



REVISIONE DELL'INDAGINE EU-SILC E FABBISOGNI INFORMATIVI PER LA MICROSIMULAZIONE

Gabriella Donatiello
ISTAT

SEMINARIO Il modello di microsimulazione dell' IRPET:
aggiornamento e nuovi moduli

IRPET, Firenze 26 giugno 2013

Indice

La revisione del Regolamento EU-SILC

La nuova struttura di EU-SILC

IT-SILC e i fabbisogni informativi

L'integrazione di reddito, consumo e ricchezza

Alcune riflessioni conclusive

La revisione del Regolamento EU-SILC 1/2

Obiettivi

- Nell'ambito di un più ampia revisione dei regolamenti delle Statistiche Sociali (Eu-Silc, Lfs)
 - maggiore integrazione e armonizzazione
 - snellimento e modularizzazione delle indagini
 - uso complementare degli archivi amministrativi
- Revisione del Regolamento EU-SILC
 - ampliare l'informazione fornita per l'azione politica
 - finalizzare le risorse
 - maggiore tempestività nel rilascio dei dati
 - fornire stime accurate a livello regionale
 - migliorare la qualità delle statistiche

La revisione del Regolamento EU-SILC 2/2

Nuovo Regolamento

- proposto dalla Commissione europea alla fine del 2015
- dopo la fase di test prevista nel 2014
- primo anno di implementazione dipenderà dalle differenti procedure di adozione dei paesi membri
- implementazione anticipata su base volontaria
 - maggiore tempestività
 - stime regionali

La nuova struttura dell'indagine 1/3

- La proposta attualmente in discussione:
- Componente trasversale
 - **Nucleo** con un numero limitato di variabili annuali (EU-2020 e principali indicatori)
 - + **Modulo** per la 1 wave con informazioni socio-demografiche, intergenerazionali, sull'abitazione e stranieri
 - **Due moduli** a frequenza ciclica (rolling modules) ogni 2-3 e ogni 6 anni
 - Necessaria un'armonizzazione delle variabili nelle indagini sociali
 - Possibile utilizzo di Sottocampioni per argomenti specifici nei moduli e solo per le famiglie dell'ultima wave
- Componente longitudinale
 - panel più lungo a 6 anni

3

La nuova struttura dell'indagine 2/3

- Nucleo + modulo 1 wave
 - 115 variabili
- Modulo a frequenza biennale/triennale
 - bambini, salute, lavoro e condizioni abitative
 - 20 variabili
- Modulo ogni 6 anni (ciclo longitudinale)
 - qualità della vita, partecipazione sociale e culturale, indebitamento, accesso ai servizi, trasmissione intergenerazionale povertà, ricchezza, consumi, trasferimenti in kind, nuovi fabbisogni informativi per le policy
 - 20 variabili

La nuova struttura dell'indagine 3/3

- Componente longitudinale: panel a 6 anni
 - obiettivo: migliorare la qualità dei dati sulla persistenza della povertà/ esclusione sociale
 - aumentare il tasso di risposta delle famiglie della 1 wave
 - ridurre l'attrito mediante azioni di sensibilizzazione delle famiglie
 - calibrazione dei pesi con fonti esterne o con informazioni degli anni precedenti

La fase di raccolta dati

- Utilizzo massiccio degli archivi amministrativi
 - ostacoli: tempestività, consistenza, comparabilità
 - preferibile un approccio integrato al completo utilizzo
 - workshops sulle best practices
- Nuove tecniche di rilevazione
 - CATI
 - CAWI
- Strumenti aggiuntivi: statistical matching
 - obiettivo: produrre statistiche integrate per reddito, consumo e ricchezza

Action Plan per la tempestività

- Informazioni sull'evoluzione della distribuzione dei redditi 6 mesi dopo il periodo di riferimento
 - utilizzo del reddito mensile familiare corrente per fornire stime anticipate
 - introduzione del reddito mensile familiare in altre indagini sociali (LFS)
- Anticipo di 6 mesi nel rilascio del file standard a Eurostat (giugno t+1)
- Rilascio anticipato degli indicatori di deprivazione materiale, entro la fine dell'anno t
- Utilizzo di modelli di microsimulazione (Euromod) per stime a breve
- Raccolta di informazioni sulle strategie di adattamento alla crisi da parte di famiglie e individui (modulo)

