

Análisis Dinámico de la Pobreza y la Estructura de los Hogares

DATOS BÁSICOS DE TESIS DOCTORAL

Autor: Juana Domínguez Domínguez

Director: José Miguel Casas Sánchez y Rafael Herrerías Pleguezuelo

Universidad y fecha de lectura: Universidad de Granada, 27 de Marzo de 2003.

Palabras clave: Pobreza, escalas de equivalencia, cadenas de Markov, indicadores sintéticos, análisis multivariante.

Clasificación JEL: D31, D30 y D63

Acceso al documento completo: solicitudes a la autora, juana.dominguez@uah.es.

Publicaciones:

CASAS, J.M.; DOMÍNGUEZ, J.; HERRERIAS, R y NÚÑEZ, J.J. (2003): “Evolución dinámica de la incidencia de la pobreza en España mediante un modelo markoviano en el período 1994-98”. Ponencia. Anales de Economía Aplicada. XVII Reunión Anual de ASEPELT-España. Almería.

CASAS, J.M.; DOMÍNGUEZ, J. y HERRERIAS, R. (2004): “Una generalización de las escalas de equivalencia demográficas”. *Estadística Española*. Vol. 159.

RESUMEN

El trabajo consta de una Introducción General y cuatro capítulos. En el primer capítulo, se aborda el problema de cómo medir la pobreza, haciendo una recopilación y análisis de la gran cantidad de medidas establecidas, una clasificación de las mismas y un enjuiciamiento de su bondad mediante una batería de axiomas ó propiedades deseables que se utilizan como norma o patrón para juzgar su capacidad como medidas de pobreza. Se propone una medida de pobreza de tipo exponencial, comprobando sus buenas prestaciones, desde el punto de vista de las propiedades ó axiomas que verifica, y comparándola con el resto de las medidas analizadas.

En el capítulo segundo, se aborda el problema de las economías de consumo inherentes al hogar, mediante la utilización de escalas de equivalencia. Se aporta una nueva definición de escala demográfica, como generalización que permite englobar a las diversas escalas que se han propuesto en la literatura especializada y que también son analizadas en este capítulo.

El capítulo 3 se dedica al análisis de la pobreza, desde un punto de vista dinámico. Así, se estudian los mecanismos por los que se entra y sale de la situación de pobreza, descomponiendo la pobreza en componentes, que se denominan transitorio y permanente. Se utiliza la herramienta de los procesos estocásticos markovianos, en tiempo discreto con espacio discreto

de estados (cadenas de Markov), en tiempo continuo con espacio de estados discreto y en tiempo continuo con espacio continuo de estados y particularmente los procesos de difusión, para desarrollar modelos que permiten el análisis dinámico de diversos aspectos relacionados con la pobreza.

En el cuarto capítulo, se aborda el problema de la ordenación de comunidades (regiones en un país, países en el mundo, etc.), utilizando un índice sintético global de pobreza. Para ello, se utiliza el Análisis de Componentes Principales para la obtención de dicho indicador y, más concretamente, la primera de las componentes principales, para cada instante considerado del tiempo. En este análisis, resulta de gran interés el estudio de la estructura de covarianza delimitada por la batería de indicadores simples utilizados. De esta manera, se presentan las técnicas que permiten la construcción del indicador sintético global, sin dependencia temporal. Además, en el caso de que exista dependencia temporal, se desarrolla la técnica precisa para la construcción de este indicador de manera funcional que, en este caso, recurre al Análisis Funcional de Componentes Principales

ÍNDICE

Introducción general

Capítulo I: Elementos del análisis de la pobreza

- 1.- Introducción
- 2.- El concepto de pobreza
- 3.- La construcción del umbral de pobreza
- 4.- Indicadores descriptivos de pobreza
- 5.- Los axiomas básicos y su relación con las familias definidas
- 6.- Inferencia sobre las medidas de pobreza
- 7.- Posibilidades y limitaciones del análisis multivariante
- 8.- Factores condicionantes y su estudio
- 9.- Las curvas clásicas de la pobreza y su relación con las utilizadas en desigualdad

Capítulo II: Las escalas de equivalencia y su influencia en la medición de la pobreza.

- 1.- Introducción
- 2.- Las escalas de equivalencia frente a la renta per capita
- 3.- Escalas de equivalencia basadas en la teoría del consumo
- 4.- Otras escalas de equivalencia
- 5.- Escalas de equivalencia uniparamétricas
- 6.- Escalas de equivalencia biparamétricas
- 7.- Escalas de equivalencia subjetivas
- 8.- Escalas de equivalencia dependientes de la renta
- 9.- Sensibilidad de las medidas de pobreza frente a las escalas de equivalencia
- 10.- Una generalización de las escalas de equivalencia
- 11.- Escalas de equivalencia y evaluación de la pobreza

- 12.- Estudio de sensibilidad de la evolución de la pobreza en España, frente a diversas escalas de equivalencia, a partir de la E.B.P.F., en el periodo 1973-1991.

Capítulo III: Análisis dinámico de la pobreza

- 1.- Introducción
- 2.- Análisis dinámico de la incidencia de la pobreza en una población
- 3.- Estudio de la evolución del tamaño de la población pobre
- 4.- Estudio dinámico de la pobreza extrema
- 5.- Estudio dinámico de la pobreza en España, a través del panel de hogares, durante el periodo 1994-98.

Capítulo IV: Estudio global de la pobreza mediante indicadores dinámicos

- 1.- Introducción
- 2.- Selección de indicadores de pobreza
- 3.- Indicador sintético global
- 4.- Análisis de la evolución de la pobreza en España, mediante un indicador sintético, a través de la E.C.P.F. (Base 1997), durante el periodo 1997-2000.

Conclusiones y líneas abiertas de investigación

Bibliografía

BIBLIOGRAFÍA RECOMENDADA

- BHAT, U.N (2002): *Elements of Applied Stochastic Processes*. Ed. John & Wiley, Inc. Hoboken, New Jersey.
- DE VOS, K. y ZAIDI, M.A. (1997): “Equivalence scale sensitivity of poverty statistics for the member states of the European community”. *Review of Income and Wealth*. Vol. 43, pp.319-333.
- FLURY, B. (1984): “Common principal components in k groups”. *Journal of the American Statistical Association*. Vol.79. pp.892-898.
- GARCIA, C; NÚÑEZ, J.J; RIVERA, L.F y ZAMORA, A.I (2002): “Análisis comparativo de la desigualdad a partir de una batería de indicadores. El caso de las Comunidades Autónomas españolas en el periodo 1973-1991”. *Estudios de Economía Aplicada*. Vol. 20, nº1, pp.137-154.
- KRZANOWSKI, W.J. (1979): “Between-groups comparison of principal components”. *Journal of The American Statistical Associations*. Vol. 74, nº367, pp. 703-707.
- ZHENG, B. (1997): “Aggregate poverty measures”. *Journal of Economic Surveys*. Vol. 11, nº 2, pp.123-162.