



La evolución de la pobreza estática y dinámica en España en el período 1985-1995 *

OLGA CANTÓ
CORAL DEL RÍO
CARLOS GRADÍN
Universidad de Vigo

Recibido: Agosto, 2002
Aceptado: Septiembre, 2003

Resumen

El objetivo de este trabajo es analizar la evolución de la pobreza económica en España, tanto desde una perspectiva estática como dinámica, entre mediados de los años ochenta y mediados de los noventa, período todavía no suficientemente abordado en la literatura. Se muestra cómo tras un fuerte impulso inicial de reducción de la pobreza, éste se agota y revierte en los últimos años. El análisis dinámico permite comprobar en qué medida se producen variaciones en los flujos de entrada y salida de la pobreza a lo largo del período, así como cuál fue la intensidad de los mismos.

Palabras Clave: distribución de la renta, pobreza estática, pobreza dinámica, España.

Clasificación JEL: D1, D31, I32.

1. Introducción

Desde finales de los años ochenta se ha avanzado mucho en el estudio de la pobreza en España gracias a la creciente disponibilidad de datos microeconómicos de calidad. Si exceptuamos los estudios impulsados por la Fundación FOESSA, que elaboró sus propias encuestas, la mayoría de los analistas pudieron describir la evolución de la pobreza a largo plazo mediante el empleo de las Encuestas de Presupuestos Familiares (EPF) elaboradas por el INE. Esto permitió conocer qué había sucedido con la pobreza en España en los grandes intervalos de tiempo comprendidos entre las fechas de su realización: 1973-74, 1980-81 y 1990-91. Sin embargo, al carecer de una serie larga de encuestas de periodicidad anual, habi-

* Los autores agradecen las sugerencias realizadas por un evaluador anónimo, lo que ha permitido mejorar sensiblemente el texto original, así como la financiación del Instituto de Estudios Fiscales a través del proyecto «Nuevos enfoques en el análisis de la pobreza: de la estática a la dinámica». Olga Cantó agradece además la financiación del Ministerio de Ciencia y Tecnología - Programa Nacional de Promoción General del Conocimiento - Proyecto BEC2000-415.

tual en otras latitudes, fue imposible conocer en qué medida una disminución de la tasa de pobreza a lo largo de una década reflejaba cambios sistemáticos en esa dirección o, por el contrario, era el resultado neto de diferentes períodos de reducciones e incrementos que se sucedían temporalmente.

La aparición del Panel Europeo a mediados de los años noventa podría solventar este problema, al menos durante los nueve años que esté vigente ¹. No obstante, ello deja todavía abierta la cuestión de si es posible arrojar algo de luz sobre los años previos y describir de forma más completa los episodios en los que la pobreza experimentó importantes cambios en nuestro país. En este sentido, las Encuestas Continuas de Presupuestos Familiares (ECPF) que abarcan el período comprendido entre mediados de los años ochenta y mediados de los noventa pueden ser de gran ayuda ². Su utilidad radica en que permiten abordar análisis que combinan tanto enfoques estáticos como dinámicos. Curiosamente, sin embargo, dichas encuestas no han sido suficientemente aprovechadas en cuanto a su contribución al análisis de la pobreza ³. Sus primeros años fueron explotados a principios de los noventa por diversos autores [Escribano (1990), EUROSTAT (1992) y O'Higgins y Jenkins (1990)], y posteriormente constituyeron la base de algunos de los resultados obtenidos por Pena (1996) e Imedio, Parrado y Sarrión (1997). Más recientemente, la información correspondiente a los años 1990 y 1995 fue utilizada, junto a diferentes bases de datos contenidas en el Luxembourg Income Study (LIS) ⁴, en la comparación internacional realizada sobre diez países de la OCDE por Martínez, Ruiz-Huerta y Ayala (1998).

En este trabajo proponemos evaluar los niveles de pobreza en España y su persistencia en el tiempo a partir de la información muestral contenida en esta encuesta, desde 1985 (primer año de elaboración) hasta 1995 (último año del que disponemos de información completa) ⁵. Para ello adoptaremos una doble perspectiva centrada inicialmente en el análisis de la evolución de la pobreza a lo largo del período analizado, para a continuación abordar aspectos típicamente dinámicos gracias a la naturaleza *panel* de esta base de datos. Ambos análisis tienen relevancia en sí mismos y a la vez se complementan a la hora de intentar ofrecer una explicación de un fenómeno tan complejo como éste, donde no sólo es relevante cuantificar su magnitud y evolución a lo largo del tiempo, sino también poder caracterizar los flujos de entrada y salida en la misma protagonizados por los diferentes colectivos directamente implicados. De esta forma, a las vertientes relacionadas con la Incidencia, la Intensidad y la Desigualdad, ya clásicas desde el trabajo de Sen (1976), los estudios más actuales sobre pobreza han incorporado una vertiente adicional, la Duración, que permite integrar en el análisis el componente temporal desde una perspectiva microeconómica, o si se prefiere, individualizada. Así, permiten diferenciar entre pobreza permanente y pobreza transitoria, y caracterizar situaciones de riesgo a través del cálculo de las probabilidades de transición experimentadas por los diferentes tipos de hogares.

A pesar de la relevancia de estas cuestiones, los resultados previos existentes en la literatura para el caso español son todavía más limitados que en el caso estático, dado el

escaso eco que estas cuestiones han tenido hasta el momento en nuestro país. Nuestra contribución en este terreno se centra en el cálculo de las tasas de entrada y salida de la pobreza en diferentes subperíodos de interés identificados en el estudio estático, y en la realización de un exhaustivo análisis de las transiciones de entrada y salida de la pobreza experimentadas por distintos grupos de hogares en función de su nivel de ingresos inicial. Para ello, la situación económica de partida de cada hogar será comparada con la existente cuatro trimestres después, limitándonos a explotar los cambios producidos entre la primera y la quinta entrevista. Evidentemente esto restringe el número de transiciones que vamos a poder identificar en nuestro análisis, al no poder recoger aquéllas que se produzcan con una diferencia temporal de más o menos duración. En ambos casos su exclusión es obligada si queremos obviar la movilidad en la distribución asociada a los altibajos puramente estacionales propios de algunas de las rentas percibidas por los hogares. Se trata, por tanto, de estimaciones conservadoras que no podrán incorporar aquellas transiciones que «verdaderamente» acontezcan en el muy corto plazo, al no poder distinguir las del ruido característico de este tipo de encuestas.

Con todo ello, la estructura de este trabajo se organiza en cinco epígrafes, unas conclusiones y un apéndice. En el segundo epígrafe se comentan los principales resultados alcanzados en la literatura existente en nuestro país, referidos al período considerado. A continuación, y ya en el tercero, se presentan las diferentes decisiones metodológicas adoptadas respecto a la variable de referencia, la unidad de análisis, la línea de pobreza, las escalas de equivalencia, los indicadores utilizados y los problemas estadísticos provocados por las elevadas tasas de abandono de los hogares en las encuestas tipo *panel*. Las estimaciones para el caso español en sus vertientes estática y dinámica se abordan en los epígrafes cuarto y quinto, respectivamente. Por último, una sección que recoge las principales conclusiones y un apéndice técnico, donde se presentan los índices de pobreza y el método de corrección del abandono de la encuesta o *attrition* utilizados, cierran el trabajo.

2. Principales resultados sobre pobreza estática y dinámica en España

A la hora de recopilar los resultados más destacados sobre pobreza económica en nuestro país, los años 1984 y 1987 representan dos momentos especialmente importantes en los inicios de esta literatura. En 1984 el detallado informe de EDIS-Cáritas sobre *Pobreza y Marginación*, estimaba la existencia de alrededor de ocho millones de individuos pobres en España, lo que generó sorpresa y, sin duda, estimuló el interés por la investigación en estos temas. Poco después, en 1987, el servicio de estudios del Banco de España editó un monográfico elaborado por Ruiz-Castillo (1987) en el que se ofrecían los primeros cálculos obtenidos a partir de medidas propuestas en la literatura internacional para cuantificar la desigualdad y la pobreza en España, presentando además las propiedades normativas de cada uno de los índices utilizados.

A partir de ese momento, y coincidiendo con la publicación de la EPF de 1990-91, se multiplicaron los trabajos que comparaban los niveles de pobreza reflejados por las distintas EPF (y, en menor medida, por las ECPF) ⁶. De la lectura de estos estudios se desprende que en España la pobreza relativa descendió significativamente durante la década de los setenta (1973/74-1980/81), aumentando posteriormente durante la crisis económica que abarca desde 1980/81 a 1985. A partir de ese momento, el inicio del período de expansión (1985-1987) supuso nuevamente una reducción en el número de hogares pobres de magnitud lo suficientemente importante como para que podamos afirmar que la década de los ochenta se saldó finalmente con un resultado positivo en términos de la disminución experimentada por los niveles de pobreza relativa ⁷.

En cuanto a la robustez de estos resultados, varios trabajos se han preocupado de contrastar su sensibilidad ante diferentes opciones metodológicas. Así, Duclos y Mercaader-Prats (1999) analizaron los efectos de utilizar diferentes escalas de equivalencia en la EPF de 1980-81. En este mismo sentido, en INE (1996) se realiza un detallado estudio de sensibilidad de sus resultados de pobreza utilizando las tres EPF disponibles. Recientemente, y en un análisis integrado de los efectos del uso de diferentes índices de pobreza, escalas de equivalencia y líneas de pobreza, Del Río y Ruiz-Castillo (1999, 2001) utilizando curvas TIP concluyen que, en el caso de España y para cualquiera de las opciones metodológicas anteriores, tanto la pobreza absoluta como la relativa disminuyeron entre 1973/74, 1980/81 y 1990/91.

Los primeros años noventa, sin embargo, parecen sugerir una ruptura con la tendencia anterior al apreciarse un estancamiento o incluso un ligero repunte en los porcentajes de población pobre al comparar 1990 y 1995, tal y como concluyen Martínez, Ruiz-Huerta y Ayala (1998). Para este período, sin embargo, todavía son necesarios trabajos adicionales que aporten nueva evidencia empírica relacionada con la utilización de índices más complejos que incorporen un mayor número de dimensiones en la medición de la pobreza, y un análisis más exhaustivo de los cambios experimentados a lo largo de ese quinquenio en relación con la década anterior, tal y como proponemos en el cuarto epígrafe.

Todo lo comentado hasta el momento hace referencia a cuestiones de pobreza estática, siendo los resultados relativos a su dinámica todavía escasos y recientes. Los primeros estudios empíricos de tipo longitudinal que conocemos son los de García y Toharia (1998) y Cantó (1996, 1998). En ellos los autores utilizan encuestas longitudinales de hogares a nivel nacional para finales de los ochenta y principios de los noventa (básicamente el Panel de Hogares de la Unión Europea, PHOGUE ⁸, y las ECPF), con el objeto de cuantificar los flujos de entrada y salida de la pobreza. Concretamente, en los dos últimos trabajos se estiman estos flujos para hogares con diferentes características socioeconómicas y sus resultados indican que la probabilidad de salida de la pobreza está altamente correlacionada con el tiempo que el hogar permaneció en ella, siendo el nivel educativo y el tamaño del hogar las características más importantes a la hora de diferenciar entre pobres permanentes y transitorios. Además, se observa que las características laborales del sustentador principal, más que las demográficas del hogar, son la clave de las transicio-

nes hacia dentro y fuera de la pobreza. En la misma línea, García y Toharia (1998) analizan la relación entre la movilidad en la parte baja de la distribución de la renta, el paro y la movilidad laboral. Estos autores nuevamente concluyen que el sexo del sustentador principal, su nivel de estudios y el número de miembros del hogar son las características que determinan fuertemente las probabilidades de transición de los individuos hacia dentro o fuera de la pobreza.

Más recientemente, García-Serrano, Malo y Toharia (2001) y EUROSTAT (2000) presentan resultados sobre pobreza estática y dinámica utilizando el PHOGUE. El primero de estos trabajos concluye que España soportaba en 1996 una tasa de pobreza permanente (pobres los tres años que abarca el estudio, 1994, 1995 y 1996) que se situaba en un 9,8 por 100, mientras que un 75,1 por 100 no era pobre en ninguno de los años, y el resto, un 15,1 por 100, efectuaba transiciones entre la pobreza y la ausencia de pobreza en alguno de los años considerados; lo que refleja un importante grado de movilidad superior a la media europea, situada en un 12,7 por 100⁹. El segundo de estos trabajos obtiene un porcentaje de pobreza permanente algo inferior, pero de una magnitud similar, cercano al 8,2 por 100¹⁰.

