

Субъективное благополучие и адаптация к бедности в России: что показывают данные РЛМС

Хай-Ан Данг, М.М. Локшин, К.Р. Абанокова

Доход и субъективное благополучие

- Давно является предметом эмпирических исследований (Blanchflower & Oswald, 2004; Clark, et al., 2008; Diener & Biswas-Diener; 2002, Diener et al., 2010; Di Tella & MacCulloch, 2006; Easterlin, 1995; Frey & Stutzer, 2002; Senik, 2005):
 - ✓ Богатые более удовлетворены жизнью, чем бедные
 - ✓ С ростом дохода удовлетворенность растет замедляющимся темпом
 - ✓ В долгосрочной динамике рост среднего дохода в стране часто не коррелирует с ростом удовлетворенности (парадокс Истерлина)
 - ✓ Население более богатых стран, в среднем, более удовлетворены жизнью, чем население бедных стран
- Большая часть исследований измеряет корреляцию между текущим уровнем благосостояния и текущим уровнем дохода (и/или других переменных)
- Оценка текущей ситуации может зависеть от ситуации, которая была в прошлом
 - ✓ формирование привычки (Gorman, 1967; Pollak, 1970; Spinnewyn, 1981) и опыт: доходы прошлых периодов также могут влиять на удовлетворенность (Kahneman and Tversky, 1979; Jantti et al., 2014; Clark, 2015) → интерес к адаптации

Исследования адаптации

- Адаптация к жизненным событиям: способен ли индивид адаптироваться к новой ситуации, т.е. восстановить свой уровень благосостояния или счастья
 - ✓ рост оплаты труда, брак, развод, рождение детей, миграция, безработица (Clark, Diener, et al., 2008; Clark & Georgellis, 2013; Frijters, Johnston, & Shields, 2011; Nowok, et al., 2013; Oswald & Powdthavee, 2008; Clark, 2018)
 - ✓ Подтверждается (частичная/полная) адаптация ко всем событиям, кроме безработицы (Clark, D'Ambrosio, and Ghislandi, 2014; Clark, 2018)
- Адаптация к росту дохода (Ferrer-i-Carbonell and Van Praag, 2008; Di Tella et al., 2010; Vendrik, 2013; Galiani et al., 2016)
 - ✓ Полная адаптация к изменению дохода в течение 4 лет, женщины и занятые на рынке труда менее адаптивны (Di Tella & Mac-Culloch, 2010 (Germany))
 - ✓ Адаптация к изменению трудового дохода в течении 1 года (Clark, 1999 (Великобритания))
 - ✓ Адаптацией объясняется существование парадокса Истерлина (обзор Clark, 2016)
- Исследование адаптации к росту дохода на данных по России (Ларин и Филясов, 2018)
 - ✓ подтверждение адаптации на данных РЛМС за 2001-2016: изменение доходов оказывает лишь краткосрочный эффект на субъективное благополучие

Мотивация

- Предыдущие исследования не говорят ничего об адаптации к бедности
 - ✓ отсутствие достаточного числа исследований связано с отсутствием панельных данных
 - ✓ только несколько исследований анализируют адаптацию субъективного благосостояния к низкому доходу/бедности
- Почему это важно?
 - ✓ Субъективное благополучие как один из индикаторов экономического роста на национальном уровне (Fleurbaey & Blanchet, 2013)
 - ✓ “Если бедные адаптируются, то должно ли государство меньше беспокоиться о них?” (Clark, 2009)
 - ✓ При адаптации бедные могут терять мотивацию, что ведет к хронической бедности и требует долгосрочных государственных программ и больше государственных ресурсов
- Мы фокусируемся на адаптации к низкому доходу, т.е. бедности
 - ✓ Нас интересует, насколько меняется уровень благополучия в зависимости от длительности нахождения в бедности
 - ✓ Адаптация: чем дольше в бедности, тем меньше бедность оказывает влияние на субъективное благополучие

Исследования адаптации к бедности

- Clark et al. (2016) на примере Германии за 1985-2012:
 - ✓ Анализировали бедность на уровне индивидов
 - ✓ Уровень удовлетворенности падает с ростом и интенсивностью бедности
 - ✓ Не находят подтверждения адаптации к бедности: каждый последующий год в бедности также отражается на неудовлетворенности, как и первый год
 - Анализ ограничен только теми индивидами, которые впервые попали в состояние бедности
 - Не учитывается, что не только бедность может влиять на субъективное благополучие, но и уровень удовлетворенности может влиять на экономическую ситуацию индивида
- Welsch and Biermann (2017) на примере Германии за 2005-2013 гг.
 - ✓ Анализировали бедность на региональном уровне (бедность как общественное “не благо”) при контроле индивидуальной бедности и ее длительности
 - ✓ Субъективное благосостояние отрицательно связано с региональным уровнем бедности вне зависимости от того, сколько времени индивид провел в бедности
 - ✓ Бедность не является “общественным не благом” для высокодоходных групп населения
 - Анализ не затрагивает непосредственно проблему адаптации к бедности

