

Warszawa, 10 listopada 2023 r.

dr hab. Michał Rubaszek, prof. SGH
Kierownik Zakładu Modelowania Rynków Finansowych
Instytut Ekonometrii
Szkola Główna Handlowa w Warszawie

Recenzja w postępowaniu habilitacyjnym dr Mariusza Maziarza Filozoficzne i metodologiczne implikacje problemu niespójnych wyników ekonometrycznych

Recenzja została przygotowana w związku z pismem z 4 października 2023 r., w którym jest informacja, iż Rada Dyscypliny Ekonomia i Finanse Uniwersytetu Jagiellońskiego powołała mnie na recenzenta w postępowaniu w sprawie nadania dr. Mariuszowi Maziarzowi stopnia doktora habilitowanego w dziedzinie nauk społecznych w dyscyplinie ekonomia i finanse.

Według ustawy z 20 lipca 2018 r. „Prawo o szkolnictwie wyższym i nauce” (art. 219) stopień doktora habilitowanego nadaje się osobie, która:

1. posiada stopień doktora;
2. posiada osiągnięcia naukowe, stanowiące znaczny wkład w rozwój określonej dyscypliny, w tym co najmniej:
 - a) monografię naukową lub
 - b) cykl powiązanych tematycznie artykułów naukowych opublikowanych w czasopiśmie naukowych lub w recenzowanych materiałach z konferencji międzynarodowych, lub
 - c) zrealizowane oryginalne osiągnięcie projektowe.
3. wykazuje się istotną aktywnością naukową realizowaną w więcej niż jednej uczelni, instytucji naukowej lub instytucji kultury, w szczególności zagranicznej.

W mojej ocenie, przedstawiony cykl 11 artykułów, zatytułowany *Filozoficzne i metodologiczne implikacje problemu niespójnych wyników ekonometrycznych*, nie stanowi znacznego wkładu w rozwój dyscypliny Ekonomia i Finanse. Uzasadnienie mojej oceny przedstawiam w dalszej części recenzji.

Sylwetka Habilitanta

Dr Mariusz Maziarz uzyskał stopień doktora w dyscyplinie Ekonomia i Finanse w styczniu 2021 r. Stopień został nadany przez Uniwersytet Ekonomiczny we Wrocławiu na podstawie rozprawy pt. „The Philosophy of Causality in Economics: Causal Inferences and Policy Proposals”, której promotorem był prof. Antoni Drapella. Od momentu obrony Habilitant jest zatrudniony przez Uniwersytet Jagielloński na Wydziale Filozofii (Interdyscyplinarne Centrum Etyki).

Opis osiągnięcia naukowego

Przedłożony do oceny cykl 11 artykułów został podzielony na cztery powiązane ze sobą obszary tematyczne, dotyczące czterech pytań badawczych:

1. Na jakim podejściu metodologicznym opiera się modelowanie ekonometryczne?
2. W jaki sposób realistycznie interpretować modele ekonometryczne?
3. Jakie są ograniczenia epistemiczne ekonometrycznych metod wnioskowania przyczynowego?
4. Jak wnioskować z niespójnych wyników modelowania ekonometrycznego?

Wszystkie prace są opublikowane w czasopismach z listy MEiN, zaś sześć artykułów znajduje się w czasopismach z listy JCR. Osiem prac jest opublikowanych w czasopismach, które zostały przypisane do dyscypliny Ekonomia i Finanse. Dziewięć opracowań zostało przygotowane samodzielnie, zaś dwa we współautorstwie. Lista artykułów przedłożonych do oceny jest następująca:

A1. Maziarz, M. (2019). Methodological Pluralism in Economics: The ‘Why’ and ‘How’ of Causal Inferences. *Filozofia Nauki*, 27(4 (108)), 43-59.

A2. Maziarz, M. (2017). ‘Growth in a time of debt’ as an example of the logical-positivist science. *Journal of Philosophical Economics*, 10(2), 47-64.

