

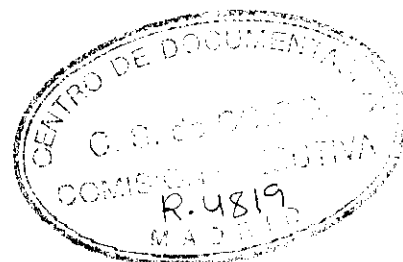
Documento de Trabajo 9623

CONVERGENCIA EN PRESTACIONES DE
PROTECCION SOCIAL ENTRE LOS PAISES
DE LA UNION EUROPEA

- JAVIER ALONSO . M.ANGEL GALINDO .
- SIMON SOSVILLA

Noviembre, 1.996

FACULTAD DE CIENCIAS ECONOMICAS Y EMPRESARIALES
UNIVERSIDAD COMPLUTENSE DE MADRID
VICEDECANATO
Campus de Somosaguas. 28223 MADRID. ESPAÑA.



CONVERGENCIA EN PRESTACIONES DE PROTECCION SOCIAL ENTRE LOS PAÍSES DE LA UNIÓN EUROPEA

Javier Alonso
(Centro Universitario Luis Vives)

Miguel Ángel Galindo
(Universidad Complutense de Madrid)

Simón Sosvilla
(FEDEA y Universidad Complutense de Madrid)

Versión preliminar
Junio, 1996

RESUMEN

En este trabajo se examina el grado de convergencia en las prestaciones de protección social *per capita* registrado en la Unión Europea durante el período 1966-92. Para ello, se empleamos datos de Eurostat, calculándose los dos indicadores más utilizados en la literatura sobre convergencia: convergencia σ y convergencia β .

1. Introducción

La coordinación de la política social ha sido un tema recurrente en la agenda de la hoy Unión Europea (UE). En efecto, ya en el Tratado de Roma (1957), en su artículo 117, establecía la necesidad de promover la mejora de las condiciones de vida y de trabajo de los trabajadores para lograr su *igualación por la vía del progreso*. Posteriormente, el Acta Única Europea (1986) manifestaba la voluntad de los Estados miembros por armonizar las políticas sociales, recogándose posteriormente en La Carta Social Europea (1989) los principios generales que deberían regular tales políticas. Pero fue el Tratado de Unión Europea (1992) en su protocolo anexo (firmado por todos los miembros con la excepción del Reino Unido) el que supuso un avance importante al facilitar un marco legal para futuras intervenciones en política social.

Las razones por las que se ha incluido la política social dentro de los acuerdos responde a cuestiones de muy diversa índole. Desde un punto de vista general, los países europeos de la Unión han desarrollado una sociedad con unos valores comunes y muy arraigados dentro de lo que llamamos el "Estado del Bienestar". Estos valores podrían ser los de la democracia y los derechos individuales, la economía de mercado y el Estado como su regulador, la igualdad de oportunidades para todos, la asistencia social y la solidaridad [véase Comisión Europea (1994, pág 9)]. Dentro de estos conceptos "universales", los países deberían adquirir una armonización dentro de sus sistemas de protección social con el resto de los países para asegurar que los valores que antes señalábamos se dieran por igual en todos los países de la Unión. La extensión de la solidaridad intranacional al ámbito Comunitario se presenta así como una necesidad de tipo moral común a todos los miembros de la Unión.

Desde un punto de vista económico, la armonización o coordinación de políticas sociales adopta distintas posturas dependiendo del punto de observación. La menor dotación de gastos sociales financiados vía impuestos o cotizaciones sociales de los países menos desarrollados podría provocar una competencia desleal o también llamado "dumping social". La reducción de costes laborales, gracias a menores cargas fiscales que financian una protección social menos desarrollada, son consideradas como competencia desleal por los países del norte, ya que podría dar lugar a deslocalizar inversiones, al ser la mano de obra más barata, además de competir en los mercados con una ventaja comparativa vía precio. Sin embargo, la coordinación de políticas sociales va encaminada a que los países con menores niveles de gasto social puedan acceder a los mercados en unas mejores condiciones competitivas gracias a los aumentos de productividad que generan los gastos sociales. En el fondo de este tema se haya la discusión académica de si los gastos sociales deben considerarse como gastos de consumo o por el contrario deberían ser considerados como gastos de inversión en capital humano.