Вклад исследования

- Анализ адаптации к бедности с использованием длительной динамики
 - ✓ первое исследование адаптации к бедности в стране со средним уровнем дохода
- Адаптация к бедности анализируется с использованием:
 - ✓ разных аспектов благосостояния (удовлетворенность жизнью и субъективное благосостояние)
 - ✓ разных подходов к определению бедности (абсолютные и относительные)
 - ✓ разных эконометрических техник
- Благополучие адаптируется к бедности или бедность к благополучию? Выявление причинно-следственной связи между субъективным благосостоянием и бедностью
- Анализ адаптации не только к бедности, но и к материальной уязвимости

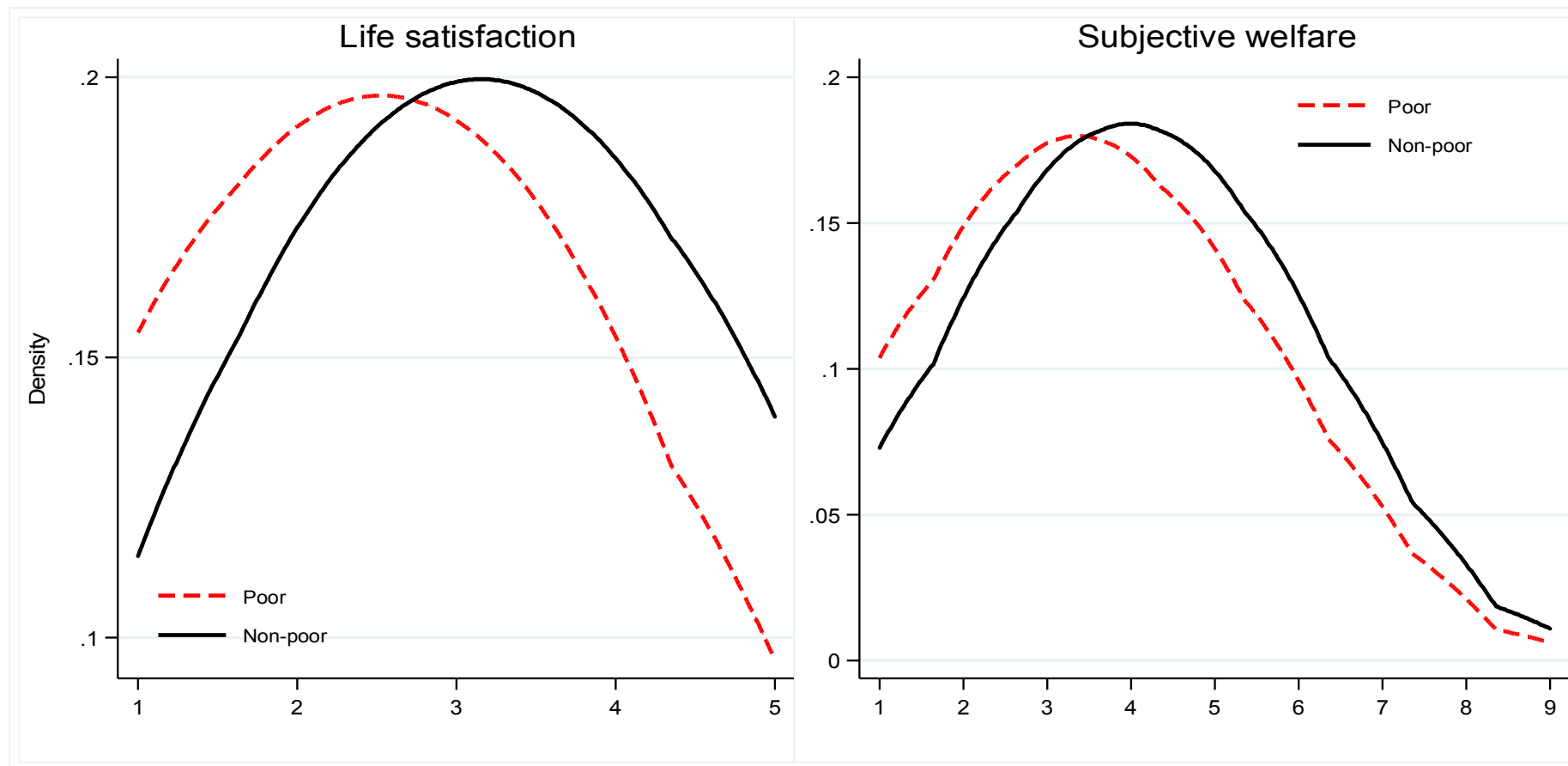
Основные результаты

- Бедность и материальная уязвимость связаны с более низким уровнем благополучия
- Мы не обнаружили адаптацию благополучия к бедности и материальной уязвимости:
 - ✓ длительное нахождение в бедности/в состоянии материальной уязвимости связано с большей неудовлетворенностью и более низким субъективным благосостоянием
- Результаты сохраняются при использовании разных показателей благосостояния и разных подходов к бедности
- Существуют различия между мужчинами и женщинами:
 - ✓ женщины оказываются более восприимчивы к нахождению в бедности, чем мужчины, при этом мужчины – более восприимчивы к материальной уязвимости
