykorzystane w badaniu: wysokość otrzymanej pomocy rozwojowej (w relacji do PKB), wskaźniki jakości rządzenia, stopa wzrostu gospodarczego, przyrost naturalny, śmiertelność noworodków. Zakres przestrzenny: 80 krajów. Zakres czasowy: 1982-1995.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Otrzymywanie pomocy rozwojowej wzmacnia procesy nielegalnej pogoni za rentą oraz podwyższa poziom korupcji wśród organów rządzących. • Obserwuje się mniejszą skłonność do podejmowania reform politycznych i gospodarczych w krajach, które otrzymują ODA.

Źródło	Opis	Najważniejsze wnioski
Koonings i Kruijt [2004]	Teoretyczna analiza zależności pomiędzy systemem politycznym a zagrożeniem upadania państwa (<i>state failure</i>) w Ameryce Łacińskiej, ze szczególnym uwzględnieniem roli zorganizowanej przemocy niepodlegającej kontroli ze strony władz centralnych.	<ul style="list-style-type: none"> • System polityczny nie jest wiodącym czynnikiem decydującym o zagrożeniu upadłością państwa. Bardziej istotna jest siła i legitymizacja do sprawowania władzy przez organy rządzące. • Brak możliwości utrzymania monopolu na użycie siły przez państwo prowadzi do tworzenia się zbrojnych grup rozszerzających swoje prawa z użyciem siły fizycznej. Osłabienie struktur państwowych i zmniejszający się poziom kontroli na terytorium może prowadzić do upadłości państwa, zarówno w państwach demokratycznych, jak i autorytarnych.
Lemarchand [2003]	Studium przypadku (<i>case study</i>) - analiza przyczyn upadłości Demokratycznej Republiki Kongo.	<ul style="list-style-type: none"> • Po obaleniu rządów autorytarnych, w warunkach słabych instytucji politycznych, doszło do kolejnej walki o władzę, która zakończyła się wojną domową i całkowitym rozkładem instytucji państwa.
Mazo [2009]	Teoretyczna analiza zależności pomiędzy zmianami klimatu i jego skutkami (np. niedostateczną ilością wody i jedzenia) a zagrożeniem wybuchu konfliktu zbrojnego i upadłości państwa (<i>state failure</i>).	<ul style="list-style-type: none"> • Postępujące zmiany klimatu stanowią egzogeniczny szok dla gospodarki, którego absorpcja trwa dłużej w krajach biednych i o słabszych instytucjach. • Niezdolność do właściwych reakcji na zmiany klimatu ze strony organów rządzących przyczynia się do zwiększonej niestabilności kraju.
Moore [1998, 2001]	Teoretyczna analiza przyczyn „niedorozwoju politycznego” (ang. <i>political underdevelopment</i>) oraz słabej jakości rządu w krajach biednego Południa.	<ul style="list-style-type: none"> • Zyski osiągnięte z wydobycia surowców naturalnych (głównie ropy i gazu) w warunkach niskiego rozwoju gospodarczego kraju oraz słabych instytucji państwa prowadzi do wybuchu konfliktu i upadłości państwa.
Ottaway, Mair [2004]	Analiza zdolności do zapewnienia bezpieczeństwa jako kluczowego czynnika zapobiegającego upadłości państwa (<i>failed states</i>), z podziałem na perspektywę międzynarodową, regionalną oraz wewnątrz krajową.	<ul style="list-style-type: none"> • Najważniejszym czynnikiem zapobiegającym upadłości państwa w krajach słabych jest zapewnienie bezpieczeństwa wewnętrznego i zewnętrznego. • W warunkach słabych instytucji państwa, większe jest zagrożenie przejścia kontroli nad częścią terytorium przez zbrojne grupy interesu.

Źródło	Opis	Najważniejsze wnioski
Prunier, Gisselquist [2003]	Studium przypadku (<i>case study</i>) - analiza przyczyn upadłości Sudanu oraz Sudanu Południowego.	<ul style="list-style-type: none"> • Do wojny domowej, zakończonej secesją Sudanu Południowego, doprowadziły konflikty na tle etnicznym i religijnym, a także spór o kontrolę nad surowcami naturalnymi (głównie ropą naftową) pomiędzy elitami.
Rajan [2011]	Teoretyczna analiza przyczyn i skutków upadłości państwa (<i>failed states</i>), ze szczególnym uwzględnieniem czynników ekonomicznych oraz instytucjonalnych.	<ul style="list-style-type: none"> • Brak otoczenia instytucjonalnego i ochrony podstawowych praw własności prowadzi do nierównomiernego rozkładu władzy ekonomicznej. Napięcia na tym tle prowadzą do konfliktów i zwiększają zagrożenie upadłością państwa.
Reinert, Amaizo, Kattel [2007]	Teoretyczna i statystyczna analiza wpływu struktury produkcji i wydajności pracy oraz handlu na sprawność instytucji państwa.	<ul style="list-style-type: none"> • Otwartość gospodarki wpływa pozytywnie na stabilność i bogactwo kraju, jeśli jego instytucje są wystarczająco silne. • W państwach wrażliwych i upadających brak infrastruktury i niski poziom technicznego uzbrojenia pracy są przeszkodami w zwiększaniu konkurencyjności na arenie międzynarodowej.
Reno[2003]	Studium przypadku (<i>case study</i>) - analiza przyczyn upadłości Sierra Leone.	<ul style="list-style-type: none"> • Zawłaszczenie przez grupę interesu eksportu surowców naturalnych (głównie diamentów) spowodowało wzrost ich siły ekonomicznej, a w konsekwencji możliwość realnego wpływania na prowadzoną politykę. • Celowe dążenie do decentralizacji ośrodków posiadających monopol na użycie siły doprowadziło do rozpadu społeczeństwa, a w konsekwencji do upadłości państwa (niezdolności do zapewniania władzy na swoim terytorium).

Źródło	Opis	Najważniejsze wnioski
Sachs [2006]	Analiza przyczyn ubóstwa we współczesnym świecie (od 1985 roku) oraz próba opisanie mechanizmów mających na celu redukcję nędzy na świecie. Opis zmian sytuacji społeczno-gospodarczej w Boliwii, Polsce, Rosji, Chinach, Indiach oraz w krajach afrykańskich.	<ul style="list-style-type: none"> • Dekolonizacja i ustanowienie granic niezgodnych z podziałem etnicznym i językowym spowodowała istniejące do dziś podziały, na tle których wybuchają konflikty.
Sambanis [2001]	<p>Ekonometryczne badanie różnic w przyczynach wybuchu wojen domowych o podłożu etnicznym oraz nieetnicznym.</p> <p>Zmienna zależna: binarna zmienna określająca wybuch wojny domowej (z podziałem na podłoża etniczne oraz nieetniczne).</p> <p>Zakres przestrzenny: 161 krajów. Zakres czasowy: 1960-1999.</p> <p>Zmienne niezależne: dochód na osobę, system polityczny (mierzony Polity IV), zróżnicowanie etniczno-językowe, wielkość populacji, region geograficzny, konflikt zbrojny w kraju sąsiadującym.</p>	<ul style="list-style-type: none"> • Występują różnice pomiędzy czynnikami zwiększającymi zagrożenie wybuchem wojny domowej o podłożu etnicznym oraz nieetnicznym. • Wyższy poziom PKB per capita zmniejsza zagrożenie wybuchem wojny domowej. • Zróżnicowanie etniczne zwiększa zagrożenie wybuchem wojny domowej. • W krajach demokratycznych prawdopodobieństwo wybuchu wojny domowej jest niższe, niż w krajach autorytarnych.
Smith, Vivekananda [2007]	Teoretyczno-statystyczna analiza wpływu klimatu i jego zmian na zagrożenie wybuchu wojny oraz efektywność procesów pokojowych.	<ul style="list-style-type: none"> • Zastane warunki klimatyczne pośrednio determinują stabilność polityczną kraju. • Kraje leżące w klimacie równikowym charakteryzują się niższą sprawnością instytucji.
Sowell [2016]	Historyczna analiza wpływu szeregu czynników (geograficznych, kulturowych, społecznych i politycznych) na rozbieżności w bogactwie i dochodach pomiędzy krajami.	<ul style="list-style-type: none"> • Wzrost obrotów handlowych oraz przynależność do organizacji międzynarodowych zwiększa stabilność państwa.

Źródło	Opis	Najważniejsze wnioski
van Reybrouck [2016]	Reportaż historyczny o sytuacji Demokratycznej Republiki Kongo od XIX do XXI wieku, zawierający także liczne wywiady z obywatelami oraz decydentami – tzw. historia mówiona (ang. <i>oral history</i>).	<ul style="list-style-type: none"> • Chaotycznie przeprowadzona dekolonizacja przyczyniła się do późniejszej niestabilności kraju. • Brak ugruntowanych zasad dotyczących wyboru i stanowienia władzy w państwie doprowadziły do zamachu stanu i ustanowienia rządów autorytarnych.
Wardín [2013]	Teoretyczna analiza przyczyn upadłości państwa, z uwzględnieniem czterech „pułapek” (brutalnego konfliktu, położenia geograficznego, złych rządów oraz zasobów naturalnych) oraz czynników kulturowych.	<ul style="list-style-type: none"> • Zagrożenie wystąpieniem „klątwy surowcowej” jest szczególnie silne w państwach afrykańskich, ponieważ charakteryzują się one niską jakością rządów, a ich zasoby naturalne są jednymi z ostatnich łatwo dostępnych do eksploatacji. • Duże uzależnienie gospodarki od wydobywanych surowców w połączeniu ze słabymi rządami wzmacnia zagrożenie upadłością państwa.
Williams [2009]	Teoretyczna analiza przyczyn zawodności państwa (<i>state failure</i>) oraz skutków wystąpienia tego zjawiska dla społeczeństwa.	<ul style="list-style-type: none"> • Niska zdolność organów rządzących do sprawowania efektywnej kontroli nad przestrzeganiem prawa przez obywateli prowadzi do upadłości państwa.
Woźniak [2008]	Teoretyczna analiza zależności pomiędzy nierównościami społecznymi a kształtem otoczenia instytucjonalnego oraz ich wpływu na efektywność ekonomiczną.	<ul style="list-style-type: none"> • Rolą rządzących jest zapewnianie takich instytucji i praw, które redukują negatywne skutki nieuczciwej pogoni za rentą i wspierają efektywność ekonomiczną.