La razón más poderosa para la coordinación de políticas sociales es la libre circulación de trabajadores. Si la Unión permitía la libre circulación de mercancías, servicios y capitales, el factor trabajo debería ser también liberalizado dada su consideración como capital humano. Los procesos tecnológicos, cada vez más sofisticados y especializados, requerían que los portadores de conocimiento (las personas) pudieran circular libremente para desarrollar, allí donde se requiriera, las inversiones de capital físico o la prestación de servicios. Esta liberalización obligaba a coordinar numerosos aspectos vinculados a la protección social de los lugares de origen y de destino. Por tanto, es la propia dinámica del mercado como asignador de recursos, el principal motor de la coordinación.

En este trabajo se examina el grado de convergencia en gasto social que se ha producido entre los países de la UE durante en período 1966-1992. Para ello, hemos aplicado la metodología desarrollada en los trabajos de Barro y Sala-i-Martin (1991 y 1992) a partir de datos sobre prestaciones de protección social (ESSPROS), elaborados por Eurostat.

El resto del trabajo se estructura de la siguiente forma. En la Sección 2 se presentan, de forma sucinta, los conceptos de convergencia utilizados. La Sección 3 contiene los resultados empíricos obtenidos. Por último, la Sección 4 recoge algunos comentarios finales y posibles extensiones.

2. Indicadores de convergencia

En la literatura existen dos indicadores de convergencia ampliamente utilizados del crecimiento económico: convergencia β y convergencia σ [véase, por ejemplo, Barro y Sala-i-Martin (1992)]. El primero se verifica si, para un conjunto de países, se encuentra que aquellos que comienzan el período muestral con rentas por debajo de la media tienden a crecer de forma más rápida que aquellos con rentas por encima de la media, mientras que el segundo se da cuando la dispersión entre la renta de distintas economías tiende a reducirse a lo largo del tiempo.

En nuestro caso, utilizaremos estos indicadores para evaluar la posible convergencia de las prestaciones de protección social *per capita*, por lo que la convergencia β se verificará cuando se obtenga una relación negativa entre la tasa de crecimiento promedio de dichas prestaciones y el logaritmo de su nivel inicial, mientras que detectaremos convergencia σ si la desviación típica del logaritmo del nivel de prestaciones de protección social *per capita* decrece con el paso del tiempo.

De esta forma, si G_{it} representa el nivel de prestaciones de protección social *per capita* del país i en el año t , la convergencia β se puede analizar mediante la estimación de la siguiente ecuación:

$$(1/T) \log(G_{iT}/G_{i0}) = a - b \log(G_{i0})/T + \epsilon_{it} \quad (1)$$

donde 0 y T representan el año inicial y final, respectivamente, y ϵ_{it} es el término de perturbación aleatoria. El estimador del parámetro b permite recuperar el ritmo de convergencia anual (β), ya que $b = (1 - e^{-\beta T})$.

3. Resultados empíricos

Como se indicó anteriormente, en este trabajo hemos utilizado datos sobre prestaciones de protección social (ESSPROS), elaborados por Eurostat. Las categorías consideradas en estas prestaciones son: enfermedad, invalidez y minusvalidez, enfermedad y accidentes de trabajo, vejez, supervivencia, maternidad, familia, colocación y movilidad, paro, vivienda y diversos. El período muestral abarca los años 1966-92 (los últimos disponibles), y los países analizados son Alemania, Bélgica, Dinamarca, España, Francia, Holanda, Irlanda, Italia, Luxemburgo, Portugal y Reino Unido (es decir, todos los países que en 1992 eran miembros de la UE, excepto Grecia, para el que no se disponen de datos).