- Существует обратная связь между бедностью и благополучием

Данные

- РЛМС, 1994-2017 (несбалансированная панель индивидов)
- Эмпирическая выборка: индивиды 16 лет и старше
- Переменные благополучия:
 - ✓ Удовлетворенность жизнью: “Насколько Вы удовлетворены своей жизнью в целом в настоящее время?” (по шкале от 1 до 5)
 - ✓ Субъективное благосостояние: *“Представьте себе, пожалуйста, лестницу из 9 ступеней, где на нижней, первой ступени, стоят нищие, а на высшей, девятой - богатые. На какой из девяти ступеней находитесь сегодня Вы лично?”* (по шкале от 1 до 9)
- Переменная дохода: подушевой денежный доход индивида за последние 30 дней
 - ✓ Индивид считается бедным, если его подушевой доход ниже абсолютной/относительной границы бедности

Функция плотности благополучия в зависимости от статуса бедности



Эконометрическая модель (1): Уровень и глубина бедности

$$y_{it} = \beta' P_{it} + \gamma' X_{it} + \eta_i + \tau_t + \varepsilon_{it}$$

- y_{it} благополучие i 'ого индивида в период t
- P_{it} вектор переменных бедности
- X_{it} контрольные переменные
 - ✓ возрастная группа, семейный статус, статус на рынке труда, уровень образования, количество детей в семье
- η_i индивидуальные эффекты
- τ_t временной тренд
- Линейная модель с фиксированными эффектами (Ferrer-i-Carbonell and Frijters, 2004; Clark et al., 2016)
- Нас интересует: β'

Эконометрическая модель (1)

