

El Estado de Bienestar en México: Determinantes del Gasto Social (1985-2019)

The Welfare State in Mexico: determinants of social spending (1985-2019)

Abstract

The welfare state in Mexico has grown in recent decades, but its consolidation is still far from being a reality, given that social spending has not increased significantly. The present research aims to study the main economic and demographic determinants of social spending in Mexico during the period 1985-2019, based on a multiple linear regression model using OLS estimators. The results show that social spending as a share of GDP has a statistically significant relationship with public debt, tax revenues and the aging of the population.

Resumen

El Estado de bienestar en México ha crecido durante las últimas décadas, pero su consolidación aún está lejos de ser una realidad, dado que el gasto social no ha aumentado en cantidades significativas. La presente investigación tiene por objeto estudiar los principales determinantes económicos y demográficos del gasto social en México durante el período 1985-2019, a partir de un modelo de regresión lineal múltiple utilizando estimadores MCO. Los resultados muestran que la participación de gasto social sobre el PIB tiene una relación estadísticamente significativa con la deuda pública, los ingresos fiscales y el envejecimiento de la población.

Introducción

A pesar del crecimiento económico que ha tenido México en las últimas tres décadas, la pobreza en el país no se ha reducido manera significativa. La pobreza aqueja a aproximadamente la mitad de la población de acuerdo a las distintas medidas de CONEVAL.¹

Una de las estrategias para combatir la pobreza durante dichos años fue el aumento del gasto social realizado por el gobierno. En la década de los noventa, el gasto social tendría una función más destacada al no sólo aumentar en términos absolutos, sino también como porcentaje del PIB, incluso dentro del mismo gasto público tendría una mayor participación aun cuando éste llegase a disminuir.² El gasto social como proporción del PIB en México ha pasado de 3.1 % en 1990, a 7.5 % en 2019, lo que demuestra la intención de los últimos gobiernos por implementar un estado de bienestar³.

No obstante, si contrastamos esta cifra con los demás miembros de la Organización para la Cooperación y el Desarrollo Económicos (OCDE), México ocupa el último lugar en el gasto asignado a programas de bienestar social.⁴ Esto resulta sumamente preocupante, puesto que existe evidencia que apoya la proposición de que el gasto social es un fuerte predictor de un mejor bienestar agregado en los países de ingresos bajos y medios. Haile y Niño-Zarazúa encuentran que el gasto social tiene un efecto causal significativamente positivo sobre el índice de desarrollo humano (IDH), mientras que el gasto en salud tiene un deseable efecto negativo significativo sobre la mortalidad infantil.⁵

1. “Evolución de las dimensiones de la pobreza,” CONEVAL, consultado Mayo 14, 2021, <https://www.coneval.org.mx/Medicion/Paginas/Evolucion-de-las-dimensiones-de-pobreza-.aspx>

2. Oscar Martínez, Yasmin Salgado y Monika Meireles, “Gasto social, austeridad y combate a la pobreza: la experiencia mexicana”, *Economía UNAM* 16, no. 47 (Mayo, 2019): 81, <http://revistaeconomia.unam.mx/index.php/ecu/article/view/463>

3. “Gasto público social,” OCDE, consultado Mayo 14, 2021, <https://www.oecd.org/centrodemexico/medios/gasto-publico-social-ocde.htm>

4. OCDE, “Gasto público social.”

5. Fiseha Haile y Miguel Niño-Zarazúa, “Does Social Spending Improve Welfare in Low-income and Middle-income Countries?”, *Journal of International Development* 30, no. 3 (Octubre, 2017): 393, <https://doi.org/10.1002/jid.3326>

Con todos estos beneficios, resulta interesante saber el porqué México no ha aumentado lo suficiente el gasto social y qué determinantes podrían estar correlacionados con este componente. Al respecto, se han realizado diversos análisis sobre los determinantes del gasto social. Mayoral y Nabernegg estudian los principales determinantes económicos, demográficos y políticos del gasto social en América Latina entre 1990 y 2010, a partir de un modelo autorregresivo de corrección de errores, que utiliza el método generalizado de momentos (MGM).⁶ Por otra parte, Huber, Mustillo y Stephens examinan el régimen, partidismo, estructura estatal, variables económicas y demográficas de 18 países de América Latina en el período 1970-2000 para averiguar si éstas poseen una función determinante sobre el gasto social.⁷ Así mismo, Avelino, Brown y Hunter estiman un modelo de corrección de errores (ECM), para explorar los efectos de los cambios en la apertura comercial y financiera sobre el gasto social de 19 países latinoamericanos entre 1980 y 1999.⁸

No se ha llevado a cabo un estudio de los determinantes del gasto social en nuestro país, por lo que mediante un modelo de regresión lineal múltiple por Mínimos Cuadrados Ordinarios (MCO), se analizará la correlación de diversos factores económicos y demográficos con el gasto social de México durante el periodo 1985-2019.