El Gráfico 1 muestra la desviación típica de sección cruzada del logaritmo de las prestaciones de protección social *per capita*. Se observa que la dispersión se redujo inicialmente desde 0,85 en 1968 hasta 0,54 en 1974, para luego aumentar hasta 0,87 en 1978 y finalmente disminuir hasta 0,22 en 1992. El aumento entre 1974 y 1978 podría reflejar los efectos de la crisis energética que afectó de forma desigual a las distintas economías consideradas. De hecho, del Gráfico 2 (que ofrece, además del indicador anterior, la dispersión del PIB *per capita* durante el mismo período), se desprende una relación estrecha entre convergencia (divergencia) σ en prestaciones de protección social y PIB, en especial desde 1974. Esta relación queda de manifiesto al evaluar las correlaciones entre ambos indicadores, ya que para todo el período considerado dicha correlación es del 0.80, siendo 0,49, 0,96 y 0,95 para los subperíodos 1967-74, 1974-78 y 1978-92, respectivamente.

El Gráfico 3 muestra el patrón de convergencia de prestaciones de protección social en términos *per capita* para el

total del períodos considerado, mientras que los Gráficos 4 a 6 ofrecen dicho patrón para los subperíodos 1966-74, 1975-78 y 1979-92. Como se observa, estos gráficos ilustran claramente los procesos de convergencia y divergencia detectados mediante el indicador de convergencia σ .

En lo concerniente a la convergencia β , en el Cuadro 1 presentamos las estimaciones de la ecuación (1) para los períodos muestrales que acabamos de mencionar. Las columnas 2 y 3 muestran los resultados de sección cruzada obtenidos a partir de una estimación por mínimos cuadrados ordinarios (MCO), mientras que las columnas 4 a 6 y 7 a 9 ofrecen, respectivamente, los resultados de la estimación de panel de los modelos de efectos fijos y efectos variables.

Las estimaciones por MCO confirman las conclusiones derivadas del análisis de la convergencia σ , ya que se obtiene una convergencia en torno al 1% anual para el período 1966-74, una divergencia del 5% anual durante los años 1974-78 y, finalmente, una convergencia del 3% anual para el período 1978-92. Para toda la muestra (1964-92), la velocidad de convergencia se sitúa alrededor del 2%, si bien la hipótesis de que β se ha mantenido constante a lo largo del tiempo se rechaza mediante un contraste de razón de verosimilitudes ($RV=28,38$, significativo al 1%).

Cuando llevamos a cabo estimaciones de panel (lo que es apropiado dada la presencia de efectos fijos individuales distintos -tal como sugieren los valores del contraste F presentados en la columna 6 del Cuadro 1, todos significativos a los niveles habituales), los resultados apenas varían para los subperíodos 1966-74 y 1978-92, mientras que para los años 1974-78 se obtiene una mayor velocidad de divergencia. Algo parecido ocurre cuando estimamos el modelo de efectos aleatorios (pero esta vez se detecta una menor divergencia en el período de

crisis), si bien los valores del contraste de Hausman implican que existen correlaciones entre los efectos individuales y los regresores, por lo que los resultados obtenidos no son consistentes.

4. Consideraciones finales

En este trabajo se ha examinado el grado de convergencia en las prestaciones de protección social *per capita* registrado en la UE durante el período 1966-92. Para ello, se han utilizado datos de Eurostat correspondientes a 11 de los 12 países que en 1992 formaban la UE (no se disponen de los datos de Grecia), calculándose los dos indicadores más utilizados convergencia: convergencia σ y convergencia β . Del análisis de ambos indicadores se concluye que durante el período 1966-74 se produjo una cierta convergencia en dichas prestaciones, mientras que para los años 1974-78 se detecta una divergencia importante, si bien para el período 1978-86 se vuelve a registrar convergencia, esta vez mucho más intensa que en período inicial.

