Centre d'économie du développement
IFReDE - GRES - Université Bordeaux IV

Document de travail

DT/119/2005

Dynamiques de pauvreté et transferts publics : le cas de la Russie

par

Matthieu Clément
Doctorant, ATER – CED / IFReDE-GRES – Université Montesquieu-Bordeaux IV

Avenue Léon Duguit - 33608 Pessac (France) - tél : 0556842938 - fax : 0556848506
ced@u-bordeaux4.fr
http://ced.u-bordeaux4.fr

Centre d'économie du développement
IFReDE - GRES - Université Bordeaux IV

Dynamiques de pauvreté et transferts publics : le cas de la Russie

par

Matthieu Clément
Doctorant, ATER – CED / IFReDE-GRES – Université Montesquieu-Bordeaux IV

Résumé :

La forte dégradation des conditions de vie subie par la population russe au moment de la transition économique pose la question de l'efficacité de la politique sociale accompagnant les réformes économiques. La Russie a hérité du système de protection sociale soviétique. Celui-ci, conçu dans le cadre d'une société où l'emploi était garanti, les inégalités limitées et la pauvreté officiellement éradiquée, permettait à chaque citoyen d'atteindre un niveau de vie socialement acceptable. Inapproprié pour face aux conséquences sociales de la thérapie de choc, il a connu un certain nombre de modifications institutionnelles tout au long de la période de transition. Cet article vise, à partir des données des enquêtes ménages *Russian Longitudinal Monitoring Survey* (RLMS) pour la période 1994-2000, à évaluer les performances des transferts publics en termes de réduction de la pauvreté. Dans un premier temps, cette évaluation, qui s'appuie sur la comparaison du bien-être pré-intervention et du bien-être post-intervention, se veut statique, en déterminant la capacité du système à cibler les ménages pauvres et à résorber les écarts de pauvreté. Dans un second temps, nous proposons une analyse dynamique qui évalue la capacité du système à réduire la pauvreté chronique et transitoire, mais également son aptitude à tirer les ménages hors de la pauvreté et à protéger les ménages non pauvres face à un risque d'entrée dans la pauvreté.

Abstract : poverty dynamics and public transfers : the case of Russia

The strong deterioration of the standard of living of Russian people during economic transition raises the question of the effectiveness of social policy. Russia inherited the Soviet system of social protection. This one, introduced in a society where employment was guaranteed, inequality limited and poverty non-officially recognized, made it possible each citizen to reach a socially acceptable standard of living. Inadequate to deal with social consequences of the shock therapy, he knew several institutional modifications, throughout the transitional period. Based on the Russia Longitudinal Monitoring Survey data over the period 1994-2000, this article aims at evaluating the performances of public transfers in terms of poverty reduction. In the first time, this evaluation, which rest on the comparison of pre-intervention and post-intervention welfare, is static, by determining the capacity of transfers to target poor households and to resorb poverty gaps. In the second time, we propose a dynamic analysis which evaluates the capacity of the system to reduce chronic and transient poverty, but also its aptitude to draw poor households out of poverty and to protect non-poor households against a risk of poverty entry.

Mots-clés : pauvreté, données de panel, transferts publics, Russie, transition économique.

JEL classification : I32, I38, P20.

Sommaire

1. Introduction **1**

2. Sources statistiques et évolution de la pauvreté **2**

1. Sources statistiques, seuil de pauvreté, bien-être et échelle d'équivalence *2*
2. Ampleur et évolution de la pauvreté *3*

3. Structure et financement du système de protection sociale **4**

1. Entre héritages et adaptations au nouvel environnement économique et social *4*
A. Architecture du système de protection sociale 4
B. Modalités de financement 6
2. Descriptif des transferts publics dans le cadre des données RLMS *6*

4. Construction d'un indicateur de dépense pré-transferts publics **8**

1. Concepts et méthodes : le problème des réponses comportementales *8*
2. Estimation de la propension marginale à consommer les transferts sociaux *9*

5. Une évaluation statique de l'efficacité des transferts publics **10**

1. Performances des transferts : ciblage et mécanismes d'allocation *11*
2. Concepts et méthodes : l'apport d'une analyse de dominance stochastique *11*
3. Evidence empirique *13*
A. Pauvreté pré-transferts et pauvreté post-transferts 13
B. Evolution des performances du système de transferts 13
C. Performance des différents transferts en 2000 16

6. Une évaluation dynamique de l'efficacité des transferts publics **19**

1. Pauvreté persistante, pauvreté temporaire et transferts publics *19*
A. Formes de la pauvreté pré-transferts et post-transferts 20
B. Formes de la pauvreté et ciblage / allocation des transferts 21
2. Mouvements de pauvreté et transferts publics : protection versus promotion *22*
A. Taux de protection et promotion : concepts et méthodes 22
B. Evidence empirique : un déficit de promotion 23

7. Conclusion **25**

Références bibliographiques ***26***

Annexes ***29***

1. Introduction

La libéralisation des prix intervenue le 2 janvier 1992, composante clé de la thérapie de choc mise en place par le gouvernement sous la tutelle des institutions économiques internationales, marque le début de la phase de transition économique en Russie. Cette dernière vise à assurer la « *transformation institutionnelle, légale, politique et administrative d'un système économique fondé sur la propriété d'Etat et la planification centralisée en un système économique fondée sur la propriété privée et l'allocation des ressources par le marché* » [Sachs (1996), p. 128]. Le processus de réformes, largement inspiré par les préceptes libéraux du Consensus de Washington, s'articule autour de trois volets de mesures [Aslund (1995)]: (i) une politique de libéralisation qui vise à supprimer les contraintes pesant sur les mécanismes de marché et à réduire les barrières commerciales ; (ii) une politique de stabilisation rigoureuse afin de limiter l'inflation liée à la libéralisation ; (iii) une politique de restructuration qui vise à redéfinir le rôle de l'Etat à travers les privatisations. La mise en œuvre de ces réformes a, dans les premières années de la transition, entraîné de profonds bouleversements économiques : effondrement de la production, inflation galopante, privatisations sauvages, développement de mafias, corruption, etc. La crise financière et la dévaluation du rouble de 1998 marquent toutefois un point de rupture. Premièrement, la bonne gestion de la crise, conjuguée à un contexte international favorable, est en grande partie à l'origine du retour de la croissance en 1999, phase d'expansion jusqu'à présent ininterrompue. Deuxièmement, les autorités russes semblent avoir pris conscience de l'importance à accorder aux objectifs de long terme, et notamment aux aspects institutionnels [Sapir (1999)]. Plusieurs réformes structurelles sont d'ailleurs d'ores et déjà engagées : réforme fiscale, réforme foncière, réforme du système bancaire, réforme des retraites, etc. [Walter (2003)].

Sur un plan social, les conséquences de la transition économique sont désastreuses. Dès 1992, on assiste à une hausse sans précédent de la pauvreté et de l'inégalité. D'après les estimations de Milanovic (1998), la proportion de pauvres en Russie serait passée de 2 % en 1987-1988 à 50 % en 1993-1995 alors que l'indice de Gini, mesure traditionnelle du degré d'inégalité, aurait doublé passant de 0,24 à 0,48. Plusieurs études montrent également que la pauvreté en Russie est avant tout un phénomène transitoire, même si parmi les familles pauvres, un certain nombre semble devoir faire face à une privation de long terme [Mroz, Popkin (1995), Lokshin, Popkin (1999), Clément (2003)]. En d'autres termes, la pauvreté n'est pas un phénomène structurel qui aurait été hérité du régime soviétique et transmis entre générations. Elle est davantage la conséquence de chocs adverses inhérents au processus de réformes, chocs expliquant en grande partie l'existence de mouvements récurrents d'entrées et de sorties dans / de la pauvreté.

