Revista de Economía Aplicada
ISSN: 1133-455X
rea@unizar.es
Universidad de Zaragoza
España

CANTÓ, OLGA; GRADÍN, CARLOS; DEL RÍO, CORAL
POBREZA CRÓNICA, TRANSITORIA Y RECURRENTE EN ESPAÑA
Revista de Economía Aplicada, vol. XX, núm. 58, 2012, pp. 69-94
Universidad de Zaragoza
Zaragoza, España

Disponible en: http://www.redalyc.org/articulo.oa?id=96924442003

Cómo citar el artículo
Número completo
Más información del artículo
Página de la revista en redalyc.org

Sistema de Información Científica
Red de Revistas Científicas de América Latina, el Caribe, España y Portugal
Proyecto académico sin fines de lucro, desarrollado bajo la iniciativa de acceso abierto

Revista de Economía Aplicada E A *Número 58 (vol. XX), 2012, págs. 69 a 94*

POBREZA CRÓNICA, TRANSITORIA Y RECURRENTE EN ESPAÑA*

OLGA CANTÓ
Instituto de Estudios Fiscales y Universidade de Vigo

CARLOS GRADÍN
CORAL DEL RÍO
Universidade de Vigo

Este trabajo analiza la dinámica de la pobreza en España identificando distintos perfiles en función de su duración temporal. Los resultados indican que la pobreza en España exhibe dos características importantes: un reducido número de individuos en pobreza crónica y un elevado nivel de recurrencia en la pobreza transitoria. Por eso en el caso español, y en contraste con otros países de la Unión Europea, resulta particularmente relevante distinguir entre los pobres transitorios que experimentan diferentes episodios de pobreza de forma recurrente de los que lo sufren una sola vez. La caracterización de las tipologías nos permite concluir también que la pobreza crónica afecta más a los hogares cuyo sustentador es de mayor edad o con bajo nivel de cualificación, así como a los que tienen un menor número de miembros asalariados. La pobreza transitoria y recurrente en cambio aparece ligada al empleo por cuenta propia y a la presencia de niños en el hogar.

Palabras clave: duración de la pobreza, cronicidad, recurrencia.

Clasificación JEL: D1, D31, I32.

El análisis de la pobreza desde un enfoque de sección cruzada ha permitido durante las últimas décadas cuantificar su incidencia e intensidad, analizar su composición e identificar las características individuales y familiares más asociadas a ella. Hace ya algún tiempo, sin embargo, la investigación sobre el tema ha subrayado la importancia de abordar también un análisis del fenómeno desde una perspectiva dinámica que permita, en particular, cuantificar la proporción de población pobre que experimenta pobreza crónica frente a la que lo hace de un modo transitorio. Uno de los resultados fundamentales de las investigaciones internacionales sobre este tema es la existencia de una gran movilidad en la parte baja de la distribución de renta de muchos países. Así, el porcentaje de personas que experimentan algún periodo de pobreza a lo largo de su vida es muy superior al de los afectados por la pobreza en un año determinado. Además, el tiempo de permanencia

(*) Los autores desean agradecer la financiación del *Ministerio de Ciencia e Innovación* en su convocatoria de Proyectos de I+D (ref. ECO2010-21668-C03-03/ECON) y a la Xunta de Galicia (105EC300023PR).

en la pobreza varía considerablemente dentro del primer colectivo, lo que subraya la importancia de diferenciar y caracterizar distintas tipologías de pobreza dinámica. El estudio de estas tipologías resulta de gran utilidad práctica para el diseño de las políticas sociales que deben tener una orientación diferente en cada caso. En concreto, en los hogares afectados por la pobreza crónica las políticas deberían incidir en mayor medida en promover la empleabilidad de sus miembros, a la vez que en garantizar su suficiencia de ingresos en el medio y largo plazo. En contraste, en los hogares afectados por pobreza transitoria las políticas deberían hacer mayor hincapié en mejorar la estabilidad de los ingresos procedentes del empleo, garantizando una protección adecuada en los periodos de desempleo.

Los estudios de sección cruzada señalan que la tasa de pobreza en España se sitúa persistentemente en torno al 18-20 por ciento de la población desde principios de los años noventa. Sin embargo, las investigaciones sobre la dinámica de la pobreza señalan de manera bastante robusta a España como un país con una elevada movilidad de rentas, tanto hacia dentro como hacia fuera de la pobreza, y con un elevado porcentaje de la población que alguna vez estuvo por debajo del umbral de pobreza. En concreto, a través de la explotación de datos trimestrales de ingresos desde mediados de los ochenta a mediados de los noventa, Cantó (2000) llega a la conclusión de que la movilidad de la renta familiar en España es elevada ya que alrededor de un 60 por ciento de los hogares españoles cambia de decil de renta de un año a otro. Estos resultados son similares a los obtenidos por Jarvis y Jenkins (1997) para el Reino Unido. En la misma línea, Ayala y Sastre (2008) concluyen que España registra, simultáneamente, una mayor tasa de pobreza que otros países de la Unión Europea (UE) y una mayor movilidad de los individuos de renta baja y media, junto con una escasa movilidad entre los ubicados en la parte alta de la distribución. Los autores apuntan a la fuerte segmentación del mercado laboral español como el factor más determinante de estos resultados, debido a la importante presencia en nuestro país de trabajadores con salarios bajos y contratos temporales (con la consecuente inestabilidad en las rentas familiares de los hogares situados en los primeros deciles de ingreso), frente a la acumulación de ventajas de los hogares situados en la parte alta de la distribución de rentas. Por todo lo anterior, parece que la población afectada por la pobreza en el caso español aglutina a personas con perfiles muy diferentes en función del tiempo que pasan en tal situación [Cantó (2002, 2003); Ayala y Sastre (2004, 2008)] y, a pesar de ello, hasta el momento, no tenemos evidencia empírica sobre el perfil demográfico y socioeconómico de estos grupos. Además, los resultados obtenidos por varios trabajos recientes [Bárcena y Cowell (2006), Ayllón (2008) o Arranz y Cantó (2010)] subrayan la relevancia de caracterizar las distintas tipologías dinámicas de la pobreza ya que la duración de los episodios de pobreza incide negativamente en las posibilidades futuras del individuo de salir esa situación.

En este trabajo presentamos un análisis de las distintas tipologías de pobreza en España en función del tiempo de permanencia en la misma, diferenciando entre pobres crónicos y transitorios, y dentro de estos últimos entre recurrentes y no recurrentes. Para la identificación de los pobres crónicos utilizamos dos criterios distintos aunque complementarios. El primero se basa en la metodología de los componentes y en el supuesto de ausencia de restricciones de liquidez. Siguiendo este enfoque, la pobreza crónica o permanente de un individuo se determina en función de su renta media dentro del intervalo de observación temporal. El segundo, en

línea con la metodología de los episodios de pobreza, asume la existencia de restricciones de liquidez y determina que una persona es pobre crónica en función del tiempo de permanencia por debajo del umbral anual de pobreza.

La organización del trabajo es como sigue. En la sección 1 se discute la relevancia de diferenciar a la población pobre en función de la dimensión temporal de la pobreza y se presentan los dos criterios alternativos para la identificación de los diferentes tipos de población pobre. En la sección 2, se cuantifica la incidencia de cada tipología dinámica de pobreza en España en un análisis comparativo con otros países de la UE, y en la sección 3 se caracteriza cada una de ellas para el caso español utilizando un modelo *logit* anidado. La última sección recoge las principales conclusiones del trabajo.

1. Pobreza crónica, transitoria y recurrente

En la medición de la pobreza estática tradicionalmente se abordan dos cuestiones: la identificación de los individuos pobres, por un lado, y la agregación de las diferentes experiencias de pobreza en un indicador único que resuma la pobreza de la población, por otro. La primera cuestión se solventa, típicamente, mediante la fijación de una línea de pobreza, la cual permite identificar como pobres a aquellos individuos cuya renta se sitúa por debajo de dicho umbral durante un periodo temporal concreto (por ejemplo, un año). La agregación se resuelve mediante el uso de índices completos de pobreza que satisfacen un conjunto de propiedades normativas que se consideran deseables, y sobre las que existe un cierto consenso en la literatura, como son la sensibilidad de los índices a la incidencia, a la intensidad y a la desigualdad de las experiencias de pobreza. El análisis se complica, sin embargo, cuando abordamos las tipologías de pobreza incorporando su dimensión temporal. En cuanto a la identificación debemos, en primer lugar, delimitar el colectivo de población que fue pobre al menos en algún periodo a lo largo de un determinado intervalo temporal de observación. En segundo lugar es necesario diferenciar dentro de ese colectivo entre pobres crónicos y pobres transitorios. Además, los pobres transitorios constituyen un conjunto muy heterogéneo en cuanto a sus patrones temporales, por lo que parece interesante diferenciarlos, a su vez, en al menos dos grupos: los pobres transitorios recurrentes y los no recurrentes, atendiendo al número de episodios de pobreza que experimentan (entendiendo aquí por episodio todo intervalo ininterrumpido de pobreza, independientemente del número de años o periodos que abarque). El problema de la agregación de las experiencias de pobreza individuales en un indicador único también es bastante más complejo que en el caso estático y, de hecho, aún no está resuelto en la literatura. En este trabajo vamos a utilizar dos criterios alternativos de identificación de la pobreza crónica y, para la agregación, teniendo en cuenta que nuestro interés último es caracterizar los diferentes tipos de pobreza, recurriremos al indicador más simple: la proporción de población pobre de acuerdo con cada tipología[1].