Estos resultados sugieren que algunos estados han venido realizando un mayor esfuerzo en lo que se refiere a los gastos de protección social para converger su situación a la existente en aquellos otros en los que dichos gastos tenían un volumen significativo. Existen tres posibilidades que explique esta evolución. En primer lugar, el crecimiento de los países que menos gastan es superior al de los países que más gastan por lo que el sector público dispone de más recursos para destinarlo a gastos sociales. En segundo lugar, los países que menos gastan aumentan la presión fiscal con el mismo nivel de crecimiento que el resto (por lo que se incrementa su capacidad para llevar a cabo gastos sociales). Y, en tercer lugar, la tendencia del gasto de los distintos países evoluciona en el mismo sentido pero en distinta intensidad, siendo financiado dicho gasto a través del déficit público.

Desde la perspectiva de la política económica estas posibilidades tienen una cierta relevancia. En primer lugar, la importancia que se le ha venido dando a los sistemas de

protección social procedente de la filosofía derivada del estado de bienestar que condiciona determinadas actuaciones de los decisores políticos a los logros de una cierta estabilidad social.

En este sentido hay que tener presente que la Unión Europea (UE) supedita toda política social a la convergencia en este tipo de gastos dado que las limitaciones del presupuesto comunitario no permitían aumentarlos y además tampoco puede actuar sobre los presupuestos nacionales ya que se atentaría contra la soberanía de cada nación. Es por ello que, en principio, la única posibilidad de que dichos gastos convergan dentro de la UE sería mediante un mayor crecimiento económico de los países con un menor nivel de desarrollo. La política que establece la UE en este ámbito es la de articular un conjunto de fondos estructurales que en el caso de los gastos de protección social quedan estrechamente vinculados al Fondo Social Europeo que está dedicado específicamente a financiar proyectos de capital humano¹.

En segundo lugar, cabe suponer, tal y como hemos indicado, que algunos países hayan tenido que aumentar su presión fiscal para poder llevar a cabo dichos gastos. Este hecho ha generado una serie de efectos perniciosos en la economía que han podido compensar los positivos que se derivaban de los mayores gastos sociales. En este sentido, esa mayor presión fiscal provocaría el descontento de los individuos propiciando en algunos casos bolsas de fraude. A su vez aquella acompañada de un gasto que no potencia la generación de capital físico ha frenado el crecimiento económico, de acuerdo con las posturas neoclásicas.

En tercer lugar, el mayor déficit que se contemplaba también

¹ Teniendo en cuenta los modelos de crecimiento endógeno, como es sabido, una mejora en el capital humano beneficia el nivel de crecimiento del país a largo plazo (Romer, 1986, Barro, 1990).

como factor que propiciaba esos mayores gastos, daría lugar a incrementos en los tipos de interés perjudicando de esta manera a la inversión y generando tensiones en los tipos de cambio (Sawyer, 1989).

Ante estas circunstancias y a la espera de un estudio posterior en el que trataremos de determinar más concretamente las causas que han propiciado la convergencia, cabe plantearse la política económica que se debería implantar. En este sentido hay que tener en cuenta la limitación respecto al presupuesto público establecida en el Tratado de Maastricht en la que se exige la contención de los déficit públicos. Ante este panorama, los países obligados a frenar sus niveles de gasto y de déficit, muchos de ellos acuciados no sólo por el nivel alcanzado en ambos sino también por su menor crecimiento, tienen nulas posibilidades de llevar a cabo estos gastos. Es más, la mayoría se han visto abocados a tener que reducirlos drásticamente (Kenen, 1995).

Es por ello que ante esta situación, no les quede más remedio que depender de los fondos estructurales concedidos, por lo que, necesariamente, la política que siga la UE tiene que ir encaminada a seguir otorgando dichos fondos.

Por último, resulta conveniente señalar algunas líneas futuras de investigación. En primer lugar, sería deseable extender el estudio con el fin de tratar de buscar una interpretación más estructural de este patrón obtenido, ampliando la regresión de convergencia (1), de forma que captase el efecto de las variables condicionantes más relevantes en la determinación de las prestaciones de protección social (es decir, análisis de convergencia β condicional). En segundo lugar, convendría realizar un ejercicio similar al aquí ofrecido para cada una de las componentes de dichas prestaciones y para cada uno de los países objeto de estudio. Ambos temas están en nuestra agenda inmediata de trabajo.