Cette dégradation des conditions de vie pose la question de l'efficacité de la politique sociale accompagnant les réformes économiques. La Russie transitionnelle a hérité du système de protection sociale soviétique. Celui-ci, conçu dans le cadre d'une société où l'emploi était garanti, les inégalités limitées et la pauvreté officiellement éradiquée[1], permettait à chaque citoyen d'atteindre un niveau de vie socialement acceptable. Inapproprié pour face aux conséquences sociales de la thérapie de choc, il a connu un certain nombre de modifications institutionnelles à l'initiative des autorités fédérales, tout au long de la période de transition. Dans quelle mesure ces différentes adaptations ont-elles permis de répondre à la nouvelle donne sociale ? En d'autres termes, quel est le rôle joué par le système de protection sociale russe dans les dynamiques de pauvreté, durant la période de transition ? Cet article

[1] La question de l'existence de pauvreté en URSS a fait l'objet de nombreux débats. Si la pauvreté n'était pas officiellement reconnue par les autorités (on parlait alors de « sous approvisionnement »), la plupart des auteurs occidentaux se sont efforcés de montrer, en dépit des problèmes d'accès aux données, qu'elle atteignait des niveaux importants. Voir à ce sujet McAuley (1979), Matthews (1986) et Klugman (1997).

vise, à partir des données des enquêtes ménages *Russian Longitudinal Monitoring Survey* (RLMS) pour la période 1994-2000, à évaluer les performances des transferts publics en termes de réduction de la pauvreté, celle-ci étant appréhendée sous un angle monétaire. Cette évaluation, qui s'appuie sur la comparaison du bien-être pré-intervention et du bien-être post-intervention, se veut à la fois statique, en déterminant la capacité du système à cibler les ménages pauvres et à résorber les écarts de pauvreté, et dynamique, en évaluant son aptitude à tirer les ménages hors de la pauvreté et à protéger les ménages non pauvres face à un risque d'entrée dans la pauvreté.

L'analyse présentée dans ce papier se décompose en cinq étapes. Dans une première partie, après avoir présenté les sources statistiques et éléments méthodologiques relatifs à la mesure de la pauvreté, il convient de décrire les évolutions de la pauvreté monétaire en Russie, sur la période 1994-2000. Dans une seconde partie, nous proposons un bref descriptif du système de protection sociale russe en soulignant les continuités par rapport à la période soviétique mais également en évoquant les modifications intervenues pour faire face aux conséquences sociales du processus de réformes. La troisième partie traite de la construction d'un indicateur de bien-être pré-intervention publique, préalable à l'analyse sur l'incidence des transferts publics. Dans une quatrième partie, nous procédons, par le biais de tests de dominance stochastique, à une analyse d'incidence statique qui vise à mettre en évidence la qualité du ciblage des transferts publics mais également leur capacité à réduire les écarts de pauvreté. Enfin, nous développons dans une cinquième partie une analyse d'incidence dynamique qui cherche à déterminer dans quelle mesure le système de transferts permet de protéger les familles non pauvres contre un risque d'entrée dans la pauvreté et à sortir les ménages pauvres de la pauvreté.

2. Sources statistiques et évolution de la pauvreté

L'objet de ce paragraphe est de présenter brièvement les concepts clés nécessaires à l'analyse des dynamiques de pauvreté. A cet égard, il s'agit en premier lieu de spécifier l'indicateur de bien-être et le seuil de pauvreté adoptés, mais également de discuter de la structure de panel des données RLMS. Il convient en second lieu d'évaluer l'ampleur et l'évolution de la pauvreté en Russie sur la période 1994-2000.

1. Sources statistiques, seuil de pauvreté, bien-être et échelle d'équivalence

Les données utilisées dans la présente étude sont issues des rounds V (novembre 1994), VII (octobre 1996), VIII (octobre 1998) et IX (septembre 2000) des enquêtes *Russia Longitudinal Monitoring Survey*[2]. L'échantillon initial de 1994 comprenant 3973 ménages, soit environ 11 000 individus, a été déterminé par stratification multiple : quatre niveaux de stratification avec tirage aléatoire pour le dernier niveau de stratification. Les informations collectées au niveau des ménages fournissent des informations détaillées sur les conditions de vie (revenus, dépenses, conditions de logement, accès à la terre), alors que celles portant sur les individus concernent l'emploi, la santé et la migration. Les données des enquêtes RLMS ont une structure de panel, en ce sens qu'un certain nombre de ménages a été interrogé à plusieurs reprises. Il est ainsi possible de construire un panel, dit *cylindré*, comprenant les ménages présents aux quatre périodes retenues. Il ne s'agit toutefois pas d'un panel pur dans la mesure où plusieurs ménages n'ont pas pu être interrogés chaque année. Certaines familles ont déménagé entre deux enquêtes ; d'autres n'existent plus (suite à une séparation ou un décès, par exemple) ; enfin certaines ont pu refuser de coopérer une fois de plus. Dans chacun des cas, une observation est perdue. L'échantillon de panel construit à partir de nos quatre vagues de données comprend seulement 2088 ménages, présents à toutes les périodes. Le taux d'usure par rapport à l'échantillon initial atteint par conséquent plus de 47 % et pose un évident problème de représentativité. Cependant, l'analyse de la durée de la pauvreté exigeant de se focaliser sur les ménages pour lesquels on observe le bien-être sur une période relativement longue, l'exclusion des

[2] Les enquêtes RLMS ont été conjointement diligentées par le Goskomstat, l'Université de Caroline du Nord, le Centre Russe de Médecine Préventive et l'Institut Russe de Sociologie avec l'assistance technique de la Banque Mondiale et de l'Agence Américaine pour le Développement International. Précisons que nous n'utilisons pas les données de la vague VI (octobre 1996) des enquêtes RLMS de manière à conserver un intervalle de temps régulier entre deux vagues (2 ans).

données manquantes apparaît comme la démarche la plus pertinente, même si elle est synonyme d'une perte de représentativité.

Les définitions utilisées pour l'analyse des dynamiques de pauvreté sont standards. La ligne de pauvreté retenue est le *seuil minimum de subsistance*, ligne officielle créée dès 1918. Révisée en 1992, suite à l'hyperinflation provoquée par la libéralisation des prix, elle tient désormais compte des standards caloriques internationaux de l'OMS et de la FAO. Elle représente le montant monétaire nécessaire pour assurer le minimum nutritionnel et les besoins quotidiens d'un individu (fuel, loyer, énergie, etc.)[3]. Elle est réévaluée tous les mois afin de tenir compte de l'évolution des prix. Les valeurs du seuil minimum de subsistance pour les quatre années retenues s'élèvent respectivement à 1828, 1755, 1432 et 1555 roubles mensuels, par adulte. L'unité d'analyse étant le ménage, le bien-être est appréhendé par les dépenses de consommation des ménages. Dans le cadre des données RLMS, l'indicateur de dépense, exprimé en termes réels, prend en compte toutes les dépenses monétaires en biens (alimentaires et non alimentaires) et services, ainsi que les transferts versés. Si la valeur des biens durables n'est pas prise en compte, pour des raisons pratiques, l'indicateur intègre la valeur imputée de l'autoconsommation en produits alimentaires. Il inclut également le montant de l'épargne, suggérant par là même que l'on raisonne en termes de consommation *potentielle* et non de consommation *courante*. Afin de prendre en compte les différences de taille et de composition démographique, l'indicateur de dépense est divisé par l'échelle d'équivalence de l'OCDE, dont l'expression est la suivante :

$$EQ_{OCDE} = (1 + 0{,}7A + 0{,}5E)^{0{,}7} \qquad (1)$$

A et E représentent respectivement le nombre d'adultes après le premier adulte et le nombre d'enfants dans le ménage. L'indicateur ainsi obtenu est la dépense des ménages en équivalent adulte. Finalement, afin de raisonner à partir d'un seuil de pauvreté unique de 1828 roubles par mois, nous avons choisi de convertir toutes les dépenses aux prix de 1994, en utilisant le rapport des seuils de pauvreté comme déflateur.

