Modelos dinámicos de variables latentes aplicados a la construcción de indicadores económicos y sociales

DATOS BÁSICOS DE TESIS DOCTORAL

***Autor*:** Jesús Pérez Mayo
***Director*:** Miguel A. Fajardo Caldera
***Universidad y fecha de lectura*:** Universidad de Extremadura, 22 de noviembre de 2002
***Palabras clave*:** pobreza, privación, clases latentes, datos de panel.
***Clasificación JEL*:**
***Acceso al documento completo*:** Pérez Mayo, J. (2003) *Modelos dinámicos de variables latentes aplicados a la construcción de indicadores económicos y sociales*, Servicio de Publicaciones de la Universidad de Extremadura, Cáceres.
Publicaciones:
Pérez Mayo, J., Fajardo Caldera, M.A., (2003), "Un método alternativo para identificar los hogares en situación de pobreza", *Estadística Española*, 45, nº 152, 115-134.
Pérez Mayo, J., Fajardo Caldera, M.A, (2004), "Un modelo para corregir el error de medida en el análisis de la movilidad de la renta", *Cuadernos Económicos de ICE*, nº 68.
Pérez Mayo, J. (2003) Measuring deprivation in Spain. IRISS Working Paper Series 2003-09.
Pérez Mayo, J. (2004) Consistent poverty dynamics in Spain. IRISS Working Paper Series 2004-09.

RESUMEN

En los últimos años, la pobreza y la exclusión social son fenómenos de gran actualidad en la agenda política de la Unión Europea. Los objetivos de este trabajo, identificar los hogares en situación de pobreza o privación y estudiar su evolución temporal, determinando los factores que influyen en dicha evolución aparecen como cuestiones necesarias para la consecución de las metas propuestas por la Unión Europea así como su seguimiento y evaluación. La herramienta utilizada en este trabajo es el *modelo de clases latentes* (Lazarsfeld, 1950; Lazarsfeld y Henry, 1968, Haberman, 1979) con su extensión temporal (Wiggins, 1973; Poulsen, 1982; Hagenaars ,1990; Langeheine y Van de Pol, 1990; Vermunt,1997), que, además, presenta una ventaja para lograr el segundo objetivo del trabajo porque que permite la inclusión del análisis estático dentro de los modelos utilizados para estudiar

la movilidad de las variables categóricas. Tradicionalmente, los trabajos que se venían realizando en este sentido tomaban como único parámetro de referencia la renta de cada hogar, sin tener en cuenta otras circunstancias más particulares de las familias, como son la capacidad para hacer frente a los pagos hipotecarios, la renovación del vestuario, disponer de agua caliente o incluir en la dieta cada dos días carne o pescado. Junto a éstas, el estudio clasifica dentro de los apartados de Calidad de la Vivienda y Estilo de Vida, otras circunstancias tales como la disponibilidad de calefacción, la existencia o no de goteras en el hogar, o la renovación del mobiliario. Los datos, que corresponden al periodo que va de 1994 a 1996, arrojaron que el 40% de la población censada en nuestro país está en condiciones de afrontar los gastos más básicos a lo largo de su vida y que un 12% de los hogares no pueden satisfacer sus necesidades básicas. La segunda de las líneas de investigación, la de movilidad, asevera que es muy difícil salir de la pobreza que sufren miles de españoles, principalmente a causa de la situación laboral que atraviesan. Es decir, cuando la responsabilidad de un hogar recae sobre un individuo desempleado, o incluido en un grupo con dificultades para acceder al mercado laboral, existe un alto nivel de probabilidad de que no mejore su situación económica. De esta forma, los grupos de pobreza coinciden con familias encabezadas por una persona mayor de 65 años, analfabeta o sin titulación académica. Por otro lado, cuando una de estas personas accede eventualmente a un empleo, mejora durante ese periodo su grado de pobreza. Este "circulo vicioso" lleva a proponer programas de inserción social centrados precisamente en la integración laboral de sus desempleados.

ÍNDICE

Introducción

Capítulo 1. Los modelos log-lineales longitudinales
- **1.1.** Introducción
- **1.2.** El modelo log-lineal
- **1.3** Los modelos log-lineales aplicados al análisis de la movilidad

Capítulo 2. Los modelos log-lineales longitudinales con variables latentes
- **2.1.** Introducción
- **2.2.** El modelo de clases latentes clásico
- **2.3.** Los modelos dinámicos de variables latentes

Capítulo 3. La influencia de algunas variables ajenas en los modelos latentes dinámicos.
- **3.1.** Introducción
- **3.2.** Covariables constantes
- **3.3.** Covariables dinámicas
- **3.4.** Covariables discretas y continuas: los modelos gráficos de cadena

Capítulo 4. Los perfiles de la privación en España: Un estudio estático y dinámico
- **4.1.** Introducción

4.2 Un estudio sobre la privación a partir del PHOGUE
4.3. Un análisis temporal de la privación
Conclusiones
Apéndice 1. Conceptos básicos de los modelos gráficos
Anexo 1. Codificación de las variables
Anexo 2. Relación entre las categorías de la privación general y sectorial con la renta
Anexo 3. Un análisis de sensibilidad para distintas líneas de pobreza
Anexo 4. Estimaciones de los parámetros del modelo dinámico final del trabajo
Referencias

BIBLIOGRAFÍA RECOMENDADA

Hagenaars, J.A. (1990) *Categorical longitudinal data. Log-linear Panel, Trend, and Cohort Analysis*. Londres. Sage Publications.
Jenkins, S.P. (1999) *Modelling household dynamics*. ISER Working Paper 1999-01. Colchester. Universidad de Essex.
Martínez, R. y Ruiz-Huerta, J. (2000) "Income, multiple deprivation and poverty: an empirical analysis using Spanish data". 26ª Conferencia General de la IARIW (Asociación para el estudio de la Renta y la Riqueza). Cracovia, 27/08-02/09.
Vermunt, J.K. (1997) *Log-linear Models for Event Histories*. Londres: Sage Publications.
Whelan, C.T., Layte, R. y Maître, B. (2001a) *What is the scale of multiple deprivation in the European Union?*. European Panel Analysis Group Working Paper nº 19. Colchester. Universidad de Essex.