Concepto de Estado de Bienestar

El término Estado de bienestar (en adelante EB) o Welfare State, acuñado en 1942, se utiliza generalmente para designar la actividad de los gobiernos dirigida a suministrar determinados servicios sociales por medio del gasto presupuestario; se financian las trans-

6. Fernando Mayoral y Markus Nabernegg, "Gasto social en América Latina 1990-2010: estudio de sus determinantes y análisis de convergencia", *Revista de Economía Mundial*, no. 40 (2015): 75, <https://www.redalyc.org/articulo.oa?id=86641407004>

7. Evelyne Huber, Thomas Mustillo y John D. Stephens, "Politics and Social Spending in Latin America", *The Journal of Politics* 70, no. 2 (Abril, 2008): 421, <https://doi.org/10.1017/s0022381608080407>

8. George Avelino, David S. Brown y Wendy Hunter, "The Effects of Capital Mobility, Trade Openness, and Democracy on Social Spending in Latin America, 1980-1999", *American Journal of Political Science* 49, no. 3 (Julio, 2005): 629, <https://doi.org/10.2307/3647736>

ferencias personales para la redistribución de la renta, así como el suministro público de asistencia sanitaria, servicios educativos, vivienda y otros servicios asistenciales.⁹ Mediante sistemas de seguridad social con garantía y coadministración estatal, el Estado de bienestar disminuye los riesgos sociales de los asalariados y garantiza un mínimo nivel de vida.¹⁰ Estos riesgos se pueden clasificar en tres categorías: riesgos por clase, que se distribuyen de manera desigual en distintos estratos socioeconómicos; riesgos en la trayectoria de vida, que son las repercusiones económicas en etapas específicas que provocan que la gente necesite recursos adicionales; y riesgos de cambio generacional, que son las desventajas que una generación hereda a la siguiente.¹¹

Por medio del gasto social, el EB puede ayudar a las personas que se encuentran en situación de necesidad y así mitigar los efectos de la pobreza, la desigualdad y las enfermedades. No obstante, no todos los países poseen sistemas de protección social eficaces por diversos factores que generan presión sobre el gasto social. Cuando se alcanza una etapa en la que este gasto no es sostenible, se produce la crisis del Estado de bienestar, que está impulsada por cambios operados en las condiciones económicas (crecimiento más lento y desindustrialización, por ejemplo) y en las tendencias demográficas (envejecimiento de la población); ambos ponen en peligro la viabilidad futura de los actuales compromisos contraídos por el EB.¹²

9. Francisco Comín Comín, “El surgimiento y desarrollo del Estado del bienestar (1883-1980),” en *El estado del bienestar en la encrucijada*, eds. Salvador Salort i Vives y Ramiro Muñoz Haedo (Alicante: Publicaciones Universidad de Alicante, 2007), 68.

10. Jaime Cárdenas Gracia, *Del Estado absoluto al Estado neoliberal*, (Ciudad de México: UNAM, Instituto de Investigaciones Jurídicas, 2017), 68.

11. Gøsta Esping-Andersen, *Fundamentos sociales de las economías postindustriales*, (Barcelona: Ariel, 2000) citado por Melina Altamirano et al., *Hacia un Estado de bienestar para México*, (Ciudad de México: El Colegio de México, 2020), 14.

12. Carlos Farge Collazos, “El Estado de bienestar”, *Enfoques* 19, no. 1-2 (2007): 53, <https://www.redalyc.org/articulo.oa?id=25913121005>

Determinantes del Gasto Social

Los principales determinantes del gasto social analizados en la literatura existente están relacionados a aspectos económicos, demográficos y políticos. El enfoque de este estudio será únicamente sobre variables económicas y demográficas.

Para diversos autores, la globalización es el principal determinante del gasto social. Wibbels argumenta que la economía internacional afecta lo social en los países en desarrollo de tres maneras: 1) el aumento de la exposición comercial y la dependencia del capital forzoso generan ciclos económicos importantes; 2) los ciclos económicos agudos contribuyen a un gasto social procíclico en virtud del acceso limitado de las naciones en desarrollo a los mercados crediticios internacionales durante las recesiones económicas; y 3) la severidad del ciclo económico combinada con una capacidad limitada para financiar el déficit acentúa las compensaciones políticas de los actores nacionales en el sector de bienes transables.¹³ Wibbels expone que, en aquellos países donde la exposición a la economía global ha disminuido de la mano de la diversificación económica, los estados de bienestar han mantenido un crecimiento.¹⁴