2. Ampleur et évolution de la pauvreté

Les valeurs des indices FGT[4] pour les quatre années, reportées dans le tableau 1, révèlent des divergences assez sensibles en termes de niveaux de pauvreté, entre les estimations issues des échantillons initiaux et celles issues du panel. Ainsi, l'incidence de la pauvreté évaluée à partir de l'échantillon initial en 1994 est supérieure de plus d'un point aux estimations issues du panel. Pour les années suivantes, la logique est inverse puisque la pauvreté est surestimée à partir du panel. L'écart est même supérieur à deux points en 2000. En d'autres termes, le fait que les ménages ayant quitté l'échantillon entre 1998 et 2000 soient principalement non pauvres peut suggérer l'existence d'une usure non aléatoire et donc d'un biais de sélection[5].

Les deux types d'estimations mettent toutefois en exergue des évolutions similaires. A long terme, d'une part, la pauvreté s'est sensiblement accrue. L'incidence estimée à partir des échantillons initiaux a augmenté de près de huit points, passant de 14,4 % à 22,3 %. Cette dégradation des

[3] Précisons que la part destinée aux produits alimentaires est prépondérante : elle atteint 68,3 %, pour seulement 19,1 % pour les produits non alimentaires, 7,4 % pour les services et 5,2 % pour les impôts et paiements. En 2000, le Ministère du travail et le Goskomstat ont proposé une nouvelle méthode de calcul du seuil minimum de subsistance accordant plus de poids aux produits non alimentaires et aux services.

[4] L'expression générale des indices de la classe FGT est $P_\alpha = \frac{1}{n} \sum_{i=1}^{q} [(z-y_i) / z]^\alpha$ avec n le nombre de ménages, q le nombre de ménages pauvres, y_i la dépense en équivalent adulte du ménage i, z le seuil de pauvreté et α un paramètre d'aversion pour la pauvreté. En fonction de la valeur du paramètre α on peut distinguer plusieurs indices caractéristiques, les « trois 'i' de la pauvreté » : l'incidence P_0, l'intensité P_1 et l'inégalité P_2 [Foster, Greer, Thorbecke (1984)].

[5] Pour une discussion plus précise sur le problème d'usure des données RLMS, se référer à Swafford (1997), Jovanovic (2000).

conditions de vie de la population est encore plus nette à partir du panel. La thérapie de choc, mise en

Tableau 1 : Indices FGT pour les échantillons initiaux (rounds) et le panel[1]. Russie 1994-2000.

	1994		1996		1998		2000	
	Round	Panel	Round	Panel	Round	Panel	Round	Panel
Incidence P_0	14,40	13,04	23,08	24,17	27,56	28,66	22,31	25,05
Intensité P_1	5,48	4,55	9,18	9,42	10,51	10,95	7,43	8,18
Inégalité P_2	2,98	2,35	5,15	5,18	5,76	5,96	3,68	4,00
Nombre de ménages	3762	2088	3560	2088	3622	2088	3777	2088
Taux d'usure	44,5 %		41,4 %		42,3 %		44,7 %	

Notes : (1) Indices de pauvreté calculés à partir de la dépense des ménages en équivalent adulte.
Source : à partir des données RLMS.

place conjointement par les autorités russes et les institutions économiques internationales, a eu d'évidentes répercussions sociales en provoquant l'effondrement des salaires réels, la hausse du chômage et le creusement des inégalités. D'autre part, au regard des évolutions intermédiaires, il est possible de distinguer deux phases. Dans un premier temps, la pauvreté a fortement augmenté pour atteindre un maximum en novembre 1998, seulement quelques mois après la crise financière. A cette date, l'incidence de la pauvreté P_0, par exemple, s'établit autour de 28 %. Précisons néanmoins que la hausse de la pauvreté est moindre entre 1996 et 1998 qu'entre 1994 et 1998. Dans un second temps, on a assisté à une diminution assez sensible de la pauvreté, puisque son ampleur en 2000 semble inférieure à celle de 1996, en tout cas en termes d'intensité (P_1) et d'inégalité (P_2). Ce retournement de tendance est largement imputable au retour de la croissance en 1999, lui même induit par la réorientation post-crise de la politique économique et sociale menée par les autorités fédérales.

3. Structure et financement du système de protection sociale

La structure du système de protection sociale russe pendant la période de transition ne saurait être appréhendée sans un retour sur la politique sociale soviétique. En effet, « *la protection sociale en Russie est sans doute l'un des domaines où l'héritage est le plus prégnant* » [Lefèvre (1995), p. 25]. Si le système de transferts publics russe à la fin des années 90 est directement calqué sur le système soviétique, il a toutefois connu un certain nombre d'adaptations à travers l'instauration de nouveaux transferts et la modification des modalités de financement des bénéfices déjà existants. C'est la raison pour laquelle il importe, dans un premier temps, d'évoquer les spécificités du système de protection sociale soviétique et de mettre en exergue les modifications intervenues durant la période de transition. Il convient, dans un second temps, de proposer quelques éléments de statistique descriptive sur les transferts sociaux, dans le cadre des données RLMS.

1. Entre héritages et adaptations au nouvel environnement économique et social

A. Architecture du système de protection sociale

Sous le régime soviétique, le système de transferts publics pouvait être assimilé à un système d'*assurance sociale* dont l'objectif était, d'une part, de compenser les interruptions dans le versement des salaires, liés par exemple à une maladie, à l'âge, à une situation d'invalidité et, d'autre part, de venir en aide aux familles dépendantes telles que les familles avec enfants [McAuley (1979)]. Au sens strict, il ne reposait donc pas sur une logique d'assistance visant à accroître directement les moyens de subsistance des plus démunis, mais cherchait plutôt à proposer une aide aux familles, dans des circonstances spécifiques, à travers différents bénéfices monétaires tels que les pensions, les congés maladie, les congés maternité, diverses prestations familiales, etc. La transition vers l'économie de

marché a entraîné une remise en cause de trois caractéristiques de la société soviétique, à savoir l'emploi garanti, l'ampleur modérée de l'inégalité et la non reconnaissance des problèmes de pauvreté. Le système de transferts est alors rapidement devenu incompatible avec le nouveau contexte économique et social caractérisé par l'apparition du chômage, le creusement des inégalités et l'augmentation de la pauvreté. Une refonte du système de protection sociale s'imposait de fait ; elle a néanmoins été progressive. Au regard de l'article 39, la constitution de 1993 exprime la volonté de garantir le soutien de l'Etat à la famille, à la maternité, et à l'enfance, et sa protection contre la vieillesse, l'invalidité et la maladie. Le texte encourage également, à la création de formes complémentaires de protection sociale, sans spécifier quelle pourrait en être la nature. Autrement dit, la référence aux objectifs de redistribution et de réduction de la pauvreté n'est pas explicite. Ceci explique qu'en dépit de plusieurs adaptations, le système de transferts publics russe ait conservé la structure générale du système soviétique, c'est-à-dire d'un système répondant à une logique d'assurance sociale. L'analyse des transferts sociaux et de leur impact sur la pauvreté en Russie suppose de distinguer deux catégories de bénéfices : les transferts hérités de la période soviétique et les transferts nouveaux, instaurés pour faire face aux conséquences sociales de la transition [Lefèvre (1995), OCDE (2001)].