Результаты

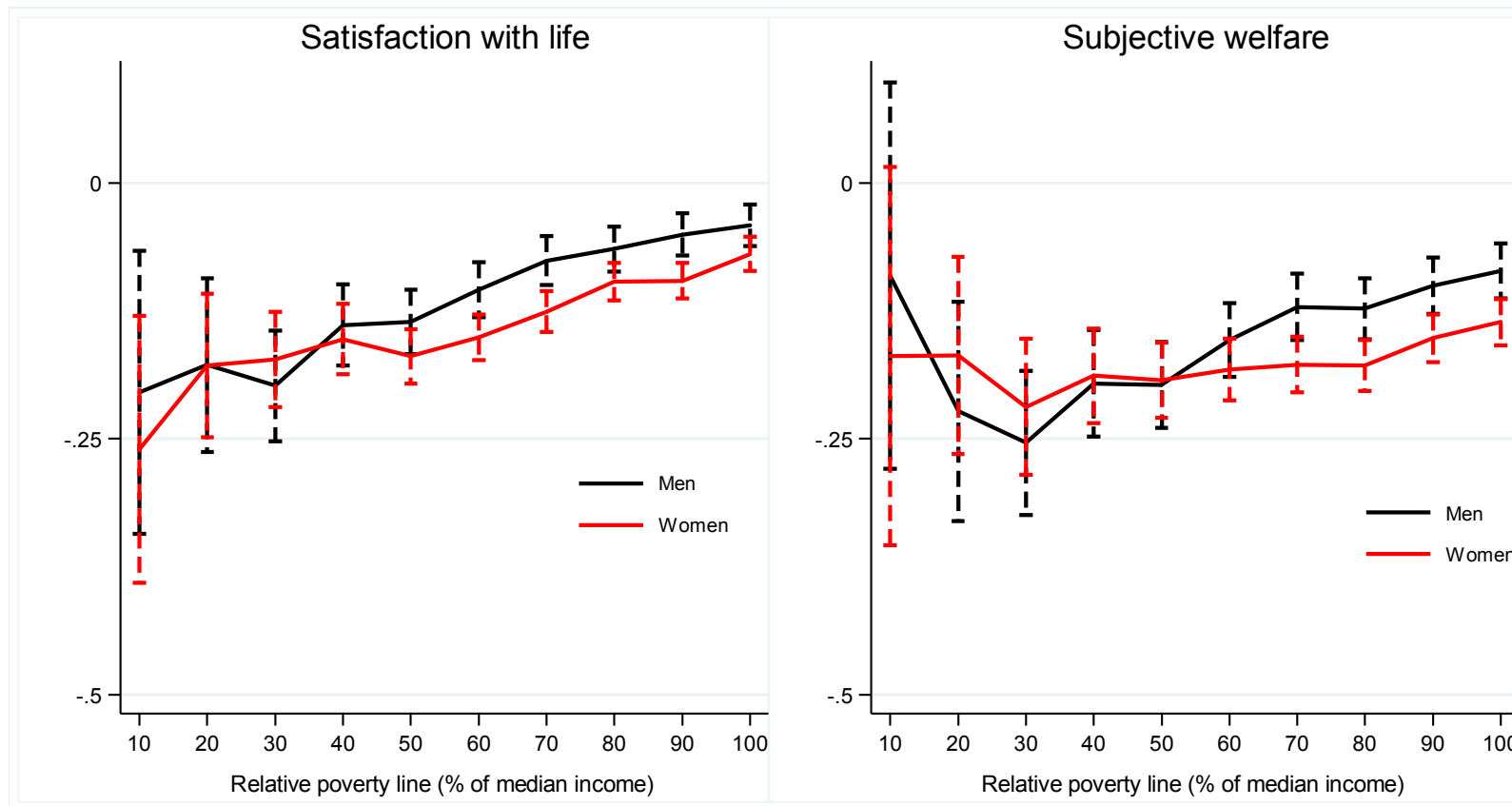
Переменные	Удовлетворенность жизнью			Субъективное благосостояние		
	Вся выборка	Мужчины	Женщины	Вся выборка	Мужчины	Женщины
За чертой бедности	-0.091*** (0.01)	-0.077*** (0.01)	-0.099*** (0.01)	-0.124*** (0.01)	-0.109*** (0.01)	-0.131*** (0.01)
Глубина бедности	-0.322*** (0.02)	-0.339*** (0.03)	-0.308*** (0.02)	-0.327*** (0.03)	-0.336*** (0.03)	-0.318*** (0.03)
<i>R</i> ²	0.072	0.069	0.075	0.030	0.031	0.031
<i>Number of observations</i>	253,986	107,385	146,601	250,782	105,861	144,921
<i>Number of individuals</i>	44,027	19,860	24,167	43,801	19,746	24,055

Бедность связана с более низким уровнем удовлетворенности и субъективного благосостояния:

индивид с доходом в два раза ниже, чем уровень бедности (т.е. глубина бедности = 0.5) будет на 0.25 п.п. менее удовлетворен, чем небедный.