Por otro lado, los estudios de Garrett y Mitchell sobre la relación entre la globalización y el Estado de Bienestar en los países de la OCDE contribuyen a esta discusión.¹⁵ Los resultados de su investigación muestran que el efecto marginal de una mayor exposición al comercio en el periodo analizado fue un menor gasto público en magnitudes pequeñas. La apertura financiera internacional se asoció con un menor gasto público total, pero no influyó sobre ninguno de los componentes del estado de bienestar.¹⁶

13. Erik Wibbels, "Dependency Revisited: International Markets, Business Cycles, and Social Spending in the Developing World", *International Organization* 60, no.2 (Abril, 2006): 462, <https://doi.org/10.1017/S0020818306060139>

14. Wibbels, "Dependency Revisited," 462.

15. Geoffrey Garrett y Deborah Mitchell, "Globalization, government spending and taxation in the OECD", *European Journal of Political Research* 39, no.2 (Marzo, 2001): 174, <https://doi.org/10.1023/A:1011043120145>

16. Garrett y Mitchell, "Globalization, government spending," 174

Con respecto a la relación entre el ciclo económico y el gasto, Braun y Gresia encuentran que el comportamiento procíclico de la política fiscal, además del aumento de la volatilidad económica, limita la capacidad de los gobiernos latinoamericanos para proteger a los pobres durante las recesiones.¹⁷ Recientemente, esto se observó también en varios países de la OCDE: las tasas de crecimiento anual del gasto público en servicios sociales disminuyeron por la Gran Recesión, desde el 3.6 % en el período previo a la crisis, hasta solo el 0.9 % en los cinco años siguientes.¹⁸

Otra variable económica que influye sobre el gasto social es la deuda pública. Las razones de endeudamiento más altos reducen el gasto social, no sólo por el sobre coste en el pago de intereses (efecto que es especialmente importante en América Latina), sino porque están asociados a recortes en el gasto total que afectan a los sectores sociales.¹⁹ En promedio, en los países en desarrollo, los préstamos de las organizaciones multilaterales tienen un efecto adverso adicional sobre el gasto social, probablemente porque imponen una mayor disciplina sobre el gasto total.

El otro grupo de factores que afectan al gasto social son los demográficos. El creciente envejecimiento de la población, gracias al aumento de la esperanza de vida unido a la disminución en la tasa de natalidad, está comenzando a impactar en los gastos públicos en salud y jubilación, lo que presiona a muchos gobiernos (principalmente de países desarrollados) a reestructurar su política social.²⁰

17. Miguel Braun y Luciano di Gresia, "Towards Effective Social Insurance in Latin America: The Importance of Countercyclical Fiscal Policy", Inter-American Development Bank, WP no. 409 (Julio, 2003): 33, <http://dx.doi.org/10.2139/ssrn.1818698>

18. OCDE, "Gasto público social."

19. Eduardo Lora y Mauricio Olivera, "Public Debt and Social Expenditure: Friends or Foes?", Inter-American Development Bank, WP no. 563 (Mayo, 2006): 17, <https://publications.iadb.org/en/publication/10725/public-debt-and-social-expenditure-friends-or-foes>

20. Fernando Martín Mayoral, Betty Espinosa y Markus Naberregg, "Determinantes del gasto social en América Latina", Reunión de Estudios Regionales, no.38 (Noviembre, 2012): 16, <https://old.aecr.org/web/congresos/2012/Bilbao2012/htdocs/pdf/p551.pdf>

Revisión de Literatura

La mayor parte de los análisis se centran en los niveles de gasto social, globalización y el envejecimiento de la población. Al examinar datos anuales sobre gasto social de 19 países latinoamericanos entre 1980 y 1999, Avelino, Brown y Hunter estiman un modelo de corrección de errores (ECM), que les permitió establecer conexiones con algunas contribuciones recientes que exploran los efectos de los cambios en la apertura comercial y financiera.²¹ Con dicho modelo, encuentran una correlación positiva y estadísticamente significativa entre la apertura comercial y la seguridad social (medida como el gasto público en pensiones como porcentaje del PIB), que contrasta marcadamente con la relación negativa obtenida por Kaufman y Segura-Ubiergo.²² No utilizaron el método de Mínimos Cuadrados Ordinarios (MCO), puesto que la estructura temporal de su conjunto de datos aumentaba la posibilidad de autocorrelación (al violar el supuesto de MCO de que los errores son independientes entre sí). Otra manera de corregir el problema de MCO es utilizar errores estándar corregidos por panel, tal como lo demuestran Beck y Katz.²³