Aneks 2. Przyporządkowanie badanych państw do grup ze względu na wartości wybranych zmiennych¹⁰²

- **Zmienna: początkowy PKB per capita (wdi pkbpc pocz); kryterium podziału: równe percentyle**
 - **Grupa 1:** Mozambik, Burundi, Burkina Faso, Malawi, Mali, Ruanda, Lesoto, Bangladesz, Togo, Wietnam, Sierra Leone, Gambia, Erytrea, Tanzania, Botswana, Gwinea Bissau, Benin,
 - **Grupa 2:** Kenia, Republika Środkowoafrykańska, Niger, Gwinea Równikowa, Timor Wschodni, Republika Zielonego Przylądka, Czad, Madagaskar, Mauretania, Komory, Kamerun, Uzbekistan, Kirgistan, Jemen, Ghana, Suazi, Senegal,
 - **Grupa 3:** Tadżykistan, Zimbabwe, Wybrzeże Kości Słoniowej, Wyspy Salomona, Nigeria, Papua Nowa Gwinea, Sudan Południowy, Kongo (Brazzaville), Zambia, Sudan, Dżibuti, Armenia, Algieria, Gujana, Fidżi, Mołdawia, Mauritius, Gruzja,
 - **Grupa 4:** Angola, Białoruś, Azerbejdżan, Kosowo, Turkmenistan, Namibia, Macedonia, Ukraina, Serbia i Czarnogóra, Gabon, Kazachstan, Trinidad i Tobago, Czarnogóra, Surinam, Słowacja, Chorwacja, Czechy, Słowenia, Bahrajn, Katar, Zjednoczone Emiraty Arabskie.
- **Zmienna: średni PKB per capita (wdi pkbpc sr), kryterium podziału: równe percentyle**
 - **Grupa 1:** Burundi, Mozambik, Malawi, Niger, Ruanda, Burkina Faso, Mali, Sierra Leone, Madagaskar, Republika Środkowoafrykańska, Erytrea, Gambia, Togo, Bangladesz, Lesoto, Gwinea Bissau, Tanzania,
 - **Grupa 2:** Czad, Tadżykistan, Benin, Kirgistan, Timor Wschodni, Komory, Kenia, Wietnam, Senegal, Zimbabwe, Sudan Południowy, Ghana, Uzbekistan, Mauretania, Kamerun, Jemen,
 - **Grupa 3:** Zambia, Dżibuti, Papua Nowa Gwinea, Mołdawia, Wyspy Salomona, Wybrzeże Kości Słoniowej, Sudan, Nigeria, Republika Zielonego

¹⁰² Państwa w poszczególnych grupach zostały uszeregowane rosnąco według wartości zmiennej będącej kryterium podziału.

Przylądka, Gruzja, Armenia, Gujana, Suazi, Kongo (Brazzaville), Ukraina, Angola, Fidzi, Kosowo, Azerbejdżan, Turkmenistan,

- **Grupa 4:** Algieria, Macedonia, Białoruś, Botswana, Namibia, Serbia i Czarnogóra, Mauritius, Czarnogóra, Kazachstan, Surinam, Gwinea Równikowa, Trinidad i Tobago, Gabon, Chorwacja, Słowacja, Czechy, Słowenia, Bahrajn, Zjednoczone Emiraty Arabskie, Katar.
- **Zmienna: średnia stopa wzrostu gospodarczego (wdi pkbpc wz sr), kryterium podziału: odchylenie standardowe**
 - **Grupa 1:** Sudan Południowy,
 - **Grupa 2:** Zjednoczone Emiraty Arabskie, Ukraina, Czad, Madagaskar, Tadżykistan, Komory, Niger, Zimbabwe, Republika Środkowoafrykańska, Mołdawia, Sierra Leone, Angola, Senegal, Dżibuti, Kirgistan, Zambia, Bahrajn, Wybrzeże Kości Słoniowej, Jemen, Gambia, Surinam, Erytrea, Kamerun, Papua Nowa Gwinea, Togo, Benin, Ghana, Mauretania,
 - **Grupa 3:** Nigeria, Fidzi, Kongo (Brazzaville), Malawi, Macedonia, Katar, Kenia, Ruanda, Gujana, Gwinea Bissau, Gruzja, Wyspy Salomona, Gabon, Burundi, Burkina Faso, Trinidad i Tobago, Chorwacja, Algieria, Tanzania, Namibia, Słowenia, Suazi, Czarnogóra, Czechy, Mali, Bangladesz, Uzbekistan, Kosowo, Mozambik, Lesoto, Turkmenistan, Azerbejdżan, Timor Wschodni, Kazachstan, Sudan, Białoruś, Mauritius, Armenia, Słowacja, Wietnam, Republika Zielonego Przylądka, Botswana,
 - **Grupa 4:** Serbia i Czarnogóra, Gwinea Równikowa.
- **Zmienna: średnia stopa wzrostu gospodarczego (wdi pkbpc wz sr), kryterium podziału: odchylenie standardowe**
 - **Grupa 1:** Sudan Południowy, Zjednoczone Emiraty Arabskie, Ukraina, Czad, Madagaskar, Tadżykistan, Komory, Niger, Zimbabwe, Republika Środkowoafrykańska, Mołdawia, Sierra Leone, Angola, Senegal, Dżibuti, Kirgistan, Zambia, Bahrajn, Wybrzeże Kości Słoniowej,
 - **Grupa 2:** Jemen, Gambia, Surinam, Erytrea, Kamerun, Papua Nowa Gwinea, Togo, Benin, Ghana, Mauretania, Nigeria, Fidzi, Kongo (Brazzaville), Malawi, Macedonia, Katar, Kenia, Ruanda, Gujana,
 - **Grupa 3:** Gwinea Bissau, Gruzja, Wyspy Salomona, Gabon, Burundi, Burkina Faso, Trinidad i Tobago, Chorwacja, Algieria, Tanzania, Namibia, Słowenia,

Suazi, Czarnogóra, Czechy, Mali, Bangladesz, Uzbekistan, Kosowo, Mozambik,

- **Grupa 4:** Lesoto, Turkmenistan, Azerbejdżan, Timor Wschodni, Kazachstan, Sudan, Białoruś, Mauritius, Armenia, Słowacja, Wietnam, Republika Zielonego Przylądka, Botswana, Serbia i Czarnogóra, Gwinea Równikowa.
- **Zmienna: średnia wielkość importu w relacji do PKB (import sr), kryterium podziału: odchylenie standardowe**
 - **Grupa 1:** Zambia, Sudan, Nigeria, Bangladesz, Burundi, Czad, Kamerun, Jemen,
 - **Grupa 2:** Ruanda, Sierra Leone, Algieria, Burkina Faso, Tanzania, Niger, Republika Środkowoafrykańska, Katar, Uzbekistan, Papua Nowa Gwinea, Madagaskar, Mali, Kenia, Wybrzeże Kości Słoniowej, Benin, Sudan Południowy, Zjednoczone Emiraty Arabskie, Zimbabwe, Azerbejdżan, Kazachstan, Malawi, Gabon, Dżibuti, Senegal, Trinidad i Tobago, Gwinea Bissau, Ghana, Turkmenistan, Angola, Gambia, Chorwacja,
 - **Grupa 3:** Komory, Surinam, Ukraina, Serbia i Czarnogóra, Armenia, Republika Zielonego Przylądka, Botswana, Togo, Mozambik, Kosowo, Gruzja, Tadżykistan, Macedonia, Namibia, Mauretania, Kongo (Brazzaville), Erytrea, Czechy, Fidżi, Słowenia, Wyspy Salomona, Bahrajn, Kirgistan, Mauritius,
 - **Grupa 4:** Białoruś, Wietnam, Suazi, Czarnogóra, Mołdawia, Słowacja, Gujana, Gwinea Równikowa, Timor Wschodni, Lesoto.
- **Zmienna: średnia wielkość importu w relacji do PKB (import sr), kryterium podziału: równe percentyle**
 - **Grupa 1:** Zambia, Sudan, Nigeria, Bangladesz, Burundi, Czad, Kamerun, Jemen, Ruanda, Sierra Leone, Algieria, Burkina Faso, Tanzania, Niger, Republika Środkowoafrykańska, Katar, Uzbekistan, Papua Nowa Gwinea,
 - **Grupa 2:** Madagaskar, Mali, Kenia, Wybrzeże Kości Słoniowej, Benin, Sudan Południowy, Zjednoczone Emiraty Arabskie, Zimbabwe, Azerbejdżan, Kazachstan, Malawi, Gabon, Dżibuti, Senegal, Trinidad i Tobago, Gwinea Bissau, Ghana, Turkmenistan,
 - **Grupa 3:** Angola, Gambia, Chorwacja, Komory, Surinam, Ukraina, Serbia i Czarnogóra, Armenia, Republika Zielonego Przylądka, Botswana, Togo, Mozambik, Kosowo, Gruzja, Tadżykistan, Macedonia, Namibia,

- **Grupa 4:** Mauretania, Kongo (Brazzaville), Erytrea, Czechy, Fidżi, Słowenia, Wyspy Salomona, Bahrajn, Kirgistan, Mauritius, Białoruś, Wietnam, Suazi, Czarnogóra, Mołdawia, Słowacja, Gujana, Gwinea Równikowa, Timor Wschodni, Lesoto.
- **Zmienna: średnia wielkość eksportu w relacji do PKB (eksport sr), kryterium podziału: odchylenie standardowe**
 - **Grupa 1:** Timor Wschodni, Sudan, Gwinea Bissau, Burundi, Ruanda, Zambia, Erytrea, Bangladesz, Burkina Faso, Czad, Komory,
 - **Grupa 2:** Tanzania, Niger, Kosowo, Jemen, Lesoto, Mali, Republika Środkowoafrykańska, Benin, Madagaskar, Kamerun, Republika Zielonego Przylądka, Sierra Leone, Mozambik, Kenia, Malawi, Armenia, Nigeria, Serbia i Czarnogóra, Senegal, Dżibuti, Zimbabwe, Ghana, Gambia, Uzbekistan, Tadżykistan, Algieria, Papua Nowa Gwinea, Gruzja,
 - **Grupa 3:** Wyspy Salomona, Wybrzeże Kości Słoniowej, Chorwacja, Macedonia, Kirgistan, Togo, Zjednoczone Emiraty Arabskie, Mauretania, Czarnogóra, Angola, Surinam, Kazachstan, Mołdawia, Namibia, Ukraina, Sudan Południowy, Azerbejdżan, Trinidad i Tobago, Botswana, Turkmenistan, Fidżi,
 - **Grupa 4:** Gabon, Mauritius, Suazi, Czechy, Słowenia, Wietnam, Białoruś, Kongo (Brazzaville), Katar, Gujana, Słowacja, Bahrajn, Gwinea Równikowa.
- **Zmienna: średnia wielkość eksportu w relacji do PKB (eksport sr), kryterium podziału: równe percentyle**
 - **Grupa 1:** Timor Wschodni, Sudan, Gwinea Bissau, Burundi, Ruanda, Zambia, Erytrea, Bangladesz, Burkina Faso, Czad, Komory, Tanzania, Niger, Kosowo, Jemen, Lesoto, Mali, Republika Środkowoafrykańska,
 - **Grupa 2:** Benin, Madagaskar, Kamerun, Republika Zielonego Przylądka, Sierra Leone, Mozambik, Kenia, Malawi, Armenia, Nigeria, Serbia i Czarnogóra, Senegal, Dżibuti, Zimbabwe, Ghana, Gambia, Uzbekistan, Tadżykistan, Algieria,
 - **Grupa 3:** Papua Nowa Gwinea, Gruzja, Wyspy Salomona, Wybrzeże Kości Słoniowej, Chorwacja, Macedonia, Kirgistan, Togo, Zjednoczone Emiraty Arabskie, Mauretania, Czarnogóra, Angola, Surinam, Kazachstan, Mołdawia, Namibia, Ukraina, Sudan Południowy,