Dado que el número de trimestres que un hogar puede permanecer como máximo en las ECPF es sólo ocho (dos años), probablemente no sea muy interesante abordar aquí un exhaustivo análisis de la pobreza permanente por características del hogar, en sintonía con los trabajos anteriores. Sin embargo, podemos enriquecer estos resultados aportando información adicional sobre la movilidad en la cola baja de la distribución mediante el estudio de las transiciones hacia dentro y fuera de la pobreza en función del nivel inicial de renta del hogar, y así comprobar si hay diferencias notables en sus respectivos patrones de movilidad. A esta cuestión dedicaremos el quinto epígrafe.

3. La medición de la pobreza económica: aspectos metodológicos previos

Para el estudio de la pobreza en España emplearemos como variable que recoge las condiciones de vida de los hogares el ingreso monetario¹¹ expresado en pesetas constantes del último trimestre de 1995 y ajustado para tener en cuenta que tratamos con individuos que pertenecen a hogares de diferente tamaño y composición. Este ajuste lo realizamos con diferentes *escalas de equivalencia* alternativas: la denominada escala OCDE¹², y otras tres escalas, siguiendo a Buhmann *et al.* (1988), construidas mediante la parametrización del número de adultos equivalentes del hogar en función de su tamaño elevado a un parámetro, s , al que le asignaremos tres valores distintos: 0,2; 0,5 y 1,0¹³. La decisión de trabajar con diferentes escenarios descansa en el conocido hecho de que la elección de la escala de equivalencia es especialmente importante en el estudio de la pobreza¹⁴.

Por otro lado, la utilización de las ECPF permite elegir la periodicidad de la variable con la que aproximarnos al nivel de vida de los hogares según queramos trabajar con los

datos trimestrales originales de la encuesta o prefiramos anualizarlos, tal y como se ha hecho en estudios distributivos previos ¹⁵. En este trabajo, en lugar de considerar el ingreso *anual* del hogar, lo que requeriría de algún método de imputación ¹⁶, proponemos examinar la evolución temporal de la pobreza utilizando los ingresos trimestrales declarados por los hogares. En el análisis estático, esto significa estudiar por separado cada trimestre y compararlo con el correspondiente de los sucesivos años presentes en la muestra, evitando así los posibles problemas de estacionalidad ¹⁷. En el análisis dinámico, sin embargo, nos veremos obligados a restringir la muestra de hogares original seleccionando sólo a aquéllos que han sido entrevistados al menos cinco trimestres, de forma que podamos comparar su nivel de renta inicial con el disfrutado un año después. Para ello, y con independencia del trimestre y del año concreto en que se haya producido la primera entrevista del hogar, se construirá un *pool* de hogares con los que verifiquen este requisito de permanencia, y sobre ese total se calcularán las tasas de entrada y salida de la pobreza, computadas analizando los primeros doce meses de existencia del hogar en la muestra. Así, estas tasas sólo representan transiciones promedio asociadas al total del período temporal objeto de estudio, no existiendo una correlación perfecta entre la información puntual de niveles de pobreza ofrecida por el análisis estático y la media de comportamientos de entrada y salida que ofrece este análisis dinámico. La razón de hacerlo así es sencilla: garantizar una muestra lo suficientemente amplia que permita una mayor robustez en los resultados obtenidos ante los problemas de abandono de la muestra característicos de estas encuestas. El precio a pagar también debe ser subrayado: perder cierta perspectiva temporal en el análisis al no poder reflejar trimestralmente las transiciones hacia y desde la pobreza que se produzcan.

La *unidad de análisis* elegida en nuestro estudio de sección cruzada será el hogar, cuya renta equivalente será ponderada por el número de individuos que lo componen de manera que los hogares con mayor tamaño tendrán una mayor representación en la muestra. Esto significa que implícitamente estamos trabajando con la distribución del ingreso ajustado por individuo bajo el supuesto de que no se producen desigualdades dentro del hogar. En el estudio longitudinal, nuevamente utilizaremos el hogar como unidad de análisis, aunque en esta ocasión sin ponderar por su tamaño. El motivo es que, tal y como están diseñadas las ECPF, sólo conocemos los cambios experimentados por los hogares a lo largo del tiempo y no la trayectoria de sus miembros tomados aisladamente, de manera que si, por ejemplo, un individuo abandona el hogar al que inicialmente pertenecía, queda automáticamente excluido de la muestra en futuras entrevistas ¹⁸.

Para identificar qué individuos u hogares son pobres en términos relativos emplearemos como *línea de pobreza* el ingreso monetario correspondiente al 60 por 100 del ingreso mediano del período correspondiente. Sin embargo, en los epígrafes en los que analicemos la pobreza absoluta mantendremos constante en las comparaciones el umbral relativo del período inicial.

Una vez definido el umbral crítico, el estudio de la pobreza económica exige abordar cuatro aspectos básicos asociados al concepto mismo de pobreza: la Incidencia (que hace

mención a la proporción de individuos cuyo nivel de renta no alcanza el umbral elegido), la Intensidad (referida a la severidad de la pobreza experimentada por esos individuos, y que se cuantifica a partir de la distancia que en términos de renta los separa del umbral de pobreza), la Desigualdad (presente por las diferencias de renta existentes entre los hogares pobres y que representa una dimensión añadida a la hora de cuantificar la gravedad del fenómeno) y la Duración (que nos permite enriquecer todo lo anterior en función de las diferentes percepciones que experimentamos según las situaciones de escasez de recursos sean transitorias o permanentes).

En relación con las tres primeras vertientes existe una abundante literatura teórica que se ha preocupado de definir índices de pobreza e identificar sus propiedades axiomáticas a la hora de incorporar esta triple perspectiva. Siguiendo esta filosofía, en este trabajo utilizaremos simultáneamente un amplio conjunto de índices a fin de obtener conclusiones lo más robustas posible a la sensibilidad que cada uno de ellos pueda tener a cada una de estas tres vertientes¹⁹. Así, estimaremos los conocidos índices de la familia de Foster, Green y Thorbecke (1984) para valores del parámetro de aversión a la pobreza mayor o igual que 2, como los mejores exponentes que abarcan las tres dimensiones propuestas; aunque también utilizaremos otros más simples como el *Headcount ratio*, el *Income Gap ratio* o el *Poverty Gap ratio*, que sólo tienen en cuenta alguno de los aspectos comentados, con el objeto de comparar los resultados obtenidos.

Estos índices «clásicos», sin embargo, no abordan la vertiente temporal del fenómeno. La explotación de la dimensión dinámica permite, por el contrario, obtener información sobre cuáles han sido las trayectorias experimentadas por los hogares mediante el cálculo de las tasas de entrada y salida en la pobreza y el análisis de las transiciones experimentadas por diferentes grupos de la población según su posición en la distribución de rentas inicial. La importancia de incorporar esta dimensión es notable ya que, si bien es cierto que el enfoque estático resulta útil a la hora de valorar los efectos que las políticas públicas tienen sobre la parte más baja de la distribución de la renta, el análisis dinámico permite distinguir entre los efectos que estas políticas tienen sobre la *protección* de los individuos más vulnerables a caer en la pobreza, de aquellos otros más relacionados con las *ayudas* para salir de ella [tal y como subraya Ravallion (1996)].

3.1. La importancia de las fuentes de datos longitudinales: las muestras procedentes de las ECPF

A pesar de las ventajas de abordar una perspectiva dinámica en el estudio de la pobreza, tradicionalmente los trabajos empíricos se han concentrado en los aspectos estáticos debido a la escasez de fuentes estadísticas longitudinales. Este tipo de encuestas son imprescindibles a la hora de aplicar estas técnicas ya que, como pone de manifiesto Kiefer (1988), para estudiar procesos con un componente de duración el uso de datos estáticos provoca sesgos en los resultados obtenidos. Estos sesgos provienen de que en las fuentes estadísticas de sección cruzada los hogares con largos períodos de tiempo en situación de pobreza tienen una mayor probabilidad de ser seleccionados en la muestra que

aquéllos que experimentan períodos de corta duración o intermitentes. En Bane y Ellwood (1986) los autores ponen un ejemplo con el que ilustran la necesidad de contar con *datos de panel* a la hora de abordar el estudio de fenómenos que se caracterizan por su naturaleza temporal: «*Si nosotros deseásemos describir el tipo de pacientes que ingresan en un determinado hospital y diferenciar entre pacientes con enfermedades de corta duración y aquéllos con enfermedades crónicas o de larga duración, lo más indicado no sería que visitásemos el hospital un día cualquiera y contásemos qué cantidad de pacientes de cada tipo encontramos. Claramente, con este método obtendríamos un porcentaje mucho más elevado de pacientes crónicos de los que realmente hay en la población de pacientes, mientras que los pacientes con enfermedades de corta duración estarían subrepresentados en nuestro estudio. Para evitar este sesgo temporal necesitamos utilizar datos longitudinales*». Como consecuencia, los estudios realizados sobre la pobreza estática se centran en individuos u hogares con largos períodos de baja renta y no reflejan suficientemente incluyen a los individuos u hogares que durante el período considerado cayeron en la pobreza.

Países como Estados Unidos, gracias especialmente al ya clásico Panel Survey of Income Dynamics (PSID), el Reino Unido con el British Household Panel Survey (BHPS) o Alemania con el German Socioeconomic Panel (GSOEP), abordaron hace ya tiempo la transformación de sus sistemas de estadísticas oficiales para incorporar información longitudinal de renta de los hogares, obteniendo como resultado un elevado número de estudios que se ocupan de aspectos dinámicos de la pobreza y desigualdad. Así, el análisis dinámico de la pobreza inició su desarrollo en EEUU tras la aparición en 1968 del PSID²⁰. Posteriormente, durante los años ochenta, algunos países europeos pusieron en marcha encuestas longitudinales fiables que dieron lugar a los primeros trabajos realizados con datos europeos²¹. Por desgracia, como hemos visto, en España apenas se pueden citar unos pocos trabajos empíricos a partir de la información contenida en las dos únicas fuentes longitudinales existentes: las ECPF y el PHOGUE.

Siendo precisos, las ECPF constituyen un panel rotatorio integrado por unas 3.200 entrevistas a hogares que se repiten trimestralmente, donde un 1/8 de la muestra es sustituido en cada ola y donde el período máximo de permanencia de los hogares en la misma es de dos años. Al igual que las EPF, las ECPF proporcionan información relativa a diferentes fuentes de ingreso del hogar y a un amplio abanico de características demográficas y socioeconómicas del mismo y de sus integrantes.

Una clara ventaja de los paneles subanuales sobre otros paneles que recogen información de los hogares cada año es que se espera que los primeros incurran en menores errores en la medición del ingreso del hogar. Por ejemplo, la calidad de la información del ingreso construida a través de la suma de ingresos trimestrales será mayor que aquella obtenida a través de la pregunta sobre información retrospectiva realizada al hogar al final del año de referencia. En ese sentido, utilizar un panel trimestral con una muestra de hogares que han respondido, al menos, un determinado número de entrevistas, aseguraría una medición más exacta de los verdaderos flujos de ingresos de los hogares. Otra venta-

ja a señalar de los paneles subanuales es que proporcionan información demográfica y socioeconómica de los hogares en períodos cortos de tiempo. Esto ayuda a identificar de forma más precisa en qué momento del tiempo tienen lugar determinados sucesos demográficos o socioeconómicos, lo que permite obtener estimaciones del ingreso equivalente del hogar más exactas. En este sentido, este tipo de paneles es especialmente útil en el análisis de la pobreza dinámica porque aumenta la correlación entre estos sucesos y los cambios en los ingresos del hogar.

