

Posudek oponenta habilitační práce

Masarykova univerzita

Fakulta Ekonomicko-správní

Habilitační obor Veřejná ekonomie

Uchazeč Ing. Robert Jahoda, Ph.D.

Pracoviště Ekonomicko-správní fakulta Masarykovy univerzity

Habilitační práce Možnosti a meze simulačních a mikrosimulačních metod při zkoumání veřejného sektoru

Oponent prof. PhDr. Tomáš Sirovátka, CSc.

Pracoviště Fakulta sociálních studií MU

Text posudku (rozsah dle zvážení oponenta)

Předložená habilitační práce se zabývá vysoce aktuálním tématem: simulační a mikrosimulační metody se stávají ve světě i v Evropě (v rostoucí míře i v České republice) stále více využívaným nástrojem při přípravě opatření veřejných politik. Umožňují totiž relativně rychlé a levné ex-ante zhodnocení dopadů uvažovaných opatření. Nemění na tom nic ani skutečnost, že tyto metody přinášejí výsledky, které se často velice podstatně odchyľují od skutečnosti, a naopak jen málokdy se k ní přibližují: předpoklad ‚racionálního jednání‘, na něž modely spoléhají, je totiž v realitě podstatně omezen.

Práce Roberta Jahody (a jeho spoluautorů) má více předností. Největší z nich jsou však dvě: za prvé, představují metodologicky inovativní příspěvky k využití simulačních metod. Za druhé, v úvodu zmíněné omezení výchozích předpokladů racionálního jednání, na nichž jsou mikrosimulační metody založeny, si autor silně uvědomuje a permanentně zvažuje či testuje jejich metodologický význam (viz níže).

Cílem předložené habilitační práce je s využitím čtyř vybraných autorských statí kriticky zhodnotit možnosti a meze simulačního a mikrosimulačního modelování jakožto disponibilních nástrojů používaných k hodnocení dopadů změn veřejných politik.

Autor předložil soubor textů, které byly publikovány v angličtině v časopisech vedených ve světových databázích, případně impaktovaných. Tento soubor shledávám jako legitimní podklad k habilitačnímu řízení. Soubor je totiž vnitřně konzistentním celkem ve více ohledech. Především, tematicky jsou jeho kapitoly zaměřeny na hodnocení dopadů opatření v oblasti veřejných politik (veřejných financí a sociální politiky). V centru zájmu je průřez různých nástrojů: daňové nástroje, nástroje v sociálním pojištění, opatření v deregulaci nájmu. Hlavním zájmem autora je hodnocení dopadů na domácnosti, zejména jde o hodnocení distribučních dopadů. Okrajově si však autor všímá i dalšího neméně podstatného aspektu, a to výdajového zatížení veřejných rozpočtů. Konečně si autor všímá, především v obecné rovině, i dopadů změn na změny chování subjektů. Autor přitom vybírá nástroje, které byly v posledních letech předmětem změn/úprav: proto je jeho hodnocení i prakticky relevantní. Kromě toho, předložené statí se originálním způsobem zabývají rozvojem a využitím mikrosimulačních metod při zhodnocení těchto nástrojů. Metodologický akcent je velice silnou stránkou textů a jejich jednotlivým principem. Autor to ostatně dobře osvětlil v úvodní kapitole.

Předložený text budu proto hodnotit jako celek a vyzdvihnu hned několik společných předností zařazených kapitol. Autor při jednotlivých tématech prokazuje znalost zahraniční i české literatury a schopnost kritického zhodnocení těchto pramenů, jednak pokud jde o teoretická východiska (a hypotézy), jednak pokud jde o postupy při modelování problematiky, která je předmětem zájmu v jeho jednotlivých kapitolách. Všimá si různých metodických přístupů i výsledků, a souvislostí mezi metodickými přístupy a výsledky. Jeho práci hodnotím v našem i evropském prostředí jako přínosnou – její obecnější metodologický přínos mohl autor sám reflektovat (otázka 1).