(1) La construcción de indicadores más complejos que tengan en cuenta la intensidad y la duración de las diferentes experiencias de pobreza es posible, pero desborda ampliamente los objetivos del presente trabajo. Véase a modo de ejemplo las propuestas de Foster (2009), Bossert *et al.* (2010) o Gradín *et al.* (2010).

Consideremos el vector de renta de un individuo $y_i = (y_{i1}, ..., y_{iT})$ donde y_{it} es su renta equivalente en el año t, representando T el número de años objeto de estudio. Siendo z_t la línea de pobreza fijada en el 60 por ciento de la renta equivalente mediana en cada momento t, diremos que el individuo i es pobre en el año t si $y_{it} < z_t$. Esto es, construimos un indicador individual de pobreza en el año t de modo que:

$$P_{it} = \begin{cases} 1 & si \quad y_{it} < z_t \\ 0 & si \quad y_{it} \geq z_t \end{cases}$$

Así, el colectivo de población que fue pobre alguna vez estará conformado por aquellas personas que para algún periodo de observación t satisfacen la condición: $P_{it} = 1$.

A continuación necesitamos algún criterio para identificar a los pobres crónicos o permanentes. Dado que en la literatura no existe consenso sobre cómo identificarlos, emplearemos dos métodos alternativos aunque, como veremos, complementarios. El primero está basado en la metodología de los componentes que ha sido utilizada por Jalan y Ravallion (1998) en la línea de trabajos previos de Ravallion (1988), Duncan y Rodgers (1991) o Rodgers y Rodgers (1993). En este enfoque se propone la descomposición de un indicador de pobreza intertemporal de cada individuo, $P_i = (y_{i1}, ..., y_{iT})$, en dos componentes: la pobreza crónica $C_i = (\overline{y}_i, ..., \overline{y}_i)$ determinada por la media de la renta (o consumo) del individuo a lo largo de la totalidad del periodo temporal T, $\overline{y_i} = \frac{1}{T}\sum_{t=1}^{T} y_{it}$, y la pobreza transitoria $T_i = P_i(y_{i1}, ..., y_{iT}) - C_i(\overline{y}_i, ..., \overline{y}_i)$ definida de forma residual como la pobreza observada que no es crónica, y que viene determinada por las fluctuaciones de la renta en torno a su media a lo largo del tiempo. Siguiendo esta filosofía, parece razonable considerar que un individuo que fue pobre alguna vez es pobre crónico si su renta equivalente total durante todo el periodo analizado, que podemos denotar como $Y_i = \sum_t y_{it}$, está por debajo del umbral de pobreza intertemporal Z calculado como el 60 por ciento de la renta equivalente mediana del periodo completo en la población de estudio N, $Z = 0{,}6$ x *mediana* $(Y_1, Y_2, ..., Y_N)$[2]:

$$P_i = \begin{cases} 1 & si \quad Y_i < Z \\ 0 & si \quad Y_i \geq Z \end{cases}$$

La principal ventaja de este criterio es su sencillez, ya que la identificación de los pobres crónicos se hace de manera similar a como se determina la pobreza en cada año, sólo que aplicando dicho criterio sobre los ingresos de todos los años

(2) La elección de esta línea de pobreza intertemporal constituye una adaptación de esta metodología a una noción relativa de pobreza, ya que habitualmente se ha implementado en estudios empíricos que utilizan un enfoque absoluto de la misma.

considerados. Su principal limitación radica en que es preciso asumir que las familias no se enfrentan a restricciones de liquidez en los mercados financieros, ya que pueden ahorrar y endeudarse para compensar su exceso o falta de rentas en cualquier periodo. Este supuesto parece poco razonable ante la evidencia empírica que muestra que los hogares de baja renta se enfrentan a restricciones de crédito importantes[3]. Además, como señala Foster (2009), el enfoque de los componentes no tiene en cuenta de manera adecuada la duración del fenómeno de pobreza ya que si los hogares experimentan largos periodos de pobreza con brechas de renta relativamente pequeñas en cada periodo, en la medición de la pobreza agregada éstas podrían verse fácilmente compensadas con un incremento de renta que pudiese experimentar el hogar en un único periodo temporal.

Por todo ello, el segundo criterio que empleamos para identificar a los pobres crónicos se basa en la metodología de los episodios de pobreza donde la condición de pobre crónico se determina en función del número de periodos que una persona permanece bajo el umbral de pobreza correspondiente[4]. Así, debemos fijar un umbral de duración de la pobreza $\tau \in (0,1)$, medido como la proporción de años mínima de permanencia en la misma que determina la condición de pobre crónico[5]. Siguiendo esta filosofía, un pobre crónico es aquel individuo que pasa, al menos, un porcentaje de tiempo τ por debajo de la línea de pobreza z. Es decir, si $d_i = \frac{1}{T}\sum_t P_{it}$ es la proporción de años de permanencia del individuo *i* en la pobre-

(3) Algunos autores como Rodgers y Rodgers (1993) o Slesnick (2001) defienden que los individuos pobres pueden suavizar su consumo ahorrando y endeudándose a lo largo del tiempo. Sin embargo, hay una gran cantidad de evidencia que muestra lo contrario. Por ejemplo, Jappelli (1990) demuestra con datos estadounidenses que el ingreso y la riqueza del hogar, además de la edad del sustentador principal, determinan claramente las posibilidades que éste tiene de obtener un crédito. En el contexto europeo, Kempson (1996) concluye que los hogares más vulnerables a la pobreza en el Reino Unido, especialmente aquellos constituidos por jóvenes con hijos, no disponen de ahorros u otros activos financieros para sufragar su consumo en periodos de baja renta. En el caso de España, los resultados de Azpitarte (2008) sugieren que los hogares unipersonales formados por individuos que están por debajo de los 45 años de edad son los más vulnerables a fluctuaciones de renta dada su limitada disposición de activos (si incluimos dentro de éstos a la vivienda principal). Así, cuando los individuos de este grupo experimenten periodos de baja renta (sobre todo de forma recurrente) es esperable que les resulte difícil cubrir la falta de rentas con activos acumulados. De hecho, el trabajo de Cutanda (2003), que analiza el exceso de sensibilidad del consumo de bienes no duraderos al nivel de renta, parece indicar que una proporción considerable de la población española podría estar afectada por estas restricciones. Para una mayor discusión sobre este tema véase Gradín *et al.* (2008).

(4) Este segundo enfoque, basado en la duración de la pobreza, se aproxima a la propuesta de Bane y Ellwood (1986) al poner de manifiesto la utilidad del uso de los episodios de pobreza en el análisis de la pobreza dinámica, aunque utiliza un concepto de episodio distinto al que propusieron estos autores. Así, y a diferencia de la noción anterior, Bane y Ellwood (1986) definieron un episodio de pobreza como el intervalo temporal durante el cual un individuo está por debajo del umbral de pobreza (lo cual puede suceder durante más de un año, según la mayor o menor duración del mismo, pudiendo englobar así a varios periodos). Posteriormente, nosotros retomaremos esta noción clásica de episodio de pobreza en nuestra aplicación empírica, con el objeto de diferenciar entre pobres transitorios recurrentes y no recurrentes.

(5) Estas estrategias se suelen denominar en la literatura metodologías de doble umbral (*dual cut-off approaches*) ya que, en una primera fase, se ha clasificado previamente al hogar como "alguna vez pobre" utilizando un umbral de renta anual.

breza, éste será pobre crónico si $d_i \geq \tau$. Este enfoque presupone, al contrario que el anterior, que no es posible compensar las brechas de un año con las rentas de otro año distinto, como consecuencia de la existencia de restricciones de liquidez.

Evidentemente, la elección de τ determina la intensidad en el grado de cronicidad que deseamos utilizar, por lo que es una decisión metodológica adicional que resulta determinante. El criterio más exigente es que $\tau = 1$, es decir, un individuo sería pobre crónico sólo si es pobre a lo largo de todo el intervalo temporal de observación (Pobreza Crónica Pura)[6]. En el otro extremo, si $\tau = 1/T$, todos los que son al menos una vez pobres serían considerados como pobres crónicos. Si, en cambio, situamos el umbral en un punto intermedio, con valores entre 0 y 1, estaremos identificando como pobres crónicos a individuos con un determinado grado de cronicidad en la pobreza[7].

En una tercera etapa, una vez identificados los pobres crónicos y los transitorios, estamos interesados en diferenciar dentro de estos últimos a aquéllos que experimentan más de un episodio de pobreza[8], y que denominaremos recurrentes en línea con Bane y Ellwood (1986) o Gardiner y Hills (1999). Según la OCDE (2001) la mayoría de los individuos que logran salir de una situación de pobreza tienen una elevada probabilidad de volver a ella a corto plazo, por lo que aquéllos que en algún momento sufren un periodo de pobreza resultan tener también una elevada probabilidad de experimentar nuevos episodios de pobreza de forma recurrente. Debemos tener en cuenta que la recurrencia, frente a la transitoriedad no recurrente, entendida ésta como un único episodio de pobreza continuo en un periodo temporal extenso, puede generar situaciones de malestar social ligadas a la elevada incertidumbre en la percepción de rentas necesarias para sobrevivir, lo que justifica su análisis detallado en este trabajo.