Les transferts hérités, d'une part, ont trait à l'assurance sociale et regroupent les pensions, les congés maladie, les congés maternité et les prestations familiales. Le système de pensions, en particulier, a connu peu d'évolutions durant les années 90. Il repose sur deux principes : (i) le principe de *solidarité entre générations*, à la base de tout système par répartition ; (ii) le principe d'*universalité*. Afin de répondre à cet objectif d'universalité, le système assure le financement de cinq types de pensions (pension de vieillesse, pension de réversion, pension d'invalidité, pension militaire et pension sociale) et permet donc à chaque citoyen ayant atteint l'âge légal de la retraite de percevoir un revenu[6]. Parmi les transferts hérités, on retrouve par ailleurs tout un ensemble de prestations familiales, telles que les primes de naissance et de décès, l'allocation pour enfants en bas âge, l'allocation étudiants, etc.[7] Si le système de transferts publics russe s'inscrit dans la lignée du système d'assurance sociale soviétique, plusieurs bénéfices nouveaux ont été mis en place, afin de faire face aux bouleversements sociaux induits par la transition économique. Dans un premier temps, une allocation familiale universelle a été instaurée en 1990 afin de venir en aide aux familles avec enfants qui sont considérées comme faisant partie des populations les plus vulnérables. Puis, ayant anticipé l'accroissement du chômage provoqué par la transition, les autorités ont créé en 1991 un système d'assurance chômage qui accorde des indemnités dégressives pendant un an aux chômeurs qui se sont enregistrés auprès d'une agence pour l'emploi. Une allocation logement, attribuée sous critère de revenu, a également été mise en place en 1993 pour faire face à l'accroissement du prix des logements. Elle couvre l'écart entre le coût d'un logement adéquat et ce qu'une famille est réellement capable de payer [Struyk *et al.* (1998), OCDE (2001)]. Enfin, les autorités fédérales ont jeté les bases institutionnelles pour la création de mécanismes d'assistance sociale visant à venir en aide aux familles les plus précaires, à travers deux lois votées en 1995 et 1998. Ces mécanismes, qui reposent sur des conditionnalités de ressources,

[6] L'âge de départ à la retraite en Russie est de 55 ans pour les femmes et de 60 ans pour les hommes. Un individu est susceptible de toucher une pension s'il justifie d'au moins 5 ans d'activité. Pour percevoir une pension complète, le nombre d'années d'activité requis est de 25 ans pour les hommes et 20 ans pour les femmes. Le montant de base d'une pension est égal à 55 % du salaire moyen des 2 années précédant le départ à la retraite ou d'une période de 5 ans d'activité continue. Un supplément de 1 % est accordé pour chaque année au-dessus des années exigées jusqu'à un bonus maximum de 20 %. Il existe un montant plancher correspondant au salaire minimum lorsque les conditions d'activité sont remplies. Sinon, l'individu perçoit une pension sociale égale aux 2/3 du salaire minimum. Voir OCDE (2001). Précisons qu'en 2001, une vaste réforme du système d'assurance vieillesse a été mise en œuvre avec pour objectif, d'une part, de rapprocher le système russe des normes européennes et, d'autre part, d'assurer sa stabilité financière. Depuis le 1er janvier 2002, le système est constitué de trois composantes : (i) une retraite de base qui reprend l'ancien mécanisme ; (ii) une retraite complémentaire dont le montant dépend des salaires perçus par les individus tout au long de leur vie active ; (iii) une retraite par capitalisation constituée des contributions individuelles accumulées sur des comptes personnels et gérées comme des fonds privés[6]. Malgré l'introduction d'une retraite par capitalisation, la réforme est prudente et le nouveau système laisse une large place au principe de solidarité entre générations. Voir Walter (2003).

[7] Sous le régime soviétique, le système de prestations familiales était particulièrement complexe puisqu'il ne regroupait pas moins de 18 bénéfices destinés aux familles avec enfants. En 1994 les autorités ont mis en œuvre une réforme globale qui vise à simplifier l'ensemble du système. Voir World Bank (1995) et OCDE (2001).

reprennent notamment les aides autrefois accordées par les entreprises[8] et peuvent prendre la forme d'aides monétaires ou d'aides en nature [Gallagher, Struyk (2001)]. Ces aides restent néanmoins trop limitées, à la fois en termes de ciblage et de montants, et n'ont pas permis de modifier en profondeur la structure du système de transferts.

B. Modalités de financement

Alors que la structure générale du système de protection sociale a connu peu de modifications, il y a eu une vraie rupture en ce qui concerne les modalités de financement, la tendance tout au long de la période de transition étant au désengagement massif de l'Etat. Ainsi, à partir de 1991, le financement de l'assurance sociale est assuré par quatre fonds extrabudgétaires (Fonds de Pension, Fonds pour l'Emploi, Fonds d'Assurance Sociale, Fonds d'Assurance Santé), eux-mêmes alimentés par des cotisations représentant 39,5 % des salaires dont 38,5 points sont payés par l'employeur qui supporte donc l'essentiel du fardeau [Lefèvre (1995)]. Par ailleurs, le financement des prestations familiales est dorénavant décentralisé au niveau des régions (Républiques ou Oblasts). Enfin, le financement de l'assistance sociale est en grande partie à la charge des municipalités, ces dernières ayant été progressivement chargées, suite à la libéralisation économique des années 90, de la gestion et du financement des aides autrefois accordées par les entreprises d'Etat [Lefèvre (2001)].

Ces différentes modifications dans les sources de financement, cependant, n'ont pas empêché le déclenchement d'une grave crise du système de protection sociale en 1996, pour l'essentiel imputable aux problèmes du système d'assurance vieillesse. Celui-ci doit en effet faire face à des problèmes de financement chroniques depuis le début de la transition économique. Une première explication de ces difficultés réside dans l'évolution défavorable des trajectoires démographiques. Le vieillissement continu de la population russe, l'augmentation du chômage et le développement des activités informelles ont conduit à une forte dégradation du ratio de couverture. Ainsi, le rapport entre le nombre d'actifs et le nombre de retraités est passé de 2,3 en 1990 à 1,7 en 2000 [Polonskaya (2004)]. Deuxièmement, il y a une forte évasion fiscale de la part des employeurs et des employés qui prend la forme d'une « sous déclaration » des salaires, synonyme de carence dans les rentrées de cotisations sociales[9]. Enfin, l'âge du départ à la retraite est bas, par rapport aux pays de l'OCDE notamment[10]. Ces trois facteurs sont à l'origine d'une crise du système d'assurance vieillesse en 1996 (qui s'est d'ailleurs transmise à l'ensemble du système de protection sociale), dont le déclenchement est par ailleurs étroitement lié au contexte politique [Jensen, Richter (2002)]. En effet, en 1996, l'incertitude liée à l'élection présidentielle a entraîné une chute brutale et inattendue du PIB qui a provoqué une réduction significative des rentrées de cotisations. De plus, les autorités fédérales, face à cette échéance électorale, ont accordé de multiples exemptions et amnisties fiscales qui ont pesé sur les ressources du Fonds de Pension. Ce dernier, tout juste équilibré avant 1996, est devenu déficitaire, entraînant par là même une généralisation des arriérés dans le paiement des pensions. D'après Foley (2003), ces arriérés touchaient un peu plus de 3 % des retraités en 1994 et 34 % en 1996. Si le retour de la croissance en 1997 puis en 1999 a permis de rétablir l'équilibre, au moins temporairement, les autorités semblent avoir pris conscience de la nécessité d'une réforme de fond du système des retraites.