3.2. El problema del abandono de la muestra

En cualquier caso, una limitación importante de los paneles con estructura subanual es que los hogares abandonan la muestra con una mayor frecuencia, dado el cansancio que les produce responder a entrevistas varias veces al año, por lo que sus tasas de abandono son más elevadas que las de los paneles anuales. Así, por ejemplo, en las ECPF aproximadamente un 35 por 100 de los hogares abandonaron el panel antes de un año, y un 72 por 100 lo abandonan antes de los dos años de permanencia máxima. Es evidente que, en este contexto, es necesario elaborar unos pesos que tengan en cuenta el sesgo que genera en los resultados el que el abandono de los hogares no se produzca aleatoriamente, o lo que es lo mismo, que éste dependa de características del individuo o de sucesos que tengan lugar en su vida (traslado de residencia, divorcio, fallecimiento, etc.)²². De hecho, la literatura reciente subraya que el abandono no aleatorio de las observaciones de las encuestas longitudinales es un problema potencialmente serio en la explotación de estas encuestas [como apuntan Bradbury, Jenkins y Micklewright (2001) y Luttmmer (2001)]. A pesar de todo, sin embargo, en la mayoría de los trabajos aplicados este sesgo no ha sido corregido.

En nuestro caso, las estimaciones de pobreza dinámica se han obtenido a partir de la utilización de unos pesos longitudinales que sí tienen en cuenta el posible sesgo provocado por el abandono no aleatorio de la encuesta. El procedimiento utilizado para obtener los pesos relevantes consiste en una regresión probit de la probabilidad de mantenerse en el panel durante cinco entrevistas, explicada por las características del hogar (edad, nivel educativo, estado civil, sexo y situación laboral del sustentador principal, así como por el número de miembros del hogar y el tamaño del municipio de residencia). Como era de esperar, encontramos que los hogares con mejor posición económica, que residen en áreas urbanas y cuyo sustentador principal es joven y posee un alto nivel educativo, tienen mayores probabilidades de abandonar el panel en cualquier entrevista. Los pesos se construyen, a partir de esta información, prediciendo la inversa de la probabilidad de «mantenerse en la encuesta panel». Esta estrategia de construcción de pesos por abandono es una de las opciones que proponen Kalton y Brick (2000), donde además se muestra que los pesos así obtenidos presentan valores muy similares a los de otras metodologías existentes en la literatura. En nuestro caso, además, estos pesos por abandono se combinan con los pesos de representatividad de la muestra que nos ofrece el Instituto Nacional de Estadística (INE) para las ECPF, de forma que el sistema de pesos utilizado tiene en

cuenta, simultáneamente, la probabilidad de que un hogar sea seleccionado de la población española para ser parte de la muestra de las ECPF, y la probabilidad de que ese hogar responda al menos cinco veces a las entrevistas ²³.

De esta forma, en el estudio de la pobreza estática utilizaremos la muestra como sección cruzada en cada uno de los trimestres, mientras que para el análisis de la dinámica construiremos una muestra tipo *pool* con sus pesos correspondientes ²⁴, que incluye a todos los hogares entrevistados al menos cinco trimestres consecutivos (y poder así comparar su primera con su quinta entrevista, realizada un año después). Esta muestra contiene 15.264 hogares observados entre el primer trimestre de 1985 y el cuarto trimestre de 1995, ambos inclusive.

4. La evolución de la pobreza estática en España: 1985-1995

4.1. Evolución del nivel de vida

Antes de analizar los niveles de pobreza existentes en nuestro país durante la década de estudio, parece razonable examinar la evolución en el nivel de vida de los individuos en términos del comportamiento de la media y la mediana de la distribución. Para ello se ha analizado la evolución de ambas medidas de posición una vez que la distribución de ingresos de cada trimestre ha sido ajustada según las cuatro escalas de equivalencia propuestas anteriormente: tres casos de la escala parametrizada, y la ampliamente utilizada escala OCDE. El comportamiento de los diferentes trimestres no presenta diferencias notables (en la tabla 1 se muestran los resultados para el segundo trimestre con un valor del parámetro en la escala de equivalencia de 0,5). Por el contrario, todos reflejan una doble tendencia en la que el año 1992 parece representar un punto de inflexión que permite identificar dos períodos claramente diferenciados. Así, de 1985 a 1992 se produce un crecimiento sostenido, tanto en media como en mediana, de entre un 30 y un 40 por 100 cuando trabajamos con elevadas economías de escala en el consumo del hogar (independientemente del trimestre analizado), y un poco mayor, de entre un 35 a un 45 por 100, cuando trabajamos en valores *per cápita* o con la escala OCDE. A partir de esta fecha este crecimiento sufre una inversión en su tendencia que se traduce en una significativa reducción en los niveles de ambas variables entre 1992 y 1995.

La única excepción a lo comentado se encuentra en la serie correspondiente al primer trimestre de los diferentes años ²⁵. En este caso, y nuevamente para todas las escalas de equivalencia utilizadas, el máximo no se alcanza en 1992 sino que llega hasta 1993 y es a partir de ese momento cuando el crecimiento se ralentiza, invirtiéndose la tendencia. Es como si los efectos de la crisis económica de principios de los noventa no se hubiesen notado hasta una vez entrado el año 1993, a partir de su segundo trimestre. En este caso el *shock* fue notable pues si bien el primer trimestre de 1993 refleja un ligero incremento respecto de 1992, en el caso del segundo trimestre la reducción experimentada entre ambos años es de 5 puntos porcentuales respecto del nivel inicial de 1985.

Tabla 1
Ingreso monetario ajustado medio y mediano ($s = 0,5$) en España: 1985-95, 2.º trimestre

	Tamaño muestral (n.º de observaciones)	Ingreso medio	Ingreso mediano
1985	3.109	234.372	200.786
1986	2.729	237.042	200.634
1987	3.113	253.825	219.699
1988	3.093	268.514	236.287
1989	3.099	287.051	250.031
1990	3.128	303.611	262.814
1991	3.117	311.482	268.466
1992	3.111	321.598	283.878
1993	3.143	318.667	274.620
1994	3.164	312.738	274.805
1995	3.153	314.063	273.983

Nota: Variables monetarias expresadas en pesetas del cuarto trimestre de 1995.

Fuente: Elaboración propia a partir de ECPF 1985-95.

Finalmente, es interesante destacar que el período de análisis se cierra con una característica también común a los diferentes trimestres: en todos ellos se observa un ligero repunte en esta tendencia decreciente al llegar a mediados de los noventa, que parece estar indicando nuevamente un cambio en el ciclo económico.

4.2. Evolución de la pobreza absoluta

La tendencia experimentada por la media y la mediana es de esperar que influya en buena medida en la evolución de la pobreza absoluta. Tomando como línea de pobreza el 60 por 100 de la mediana del trimestre correspondiente de la distribución de 1985, y manteniéndola fija (expresada en pesetas de 1995) a la hora de hacer las comparaciones con los trimestres de los años sucesivos, en la tabla 2 se muestran los cambios experimentados por el porcentaje de pobres en el segundo trimestre (*headcount ratio*, *H*). Como si del negativo de la fotografía de la evolución del nivel de vida se tratara, la nueva tabla refleja fielmente el diagnóstico anterior. Ahora el año 1992 representa un mínimo, de forma que en los años previos el porcentaje de población cuya renta equivalente se situaba por debajo de la línea de pobreza elegida cae sistemáticamente año tras año. A partir de ese momento, y lógicamente coincidiendo con el final del período de bonanza económica, la disminución en el nivel medio y mediano de los ingresos trimestrales hace que la cola baja de la distribución vea incrementar su importancia con relación a la población total, reflejando así un aumento en la incidencia de la pobreza. De esta forma, por ejemplo, para el segundo trimestre y la escala de equivalencia con un valor intermedio del parámetro (igual a 0,5) la proporción de individuos pobres se reduce desde el 20,4 por 100 en 1985, hasta el 4,8 por 100 en 1992, volviendo a subir hasta el 6,8 por 100 en 1995.

Tabla 2
Pobreza en España: 1985-95, 2.º trimestre, $s = 0,5$

Pobreza absoluta: línea de pobreza, 60 por 100 de la mediana del ingreso ajustado del 2.º trimestre de 1985 (expresada en pesetas constantes de 1995).

	Incidencia (H)			Intensidad (I)			Desigualdad entre los pobres (CV _q)		
	Estimación	Intervalo confianza 95%		Estimación	Intervalo confianza 95%		Estimación	Intervalo confianza 95%	
		Mín.	Máx.		Mín.	Máx.		Mín.	Máx.
1985	20,4	19,0	22,3	31,4	29,0	33,8	0,374	0,338	0,408
1986	16,7	15,2	18,4	32,1	29,4	35,1	0,409	0,366	0,456
1987	13,8	12,4	15,2	28,1	25,5	30,6	0,341	0,305	0,374
1988	10,9	9,6	12,2	29,5	26,6	33,2	0,385	0,336	0,443
1989	7,4	6,5	8,4	26,9	23,8	30,2	0,317	0,270	0,368
1990	7,2	6,3	8,3	23,1	19,7	26,7	0,328	0,263	0,389
1991	6,3	5,4	7,2	31,3	27,4	35,9	0,429	0,370	0,504
1992	4,8	4,0	5,6	30,3	25,6	35,6	0,409	0,334	0,496
1993	6,3	5,4	7,3	31,8	27,5	36,2	0,394	0,328	0,465
1994	6,6	5,6	7,6	30,1	26,8	34,7	0,359	0,302	0,429
1995	6,8	5,8	7,8	32,5	28,1	36,8	0,393	0,322	0,472

Pobreza relativa: línea de pobreza, 60 por 100 de la mediana del ingreso ajustado del 2.º trimestre de cada año.

	Incidencia (H)			Intensidad (I)			Desigualdad entre los pobres (CV _q)		
	Estimación	Intervalo confianza 95%		Estimación	Intervalo confianza 95%		Estimación	Intervalo confianza 95%	
		Mín.	Máx.		Mín.	Máx.		Mín.	Máx.
1985	20,4	19,0	22,3	31,4	29,0	33,8	0,374	0,338	0,408
1986	16,7	15,0	18,0	32,0	29,1	34,9	0,409	0,362	0,458
1987	17,1	15,6	18,3	28,5	26,3	30,8	0,326	0,297	0,357
1988	17,0	15,7	18,4	28,5	26,0	30,6	0,339	0,302	0,378
1989	15,5	13,6	17,0	24,6	22,2	26,7	0,279	0,249	0,313
1990	15,7	14,2	17,1	25,5	24,2	28,0	0,270	0,239	0,310
1991	15,3	13,9	16,6	27,8	25,6	30,0	0,322	0,284	0,361
1992	15,6	14,2	17,0	25,3	23,5	27,6	0,286	0,253	0,327
1993	16,0	14,7	17,5	27,0	24,6	29,1	0,317	0,282	0,353
1994	17,6	16,1	19,0	26,2	24,3	28,5	0,295	0,265	0,331
1995	17,9	16,6	19,4	26,6	24,4	29,0	0,313	0,278	0,353

Nota: Intervalos de confianza estimados mediante *bootstraps* corrigiendo por el sesgo (1.000 réplicas).

Fuente: Elaboración propia a partir de ECPF 1985-95.

Curiosamente, sin embargo, la utilización de índices que miden la pobreza únicamente en términos de la distancia relativa que separa la renta de los individuos pobres de la línea de pobreza elegida, refleja unos niveles mínimos de pobreza que en la mayoría de los casos se alcanza en 1990 (o incluso en los últimos trimestres de 1989). De esta forma,

a pesar de que en media la población disfrutó de dos años más de crecimiento en su nivel de ingresos (1991 y 1992) y de que el porcentaje de individuos pobres todavía se redujo significativamente durante esos dos años, los individuos situados por debajo del umbral de pobreza no parecen haberse beneficiado de ese crecimiento en la misma medida que el resto de la población. La Intensidad del fenómeno, por tanto, parece haberse resentido incluso antes de caer en la recesión económica, haciendo más difícil la situación de este colectivo. Confirmando lo anterior, la estimación de una medida de la dispersión de la renta entre los individuos pobres, como el *Coficiente de Variación*, permite comprobar cómo entre 1990 y 1991 se produjo un incremento en la desigualdad de sus ingresos de aproximadamente un 31 por 100 ²⁶.

A partir de 1991 la Intensidad de la pobreza sigue una senda más errática y sin un patrón de comportamiento tan uniforme como el que caracterizó el período anterior. Así, el primer y el segundo trimestres (fundamentalmente) no presentan una continuidad en el crecimiento de sus niveles de pobreza sino que se reflejan incrementos y disminuciones a muy corto plazo y no significativos, difíciles de interpretar en términos económicos (tal vez se trate de ruido provocado por trabajar con datos trimestrales).

