



TISKOVÁ ZPRÁVA

Nevhodná interpretace a použití indexu rizika v systému PES způsobí dlouhodobé a závažné ekonomické dopady

Praha, 14. prosince 2020 – Index rizika používaný ke stanovení stupně protiepidemického systému PES je jedním z nejsledovanějších statistických ukazatelů posledních týdnů. Podle tohoto indexu se totiž nastavuje většina opatření, která mají ve svém důsledku výrazné ekonomické a sociální dopady na podstatnou část obyvatel. S ohledem na závažnost těchto dopadů obyvatelé ČR očekávají, že takto zásadní index bude sestaven tak, aby co nejpřesněji sloužil svému účelu. Jak je to ale ve skutečnosti?

Datově-analytická agentura MODE research působící při Katedře statistiky a pravděpodobnosti Fakulty informatiky a statistiky VŠE zpracovala analýzu vlastností zmíněného indexu rizika. Vzhledem k naléhavosti tématu nepřinášíme komplexní analýzu indexu, ale pouze komentář vybraných a potenciálně problematických vlastností. Hlavní závěry představuje vedoucí týmu Tomáš Karel: *„Pouhá hodnota indexu rizika by neměla sloužit jako klíčový nástroj řešení epidemické situace. Nevhodná interpretace jeho vývoje v čase může mít, s ohledem na vlastnosti vyplývající z konstrukce indexu, dlouhodobé a závažné ekonomické dopady“*.

Odborníci z VŠE v analýze poukazují na vysokou míru závislosti mezi počtem provedených testů a hodnotou indexu rizika. Zvolená konstrukce indexu proto není dostatečně robustní vůči změně testovací strategie. *„Hodnota indexu rizika může výrazně vzrůst pouze samotným zvýšením počtu prováděných testů,“* uvádí Karel. Některé ukazatele vstupující do indexu jsou navíc mezi sebou natolik silně propojené (v podobě vysoké vzájemné míry závislosti), takže index rizika může ve velmi krátké době vykazovat výrazné skokové nárůsty i poklesy. *„Vývoj indikátoru rizika nemusí z těchto důvodů pro veřejnost představovat optimální vodítko, na jehož základě lze provádět ekonomická rozhodnutí. To pak může vést k systému řízení brzda – plyn,“* upozorňuje Karel.

Nejistota je přitom pro řadu podnikatelů mnohdy ještě horší než nepříjemná jistota. Nežádoucí výrazné kolísání indexu je pak způsobené i nahrazením reprodukčního čísla R jeho zjednodušeným odhadem. Ten může být zásadně ovlivněn počtem prováděných testů v jednotlivých týdnech. Nelze též přehlédnout, že index rizika kombinuje různé transformace dat: čtrnáctidenní úhrny pozitivních testů, průměrná pozitivita testů za posledních sedm dní, srovnání počtu pozitivních testů za dva časové úseky. Různé transformace dat pak mohou nést rozdílnou informaci.



TISKOVÁ ZPRÁVA

„Každý návrh takovéto protiepidemické strategie s významnými ekonomickými a společenskými dopady by měl projít širokou odbornou debatou a dostatečným recenzním řízením s veřejně dostupnými výsledky,“ uzavírá Tomáš Karel.

Analýza je dostupná [ZDE](#).

Vysoká škola ekonomická v Praze je největší ekonomickou univerzitou v České republice. V současnosti se zde vzdělává více než 13 000 studentů na šesti fakultách. Těmi jsou Fakulta financí a účetnictví, Fakulta mezinárodních vztahů, Fakulta podnikohospodářská, Fakulta informatiky a statistiky, Národohospodářská fakulta a Fakulta managementu v Jindřichově Hradci. Absolventi VŠE zastávají významné funkce v soukromém i veřejném sektoru. Nejvíce jich směřuje do různých odvětví průmyslu a služeb, obchodu, marketingu, bankovníctví, veřejné správy, účetnictví, auditu, cestovního ruchu a do oblastí informačních technologií. Čestný titul doktor honoris causa VŠE převzala řada významných českých i zahraničních ekonomů, např. nositelé Nobelovy ceny prof. Robert A. Mundell, prof. Milton Friedman či prof. Richard Thaler. Více informací na www.vse.cz.

Kontakt pro média

Tomáš Karel

Katedra statistiky a pravděpodobnosti – Fakulta informatiky a statistiky VŠE
e-mail: tomas.karel@vse.cz

Martina Mlynářová

Tisková mluvčí
tel.: 224 095 754
mobil: 731 124 440
e-mail: pr@vse.cz