2. Descriptif des transferts publics dans le cadre des données RLMS

Dans le cadre des données RLMS, les informations sur les transferts publics sont peu désagrégées, mais sont néanmoins suffisantes pour appréhender l'impact des transferts sur les

[8] Sous le régime soviétique, les entreprises d'Etat exerçaient un certain nombre de fonctions sociales, sous forme notamment de prestations en nature, et permettaient aux salariés et à leur famille un accès privilégié à de nombreux services : logement, crèches et garderies, chauffage, approvisionnement à prix subventionnés, transport, maisons de vacances, services médicaux, etc. Pour plus de précisions, se référer à Lefèvre (1993), Crosnier (1993) et Klugman (1997).

[9] Cette incitation à la sous déclaration des salaires tient à ce que le montant des pensions ne dépend que des deux dernières années de salaires ou des cinq meilleures.

[10] Voir tableau récapitulatif de Foley (2003), p. 16.

Tableau 2 : Descriptif des transferts publics (contribution, pourcentage de ménages bénéficiaires et montant moyen parmi les ménages bénéficiaires). Russie 1994-2000.

	1994		1996		1998		2000	
	% de ménages bénéficiaires	Montant moyen parmi les bénéficiaires[1]	% de ménages bénéficiaires	Montant moyen parmi les bénéficiaires[1]	% de ménages bénéficiaires	Montant moyen parmi les bénéficiaires[1]	% de ménages bénéficiaires	Montant moyen parmi les bénéficiaires[1]
Pensions	50,40	1390,19	36,69	1304,74	46,80	1108,84	52,24	1057,75
Prestations familiales	31,18	184,12	18,08	285,71	11,15	262,23	17,19	171,95
Dont:								
Allocation enfant	*26,93*	*164,3*	*15,64*	*267,53*	*7,81*	*273,83*	*12,85*	*160,97*
Allocation étudiant	*6,25*	*210,82*	*3,26*	*301,55*	*3,81*	*206,12*	*4,93*	*180,24*
Indemnités chômage	1,44	554,70	1,18	539,20	0,50	646,50	0,66	430,41
Assistance sociale	1,70	548,57	7,41	153,99	15,41	194,24	20,45	135,80
Dont:								
Allocation chauffage	*1,70*	*548,57*	*0,93*	*349,02*	*1,60*	*213,57*	*1,48*	*273,52*
Allocation logement			*6,65*	*122,93*	*14,58*	*181,82*	*19,10*	*99,43*
Autres transferts							*1,48*	*318,46*
Ensemble des transferts	73,26	1058,36	52,47	1044,72	57,10	1018,11	65,72	932,32

Notes : (1) Roubles mensuels exprimés en équivalent adulte aux prix de 1994.
Source : à partir des bases de données des enquêtes RLMS.

conditions de vie. Quatre catégories de bénéfices sont distinguées : les pensions, les prestations familiales, les indemnités chômage et l'assistance sociale. Outre les allocations liées à l'enfance (non désagrégées), les prestations familiales intègrent l'allocation étudiant. En ce qui concerne l'assistance sociale, le seul mécanisme présent pour les quatre années est l'allocation chauffage, un transfert hérité de la période soviétique. Compte tenu des délais d'application de la loi, on ne dispose d'informations sur l'allocation logement qu'à partir de l'année 1996. Enfin, les mécanismes d'assistance sociale gérés à l'échelle locale n'entrent en vigueur qu'à partir de 2000 et sont appréhendés par le biais d'une variable agrégée.

Le pourcentage de bénéficiaires de chaque transfert et le montant moyen des différents transferts parmi les ménages bénéficiaires pour 1994, 1996, 1998 et 2000 sont reportés dans le tableau 2. Ces résultats appellent plusieurs commentaires. Premièrement, les pensions sont à la fois le transfert reçu par le plus grand nombre et celui dont le montant moyen est le plus important. Ainsi, en 1994 et 2000, plus de la moitié des familles percevait une pension. Cette place prépondérante occupée par l'assurance vieillesse dans le système de transferts publics[11] se justifie par le vieillissement continu de la population russe, à l'origine d'une augmentation marquée du nombre de pensionnaires de 32,8 millions en 1990 à 38,4 millions en 2000 [Gurvich (2002)]. Précisons que la forte diminution du pourcentage de familles bénéficiaires intervenue entre 1994 et 1996 doit être mise en relation avec la crise du système de pensions et plus généralement du système de protection sociale de 1996, évoquée précédemment. Deuxièmement, entre 1994 et 2000, on a assisté à une augmentation régulière et marquée de la proportion de bénéficiaires de l'assistance sociale, essentiellement du fait de la mise en place de nouveaux mécanismes. Ainsi, l'allocation logement, inexistante en 1994, est perçue par près de 20 % des ménages en 2000. Néanmoins, les montants alloués au titre de l'assistance sociale reste

[11] En 2000, la contribution des pensions au système de transferts publics atteint 90 %.

globalement très limités. Troisièmement, les indemnités chômage sont résiduelles dans la mesure où la part des ménages en bénéficiant est inférieure à 2 %, quelle que soit l'année considérée. Ceci s'explique vraisemblablement par le faible taux d'enregistrement des chômeurs auprès des agences pour l'emploi. Le taux de chômage effectif (au sens du BIT) est en effet 3,5 à 5,5 fois supérieur au taux de chômage officiel, ce large écart indiquant qu'une majorité de chômeurs considère que les bénéfices d'un enregistrement ne compensent pas les coûts, et préfèrent rester indépendants dans leur recherche d'emploi [Kapeliouchnikov (1999)]. Quatrièmement, la proportion des ménages recevant des prestations familiales a fortement décliné passant de 31 % en 1994 à 11 % en 1998 avant de se redresser. La baisse est notamment très significative entre 1994 et 1996, traduisant là aussi la crise du système de protection sociale de 1996. Enfin, tous les transferts publics ont vu leur montant moyen diminuer sur la période 1994-2000. Pour les pensions, par exemple, cette baisse atteint 24 %. La tendance est encore plus prononcée dans le cas de l'allocation chauffage[12].

4. Construction d'un indicateur de dépense pré-transferts publics

La construction d'un indicateur de bien-être pré-transferts, préalable à toute analyse d'incidence des transferts sociaux sur les conditions de vie, soulève un certain nombre de problèmes conceptuels relatifs à l'existence de réponses comportementales de la part des ménages, suite à l'obtention d'un transfert. Néanmoins la structure de panel des données RLMS peut permettre, dans une certaine mesure, de tenir compte de ces réponses sans à avoir à en déterminer la nature et donc de construire un indicateur de bien-être pré-intervention publique.