La utilización de índices más complejos, en los que además de las cuestiones de Incidencia e Intensidad se tiene en cuenta aspectos relativos a la Desigualdad existente en el reparto de recursos entre la población pobre, no ofrece conclusiones excesivamente novedosas. En la figura 1 se representan las estimaciones para la familia de índices de Foster, Green y Thor-

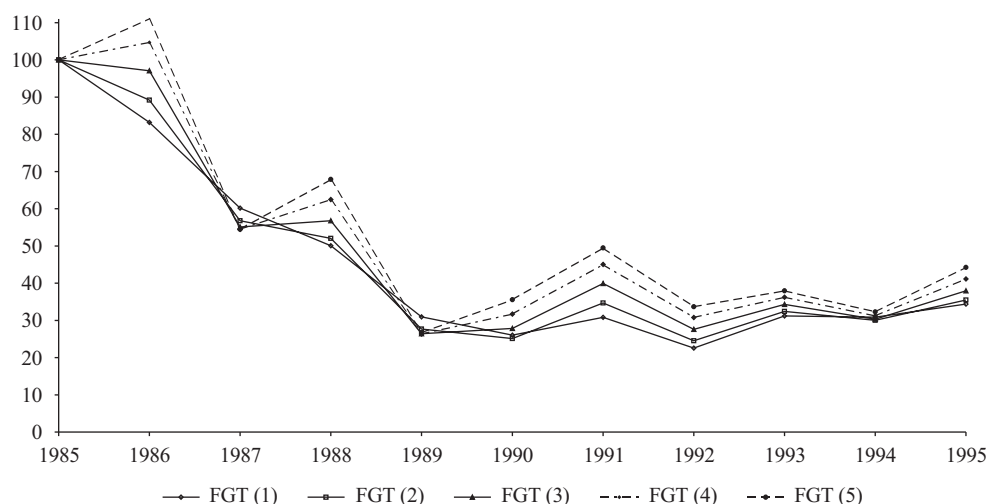


Figura 1. Pobreza absoluta en España 1985-95:
Ingreso monetario ajustado ($s = 0,5$), 2.º trimestre

becke, para diferentes valores del parámetro de aversión a la pobreza. Para realizar las comparaciones interanuales se toma como referencia (y con valor de 100) el nivel existente en el trimestre correspondiente de 1985. En todos ellos se refleja la tendencia decreciente en los niveles de pobreza hasta principios de los noventa y su crecimiento posterior. Salvo en casos particulares, tampoco se perciben diferencias destacables según a qué parte de la distribución de la población pobre sea más sensible el índice (indicado por el parámetro de la familia *FGT* a partir de 2). Es interesante, sin embargo, constatar que la cuantía de la reducción de la pobreza (entre 1985 y 1990) es todavía más importante que la obtenida con el índice *I*. Así, mientras éste computa disminuciones de entre un 20 y un 30 por 100, estos nuevos índices apuntan caídas de un 70 y hasta un 80 por 100, niveles mucho más parecidos a los reflejados por el *headcount ratio*.

4.3. Evolución de la pobreza relativa

El análisis de los resultados obtenidos utilizando el criterio de pobreza absoluta refleja, básicamente, el efecto que el fuerte crecimiento económico experimentado en la segunda mitad de los ochenta tuvo sobre los niveles de pobreza, y sólo en una menor medida este resultado parece haber sido influido por una hipotética redistribución de los recursos hacia la población pobre. Asomarnos al concepto de pobreza relativa significa, sin embargo, ser un poco más exigentes y adecuar el umbral de pobreza a las condiciones de vida propias de cada momento, de forma que refleje la mejoría en el estándar de vida medio de la población cuando consideramos períodos largos de tiempo. De esta forma, la línea de pobreza elegida para cuantificar el fenómeno se mueve en función del crecimiento experimentado, siendo igual al 60 por 100 de la mediana del ingreso ajustado en cada una de las distribuciones trimestrales objeto de estudio. Con este nuevo criterio únicamente se observarán reducciones en los niveles de pobreza si es que efectivamente se ha producido una redistribución de la renta a favor de la población pobre.

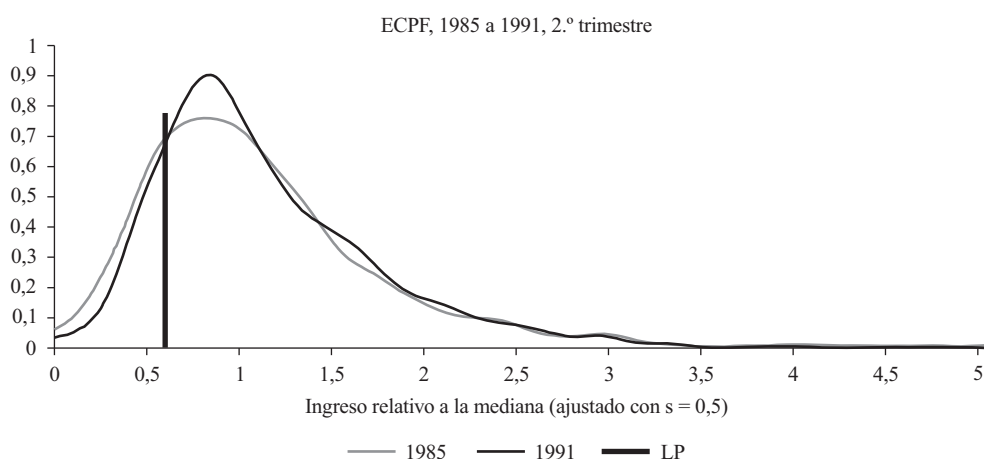
Obviamente este cambio en la definición de las líneas de pobreza explica por qué los niveles de pobreza relativa son mayores que los de pobreza absoluta, independientemente del índice utilizado a la hora de cuantificarla; y por qué la caída y el repunte posterior en el porcentaje de individuos pobres a lo largo de la década se suaviza en relación con lo visto anteriormente (nuevamente en la tabla 2 se muestran los resultados para el segundo trimestre). Aun así, la proporción de pobres entre 1985 y 1991 cayó desde alrededor de un 20 por 100 hasta aproximadamente un 15 por 100 (según el trimestre y la escala de equivalencia utilizada), lo que refleja una mejoría notable que no sólo se debe al crecimiento experimentado sino que fundamentalmente apunta a un cambio en la distribución de los ingresos que parece haber beneficiado relativamente más a la población pobre. El repunte posterior en el *headcount* es de menor cuantía, pasando de ese 15 por 100 de individuos pobres en 1991 a alrededor de un 17-18 por 100 a mediados de la década, pero refleja un preocupante cambio en la tendencia que se venía observando desde la década de los setenta y ochenta, tanto a partir de la información recogida por las EPF de 1973-74, 1980-81 y 1990-91 como por la ECPF entre 1985 y 1991.

En las figuras 2a y 2b se puede comprobar cómo las funciones de densidad relativas a la mediana del ingreso del segundo trimestre de 1985 frente a 1991, y de 1991 frente a 1995, puestas en relación con sus respectivas líneas de pobreza relativas, muestran lo anteriormente comentado. En el primer caso, el área comprendida entre la densidad de 1985 y la línea de pobreza es claramente superior a la de 1991, y de igual forma ocurre con la de 1995 si la comparamos nuevamente con la de 1991, aunque en este caso las diferencias son mucho menos nítidas. No es de extrañar, así, que la comparación de las funciones de 1985 y 1995 representadas en la figura 2c muestre una reducción en la cola baja de la distribución a costa de una mayor densidad en los niveles medios de ingresos.

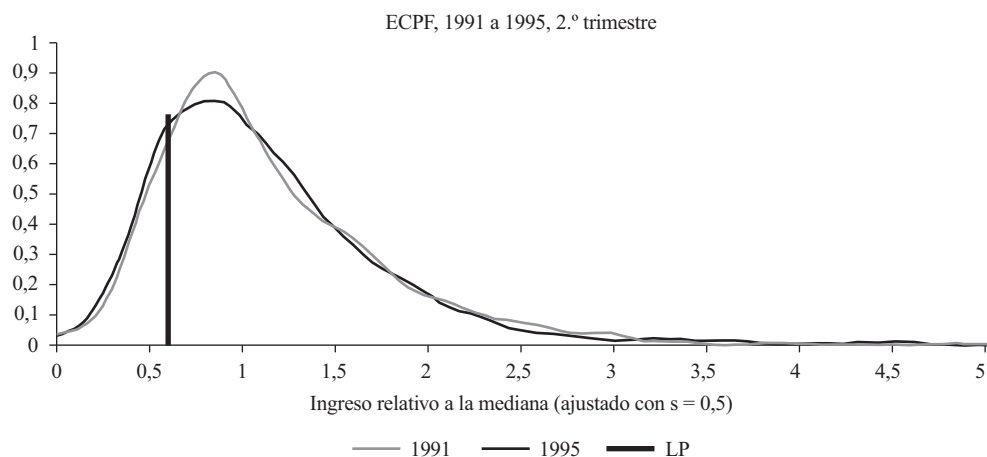
También es digno de mención el hecho de que hasta principios de los noventa no sólo se redujo la incidencia de la pobreza (como acabamos de ver) sino que también se produjo una mejoría en el nivel de vida medio de los pobres en relación con el conjunto de la población, reduciéndose la brecha económica que separa ambos colectivos tal y como refleja el índice *I* (véase nuevamente la tabla 2).

Por otra parte, la utilización de los índices de la familia *FGT* muestra que cuando tenemos en cuenta conjuntamente las tres dimensiones de la pobreza la inflexión en la reducción de la pobreza se produce de forma más temprana. De hecho, en el caso de la escala $s = 0,5$ se constata que la pobreza aumenta o al menos no se reduce a partir de 1989 en el segundo y cuarto trimestres, y a partir de 1990 en el primero y tercero, períodos ambos en los que todavía se estaba reduciendo el porcentaje de individuos pobres (cuyo valor mínimo, recordemos, se alcanzaba en 1991 en todos los casos).

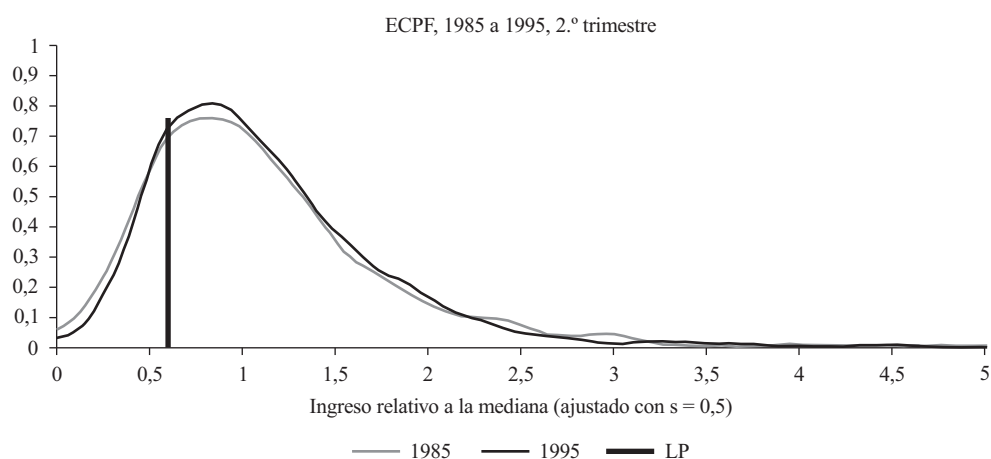
Una ventaja adicional de esta familia de índices es que, para valores mayores que 2 del parámetro de aversión a la pobreza, permite analizar en qué medida la redistribución neta de



**Figura 2a. La distribución del ingreso en España
ECPF, 1985 a 1991, 2.º trimestre**

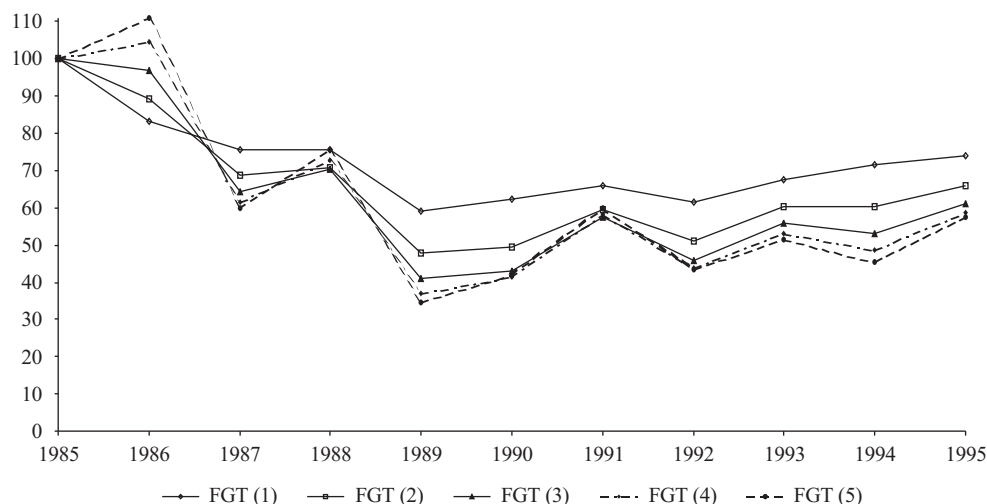


**Figura 2b. La distribución del ingreso en España
ECPF, 1991 a 1995, 2.º trimestre**



**Figura 2c. La distribución del ingreso en España
ECPF, 1985 a 1995, 2.º trimestre**

recursos hacia la población pobre, que acabamos de detectar con el índice I , benefició más a unos pobres que a otros. En la figura 3 se comprueba que, en general, la reducción de la pobreza relativa en la segunda mitad de los años ochenta es mayor cuanto mayor es la aversión a la pobreza, indicando que fueron los individuos más pobres los más beneficiados del crecimiento experimentado en esos años²⁷. Sin embargo, el período de crecimiento de la pobreza parece haber perjudicado al conjunto de la población pobre de manera homogénea, no mostrando los distintos índices un comportamiento diferenciado.