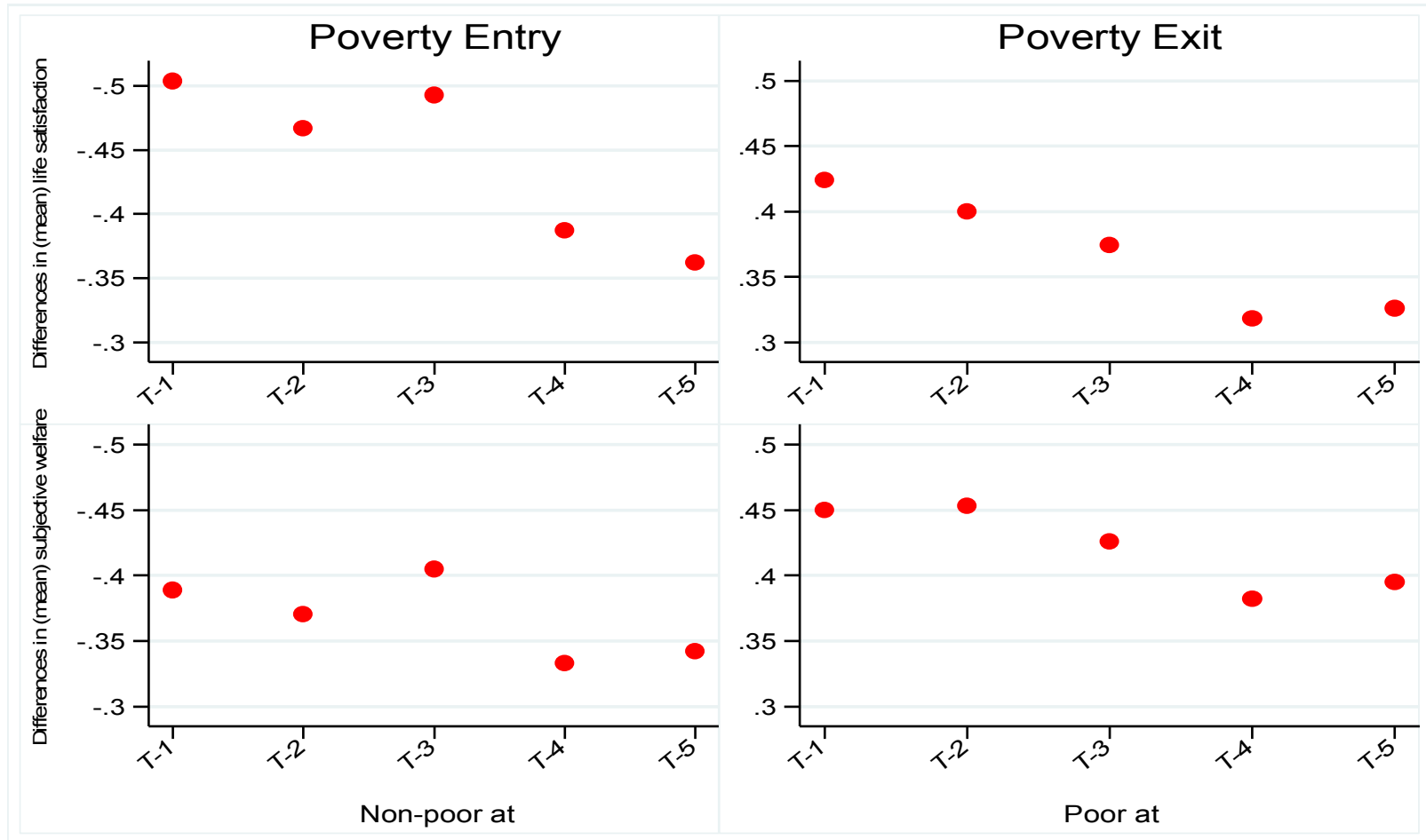
Эконометрическая модель (1)

Различия между женщинами и мужчинами

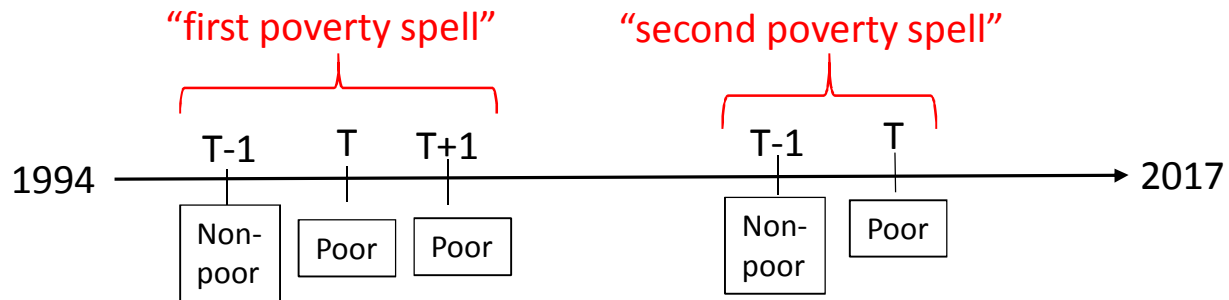


$$E(P_{it} = 1 | P_{it-n} = 0) - E(P_{it} = 0 | P_{it-n} = 0)$$

$$E(P_{it} = 0 | P_{it-n} = 1) - E(P_{it} = 1 | P_{it-n} = 1)$$



Длительность нахождения в бедности



Number of spells	Частота	Процент
1-й вход в бедность	11,519	70.05
2-й вход в бедность	3,874	23.06
3-й вход в бедность и чаще	1,157	6.89
<i>Number of "poverty spell" observations</i>	<i>16,800</i>	<i>100</i>

First poverty spell	Частота	Процент
1-й год в бедности	6,618	57.48
2-й год в бедности	2,171	18.86
3-й год в бедности	1,053	9.15
4-й год в бедности	611	5.31
5-й год в бедности и дольше	1,061	9.21
<i>Number of "first poverty spell" observations</i>	<i>11,514</i>	<i>100</i>

