

Avaliação de Impacto de Políticas Públicas

Data e local: 9 de janeiro a 16 de fevereiro de 2012, Fundação Itaú Social, São Paulo

Evento: 3º Curso Avançado de Avaliação de Políticas Públicas e Projetos Sociais

Representantes do BNDES: Arthur de Rezende Pinto
Maria Araujo Parreiras

Introdução

Como promotor de um desenvolvimento que não basta ser estritamente econômico, o BNDES analisa os projetos a serem financiados, não só pelos aspectos econômicos e financeiros, mas também por seus efeitos diretos e indiretos nos âmbitos territoriais, ambientais e sociais. Esses efeitos, que ocorrem principalmente nas empresas apoiadas e/ou no público-alvo das operações, denominam-se efetividade.

A importância da avaliação para o BNDES – assim como para políticas públicas em geral – reside primordialmente na explicitação e na aferição dos resultados atingidos pela intervenção. Existem diversas formas de realizar essa tarefa, utilizando técnicas qualitativas, quantitativas ou combinando ambas.

O principal objetivo das avaliações de impacto de cunho quantitativo – matéria do curso relatado a seguir – é isolar o efeito da participação na intervenção em questão de efeitos que também são influenciados por fatores externos à política.

O curso

Entre 9 de janeiro e 16 de fevereiro, foi ministrado, pela Fundação Itaú Social, o Curso Avançado de Avaliação de Políticas Públicas e Projetos Sociais. Realizado anualmente, com objetivo de disseminar a prática de avaliação, o curso expõe os principais conceitos e técnicas econométricas utilizados na mensuração de impactos e o cálculo do retorno econômico de políticas públicas e projetos sociais. As exposições intercalaram aulas teóricas e práticas e abordaram os seguintes tópicos:

- Econometria Básica – Prof. Naércio Menezes-Filho (Insper e FEA-USP): MQO, Causalidade, Identificação e Estimação; Variáveis Instrumentais; Experimentos Aleatórios; e Modelo de Resultados Potenciais – Efeito Médio do Tratamento.
- Econometria para Avaliação de Políticas Públicas e Projetos Sociais – Básico – Prof^a. Cecília Machado (EPGE-FGV): Propensity Score e Matching; Matching e Métodos de Regressão; e Diferença em Diferenças.
- Desenho de Avaliação – Prof. Eduardo Luiz Gonçalves Rios-Neto (FACE-UFMG) e Prof. Ricardo Paes de Barros (Ipea e SAE).
- Econometria para Avaliação de Políticas Públicas e Projetos Sociais – Avançado – Prof^a. Cristine Pinto (EESP-FGV): Variáveis Instrumentais – LATE; Efeitos nos Diferentes Quantis; Lidando com Atrito; Regressão com Descontinuidade; e Tratamentos Contínuos – Propensity Score Generalizado.
- Retorno econômico – Prof. Samuel Hazzan (EAESP-FGV).

Avaliações de impacto

Avaliações de impacto de política pública ou projeto social, ao tentarem verificar o efeito da participação sobre o desempenho futuro de um beneficiário, se deparam com o problema da inferência causal. Esse problema se origina na inexistência de um contrafactual

perfeito.¹ Idealmente, a identificação do efeito de participação em um programa seria a comparação entre o desempenho futuro de um indivíduo exposto ao tratamento (isto é, sendo ele beneficiário de um projeto) com o desempenho desse mesmo indivíduo caso não fosse exposto ao tratamento.² Essa seria a única forma de assegurar-se de que o diferencial de desempenho é causado pelo projeto. Evidentemente, essa avaliação ideal é impossível, já que apenas um dos dois resultados mencionados pode ser observado. Uma saída para o problema seria observar a evolução no tempo desse indivíduo. Entretanto, a diferença de desempenho entre os períodos pré e pós-participação, ainda que para o mesmo indivíduo, não recupera como resultado apenas o efeito do programa. Isso porque outros fatores além da participação afetam o resultado do indivíduo, de forma que é impossível atribuir a diferença de desempenho apenas ao efeito de ser beneficiário. Por essa razão, não se consegue observar qual o impacto do programa sobre um indivíduo específico.

A inferência causal é realizada negligenciando o efeito do programa sobre *um* determinado indivíduo e buscando um efeito *médio* do programa sobre um grupo de indivíduos – os beneficiados/tratados. O procedimento consiste em comparar o grupo de unidades expostas ao tratamento, os beneficiários, e um grupo similar composto por unidades que não tenham sido expostas ao tratamento, o denominado grupo de controle.

Dado o problema de inexistência do contrafactual perfeito, as metodologias econométricas buscam a “construção” de um grupo com características suficientemente próximas às do grupo de beneficiários, de forma que ambos se tornem comparáveis. A metodologia a ser utilizada depende da forma como a participação no programa foi designada.

Se a participação no programa foi aleatoriamente atribuída, o grupo de tratamento e o grupo de controle são definidos independentemente

¹ Contrafactual é uma situação ou um evento que poderia ter acontecido.