A su vez, diversos trabajos se acercan a la autocorrelación mediante el uso de una variable dependiente rezagada. Achen demuestra, sin embargo, que este método puede llevar a los investigadores a descartar por error la importancia de las variables, especialmente si no varían drásticamente con el tiempo, por lo que sugiere transformar los datos para abordar la autocorrelación y evitar las trampas de utilizar la variable dependiente rezagada.²⁴ También existen problemas de autocorrelación en los residuos, producidos por variables explicativas con tendencia y donde se dispone de periodos cortos, como es el caso del PIB, el gasto

21. Avelino, Brown y Hunter, "The Effects of Capital Mobility," 629

22. Robert R. Kaufman y Alex Segura-Ubiergo, "Globalization, Domestic Politics, and Social Spending in Latin America: A Time-Series Cross-Section Analysis, 1973-97", *World Politics* 53, no. 4 (Julio, 2001): 578, <https://www.jstor.org/stable/25054165>

23. Nathaniel Beck y Jonathan N. Katz, "What to do (and not to do) with Time-Series Cross-Section Data", *The American Political Science Review* 89, no.3 (Septiembre, 1995): 636, <https://doi.org/10.2307/2082979>

24. Christopher Achen, "Why Lagged Dependent Variables Can Suppress the Explanatory Power of Other Independent Variables", *Annual Meeting of the American Political Science Association*, (Julio, 2000): 11, <http://www-personal.umich.edu/franzese/Achen.2000.LDVstealingExplanPower.pdf>

social o el grado de apertura comercial. Para solucionar esto, Snyder y Yackovlev utilizan estimadores Mínimos Cuadrados Generalizados Factibles (MCGF).²⁵

Por otra parte, Lora y Olivera analizan los efectos de la deuda pública total (externa e interna) sobre el gasto social a nivel mundial y en América Latina al utilizar un panel desequilibrado de 58 países en desarrollo para el período 1985-2003.²⁶ Para abordar los problemas de endogeneidad en datos de panel, utilizaron el estimador de Arellano y Bond, que utiliza valores rezagados de las variables explicativas (en primeras diferencias) como instrumentos para esas mismas variables. La validez del método se basa en el supuesto de que los instrumentos están correlacionados con las variables explicativas, pero no con la variable dependiente. Sus hallazgos indican que los índices de endeudamiento más altos reducen el gasto social y la parte más grande y más robusta de este efecto se produce directamente desde el saldo de la deuda hasta el gasto social, que se ve más afectado que otros gastos cuando aumenta la deuda.

Metodología y Datos

Con base en el fundamento teórico previamente descrito y las metodologías utilizadas por otros autores, se formuló un modelo econométrico de regresión lineal múltiple que trata de explicar el comportamiento del gasto social en México durante el período 1985-2019. La participación del gasto social en el PIB de un país depende del nivel de producción, la deuda pública, la apertura internacional y el envejecimiento de la población. Por lo tanto, el modelo empírico fue estructurado de la siguiente manera:

$$GS_t = \alpha_0 + \alpha_1 PIB_t + \alpha_2 DGG_t + \alpha_3 TX_t + \alpha_4 EXP_t + \alpha_5 IED_t + \alpha_6 N_t + \epsilon_t$$

25. James M. Snyder e Irene Yackovlev, "Political and Economic Determinants of Changes in Government Spending on Social Protection Programs", Massachusetts Institute of Technology (Abril, 2000); 19, <http://economics.mit.edu/files/1207>

26. Lora y Olivera, "Public Debt and Social Expenditure," 17.

donde $\alpha_0, \alpha_1, \dots, \alpha_n$ son los parámetros a estimar del modelo; t representa la perturbación estocástica; GSt es el gasto social; $PIBt$ denota el producto interno bruto; $DGGt$ es la deuda pública; TXt comprende los ingresos fiscales; $EXPt$ son las exportaciones; $IEDt$ es la inversión extranjera directa y Nt representa el envejecimiento poblacional. Cada uno de estos regresores posee un respaldo empírico que a continuación se explicarán.

Se incorporó el PIB debido a los diversos estudios empíricos que respaldan la relación entre ciclo económico y gasto social. Por ejemplo, Braun y Gresia realizan una extensa revisión de literatura en la que confirman que el gasto social es fuertemente procíclico en América Latina; los gobiernos tienden a aumentar el gasto a favor de los pobres durante las expansiones y reducirlo durante las recesiones.²⁷ A su vez, Hicks y Wodon (2000) muestran que tanto en México, como en Argentina, la proporción del PIB destinada al gasto social focalizado cayó como consecuencia de la crisis de 1994, que afectó a toda la región.²⁸