**Figura 3. Pobreza relativa en España 1985-95:
Ingreso monetario ajustado ($s = 0,5$), 2.º trimestre**

Con independencia de las decisiones metodológicas adoptadas, la evolución de la pobreza parece mostrar, así, una tendencia bastante clara: reducción de la pobreza desde mediados de los ochenta hasta principios de los noventa, y una inflexión a partir de este momento que hace que durante la primera mitad de los noventa se reproduzca en España un fenómeno que otros países desarrollados habían experimentado anteriormente, ya en la década de los ochenta.

Una vez conocido el marco estático de la pobreza en España durante el período 1985-1995 se abren nuevas incógnitas acerca de la naturaleza de dicho fenómeno. Así, toda variación en las tasas de pobreza puede ser el resultado neto de un flujo de entrada de hogares en la pobreza y de otro de salida de la misma por parte de algunos de ellos que inicialmente eran considerados pobres. Cuantificar esas tasas e identificar sus causas constituyen elementos fundamentales en el diseño de las políticas de inclusión social (tanto las destinadas a la prevención de la exclusión social como aquéllas dirigidas a la atención e integración de individuos pobres o socialmente excluidos). Obviamente, estos aspectos nos introducen en el corazón del carácter dinámico del fenómeno de la pobreza, objetivo que centrará la siguiente sección de nuestro trabajo.

5. La evolución de la pobreza dinámica en España: 1985-1995

5.1. Evolución de las tasas de salida y entrada en la pobreza

En esta sección nos proponemos cuantificar las tasas de entrada y salida de la pobreza a lo largo del período objeto de estudio, y realizar un análisis de la naturaleza de las transiciones. Los primeros resultados (en la tabla 3) indican que alrededor de un 40 por 100 de los hogares clasificados como pobres en un determinado momento lograron salir de esta situación de pobreza un año después. A su vez, alrededor de un 6 por 100 de los hogares clasificados como no pobres experimentaron una transición hacia la pobreza.

Tabla 3
Flujos de entrada y salida de la pobreza

Período:	Tasas de entrada	Intervalos de confianza al 95%		Tasas de salida	Intervalos de confianza al 95%	
		Mín.	Máx.		Mín.	Máx.
1985-1990	6,3	5,7	6,8	41,3	38,9	43,7
1991-1995	6,6	5,8	7,3	37,6	34,5	40,7
TOTAL	6,4			39,9		

Nota: Pobreza relativa a partir del Ingreso monetario ajustado ($s = 0,5$). Intervalos de confianza estimados mediante *bootstraps* (1.000 réplicas).

Fuente: Elaboración propia a partir de ECPF 1985-95.

Lamentablemente, no podemos profundizar mucho en la evolución temporal de estos flujos ya que la limitada muestra de la que disponemos, resultante de dividir la muestra inicial en los dos subperíodos que nos sugiere el análisis estático, 1985-1990 y 1991-1995, hace que los errores estándar sean elevados²⁸. En cualquier caso, sí podemos afirmar que en el primer período, en el que los niveles de pobreza claramente disminuyen (1985-1990), la tasa de salida de la pobreza es significativamente mayor, siendo asimismo menor la tasa de entrada, aunque en este caso sólo puntualmente. Esto sugeriría que, durante ese período favorable del ciclo económico, la *promoción* de los hogares en situación de dificultad económica, más que el incremento en la *protección* de los más vulnerables a caer en la pobreza, es lo que permitió reducirla. Por el contrario, el segundo período, que va desde 1991 a 1995, y que está caracterizado por tasas de pobreza constantes o ligeramente ascendentes, vendría explicado tanto por ligeros incrementos en las tasas de entrada en la pobreza como, sobre todo, por importantes disminuciones en la tasa de salida de los hogares que ya se encontraban en una situación de dificultad económica. Así, durante el proceso de crisis de inicios de los noventa los incrementos en las tasas de pobreza provendrían tanto del empeoramiento en la situación económica de los hogares más vulnerables como, fundamentalmente, de la falta de rutas de salida de la pobreza para los hogares que ya lo eran.

5.2. Análisis de las transiciones

Un segundo aspecto interesante en el estudio de la pobreza dinámica es determinar de qué puntos de la distribución de la renta provienen los hogares que transitan hacia dentro o fuera de la pobreza. En este sentido, por ejemplo, estamos interesados en saber si los hogares que experimentan una caída de ingresos son hogares que se podían clasificar en el momento $t-1$ como hogares *vulnerables* (cercanos a la línea de pobreza) o, en cambio, son hogares que no hubiésemos identificado con un alto riesgo de transitar hacia la pobreza. En segundo lugar, nos interesa también saber si los hogares que logran salir de una situación de pobreza son aquellos más cercanos a la línea o en cambio una parte importante de ellos provienen de situaciones de pobreza extrema, de manera que la movilidad de la parte más baja de la distribución sea muy efectiva en aliviar situaciones de pobreza severa. Además, es relevante medir qué porcentaje de los hogares que salen de la pobreza o entran en ella son hogares cuyos miembros tienen rentas con un elevado grado de estacionalidad y, por tanto, registraron ingresos nulos en alguno de los dos momentos del tiempo observados.

Los resultados sobre la procedencia de los hogares que transitan hacia dentro o fuera de la pobreza aparecen en la tabla 4, donde las columnas 1 y 3 presentan las distribuciones de las poblaciones que entran y salen de la pobreza, y las columnas 2 y 4 sus respectivas tasas de entrada y salida, calculadas como el porcentaje de hogares que transitan dentro de cada grupo de renta. Observamos que un 40 por 100 de los hogares que caen en la pobreza y un 45,6 por 100 de los que salen lo hacen desde puntos de la distribución de la renta muy cercanos a la línea de pobreza (situados un 10 por 100 de la mediana por encima o por debajo de la misma). Esto parece indicar que algunos de los hogares que transitan, cuando utilizamos una lí-

Tabla 4
Procedencia de los hogares que transitan

Porcentaje mediana en $t-1$	Hogares que entran	Tasa de entrada	Hogares que salen	Tasa de salida
Ingreso nulo			4,9	46,8
[>0, ≤10]			1,1	28,3
[>10, ≤20]			2,1	31,8
[>20, ≤30]			6,5	32,0
[>30, ≤40]			13,5	32,9
[>40, ≤50]			26,2	36,7
[>50, ≤60]			45,6	47,2
[>60, ≤70]	40,0	26,5		
[>70, ≤80]	20,8	12,4		
[>80, ≤90]	11,3	7,1		
[>90, ≤100]	7,7	5,1		
[>100]	20,1	2,1		
TOTAL	100	6,4	100	39,9

Nota: Pobreza relativa a partir del Ingreso monetario ajustado ($s = 0,5$).

Fuente: Elaboración propia a partir de ECPF 1985-95.

nea «fina» del 60 por 100 de la mediana, pueden estar realmente experimentando cambios relativamente pequeños en su ingreso familiar.

Entre los hogares más vulnerables a la pobreza, situados en niveles de renta entre el 60 y el 70 por 100 de la mediana, al menos uno de cada cuatro transitó hacia la pobreza en el período de un año. Observamos, en todo caso, que una parte importante (un 20 por 100) de los hogares que entraron en la pobreza no los habríamos clasificado, *a priori*, como especialmente vulnerables, al poseer ingresos por encima de la mediana de la distribución.

Por otro lado, un pequeño grupo de hogares (concretamente el 5 por 100 de entre los que logran salir de la pobreza) tienen ingresos nulos en su primera entrevista. Claramente éste es un grupo especial ya que su tasa de salida de la pobreza es similar a la de los hogares que están justo por debajo de la línea (en ambos casos de alrededor del 47 por 100). Esto nos indica que, o bien sus ingresos son estacionales o bien son hogares que sólo de forma temporal registraron ausencia de ingresos (no descartando que un porcentaje significativo pueda deberse a errores en la medición de la variable). En cualquier caso, y a pesar de que la mayoría de los hogares que logran salir de una situación de pobreza parten de ingresos cercanos a la línea, las probabilidades de salir de la pobreza parecen depender poco de la distancia del ingreso familiar a la misma, por lo que dichas salidas probablemente tengan su origen en el tipo de transiciones demográficas y de mercado de trabajo que *experimentan* los miembros del hogar a lo largo del año. Sin embargo, la probabilidad de entrada en la pobreza sí parece claramente determinada por la posición del hogar en la distribución de ingresos. Así, mientras el 26,5 por 100 de los hogares inicialmente situados entre el 60 y el 70 por 100 de la mediana sufrieron transiciones, sólo el 7,1 por 100 de los situados entre el 80 y 90 por 100 acabaron en situación de pobreza.

La relevancia de los cambios en el ingreso familiar, en términos de las transiciones que provocan, y las consecuencias de utilizar una determinada línea de pobreza, lo que permitirá captar unas transiciones y no otras, vendrá explicada por el análisis de los puntos de procedencia y destino en la distribución de la renta de los hogares que transitan. Para describir con más detalle qué tipo de transiciones están teniendo lugar no basta con determinar desde qué punto de la distribución se parte en el momento $t-1$ sino que también es relevante conocer a qué punto se llega tras la transición. Nos preguntamos, por ejemplo, si los hogares que caen en la pobreza lo hacen de manera categórica situándose en posiciones de pobreza extrema o, en cambio, se sitúan en lugares cercanos a la línea de pobreza desde los que esperamos verles transitar hacia fuera en un corto período de tiempo.

En la tabla 5 se puede observar que las entradas en la pobreza se producen en niveles de ingresos cercanos a la línea de pobreza. Así, para todos los grupos de renta, al menos el 70 por 100 de los hogares que sufrieron una transición hacia la pobreza acabaron situándose entre el 40 y el 60 por 100 de la mediana, siendo este porcentaje progresivamente mayor a medida que tratamos con hogares con menor nivel de renta inicial. Este último hecho, sin embargo, no es sorprendente ya que en estos casos las transiciones hacia la pobreza incorporan la mayoría de los movimientos decrecientes en la distribución, mientras que a medida que analizamos grupos inicialmente más alejados del umbral de

Tabla 5
Procedencia y destino de hogares que caen en la pobreza

Porcentaje mediana t								
Porcentaje mediana $t-1$	Ingreso nulo	>0, ≤10]	>10, ≤20]	>20, ≤30]	>30, ≤40]	>40, ≤50]	>50, ≤60]	Total
[>60, 70]	0,03	1,9	1,6	2,5	8,0	19,8	66,1	100
[>70, 80]	0,7	3,4	1,4	3,5	6,6	23,6	60,7	100
[>80, 90]	0,0	4,1	5,2	3,7	8,6	26,1	52,2	100
[>90, 100]	1,3	5,6	0,0	3,4	17,6	25,5	46,6	100
[>100]	2,2	8,5	2,9	3,2	13,5	21,5	48,3	100

Nota: Pobreza relativa a partir del Ingreso monetario ajustado ($s = 0,5$).