- **Grupa 4:** Azerbejdżan, Trinidad i Tobago, Botswana, Turkmenistan, Fidżi, Gabon, Mauritius, Suazi, Czechy, Słowenia, Wietnam, Białoruś, Kongo (Brazzaville), Katar, Gujana, Słowacja, Bahrajn, Gwinea Równikowa.
- **Zmienna: początkowy system polityczny (sys_pol_pocz), kryterium podziału: odchylenie standardowe / równe percentyle**
 - **Grupa 1:** Bahrajn, Katar, Czad, Wybrzeże Kości Słoniowej, Malawi, Uzbekistan, Algieria, Dżibuti, Ghana, Kuwejt, Mozambik, Turkmenistan, Zjednoczone Emiraty Arabskie, Angola, Burkina Faso, Republika Środkowoafrykańska, Gabon, Gwinea Bissau, Mali, Niger, Wietnam,
 - **Grupa 2:** Kamerun, Erytrea, Tanzania, Togo, Ruanda, Republika Zielonego Przylądka, Mauretania, Sudan, Azerbejdżan, Chorwacja, Kazachstan, Kirgistan, Tadżykistan, Jemen, Madagaskar, Senegal, Burundi, Sudan Południowy, Suazi,
 - **Grupa 3:** Benin, Gwinea Równikowa, Gujana, Kenia, Zambia, Kongo (Brazzaville), Gruzja, Papua Nowa Gwinea, Zimbabwe, Komory, Mołdawia, Surinam, Botswana, Timor Wschodni, Macedonia, Namibia, Serbia i Czarnogóra, Sierra Leone, Ukraina,
 - **Grupa 4:** Armenia, Białoruś, Słowacja, Wyspy Salomona, Somalia, Uganda, Bangladesz, Cypr, Gambia, Kosowo, Nigeria, Trinidad i Tobago, Fidżi, Lesoto, Mauritius, Czarnogóra, Czechy, Słowenia.
- **Zmienna: końcowy system polityczny (sys_pol_konc), kryterium podziału: odchylenie standardowe**
 - **Grupa 1:** Bahrajn, Kuwejt, Katar, Suazi, Uzbekistan, Turkmenistan, Zjednoczone Emiraty Arabskie, Angola, Azerbejdżan, Białoruś, Burundi, Czad, Erytrea, Somalia, Uganda, Wietnam, Gwinea Równikowa, Kazachstan, Gambia,
 - **Grupa 2:** Kamerun, Kongo (Brazzaville), Sudan, Ruanda, Tadżykistan, Mauretania, Togo, Republika Środkowoafrykańska, Sudan Południowy, Bangladesz,
 - **Grupa 3:** Algieria, Fidżi, Gabon, Tanzania, Jemen, Komory, Dżibuti, Wybrzeże Kości Słoniowej, Sierra Leone, Ukraina, Zimbabwe, Armenia, Gwinea Bissau, Mozambik, Papua Nowa Gwinea, Surinam, Burkina Faso, Madagaskar, Malawi, Namibia, Niger, Serbia i Czarnogóra, Benin, Gruzja,

Gujana, Kirgistan, Mali, Nigeria, Senegal, Zambia, Botswana, Cypr, Timor Wschodni, Ghana, Kosowo, Lesoto, Wyspy Salomona,

- **Grupa 4:** Chorwacja, Czechy, Kenia, Macedonia, Mołdawia, Czarnogóra, Republika Zielonego Przylądka, Mauritius, Słowacja, Słowenia, Trinidad i Tobago.
- **Zmienna: końcowy system polityczny (sys pol konc), kryterium podziału: równe percentyle**
 - **Grupa 1:** Bahrajn, Kuwejt, Katar, Suazi, Uzbekistan, Turkmenistan, Zjednoczone Emiraty Arabskie, Angola, Azerbejdżan, Białoruś, Burundi, Czad, Erytrea, Somalia, Uganda, Wietnam, Gwinea Równikowa, Kazachstan, Gambia, Kamerun, Kongo (Brazzaville), Sudan,
 - **Grupa 2:** Ruanda, Tadżykistan, Mauretania, Togo, Republika Środkowoafrykańska, Sudan Południowy, Bangladesz, Algieria, Fidżi, Gabon, Tanzania, Jemen, Komory, Dżibuti, Wybrzeże Kości Słoniowej, Sierra Leone, Ukraina, Zimbabwe,
 - **Grupa 3:** Armenia, Gwinea Bissau, Mozambik, Papua Nowa Gwinea, Surinam, Burkina Faso, Madagaskar, Malawi, Namibia, Niger, Serbia i Czarnogóra, Benin, Gruzja, Gujana, Kirgistan, Mali, Nigeria, Senegal, Zambia,
 - **Grupa 4:** Botswana, Cypr, Timor Wschodni, Ghana, Kosowo, Lesoto, Wyspy Salomona, Chorwacja, Czechy, Kenia, Macedonia, Mołdawia, Czarnogóra, Republika Zielonego Przylądka, Mauritius, Słowacja, Słowenia, Trinidad i Tobago.
- **Zmienna: przeszłość kolonialna (kolonia)**
 - **Byłe kolonie brytyjskie:** Bahrajn, Botswana, Cypr, Fidżi, Gambia, Ghana, Katar, Kenia, Kuwejt, Lesoto, Malawi, Namibia, Nigeria, Papua Nowa Gwinea, Sierra Leone, Suazi, Sudan, Tanzania, Trinidad i Tobago, Uganda, Wyspy Salomona, Zambia, Zimbabwe, Zjednoczone Emiraty Arabskie,
 - **Byłe kolonie francuskie:** Algieria, Benin, Burkina Faso, Czad, Dżibuti, Gabon, Kamerun, Komory, Kongo (Brazzaville), Madagaskar, Mali, Mauretania, Mauritius, Niger, Republika Środkowoafrykańska, Senegal, Togo, Wietnam, Wybrzeże Kości Słoniowej,
 - **Byłe kolonie portugalskie:** Angola, Gwinea Bissau, Mozambik, Republika Zielonego Przylądka,

- **Byłe kolonie belgijskie:** Burundi, Ruanda,
- **Byłe kolonie hiszpańskie:** Gujana, Gwinea Równikowa, Surinam, Timor Wschodni,
- **Byłe kolonie włoskie:** Somalia,
- **Brak przeszłości kolonialnej:** Armenia, Azerbejdżan, Bangladesz, Białoruś, Chorwacja, Czechy, Erytrea, Gruzja, Kazachstan, Kosowo, Kirgistan, Macedonia, Mołdawia, Czarnogóra, Serbia i Czarnogóra, Słowacja, Słowenia, Sudan Południowy, Tadżykistan, Turkmenistan, Ukraina, Uzbekistan, Jemen.
- **Zmienna: sposób uzyskania niepodległości (typ niepodległość)**
 - **Formowanie państwa:** Jemen,
 - **Dekolonizacja:** Algieria, Angola, Bahrajn, Benin, Botswana, Burkina Faso, Burundi, Kamerun, Republika Zielonego Przylądka, Republika Środkowoafrykańska, Czad, Komory, Kongo (Brazzaville), Cypr, Dżibuti, Timor Wschodni, Gwinea Równikowa, Fidżi, Gabon, Gambia, Ghana, Gwinea Bissau, Gujana, Wybrzeże Kości Słoniowej, Kenia, Kuwejt, Lesoto, Madagaskar, Malawi, Mali, Mauretania, Mauritius, Mozambik, Namibia, Niger, Nigeria, Papua Nowa Gwinea, Katar, Ruanda, Senegal, Sierra Leone, Wyspy Salomona, Somalia, Sudan, Surinam, Suazi, Tanzania, Togo, Trinidad i Tobago, Zjednoczone Emiraty Arabskie, Uganda, Wietnam, Zambia, Zimbabwe,
 - **Secesja:** Armenia, Azerbejdżan, Bangladesz, Białoruś, Chorwacja, Erytrea, Gruzja, Kazachstan, Kosowo, Kirgistan, Macedonia, Mołdawia, Czarnogóra, Słowenia, Sudan Południowy, Tadżykistan, Turkmenistan, Ukraina, Uzbekistan,
 - **Podział państwa:** Czechy, Słowacja.
- **Zmienna: zagrożenie klątwą surowcową (klątwa surowce)**
 - **zagrożenie klątwą surowcową:** Algieria, Angola, Armenia, Azerbejdżan, Bahrajn, Botswana, Czad, Gabon, Gwinea Równikowa, Jemen, Kamerun, Katar, Kazachstan, Kongo (Brazzaville), Kuwejt, Mauretania, Mozambik, Namibia, Nigeria, Papua Nowa Gwinea, Republika Środkowoafrykańska, Ruanda, Sierra Leone, Sudan, Timor Wschodni, Trinidad i Tobago, Turkmenistan, Uzbekistan, Zambia, Zjednoczone Emiraty Arabskie,

- **brak zagrożenia klątwą surowcową:** Bangladesz, Benin, Białoruś, Burkina Faso, Burundi, Chorwacja, Cypr, Czarnogóra, Czechy, Dżibuti, Erytrea, Fidżi, Gambia, Ghana, Gruzja, Gujana, Gwinea Bissau, Kenia, Kirgistan, Komory, Kosowo, Lesoto, Macedonia, Madagaskar, Malawi, Mali, Mauritius, Mołdawia, Niger, Republika Zielonego Przylądka, Senegal, Serbia i Czarnogóra, Słowacja, Słowenia, Somalia, Suazi, Sudan Południowy, Surinam, Tadżykistan, Tanzania, Togo, Uganda, Ukraina, Wietnam, Wybrzeże Kości Słoniowej, Wyspy Salomona, Zimbabwe.
- **Zmienna: dominująca religia (religia)**
 - **Katolicyzm:** Angola, Benin, Burundi, Chorwacja, Gabon, Gwinea Równikowa, Kamerun, Kongo (Brazzaville), Mozambik, Republika Zielonego Przylądka, Ruanda, Słowacja, Słowenia, Tanzania, Timor Wschodni,
 - **Islam:** Algieria, Azerbejdżan, Bahrajn, Bangladesz, Burkina Faso, Czad, Dżibuti, Erytrea, Gambia, Gwinea Bissau, Jemen, Katar, Kazachstan, Kirgistan, Komory, Kosowo, Kuwejt, Mali, Mauretania, Niger, Nigeria, Senegal, Sierra Leone, Somalia, Sudan, Tadżykistan, Turkmenistan, Uzbekistan, Wybrzeże Kości Słoniowej, Zjednoczone Emiraty Arabskie,
 - **Prawosławie:** Białoruś, Cypr, Czarnogóra, Gruzja, Macedonia, Mołdawia, Serbia i Czarnogóra, Ukraina,
 - **Protestantyzm:** Fidżi, Ghana, Gujana, Kenia, Lesoto, Malawi, Namibia, Papua Nowa Gwinea, Trinidad i Tobago, Uganda, Wyspy Salomona, Zambia, Zimbabwe,
 - **Hinduizm:** Mauritius, Surinam,
 - **Inna:** Armenia, Botswana, Czechy, Madagaskar, Republika Środkowoafrykańska, Suazi, Sudan Południowy, Togo, Wietnam.