IT-SILC e i fabbisogni informativi 1/2

- Dal 2011 IT-SILC è condotta con tecnica CAPI
- Passaggio a tecnica mista di rilevazione Cati e Cawi: nel 2013 prima sperimentazione di interviste Cati
- Sono stati acquisiti ulteriori archivi amministrativi:
 - indennità di disoccupazione (PY090N)
 - assegni familiari (HY050N)
- Studio di fattibilità:
 - acquisizione fonti amministrative sui redditi da attività finanziarie
 - nuova procedura di calibrazione dei pesi vincolati alla distribuzione dei contribuenti dell'Agenzia Entrate
 - maggiore disaggregazione nel rilascio delle variabili nazionali utili per le microsimulazioni: liquidazioni, arretrati, reddito dei parasubordinati al lordo delle imposte

8

IT-SILC e i fabbisogni informativi 2/2

- Costruzione di una base dati integrata su reddito consumi e ricchezza
- Costituita nel servizio CEF un'unità che si occupa dell'integrazione
 - utilizzo dell'expertise relativa alle indagini EU-SILC e HBS
 - utilizzo dell'expertise Istat sulle tecniche di integrazione
 - vincoli di bilancio per utilizzare al meglio l'informazione disponibile
 - richiesta di Eurostat di condividere le esperienze nel campo dello statistical matching (IT, FR, FI, UK) per la diffusione di una best practice

La metodologia di integrazione 1/5

- A livello europeo l'obiettivo è costruire statistiche integrate su reddito consumi e ricchezza basate su SILC, HBS, ECB Survey
- Non si dispone di un'unica base dati che consenta di osservare congiuntamente tali aspetti
- Scelta di utilizzare lo statistical matching come second best
- Prerequisito: coerenza delle fonti e delle variabili comuni
 - maggiore armonizzazione tra SILC, HBS e altre indagini sociali
 - non limitata solo alle core social variables

La metodologia di integrazione 2/5

- Sulla base degli esercizi condotti da IT, UK, FI, FR Eurostat ha identificato l'utilizzo di 3 possibili tecniche di integrazione:
 1. matching statistico basato sulle indagini correnti
 2. raccolta ex-ante di dati su consumo/ricchezza in SILC, mediante un modulo semplificato, e utilizzo di tali informazioni per il matching
 3. utilizzo dei quesiti soggettivi su aspetti di vulnerabilità in grado di spiegare la relazione tra reddito, consumo, ricchezza (fine mese, spese impreviste, ecc)

La metodologia di integrazione 3/5

- Eurostat propone di sviluppare un primo modulo semplificato relativo a consumi e ricchezza in SILC
 - prima fase: in grado di fornire alcune informazioni necessarie anche se non esaustive
 - secondo fase: predisposizione di un modulo ciclico ogni 6 anni relativo a ricchezza, indebitamento e consumo e incentrato su gruppi di popolazione più vulnerabile
- Obiettivo: costruire indicatori/parametri sulla distribuzione congiunta

La metodologia di integrazione 4/5

- Per l'integrazione di reddito, consumo e ricchezza risulta necessario:
 - disporre di «variabili di aggancio» che consentano di migliorare le stime prodotte con lo statistical matching
 - inserire variabili nel questionario SILC (nucleo) in grado di catturare alcuni aspetti della ricchezza/consumo con alto valore predittivo (es. variabile su spesa alimentare)
 - armonizzazione le definizioni di alcune variabili comuni tra SILC e HBS (es: costi dell'abitazione)

La metodologia di integrazione 5/5

- Eurostat raccomanda di utilizzare il matching statistico per obiettivi specifici di analisi
 - analisi multidimensionale della povertà e vulnerabilità con focus sulla coda sinistra della distribuzione più che analisi della distribuzione della ricchezza
 - produrre indicatori complementari (es povertà patrimoniale oltre a quella monetaria)

Alcune riflessioni conclusive 1/2

- IT-SILC un'indagine in continua evoluzione e in una fase di cambiamento strutturale
- Il CEF intende focalizzare l'attenzione sull'integrazione delle informazioni relative a reddito, consumi e ricchezza
- Condotta un primo esercizio per la costruzione di un data base integrato reddito/consumi utilizzando IT-SILC 2010 e HBS 2009
 - analisi dei data set e armonizzazione delle variabili comuni
 - scelta delle variabili per il matching (Regressione stepwise, Logistic regression weighted data, Generalized Linear models, Classification trees, Random Forest Method)
 - utilizzo del package STATMATCH sviluppato in Istat (metodo non parametrico hot deck)

Alcune riflessioni conclusive 2/2

- Prossimi sviluppi:
- Dopo imputazione del reddito familiare in HBS
- Seconda fase, a breve termine, imputare le spese per beni durevoli e non durevoli in IT-SILC
- Successivamente utilizzare i dati della Banca d'Italia per imputare la ricchezza in IT-SILC e «testare» eventuali variabili di aggancio per il modulo semplificato su consumo/ricchezza