Fuente: Elaboración propia a partir de ECPF 1985-95.

pobreza, las transiciones a la pobreza reflejadas en la tabla sólo representan un porcentaje reducido de la totalidad de sus movimientos decrecientes experimentados entre $t-1$ y t .

En cambio, en la tabla 6 se puede observar que en el caso de las salidas de la pobreza los movimientos se dividen en dos grandes grupos: el constituido por los que se mueven a puntos muy cercanos de la línea, y aquel otro formado por los que incluso llegan a superar la mediana del ingreso. Aquí, en cualquier caso, volvemos a observar que los hogares con rentas nulas en $t-1$ transitan, generalmente, a puntos altos de la distribución, lo que parece confirmar la estacionalidad o el error en la medición de sus ingresos. Analizando los resultados con más detalle, vemos que son fundamentalmente los hogares que se sitúan cerca de la línea los que con mayor frecuencia se mueven a puntos cercanos a la línea, mientras que los hogares en condiciones de pobreza más intensa registran saltos bastante significativos en la distribución de la renta. De hecho, entre el 25 y el 35 por 100 de los hogares que logran salir de la pobreza dentro cada grupo de ingreso logran superar la mediana de la distribución en el momento t ²⁹.

Tabla 6
Procedencia y destino de hogares que salen de la pobreza

Porcentaje mediana t						
Porcentaje mediana $t-1$	>60, ≤70]	>70, ≤80]	>80, ≤90]	>90, ≤100]	>100]	Total
Ingreso nulo	14,9	16,9	11,9	23,5	32,7	100
[>0, 10]	24,6	0,0	42,7	19,8	12,8	100
[>10, 20]	20,6	16,1	27,7	0,0	35,4	100
[>20, 30]	27,9	23,0	17,0	2,9	29,3	100
[>30, 40]	30,4	27,1	15,7	11,5	25,3	100
[>40, 50]	31,1	20,2	13,3	9,3	26,0	100
[>50, 60]	34,7	22,1	13,4	8,4	21,4	100

Nota: Pobreza relativa a partir del Ingreso monetario ajustado ($s = 0,5$).

Fuente: Elaboración propia a partir de ECPF 1985-95.

Finalmente, si consideramos que la percepción del cambio en bienestar producido por un incremento o decremento en el ingreso familiar es diferente según la magnitud del cambio relativo al nivel de renta del hogar en el momento $t-1$, es decir, si los hogares valoran los cambios en su ingreso esencialmente en términos relativos a su renta inicial, deberíamos analizar también la magnitud de los cambios en el ingreso en las transiciones tanto hacia dentro como hacia fuera de la pobreza desde distintos puntos de la distribución. Esto es lo que nos planteamos a continuación.

En la tabla 7 comprobamos que más de la mitad de los hogares que caen en la pobreza han experimentado cambios relativamente pequeños en su ingreso que no superan el 30 por 100 de su ingreso inicial. En cualquier caso, también debemos tener en cuenta que un 31 por

Tabla 7
Tasa de cambio en el ingreso

Porcentaje cambio ingreso de $t-1$ a t en valor absoluto	Hogares que entran	Hogares que salen
=0	0,0	0,0
[>0, 10]	22,5	1,0
[>10, 20]	13,2	2,9
[>20, 30]	16,7	5,3
[>30, 40]	12,6	9,7
[>40, 50]	9,0	7,2
[>50, 60]	9,6	6,9
[>60, 70]	6,4	6,3
[>70, 80]	3,4	5,0
[>80, 90]	1,5	4,2
[>90, 100]	5,0	3,7
[>100, 110]	—	4,6
[>110, 120]	—	2,6
[>120, 130]	—	2,8
[>130, 140]	—	3,3
[>140, 150]	—	2,1
[>150, 160]	—	2,5
[>160, 170]	—	2,0
[>170, 180]	—	2,1
[>180, 190]	—	1,7
[>190, 200]	—	1,2
[>200, 210]	—	1,4
[>210, 220]	—	1,5
[>220, 230]	—	0,9
[>230, 240]	—	0,9
[>240, 250]	—	0,7
[>250, 260]	—	0,5
[>260, 270]	—	0,5
[>270, 280]	—	1,1
[>280, 290]	—	0,2
[>290, 300]	—	0,3
[>300]	—	14,5
TOTAL	100	100

Nota: Pobreza relativa a partir del Ingreso monetario ajustado ($s = 0,5$).

Fuente: Elaboración propia a partir de ECPF 1985-95.

100 de los hogares que entran en la pobreza lo hacen con cambios en su ingreso de entre un 30 y un 60 por 100 en relación a su nivel inicial. Así, a pesar de que, como era de esperar, los cambios en el ingreso no son en su mayoría muy grandes, un tercio de los hogares transitan hacia la pobreza experimentan cambios significativos en sus ingresos. En la misma tabla se muestra que los hogares que logran salir de la pobreza experimentan cambios mucho más variados en términos porcentuales ya que parten de niveles de ingreso muy bajos³⁰. En cualquier caso, y de forma similar a los hogares que caen en la pobreza, un tercio de los hogares que transitan fuera de ella experimentan cambios que oscilan entre el 30 y el 70 por 100 de su ingreso inicial.

6. Conclusiones

Los grandes avances en el estudio de la pobreza en España fueron mayoritariamente resultado de la disponibilidad de dos fuentes estadísticas: por un lado las encuestas específicamente realizadas para la elaboración de los informes de la «serie pobreza» publicados por la Fundación FOESSA-Cáritas, y cuyo diseño muestral se circunscribe únicamente a la población considerada pobre; y por otro lado, las tres grandes EPF de 1973-74, 1980-81 y 1990-91. El diseño y la periodicidad de estas encuestas no permiten un seguimiento pormenorizado de su evolución en los años ochenta y noventa, y menos aún el estudio de los flujos de entrada y salida de la pobreza en España. Al igual que el PHOGUE, la ECPF posibilita la incorporación de la vertiente dinámica en el análisis de la pobreza y la desigualdad, pero con la ventaja de cubrir un período temporalmente amplio y previo a la aparición de aquél y en el cual se han producido importantes cambios en la evolución de la pobreza en España, posibilitando además una cierta continuidad con los resultados que en el futuro se puedan extraer de la nueva ECPF.

Con el objeto de completar nuestro conocimiento del fenómeno de la pobreza en España, en este trabajo hemos utilizado una serie homogénea de la ECPF, que abarca desde su inicio en 1985 hasta 1995, para analizar tanto la evolución de los aspectos estáticos de la pobreza (fundamentalmente relacionados con la Incidencia y la Intensidad del fenómeno), como los relacionados con los flujos de entrada y salida en la pobreza de distintos colectivos, según su mayor o menor cercanía al umbral de pobreza.

El estudio de la evolución de la pobreza estática permite identificar dos períodos claramente diferenciados, situándose en 1990-1991 el punto inflexión que separa ambos. Así, de 1985 a 1990-1991 tanto la pobreza absoluta como la relativa descendieron con claridad, mientras que a partir de este momento (y a pesar de que el ciclo económico reflejado en estas encuestas no se agotó hasta principios de 1993) los niveles de pobreza asociados tanto a la proporción de individuos afectados como a la intensidad de las situaciones de escasez reflejaron un ligero incremento, que sólo en 1995 parece ralentizarse. En cualquier caso, la diferente magnitud de ambos procesos hace que el saldo final se concrete en una valoración positiva del período analizado, donde los niveles de pobreza absoluta y relativa se acabaron reduciendo en una cuantía significativa.

El estudio de los flujos de entrada y salida de la pobreza permite caracterizar con mayor precisión ambos períodos. Así, la reducción en la pobreza experimentada hasta principios de los noventa parece asociada a elevados niveles en la tasa de salida de la pobreza, en mayor medida que a la protección hacia los hogares más vulnerables a caer en ella. Por el contrario, el aumento en la pobreza acontecido entre 1991 y 1995 sería el resultado tanto de incrementos en la tasa de entrada como, fundamentalmente, de disminuciones significativas en la tasa de salida. Estas transiciones de los hogares a través de la distribución de ingresos implican un grado de movilidad importante en la medida que involucran a un elevado porcentaje de población. Sin embargo, la intensidad del «salto» experimentado por los hogares parece relativamente modesta, ya que frecuentemente no sobrepasa las dos decilas en términos absolutos. En consecuencia, esto delata la existencia de un amplio colectivo de hogares económicamente vulnerables que a tenor de la evolución de sus oportunidades de ingresos pueden caer en la pobreza o promocionar hacia fuera de la misma.

Apéndice

A) Índices de pobreza utilizados

El índice de pobreza más sencillo y conocido es el denominado *headcount ratio*, H . Si con q representamos al número total de pobres y n el tamaño de la población, el índice H representa la proporción de pobres existente en dicha población:

$$H = \frac{q}{n}$$

El índice H presenta serios inconvenientes. Su mayor limitación es que es insensible a los cambios experimentados por los pobres siempre que éstos no superen la línea de pobreza. Así, se trata de un índice insensible a la *intensidad* de la pobreza, ya que aunque todos los individuos pobres lo fuesen cada vez más, el índice no se alteraría al no depender su expresión de cuán pobres son. Además, también es insensible a la *desigualdad* entre la población pobre ya que cualquier transferencia monetaria entre dos individuos situados por debajo de la línea de pobreza no alteraría el índice a pesar de que dicha transferencia se realice a favor de un individuo cercano a la línea y en perjuicio de uno que se encuentre en los niveles más bajos de la distribución.

El primer aspecto, referido a la severidad del fenómeno, podría ser incorporado al análisis si evaluásemos el volumen de renta que sería necesario transferir de ricos a pobres para eliminar la pobreza. La Intensidad se podría medir así, calculando cuánta renta sería necesario darles a los pobres para que dejen de serlo, es decir para que alcancen la línea de pobreza, z . Si relativizamos la cantidad anterior, tomando como referencia la cantidad máxima posible —si todos los pobres tuviesen renta cero— dado el nivel de incidencia observado (qz), obtenemos el índice, I (*income gap ratio*):

$$I = \frac{\sum_{i=1}^q (z - x_i)}{qz} = 1 - \frac{\sum_{i=1}^q x_i}{qz} = 1 - \frac{\mu_q}{z}$$

donde x_i es el ingreso equivalente del individuo i , y μ_q es el ingreso medio de los individuos que están por debajo del umbral de pobreza.

El índice anterior sigue sin tener en cuenta el tercer aspecto fundamental de la pobreza, la *desigualdad* entre los pobres. Si queremos incorporar esta dimensión a la hora de medir la pobreza debemos acercarnos a otros índices que, aun a costa de perder sencillez, logran corregir este problema. Foster, Green y Thorbecke (1984) propusieron una familia de medidas de pobreza en la que cada uno de sus componentes se caracteriza por poseer una sensibilidad distinta al déficit de los individuos para alcanzar la línea de pobreza en función de cuán lejos estén de la misma. Esto lo logra a través del parámetro α en la expresión:

$$FGT(\alpha) = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^q \left[\frac{z - x_i}{z} \right]^\alpha, \quad \alpha \geq 0$$

donde α puede interpretarse como un parámetro de *aversión a la pobreza*. Como es fácil de comprobar esta familia de índices es una generalización de algunos de los anteriores que no son más que casos particulares. Así, tenemos que $FGT(0) = H$ y $FGT(1) = HI$, brecha relativa de pobreza o *poverty gap ratio*, índice que resulta del producto de la incidencia y la intensidad. Para $\alpha = 2$ el índice también adopta la siguiente forma:

$$FGT(2) = H[I^2 + (1-I)^2 CV_q^2]$$

donde CV_q es el coeficiente de variación entre los pobres. A partir de $\alpha = 2$, cuanto mayor es este parámetro mayor es el peso que el índice otorga a los déficit de ingreso más grandes (que reflejan la situación de los más desfavorecidos caracterizados por una mayor distancia entre su ingreso equivalente y la línea de pobreza). Por tanto, a mayores valores de α mayor importancia reconoce el índice a transferencias de renta progresivas dirigidas hacia pobres extremos. Un α infinito daría únicamente valor a la brecha del individuo más pobre, y sólo la situación de este individuo estaría reflejada en el índice.