Bibliografia

1. Aaronson, S., Abouharb, M., 2013, *Does the WTO help member states improve governance?*, World Trade Review, October.
2. Acemoglu, D., 2005, *Politics and Economics in Weak and Strong States*, Journal of Monetary Economics, vol. 52, No. 7, s. 1199-1226.
3. Acemoglu, D., Johnson S., Robinson, J., 2001, *The Colonial Origins of Comparative Development: An Empirical Investigation*, American Economic Review, vol. 91, No. 5, s. 1369-1401.
4. Acemoglu, D., Johnson S., Robinson, J., 2002, *Reversal of Fortune: Geography and Institutions in the Making of the Modern World Income Distribution*, Quarterly Journal of Economics, vol. 117, No. 4, s. 1231-1294.
5. Acemoglu, D., Johnson S., Robinson, J., 2005, *Institutions as a Fundamental Cause of Long-Run Growth* [w:] Aghion, P., Durlauf, S.N. (red.), *Handbook of Economic Growth*, vol. 1A, Elsevier, London, s. 385-472.
6. Acemoglu, D., Robinson, J., 2005, *Economic Origins of Dictatorship and Democracy*, Cambridge University Press, Cambridge.
7. Acemoglu, D., Robinson, J., 2006, *Economic Backwardness in Political Perspective*, American Political Science Review, Vol. 100, No. 1, s. 115-131.
8. Acemoglu, D., Robinson, J., 2014, *Dlaczego narody przegrywają? Źródła władzy, pomysłowości i ubóstwa*, Zysk i S-ka, Poznań.
9. Akerlof, G.A., Yellen, J.L., 1985, *A Near-Rational Model of the Business Cycle, with Wage and Price Inertia*, The Quarterly Journal of Economics, vol. 100, s. 823-838.
10. Alesina, A., Easterly, W., Matuszeski, J., 2011, *Artificial states*, Journal of the European Economic Association, vol. 9, No. 2, s. 246-277.
11. Arystoteles, 2003, *Polityka* [w:] Arystoteles, *Dzieła wszystkie*, t. I, Warszawa.
12. Auty, R., 1993, *Sustaining Development in Mineral Economies: The Resource Curse Thesis*, Routledge, London.

13. Auty, R., 1994, *Industrial policy reform in six large newly industrializing countries: The resource curse thesis*, World Development, vol. 22, issue 1., s. 11-26.
14. Baliamoune-Lutz, M., 2009, *Institutions, trade, and social cohesion in fragile states - implications for policy conditionality and aid allocation*, Journal of Policy Modelling, vol. 31, s. 877-890.
15. Balicki, A., 2006, *Analiza przeżycia i tablice wymieralności*, Polskie Wydawnictwo Ekonomiczne, Warszawa.
16. Bank Światowy, World Development Indicators, <http://databank.worldbank.org/data/reports.aspx?source=world-development-indicators> [dostęp: 18-07-2016].
17. Bartkowiak, R., 2008, *Historia myśli ekonomicznej*, PWE, Warszawa.
18. Battaglini, A., Scheffran, J., 2011, *Climate and conflicts: the security risks of global warming*, Regional Environmental Change, vol. 11, s. S27-S39.
19. Bertocchi, G., 2010, *The empirical determinants of state fragility*, <http://www.voxeu.org/article/determinants-state-fragility> [dostęp: 10-10-2015].
20. Bertocchi, G., Guerzoni, A., 2012, *Growth, history, or institutions: What explains state fragility in sub-Saharan Africa?*, Journal of Peace Research, vol. 49 (6), s. 769-783.
21. Bludnik, I., 2010, *Neoklasyzm. Analiza krytyczna*, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Poznaniu, Poznań.
22. Boaz, D., 2005, *Libertarianizm*, Zysk i S-ka, Poznań.
23. Brautigam, D., Knack, S., 2004, *Foreign aid, institutions, and governance in sub-Saharan Africa*, Economic Development and Cultural Change, vol. 52(1), s. 255–285.
24. Buchanan, J., 1975, *The Limits of Liberty: Between Anarchy and Leviathan*, The Collected Works of James M. Buchanan, Vol. 7 , Liberty Fund, Indianapolis.
25. Burke, M., Miguel, E., Satyanath, S., Dykema, J., Lobell, D., 2009, *Warming increases the risk of civil war in Africa*, Proceedings of the National Academy of Science of the United States of America, vol. 106, No. 49, s. 20670-20674.

26. Burnside, C., Dollar, D., 2000, *Aid, Policies, and Growth*, The American Economic Review, vol. 90, No. 4 (Sep.), s. 847-868.
27. Buzan, B., 1991, *People, States and Fear. An Agenda for International Security Studies in the Post-Cold War Era*, Harvester Wheatsheaf, New York – London.
28. Carment, D., Prest, S., Samy, Y., 2008, *Determinants of State Fragility and Implications for Aid Allocation*, UNI-WIDER Research Paper, No. 2008/46, <https://www.wider.unu.edu/publication/determinants-state-fragility-and-implications-aid-allocation> [dostęp: 15-01-2017].
29. Carment, D., Samy, Y., Hales, D., Miller, J., St. Jean, L., Tikuisis, P., 2010, *Indicators of State Failure. Phase II*, <http://www4.carleton.ca/cifp/app/serve.php/1350.pdf> [dostęp: 10-01-2016].
30. Center for Systemic Peace, *Polity IV Project (Political Regime Characteristics and Transitions)*, <http://www.systemicpeace.org/inscrdata.html> [dostęp: 18-07-2016].
31. Chari, V.V., 1998, *Nobel Laureate Robert E. Lucas, Jr: Architect of Modern Macroeconomics*, The Journal of Economic Perspectives, vol. 12, No 1, s. 171-86.
32. Chauvet, L., Collier, P., 2005, *Policy Turnarounds in Failing States*, <http://citeseerx.ist.psu.edu/viewdoc/download?doi=10.1.1.490.2649&rep=rep1&type=pdf> [dostęp: 5-05-2014].
33. Chauvet, L., Collier, P., Heoffler, A., 2007, *The Cost of Failing States and the Limits to Sovereignty*, UNU-WIDER Research Paper No. 2007/30.
34. CIFP FAQ, *Country Indicators for Foreign Policy Failed and Fragile States FAQ*, <http://www4.carleton.ca/cifp/app/serve.php/1138.pdf> [dostęp: 20-05-2016].
35. CIFP, *Country Indicators for Foreign Policy*, <http://www4.carleton.ca/cifp/> [dostęp: 20-05-2016].
36. Clarke, W., Gosende, R., 2003, *Somalia: Can a Collapsed State Reconstitute Itself?* [w:] Rotberg, R., *State Failure and State Weakness in a Time of Terror*, World Peace Foundation and Brookings Institution Press, Waszyngton, s. 129-160.
37. Collett, D., 2004, *Modelling Survival Data in Medical Research*, Chapman & Hall, London.

38. Collier, P., 2000, *Economic Causes of Civil Conflict and Their Implications for Policy*, https://siteresources.worldbank.org/DEC/Resources/econommic_causes_of_civilwar.pdf [dostęp: 15-01-2017].
39. Collier, P., 2007, *The Bottom Billion. Why the Poorest Countries Are Failing and What Can Be Done About It*, Oxford University Press, Oxford.
40. Collier, P., Hoeffler, A., 2002, *Aid, Policy and Growth in Post-Conflict Societies*, Policy Research Working Paper 2902 (October), The World Bank Development Research Group.
41. Collier, P., Hoeffler, A., 2004, *Greed and grievance in civil war*, Oxford Economic Papers, vol. 56, s. 563-595.
42. Collier, P., Sambanis, N., 2005, *Understanding Civil War : Evidence and Analysis*, Volume 1.: Africa, World Bank, <https://openknowledge.worldbank.org/handle/10986/7437> [dostęp: 13-3-2014].
43. Cook, P., Ludwig, J., Venkatesh, S., Braga, A., 2007, *Underground Gun Markets*, The Economic Journal, vol. 117, Nr 524, s. F588-F618.
44. CSRC (Crisis State Research Center), 2006, *Crisis, Fragile and Failed States Definitions used by CSRC*, The London School of Economics and Political Science, <http://www.lse.ac.uk/internationalDevelopment/research/crisisStates/download/drc/FailedState.pdf> [dostęp: 12-01-2016].
45. Czaplicka, K., 2007, *Sub-Saharan Africa: Reflections on development policies* [w:] Trzeciński, K., (red.), *The State and Development in Africa and Other Regions: Past and Present*, Oficyna Wydawnicza ASPRA-JR, Warszawa.
46. de Soto, H., 2002, *Tajemnica kapitału. Dlaczego kapitalizm triumfuje na Zachodzie a zawodzi gdzie indziej*, Fijorr Publishing, Warszawa.
47. de Soysa, I., 2002, *Paradise Is a Bazaar? Greed, Creed, and Governance in Civil War*, 1989-99, Journal of Peace Research, vol. 39, no. 4, s. 395-416.
48. Desment, K., Ortuño-Ortín, I., Wacziarg, R., 2015, *Culture, Ethnicity and Diversity*, National Bureau of Economic Research Working Paper Series, No. 20989, <http://www.nber.org/papers/w20989> [dostęp: 16-12-2016].

49. Di John, J., 2008, *Conceptualising the Causes and Consequences of Failed States: A Critical Review of the Literature*, Crisis States Working Paper Series, No. 2, London.
50. Domański, C., Misztal, M., 1998, *Zastosowanie wybranych metod dyskryminacji do wspomagania diagnozy i określenia ryzyka operacyjnego u pacjentów z chorobą wieńcową* [w:] Trzaskalik, T. (red.), *Modelowanie preferencji a ryzyko '98*, Wydawnictwo Akademii Ekonomicznej im. Karola Adameckiego w Katowicach, Katowice.
51. Domisiewicz, R., 2004, *The New Challenge: Weak and Failed States* [w:] Rotfeld, A., *Towards the UN Reform. New Treats, New Responses*, Diplomatic Academy of Ministry of Foreign Affairs, Warszawa.
52. Doornbos, M., 2002, *State Collapse and Fresh States: Some Critical Reflections*, *Development and Change*, vol. 33, No. 5, s. 797-815.
53. Dudek, H., Dybciak, M., 2006, *Zastosowanie modelu logitowego do analizy wyników egzaminów* [w:] Zajączkowska, M., *Ekonomika i organizacja gospodarki żywnościowej*, Zeszyty Naukowe Szkoły Głównej Gospodarstwa Wiejskiego w Warszawie, nr 60, Wydawnictwo SGGW, Warszawa.
54. Dutt, G., Gaioli, F., 2007, *Coping with Climate Change*, *Economic and Political Weekly*, vol. 42, No. 42, s. 4239-4250.
55. Ear, S., 2007, *Does aid dependence worsen governance?*, *International Public Management Journal*, vol. 10(3), s. 259–286.
56. Easterly, W., 2008, *Brzemie białego człowieka*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa.
57. Elgström, O., 2002, *Development and democracy: gains and gaps* [w:] Elgström, O., Hyden, G. (red.), *Development and Democracy. What have we learned and how?*, Routledge, London, s. 191-201.
58. Englehart, N., 2007, *Governments Against States: The Logic of Self-Destructive Despotism*, *International Political Science Review*, vol. 28, No. 2, s. 133-153.
59. Esty, D., Goldstone, J., Gurr, T., Haraff, B., Surko, P., Unger, A., Chen, R., 1998, *Failed States and International Security: Causes, Prospects, and Consequences*, *The State Failure Project: Early Warning Research for U.S. Foreign Policy Planning*,