Por otro lado, en el análisis se incluye también a las exportaciones y a la inversión extranjera directa debido a que son utilizadas como variables proxies por múltiples autores para medir la globalización. Por ejemplo, en su trabajo sobre el impacto de la globalización en el esfuerzo del estado de bienestar de los países de la OCDE, Garrett y Mitchell definen a la globalización en términos de comercio total, importaciones, inversión extranjera directa e integración del mercado financiero.²⁹ A su vez, Kaufman y Segura analizan si la integración en los mercados globales ha restringido el gasto social y se basan en gran medida en la distinción trazada por Geoffrey Garrett entre una hipótesis de eficiencia, que postula que una mayor exposición a la competencia internacional inducirá a los gobiernos a reducir los gastos sociales, además, una hipótesis de compensación, que enfatiza en incentivos para invertir en capital humano y responder a las demandas políticas de protección frente al riesgo.³⁰ Para la apertura a los mercados internacionales de capital, dichos autores utilizan un

27. Braun y Gresia, "Towards Effective Social Insurance," 13.

28. Norman Hicks y Quentin Wodon, "Protección social para los pobres en América Latina", Revista de la CEPAL, no. 73 (Abril, 2001): 109, <https://www.cepal.org/es/publicaciones/10721-proteccion-social-pobres-america-latina>

29. Garrett y Mitchell, "Globalization, government spending and taxation," 146.

30. Kaufman y Segura-Ubierno, "Globalization, Domestic Politics, and Social Spending," 554.

índice de liberalización de la cuenta de capital que contempla el grado de control sectorial sobre la inversión extranjera y la integración comercial la calculan como importaciones más exportaciones como porcentaje del PIB.

Además de las razones expuestas con anterioridad en la tercera sección de este artículo, la deuda pública se incorpora al modelo en vista de una multitud de hallazgos sólidos que indican que los índices de endeudamiento más altos reducen el gasto social.³¹ Los ingresos fiscales también son importantes en el análisis del gasto social, puesto que los gobiernos enfrentan una restricción presupuestaria que condiciona su capacidad de gasto.³² Por último, el factor demográfico es crucial porque una vez que se implementan los esquemas de seguridad social, se crean derechos que son difíciles de cambiar y los gastos crecen con el crecimiento de los grupos con derechos. La explicación más plausible es el costo político de recortar los derechos, pero el anclaje legal de los esquemas de seguridad social posiblemente contribuya a su resiliencia.³³

El método utilizado para la estimación fue el de Mínimos Cuadrados Ordinarios (MCO). Se utilizó este método porque el modelo era lineal con una variable dependiente que tiene datos de series de tiempo continuas, además de que otros autores utilizaron este método como primera opción. Para evitar los problemas mencionados con anterioridad, se probaron los supuestos de MCO mediante varias pruebas: Breusch-Pagan y White para determinar la heterocedasticidad, Shapiro-Wilk W para la normalidad del término de error y la prueba de inflación de la varianza para la multicolinealidad de las variables independientes.

Para realizar la presente investigación, se utilizaron las siguientes variables de la base de datos de la Organización para la Cooperación y el Desarrollo Económicos (OCDE): gasto público social (% del PIB), ingresos fiscales (% del PIB) y personas de 65 años o más (% del PIB).

31. Lora y Olivera, "Public Debt and Social Expenditure," 28.

32. Mayoral y Nabernegg, "Gasto social en América Latina," 70.

33. Huber, Mustillo y Stephens, "Politics and Social Spending in Latin America", 432.

de la población total).³⁴ Los datos del crecimiento del PIB (% anual), las exportaciones de bienes y servicios (US\$ a precios actuales) y la inversión extranjera directa (entrada neta de capital, BP; US\$ a precios actuales) fueron obtenidos de los Indicadores del Desarrollo Mundial del Banco Mundial.³⁵ Las cifras de la deuda del gobierno general (% del PIB) se obtuvieron de dos fuentes distintas: para el periodo 1985-1995, se consultaron las estadísticas históricas del Centro de Estudios de las Finanzas Públicas (CEFP).³⁶ Para los años restantes (1996-2019), se empleó la base de datos del Fondo Monetario Internacional (FMI).³⁷ La razón por la que se utilizaron dos fuentes de datos se debe a que ningún organismo internacional contempla la serie completa desde 1985 hasta la actualidad. A excepción de las exportaciones y la inversión extranjera directa, todas las variables se agregaron al modelo directamente como se citan. Estas dos variables no se incorporaron como las demás, ya que no estaban disponibles como porcentaje del PIB durante el período estudiado y se optó por utilizarlas como variaciones anuales (%) y no en niveles para controlar la posible endogeneidad entre los regresores.³⁸ En la Tabla 1, elaborada mediante el software estadístico STATA 13, se presentan las estadísticas descriptivas de las variables utilizadas. Así mismo, en la Tabla 2 se muestra la descripción de las variables y fuente de datos.