2. La duración de la pobreza en España

El análisis de la dinámica de la pobreza en nuestro país se realiza a partir de la información recogida en el Panel de Hogares de la Unión Europea (PHOGUE) durante el periodo 1994-2001. Para poder contextualizar mejor los resultados obtenidos para España en el ámbito internacional, se ofrece, en primer lugar, un análisis comparativo de duración de la pobreza en varios países de la UE. Posteriormente, y ya en el siguiente apartado, se aborda la caracterización de los distintos tipos de pobreza identificados en el caso español. Los países europeos elegidos fueron seleccionados por presentar diferentes niveles de incidencia de la pobreza

(6) Ésta es la elección adoptada en este trabajo.

(7) En el caso particular del indicador de Laeken utilizado por la UE para cuantificar la pobreza crónica, ésta se determina a partir del porcentaje de individuos pobres que lo son en un año determinado y en dos de los tres anteriores. Así, un individuo pobre un año determinado sería identificado como pobre crónico si fue pobre al menos tres de cuatro años, esto es, el 75 por ciento de los últimos cuatro años observados.

(8) Retomamos aquí la noción clásica de episodio de pobreza denominado "*spell*" en la literatura anglosajona y que engloba a todos aquellos periodos en los que el individuo está continuamente por debajo del umbral de la pobreza.

(calculada en promedio anual durante el periodo 1994-2000), siendo los siguientes: Portugal, con un nivel similar al de España (un 20,5 por ciento de individuos por debajo del umbral anual de pobreza)[9], Francia y el Reino Unido con un nivel intermedio (un 15 y un 17,4 por ciento, respectivamente), y Alemania y Dinamarca con niveles claramente inferiores (en torno a un 10 por ciento). El cuadro 1 resume la duración de la pobreza en cada uno de estos países utilizando una ventana de observación de siete años, construida a partir de la información anual de características y rentas recogida en el PHOGUE[10].

En la mitad superior del cuadro 1 se presenta el porcentaje de población que permanece de uno a siete años por debajo del umbral de pobreza. Los resultados nos indican que en España el 44 por ciento de la población experimenta algún episodio de pobreza entre 1994 y 2000[11]. En conjunto, además, podemos concluir que los países con una tasa anual de incidencia de la pobreza más elevada, como España y Portugal, también registran un mayor porcentaje de población que pasa al menos un año en situación de pobreza, mientras que en países como Alemania y Dinamarca este grupo se reduce a menos del 30 por ciento de la población (Francia y Reino Unido, con un 32 y 36 por ciento respectivamente, se sitúan en un nivel intermedio). En contraste, hay pocas diferencias entre países en cuanto al porcentaje de individuos que pasan un único año de los siete por debajo del umbral de la pobreza. Así, este grupo representa un 13 por ciento de la población en España, lo que significa un porcentaje muy similar al de Dinamarca, y no muy diferente del de los demás países analizados (que se sitúan entre un 11 y un 12 por ciento). Las mayores diferencias respecto de la duración de la pobreza se observan para valores intermedios (entre 2 y 5 años) con niveles significativamente mayores en España y Portugal en comparación con el resto de países.

La comparación varía sensiblemente cuando analizamos la distribución del tiempo de permanencia en la pobreza de los individuos que fueron pobres alguna vez, cuyos resultados se pueden ver en la mitad inferior del cuadro 1. Países de elevada incidencia de la pobreza como Portugal, España o Reino Unido presentan porcentajes bajos en sus respectivas poblaciones de individuos que sólo fueron pobres en un único periodo (26, 30 y 31 por ciento, respectivamente), a costa de ofrecer mayores porcentajes entre los colectivos con un mayor número de episo-

(9) El umbral de pobreza se ha situado en el 60 por ciento de la mediana de la renta familiar ajustada y contemporánea, para cada uno de los años objeto de estudio. Con el objeto de homogeneizar y hacer comparables rentas de hogares de diferente tamaño y composición, el ajuste se realiza utilizando la escala de equivalencia de la OCDE modificada, que asigna un valor de 1 al primer adulto del hogar, 0,5 a cada uno de los adultos restantes y 0,3 a cada menor presente en el mismo.

(10) Para ello se ha construido un panel para cada país cuya información sobre rentas se ajusta para hacerla contemporánea a la referida a las características socioeconómicas y demográficas del hogar en cada momento del tiempo. Dado el diseño del PHOGUE, esto implica, inevitablemente, perder una ola de información, por lo que sólo trabajaremos con siete años en lugar de con los ocho que originalmente ofrece esta encuesta europea. Véase el anexo para una explicación detallada sobre la construcción de esta base de datos.

(11) Este resultado es similar al estimado por Ayala y Sastre (2007). Estos autores obtienen un porcentaje del 46,5 por ciento ya que, aunque utilizan la misma fuente de datos, no realizan el ajuste temporal de las rentas y las características socioeconómicas y demográficas del hogar. Esto, además, implica que su análisis incluye un año más de información del panel.

Cuadro 1: Duración de la pobreza en varios países de la UE. PHOGUE 1994-2001.
Umbral del 60% de la mediana de la renta familiar ajustada y contemporánea

	España		Alemania		Dinamarca		Francia		Portugal		Reino Unido	
Promedio de la Tasa anual de pobreza durante el periodo 1994-2000 (%)	18,8		10,7		10,4		15,0		20,5		17,4	
Población total Años de pobreza												
Ninguno	56,0		72,0		71,2		67,5		56,0		63,8	
	%	Acum.	%	Acum.	%	Acum.	%	Acum.	%	Acum.	%	Acum.
Uno	13,4	13,4	11,8	11,8	13,7	13,7	11,6	11,6	11,6	11,6	11,4	11,4
Dos	9,2	22,6	5,8	17,7	6,5	20,2	6,0	17,6	8,3	19,9	6,4	17,8
Tres	5,9	28,5	2,9	20,6	2,6	22,8	4,4	22.0	4,8	24,7	5,3	23,1
Cuatro	5,6	34,1	2,5	23,2	2,5	25,3	3,4	25,4	5,3	30,0	3,7	26,8
Cinco	3,8	37,9	1,4	24,6	1,3	26,6	2,3	27,6	4,6	34,7	3,7	30,5
Seis	3,4	41,3	1,5	26,1	1,1	27,7	2,1	29,7	3,7	38,4	2,8	33,3
Siete	2,7	**44,0**	1,9	**28,0**	1,0	**28,7**	2,7	**32,5**	5,6	**44,0**	2,8	**36,1**
Total	100		100		100		100		100		100	

Nota: Estos resultados han sido obtenidos para los presentes en el panel durante las ocho olas (panel puro) y utilizando pesos por abandono de la muestra, La tasa de pobreza anual es la media del periodo 1994-2000 para cada país. En todos los resultados dinámicos utilizamos los pesos longitudinales de la última entrevista del individuo en el panel.

Fuente: Elaboración propia.

Cuadro 1: DURACIÓN DE LA POBREZA EN VARIOS PAÍSES DE LA UE. PHOGUE 1994-2001.
UMBRAL DEL 60% DE LA MEDIANA DE LA RENTA FAMILIAR AJUSTADA Y CONTEMPORÁNEA (continuación)

	España		Alemania		Dinamarca		Francia		Portugal		Reino Unido	
Alguna vez pobres Años de pobreza:												
	%	Acum.	%	Acum.	%	Acum.	%	Acum.	%	Acum.	%	Acum.
Uno	30,5	30,5	42,3	42,3	47,5	47,5	35,7	35,7	26,5	26,4	31,2	31,2
Dos	20,9	51,4	20,9	63,2	22,8	70,3	18,5	54,2	18,8	45,2	17,8	49,0
Tres	13,3	64,6	10,5	73,7	9,2	79,5	13,4	67,6	10,9	56,1	14,5	63,6
Cuatro	12,7	77,3	9,0	82,7	8,5	88,7	10,4	78,0	12,1	68,2	10,4	73,9
Cinco	8,7	86,1	5,2	87,9	4,6	92,7	7,0	85,0	10,5	78,8	10,2	84,2
Seis	7,7	93,8	5,3	93,2	3,7	96,3	6,5	91,5	8,5	87,3	7,8	91,9
Siete	6,1	100,0	6,8	100,0	3,5	100,0	8,5	100,0	12,7	100,0	8,0	100,0
Muestra	9.595		9.830		3.019		9.225		9.305		7.116	

Nota: Estos resultados han sido obtenidos para los presentes en el panel durante las ocho olas (panel puro) y utilizando pesos por abandono de la muestra, La tasa de pobreza anual es la media del periodo 1994-2000 para cada país. En todos los resultados dinámicos utilizamos los pesos longitudinales de la última entrevista del individuo en el panel.

Fuente: Elaboración propia.

dios de pobreza (sobre todo a partir de 3 ó más años). En contraste, países con menor incidencia de la pobreza como Dinamarca o Alemania presentan mayores tasas en el primer grupo (47 y 42 por ciento) pero valores claramente inferiores entre los colectivos de 3 a 6 años[12]. Volviendo al caso español, y en comparación con países como Francia y Reino Unido, observamos que nuestro país registra un menor porcentaje de individuos en pobreza crónica, a pesar de presentar un mayor porcentaje de individuos por debajo del umbral año a año. Como consecuencia, presenta un mayor porcentaje de individuos pobres entre dos y cuatro años.