Při hledání vlastních řešení a metod simulace přináší Robert Jahoda často inovativní postupy: vhodně a dovedně využívá pro modelování databáze, zejména statistická šetření, kombinuje přitom mikrodata s makrodaty, která propojuje pomocí modelování. Je kritický k omezením, jež vyplývají pro jeho modely z předpokladu racionálního jednání. Důsledně diskutuje takové faktory/omezení, v poslední páté kapitole se pokouší tyto 'neracionální' faktory dokonce zohlednit v použitém modelu. Dokáže konečně hodnotit, které předpoklady modelu jsou relevantní z hlediska jejich významu pro výsledky, a testuje především jejich vliv. V jeho postupech, výsledcích či interpretacích nenacházím závažnější problémy, některé komentáře k jednotlivým kapitolám, jež dále uvádím, jsou spíše dílčí poznámky diskusní povahy.

Kapitola 2 se zabývá redistributivními dopady daňové slevy na dítě (child tax bonus). Při modelování jsou využita data SILC 2009 a 2010. Důkladná je diskuse zahraničních přístupů, zajímavé by navíc bylo komponovat tento nástroj do metody hodnocení 'Child benefit package' (Bradshaw a následovníci, u nás zejména Mitchell). Totiž, velmi zajímavá jsou právě zjištění o míře překrytí tohoto nástroje s dávkovými nástroji. Autor ukazuje rozpor mezi daty ze šetření a modelem a diskutuje jeho metodologické příčiny (s. 29 a n.). Jeho závěry odkazují k relativně malé cílenosti a proto i menších redistributivních efektů nástroje CTB. Zjištění mají implikace z hlediska veřejné politiky v širším kontextu rodinné politiky.

Kapitola 3 se zabývá distributivními dopady úlevy z úroku z hypotéky pro účely bydlení (mortgage interest deduction), která v rámci daňové reformy byla od počátku roku 2014 nově upravena (a v kontextu dalších změn/reforem). Důkladná je teoretická a metodologická diskuse, včetně zhodnocení zahraničních i českých přístupů, explikace vlastního modelu, jenž inovativně kombinuje – využívá data šetření SILC a data ČNB, přináší též inovativní metodu odhadu individuálně placeného úroku. Zjištění ukazují, že dopad je příznivý pro nižší příjmové skupiny a naopak negativní pro vyšší příjmové skupiny, změna ale není příliš výrazná. Opět mají zjištění význam v širším kontextu bytové politiky.

Kapitola 4 se zabývá dopady deregulace nájmu na chudobu ovlivněnou náklady na bydlení (HIP-housing induced poverty), využita jsou data SILC. Autor podrobuje kritické diskusi dva využívané přístupy: přístup, jenž pracuje s poměrem nákladů na bydlení na příjmech a přístup, jenž pracuje s reziduálním příjmem po nákladech na bydlení a přiřklání se k využití druhého z nich. Všimá si ve svém modelu i příjmových skupin, které jsou definovány 'blízko k chudobě' (širší koncept). Přijímám metodologický postup, za diskutabilní považuji využití životního minima a 1,5 násobku ŽM pro stanovení hranic chudoby: jinou možností bylo pracovat s hranicí chudoby podle Eurostatu (argumenty v textu nejsou, pokládá je snad autor za 'self-evident'?), otázka 2. Autor odkrývá diskrepanci mezi daty šetření SILC 2008-2010 a výsledky modelu (model naznačil vyšší dopad deregulace nájemného na chudobu podle reziduálního příjmu). Diskutuje důvod této diskrepance (dynamika vývoje příjmů oproti fixovanému cílovému nájemnému). Dále ověřuje vliv dalších faktorů na výsledky: růst příjmů domácností, změnu výše životního minima, změnu chování domácností z hlediska 'spotřeby

bydlení'. Diskutuje také další faktor, který může hrát roli: nevyužívání příspěvku na bydlení (důvody nevyužívání mohly být uvedeny zejména podle originální práce van Oorschota), které má podle indicií značný rozsah.