² No caso de programas sociais, os beneficiários são principalmente indivíduos. Entretanto, no caso do BNDES, pode-se pensar os beneficiários genericamente como empresas.

de quaisquer outros fatores. Não há razão para que as distribuições das características dos dois grupos apresentem diferenças sistemáticas. Então, se ambos os grupos são estatisticamente iguais, diferindo entre si apenas pela participação no programa, a diferença das médias de desempenho dos tratados e dos controles já recupera o efeito médio do tratamento. A vantagem da aleatorização é que a inferência causal é realizada sem necessidade de hipóteses.

Muitos projetos e políticas são focalizados em determinada parcela da população, de modo que a participação não é aleatória. Um programa de requalificação profissional para desempregados provavelmente afetará de maneira diferenciada o desempenho futuro de homens e mulheres no mercado de trabalho. Se isso ocorre, uma alternativa para a avaliação é supor que a probabilidade de seleção dos participantes é determinada de acordo com características observáveis. Então, em vez de o tratamento ser aleatório para toda a população, é preciso que unidades com características semelhantes tenham o desígnio de tratamento aleatório. Ou seja, ainda que homens e mulheres desempregados apresentem diferentes probabilidades de participação no programa, ao se fixar a análise nos homens, o tratamento é aleatório. O mesmo vale para as mulheres. Sob seleção em observáveis, o trabalho econométrico caminha para encontrar, com base em variáveis observadas, o grupo de controle mais parecido possível com os tratados, sendo o *status* de participação no programa a única diferença entre eles. Feito isso, podem-se comparar os desempenhos dos dois grupos, e a diferença é o impacto médio do programa.

Há ainda a possibilidade de que as unidades beneficiárias de um projeto se diferenciem das não beneficiárias por fatores não observáveis, por exemplo: entusiasmo, aptidão ao empreendedorismo, questões culturais etc. Seleção em não observáveis é comum quando a participação no programa requer inscrição por parte do indivíduo. Nesse caso, ainda que haja um grupo de indivíduos não beneficiários similares (em características observadas) aos beneficiários, uma simples comparação não pode ser estabelecida, já que, pelo menos no interesse em relação ao programa, os grupos são diferentes.

Para as três possibilidades de desígnio de participação em alguma política pública ou programa social – aleatorização, seleção em observáveis e seleção em não observáveis –, há técnicas estatísticas que auxiliam na busca de um grupo de comparação para as unidades beneficiárias, permitindo, portanto, que a estimação do impacto seja realizada.³

Depois da estimação do impacto do projeto ou política, torna-se necessário avaliar seu retorno econômico, e a chave para essa análise é conseguir quantificar em valores monetários os benefícios. A ideia é projetar um fluxo de caixa com os custos do projeto e uma medida monetária dos benefícios. Mesmo que seja controverso quantificar em benefícios monetários um ano adicional de estudo, queda na mortalidade infantil, maior acesso de produtores rurais a financiamento e redução na criminalidade, entre outros resultados de política pública, esse exercício é importante, sobretudo, porque toda política envolve custos. Então, por meio da mensuração dos benefícios, torna-se possível verificar se o resultado obtido não poderia ser alcançado, a um menor custo, com um projeto alternativo.

Monitoramento e avaliação no BNDES

A implementação de um Sistema de Monitoramento e Avaliação (M&A) no BNDES vem ganhando importância por diversas razões, como: potencial de explicitação dos efeitos benéficos gerados na economia com o uso dos recursos públicos; diretriz interna para ênfase na qualidade do desembolso em um contexto de volume menor de recursos; nova exigência para captações internacionais de recursos; e demanda dos órgãos de controle federais sobre indicadores de efetividade do BNDES. Ao completar sessenta anos, o Banco pode encarar como um desafio para essa próxima etapa a implementação do Sistema de M&A e sua difusão e absorção pelo corpo técnico.

³ Essas técnicas, objeto do curso, foram citadas anteriormente na descrição de sua programação.

Diversos estudos já foram publicados por técnicos do BNDES, ao longo de sua existência, contendo avaliações de seu impacto. Mais recentemente, a Área de Planejamento vem desenvolvendo e implementando métodos e processos para monitorar e avaliar a efetividade das ações do Banco. O ineditismo da proposta consiste em inserir o processo de avaliação nas rotinas de análise e acompanhamento das operações, de forma a torná-lo sistemático, sustentado e institucionalizado.

Em linhas gerais, no caso do BNDES, as avaliações de impacto consistem em comparar um grupo de empresas ou público-alvo do apoio financeiro com um outro grupo similar, exceto por não ter recebido o apoio. A diferença de desempenho dos dois grupos seria explicada pela atuação do Banco. O estudo “Avaliação de impacto do uso do Cartão BNDES sobre o emprego nas empresas de menor porte”, integrante da *Revista do BNDES* 36, vale-se dessas técnicas e foi elaborado depois da participação de outros empregados do Banco no curso ministrado pela Fundação Itaú Social em 2011.

Dessa forma, a realização do curso por profissionais do BNDES contribui para o avanço na realização de avaliações de efetividade que, por sua vez, possibilitam maior aprendizado organizacional sobre as operações realizadas; *feedback* para os processos de planejamento corporativo; redesenho dos programas e linhas operacionais; e transparência dos efeitos gerados para o governo, para o empresariado e para a sociedade.