- A3.** Maziarz, M. (2019). The unrealistic realist philosophy. The ontology of econometrics revisited. *Journal of Philosophical Economics*, 13(1), 39-64.
- A4.** Scheuer, B., & Maziarz, M. (2019). Philosophy of economics: The constructivist and scientific realist interpretation of macroeconomics. *Filosofija. Sociologija*, 30(1), 8-16.
- A5.** Maziarz, M. (2021). 'Emerging contrary result' phenomenon and scientific realism. *Panoeconomicus*, 68(3), 253-265.
- A6.** Maziarz, M. (2017). Causality and inference in economics: An unended quest. *Annales. Etyka w życiu gospodarczym*, 20(5), 67-81.
- A7.** Maziarz, M. (2015). A review of the Granger-causality fallacy. *The Journal of Philosophical Economics: Reflections on Economic and Social Issues*, 8(2), 86-105.
- A8.** Maziarz, M., & Mróz, R. (2020). Response to Henschen: causal pluralism in macroeconomics. *Journal of Economic Methodology*, 27(2), 164-178.
- A9.** Maziarz, M. (2017). The Reinhart-Rogoff controversy as an instance of the 'emerging contrary result' phenomenon. *Journal of Economic Methodology*, 24(3), 213-225.
- A10.** Maziarz, M. (2019). It's all in the eye of beholder. *Argumenta Oeconomica*, 2(43), 307-328.
- A11.** Maziarz, M. (2021). Resolving empirical controversies with mechanistic evidence. *Synthese*, 199(3-4), 9957-9978.

Tabela 1 przedstawia opis osiągnięcia naukowego w ujęciu bibliometrycznym. Pokazuje ona, że sumaryczna liczba punktów MEiN wynosi 790 (450 dla publikacji z dyscypliny Ekonomia i Finanse), zaś łączny impact factor to 5,7 (4,2). Tabela pokazuje również, że liczba cytowań według bazy Google Scholar wynosi 192. W mojej ocenie, dane dotyczące liczby punktów MEiN oraz IF są na odpowiednim poziomie na tym etapie ubiegania się o stopień habilitowany. Z kolei liczba cytowań jest raczej niska. Warto przy tym odnotować, że ich znaczna część jest skoncentrowane na artykule **A7**. Tabela 1 ukazuje również, że 5 artykułów znajduje się wśród pozycji cytowanych w pracy doktorskiej. Ukazuje to, że wyniki uzyskane w cyklu publikacji podlegającej ocenie zostały w pewnym stopniu również ujęte w pracy doktorskiej. Warto przy tym odnotować, że w autoreferacie Habilitant podkreśla, że cykl artykułów podlegający ocenie jest niezwiązany z pracą doktorską. Wydaje się jednak, że bardziej uzasadnione byłoby dokładne i przejrzyste opisanie, które części pracy doktorskiej zostały wykorzystywane w artykułach podlegających ocenie.

Tabela 1. Wskaźniki bibliometryczne osiągnięcia naukowego

	# autorów	Punkty MEiN	IF	Cytowania Google Scholar	Odwołania w doktoracie	Dyscyplina EiF
A1	1	100	BRAK	1		NIE
A2	1	20	BRAK	4		TAK
A3	1	20	BRAK	3		TAK
A4	2	20	0.3	3		TAK
A5	1	70	1.0	2	TAK	TAK
A6	1	40	BRAK	0		NIE
A7	1	20	BRAK	130	TAK	TAK
A8	2	100	1.2	10	TAK	TAK
A9	1	100	1.2	33	TAK	TAK
A10	1	100	0.5	5	TAK	TAK
A11	1	200	1.5	1		NIE
Suma		790	5.7	192		
Suma EiF		450	4.2	190		

Uwagi: Punkty MEiN oraz przypisanie do dyscypliny Ekonomia i Finanse na podstawie załączniak do komunikatu z 17 lipca 2023 r.

Szczegółowy opis osiągnięcia naukowego

Poniżej przedstawiam bardzo ogólny opis głównych wniosków z ocenianych artykułów. Niestety, nie zawierają wyników, które stanowiłyby wkład do dyscypliny Ekonomia i Finanse. Rada Doskonałości Naukowej nie powołała mnie natomiast, abym ocenił wkład Habilitanta do rozwoju innych dyscyplin, np. dyscypliny „Filozofia”.

A1. Habilitant argumentuje, że modelowanie ekonometryczne jest zgodne z neopozytywistyczną filozofią nauki.

A2. Habilitant wskazuje dlaczego słynne badanie przeprowadzone przez Reinhart i Rogoffa pt. *Growth in a Time of Debt* (dalej: RR) jest zgodne z zasadami pozytywizmu logicznego.