A partir de estos resultados y con el objetivo de analizar con mayor detalle las características dinámicas de la pobreza en España, en los cuadros 2 y 3 se ofrecen los niveles de pobreza crónica, transitoria recurrente y no recurrente para estos mismos países. Para medir la relevancia poblacional de las distintas tipologías de pobreza se ha seguido tanto el criterio basado en la metodología de los episodios como el inspirado en la metodología de los componentes descritos en el apartado anterior[13].

Como refleja el cuadro 1, un 44 por ciento de la población española sufrió al menos un año de pobreza durante el periodo analizado. Siguiendo la metodología de los episodios, dentro de este colectivo podemos distinguir tres grupos según el número de años y de episodios de pobreza experimentados. Así, consideramos pobres crónicos a aquellos individuos cuyo nivel de renta fue inferior al umbral de pobreza durante los siete años analizados; pobres transitorios no recurrentes a aquéllos que, no habiendo sido pobres durante todo el periodo, sólo experimentaron un episodio de pobreza (el cual podría tener una duración de entre 1 y 6 años); y pobres transitorios recurrentes al resto de individuos alguna vez pobres que, situándose por debajo del umbral entre 1 y 6 años, experimentaron 2 o más episodios de pobreza (de forma que podemos identificar en su trayectoria al menos un periodo de salida y otro de re-entrada en la pobreza). El cuadro 2 refleja la importancia relativa de cada uno de estos colectivos en España en relación con el resto de países europeos analizados. Así, un 2,7 por ciento de la población española fue pobre de manera crónica, esto es, durante los siete periodos analizados, un 23 por

(12) La principal diferencia entre ambos países se encuentra en el colectivo de individuos que se sitúan los siete años por debajo del umbral de pobreza, ya que en este caso, mientras en Dinamarca este grupo sólo representa al 3,5 por ciento de su población alguna vez pobre (claramente el menor valor de los seis países analizados), en Alemania dicho porcentaje se eleva al 6,8 por ciento, por encima incluso del caso español.

(13) El lector ha de tener en cuenta que nuestro análisis no se ocupa de la dinámica intra-anual ya que asumimos que los hogares pueden suavizar el consumo dentro del año natural. Algunos autores como Cantó *et al.* (2006) han discutido la relevancia del periodo de medición del ingreso o el gasto sobre la dinámica de la pobreza en España y concluyen que el periodo de medición es relevante en tanto que la movilidad intra-anual de rentas es elevada y, por tanto, al analizar la dinámica se encuentran diferentes resultados utilizando distintos periodos de medición. Esto sucede especialmente en la estimación de la probabilidad de entrada en la pobreza más que en la estimación de la probabilidad de salida. Tampoco nos ocupamos en este trabajo de la dinámica de rentas de largo plazo o de ciclo vital de los individuos ya que, aunque explotamos el panel más largo de rentas existente para España, éste contiene información únicamente de siete años de su vida. Finalmente tampoco abordamos el tema de la transmisión intergeneracional de la pobreza que resulta ser especialmente interesante desde el punto de vista del estudio de la igualdad de oportunidades.

ciento fue pobre durante un único episodio de pobreza de duración inferior a 7 años, y un 18,2 por ciento fue pobre de manera transitoria recurrente, y tuvo así dos o más episodios de pobreza. Esto significa que, de los españoles que fueron pobres en algún periodo, casi la mitad lo fueron de forma no recurrente (un 52 por ciento), mientras que el resto se repartieron entre el 6,1 por ciento de pobres crónicos y el 41,5 por ciento de pobres que experimentaron alguna recaída a una situación previa de escasez de recursos. Si comparamos estas cifras con las de los demás países analizados, comprobamos que lo más destacable es el elevado nivel de recurrencia de la pobreza en España, medida ésta tanto sobre el total de la población (los demás países se mueven entre el 7 por ciento de Dinamarca o Alemania y el 14 de Portugal) como sobre la población pobre (al situarse éstos en torno al 30 por ciento o menos). En cambio, la pobreza crónica en España no difiere sustancialmente de la de Francia o Reino Unido y es significativamente menor que la de Portugal, siendo el segundo país, tras Dinamarca, con el menor porcentaje de pobres crónicos entre la población considerada como pobre en algún periodo.

Si identificamos la cronicidad mediante el enfoque basado en la metodología de los componentes, la pobreza crónica alcanza niveles sustancialmente más elevados en todos los países, afectando al 31 por ciento de los pobres en España (y a casi el 14 por ciento de su población total). Este incremento se alcanza, fundamentalmente, a costa de identificar un menor nivel de pobreza recurrente (la cual se reduce a la mitad en la mayoría de casos) aunque también se reduce de manera notable la de tipo no recurrente[14]. El hecho de que la pobreza crónica estimada con este enfoque sea mayor no debería sorprendernos, ya que en este colectivo no sólo estamos incluyendo a todos los individuos así identificados utilizando la metodología de los episodios (aquéllos que siempre fueron pobres) sino también a aquellos individuos cuya renta en periodos de no pobreza no alcanza para compensar la escasez experimentada en los periodos de indigencia. Lo verdaderamente llamativo de estos resultados es la dimensión que alcanzan estas diferencias en la mayoría de países. Esto pone de manifiesto la precariedad de muchas de las salidas de la pobreza, ya que la renta que se obtiene en periodos por encima del umbral de pobreza no permite compensar los déficits que se producen durante los periodos de pobreza. En cualquier caso, la posición relativa de España, junto a la de Francia, se mantiene en niveles intermedios de cronicidad, situándose entre los más elevados de Portugal y Reino Unido y los más reducidos de Dinamarca y Alemania. Por otro lado, también se mantiene o incluso se acentúa la elevada recurrencia de la pobreza en España en comparación con el resto de países. Así, este resultado de nuevo parece ser robusto al criterio de identificación empleado.

(14) Recordemos que, siguiendo este enfoque, identificamos como pobres crónicos a aquellos individuos cuya renta equivalente total durante todo el periodo de estudio (renta intertemporal) no alcanza al 60 por ciento de la mediana de la distribución de renta intertemporal del país al que pertenece. Como consecuencia de esto, el nivel de pobreza transitoria se define subsidiariamente como la diferencia entre porcentaje de individuos que fueron pobres en algún periodo menos el porcentaje de pobres crónicos previamente estimado. Finalmente, dentro del colectivo de pobres transitorios, diferenciamos la recurrencia de la no recurrencia de igual forma a como hicimos en el enfoque de los episodios de pobreza, teniendo nuevamente en cuenta el número de episodios de pobreza experimentados por cada individuo.

Cuadro 2: Niveles de pobreza crónica, transitoria y recurrente, varios países de la UE. PHOGUE 1994-2001. Umbral del 60% de la mediana de la renta familiar ajustada y contemporánea

			Criterio de cronicidad					
			Episodios de pobreza			Componentes de pobreza		
				Pobreza Transitoria (de 1 a 6 años pobre)			Pobreza Crónica	
País	Muestra	Total pobres alguna vez (% muestra)	Pobreza Crónica (7 años pobre)	Recurrente (2 ó más episodios)	No Recurrente (1 episodio)	Pobreza Crónica	Recurrente (2 ó más episodios)	No Recurrente (1 episodio)
España								
Pobres alguna vez	4.348	100	6,1	41,5	52,4	31,5	23,8	44,7
Total	9.595	44	2,7	18,2	23,0	13,8	10,5	19,6
Alemania								
Pobres alguna vez	2.895	100	6,8	26,8	66,4	26,6	13,6	59,7
Total	9.830	28,0	1,9	7,5	18,6	7,4	3,8	16,7
Dinamarca								
Pobres alguna vez	854	100	3,5	23,0	73,5	26,0	12,5	61,4
Total	3.019	28,7	1,0	6,6	21,1	7,5	3,6	17,6
Francia								
Pobres alguna vez	3.157	100	8,4	31,4	60,1	35,9	14,3	49,7
Total	9.225	32,5	2,8	10,2	19,5	11,6	4,6	16,1
Portugal								
Pobres alguna vez	4.692	100	12,7	31,5	55,8	41,1	15,5	43,4
Total	9.305	44,0	5,6	13,8	24,6	18,1	6,8	19,1
Reino Unido								
Pobres alguna vez	2.563	100	8,0	29,1	62,9	40,4	10,9	48,6
Total	7.116	36,1	2,8	10,5	22,7	14,6	3,9	17,6

Nota: Estos resultados han sido obtenidos para los presentes en el panel durante las ocho olas (panel puro) y utilizando pesos por abandono de la muestra.

Fuente: Elaboración propia.

Con el objeto de dar un primer paso en la identificación de los factores de diferenciación de los hogares con menores recursos en cuanto a la dinámica de sus rentas, en el cuadro 3 se desagregan los resultados sobre tipología de pobreza en España según el sustentador principal del hogar sea menor o mayor de 65 años. El motivo de hacerlo así es verificar si la elevada recurrencia en la pobreza en España puede estar asociada a las características de nuestro mercado laboral, con importantes tasas de desempleo y temporalidad, tal y como ya señalaron trabajos previos como el informe de la OCDE (2001) y Ayala y Sastre (2007).