Gráfico 1: Convergencia en prestaciones de protección social

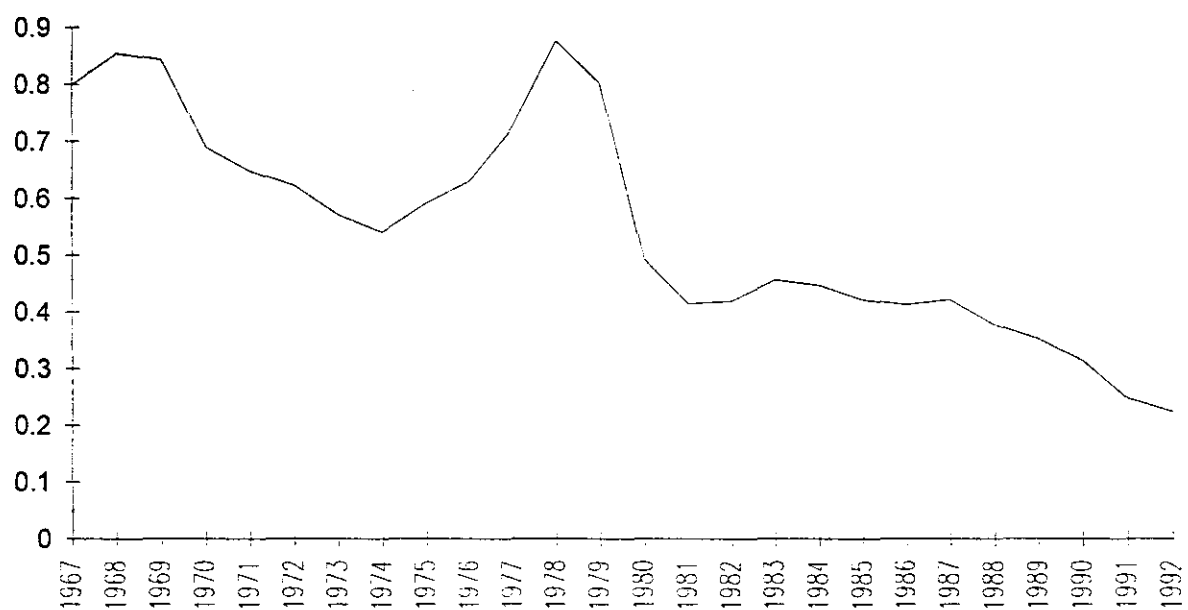


**Gráfico 2: Convergencia en prestaciones de protección social (PSS) y
convergencia en PIB**

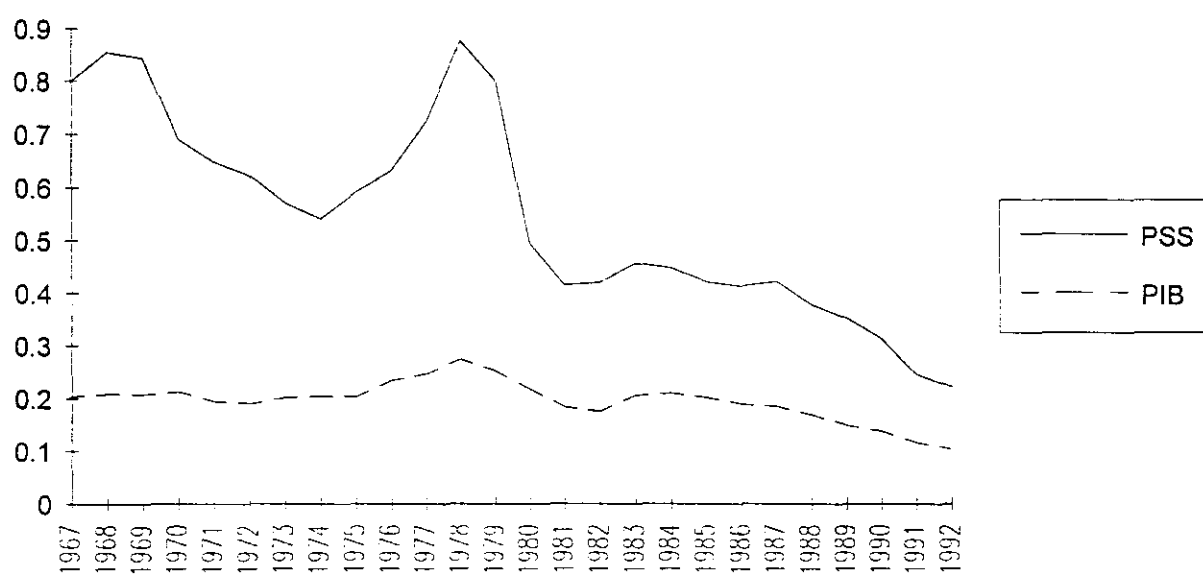


Gráfico 5:
Convergencia del gasto en protección social *per capita*