34. “Centro de México – Estadísticas,” OCDE, consultado Mayo 17, 2021, <https://www.oecd.org/centrodemexico/estadisticas/>

35. “Indicadores del Desarrollo Mundial,” Banco Mundial, consultado Mayo 17, 2021, <https://databank.bancomundial.org/source/world-development-indicators>

36. Centro de Estudios de las Finanzas Públicas, Estadísticas Históricas de la Deuda Pública en México, 1980-2001, (Ciudad de México: Cámara de Diputados, H. Congreso de la Unión, 2002), 17.

37. “World Economic Outlook 2021,” FMI, consultado Mayo 17, 2021, <https://www.imf.org/external/datamapper/profile/MEX>

38. Mayoral y Nabernegg, “Gasto social en América Latina,” 79.

Variable	Media	Desv. Est.	Mínimo	Máximo
GS_t	5.1560	2.0150	1.7250	7.6760
PIB_t	2.3686	2.8861	-6.2912	6.8469
DGG_t	45.1457	10.2743	25.2000	78.6000
TX_t	13.0025	1.8346	9.9120	16.6180
EXP_t	7.9467	11.3605	-23.6560	28.8544
IED_t	8.4181	34.2159	-57.4044	102.6115
N_t	5.3438	1.0713	3.9140	7.4060 height

Cuadro 1: Estadísticas descriptivas.
Fuente: Elaboración propia con STATA 13.

Variable	Unidad de medición	Fuente de datos
GS_t	Gasto público social % del PIB	OCDE
PIB_t	Producto Interno Bruto Tasa (%) Variación anual	Banco Mundial
DGG_t	Deuda del gobierno general % del PIB	FMI y CEFP
TX_t	Ingresos fiscales % del PIB	OCDE
M_t	Exportaciones de bienes y servicios Tasa (%) Variación anual	Banco Mundial
IED_t	Inversión extranjera directa Tasa (%) Entrada neta de capital (BP) Variación anual	Banco Mundial
N_t	Personas de 65 años o más Tasa (%) Porcentaje de la población	OCDE

Cuadro 2: Tabla 2. Descripción de las variables y fuente de datos.
Fuente: Elaboración propia.

Resultados

Prueba de Inflación de la Varianza

La Tabla 3 presenta los resultados de la prueba del factor de inflación de la varianza. Se observa que no hubo multicolinealidad entre las variables independientes asociadas en el modelo utilizado para el estudio. El bajo factor general de inflación de la varianza (de 1.52) confirma que el modelo estaba bien especificado y no posee problema de multicolinealidad.

Variable	VIF	1/VIF
TX	2.070	0.484
DGG	1.720	0.582
PIB	1.440	0.695
EXP	1.420	0.707
N	1.350	0.743
IED	1.110	0.900
Media VIF	1.52	

Cuadro 3: **Prueba de inflación de varianza para multicolinealidad**

Fuente: Elaboración propia con STATA 13.

Pruebas de Heterocedasticidad

Se realizó la prueba de Breusch-Pagan y la prueba de White para detectar heterocedasticidad. Ambas pruebas mostraron valores altos de p (0.290 y 0.436, respectivamente), lo que sugiere que no se puede rechazar la hipótesis nula de que los residuos sean homocedásticos. Los resultados se muestran en la Tabla 4.

	Chi ²	Prob > chi ²
Prueba de Breusch-Pagan	1.12	0.290
Prueba de White	27.51	0.436

Cuadro 4: **Pruebas de heteroscedasticidad.**

Fuente: Elaboración propia con STATA 13.

Prueba de Normalidad

El resultado de la prueba Shapiro-Wilk W muestra un valor p de 0.114. Esto fue superior a 0.05, lo que revela que los residuos poseen una distribución normal.

Variable	W	V	z	Prob z
Error	0.950	1.782	1.206	0.114

Cuadro 5: **Prueba de Shapiro-Wilk W.**

Fuente: Elaboración propia con STATA 13.

Resultados de la Regresión

En la tabla 6 se presentan los resultados de la estimación con MCO. Como puede verse, si la variación anual del PIB aumenta en 1 %, el gasto social como proporción del PIB disminuiría en -0.01 %. Esto coincide con los resultados Avelino et al., pero dicha variable no es estadísticamente significativa al nivel de confianza de 95 %. Con respecto a las variables relacionadas a las finanzas públicas, se encontró que la deuda pública (% del PIB) es estadísticamente significativa con el signo esperado; si la deuda pública incrementa en 1 por ciento, el gasto social disminuirá -0.029 %. La variable ingresos fiscales (% del PIB) también resultó significativa, aunque no con el signo que se esperaba. Estos resultados coinciden con

los de Lora y Olivera, aunque sólo para la deuda pública. En cuanto a las variables proxy de la globalización, ninguna es estadísticamente significativa, sin embargo, las exportaciones mantienen el signo esperado, resultado que corresponde con los obtenidos por Wibbels. La población de 65 años o más (%de la población total), variable demográfica empleada, mantiene el signo, tamaño y significancia estadística; por cada punto porcentual que aumenta este sector de la población, el gasto social incrementa en 1.89%. El coeficiente de determinación fue de 0.95, lo que indica que las variables empleadas explican al gasto social en un 95%.