Los resultados del cuadro 3 confirman que existen diferencias destacables entre ambos colectivos de hogares. La incidencia de los que son pobres alguna vez es mayor cuando el sustentador principal del hogar es menor de 65 años (45 frente a 38 por ciento) confirmando, una vez más, la mejora en la situación relativa de los hogares "mayores" si la comparamos con la que experimentaban décadas atrás. Lo novedoso ahora es comprobar que las diferencias entre ambos colectivos también se reflejan en la estructura dinámica de la pobreza. De acuerdo con el criterio basado en la metodología de los episodios sólo la pobreza transitoria recurrente afecta en mayor medida a los hogares con sustentador menor de 65 años, al representar este colectivo un 19 por ciento de la población total y un 43 por ciento de los pobres, frente a un 12 y un 31 por ciento, respectivamente, en el caso de los hogares pobres recurrentes cuyo sustentador supera dicha edad. Por el contrario, la pobreza crónica afecta en mayor medida a hogares con sustentador en edad de jubilación: 3,9 por ciento de la población y 10,3 por ciento de los alguna vez pobres (frente a 2,5 y 5,4 por ciento, respectivamente). Estos resultados son consistentes con los obtenidos por Amuedo-Dorantes y Serrano-Padial (2010). Estos autores concluyen que los contratos temporales implican un incremento de la probabilidad de experimentar periodos de pobreza, no sólo a corto sino también a medio y largo plazo, a través de efectos *feedback* indirectos que se producen debido al menor estatus que alcanzan estos trabajadores en futuros puestos de trabajo (sobre todo en el caso de las mujeres y los hombres de más de 35 años). Finalmente, la proporción de población total afectada por la pobreza transitoria de carácter no recurrente es similar en ambos grupos, si bien su peso relativo es ligeramente mayor entre los hogares con sustentador principal de más de 65 años.

En el caso de emplear como criterio para la identificación de las tipologías de pobreza el basado en el enfoque de los componentes, se constata que la pobreza recurrente sigue siendo mayor en el caso de hogares sustentados por una persona menor de 65 años, al igual que lo observado con el otro enfoque, si bien la diferencia se reduce: un 11 por ciento de la población y una cuarta parte de los pobres, frente a un 7 y un 19 por ciento, respectivamente. En cambio, se revierte la comparación de la magnitud de la pobreza crónica, ya que ésta es ahora superior en el colectivo cuyo sustentador es más joven (14 por ciento de la población total frente a 11 por ciento; y 32 por ciento de los pobres frente a 30 por ciento). Dado que la incidencia de la pobreza transitoria no recurrente sigue siendo similar en ambos colectivos, cabe concluir que la metodología de los componentes detecta como crónica una parte de la pobreza que la metodología de los episodios identifica como recurrente, y esto incide en mayor medida sobre los hogares con sustentador en edad de trabajar que sobre el resto.

Cuadro 3: Pobreza crónica, transitoria y recurrente en España: porcentajes por colectivos. PHOGUE 1994-2001.Umbral del 60% de la mediana de la renta familiar ajustada y contemporánea

			Episodios de pobreza			Componentes de pobreza		
				Pobreza Transitoria (de 1 a 6 años pobre)			Pobreza Transitoria	
	Muestra	Total pobres alguna vez (% muestra)	Pobreza Crónica (7 años pobre)	Recurrente (2 ó más episodios)	No Recurrente (1 episodio)	Pobreza crónica	Recurrente (2 ó más episodios)	No Recurrente (1 episodio)
Sustentador principal < 65 años								
Pobres alguna vez	3.588	100	5,4	43,1	51,4	31,7	24,6	43,6
Total	7.840	45,0	2,5	19,4	23,1	14,3	11,1	19,6
Sustentador principal ≥ 65 años								
Pobres alguna vez	760	100	10,3	31,1	58,6	29,9	18,6	51,5
Total	1.755	38,2	3,9	11,9	22,4	11,4	7,1	19,7

Nota: Estos resultados han sido obtenidos para los presentes en el panel durante las ocho olas (panel puro) y utilizando pesos por abandono de la muestra.

Fuente: Elaboración propia.

3. La caracterización de la pobreza crónica, transitoria y recurrente en España

A continuación se ofrece una caracterización más completa de la pobreza según su naturaleza dinámica con el objeto de identificar qué características demográficas y socioeconómicas de los individuos están más relacionadas con cada tipo de pobreza.

Para abordar la caracterización de los distintos perfiles temporales de pobreza de forma robusta hemos optado por estimar la probabilidad de pertenecer a una tipología de pobreza a través de un modelo *logit* multinomial anidado en dos niveles[15]. En un primer nivel el individuo puede ser pobre alguna vez o no serlo nunca, es decir las posibilidades, que podemos denominar ramas, son $m = \{1, 2\}$. En un segundo nivel aquéllos que son pobres alguna vez ($m = 1$) pertenecerán a un determinado tipo de pobreza dinámica y, por tanto, podrán estar incluidos en una de las tres alternativas: ser pobre crónico, ser pobre transitorio recurrente o ser pobre transitorio no recurrente, es decir, $j = \{1, 2, 3\}$. La otra rama de este segundo nivel ($m = 2$) contiene una única opción (rama degenerada) ya que no hacemos ninguna distinción entre los que no fueron pobres nunca. Así, suprimiendo por simplicidad los subíndices de individuo, la probabilidad p_{1j} de que una persona pobre alguna vez (primera rama) lo sea de tipo j viene dada por:

$$p_{1j} = p_1 \times p_{j|1} = \frac{\exp\left(\lambda_1 I_1\right)}{\sum_{m=1}^{2}\exp\left(\lambda_m I_m\right)} \times \frac{\exp\left(x'\beta_{1j} / \lambda_1\right)}{\sum_{k=1}^{3}\exp\left(x'\beta_{1k} / \lambda_1\right)}$$

donde p_1 es la probabilidad de ser pobre alguna vez y donde $p_{j|1}$ es la probabilidad de pertenecer a una determinada tipología de pobreza j condicionada a ser pobre alguna vez. En esta última expresión, $I_m = \ln\left\{\sum_{k=1}^{3}\exp\left(x'\beta_{mk} / \lambda_m\right)\right\}$, x' es el vector de características de los hogares, β_{mk} son los parámetros a estimar asociados a la tipología k y λ_m es el parámetro de disimilitud que permite corregir por la correlación de los errores entre los individuos que se encuentran en esa rama. La ventaja de este modelo econométrico frente al multinomial es que permite estimar el efecto de las características sobre la probabilidad de que un individuo esté incluido en una de las tipologías de pobreza dinámica, permitiendo que los errores de las tres alternativas de pobreza dentro de una misma rama estén correlacionados entre sí. En nuestro caso en particular, y dado que la segunda rama es degenerada, tenemos que $\lambda_2 = 1$. En el caso en el que se cumpliera que $\lambda_1 = 1$, la correlación de los errores sería cero y el modelo se reduciría a un *logit* multinomial. Para la correcta identificación del modelo es preciso tomar una alternativa de referencia fijando sus coeficientes igual a cero. Dado que en nuestro caso estamos interesados en identificar los determinantes de los diferentes tipos de pobreza entre sí, tomaremos la pobreza transitoria no recurrente como referencia, de modo que estimaremos la probabilidad de ser pobre crónico y transitorio recurrente en relación a aquélla.

(15) Véase Hensher *et al.* (2005) para más detalles sobre la especificación econométrica.

Como variables explicativas de la probabilidad de ser pobre hemos incluido diferentes características de los hogares en el segundo año de la muestra que pueden incidir o bien en la habilidad del hogar para obtener ingresos o bien en sus necesidades[16]. Esto incluye variables demográficas como la edad (y la edad al cuadrado), el sexo y la condición de inmigrante del sustentador principal, el número de miembros del hogar, el tipo de familia (pareja con niños, pareja sin niños, hogar monoparental, un adulto sólo, u otro tipo), los estudios alcanzados por el sustentador principal (básicos, secundarios o universitarios), la situación laboral del mismo (empleado asalariado, empleado por cuenta propia, desempleado, jubilado), el tipo de ocupación (según requiera cualificación alta, media o baja)[17], si es o no enfermo crónico, así como otra información referida al conjunto de miembros en edad de trabajar en el hogar, como el porcentaje de los mismos que reciben rentas salariales, prestaciones de desempleo, que tienen contrato temporal o que están desempleados, además del porcentaje de miembros del hogar que reciben algún tipo de pensión. Dada la necesidad de omitir una categoría en las variables ficticias, tomaremos como referencia un hogar conformado por una pareja sin hijos, donde el sustentador principal es un hombre asalariado no inmigrante, con estudios primarios, empleado en una ocupación de baja cualificación, que no padece enfermedad crónica.

Los resultados de las estimaciones del modelo *logit* anidado están recogidos en el cuadro 4. En dicho cuadro presentamos dos tipos de resultados. En las primeras cuatro columnas presentamos la estimación de los coeficientes y sus respectivos errores estándar asociados a la probabilidad de que la pobreza sea crónica frente a que sea transitoria no recurrente, alternativa tomada como referencia, siguiendo los dos métodos de identificación de la cronicidad discutidos anteriormente (episodios de pobreza y componentes). En la otra mitad del cuadro se presenta la misma estructura de resultados para la pobreza transitoria de tipo recurrente tomando la misma referencia.

En primer lugar cabe resaltar que los test de log-verosimilitud muestran en los cuatro casos que los inobservables de las tres tipologías de pobreza están correlacionados entre sí, por lo que el modelo multinomial no anidado generaría sesgos en la estimación de los coeficientes de interés.