B) Sistema de pesos teniendo en cuenta las diferentes probabilidades de selección y de abandono del panel por parte de los hogares

En este estudio utilizamos una muestra de hogares españoles que se entrevistan trimestralmente entre 1985 y 1995. En primer lugar, construimos el ingreso trimestral referido a su respectiva mediana y definimos al hogar como pobre o no pobre en cada momento del tiempo según supere o no el 60 por 100 de su mediana correspondiente. Con esta informa-

ción realizamos el análisis de la pobreza estática utilizando en dichos cálculos los factores de elevación correspondientes para tener en cuenta las diferentes probabilidades de estar en la muestra debido al propio diseño de la encuesta y a la falta de respuesta, es decir, utilizamos estrictamente los pesos trimestrales de representatividad proporcionados por el INE.

En segundo lugar, construimos una muestra tipo *pool* de hogares con aquellos que tienen, al menos, cinco entrevistas completas en el panel. Esta muestra nos permitirá a través de la comparación de las situaciones en el momento $t-1$ (primera entrevista) y el momento t (quinta entrevista), un año después, analizar la pobreza dinámica. Esta segunda muestra sufre de un doble problema de falta de representatividad: además de las diferentes probabilidades de selección de los hogares debido al diseño de la encuesta y a la no respuesta, añade el hecho de que existen diferentes probabilidades de abandono del panel antes de la quinta entrevista según sean las características del hogar. Como sugieren Kalton y Brick (2000), para preservar la representatividad en nuestra muestra longitudinal final debemos computar los pesos apropiados de manera que seamos capaces de controlar por ambos sesgos potenciales.

Así, seleccionamos la muestra de hogares que se observan al menos cinco veces (muestra que en nuestro caso está constituida por 15.264 hogares, y a la que denominaremos M_5), tomando como referencia, a la hora de considerar a un hogar pobre en $t-1$ y en t , su nivel de ingresos en relación con el 60 por 100 de la mediana de la muestra total del trimestre correspondiente a su primera y su quinta entrevista, respectivamente. Para generar los pesos que permiten corregir por ambos sesgos interpretamos el *pool* como resultado de dos muestreos consecutivos. Primero, en cada trimestre t el INE selecciona aleatoriamente a los hogares de la población generando así lo que llamaremos Muestra 1 en el momento t (de tamaño n_t) y ésta es nuestra muestra de sección cruzada. Posteriormente, dada la tasa de abandono del panel (*attrition*), se produce un nuevo proceso de muestreo que genera la Muestra 2 en cada trimestre t y ésta es nuestra muestra final cuando consideramos sólo aquellos hogares que llegaron a la quinta entrevista. Así, el tamaño de la muestra final (m_t) es menor que el de la primera muestra ($m_t < n_t$).

Para preservar la representatividad de la muestra final, calcularemos la probabilidad *a priori* de cada hogar de aparecer en esta muestra para posteriormente obtener su peso, que será inversamente proporcional a dicha probabilidad, pero reescalado para garantizar el tamaño muestral correspondiente. Para ello, definamos S_j como una variable aleatoria que vale 1 si un determinado hogar es seleccionado en la Muestra j ($j = 1, 2$) y 0 caso contrario. Entonces, la probabilidad de que un hogar i ($i = 1, \dots, m_t$) aparezca en la Muestra 2 en el trimestre t se puede expresar como:

$$P_{it}(S_2 = 1) = P_{it}(S_2 = 1 \mid S_1 = 1) P_{it}(S_1 = 1), \quad i = 1, \dots, m_t; t = 1, \dots, T$$

donde la probabilidad de ser seleccionado en la primera muestra, $P_{it}(S_1 = 1)$, se conoce, ya que es habitual interpretar los pesos de sección cruzada que proporcionan las oficinas estadísticas como proporcionales a la inversa de la probabilidad de selección. Por otro

lado, $P_{it}(S_2 = 1 | S_1 = 1)$ es la probabilidad de ser seleccionado en la Muestra 2 condicionado al hecho de haber sido seleccionado en la Muestra 1. Esta probabilidad se estima a través de una regresión tipo *probit* sobre un grupo de características relevantes del hogar. Por tanto, el peso que se asigna al hogar i -ésimo de la Muestra 2 en el trimestre t se define como proporcional a la inversa de la probabilidad estimada de ser seleccionado en esa muestra y por tanto tendríamos unos pesos como:

$$w_{it} = \frac{1}{\hat{P}_{it}(S_2 = 1)}$$

Finalmente, reescalamos estos pesos de manera que sumen el tamaño del *pool*, utilizando el factor de escala α :

$$w_i^5 = \alpha w_{it}$$

de manera que si el hogar i está en su 5.^a entrevista, la suma de los pesos de todos los hogares de ese tipo resulta 15.264 y por tanto podemos escribir:

$$\sum_{i=1}^{M_5} w_i^5 = M_5$$

Notas

1. El Panel de Hogares de la Unión Europea (PHOGUE) actualmente cubre desde 1994 hasta 1997 y se prevé que alcance hasta el año 2002, a partir del cual será reemplazado por una nueva encuesta europea (*Estadística sobre renta y condiciones de vida*).
2. En 1997 fueron profundamente reformadas, lo que dificultará las comparaciones con la serie anterior, si bien esto garantiza su continuidad en el futuro.
3. Recientemente, sin embargo, han aparecido estudios que abordan temas relacionados con la desigualdad de los recursos, aunque no con la pobreza en sí, utilizando las ECPF. Entre ellos podemos destacar Oliver y Raymond (1999) y Oliver, Ramos y Raymond (2001a, 2001b).
4. Esta fuente estadística, gestionada por el CEPS/INSTEAD de Luxemburgo, ha sido hasta la actualidad la base de microdatos internacional más importante ya que contiene información muestral basada en definiciones estandarizadas y homogéneas de renta para unos 25 países a partir de encuestas proporcionadas por los diferentes gobiernos e instituciones públicas. La mayoría de estos países son europeos, a los que se les une EEUU, Canadá, Australia, Israel y Taiwán, con información recogida desde 1967, aunque en cada país la disponibilidad temporal de datos es diferente. Las fuentes de datos varían e incluyen tanto secciones cruzadas de paneles de hogares, como encuestas de presupuestos, datos administrativos, etc. En lo referente al caso español las bases de datos incluidas representando a nuestro país fueron las EPF de 1980-81 y 1990-91.
5. Somos conscientes que la utilización de encuestas como las ECPF o las EPF en el estudio de la pobreza presenta ventajas pero también serios inconvenientes, como varios autores han destacado [véase Merca-der-Prats (1993), Ruiz-Huerta y Martínez (1994), INE (1996) y las referencias allí citadas]. A los problemas ya clásicos, relacionados con la falta de respuesta o la escasa fiabilidad de algunos datos (fundamentalmente la subestimación de los ingresos declarados por los hogares) hay que añadirles aquellos otros que tienen una especial relevancia al tratar el problema de la pobreza. Entre ellos, la exclusión en el dise-

ño muestral de los estratos más marginados de la población es, sin duda, el más importante. Sin embargo, consideramos que a pesar de sus limitaciones (sobre todo al estimar la pobreza más extrema) las ECPF constituyen, a día de hoy, una de las principales fuentes de información a nivel microeconómico que no puede ser obviada en este tipo de estudios.

6. Entre otros podemos destacar, Duclos y Mercader-Prats (1993) revisado en (1999), Mercader-Prats (1993, 1995, 1998), Martín-Guzmán y Bellido (1993), García y Martín (1994), Ruiz-Huerta y Martínez (1994) e INE (1996). Una recopilación de esta literatura puede encontrarse en Cantó, Del Río y Gradín (2000).
7. Los resultados referentes a mediados de los ochenta se obtienen de la comparación de la ECPF de 1985 y la EPF de 1980-81 realizada en Escribano (1990), aunque debido a los problemas existentes en términos de comparabilidad entre ambas encuestas debemos tomarlos con cierta cautela.
8. Como ya mencionamos anteriormente, el PHOGUE es una encuesta anual tipo panel a nivel europeo, en cuyo diseño y elaboración están involucrados los institutos de estadística de los países miembros de la Unión. Su estructura panel garantiza que los «mismos» hogares son entrevistados en diferentes momentos del tiempo (lo que permite abordar el estudio de aspectos relacionados con la duración de la pobreza y los factores de entrada y salida de la misma). Asimismo, su metodología común permite obtener una información estadística armonizada que garantiza una elevada fiabilidad en las comparaciones internacionales.
9. En este trabajo también se ofrece una descripción del colectivo de pobres permanentes, principalmente en cuanto a su historial laboral y a las características del hogar donde viven.
10. Además, identifica a los desempleados, las parejas con 3 o más hijos y los mayores de 65 años como los grupos de mayor riesgo de padecer situaciones de pobreza más persistentes.
11. Para una discusión detallada sobre las ventajas e inconvenientes de emplear gasto o ingreso, véase INE (1996).
12. Esta escala calcula el número de adultos equivalentes dándole un peso igual a la unidad al primer adulto, 0,7 a los restantes adultos y 0,5 a los menores de 14 años. La renta equivalente del hogar se obtiene, finalmente, dividiendo su renta total entre el número de adultos equivalentes, así calculado.
13. Diferentes estimaciones muestran que la escala OCDE equivale a un valor del parámetro que se sitúa en el entorno de 0,75. Así Buhmann *et al.* (1988) obtienen un valor de 0,73, Duclos y Mercader-Prats (1993) de 0,76 (Reino Unido) y 0,77 (España), y Jenkins y Cowell (1994) de 0,75 (Reino Unido). En Cantó, Del Río y Gradín (2002b) puede encontrarse una descripción más detallada de las escalas paramétricas utilizadas.
14. En Del Río y Ruiz-Castillo (1999) se ofrece evidencia empírica para el caso español a partir de las EPF de 1973-74, 1980-81 y 1990-91.
15. En Cantó, Del Río y Gradín (2002a) se ofrece un análisis de los efectos del período de cómputo de los ingresos sobre el análisis estático y dinámico de la pobreza, según éste sea anual (agregando los ingresos declarados durante cuatro trimestres) o trimestral. Sus resultados indican que la renta trimestral registra niveles de pobreza significativamente más elevados, siendo las diferencias mayores a medida que el índice utilizado en la medición de la pobreza es más sensible a la situación de la cola baja de la distribución.
16. En la mayoría de los estudios los ingresos son anualizados a partir de la información de un único trimestre. Para alternativas más sofisticadas de anualización de ingresos o gastos en las ECPF véase INE (2001) y Del Río y Ruiz-Castillo (2002).
17. Para ello, cada una de las cuatro series trimestrales se expresan en pesetas del último trimestre de 1995 según el IPC oficial correspondiente.
18. Para poder utilizar al individuo como unidad de análisis en el estudio dinámico necesitaríamos saber qué les ha sucedido, por ejemplo, a todos aquellos que se han independizado y constituido hogares propios.