- http://www.comm.ucsb.edu/faculty/mstohl/failed_states/1998/papers/gurr.html [dostęp: 20-10-2016].
60. Fearon, J., 1998, *Commitment Problems and the Spread of Ethnic Conflict* [w:] Lake, D., Rothchild, D. (red.), *In The International Spread of Ethnic Conflict*, Princeton University Press, Princeton, s. 107-126.
 61. Fearon, J., Laitin, D., 2003, *Ethnicity, Insurgency, and Civil War*, *American Political Science Review* 97, no.1, s. 75–90.
 62. Feeny, S., McGillivray, M., 2010, *Aid and public sector fiscal behaviour in failing states*, *Economic Modelling*, s. 1006-1016.
 63. Fenwick, L., 2009, *British and French Styles of Influence in Colonial and Independent Africa: A Comparative Study of Kenya and Senegal*, <http://auislandora.wrlc.org/islandora/object/0809capstones%3A10/datastream/PDF/view> [dostęp: 08-02-2017].
 64. Fernandez, R., 2010, *Does culture matter?*, National Bureau of Economic Research Working Paper Series, No. 16277, <http://www.nber.org/papers/w16277> [dostęp: 15-12-2016].
 65. Fetzek, S., Mazo, J., 2014, *Climate, Scarcity and Conflict*, *Survival: Global Politics and Strategy*, vol. 56, iss. 5, s. 143-170.
 66. Fiedor, B., 2015, *Instytucje formalne i nieformalne w kształtowaniu trwałego rozwoju*, *Problemy współczesnej ekonomii – tom 2*, *Studia i Prace Wydziału Nauk Ekonomicznych i Zarządzania*, nr 40, Wydawnictwo Naukowe Uniwersytetu Szczecińskiego, Szczecin, s. 83-107.
 67. Fisher, R.A., 1936, *The use of multiple measurements in taxonomic problems*, *Annals of Eugenics*, No. 7, s. 179-188.
 68. Friedman, M., 1993, *Why Government Is the Problem*, Hoover Institution Essays in Public Policy, No. 39, Stanford.
 69. Friedman, M., 2008, *Kapitalizm i wolność*, Wydawnictwo Helion, Gliwice.
 70. Friedman, M., Friedman, R., 1980, *Free to Choose: A Personal Statement*, Harcourt, New York.
 71. Fukuyama, F., 1996, *Trust. The Social Virtues and the Creation of Prosperity*, Free Press Paperback, New York.
 72. Fukuyama, F., 2003, *Kapitał społeczny* [w:] Harrison, L., Huntington, S. (red.), *Kultura ma znaczenie. Jak wartości wpływają na rozwój społeczeństw*, Zysk i S-ka, Poznań.

73. Fukuyama, F., 2005, *Budowanie państwa. Władza i ład międzynarodowy w XXI wieku*, Dom Wydawniczy Rebis, Poznań.
74. Fukuyama, F., 2012, *Historia ładu politycznego. Od czasów przedludzkich do rewolucji francuskiej*, Dom Wydawniczy REBIS, Poznań.
75. Gantar, E., 1998, *Symboliczne metody klasyfikacji danych*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa.
76. Gemechu, D., 2009, *Władza a rola wartości politycznych w społeczeństwie wieloetnicznym na przykładzie krajów Rogu Afryki* [w:] Kacprzak, L., Knopek, J., Mierzejewski, D. (red.), *Wartości a współczesne państwo*, Wydawnictwo Państwowej Wyższej Szkoły Zawodowej w Pile, Piła, s. 191-400.
77. Gil, G., 2015, *Upadanie państwa w stosunkach międzynarodowych po zimnej wojnie*, Wydawnictwo Uniwersytetu Marii Curie-Skłodowskiej, Lublin.
78. Gilley, B., 2006, *The Determinants of State Legitimacy: Results for 72 Countries*, *International Political Science Review*, vol. 27, No. 1, s. 47-71.
79. Giza, W., 2012, *Indywidualny i społeczny wymiar dobrobytu w świetle teorii użyteczności* [w:] Zagóra-Jonszta, U. (red.), *Dokonania współczesnej myśli ekonomicznej. Teoretyczne ujęcie dobrobytu*, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Katowicach, s. 101-109.
80. Giza, W., 2013, *Zawodność rynku. Powstanie i rozwój idei*, *Zeszyty Naukowe. Seria specjalna: Monografie*, nr 222, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Krakowie, Kraków.
81. Godłów-Legiędź, J., 2010, *Współczesna ekonomia. Ku nowemu paradygmatowi?*, Wydawnictwo C.H. Beck, Warszawa.
82. Grabiński, T., Wydymus, S., Zeliaś, A., 1989, *Metody taksonomii numerycznej w modelowaniu zjawisk społeczno-gospodarczych*, PWN, Warszawa.
83. Hardin, R., 1996, *Economic theories of the state* [w:] Mueller, D. (red.), *Perspectives on public choice*, Cambridge University Press, Cambridge, s. 21-34.
84. Harrison, L., Huntington, S. (red.), 2003, *Kultura ma znaczenie. Jak wartości wpływają na rozwój społeczeństw*, Poznań.

85. Helman, G., Ratner, S., 1992, *Anarchy rules: Saving Failed States*, Foreign Policy, vol. 89, <http://foreignpolicy.com/2010/06/15/saving-failed-states> [dostęp: 20-05-2015].
86. Hobbes, T., 1954, *Lewiatan, czyli materia, forma i władza państwa kościelnego i świeckiego*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa.
87. Hobbes, T., 1956, *Elementy filozofii*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa.
88. Hodgson, G., 2006, *What Are Institutions?*, Journal of Economic Issues, vol. 40, no. 1, s. 1-25.
89. Hofstede, G., Hofstede, G. J., Minkov, M., 2011, *Kultury i organizacje. Zaprogramowanie umysłu*, Polskie Wydawnictwo Ekonomiczne, Warszawa.
90. Holcombe, R. G., 1997, *A theory of the Theory of Public Goods*, The Review of Austrian Economics, vol. 10, No. 1, s. 1-22.
91. Holcombe, R.G., 2004, *Government: Unnecessary but Inevitable*, The Independent Review, v. VIII, No. 3, s. 325-342.
92. Holsti, K., 1985, *The Necrologists of International Relations*, Canadian Journal of Political Science, No. 4, s. 675-695.
93. Horowitz, D., 1985, *Ethnic Groups in Conflict*, University of California Press, Berkeley.
94. Howard, T., 2008, *Revisiting State Failure: Developing a Casual Model of State Failure Based Upon Theoretical Insight*, Civil Wars, vol. 10, No. 2, s. 125-147.
95. Howard, T., 2010, *The tragedy of failure: evaluating state failure and its impact on the spread of refugees, terrorism, and war*, ABC-CLIO, Santa Barbara.
96. Howard, T., 2016, *Failed States and the Origins of Violence. A Comparative Analysis of State Failure as a Root Cause of Terrorism and Political Violence*, Routledge, New York.
97. Huria, S., 2008, *Failing and Failed States. The Global Discourse*, IPCS Issue Brief, No. 75 (July).
98. Inglehart, R., 2003, *Kultura a demokracja* [w:] Harrison, L., Huntington, S. (red.), *Kultura ma znaczenie. Jak wartości wpływają na rozwój społeczeństw*, Zysk i S-ka, Poznań.

99. Inglot-Brzęk, E., 2009, *Zmiana w organizacji biurokratycznej* [w:] Woźniak, M. (red.) *Nierówności Społeczne a Wzrost Gospodarczy z. 15: Uwarunkowania instytucjonalne*, Wydawnictwo Uniwersytetu Rzeszowskiego, Rzeszów, s. 375-387.
100. Iqbal, Z., Starr, H., 2007, *State failure: Conceptualization and Determinants*, Working Paper, University of South Carolina, people.cas.sc.edu/starr/Research/State_failure_1.42.pdf [dostęp: 12-01-2016].
101. Iqbal, Z., Starr, H., 2008, *Bad Neighbors: Failed States and Their Consequences*, *Conflict Management and Peace Science*, vol. 25, s. 315-331.
102. Issue Correlates of War Project, <http://www.paulhensel.org/icow.html> [dostęp: 18-07-2016].
103. Jacoby, T., 2005, *Cultural Determinism, Western Hegemony & the Efficacy of Defective States*, *Review of African Political Economy*, vol. 32, No. 104/105, s. 215-233.
104. Jagiełło, R., 2013, *Analiza dyskryminacyjna i regresja logistyczna w procesie oceny zdolności kredytowej przedsiębiorstw*, *Materiały i Studia*, Zeszyt nr 286, Narodowy Bank Polski, Warszawa.
105. Jellinek, J., 1921, *Ogólna nauka o państwie*, Księgarnia F. Hoesicka, Warszawa.
106. Justyńska, I., Justyński, J., 2012, *Historia myśli socjologiczno-ekonomicznej*, Wolters Kluwer Polska, Warszawa.
107. Kalbfleisch, J. D., Prentice, R. L., 1980, *The Statistical Analysis of Failure Time Data*, John Wiley & Sons, New York, Chichester, Brisbane, Toronto.
108. Kaplan, E. L., Meier, P., 1958, *Nonparametric estimation from incomplete observations*, *Journal of the American Statistical Association*, vol. 53, No. 282, s. 457-481.
109. Karadeli, C., 2009, *Failed State Concept and the Sub-Saharan African Experience*, *Journal of Arts and Sciences*, vol. 12, s. 111-126.
110. Keynes, J. M., 1919, *The Economic Consequences of the Peace*, <http://socserv2.socsci.mcmaster.ca/~econ/ugcm/3ll3/keynes/peace.htm> [dostęp: 18-05-2016].

111. Keynes, J.M., 1926, *The end of laissez-faire*, <http://www.panarchy.org/keynes/laissezfaire.1926.html> [dostęp: 18-05-2016].
112. Keynes, J.M., 2003, *Ogólna teoria zatrudnienia, procentu i pieniądza*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa.
113. Khan, M., 2000, *Rent-Seeking as a Process: Inputs, Rent-Outcomes and Net Effects* [w:] Khan, M., Jomo, K. (red.), *Rents, Rent-Seeking and Economic Development*, Cambridge University Press, Cambridge, s. 70-144.
114. Kiedrowska, M., Marszałek, P., 2003, *Polityka pieniężna i fiskalna w teoriach makroekonomicznych*, Ruch Prawniczy, Ekonomiczny i Socjologiczny, Zeszyt 1, s. 71-90.
115. King, G., Zeng, L., 2001, *Improving Forecasts of State Failure*, *A Quarterly Journal of International Relations*, *World Politics* 53.4, July, s. 623-58.
116. Klare, M., 2001, *Natural Resource Wars: The New Landscape of Global Conflict*, Metropolitan Books, New York.
117. Klima, E., 2009, *Państwo – historia idei*, *Acta Universitatis Lodzianis. Folia Geographica Socio-Oeconomica*, nr 10, Łódź 2009, s. 4-20.
118. Knack, S., 2001, *Aid Dependence and the Quality of Governance: Cross-Country Empirical Tests*, *Southern Economic Journal*, Vol. 68, No. 2 (October), s. 310-329.
119. Knack, S., 2004, *Does foreign aid promote democracy?*, *International Studies Quarterly*, vol. 48(1), s. 251–266.
120. Konwencja o Prawach i Obowiązках Państw (konwencja z Montevideo), 1933, <http://www.cfr.org/sovereignty/montevideo-convention-rights-duties-states/p15897> [dostęp 15-04-2016].
121. Koonings, K., Kruijt, D., 2004, *Armed actors, organized violence and state failure in Latin America: a survey of issues and arguments* [w:] Koonings, K., Kruijt, D. (red.), *Armed Actors. Organised Violence and State Failure in Latin America*, Zed Books, London & New York.
122. Krueger, A., 1974, *The Political Economy of the Rent-Seeking Society*, *The American Economic Review*, vol. 64, No. 3, s. 291-303.