Una primera observación de los resultados de las estimaciones nos permite constatar que, una vez que controlamos por otras características del sustentador principal, el impacto de la edad sobre la probabilidad de estar clasificado como pobre crónico o transitorio recurrente frente a pertenecer al grupo de los pobres transitorios no recurrentes desaparece, lo cual apunta a que el efecto de la edad del sustentador principal detectado en la parte descriptiva mostrada en la sección anterior está estrechamente ligado a su situación laboral. Además, estos resultados nos permiten concluir también que los distintos tipos de pobreza tienen perfiles diferen-

(16) Utilizamos la información procedente de la segunda entrevista al hogar porque la variable "tipo de contrato" que resulta especialmente importante para la estimación no fue recogida en la primera entrevista del PHOGUE.

(17) Las ocupaciones de alta cualificación son las clasificadas como directivos, profesionales y técnicos, y las de cualificación media son las de empleados de servicios y comercio, así como operadores cualificados.

Cuadro 4: Determinantes de la probabilidad de ser pobre crónico, transitorio y recurrente o transitorio y no recurrente

	Pobreza crónica				Pobreza transitoria y recurrente			
Individuos	Episodios		Componentes		Episodios		Componentes	
	Coeficiente	Error Estándar	Coeficiente	Error Estándar	Coeficiente	Error Estándar	Coeficiente	Error Estándar
Nº miembros hogar	1,1438	1,13	0,0024	0,19	0,1584	0,39	-0.1743	0,19
Hogar con menores	5,0150	3,33	2,2505	1,30 *	2,9339	1,48 **	1.1257	0,67 *
Hogar de un adulto solo	-5,3141	2,37 **	-1,0825	0,79	0,2122	1,57	0,0704	0,67
Familia monoparental	-2,3272	2,77	-0,6152	0,81	-2,4155	1,62	-1,2111	0,95
Otro tipo de familia (no pareja)	-3,9911	2,88	-1,4627	0,99	-1,8457	1,30	0,2156	0,54
Edad Sustentador Principal (SP)	0,2215	0,24	0,0295	0,07	0,0224	0,14	-0,0566	0,09
Edad SP al cuadrado	-0,0019	0,00	-0,0004	0,00	-0,0005	0,00	0,0004	0,00
SP mujer	-0,2707	1,85	-0,3357	0,47	-1,1889	1,06	-0,3013	0,51
SP estudios universitarios	-11,9288	8,52	-2,2365	1,53	-0,9175	1,49	-0,1800	0,84
SP estudios secundarios	-7,5625	3,65 **	-2,4191	1,16 **	-1,8981	1,05 *	-0,6121	0,56
SP contrato temporal	6,2260	3,45 *	3,5844	1,48 **	2,7182	1,80	0,6971	0,79
SP empleado/a por cuenta propia	-12,0065	9,67	1,4427	0,62 **	2,7391	1,46 *	1,2680	0,79 *
SP desempleado/a	1,6352	4,17	2,4610	1,04 **	-0,1976	1,83	-0,9032	1,16
SP jubilado/a o inactivo/a	1,0529	4,66	2,7422	1,36 **	2,8458	2,57	1,1573	1,10

Nota: Significatividad: * p <0,10, ** p < 0,05. El individuo de referencia es un individuo no pobre. Las características de referencia son un individuo que vive en pareja en un hogar sin niños donde el sustentador principal es un hombre con estudios primarios y un nivel de cualificación bajo y es empleado por cuenta ajena con un contrato indefinido, no siendo inmigrante ni enfermo crónico. Los errores estándar de la regresión han sido ajustados permitiendo la correlación de las observaciones entre miembros de un mismo hogar. Por tanto las observaciones son independientes entre hogares pero no entre individuos ya que la situación de pobreza se define a nivel de hogar.

Fuente: Elaboración propia.

Cuadro 4: Determinantes de la probabilidad de ser pobre crónico, transitorio y recurrente o transitorio y no recurrente (continuación)

	Pobreza crónica				Pobreza transitoria y recurrente			
Individuos	Episodios		Componentes		Episodios		Componentes	
	Coeficiente	Error Estándar	Coeficiente	Error Estándar	Coeficiente	Error Estándar	Coeficiente	Error Estándar
SP enfermo/a crónico/a	-0,4495	1,56	-0,0392	0,39	0,0891	0,88	-0,1066	0,45
SP ocupación cualificación alta	-0,1934	4,05	-2,0822	1,13 *	-4,2610	1,89 **	-1,5946	1,20
SP ocupación cualificación media	-3,6515	2,76	-0,7127	0,65	-2,1043	1,23 *	-0,8699	0,77
SP inmigrante	5,1002	5,11	1,1812	2,30	2,0834	3,91	1,9233	2,46
% miembros con rentas salariales	-29,7534	17,73 *	-4,6121	2,25 **	-1,8326	2,29	-0,6024	0,96
% miembros con prest, desempleo	6,4975	5,76	0,9332	1,56	2,8643	3,11	0,7826	1,41
% miembros con pensiones	-0,4597	2,21	-1,8130	1,02 *	-5,2510	4,37	-3,1440	2,24
% miembros activos contrato temporal	-15,4746	11,98	-3,6422	2,01 *	-0,0018	2,52	0,7843	1,52
% miembros activos desempleados	-2,9737	3,70	1,3046	1,16	3,3987	2,65	2,5787	1,74
Constante	-16,1750	12,02	-2,0817	2,48	-2,9440	4,34	0,5335	2,16
Log-verosimilitud	-8.320,90		-9.064,03		-8.320,90		-9.064,03	
Test de log-verosimilitud IIA ($\lambda_1 = 1$)	Chi2(1) = 49.45, Probabilidad > Chi2(1) = 0,000							
Número de individuos	9.502		9.502		9.502		9.502	

Nota: Significatividad: * p <0.10, ** p < 0.05. El individuo de referencia es un individuo no pobre. Las características de referencia son un individuo que vive en pareja en un hogar sin niños donde el sustentador principal es un hombre con estudios primarios y un nivel de cualificación bajo y es empleado por cuenta ajena con un contrato indefinido, no siendo inmigrante ni enfermo crónico. Los errores estándar de la regresión han sido ajustados permitiendo la correlación de las observaciones entre miembros de un mismo hogar. Por tanto las observaciones son independientes entre hogares pero no entre individuos ya que la situación de pobreza se define a nivel de hogar.

Fuente: Elaboración propia.

ciados de acuerdo con el enfoque de los episodios. Las características asociadas en mayor medida con la pobreza crónica (frente a la transitoria no recurrente) son: que el hogar tenga un bajo porcentaje de miembros que perciben rentas salariales, la temporalidad del contrato del sustentador principal, o el hecho de que éste no haya alcanzado un nivel de estudios medio. Por otro lado, los hogares conformados por un adulto tienen una menor probabilidad de experimentar pobreza crónica. En cambio, la pobreza transitoria de tipo recurrente será más probable en hogares con menores y donde el sustentador principal no haya alcanzado los estudios secundarios, sea empleado por cuenta propia o trabaje en ocupaciones de baja cualificación.

En el caso del enfoque de los componentes, el perfil de pobreza varía respecto del otro enfoque. En particular, se observa que cualquier situación laboral del sustentador principal que no sea la de un ocupado con contrato fijo, es decir empleado por cuenta propia, jubilado, desempleado o contratado temporal, incrementa la probabilidad de ser pobre crónico, lo mismo que un bajo porcentaje de perceptores de ingresos de cualquier naturaleza (sean salariales, incluidas las procedentes de contratos temporales, o de pensiones). En contraste, el perfil de pobreza transitoria de tipo recurrente parece no diferir mucho de la de tipo no recurrente, salvo por la mayor probabilidad de recurrencia en el caso de hogares con niños y sustentadores principales empleados por cuenta propia.

Es decir, el método de los componentes establece dos grandes perfiles de pobreza dinámica, la pobreza crónica por un lado, conformada por lo hogares con menor dotación de capital humano y peor inserción laboral, y la transitoria por el otro, siendo la presencia de niños y el trabajo por cuenta propia del sustentador las únicas variable relevantes que diferencian dentro de ésta a aquéllos de tipo recurrente. En cambio, con el enfoque de los episodios de pobreza, la baja cualificación y la mala inserción laboral determinan una mayor probabilidad de pertenecer tanto al colectivo de pobres crónicos como al de los transitorios y recurrentes respecto a pertenecer al grupo de los pobres transitorios y no recurrentes. Cuando analizamos únicamente a los pobres transitorios el empleo por cuenta propia o la presencia de niños en el hogar son las variables que más promueven la recurrencia.

El motivo de esta discrepancia entre ambos enfoques radica probablemente en el hecho de que el criterio de pobreza crónica empleando el método de los componentes abarca a todos los pobres crónicos identificados con el enfoque de los episodios de pobreza así como a una parte importante de los pobres transitorios, especialmente recurrentes, que pasan mayor tiempo en la pobreza. Por ello los pobres transitorios que quedan, recurrentes o no, tienen perfiles muy similares entre sí. En cambio en el enfoque de los episodios de pobreza, hay mayor parecido entre el perfil de los pobres crónicos y el de buena parte de los recurrentes, con las salvedades mencionadas. Cabe destacar también, sin embargo, algunas similitudes de ambos enfoques. En ambos casos, por ejemplo, el bajo nivel de estudios y la escasez de perceptores de rentas salariales en el hogar están asociados a la cronicidad en la pobreza. Es interesante también resaltar que la temporalidad en el contrato del sustentador principal también está ligada en ambos enfoques con la cronicidad en la pobreza pero no con la recurrencia. Las variables relacionadas con una mayor probabilidad de recurrencia en ambos enfoques son la presencia de niños en el hogar, quizás consecuencia de las dificultades de conciliación de vida familiar y laboral, y el empleo por cuenta propia del sustentador principal, que como es de esperar conlleva una mayor inestabilidad de ingresos.