Среднее значение благополучия в зависимости от длительности в бедности

Удовлетворенность жизнью

Poverty spell	Длительность			
	1-й год	2-й год	3-й год	4-й год и дольше
до входа в бедность	2.7	2.6	2.5	2.5
1-й вход в бедность	2.7	2.6	2.5	2.5
2-й вход в бедность	2.7	2.6	2.7	2.7
3-й и более вход в бедность	2.9	2.8	2.9	2.9

Субъективное благосостояние

Poverty spell	Длительность			
	1-й год	2-й год	3-й год	4-й год и дольше
до входа в бедность	3.6	3.5	3.4	3.4
1-й вход в бедность	3.6	3.5	3.5	3.5
2-й вход в бедность	3.7	3.6	3.6	3.5
3-й и более вход в бедность	3.8	3.7	3.7	3.7

Нас интересует, насколько меняется уровень благополучия в зависимости от длительности нахождения в бедности

Эконометрическая модель (2): Длительность нахождения в бедности

$$y_{it} = \beta_t p_{it} + \beta_{t-1} p_{it-1} + \beta_{t-2} p_{it-2} + \beta_{t-3} p_{it-3} + \beta_{t-4} p_{it-4} + \gamma' X_{it} + \eta_i + \tau_t + \varepsilon_{it}$$

- y_{it} благополучие i 'ого индивида в год t
- p_{it} вход в бедность в период t (“*first poverty spell*”)
- X_{it} контрольные переменные
 - ✓ возрастная группа, семейный статус, статус на рынке труда, уровень образования, количество детей в семье
- η_i индивидуальные эффекты
- τ_t временной тренд
- Линейная модель с фиксированными эффектами (Ferrer-i-Carbonell and Frijters, 2004; Clark et al., 2016)
- Адаптация: $\beta_t > \beta_{t-1} > \beta_{t-2} > \beta_{t-3} > \beta_{t-4}$

Эконометрическая модель (2)

Результаты

Переменные	Удовлетворенность жизнью				Субъективное благосостояние			
	Вся выборка	Более 2 лет в бедности	Более 3 лет в бедности	Более 4 лет в бедности	Вся выборка	Более 2 лет в бедности	Более 3 лет в бедности	Более 4 лет в бедности
1-й год в бедности	-0.180*** (0.02)	-0.226*** (0.05)	-0.227*** (0.06)	-0.247*** (0.08)	-0.151*** (0.02)	-0.348*** (0.06)	-0.362*** (0.09)	-0.403*** (0.12)
2-й год в бедности	-0.211*** (0.03)	-0.271*** (0.06)	-0.344*** (0.07)	-0.386*** (0.09)	-0.188*** (0.04)	-0.372*** (0.08)	-0.410*** (0.10)	-0.437*** (0.13)
3-й год в бедности	-0.239*** (0.04)	-0.324*** (0.07)	-0.400*** (0.08)	-0.390*** (0.10)	-0.067 (0.06)	-0.296*** (0.09)	-0.277** (0.12)	-0.350** (0.14)
4-й год в бедности	-0.284*** (0.05)	-0.364*** (0.09)	-0.484*** (0.10)	-0.496*** (0.12)	-0.129* (0.07)	-0.402*** (0.12)	-0.429*** (0.14)	-0.547*** (0.16)
5-й год в бедности и дольше	-0.143** (0.06)	-0.276** (0.11)	-0.450*** (0.13)	-0.442*** (0.14)	0.086 (0.08)	-0.305** (0.15)	-0.298* (0.17)	-0.332* (0.19)
<i>R</i> ²	0.035	0.051	0.057	0.067	0.032	0.046	0.045	0.047
<i>Number of observations</i>	24,440	6,611	4,426	3,133	24,127	6,534	4,377	3,092
<i>Number of individuals</i>	6,654	1,063	616	386	6,640	1,063	616	386