1. Concepts et méthodes : le problème des réponses comportementales

De manière générale, les analyses sur l'incidence des transferts reposent sur la comparaison de la distribution pré-intervention (distribution du bien-être hors transferts sociaux) et de la distribution post-intervention (distribution du bien-être courant). C'est la raison pour laquelle l'estimation d'un indicateur de bien-être pré-transferts est un préalable à toute analyse empirique. La plupart du temps il est estimé en soustrayant le montant total des transferts du niveau de bien-être courant, que celui-ci soit appréhendé par le revenu ou la dépense[13]. Une telle démarche suppose l'absence de réponses comportementales de la part des ménages suite au versement des transferts et semble à cet égard peu réaliste. En effet, l'intervention publique, via le système de transferts, peut induire une modification du comportement des ménages en termes d'offre de travail, de consommation, de décisions d'investissement ou d'épargne. Ces réponses comportementales expliquent que le gain net en termes de revenu ou de consommation consécutif à l'allocation des transferts soit inférieur au montant des transferts. Par exemple, face à l'augmentation d'un transfert, le ménage peut choisir de réduire son offre de travail. Se produit alors un effet d'éviction du revenu salarial par le revenu social qui explique que le gain en termes de bien-être résultant de l'augmentation du transfert soit inférieur au montant de cette augmentation. Un raisonnement similaire peut être mené en parlant de l'éviction des transferts privés par les transferts publics [Cox, Jakubson (1995)].

Si le bien-être est appréhendé par les dépenses de consommation, il est possible, à l'instar de Ravallion *et al.* (1995), de tenir compte des réponses comportementales en introduisant le concept de *propension marginale à consommer les transferts sociaux*[14]. Cette dernière, notée c_{Tr}, mesure le changement de consommation induit par la variation des transferts sociaux. Une c_{Tr} comprise entre 0 et 1 indique qu'il existe des réponses comportementales de la part des ménages, mais que le bénéfice net est toujours positif à la marge. Dans le cas où elle est égale à l'unité, il y a absence de réponses comportementales. Si le concept de c_{Tr} ne renseigne pas sur la nature de ces réponses, il permet, d'une part, de déterminer le montant des transferts nets des réponses comportementales et d'autre part, de

[12] Le cas de l'allocation chauffage est particulier en ce sens qu'il s'agit d'un transfert hérité du système soviétique, en voie de disparition.
[13] Pour la Russie, voir Klugman (1997) et World Bank (1999).
[14] Voir également Okrasa (1999) et Van de Walle (2003).

construire l'indicateur de dépense pré-intervention. Formellement, si y_i et Tr_i représentent respectivement la dépense courante et le montant des transferts sociaux pour le ménage i, alors la dépense pré-intervention $y_i^{pré}$ est donnée par :

$$y_i^{pre} = y_i - c_{Tr} Tr_i \qquad (2)$$

Le terme $c_{Tr} Tr_i$ représente le montant des transferts nets des réponses comportementales.

2. Estimation de la propension marginale à consommer les transferts sociaux

La structure de panel des données RLMS peut permettre d'estimer la propension marginale à consommer les transferts sociaux à partir d'un modèle à effets fixes individuels et temporels. Il s'agit d'appliquer la méthode de Ravallion *et al.* (1995). Si l'on note Y_{it} la dépense en équivalent adulte du ménage i à la date t, Tr_{it} le montant des transferts en équivalent adulte, X_{it} un vecteur de variables de contrôle, η_i l'effet fixe individuel, δ_t l'effet fixe temporel et ε_{it} le terme de résidu, on a le modèle suivant :

$$Y_{it} = \alpha + c_{Tr} Tr_{it} + \gamma' X_{it} + \eta_i + \delta_t + \varepsilon_{it} \qquad (3)$$

L'application de l'estimateur *LSDV* (*Least Squares Dummy Variables*) au modèle (3) permet d'obtenir une première approximation de la propension marginale à consommer les transferts publics[15]. L'estimation du modèle en l'absence de variables de contrôle conduit à une c_{Tr} de 0,23 (σ = 0,1927) qui n'est pas statistiquement significative. Lorsque l'on introduit des variables de contrôle, la c_{Tr} s'élève à 0,58 (σ = 0,2028) et devient significativement différente de 0 et de 1, traduisant ainsi la présence de réponses comportementales[16].

Le problème majeur relatif à une telle spécification, tient à l'endogénéité potentielle de la variable Tr_{it}, endogénéité qui peut engendrer un biais dans les estimations puisque l'hypothèse d'absence de corrélation entre la variable considérée et le résidu n'est plus respectée [$Cov(Tr_{it}, \varepsilon_{it}) \neq 0$]. Trois sources d'endogénéité doivent être distinguées. Premièrement, le montant des transferts peut être corrélé aux effets fixes individuels, c'est-à-dire aux caractéristiques des ménages non observables et stables dans le temps [$Cov(Tr_{it}, \eta_i) \neq 0$]. Une telle source d'endogénéité peut par exemple se manifester dans le cas où les transferts sont délibérément ciblés sur les pauvres de long terme [Van de Walle (2003a)]. Cette endogénéité potentielle peut être corrigée par l'estimation du modèle en différence première. En effet, un modèle où toutes les variables sont différenciées permet d'éliminer le terme d'effets fixes individuels, conformément à l'équation (4) :

$$\Delta Y_{it} = c_{Tr} \Delta T_{it} + \gamma' \Delta X_{it} + \Delta\delta_t + \Delta\varepsilon_{it} \qquad (4)$$

Si l'on se réfère au tableau A-1 reporté en annexes [Régression (1)], l'estimation du modèle (4) avec variables de contrôle en différence première, conduit à une c_{Tr} de 0,44 (σ = 0,1751) significativement différente de 0 et de 1, que nous choisissons comme valeur de référence.

---

[15] Le modèle à effets fixes est estimé par application du théorème de Frisch-Waugh qui « *montre comment l'estimation des coefficients d'un modèle économétrique peut se décomposer en celle, séquentielle, de deux sous-ensembles de coefficients* » [Sevestre (2002), p. 21]. La mise en œuvre de cette procédure séquentielle dans le cadre du modèle à effets fixes revient en fait à appliquer les moindres carrés ordinaires (*MCO*) au modèle en déviation à la moyenne. L'estimateur ainsi obtenu est un estimateur intra-individuel ou estimateur *LSDV* (*Least Squares Dummy Variables*). Pour plus de précisions sur ces aspects techniques, se reporter à Greene (1997) et Sevestre (2002).

[16] Les variables de contrôle retenues sont liées à la composition démographique du ménage (taille du ménage, nombre d'enfants de moins de 7 ans, nombre d'enfants de 7 à 15 ans, nombre de retraités), aux caractéristiques du chef de ménage (sexe, âge, âge au carré, nombre d'années d'éducation) et aux caractéristiques productives du ménage (accès à la terre, nombre d'actifs).

Deuxièmement, le montant des transferts peut être lié aux effets fixes temporels, c'est-à-dire aux déterminants de la consommation non observables et communs à tous les ménages [$Cov(Tr_{it}, \delta_t) \neq 0$]. Ceci peut par exemple se produire si les conditions d'éligibilité d'un ou plusieurs transferts se modifient dans le temps [Van de Walle (2003a)]. Afin de corriger cette deuxième source d'endogénéité, Okrasa (1999) préconise d'estimer un modèle en différence première pour chaque sous période du panel. Dans notre cas, il s'agit d'estimer trois modèles distincts pour 1994-96, 1996-98 et 1998-2000. Puisque pour ces trois régressions seules deux années sont retenues, le terme $\Delta\delta_t$ devient une simple constante et l'estimation s'opère par les *MCO*. Une telle démarche permet donc non seulement de corriger la deuxième source d'endogénéité mais également de tester la stabilité temporelle de la c_{Tr}. Pour les trois sous périodes, cette dernière atteint respectivement 0,40 (σ = 0,3917), 0,43 (σ = 0,1900) et 0,37 (σ = 0,3729) [Régressions (2) à (4)]. Ces trois valeurs n'étant pas statistiquement différentes de 0,44, l'hypothèse de stabilité temporelle de la propension à consommer sans les transferts sociaux ne peut être rejetée et la deuxième source d'endogénéité peut être considérée comme négligeable.