A3. Habilitant wskazuje, że problem niespójności wyników stanowi przeszkodę w przyjęciu hipotezy o realizmie naukowym w przypadku badań opartych o analizy ekonometryczne.

A4. Habilitant przeprowadza kolejną analizę opracowania RR na temat zależności między długiem i wzrostem z perspektywy konstruktywistycznej.

A5. Habilitant podejmuje próbę obrony stanowiska realistycznego poprzez argumentację, że zjawisko niespójnych wyników nie kwestionuje interpretacji realistycznej w przypadku uwzględnienia kontekstu i celu modelu.

A6. Habilitant przedstawia filozoficzne teorie przyczynowości na tle praktyki badawczej ekonomistów.

A7. Habilitant przeprowadza dyskusję na temat warunków, które muszą być spełnione aby testy przyczynowości w sensie Grangera były miarodajne.

A8. Habilitant przeprowadza dyskusję na temat przyczynowości w modelach VAR w kontekście relacji niezmiennych pod wpływem interwencji.

A9. Habilitant ponownie omawia artykuł RR, aby ustalić przyczyny pojawienia się kontrowersyjnych wyników.

A10. Habilitant kontynuuje analizy nad artykułem RR poprzez omówienie problemu subiektywności wyborów metodologicznych.

A11. Habilitant proponuje rozwiązanie problemu niespójnych wyników przy wykorzystaniu przesłanek mechanistycznych. Wskazuje on, że przesłanki te pozwalają na rozróżnienie modeli ekonometrycznych reprezentujących rzeczywiste związki przyczynowe od przypadkowych zależności.

Ocena

Rada Doskonałości Naukowej powołała mnie, aby dokonał oceny, czy cykl publikacji Habilitanta stanowi wkład w rozwój dyscypliny „Ekonomia i Finanse”. W mojej ocenie wyniki przedstawione w artykułach A1-A11 w niewystarczającym stopniu rozszerzają nasze zrozumienie procesów ekonomicznych (dotyczących produkcji, dystrybucji lub konsumpcji dóbr i usług), aby uznać je za osiągnięcie naukowe w tej dyscyplinie. Istnieje możliwość, że cykl artykułów stanowi wkład w rozwój innej dyscypliny, np. dyscypliny „Filozofia” w zakresie tematycznym „filozofia nauki badań ekonomicznych”. Warto odnotować, że filozofia nauki badań ekonomicznych pomaga w zrozumieniu jak rozwija się nauka „Ekonomia”, ale nie

jest zaliczana do dyscypliny „Ekonomia i Finanse”. Poniżej przedstawiam uzasadnienie powyższej oceny:

Po pierwsze, szereg zdań z autoreferatu jednoznacznie wskazuje, że Habilitant sam przypisuje uzyskane wyniki do dyscypliny „Filozofia”.

A1. „[...]Dokonano operacjonalizacji szkół myśli obecnych w filozofii nauki do kontekstu badań ekonomicznych[...]” oraz „[...]Pluralistyczna wizja praktyk modelowania ekonomistów Dani Rodriki (2015) wzbudziła znaczne zainteresowanie wśród filozofów ekonomii[...]”

A2. „[...] Uzyskane wyniki rozwijają metodologiczną debatę dotyczącą paradygmatu filozofii nauki adekwatnego do badań ekonomicznych [...]” oraz „[...] Pytanie, czy ekonomia jest nauką neopozytywistyczną, pojawia się w literaturze z zakresu filozofii ekonomii dość często, lecz dotychczas nie udzielono na nie konkluzywnej odpowiedzi [...]”. Odnośnie artykułu A2, w autoreferacie pojawia się też fragment ukazujący, kto jest adresatem opracowania „[...] Dodatkowo, metoda ilościowa stosowana przez Reinhart i Rogoffa jest stosunkowo prosta, a jej analiza z perspektywy filozoficznej oraz odbiór tejże analizy nie wymaga zaawansowanej wiedzy z zakresu ekonometrii, co uprawdopodobnia recepcję uzyskanych wyników przez metodologów ekonomii i filozofów nauki [...]”

A3. „[...] Argument przedstawiony w tym artykule pokazuje, że dotychczasowe podejścia zgodne z filozofią realizmu naukowego do ekonometrii nie są adekwatne do rzeczywistego obrazu empirycznej subdyscypliny nauk ekonomicznych [...]”