123. Krzyśko, M., 1982, *Analiza dyskryminacyjna*, Wydawnictwo Naukowe Uniwersytetu im. Adama Mickiewicza w Poznaniu, Poznań.
124. Kukułka, A., 2016, *Ekonomiczne skutki katastrof naturalnych w krajach rozwijających się na przykładzie Indonezji*, Difin, Warszawa.
125. Kydland, F.E., Prescott, E.C., 1977, *Rules Rather than Discretion: The Inconsistency of Optimal Plans*, *Journal of Political Economy*, vol. 85, No. 3, s. 473-492.
126. Lachowski, T., 2012, *Fenomen „państwa upadłego – implikacje dla międzynarodowego bezpieczeństwa* [w:] Rączkowski, M. (red.), *Zagrożenia asymetryczne we współczesnym świecie – wybrane problemy*, Piktora, Łódź, s. 63-84.
127. Lange, M., Mahoney, J., vom Hau, M., 2006, *Colonialism and Development: A Comparative Analysis of Spanish and British Colonies*, *American Journal of Sociology*, vol. 111, nr 5, s. 1412-1462.
128. Lechman, E., 2014, *Case Study Methodology: Few Conceptual Considerations*, *Przedsiębiorstwo we współczesnej gospodarce – teoria i praktyka*, nr 4, s. 21-31.
129. Lee, A., Schultz, K.A., 2012, *Comparing British and French Colonial Legacies: A Discontinuity Analysis of Cameroon*, *Quarterly Journal of Political Science*, vol. 7, No. 4, s. 365-410.
130. Legiędź, T., 2015, *Formowanie się porządku społecznego w krajach transformacji z perspektywy teorii rozwoju gospodarczego D. C. Northa, J. J. Wallisa oraz B. R. Weingasta*, *Prace naukowe Uniwersytetu Ekonomicznego we Wrocławiu*, nr 405, s.38-54.
131. Lemerchand, R., 2003, *The Democratic Republic of Congo: From Failure to Potential Reconstruction* [w:] Rotberg, R. (red.), *State Failure and State Weakness in a Time of Terror*, World Peace Foundation and Brookings Institution Press, Waszyngton, s. 29-70.
132. Lizak, W., 2009, *Państwo w Afryce* [w:] Sułek, M., Symonides, J. (red.), *Państwo w teorii i praktyce stosunków międzynarodowych*, Wydawnictwo Uniwersytetu Warszawskiego, Warszawa, s. 373-392.
133. Locke, J., 1992, *Dwa traktaty o rządzie*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa.

134. Lockwood, M., 2005, *The State They're In: An Agenda for International Action on Poverty in Africa*, ITDG Publishing, Bourton-on-Dunsmore.
135. Łoś-Nowak, T., 2012, *Jakie państwo w ponowoczesnym świecie?* [w:] Bernacki, W., Walaszka A. (red.), *Amerykomania. Księga jubileuszowa ofiarowana Profesorowi Andrzejowi Mani*, tom 2, Wydawnictwo Uniwersytetu Jagiellońskiego, s. 511-533.
136. Lucas, R.E. Jr., 1976, *Econometric Policy Evaluation: A Critique* [w:] Brunner, K., Meltzer, A. (red.), *The Phillips Curve and Labor Markets*, Carnegie-Rochester Conference Series on Public Policy, 1, American Elsevier, New York.
137. Lucas, R.E. Jr., 1982, *Optimal Investment with Rational Expectations* [w:] Lucas, R.E. Jr., Sargent, T. (red.), *Rational Expectations and Econometric Practice*, vol. 1, The University of Minnesota Press, Minneapolis, s. 55-66.
138. Lucas, R.E. Jr., Prescott, E., 1971, *Investment Under Uncertainty*, *Econometrica*, vol. 39, No. 5., s. 659-681.
139. Mączyńska, E., 2015, *Funkcje państwa w kształtowaniu ładu społeczno-gospodarczego* [w:] Jarmołowicz, W., Piątek, D. (red.), *Państwo wobec wolności gospodarczej. Teoria i praktyka transformacji*, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Poznaniu, Poznań, s. 17-35.
140. Maddala, G. S., 2008, *Ekonometria*, red. nauk. przekł. Gruszecki, M., Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa.
141. Malinowski, M., 1986, *Cień Marsa nad Czarnym Lądem*, Krajowa Agencja Wydawnicza, Warszawa.
142. Marshall, M., 2008, *Fragility, Instability, and the Failure of States*, Working Paper, Council on Foreign Relations, https://www.cfr.org/content/publications/attachments/CPA_WorkingPaper_1.pdf [dostęp: 8-11-2016].
143. Mazo, J., 2009, *Climate Conflict: How global warming threatens security and what to do about it*, The Adelphi Series, vol. 49, iss. 409, s. 1-168.
144. Mehlum, H., Moene, K., Torvik, R., 2006, *Institutions and The Resource Curse*, *Economic Journal*, vol. 116, s. 1-20.
145. Metelska-Szaniawska, K., 2008, *Konstytucyjne czynniki reform gospodarczych w krajach postsocjalistycznych*, Wydawnictwa Uniwersytetu Warszawskiego, Warszawa.

146. Miller, R. G., Gong, G., Muñoz, A., 1981, *Survival analysis*, Wiley, New York.
147. Moore, M., 1998, *Death without taxes: democracy, state capacity and aide dependence in the fourth world* [w:] Robinson, M., White, G. (red.), *The Democratic Developmental State: Politics and Institutional Design*, Oxford Studies in Democratization, Oxford University Press, Oxford.
148. Moore, M., 2001, *Political Underdevelopment: What causes "bad governance"*, Public Management Review, vol. 3, s. 385-418.
149. Moss, L. S., 2010, *Optimal Jurisdictions and the Economic Theory of the State: Or, Anarchy and One-World Government Are Only Corner Solutions*, American Journal of Economics and Sociology, vol. 69, No. 1, s. 321-332.
150. Moyo, D., 2009, *Why foreign aid is hurting Africa*, The Wall Street Journal, <http://online.wsj.com/news/articles/SB123758895999200083> [dostęp: 11-04-2015].
151. Muszyński, M., 2013, *Prawo międzynarodowe wobec problemu niewypłacalności państw*, Ruch Prawniczy, Ekonomiczny i Socjologiczny, Zeszyt 2, s. 29-42.
152. Noga, M., 2014, *Kultura a ekonomia*, CeDeWu, Warszawa.
153. North, D., 1988, *Institutions, Economic Growth and Freedom: An Historical Introduction* [w:] Walker, M. (ed.), *Freedom, Democracy, and Economic Welfare*, Vancouver, Fraser Institute, s. 3-25.
154. North, D., 1990, *Institutions, Institutional Change and Economic Performance*, Cambridge University Press, Cambridge – New York.
155. North, D., Wallis, J., Webb, S., Weingast, B., 2007, *Limited access orders in the developing world: A new approach to the problems of development*, World Bank Policy Research Paper, No. 4359.
156. North, D., Wallis, J., Weingast B., 2009a, *Violence and Social Orders. A Conceptual Framework for Interpreting Recorded Human History*, Cambridge University Press, Cambridge.
157. North, D., Wallis, J., Weingast, B., 2009b, *Violence and the Rise of Open-Access Orders*, Journal of Democracy, vol. 20, No. 1, s. 55-68.
158. Olson, M., 1965, *The Logic of Collective Action - Public Goods and The Theory of Groups*, Harvard University Press, Cambridge.

159. Olson, M., 1993, *Dictatorship, Democracy, and Development*, The American Political Science Review, vol. 87, No. 3, s. 567-576.
160. Olson, M., 2000, *Power and Prosperity. Outgrowing Communist and Capitalist Dictatorships*, Basic Books, New York.
161. Oniszczyk, J., 2011, *Określenie państwa współczesnego* [w:] Oniszczyk, J. (red.), *Współczesne państwo w teorii i praktyce*, Oficyna Wydawnicza SGH, Warszawa, s. 49-72.
162. Ostrom, E., 2008, *Doing institutional analysis. Digging deeper than markets and hierarchies* [w:] Ménard, C., Shirley, M. (red.), *Handbook of New Institutional Economics*, Springer-Verlag, Berlin, s. 819-848.
163. Ottaway, M., Mair, S., 2004, *State at Risk and Failed States. Putting Security First*, Policy Outlook. Democracy & Rule of Law Project (September), Carnegie Endowment for International Peace.
164. Pańków, W., 2004, *Instytucje i organizacje: pochodzenie, powstawanie, funkcje, przekształcenia*, Poltext, Warszawa.
165. Pasour, E. C. Jr., 1981, *The Free Rider as a Basis for Government Intervention*, The Journal of Libertarian Studies, vol. 5, No. 4, s. 453-464.
166. Patel, P., Sondorp, E., 2003, *Climate change, conflict and health*, Transactions of the Royal Society of Tropical Medicine and Hygiene, vol. 97, s. 139-140.
167. Pęciak, R., 2016, *Rozważania dotyczące genezy maksymy laissez-faire, laissez-passer*, Współczesne Problemy Ekonomiczne, nr 13, s. 123-131.
168. Piątek, D., 2016, *Instytucje państwa a wzrost gospodarczy w krajach postsocjalistycznych*, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Poznaniu, Poznań.
169. Piątek, D., Szarzec, K., 2008, *Cechy państwa sprzyjające rozwojowi gospodarczemu*, Ruch Prawniczy, Ekonomiczny i Socjologiczny, Zeszyt 4, Poznań, s. 109-128.
170. Pigou, A., 1912, *Wealth and Welfare*, Macmillian and Co., London.
171. Pigou, A., 1920, *The Economics of Welfare*, Macmillian and Co., London.
172. Poggi, G., 2010, *Państwo. Jego natura, rozwój i perspektywy*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa.
173. Polska Pomoc, <https://polskapomoc.gov.pl> [dostęp: 21-05-2016].

174. Porter, B. D., 1994, *War and the Rise of the State: The Military Foundations of Modern Politics*, Free Press, New York.
175. Prunier, G., Gisselquist, R., 2003, *The Sudan: A Successfully Failed State* [w:] Rotberg, R., *State Failure and State Weakness in a Time of Terror*, World Peace Foundation and Brookings Institution Press, Washington D.C.
176. Ptak, P., 2008, *Ile państwa w gospodarce? Milton Friedman o ekonomicznej roli państwa*, C. H. Beck, Warszawa.
177. Pureza, J., Roque, S., Rafael, M., Cravo, T., 2007, *Do States Fail or Are They Pushed? Lessons Learned From Three Former Portuguese Colonies*, Oficina do CES, No. 273.
178. Rajan, R., 2011, *Failed States, Vicious Cycles, and a Proposal*, Center for Global Development, Working Paper 243 (March).
179. Ratajczak, M., 2011, *Popularność ekonomii instytucjonalnej. Moda czy trwała zmiana?*, Polskie Towarzystwo Ekonomiczne, Zeszyty Naukowe, nr 9, Kraków, s. 29-42.
180. Reilly, D., 2008, *Failed States: Internal and External Sources of Failure*, Journal of Conflict Studies, vol. 28, <https://journals.lib.unb.ca/index.php/JCS/article/view/11244/13417> [dostęp: 27-07-2015].
181. Reinert, E., Amaizo, Y., Kattel, R., 2007, *The Economics of Failed, Failing and Fragile States - Productive Structure as the Missing Link*, http://www.policyinnovations.org/ideas/policy_library/data/01442/_res/id=sa_File1/Paper.pdf [dostęp: 2016-12-20].
182. Reno, W., 2003, *Sierra Leone: Warfare in a Post-State Society* [w:] Rotberg, R., *State Failure and State Weakness in a Time of Terror*, World Peace Foundation and Brookings Institution Press, Waszyngton.
183. Ricardo, D., 1971 (cop.), *Principles of political economy and taxation*, Penguin Books, Aylesbury.
184. Roman, Ł., 2014, *Państwa upadłe jako zagrożenie bezpieczeństwa na początku XXI wieku*, *Obronność. Zeszyty Naukowe* 3 (11), Wydawnictwo Akademii Obrony Narodowej, Warszawa, s. 113-124.
185. Rotberg, R., 2002, *Failed States in a World of Terror*, *Foreign Affairs*, vol. 81, Jul / Aug, <https://www.foreignaffairs.com/articles/2002-07-01/failed-states-world-terror> [dostęp: 15-11-2015].