Troisièmement, le montant des transferts peut être lié aux caractéristiques observables des ménages prises en compte dans le vecteur X_{it}. Il s'agit alors de recourir aux techniques des variables instrumentales et d'appliquer la méthode des doubles moindres carrés (*DMC*). Le montant des transferts de l'année *t*, noté Tr_{it}, est instrumentalisé par les variables de contrôle en niveau de l'année précédente X_{it-1}. On obtient alors une prédiction du montant des transferts en *t*, qui permet de calculer la valeur prédite de ΔTr_{it}[17]. L'estimation du modèle en différence première avec cette approximation et les différentes variables de contrôle conduit à une c_{Tr} estimée de 0,73 (σ = 0,1946), valeur qui n'est pas statistiquement différente de 0,44 [Régression (5)]. En outre, le test de Hausman, comparant l'estimateur *LSDV* à l'estimateur des *DMC*, nous conduit à retenir le modèle en différence première standard [Régression (1)] et donc à rejeter l'hypothèse d'endogénéité des transferts publics.

Enfin, il convient de discuter de la stabilité structurelle de la c_{Tr}. En effet, les ménages les plus pauvres sont censés, en théorie, présenter une propension à consommer les transferts sociaux plus importante que la moyenne. Pour tester une telle hypothèse, le modèle (4) est estimé pour deux sous échantillons : les pauvres et les non pauvres en 1994 [Régressions (6) et (7)]. Il est alors possible de mettre en œuvre un test de Chow de stabilité structurelle. Le modèle contraint, défini sous l'hypothèse H_0 de stabilité des coefficients entre les deux sous échantillons correspond au modèle (4) dont l'estimation est donnée par la régression (1). Le modèle non contraint est une superposition des deux régressions individuelles [Régressions (6) et (7)]. La statistique du test de Chow étant supérieure au seuil de la loi de Fisher correspondant, l'hypothèse H_0 doit être rejetée. En d'autres termes, la stratification de l'échantillon en termes de ménages pauvres / non pauvres semble justifiée d'un point de vue statistique. Néanmoins, les c_{Tr} estimées, qui s'établissent à 0,62 (σ = 0,2005) et 0,42 (σ = 0,6233) pour les pauvres et les non pauvres respectivement, ne sont pas significativement différentes de 0,44. Nous choisissons donc de ne pas tenir compte de l'instabilité structurelle mise en évidence par le test de Chow, et de conserver notre valeur de référence.

En définitive, nous optons pour une propension marginale à consommer sans les transferts sociaux de 0,44 puisque aucune des différentes estimations ne s'en écarte d'un point de vue statistique. Quoique relativement arbitraire, cette valeur est proche des estimations de Ravallion *et al.* (1995) pour la Hongrie [0,43] et de Van de Walle (2003a) pour le Vietnam [0,50]. En tout cas, elle suggère la présence de réponses comportementales, même si les techniques développées ne renseignent pas sur la nature de ces réponses.

5. Une évaluation statique de l'efficacité des transferts publics

[17] L'instrumentalisation est satisfaisante dans la mesure où le coefficient de corrélation entre la valeur prédite et la vraie valeur de ΔTr_{it} atteint 0,66.

Sous le régime soviétique, l'emploi garanti et le système de protection sociale permettaient à chaque citoyen, pour autant qu'il accepte de participer pleinement au développement de l'idéal socialiste, d'atteindre un niveau de vie socialement acceptable. La période de transition économique ayant provoqué un accroissement sans précédent de la précarité, on est en droit de s'interroger sur la capacité du système de protection sociale russe à réduire la pauvreté. Dans un premier temps, nous présentons quelques aspects théoriques montrant qu'un système de transferts doit être jugé sur son aptitude à repérer les ménages pauvres (*ciblage*), mais également sur sa faculté à résorber l'écart de pauvreté (*allocation*). Dans un second temps, nous spécifions un ensemble d'outils graphiques permettant d'identifier l'impact des transferts sur la pauvreté, en distinguant l'influence du ciblage et des mécanismes d'allocation. Enfin, l'application de ces techniques à la Russie nous permet d'évaluer les performances du système de transferts et des différents types de bénéfices dans la lutte contre la pauvreté.

1. Performances des transferts : ciblage et mécanismes d'allocation

Soient z la ligne de pauvreté, y_i le bien-être du ménage i et q le nombre de ménages pauvres. En l'absence de contrainte budgétaire, un système de transferts est jugé efficace s'il permet de résorber l'écart de pauvreté global $\sum_{i=1}^{q}(z - y_i)$. Dans le cas où les autorités disposent d'un budget limité, l'effet sera optimal s'il y a maximisation du gain pour les pauvres, compte tenu de la contrainte budgétaire. En fait, l'évaluation du rôle du système de transferts exige de distinguer deux éléments : (i) le ciblage qui traduit la capacité du système à repérer et atteindre les q ménages pauvres ; (ii) les règles d'allocation qui traduisent la contribution du système à la résorption de l'écart de pauvreté de chaque ménage pauvre. Il convient, afin de fixer les idées, d'appuyer nos propos par un raisonnement graphique, conformément à Coady *et al*. (2004).