Conclusiones

En este trabajo se ofrece un análisis de los distintos perfiles de la pobreza en España en función del tiempo de permanencia de los individuos en la misma, diferenciando entre pobres crónicos y pobres transitorios, y dentro de estos últimos entre recurrentes y no recurrentes. Para ello se han utilizado dos metodologías alternativas para definir la pobreza crónica que permiten identificar vertientes complementarias relativas tanto a la medición, como a la caracterización de la pobreza dinámica en nuestro país.

Los resultados muestran que países como Portugal, España y Reino Unido (con elevados niveles de incidencia de la pobreza anual) presentan, asimismo, reducidos porcentajes de individuos pobres durante un único periodo, con relación a sus respectivas poblaciones pobres. Así, por ejemplo, en España este colectivo apenas alcanza un 30 por ciento, mientras que en Dinamarca o Alemania más del 40 por ciento de sus ciudadanos pobres lo han sido exclusivamente durante un año de los 7 de estudio. Por otro lado, este trabajo también ha mostrado que la pobreza en España exhibe dos características importantes que hacen que el perfil temporal de la misma se desmarque del resto de países. En primer lugar, presenta un reducido porcentaje de individuos en pobreza crónica, en relación a su población pobre, sólo superado a la baja por el caso danés. Esto, unido a su elevada incidencia, hace que su posición relativa en términos de pobreza crónica se sitúe en un nivel intermedio respecto a los países incluidos en este estudio. Y en segundo lugar, e independientemente del criterio de identificación utilizado para definir la pobreza crónica, España exhibe un elevado nivel de recurrencia de la pobreza, que resulta ser incluso más alto en el caso de los hogares con sustentador principal menor de 65 años.

En cuanto a la identificación de los rasgos de la pobreza transitoria y recurrente en España, ambos criterios coinciden en que esta pobreza afecta en mayor medida a hogares con sustentador principal menor de 65 años, mientras que la pobreza crónica afecta a los de mayor edad. Las variables de educación e inserción laboral de los hogares aparecen como los principales determinantes de las distintas tipologías de pobreza. Hogares con un bajo nivel de cualificación y con dificultades de inserción en el mercado de trabajo (menor número de perceptores de ingresos, ocupaciones de peor cualificación) tienen una mayor probabilidad de ser pobres recurrentes (según el enfoque de los episodios de pobreza) o crónicos (según ambos enfoques). Además, el empleo por cuenta propia, debido a su elevada inestabilidad en los ingresos, y la presencia de menores en el hogar aparecen unidos en ambos enfoques a una mayor probabilidad de recurrencia en la pobreza.

Anexo

La base de datos utilizada en este estudio para analizar la dinámica de la pobreza es la información referente a España, Reino Unido, Alemania, Dinamarca, Portugal y Francia del Panel de Hogares de la Unión Europea (PHOGUE) para el periodo 1994-2001. Esta base de datos fue elaborada por Eurostat para obtener estadísticas comparables de la población europea referentes al mercado de trabajo, rentas, calidad de vida, educación, nivel de satisfacción, salud e inmigración, entre

otros. El panel recaba información individual sobre edad, sexo, nivel educativo, renta y situación laboral, junto con información relativa a la composición de los hogares. Como ocurre con la mayoría de este tipo de encuestas, en el diseño muestral del PHOGUE no se incluye a importantes colectivos de especial relevancia en el estudio de la pobreza (como son las personas que carecen de vivienda o que habitualmente residen en viviendas no recogidas en la encuesta, como las cárceles, las pensiones o los centros de acogida). De esta forma, y como principal desventaja, esta base de datos no será capaz de captar la situación de algunos de los estratos más marginados de la población, por lo que los resultados obtenidos deben interpretarse con la cautela necesaria. Como ventaja fundamental, sin embargo, debemos reseñar la riqueza y la homogeneidad de la información incorporada, lo que hace de esta encuesta un elemento básico en el estudio comparado de la realidad socioeconómica de las poblaciones residentes en los países de la UE.

El panel es anual y tiene una estructura longitudinal que permite seguir la información de un mismo individuo a lo largo de ocho años siempre que no abandone la encuesta antes de terminar su periodo de colaboración. La mayoría de las variables del panel describen la situación del individuo y de su hogar en el momento de la entrevista (desde 1994 a 2001). En todo caso, la información completa de la renta anual percibida por el individuo y procedente de diferentes fuentes se refiere a la obtenida durante todo el año anterior al momento de la entrevista. Así, en la construcción de la variable de renta familiar relevante para determinar la situación de pobreza del individuo resulta fundamental, desde nuestro punto de vista, ajustar los datos para que la información de las características del individuo y el hogar correspondan al mismo periodo de tiempo en el que se recibieron las rentas. La importancia de esta consideración ha sido ya apuntada por varios autores como Atkinson *et al.* (2002), Cantillon *et al.* (2003) y, más recientemente, Debels y Vandecasteele (2008). Los problemas de no realizar este ajuste son importantes y, además, se incrementan cuando se pretenden relacionar los cambios en el ingreso anual del hogar (y por tanto también las salidas o entradas en la pobreza) con los cambios demográficos o laborales de los miembros del mismo.

Nuestra opción en este trabajo es construir una renta contemporánea similar a una de las que proponen estos últimos autores, y que denominan *"lagged income method"*. En particular, el objetivo es asociar las características del individuo y el hogar declaradas en el momento t con las rentas declaradas en el momento $t+1$, ya que son las que se corresponden contemporáneamente. Esto implica que, inevitablemente, perdemos una ola completa de información (rentas del año 1993, declaradas en 1994, y características de 2001 declaradas ese mismo año) por lo que trabajaremos con siete años en lugar de con los ocho que, inicialmente, ofrece la base de datos.

Siguiendo este enfoque, definimos la renta equivalente del hogar h en el momento t como Y_t^h, que resulta de dividir la renta contemporánea anual del hogar en ese momento del tiempo (cuya información se obtiene en $t+1$) por la escala de equivalencia correspondiente E_t^h (en nuestro caso utilizaremos la denominada escala de la OCDE modificada). Analíticamente,

$$Y_t^h = \frac{Y_{t+1}^h}{E_t^h}$$

Como señalan Debels y Vandecasteele (2008), este tipo de ajuste presenta algunos problemas en los hogares cuyos individuos perceptores de rentas cambian entre *t* y *t+1* ya que, por ejemplo, si un individuo perceptor de rentas abandona o llega al hogar entre los dos momentos del tiempo, las rentas totales del hogar en el segundo momento ya no reflejan adecuadamente las que realmente tuvo en el primero. Nuestra estrategia para intentar solucionar este problema es aprovechar toda la información disponible en la base de datos para ajustar los cambios de composición del hogar. Así, cuando los individuos perceptores de rentas cambian de hogar podemos aprovechar la información identificativa del mismo para sumar y restar sus rentas correspondientemente. Por lo tanto, si un individuo cambia de hogar entre *t* y *t+1* sumamos su renta en *t+1* al hogar del que proviene y se la restamos al hogar al que llega. Si lo que sucede es que el individuo aparece por primera vez en el panel en *t+1* lo que hacemos es simplemente lo segundo. Lamentablemente, para el caso de individuos que abandonan el panel definitivamente entre dos momentos del tiempo (si fallecen, por ejemplo), aunque el ajuste temporal de rentas y escala de equivalencia es el adecuado, no podemos tenerlos en cuenta como individuos que contribuyan a la muestra del año *t*. La combinación de este efecto junto con el habitual del abandono de la muestra de los hogares en el panel (denominado habitualmente "*attrition"*), hacen que nuestras muestras anuales para un panel contemporáneo respecto del panel original se reduzcan aproximadamente entre un 10 y un 15 por ciento, dependiendo de la ola que consideremos (véase Cuadro A2 del Anexo). De todos modos, en nuestro análisis empírico utilizamos los pesos longitudinales que proporciona la oficina estadística europea para intentar corregir por el efecto que pudieran tener las diferencias en tasas de abandono de la muestra según las características del hogar.