186. Rotberg, R., 2004, *The Failure and Collapse of Nation-States: Breakdown, Prevention, and Repair* [w:] Rotberg, R. (red.), *When States Fail. Causes and consequences*, Princeton University Press, Princeton, s. 1-50.
187. Sachs, J., 2006, *Koniec z nędzą. Zadanie dla naszego pokolenia*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa.
188. Sachs, J., 2009, *Nasze wspólne bogactwo. Ekonomia dla przeludnionej planety*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa.
189. Sachs, J., Warner, A., 1995, *Natural resource abundance and economic growth*, National Bureau of Economic Research Working Paper, vol. 5398, Cambridge.
190. Sala-i-Martin, X., 1997, *I Just Ran Four Million Regressions*, National Bureau of Economic Research, NBER Working Paper, No. 6252.
191. Salavrakos, I.-D., 2012, *Political Economy, Theories of the State and Economic Crisis*, International Journal of Business and Social Science, vol. 3, No. 20, s. 79-98.
192. Sambanis, N., 2001, *Do Ethnic and Nonethnic Civil Wars Have the Same Causes? A Theoretical and Empirical Inquiry (part 1)*, Journal of Conflict Resolution, vol. 45, No. 3., s. 259-282.
193. Samuelson, P., 1954, *The Pure Theory of Public Expenditure*, The Review of Economics and Statistics, vol. 36, no. 4 (Nov.), s. 387-389.
194. Santarelli, E., 2000, *The duration of new firms in banking: an application of Cox regression analysis*, Empirical Economics, vol. 25, s. 315-325.
195. Say, J. B., 1960, *Traktat o ekonomii politycznej czyli prosty wykład sposobu, w jaki się tworzą, rozdzielają i spożywają bogactwa*, Państwowe Wydawnictwo Naukowe, Kraków.
196. Sender, J., 1999, *Africa's Economic Performance: Limitations of the Current Consensus*, Journal of Economic Perspectives, vol. 13, No. 3, s. 89-114.
197. Sialitskaya, Y., 2013, „Klątwa bogactwa” a polityka gospodarcza państwa (praca doktorska).
198. Smith, A., 2015, *Badania nad naturą i przyczynami bogactwa narodów*, Tom 2., Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa.
199. Smith, D., Vivekananda, J., 2007, *A climate of conflict. The links between climate change, peace and war*, International Alert, London.

200. Smith, D., Vivekananda, J., 2008, *A Climate of Conflict*, Sida.
201. Smith, D., Vivekananda, J., 2009, *Climate Change, Conflict and Fragility. Understanding the linkages, shaping effective responses*, International Alert.
202. Sowell, T., 2016, *Bieda, bogactwo i polityka w ujęciu globalnym*, Fijorr Publishing Company, Warszawa.
203. Stankiewicz, W., 2012, *Ekonomika instytucjonalna. Zarys wykładu* (wyd. 3 uzupełnione),
http://www.pwsbia.edu.pl/pliki/Waclaw_Stankiewicz_Ekonomika_Instytucjonalna_III.pdf [dostęp: 21-01-2017].
204. Stern, N., 2007, *Stern Review on the Economics of Climate Change*,
http://mudancasclimaticas.cptec.inpe.br/~rmclima/pdfs/destaques/sternreview_report_complete.pdf [dostęp: 15-09-2016].
205. Sulkowski, P., 2011, *Państwa upadłe a bezpieczeństwo* [w:] Żukrowska, K. (red.), *Bezpieczeństwo międzynarodowe. Przegląd aktualnego stanu*, IUSatTAX, Warszawa.
206. Swadźba, S., 2007, *Globalizacja a polityka ekonomiczna państwa* [w:] Sokołowski, J., Przybyła, Z. (red.), *Współczesne problemy polityki ekonomicznej*, Jarmen Press, Wrocław / Jelenia Góra, s. 379-385.
207. Swadźba, S., 2017, *System gospodarczy a wzrost i rozwój gospodarczy Afryki Subsaharyjskiej* [w:] Swadźba, S. (red.), *Systemowe uwarunkowania wzrostu i rozwoju gospodarczego krajów Afryki Subsaharyjskiej*, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Katowicach, Katowice, s. 147-161.
208. Sylwestrzak, A., 2013, *Historia doktryn politycznych i prawnych*, Wyd. 9, LexisNexis, Warszawa.
209. Szarzec, K., 2013, *Państwo w gospodarce. Studium teoretyczne – od Adama Smitha do współczesności*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa.
210. The Economist, 2014, *What Dutch disease is, and why it's bad*,
<http://www.economist.com/blogs/economist-explains/2014/11/economist-explains-2> [dostęp: 10-12-2016].
211. The World Factbook, <https://www.cia.gov/library/publications/the-world-factbook> [dostęp: 18-07-2016].

212. Therborn, G., 2015, *Nierówność, która zabija. Jak globalny wzrost nierówności niszczy życie milionów i jak z tym walczyć*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa.
213. Totleben, B., 2015, *Sytuacja makroekonomiczna państw upadłych i trwałych - analiza porównawcza*, Zeszyty Naukowe Uniwersytetu Szczecińskiego / Współczesne Problemy Ekonomiczne. Globalizacja. Liberalizacja. Etyka, 858, s. 95-104.
214. Tusińska, M., 2016, *Nierówności dochodowe i ubóstwo w krajach Afryki Subsaharyjskiej* [w:] Swadźba, S. (red.), *Systemowe uwarunkowania wzrostu i rozwoju gospodarczego krajów Afryki Subsaharyjskiej*, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Katowicach, Katowice, s. 112-124.
215. UNDP (United Nations Development Programme), 1996, *Human Development Report 1996: Economic growth and Human Development*, Oxford University Press, New York.
216. UNDP (United Nations Development Programme), 2009, User's Guide on Measuring Fragility, <http://www4.carleton.ca/cifp/app/serve.php/1245.pdf> [dostęp: 18-01-2016].
217. Vallings, C., Moreno-Torres, M., 2005, *Drivers of Fragility: What Makes States Fragile?*, PRDE Working Paper No. 7.
218. van Reybrouck, D., 2016, *Kongo. Opowieść o zrujnowanym kraju*, W.A.B., Warszawa.
219. Veblen, T., 1904, *The Theory of Business Enterprise*, Charles Scribner's Sons, New York.
220. Vogiatzoglou, K., Nguyen, P., 2016, *Economic Openness and Economic Growth A Cointegration Analysis for Asean-5 Countries*, The European Journal of Applied Economics, vol. 13 (2), s. 10-20.
221. Wald, A., 1944, *On a statistical problem in the classification of an individual into one of two groups*, The Annals of Mathematical Statistics, s. 145-162.
222. Wald, A., 1950, *Statistical Decision Function*, Wiley, New York.
223. Wardin, K., 2013, *Zagrożenie bezpieczeństwa międzynarodowego: państwa słabe i upadłe – casus pułapki tożsamości kulturowej*, Przegląd Naukowo-Metodyczny. Edukacja dla Bezpieczeństwa, nr 4, s. 37-46.

224. Weber, M., 1964, *The Theory of Social Economic Organization*, The Free Press, New York.
225. Weber, M., 2002, *Gospodarka i społeczeństwo. Zarys socjologii rozumującej*, Wydawnictwo Naukowe PWN, Warszawa.
226. Weingast, B., 1997, *The Political Foundations of Democracy and the Rule of Law*, *American Political Science Review*, vol. 91, No. 2, s. 245-263.
227. Wilkin, J., 2010, *Słabość państwa w jego relacji do gospodarki i słabość ekonomicznej teorii państwa*, *Zarządzanie Publiczne*, nr 1 (11), s. 25-35.
228. Wilkin, J., 2013, *Kategoria jakości rządzenia w naukach gospodarczych – zagadnienia metodologiczne* [w:] Wilkin, J. (red.), *Jakość rządzenia w Polsce. Jak ją badać, monitorować i poprawiać?*, Scholar, Warszawa, s. 19-38.
229. Wilkin, J., 2016, *Instytucjonalne i kulturowe podstawy gospodarowania. Humanistyczna perspektywa w ekonomii*, Scholar, Warszawa.
230. Williams, P., 2009, *State Failure in Africa: Causes, Consequences and Responses*,
https://blackboard.angelo.edu/bbcswebdav/institution/LFA/CSS/Course%20Material/CCSS2323/Readings/STATE_FAILURE_IN_AFRICA_CAUSES_CONSEQUENCES_AND.pdf [dostęp: 22-02-2017].
231. Williamson, O., 2000, *The New Institutional Economics: Taking Stock, Looking Ahead*, *Journal of Economic Literature*, vol. 38, No. 3, s. 595-613.
232. Wiśniewska, D., 2012, *Analiza dyskryminacyjna w prognozowaniu cen akcji. Nowa koncepcja konstruowania prognoz jakościowych*, Wydawnictwo Uniwersytetu Ekonomicznego w Poznaniu, Poznań.
233. Witkowska, D., 2002, *Sztuczne sieci neuronowe i metody statystyczne. Wybrane zagadnienia finansowe*, C.H. Beck, Warszawa.
234. World Value Survey, <http://www.worldvaluessurvey.org> [dostęp: 10-07-2016].
235. Woźniak, M.G., 2008, *Sprawiedliwe nierówności a aksjologia ładu instytucjonalnego*, *Annales. Etyka w życiu gospodarczym*, vol. 11, nr 1, s. 233-248.
236. WTO (World Trade Organization), *Government Procurement Agreement. Opening markets and promoting good governance*,

https://www.wto.org/english/thewto_e/20y_e/gpa_brochure2015_e.pdf

[dostęp: 22-03-2017].

237. Yin, R., 2015, *Studium przypadku w badaniach naukowych. Projektowanie i metody*, Wydawnictwo Uniwersytetu Jagiellońskiego, Kraków.
238. Zagóra-Jonszta, U., 2007, *Własność w ujęciu wybranych kierunków myśli ekonomicznej* [w:] Polszakiewicz, B., Boehlke, J., *Własność i kontrola i teorii i praktyce*, Wydawnictwo Uniwersytetu Mikołaja Kopernika, Toruń, s. 39-59.
239. Zartman, W. (red.), 1995, *Collapsed states. The Disintegration and Restoration of Legitimate Authority*, Lynne Rienner Publishers, Colorado.
240. Zieliński, E., 2001, *Nauka o państwie i polityce*, Elipsa, Warszawa.