Variable dependiente: Gasto social (% PIB)	
VARIABLES EXPLICATIVAS	COEFICIENTE
Δ PIB (%)	-0.0122 (0.0340)
Deuda pública (% del PIB)	-0.0291*** (0.0104)
Ingresos fiscales (% del PIB)	-0.1401** (0.0642)
Δ Exportaciones (%)	-0.0102 (0.0085)
Δ IED (%)	0.0006 (0.0025)
Población 65 años (% de la población total)	1.8972*** (0.0887)
Constante	-1.7399** (0.6671)
Observaciones	35
Estadístico F	96.23
R ²	0.9537
R ² ajustado	0.9438

Cuadro 6: **Resultados de la regresión**

Nota: *p<0.1; **p<0.05; ***<0.01. El error estándar se encuentra entre paréntesis.

Fuente: elaboración propia con datos de la OCDE, Banco Mundial, CEFP y el FMI utilizando el software STATA 13.

Conclusiones

El presente estudio ha tenido por objetivo analizar los determinantes del gasto social en México durante el periodo 1985-2019. Para ello, se han tenido en cuenta factores económicos y demográficos que tienen fundamento teórico.

El modelo econométrico se estimó a partir de Mínimos Cuadrados Ordinarios (MCO). Para comprobar que se cumplieran los supuestos de MCO, se realizaron pruebas de heterocedasticidad, multicolinealidad y distribución normal, que mostraron que el modelo estaba bien especificado y no violaba ninguno de los supuestos. Los resultados del análisis empírico muestran que la deuda pública, los ingresos fiscales y el envejecimiento de la población son estadísticamente significativos, lo que significa que los cambios en estas variables explican el gasto social. La relación negativa entre deuda y gasto social encontrada implica que el gobierno no debe incrementar la deuda pública si el objetivo es consolidar un estado de bienestar. La deuda externa de México disminuyó a principios de la década de 2000, pero con la crisis de 2008, cambió la tendencia y esta ha venido en aumento. También se encontró que el envejecimiento de la población ha influido de manera positiva sobre el gasto social. Por cada punto porcentual que aumenta la población mayor a 65 años, el gasto social incrementa en 1.89 %. La variable ingresos fiscales también resultó significativa, pero no con el signo esperado, lo que indica que el gasto social no es procíclico en el caso de nuestro país.

Esto supone un avance en el análisis de este gasto en México, puesto que ningún estudio había tenido este mismo enfoque. Mediante estos resultados, se puede analizar qué variables son las que inciden más sobre el gasto social, para que éstas no supongan un límite en la consolidación de un Estado de bienestar que disminuya los riesgos sociales a los que está expuesta la población. Cabe recalcar que un hipotético aumento del gasto social debe contemplar la sostenibilidad fiscal que supondría dicho incremento, puesto que si no existe espacio fiscal, el Estado de bienestar colapsaría.

Referencias

- [1] Achen, Christopher. “Why Lagged Dependent Variables Can Suppress the Explanatory Power of Other Independent Variables” Annual Meeting of the American Political Science Association, (Julio, 2000): 1-42. <http://www-personal.umich.edu/franze-se/Achen.2000.LDVstealingExplanPower.pdf>
- [2] Altamirano, Melina, Raymundo Campos, Carlos Alba, Horacio Sobarzo, Jesús Carrillo, Alexis Rodas, Andrea Arenas y Alejandro Porcel. Hacia un Estado de bienestar para México. Ciudad de México: El Colegio de México, 2020.
- [3] Avelino, George, David S. Brown y Wendy Hunter. “The Effects of Capital Mobility, Trade Openness, and Democracy on Social Spending in Latin America, 1980-1999” American Journal of Political Science 49, no. 3 (Julio, 2005): 625-641. <https://doi.org/10.2307/3647736>
- [4] Banco Mundial. “Indicadores del Desarrollo Mundial.” Consultado Mayo 17, 2021. <https://databank.bancomundial.org/source/world-development-indicators>
- [5] Braun, Miguel, y Luciano di Gresia. “Towards Effective Social Insurance in Latin America: The Importance of Countercyclical Fiscal Policy” Inter-American Development Bank, WP no. 409 (Julio, 2003): 1-62. <http://dx.doi.org/10.2139/ssrn.1818698>
- [6] Beck, Nathaniel, y Jonathan N. Katz. “What to do (and not to do) with Time-Series Cross-Section Data” The American Political Science Review 89, no.3 (Septiembre, 1995): 634-647. <https://doi.org/10.2307/2082979>
- [7] Cárdenas Gracia, Jaime. Del Estado absoluto al Estado neoliberal. Ciudad de México: UNAM, Instituto de Investigaciones Jurídicas, 2017.
- [8] CEFP. Estadísticas Históricas de la Deuda Pública en México, 1980-2001. Ciudad de México: Cámara de Diputados, H. Congreso de la Unión, 2002.