Unión Europea, 1975-78

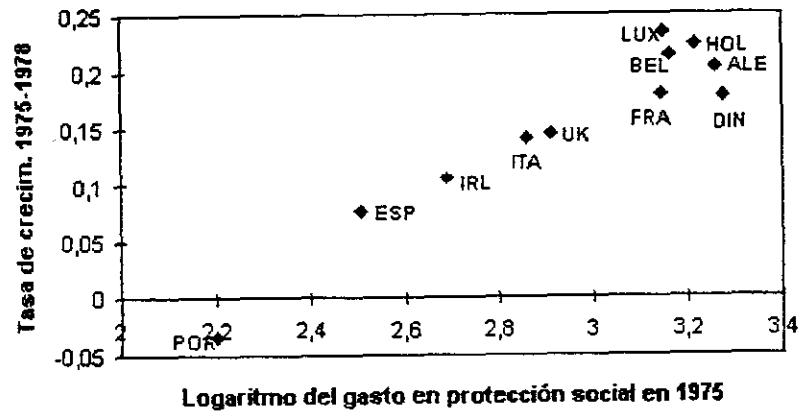


Gráfico 6:
Convergencia del gasto en protección social *per capita*
Unión Europea, 1979-92

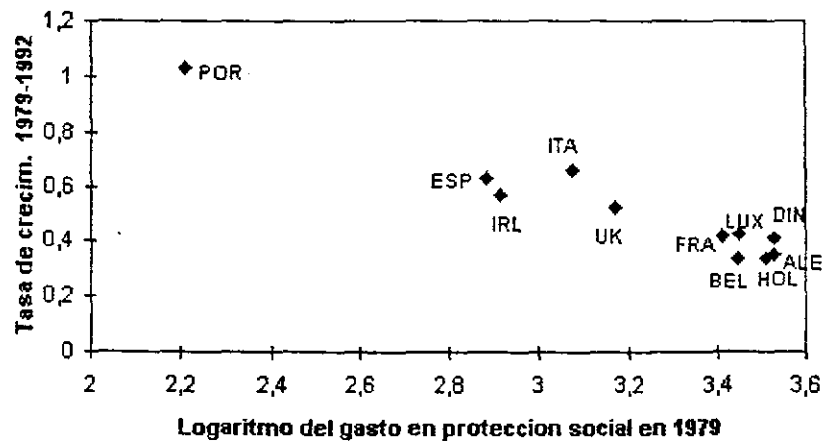


Gráfico 3:
Convergencia del gasto en protección social *per capita*
Unión Europea, 1966-92