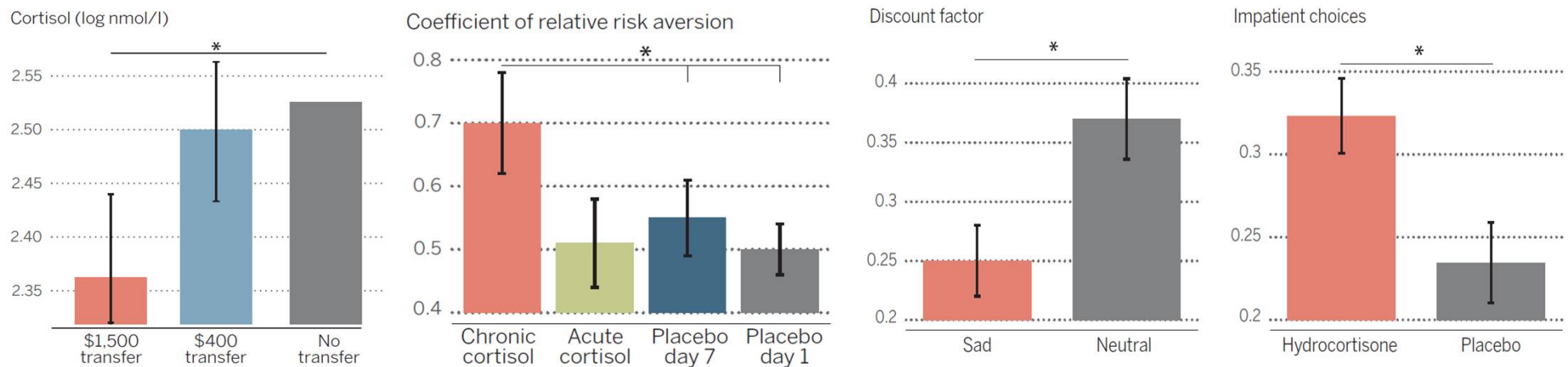
Устойчивость результатов

Многократное попадание в бедность

Переменные	Удовлетворенность жизнью			Субъективное благосостояние		
	Вся выборка	Мужчины	Женщины	Вся выборка	Мужчины	Женщины
1-й вход в бедность	-0.132*** (0.02)	-0.147*** (0.02)	-0.121*** (0.02)	-0.113*** (0.02)	-0.090*** (0.03)	-0.129*** (0.03)
2-й вход в бедность	-0.137*** (0.03)	-0.127*** (0.04)	-0.144*** (0.03)	-0.132*** (0.04)	-0.109** (0.05)	-0.149*** (0.04)
3-й вход в бедность	-0.143*** (0.04)	-0.080 (0.06)	-0.186*** (0.05)	-0.135** (0.06)	-0.048 (0.08)	-0.198*** (0.06)
Глубина бедности	-0.306*** (0.03)	-0.284*** (0.04)	-0.315*** (0.04)	-0.348*** (0.04)	-0.299*** (0.06)	-0.376*** (0.05)
<i>R2</i>	0.046	0.055	0.043	0.030	0.033	0.031
<i>Number of observations</i>	46,731	19,206	27,525	46,087	18,929	27,158
<i>Number of individuals</i>	11,752	4,983	6,769	11,691	4,958	6,733

Благополучие (не)адаптируется к бедности или бедность к благополучию? Механизм обратной СВЯЗИ

- Бедность влияет на предпочтение о риске (бедные более склонные к неприятию риска) и на принятие межвременных решений (бедные сильнее дисконтируют будущее) (Guiso and Paiella, 2008; Tanaka et al., 2010; Banerjee and Duflo, 2008)
- “Бедность может вызывать психологические изменения, которые негативно отражаются на экономическом поведении, что препятствует выходу из бедности” (Haushofer and Fehr, 2014)



Эконометрическая модель (3)

$$y_{it}^* = \beta_0' p_{it} + \beta_1' p_{it-k} + \gamma_1' X_{it} + \rho_1 y_{it-k} + \eta_{1i} + \tau_{1t} + \varepsilon_{1it}$$

$$p_{it}^* = \beta_2' p_{it-k} + \gamma_2' X_{it} + \rho_2 y_{it-k} + \eta_{2i} + \tau_{2t} + \varepsilon_{2it}$$

- y_{it}^* и p_{it}^* - латентные переменные благополучия и бедности индивида i в период t ($k=1..5$)
- X_{it} контрольные переменные
 - ✓ пол, возрастная группа, семейный статус, статус на рынке труда, уровень образования, количество детей в семье, региональные характеристики
- η_i индивидуальные эффекты (Wooldridge, 2005; Hesketh and Skrondal, 2013)

$$\eta_{1i} = \alpha_{10} + \alpha_{11} y_{i0} + \overline{X_{1i}} \alpha_{12} + X_{1i0} \alpha_{13} + \alpha_{1i}$$

$$\eta_{2i} = \alpha_{20} + \alpha_{21} p_{i0} + \overline{X_{2i}} \alpha_{22} + X_{2i0} \alpha_{23} + \alpha_{2i}$$

- τ_t временной тренд
- Оценивается система внешне несвязанных уравнений

Эконометрическая модель (3)

Результаты (для удовлетворенности жизнью)