Cuadro A1: MUESTRA PANEL PARA ESPAÑA, PHOGUE (1994-2001)

	1994	1995	1996	1997	1998	1999	2000	2001
Número de Hogares								
Hogares, muestra inicial	7.206	6.522	6.267	5.794	5.485	5.418	5.132	4.966
Hogares, todos los miembros y entrevista completa	7.206	6.518	6.224	5.771	5.473	5.347	5.132	4.966
Hogares, todos los miembros entrevista completa e información de renta año anterior	7.142	6.448	6.125	5.709	5.430	5.289	5.040	4.941
Porcentaje de hogares eliminados	0,90	1,15	2,32	1,49	1,01	2,44	1,83	0,51
Número de Individuos								
Todos los individuos, muestra inicial	23.025	20.708	19.712	18.167	16.728	16.222	15.048	14.320
Adultos, muestra inicial	18.428	16.727	16.110	15.149	14.044	13.654	12.731	12.169
Menores, muestra inicial	4.597	3.981	3.602	3.018	2.684	2.568	2.317	2.151
Menores nacidos en el panel	—	142	142	151	133	153	156	127
Número de individuos, completo								
Todos los individuos, entrevista completa	22.486	20.243	19.230	17.846	16.479	15.643	14.613	14.131
Adultos, entrevista completa	17.893	16.263	15.640	14.819	13.779	13.104	12.317	11.964
Menores, en hogares con todos los individuos entrevista completa (recién nacidos incluidos)	4.593	3.980	3.590	3.027	2.700	2.539	2.296	2.167
Porcentaje de individuos eliminados	2,34	2,25	2,45	1,77	1,49	3,57	2,89	1,32
Número de individuos, completo + datos renta hogar (con entrevista completa + información renta hogar)								
Todos los individuos	22.305	20.092	19.025	17.679	16.391	15.601	14.588	14.109
Adultos	17.756	16.154	15.500	14.702	13.722	13.078	12.302	11.949
Menores	4.549	3.937	3.525	2.977	2.669	2.523	2.286	2.160
Porcentaje de individuos eliminados	0,80	0,75	1,07	0,94	0,53	0,27	0,17	0,16
Porcentaje de adultos eliminados	0,77	0,67	0,90	0,79	0,41	0,20	0,12	0,13
Porcentaje de menores eliminados	0,96	1,08	1,81	1,65	1,15	0,63	0,44	0,32

Fuente: Elaboración propia utilizando el PHOGUE (1994-2001).

Cuadro A2: Muestra Panel Final para España. PHOGUE (1994-2001) utilizando información contemporánea de los ingresos del hogar y sus características sociodemográficas

	1993/ 1994	1994/ 1995	1995/ 1996	1996/ 1997	1997/ 1998	1998/ 1999	1999/ 2000	2000/ 2001
Número de Individuos, completo + datos renta hogar (con entrevista completa + información renta anual hogar)								
Todos los individuos	22.305	20.092	19.025	17.679	16.391	15.601	14.588	14.109
Adultos	17.756	16.154	15.500	14.702	13.722	13.078	12.302	11.949
Menores	4.549	3.937	3.525	2.977	2.669	2.523	2.286	2.160
	Años de observación del ingreso y las características de forma contemporánea							
	1994	1995	1996	1997	1998	1999	2000	
MUESTRA FINAL (contemporánea)								
Número de Individuos, completo + datos renta hogar (con entrevista completa + información renta anual hogar)								
Todos los individuos	19.044	17.754	16.496	15.402	14.519	13.740	13.251	
Adultos	15.042	14.216	13.374	12.800	12.088	11.489	11.147	
Menores	4.002	3.538	3.122	2.602	2.431	2.251	2.104	
Porcentaje de individuos eliminados	14,62	11,64	13,29	12,88	11,42	11,93	9,17	
Porcentaje de adultos eliminados	15,28	12,00	13,72	12,94	11,91	12,15	9,39	
Porcentaje de menores eliminados	12,02	10,13	11,43	12,60	8,92	10,78	7,96	

Fuente: Elaboración propia utilizando el PHOGUE (1994-2001).

REFERENCIAS BIBLIOGRÁFICAS

Amuedo-Dorantes, C. y Serrano-Padial, R. (2010): "Labour market flexibility and poverty dynamics", *Labour Economics*, vol. 17, Issue 4, August 2010, págs. 632-642.

Atkinson, T., Cantillon, B., Marlier, E. and Nolan, B. (2002): *Social Indicators: The EU and Social Inclusion*, Oxford University Press, Oxford.

Ayala L. y Sastre M. (2004): "Europe vs. the United States: Is there a trade-off between mobility and inequality?", *Journal of Income Distribution*, vol. 13, págs. 56-75.

Ayala, L. y Sastre, M. (2007): "Familia, infancia y pobreza", en *Familia y Economía*, capítulo 3, págs. 119-169.

Ayala, L. y Sastre, M. (2008): "The structure of income mobility: Empirical evidence from five UE countries", *Empirical Economics*, 35, págs. 451-473,

Arranz, J.M. y Cantó, O. (2010): "Measuring the effect of spell recurrence on poverty dynamics", UNU-WIDER Working paper number 2010/72.

Ayllón, S. (2008): "Modelling Poverty transitions in Spain: Do attrition and initial conditions really matter?", Paper presented at the UNU-WIDER Conference on *"Frontiers of Poverty Analysis"*, Helsinki, September 2008.

Azpitarte, F. (2008): "Measurement and Identification of Asset-Poor Households: A Cross-National Comparison of Spain and the United Kingdom", ECINEQ Working Papers Series WP 2008-105.

Bane, M.J. y Ellwood, D.T. (1986): "Slipping into and out of poverty: the dynamics of spells", *Journal of Human Resources,* vol. 21(1), págs. 1-23.

Bárcena, E. y Cowell, F.A. (2006): "Static and Dynamic Poverty in Spain, 1993-2000", *Hacienda Pública Española / Revista de Economía Pública*, vol. 179, págs. 51-78.

Bossert, W., Chackravarty, S. y D'Ambrosio, C. (2010): "Poverty and Time", UNU-WIDER Working paper number 2010/74.

Cantillon, B., Van Dam, R., Van den Bosch, K. y Van Hoorebeeck, B. (2003): "The Impact of the Reference Period on Measures of Household Income from Surveys", *Berichten*, 27.

Cantó, O. (2000): "Income mobility in Spain: How much is there?", *Review of Income and Wealth*, vol. 46 (1), págs. 85-102.

Cantó, O. (2002): "Climbing out of poverty, Falling back in: Low incomes' stability in Spain", *Applied Economics*, vol. 34, págs. 1903-1916.

Cantó, O. (2003): "Finding out the routes to escape poverty: the relevance of demographic vs. labour market events in Spain", *Review of Income and Wealth*, vol. 49 (4), págs. 569-589.

Cantó, O., Gradín, C. y Del Río, C. (2006): "Poverty statics and dynamics: Does the accounting period matter?", *International Journal of Social Welfare***,** vol. 15 (3), págs. 209-218.

Cutanda, A. (2003): "An empirical investigation of the effect of borrowing constraints on Spanish consumption", *Spanish Economic Review*, vol. 5, págs. 63-84.

Debels, A. y Vandecasteele, L. (2008): "The time lag in annual household-based income measures: Assessing and correcting the bias", *Review of Income and Wealth*, vol. 54 (1), págs.71-88.

Duncan, G.J. y Rodgers, W. (1991): "Has Children's Poverty Become More Persistent?", *American Sociological Review*, vol. 56, págs. 538-550.

Foster, J. (2009): "A class of chronic poverty measures", en *Poverty Dynamics: Interdisciplinary Perspectives*, Addison, T., Hulme, D. y Kanbur, R. (eds.), Chapter 3, Oxford University Press, Oxford.

Gardiner, K. y Hills, J. (1999): "Policy implications of new data on income mobility", *The Economic Journal*, vol. 109, págs. F91-F111.

Gradín, C., Cantó, O. y Del Río, C. (2008): "Inequality, poverty and mobility: Choosing income or consumption as a welfare indicator", *Investigaciones Económicas*, vol. XXXII (2), págs. 169-200.

Gradín, C., Del Río, C. y Cantó, O. (2010): "Measuring poverty accounting for time", Documento de Traballo, Departamento de Economía Aplicada, DT 1005, Universidade de Vigo.

Hensher, D.A., Rose, J.M. y Greene, W.H. (2005): *Applied Choice Analysis: A Primer*, Cambridge University Press, New York.

Jalan, J. y Ravallion, M. (1998): "Transient Poverty in Post-reform Rural China", *Journal of Comparative Economics*, vol. 26, págs. 338-357.

Jappelli, T. (1990): "Who is credit constrained in the U.S. Economy?", *Quarterly Journal of Economics*, vol. 105, págs. 219-234.

Jarvis, S. y Jenkins, S.P. (1997): "Low income dynamics in 1990s Britain", *Fiscal Studies*, vol. 18 (2), págs. 1-20.

Kempson, E. (1996): *Life on a Low Income*, Joseph Rowntree Foundation, York.

Maddala, G.S. (1993): *Limited dependent and qualitative variables in econometrics*, Econometric Society Monographs, number 3, Cambridge University Press, New York.

OCDE (2001): Employment Outlook, June, Chapter 2: When money is tight: poverty dynamics in OECD countries, OECD, Paris.

Ravallion, M. (1988): "Expected poverty under risk-induced welfare variability", *Economic Journal*, vol. 98, págs. 1171-1182.

Rodgers, J.R. y Rodgers, J.L. (1993): "Chronic Poverty in the United States", *Journal of Human Resources*, vol. 18, págs. 25-54.

Slesnick, D. (2001): *Consumption and Social Welfare*, Cambridge University Press, New York.

Fecha de recepción del original: febrero, 2009
Versión final: marzo, 2010

ABSTRACT

This paper aims to measure the relative importance of chronic versus transitory poverty in Spain by identifying groups of individuals with different poverty patterns over time. Results indicate that poverty in Spain has two important characteristics: a small group of individuals is persistently poor while those in transitory poverty experience a high probability of recurrence. Thus, in the case of Spain, in contrast with other European Union countries, it is particularly relevant to make a further distinction within the transitory poor: those with recurrent poverty spells versus those that experience "once in a lifetime" poverty. Chronic poverty has a stronger effect on households whose head is over 65 or has a low level of education, and whose members are less likely to be wage earners. Transitory and recurrent poverty is linked to the self-employment of the head and to the presence of children in the household.

Key words: poverty duration, chronicity, recurrence.

JEL classification: D1, D31, I32.