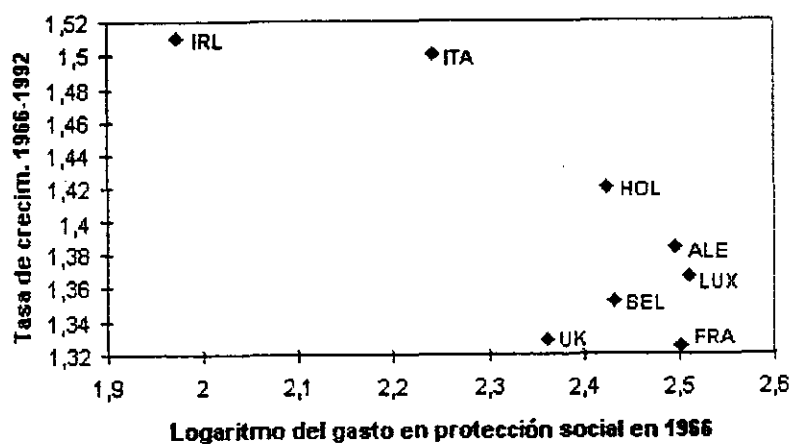
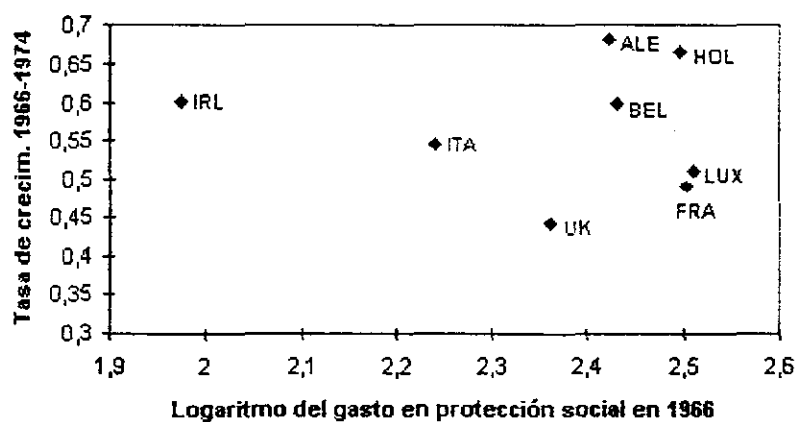


Gráfico 4:
Convergencia del gasto en protección social *per capita*
Unión Europea, 1966-74



Cuadro 1: Convergencia β

	MCO		PANEL					
			Efectos fijos			Efectos aleatorios		
Muestra	β (ee)	R^2 (eereg)	β (ee)	R^2 (eereg)	F	β (ee)	R^2 (eereg)	Hausman
1966-74	0.011 (0.006)	0.55 (0.21)	0.013 (0.002)	0.77 (0.19)	8.79	0.010 (0.005)	0.51 (0.16)	25.38
1974-78	-0.05 (0.008)	0.80 (0.09)	-0.06 (0.004)	0.42 (0.11)	8.40	-0.04 (0.008)	0.26 (0.12)	4.96
1978-92	0.031 (0.002)	0.70 (0.23)	0.028 (0.006)	0.72 (0.27)	9.43	0.023 (0.006)	0.70 (0.22)	10.02
1966-92	0.015 (0.006)	0.64 (0.11)	0.012 (0.002)	0.053 (0.56)	12.68	0.013 (0.002)	0.48 (0.58)	10.14

Notas:

- ee es el error estandar de β
- eereg es el error estandar de la regresión
- F es un contraste de igualdad de los efectos individuales
- Hausman es un contraste de independencia de los efectos individuales

Referencias:

Barro, R.J. (1990), "Government spending in a simple model of endogenous growth", Journal of Political Economy, Vol. 98.

Barro, R. J. y Sala-i-Martin, X. (1991): "Convergence across states and regions", Brookings Papers in Economic Activity.

Barro, R. J. y Sala-i-Martin, X. (1992): "Convergence", Journal of Political Economy.

Comisión Europea (1994): La política social europea. Un paso adelante para la Union. Direccion General de Empleo, Relaciones laborales y Asuntos Sociales. Luxemburgo.

Kenen, P.B. (1995): Economic and Monetary Union in Europe, Cambridge University Press, Cambridge.

Romer, P. (1986): "Increasing returns and long-run growth", Journal of Political Economy, 94.

Sawyer, J.A. (1989): Macroeconomic theory.- Keynesian and Neowalrasian models, Harvester Wheatsheaf.