- [9] Comín Comín, Francisco. “El surgimiento y desarrollo del Estado del bienestar (1883-1980).” En *El estado del bienestar en la encrucijada*, editado por Salvador Salort i Vives y Ramiro Muñoz Haedo, 67-128. Alicante: Publicaciones Universidad de Alicante, 2007.
- [10] CONEVAL. “Evolución de las dimensiones de la pobreza.” Consultado Mayo 14, 2021. <https://www.coneval.org.mx/Medicion/Paginas/Evolucion-de-las-dimensiones-de-pobreza-.aspx>
- [11] Esping-Andersen, Gøsta. *Fundamentos sociales de las economías postindustriales*. Barcelona: Ariel, 2000.
- [12] Farge Collazos, Carlos. ^{.E1} Estado de bienestar.^{Enfoques} 19, no. 1-2 (2007): 45-54. <https://www.redalyc.org/articulo.oa?id=25913121005FMI>. “World Economic Outlook 2021.” Consultado Mayo 17, 2021. <https://www.imf.org/external/datamapper/profile/MEX>
- [13] Garrett, Geoffrey, y Deborah Mitchell. “Globalization, government spending and taxation in the OECD” *European Journal of Political Research* 39, no.2 (Marzo, 2001): 145–177. <https://doi.org/10.1023/A:1011043120145>
- [14] Haile, Fiseha, y Miguel Niño-Zarazúa. “Does Social Spending Improve Welfare in Low-income and Middle-income Countries?” *Journal of International Development* 30, no. 3 (Octubre, 2017): 367-398. <https://doi.org/10.1002/jid.3326>
- [15] Huber, Evelyne, Thomas Mustillo y John D. Stephens. “Politics and Social Spending in Latin America” *The Journal of Politics* 70, no. 2 (Abril, 2008): 420-436. <https://doi.org/10.1017/s0022381608080407>
- [16] Kaufman, Robert R., y Alex Segura-Ubierno. “Globalization, Domestic Politics, and Social Spending in Latin America: A Time-Series Cross-Section Analysis, 1973–97” *World Politics* 53, no. 4 (Julio, 2001): 553-587. <https://www.jstor.org/stable/25054165>
- [17] Lora, Eduardo, y Mauricio Olivera, “Public Debt and Social Expenditure: Friends or Foes?”. Inter-American Development Bank, WP no. 563 (Ma-

-
- yo, 2006): 1-35. <https://publications.iadb.org/en/publication/10725/public-debt-and-social-expenditure-friends-or-foes>
- [18] Martín Mayoral, Fernando, Betty Espinosa y Markus Nabernegg. “Determinantes del gasto social en América Latina” Reunión de Estudios Regionales, no.38 (Noviembre, 2012): 1-25. <https://old.aecr.org/web/congresos/2012/Bilbao2012/htdocs/pdf/p551.pdf>
- [19] Martínez, Oscar, Yasmin Salgado y Monika Meireles. “Gasto social, austeridad y combate a la pobreza: la experiencia mexicana” Economía UNAM 16, no. 47 (Mayo, 2019): 66-92. <http://revistaeconomia.unam.mx/index.php/ecu/article/view/463>
- [20] Mayoral, Fernando, y Markus Nabernegg. “Gasto social en América Latina 1990-2010: estudio de sus determinantes y análisis de convergencia” Revista de Economía Mundial, no. 40 (2015): 67-90. <https://www.redalyc.org/articulo.oa?id=86641407004>
- [21] OCDE. “Gasto público social.” Consultado Mayo 14, 2021. <https://www.oecd.org/centrodemexico/medios/gasto-publico-social-ocde.htm>
- [22] OCDE. “Centro de México – Estadísticas.” Consultado Mayo 17, 2021. <https://www.oecd.org/centrodemexico/estadisticas/>
- [23] Snyder, James M., e Irene Yackovlev. “Political and Economic Determinants of Changes in Government Spending on Social Protection Programs” Massachusetts Institute of Technology (Abril, 2000); 1-60. <http://economics.mit.edu/files/1207>
- [24] Wibbels, Erik. “Dependency Revisited: International Markets, Business Cycles, and Social Spending in the Developing World” International Organization 60, no.2 (Abril, 2006): 433-468. <https://doi.org/10.1017/S0020818306060139>