A3/A4/A5. „[...] Innowacyjność podjętego problemu polega na zastosowaniu filozoficznej literatury dotyczącej realizmu naukowego do analizy modelowania statystycznego oraz rozważenia zjawiska niespójnych wyników empirycznych [...]” oraz „[...] uzyskane wyniki mają donośne znaczenie nie tylko dla metodologii ekonomii [...]”.

A6. „[...] Celem artykułu jest przedstawienie najnowszych badań nad przyczynowością w filozofii ekonomii [...]” oraz „[...] przyczynowość została opisana w świetle dwóch najpopularniejszych paradygmatów filozofii nauki: realizmu naukowego oraz instrumentalizmu [...]”.

A6/A7/A8. „[...] Udzielenie odpowiedzi na trzecie pytanie badawcze stanowi istotny wkład w literaturę metodologiczną z zakresu możliwości wyciągania wniosków przyczynowych na podstawie danych obserwacyjnych [...]”.

A11. „[...] Problem niespójnych wyników statystycznych (rozumiany jako jedno z wyjaśnień kryzysu replikacji) dotyczy wszystkich dyscyplin wykorzystujących modelowanie statystyczne i jest jednym z najbardziej istotnych problemów metodologicznych współczesnej nauki.[...]”

Drugim argumentem na rzecz sklasyfikowania cyklu artykułów do dyscypliny „Filozofia” jest fakt, że znaczna część przeprowadzonych badań, które stanowią oceniane osiągnięcie naukowe, została przeprowadzona w ramach grantów NCN uzyskanych w panelu HS1 (Filozofia, nauki o poznaniu, religioznawstwo, teologia), a nie w panelu HS4 (Ekonomia i Finanse). Wskazują na to m.in. numery grantów (2015/19/N/HS1/01066, 2018/28/T/HS1/00007, 2022/45/B/HS1/00183) jak również ich opis na stronie Narodowego Centrum Nauki.

Trzecim argumentem jest treść listu dr hab. Tomasza Żuradzkiego, prof. Instytutu Filozofii UJ z 14 października 2023 r.. Dowiadujemy się, że artykuł **A11** powstał jako część kształcenia w Szkole Doktorskiej Nauk Humanistycznych UJ i był raportowany przez Habilitanta w Indywidualnym Planie Badawczym jako składowa doktoratu z filozofii. Habilitant zadeklarował jednocześnie, że publikacja jest „związana z dyscypliną, w ramach której przygotowywana jest rozprawa doktorska /z realizowanym programem doktorskim”

Ostatnim, i najważniejszym argumentem jest to, że w ocenianym cyklu artykułów nie przedstawiono autorskich wyników, które opisywałyby procesy ekonomiczne lub dynamikę rynków finansowych. Praca stanowi jedynie opis tego, jak zjawiska ekonomiczne są badane przez ekonomistów.

Ocena działalności dydaktycznej

Doktor Mariusz Maziarz posiada ograniczone doświadczenie w zakresie prowadzenia zajęć dydaktycznych. W autoreferacie wymienione są jedynie ćwiczenia do wykładu „Kierunki rozwoju współczesnej ekonomii” w trakcie studiów doktoranckich na Uniwersytecie Ekonomicznym we

Wrocławiu. Habilitant nie był promotorem prac licencjackich, prac magisterskich czy prac podyplomowych. Jest to dorobek bardzo ubogi jak na kandydata do stopnia doktora habilitowanego

Ocena końcowa i rekomendacja

W mojej ocenie cykl artykułów autorstwa doktora Mariusza Maziarza nie stanowi osiągnięcia naukowego stanowiącego wkład w rozwój dyscypliny „Ekonomia i Finanse”. W efekcie, nie przychylam się do wniosku Habilitanta o nadanie stopnia doktora habilitowanego. Jednocześnie wnioskuję o dopuszczenie Habilitanta do dalszych etapów postępowania, aby moja wątpliwość odnośnie wyboru dyscypliny „Ekonomia i Finanse” oraz kontrowersje dotyczące artykułu **A11** mogły być wyjaśnione w trakcie kolokwium habilitacyjnego.

Prof. dr hab. Michał Rubaszek

KIEROWNIK
Zakład Modelowania Rynków Finansowych
Michał Rubaszek
prof. dr hab. Michał Rubaszek