19. Para una completa revisión de estos índices y de sus propiedades axiomáticas puede verse, por ejemplo, Zheng (1997). En cualquier caso, en el apéndice se presentan brevemente los índices utilizados y sus características más importantes.
20. Uno de los estudios más significativos de este período es el ya citado Bane and Ellwood (1986). Otros trabajos interesantes son Hill (1981), Plotnick (1983), Duncan (1984) y Sawhill (1988).
21. El primer trabajo que conocemos es el de Duncan *et al.* (1993), donde se compara la duración de la pobreza en países como Alemania, Suecia, Países Bajos, Luxemburgo y la región de Lorena (Francia). Actualmente se están consolidando interesantes fuentes de datos longitudinales comparables para diferentes países europeos como son el PHOGUE, y el Panel Comparability Project (PACO) desarrollado en Luxemburgo (CEPS/INSTEAD).
22. Obviamente, si la falta de respuesta fuese aleatoria, el problema con el que nos encontraríamos se derivaría únicamente de la reducción de la muestra y, por tanto, de la posible falta de robustez de los resultados obtenidos.
23. Obsérvese que en el caso de la pobreza estática, donde se calculan los niveles de pobreza para cada trimestre por separado, no es necesario incorporar los pesos relacionados con el abandono de los hogares ya que se utiliza la totalidad de la muestra. De esta forma, los pesos oficiales proporcionadas por el INE garantizan la representatividad de la muestra en cada momento temporal. Sin embargo, en la pobreza dinámica, al tener que comparar los niveles de ingresos en la primera y quinta entrevista a la hora de calcular las tasas de entrada y salida de la pobreza, los pesos por abandono son imprescindibles si queremos que la submuestra de hogares con al menos cinco entrevistas sea representativa.
24. Para una descripción detallada del cálculo de estos pesos véase el apéndice final.
25. En Cantó, Del Río y Gradín (2002b) se muestran las figuras correspondientes a los cuatro trimestres. Por cuestiones de espacio, en el presente trabajo sólo presentaremos las tablas y figuras correspondientes al segundo trimestre, aunque siempre que sea de interés se mencionarán en el texto las diferencias existentes entre éste y el resto. La elección del segundo trimestre se justifica en la creencia de que es el que menos se ve influido por factores estacionales, siendo el habitualmente elegido en este tipo de estudios.
26. En la tabla 2 se observa lo comentado anteriormente a partir de las estimaciones del *Income gap ratio (I)*, del *Coficiente de variación* entre los pobres (*CVq*) y de sus intervalos de confianza.
27. Resulta llamativo, sin embargo, constatar que entre 1985 y 1986 (para el primer y segundo trimestre) la pobreza relativa aumenta en los casos de mayor aversión a la pobreza, mientras que se reduce en los casos de menor aversión indicando que los más beneficiados entre los pobres fueron aquellos cuyas rentas estaban más próximas a la línea de pobreza.
28. Concretamente, en el subperíodo 1985-1990 se identificaron 9.450 hogares con al menos 5 entrevistas, mientras que en 1991-1995 había 5.814 hogares.
29. Si exceptuamos el grupo con ingresos positivos pero inferiores al 10 por 100 de la mediana en $t-1$, donde sólo el 12,8 por 100 de los que salen de la pobreza superan el 100 por 100 de la mediana en t .
30. Esto explica, por ejemplo, que uno de cada siete hogares que transitan haya triplicado su ingreso inicial.

Referencias

- Bane, M. J. y D. T. Ellwood (1986), "Slipping in and out of poverty: The dynamics of spells", *Journal of Human Resources*, 21 (1): 1-23.
- Bradbury, B., S. P. Jenkins y J. Micklewright (2001), "Conceptual and measurement issues", en B. Bradbury, S. P. Jenkins y J. Micklewright (eds.), *The Dynamics of Child Poverty in Industrialised Countries*, Cambridge, Cambridge University Press - UNICEF: 27-61.
- Buhmann, B., L. Rainwater, G. Schmaus y T. Smeeding (1988), "Equivalence scales, Well-Being, Inequality and Poverty: Sensitive Estimates across ten countries using the Luxembourg Income Study (LIS) database", *Review of Income and Wealth*, 34: 115-142.
- Cantó, O. (1996), *Poverty dynamics in Spain: A study of transitions in the 1990s*, Distributional Analysis Research Programme Discussion Paper, 15, Londres: London School of Economics.
- Cantó, O. (1998), *The Dynamics of Poverty in Spain: The Permanent and Transitory Poor*, Tesis Doctoral no publicada, Florencia: European University Institute.
- Cantó, O., C. del Río y C. Gradín (2000), "La situación de los estudios sobre pobreza y desigualdad en España", *Cuadernos de Gobierno y Administración*, 2: 25-94, especial monográfico *Pobreza y Desigualdad en España: enfoques, fuentes y acción pública*.
- Cantó, O., C. del Río y C. Gradín (2002a), "Poverty Statics and Dynamics: Does the accounting period matter?", *Papeles de Trabajo*, 22/02, Madrid: Instituto de Estudios Fiscales.
- Cantó, O., C. del Río y C. Gradín (2002b), "La evolución de la pobreza estática y dinámica en España en el período 1985-1995", *Papeles de Trabajo*, 24/02, Madrid: Instituto de Estudios Fiscales.
- Del Río, C. y J. Ruiz-Castillo (1999), "El enfoque de la dominancia en el análisis de la pobreza", en *Dimensiones de la desigualdad, III Simposio sobre Igualdad y Distribución de la Renta y la Riqueza. Volumen I*, Madrid: Fundación Argentaria, Colección Igualdad, 13: 429-460.
- Del Río, C. y J. Ruiz-Castillo (2001), "TIPs for Poverty Analysis. The case of Spain, 1980-81 to 1990-91", *Investigaciones Económicas*, XXV (1), enero: 63-91.
- Del Río, C. y J. Ruiz-Castillo (2002), "The measurement of annual household expenditures using an 8-quarters rotating sample. The case of Spain 1985-1996", mimeo.
- Duclos, J. Y. y M. Mercader-Prats (1993), "Household composition and classes of Equivalence Scales: with application to Spain and the UK", Microsimulation Unit Paper, Department of Applied Economics, University of Cambridge.
- Duclos, J. Y. y M. Mercader-Prats (1999), "Household Needs and Poverty: With Application to Spain and the UK", *Review of Income and Wealth*, 45 (1): 77-98.
- Duncan, G. J. (1984), *Years of poverty, years of plenty*, Ann Arbor, Michigan: Institute for Social Research.
- Duncan, G. J., B. Gustafsson, R. Hauser, G. Schmauss, H. Messinger, R. Muffels, B. Nolan y J. C. Ray (1993), "Poverty dynamics in eight countries", *Journal of Population Economics*, 6: 215-234.
- Escribano, C. (1990), "Evolución de la pobreza y la desigualdad en España. 1973-1987", *Información Comercial Española*, 686: 81-108.

- Eurostat (1992), *Poverty in Figures: Europe in the Early Eighties*, Luxemburgo: Oficina de Publicaciones Oficiales de las Comunidades Europeas.
- Eurostat (2000), *Income, poverty and social exclusion. European social statistics*, Luxemburgo: Oficina de Publicaciones Oficiales de las Comunidades Europeas.
- Foster, J., J. Green y E. Thorbecke (1984), "A class of decomposable poverty measures", *Econometrica*, 52 (3): 761-66.
- García, A. y G. Martín (1994), "La pobreza y su distribución territorial", en *V Informe Sociológico sobre la Situación Social en España*, Madrid: Fundación FOESSA, vol. 1: 315-334.
- García, I. y L. Toharia (1998), "Paro, pobreza y desigualdad en España: análisis transversal y longitudinal", *Ekonomiaz*, 40: 134-165.
- García-Serrano, C., M. A. Malo y L. Toharia (2001), *La pobreza en España. Un análisis crítico basado en el Panel de Hogares de la Unión Europea (PHOGUE)*, Colección Estudios, Madrid: Ministerio de Trabajo y Asuntos Sociales.
- Hill, M. (1981), "Some dynamic aspects of poverty", en *Five Thousand American Families: Patterns of Economic Progress. Analyses of the first twelve years of the Panel Study of Income Dynamics*, Michigan: vol. IX.
- Imedio, L. J., E. M. Parrado y M. D. Sarrión (1997), "Evolución de la desigualdad y la pobreza en la distribución de la renta familiar en España en el período 1985-1995", *Cuadernos de Ciencias Económicas y Empresariales* (2.^a época), 32: 93-109.
- INE (1996), *Encuesta de Presupuestos Familiares. Desigualdad y Pobreza en España. Estudio basado en las Encuestas de Presupuestos Familiares 1973-74, 1980-81 y 1990-91*, Madrid: Instituto Nacional de Estadística y Universidad Autónoma de Madrid.
- INE (2001), *Encuesta continua de Presupuestos Familiares. Base 97. Ficheros longitudinales de usuarios*, Madrid: Instituto Nacional de Estadística.
- Jenkins, S. P. y F. Cowell (1994), "Parametric equivalence scales and scale relativities", *The Economic Journal*, 104: 891-900.
- Kalton, G. y M. Brick (2000), "Weighting in household panel surveys", en Rose, E. (ed.), *Researching Social and Economic Change: the uses of households panel studies*, Londres: Routledge.
- Kiefer, N. M. (1988), "Economic duration data and hazard functions", *Journal of Economic Literature*, 26, junio: 646-679.
- Luttmer, E. F. P. (2001), *Measuring poverty dynamics and inequality in transition economies: Disintagling real events from noisy data*, The World Bank.
- Martín-Guzmán, P. y N. Bellido (1993), "Líneas de pobreza: una estimación de la pobreza subjetiva en España", en *La distribución de la renta, I Simposio sobre Igualdad y Distribución de la Renta y la Riqueza*, Madrid: Fundación Argenteria, vol. II: 91-100.
- Martínez, R., J. Ruiz-Huerta y L. Ayala (1998), "Desigualdad y pobreza en la OCDE: una comparación de diez países", *Ekonomiaz*, 40: 42-67.

- Mercader-Prats, M. (1993), "Bajos niveles de renta en España y una comparación con el Reino Unido y Francia", en *La distribución de la renta, I Simposio sobre Igualdad y Distribución de la Renta y la Riqueza*, Madrid: Fundación Argentaria, vol. II: 137-149.
- Mercader-Prats, M. (1995), *Peut-on mesurer la pauvreté?: Aspects méthodologiques et conceptuels de la mesure de la pauvreté, l'Espagne dans le context Européen*, Tesis Doctoral no publicada, École des Hautes Études en Sciences Sociales, París: Delta.
- Mercader-Prats, M. (1998), "Identifying Low Standards of Living: Evidence from Spain", *Research on Economic Inequality*, 8: 155-73.
- O'Higgins, M. y S. Jenkins (1990), "Poverty in Europe: Estimates for 1975, 1980 and 1985", *Analyzing Poverty in the European Community*, Luxemburgo: Eurostat News Special Edition 1-1990.
- Oliver, J. y J. L. Raymond (1999), "La distribución de la renta en España en el período 1985-1996: Resultados derivados de la Encuesta Continua de Presupuestos Familiares", *Cuadernos de Información Económica*, 150: 1-4.
- Oliver, J., X. Ramos y J. L. Raymond (2001a), "Anatomía de la distribución de la renta en España, 1985-1996: la continuidad de la mejora", *Papeles de Economía Española*, 88: 67-88.
- Oliver, J., X. Ramos y J. L. Raymond (2001b), "La mejora en la distribución de la renta en España, 1985-1996: Un análisis de robustez", en J. M. Labeaga y M. Mercader-Prats (eds.), *Desigualdad, redistribución y bienestar: una aproximación a partir de la microsimulación de reformas fiscales*, Madrid: Instituto de Estudios Fiscales: 355-372.
- Pena, B. (1996), *Distribución Personal de la Renta en España: correcciones y modelización de la información básica, desigualdad y análisis*, Madrid: Ed. Pirámide.
- Plotnick, R. (1983), "Turnover of the ACDF population: An event history analysis", *Journal of Human Resources*, 18: 65-81.
- Ravallion, M. (1996), "Issues in Measuring and Modelling Poverty", *The Economic Journal*, 106: 1328-1343.
- Ruiz-Castillo, J. (1987), *La medición de la pobreza y la desigualdad en España 1980-1981*, Servicio de Estudios del Banco de España, Madrid: Banco de España, Estudios Económicos, 42.
- Ruiz-Huerta, J. y R. Martínez (1994), "La pobreza en España ¿Qué nos muestran las encuestas de presupuestos familiares?", *Documentación Social*, 96: 15-109.
- Sawhill, I. (1988), "Poverty in the United States: Why is it so persistent?", *Journal of Economic Literature*, 26: 1073-1119.
- Sen, A. (1976), "Poverty: an ordinal approach to measurement", *Econometrica*, 44: 219-31.
- Zheng, B. (1997), "Aggregate poverty measures", *Journal of Economic Surveys*, 11 (2): 123-162.

Abstract

The aim of this paper is the analysis of economic poverty in Spain since the mid-eighties until the mid-nineties, a period not sufficiently covered by the recent literature. We propose both a static and a dynamic approach to the measurement of poverty. Our results show that after an initial period of reduction in poverty levels, deprivation indices have turned to a stabilization or even an increase. The dynamic perspective lets us deepen the analysis of transitions, taking into account their intensity and considering the relevance of their fluctuations along the period.

Keywords: income distribution, static poverty, dynamic poverty, Spain.

JEL Classification: D1, D31, I32.