Źródła danych statystycznych:

- Bertelsmann Stiftung's Transformation Index, www.bti-project.org
- Country Indicators for Foreign Policy, www4.carleton.ca/cifp
- Country Policy and Institutional Assessment, <https://data.worldbank.org/data-catalog/CPIA>
- Fragile States Index, <http://fundforpeace.org/fsi/>
- Fund for Peace, <http://fundforpeace.org>
- Global Peace Index, <http://visionofhumanity.org>
- Index of African Governance, [http:// mo.ibrahim.foundation/iiag](http://mo.ibrahim.foundation/iiag)
- Index of State Weakness in the Developing World, www.brookings.edu/research/index-of-state-weakness-in-the-developing-world/
- Issue Correlates of War Project, www.paulhensel.org/icow.html
- Political Regime Characteristics and Transitions, www.systemicpeace.org/polity/polity4.htm
- State Fragility Index, <http://fundforpeace.org/fsi>
- World Development Indicators, <http://databank.worldbank.org>
- World Religion Dataset, National Religion Dataset, <http://www.thearda.com/Archive/Files/Descriptions/WRDNATL.asp>
- Worldwide Governance Indicators, <http://info.worldbank.org/governance/wgi>

Spis wykresów

Wykres 1. Liczba państw na świecie w latach 1800-2015	84
Wykres 2. Skala występowania zjawiska upadłości państw w latach 1800-2015	86
Wykres 3. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od pocz. PKB per capita	96
Wykres 4. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od średniego PKB per capita	98
Wykres 5. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od średniego tempa wzrostu gospodarczego	100
Wykres 6. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od średniej wartości importu	102
Wykres 7. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od średniej wartości eksportu	104
Wykres 8. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od początkowego systemu politycznego	106
Wykres 9. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od systemu politycznego w ostatnim roku badania	108
Wykres 10. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od przeszłości kolonialnej	110
Wykres 11. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od sposobu uzyskania niepodległości	112
Wykres 12. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od występowania zagrożenia kłatwą surowcową	113
Wykres 13. Krzywe prawdopodobieństwa upadłości państwa w zależności od dominującej religii	115
Wykres 14. Porównanie wyników estymacji – modele (17) oraz (36)	145
Wykres 15. Zależność pomiędzy PKB per capita a prawdopodobieństwem upadłości państwa	149
Wykres 16. Zależność pomiędzy system politycznym a prawdopodobieństwem upadłości państwa	150

Spis tabel

Tabela 1. Charakterystyka instytucji wg Acemoglu i Robinsona.....	36
Tabela 2. Zestawienie wybranych definicji państw według stopnia rozkładu jego funkcji	42
Tabela 3. Zestawienie wybranych klasyfikacji upadłości państw	49
Tabela 4. Macierz korelacji wybranych klasyfikacji sprawności państw	51
Tabela 5. Lista państw upadłych utworzonych w 1960 roku i później	87
Tabela 6. Lista państw nieupadłych utworzonych w 1960 roku i później	88
Tabela 7. Opis zmiennych wykorzystanych w badaniu	91
Tabela 8. Tablica przeżycia ze względu na początkowy PKB per capita	96
Tabela 9. Tablica przeżycia ze względu na średni PKB per capita	97
Tabela 10. Tablica przeżycia ze względu na średnią stopę wzrostu PKB per capita.....	99
Tabela 11. Tablica przeżycia ze względu na średnią wielkość importu w relacji do PKB	101
Tabela 12. Tablica przeżycia ze względu na średnią wielkość eksportu w relacji do PKB	103
Tabela 13. Tablica przeżycia ze względu na początkowy system polityczny	105
Tabela 14. Tablica przeżycia ze względu na końcowy system polityczny	107
Tabela 15. Tablica przeżycia ze względu na przeszłość kolonialną	109
Tabela 16. Tablica przeżycia ze względu na sposób uzyskania niepodległości	111
Tabela 17. Tablica przeżycia ze względu na występowanie zagrożenia klątwą surowcową.....	113
Tabela 18. Tablica przeżycia ze względu na dominującą religię.....	114
Tabela 19. Schemat macierzy klasyfikacji dla dwóch populacji	118
Tabela 20. Opis zmiennych wykorzystanych w badaniu	122
Tabela 21. Statystyki opisowe zmiennych wykorzystanych w badaniu	124
Tabela 22. Wyniki estymacji - analiza dyskryminacyjna (cz. 1).....	126
Tabela 23. Wyniki estymacji - analiza dyskryminacyjna (cz. 2).....	127
Tabela 24. Wyniki estymacji - analiza dyskryminacyjna (cz. 3).....	128
Tabela 25. Wyniki estymacji – model logitowy (cz. 1) – parametry funkcji	134
Tabela 26. Wyniki estymacji – model logitowy (cz. 2) – parametry funkcji	135
Tabela 27. Wyniki estymacji – model logitowy (cz.3) – parametry funkcji	136
Tabela 28. Wyniki estymacji – model logitowy – ilorazy szans (<i>odds ratio</i>)	140

Tabela 29. Porównanie wyników estymacji – modele (17) oraz (36).....	143
Tabela 30. Ocena trafności klasyfikacji z wykorzystaniem modeli analizy dyskryminacyjnej oraz regresji logistycznej	146

Spis rysunków

Rysunek 1. Schemat rozwoju i upadłości państwa według Acemoglu i Robinsona.....	38
Rysunek 2. Mapa świata z zaznaczonymi państwami upadłymi i upadającymi zgodnie z <i>Fragile State Index</i>	77
Rysunek 3. Mapa świata z zaznaczonymi państwami objętymi badaniem	89

Summary

The doctoral thesis is an attempt at defining economic and political factors influencing the probability of state failure. According to the definition assumed in "Country Indicators for Foreign Policy", a project implemented at the Carleton University, failed states are characterised by conflict, humanitarian crises, and economic collapse. Government authority, legitimacy, and capacity no longer extend throughout the state, but instead are limited either to specific regions or groups. The existence of failed states constitutes a global problem for the following reasons:

- the overall population of failed states amounts to approximately 1.3 billion people,
- the GDP per capita in failed states is almost 50 times lower than in the so-called "stable states",
- the average life span in failed states is approximately 30% shorter than that of the population in stable states,
- failed states receive almost 50% of world resources within the framework of the official development aid.

A critical review of the source literature leads at a conclusion that advantageous economic situation of a state limits the risk of its failure [Carment, Prest, Samy 2008; Bertocchi, Guerzoni 2010; Easterly 2013]. Free market economy and democracy are not always correlated with a state's development [Sachs 2006], failure may occur in the states characterised by such features. This approach is argued with by i.e. Easterly [2006].

Among others North, Wallis and Weingast (2009), Acemoglu, Robinson (2014), draw attention to the key role of economic and political institutions in the context of state stability and failure. In the analyses conducted, they show that the state's role is to create economic and political institutions that stimulate economic development.

It is said in the source literature that geographic factors have no direct influence on state failure [Acemoglu, Robinson 2014; Valilings, Moreno-Torres 2005]. Poor location may be an economic development barrier [Sachs 2006] which increases the probability of failure. Taking into consideration the colonial past leads to the conclusion that the post Crown colonies are less prone to failure than other post-colonial countries [Bertocchi, Guerzoni 2011; Collier, Hoeffler, Sambanis 2005; Sambanis 2005].

The research mentioned above focuses mainly on the process of state failure in the context of particular groups of factors or they refer to limited locations (mainly to the African or Sub-Saharan African countries) or time. The doctoral thesis presented complements the identified research gap in the analysis of the determinants of state failure.

The main objective of the thesis is to present and evaluate the main reasons for state failure focusing on economic and political factors.

The main objective of the thesis has been assigned with the following detailed objectives:

1. Identification of the group of factors characteristic for failed states.
2. Providing independent classification of factors determining state failure.
3. Outlining correlation between the identified factors and probability of state failure.

Taking into consideration the critical review of the source literature, main and detailed objectives, the following research thesis have been formulated:

Hypothesis 1: Economic and political factors determine the risk of state failure.

Hypothesis 2: Probability of state failure decreases when economic situation improves.

Hypothesis 3: Probability of state failure is lower in democratic countries.

The research time scope of the thesis is years 1960 – 2015. Such a long research scope made it possible to collect data on the significance, direction and strength of the influence of separate determinants on the risk of state failure occurrence.

Location of the research has been limited to the states which were created in or after 1960 and population of which does not exceed 0.5 million people. The final research was conducted in 77 countries in which 17 has been classified as failed.

Both qualitative and quantitative methods have been used in the research. In order to achieve the objectives of the dissertation, the critical review of the source literature has been conducted in the area of the state's role in economy and the factors determining state failure. The dissertation has been based on Polish and English scientific papers on the domain of the research. Quantitative data used in the research is referential and was gathered by the World Bank, International Development Association, International Monetary Fund, Penn World Table, Center for Systemic Peace, Fund for Peace, Institute for Economics and Peace, Mo Ibrahim Foundation and others.

Quantitative methods are based on statistical and econometric methods. In order to show the correlation between the identified factors and the probability of state failure, statistic survival analysis [Iqbal, Starr 2007], discriminant analysis and logit model have been used [Howard 2010, 2016; Iqbal, Starr 2008; King, Zeng 2001]. These methods enabled the evaluation of the direction and strength of influence of the identified determinants on state failure risk.

The layout and content of the dissertation have been governed by achieving the main and detailed objectives and the research area.

In the first chapter, the characteristic features of states have been identified, taking into special consideration failed states. State's functions in economy have been specified. The models of development and failure of state, according to North, Wallis and Weingast and Acemoglu and Robinson, have been presented. The leading definitions of state failure have been presented. A comparison of multiple failure classifications have been provided as well as the correlation between them.

The second chapter includes critical review of literature in the area of the determinants of state failure. The determinants have been divided into three categories: economic, political and other determinants. The identified determinants constitute the base for the choice of variables for the research in the next parts of the dissertation.

The third chapter presents the influence of the chosen factors on the probability of state failure occurrence in the states created in or after 1960. General characteristic of the research group have been presented including the division in accordance with the factors mentioned above. Next, the variables determining the risk of state failure have been presented by estimating statistic survival analysis.

In the fourth chapter quantitative analysis have been conducted in order to empirically verify the research hypotheses proposed. Discriminant analysis have been implemented in order to identify the influence of the chosen factors on state failure probability. Further, the model parameters have been estimated using logit model. It has allowed to distinct the group of factors which have influence on state failure occurrence probability.

Based on the empirical analysis conducted, verification of the hypotheses presented in the dissertation have been conducted. It has been proven that the level of GDP per capita determines the risk of state failure and that together with its increase the probability of state failure decreases. The states in which inhabitants have access to public welfare are less endangered by the attempts of illegal power takeover by interest

groups. The growth of the average economic growth decreases the probability of the risk of state failure. It has been proven as well that the market exchange rate has influence on the probability of state failure occurrence. States which at the beginning of their existence were characterised by relatively high import ratio (in comparison do GDP) are more endangered by failure due to the fact that economic growth and development are dependent from the relations with other states. On the other hand the value of export is correlated with lower risk of failure occurrence due to international regulations which foster achieving higher economic growth rate.

It has been empirically proven that the functioning political system is connected with the probability of failure occurrence. Political system influences the risk of failure – the more democratic the state, the lower the probability of failure. This is because political system determines not only the elections and control of the authorities but also determines the methods of solving conflicts. Mass protests, coups or other attempts of ousting the authorities are less common in democratic countries.

All the hypotheses presented in the dissertation have been positively verified.

Based on the data collected, it is possible to formulate recommendations for many international institutions supporting states endangered by failure. The help offered to these states should consider both economic and political area. The most important objective is to support economic growth and development. The activities should also consider the processes of providing and guaranteeing peace as if there is no safety, building the fundamentals of a stable state is impossible. International community should support the process of evolution of state institutions so that they are of inclusive character however, taking into consideration local conditions. It is therefore essential to build institutional environment which provides the inhabitants with the possibility of taking part in economic and political processes.