Переменные	Спецификация 1		Спецификация 2		Спецификация 3	
	Удовлетв	Бедность	Удовлетв	Бедность	Удовлетв	Бедность
За чертой бедности в год T	-0.108***		-0.095***		-0.095***	
	(0.01)		(0.01)		(0.01)	
Глубина бедности в год T	-0.387***		-0.347***		-0.322***	
	(0.02)		(0.02)		(0.03)	
<i>Лагированные переменные</i>						
За чертой бедности в год T-1	-0.034***	0.260***	-0.016*	0.231***	-0.021**	0.219***
	(0.01)	(0.00)	(0.01)	(0.00)	(0.01)	(0.00)
Глубина бедности в год T-1	-0.004	0.276***	0.026	0.225***	0.046*	0.213***
	(0.02)	(0.01)	(0.02)	(0.01)	(0.03)	(0.01)
Удовлетворенность в год T-1	0.385***	-0.015***	0.326***	-0.009***	0.297***	-0.008***
	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)
За чертой бедности в год T-2			-0.013	0.118***	-0.008	0.114***
			(0.01)	(0.00)	(0.01)	(0.00)
Глубина бедности в год T-2			0.017	0.176***	0.033	0.123***
			(0.02)	(0.01)	(0.02)	(0.01)
Удовлетворенность в год T-2			0.216***	-0.005***	0.192***	-0.004***
			(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)
За чертой бедности в год T-3					-0.001	0.052***
					(0.01)	(0.00)
Глубина бедности в год T-3					0.020	0.133***
					(0.02)	(0.01)
Удовлетворенность в год T-3					0.131***	-0.002***
					(0.00)	(0.00)
<i>Number of observations</i>	189,328		139,217		106,118	

Адаптация к материальной уязвимости

- Концепция индекса материальной уязвимости Dang and Lanjouw (2017):

$$P(Y_1 < Z_1 | Z_0 < Y_0 < V_0)$$

Y_t - доходы/расходы в период t , Z_t - линия бедности в период t , V_t -линия уязвимости в период t

- Линия уязвимости определяется таким образом, что доля населения с доходами выше черты бедности, но ниже границы уязвимости в период 0, окажется ниже черты бедности в период 1

Адаптация к материальной уязвимости

Результаты (модель 1)

Переменные	Удовлетворенность жизнью			Субъективное благосостояние		
	Вся выборка	Мужчины	Женщины	Вся выборка	Мужчины	Женщины
За чертой уязвимости (но выше черты бедности)	-0.079***	-0.066***	-0.088***	-0.135***	-0.124***	-0.142***
	(0.01)	(0.01)	(0.01)	(0.01)	(0.01)	(0.01)
<i>R</i> ²	0.037	0.037	0.039	0.019	0.021	0.019
<i>Number of observations</i>	171,668	72,734	98,934	169,818	71,834	97,984
<i>Number of individuals</i>	37,742	16,893	20,849	37,521	16,801	20,720

Адаптация к материальной уязвимости

Модель (2)

Переменные	Удовлетворенность жизнью			Субъективное благосостояние		
	Вся выборка	Мужчины	Женщины	Вся выборка	Мужчины	Женщины
1-й год в уязвимости	-0.076* (0.04)	-0.058 (0.06)	-0.102** (0.05)	-0.066 (0.06)	-0.218*** (0.07)	0.037 (0.07)
2-й год в уязвимости	-0.193*** (0.07)	-0.338*** (0.11)	-0.102 (0.09)	0.020 (0.09)	-0.124 (0.12)	0.104 (0.12)
3 и более лет в уязвимости	-0.238** (0.11)	-0.393** (0.16)	-0.146 (0.12)	-0.058 (0.14)	-0.170 (0.18)	0.019 (0.17)
<i>R2</i>	0.017	0.027	0.020	0.016	0.024	0.020
<i>Number of observations</i>	12,779	5,667	7,112	12,673	5,622	7,051
<i>Number of individuals</i>	4,688	2,100	2,588	4,685	2,099	2,586

Заключение

- Бедность и материальная уязвимость связаны с более низким уровнем благополучия (Clark et al., 2016; Welsch and Biermann, 2017)
- Мы не обнаружили адаптацию благополучия к бедности и материальной уязвимости (Clark et al., 2016):
 - ✓ длительное нахождение в бедности/в состоянии материальной уязвимости связано с большей неудовлетворенностью и более низким субъективным благосостоянием
- Результаты сохраняются при использовании разных показателей благосостояния и разных подходов к бедности
- Существуют различия между мужчинами и женщинами:
 - ✓ женщины оказываются более восприимчивы к нахождению в бедности, чем мужчины, при этом мужчины – более восприимчивы к материальной уязвимости
- Существует обратная связь между бедностью и благополучием