Kapitola 5 se zabývá simulací k odpovědi na otázku, jak velký počet účastníků vstoupí do druhého důchodového pilíře, za předpokladu že bude zaveden, za určitých předpokladů/charakteristik. Na str. 104 sice vzniká určitá nejistota ohledně cíle kapitoly, kdy je ještě navíc uveden záměr formulovat způsob jak provést transformaci (důchodového systému), avšak později je dříve zmíněný cíl potvrzen. Kapitola je opět dobře opřena o diskusi zahraničních a českých přístupů k simulacím problému. Metodologicky se opírá o srovnání poměrů náhrady při (ne)účasti v druhém pilíři. Inovativní přínos spočívá v důrazu na rozložení příjmů (percentily) a v obohacení modelu dvěma variantami: racionální volba a volba při vlivu iracionálních faktorů (vyjádřeno ‚indexem racionality‘). Důkladná je diskuse faktorů, které rozhodování ovlivňují (racionální faktory, neracionální faktory – tyto posledně uvedené viz s. 95). Výsledky simulace racionálních faktorů ukazují nejvyšší vliv u míry reálného zhodnocení vkladů do fondu, ale také identifikují širší okruh dalších faktorů ve hře. Autoři přiznávají obtíže odhadnout míru senzitivity výsledků na faktory iracionální povahy, a proto volí ‚ad hoc‘ řešení při vymezení předpokladů iracionální varianty. Zajímavé je překvapivé zjištění o vysoké míře potenciální účasti při vlivu iracionálních faktorů oproti racionální variantě. Autoři to vysvětlují zejména nejistotami pojištěnců ohledně finanční udržitelnosti průběžného systému oproti ‚jistotám‘ úspor ve fondovém pilíři. V tomto ohledu jde interpretace správným směrem, přehlíží však okolnost, že nejistota ohledně finanční udržitelnosti průběžného systému je především důsledkem politického diskurzu, který se v tomto směru u nás rozvinul (což odpovídá iracionálním faktorům, které diskutují na str. 95 jako je nedokonalá informace a halo efekt pod vlivem názorových vůdců). Celkově bych řekl, že z celkových výsledků vzniká další otázka – pokud jako racionální faktor je nejvýznamnější reálná míra zhodnocení (avšak tu je obtížné odhadovat, pokud bereme v úvahu šoky, jako jsou finanční krize – to myslím autoři v úvahu nevzali, podobně jako dosavadní nízkou reálnou míru zhodnocení fondů u nás), a vedle toho iracionální faktory se jeví natolik významné, lze vůbec při takové nejistotě v základních předpokladech postavit adekvátní simulační model pro řešení položené otázky? (otázka 3)

Dotazy oponenta k obhajobě habilitační práce (počet dotazů dle zvážení oponenta)

1. Diskutujte přínos Vaší práce v obecnějších souvislostech metodologie simulačních a mikrosimulačních metod.
2. Objasněte důvody volby životního minima pro analýzu housing induced poverty? (zejména: co implikuje volba metodologicky, dopad pro výsledky?)
3. Do jaké míry umožňují nejistoty ohledně základních předpokladů postavit adekvátní model pro odhad účasti ve druhém pilíři?

Závěr

Habilitační práce Roberta Jahody „Možnosti a meze simulačních a mikrosimulačních metod při zkoumání veřejného sektoru“ **splňuje** požadavky standardně kladené na habilitační práce v oboru Veřejná ekonomie. Jde o práci, která je ve více ohledech originální a představuje

významný badatelský přínos. Má současně i významné dopady pro možnosti aplikovaného výzkumu ve veřejné politice.

Brno, dne 12. srpna 2014

Tomáš Sirovátka