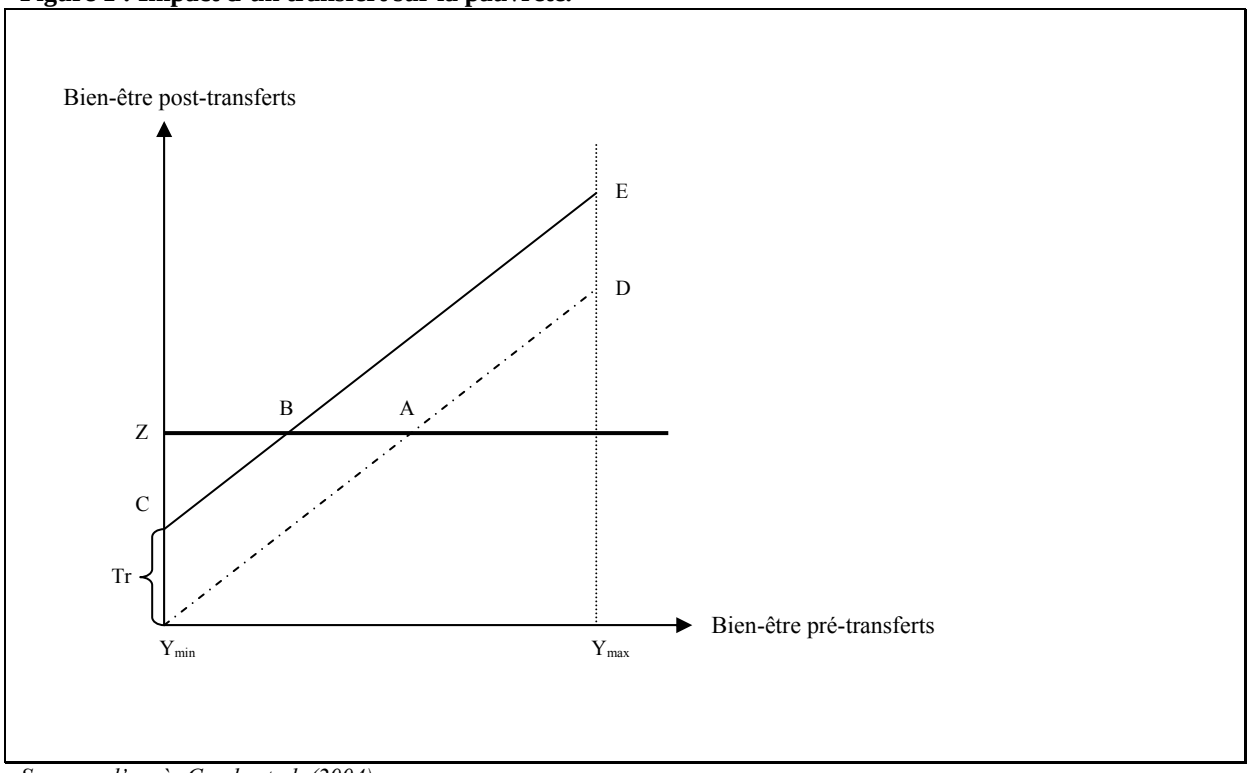
La figure 1 affiche en abscisses le bien-être pré-transferts et en ordonnées le bien-être post-transferts. Y_{min} et Y_{max} représentent respectivement les niveaux du bien-être pré-transferts minimum et maximum. Le segment DY_{min} représente la situation sociale avant l'intervention publique et correspond par conséquent à la droite d'égalité entre le bien-être pré-transferts et le bien-être post-transferts. Etant donné z la ligne de pauvreté, l'aire du triangle zAY_{min} représente l'écart de pauvreté pré-transferts global [$\sum_{i=1}^{q}(z - y_i^{pré})$]. En supposant que les pouvoirs publics disposent d'un budget juste suffisant pour éliminer la pauvreté, le programme de transferts optimal sera celui qui comble la totalité de l'écart de pauvreté global. Considérons à titre d'illustration le cas d'un transfert uniforme qui accorde le même montant Tr à tous les ménages (pauvres ou non). La situation post-intervention, résumée par le segment EC, indique que si l'écart de pauvreté a diminué (passant de zAY_{min} à zBC), le transfert n'a pas permis de le résorber en totalité. En fait, cet effet mitigé est lié à deux sources d'inefficience. Premièrement, des ménages non pauvres ont reçu le transfert : il s'agit là d'un problème de *ciblage*. Deuxièmement, certains ménages pauvres ont reçu des bénéfices supérieurs à leur écart de pauvreté : il s'agit d'un problème d'*allocation*.

2. Concepts et méthodes : l'apport d'une analyse de dominance stochastique

Les analyses de dominance stochastique sont particulièrement didactiques en ce sens qu'elles permettent de classer différentes distributions, de manière robuste. Il existe des techniques récentes, appropriées à l'analyse de l'incidence des transferts publics. En particulier, les courbes de *Program Dominance* de second ordre (PD^2) présentent l'avantage, à travers leur décomposition en courbe de *Targeting Dominance* (TD^2) et d'*Allocation Dominance* (AD^2), d'introduire la distinction entre l'influence du ciblage et celle des règles d'allocation [Duclos *et al.* (2003)]. La courbe de Program Dominance d'ordre 2 pour un transfert tr, notée PD_{tr}^2, indique la part cumulative dans le total d'un transfert détenue par une population classée par ordre de bien-être pré-transferts (éventuellement

normalisé par la ligne de pauvreté). Elle affiche en ordonnées la part cumulée dans la dépense totale

Figure 1 : Impact d'un transfert sur la pauvreté.



Source : d'après Coady et al. (2004).

destinée au transfert *tr* et en abscisses le bien-être pré-transferts du ménage. Soit une ligne de pauvreté *z* et deux transferts *k* et *l*. Si $PD_k^2 > PD_l^2$ pour tout niveau de bien-être pré-transferts inférieur à *z*, alors PD_k^2 domine PD_l^2 et donc le transfert *k* est plus efficace que *l* pour réduire la pauvreté.

Comme cela a été mentionné précédemment, l'impact positif d'un transfert peut être dû à un bon ciblage (les pauvres bénéficient plus d'un transfert que les non pauvres) et/ou à une bonne allocation (les plus pauvres reçoivent des bénéfices relativement plus importants). Afin de tenir compte de cette distinction, les courbes *PD²* peuvent se décomposer en une courbe *TD²* (Targeting Dominance) qui rend compte de qui bénéficie du transfert et une courbe *AD²* (Allocation Dominance) qui capture les différences d'allocation parmi les bénéficiaires du transfert. La courbe de Targeting Dominance de second ordre TD_{tr}^2, d'une part, associe la proportion cumulée des bénéficiaires dans la population totale des bénéficiaires (ordonnées) au bien-être pré-transferts normalisé ou non (abscisses). Si $TD_k^2 > TD_l^2$ pour tout niveau de bien-être pré-transferts inférieur à *z*, le transfert *k* propose un meilleur ciblage que le transfert *l*. La courbe d'Allocation Dominance de second ordre AD_{tr}^2, d'autre part, représente la différence entre la courbe PD_{tr}^2 et la courbe TD_{tr}^2. Elle indique le gain (ou la perte) dans la réduction de la pauvreté imputable au mécanisme d'allocation du transfert. Si $PD_{tr}^2 > TD_{tr}^2$ pour tout niveau de bien-être avant transferts inférieur à *z*, alors le mécanisme d'allocation est favorable aux pauvres. En d'autres termes, la part des pauvres dans le total du transfert est supérieure à leur part dans le nombre de bénéficiaires. En outre, si $AD_k^2 > AD_l^2$ pour tout bien-être pré-transferts inférieur à *z*, les règles d'allocation qui gouvernent le transfert *k* sont plus favorables aux pauvres que celles à la base du transfert *l*.

Tableau 3 : Mesures de la pauvreté en termes de dépense pré-transferts et de dépense post-transferts[1]. Russie 1994-2000.

	1994			2000			η[3]		
	Incidence P0	Intensité P1	Inégalité P2	Incidence P0	Intensité P1	Inégalité P2	Incidence P0	Intensité P1	Inégalité P2
Dépense pré-transferts[2]	0,2050	0,0958	0,0645	0,2954	0,1268	0,0771	8,50*	5,48*	2,97*
	0,007	*0,004*	*0,003*	*0,008*	*0,004*	*0,003*			
Dépense post-transferts	0,1440	0,0548	0,0298	0,2231	0,0743	0,0368	8,58*	4,60*	2,47*
	0,006	*0,003*	*0,002*	*0,007*	*0,003*	*0,002*			
η pré / post transferts[3]	6,61*	8,20*	9,62*	6,80*	10,50*	11,18*			

Notes : (1) Indices de la classe FGT avec $\alpha = 0$, $\alpha = 1$ et $\alpha = 2$. Dépenses mensuelles exprimées en équivalent adulte aux prix de 1994. Ligne de pauvreté de 1828 roubles par adulte et par mois. Les erreurs types sont indiquées en italique. (2) Dépense pré-transferts estimée avec une c_{Tr} de 0,44. (3) Le calcul des statistiques η suit Kakwani (1990). Une (*) signifie que les différences de pauvreté sont statistiquement significatives au seuil de 5 %.
Source : à partir des bases de données des enquêtes RLMS.

3. Evidence empirique

A. Pauvreté pré-transferts et pauvreté post-transferts

L'impact du système de transferts sur les conditions de vie peut être appréhendé en comparant l'ampleur de la pauvreté sur la base de la dépense pré-transferts et de la dépense post-transferts. A cette fin, les valeurs des indices FGT associées aux deux types de dépenses sont reportées dans le tableau 3.

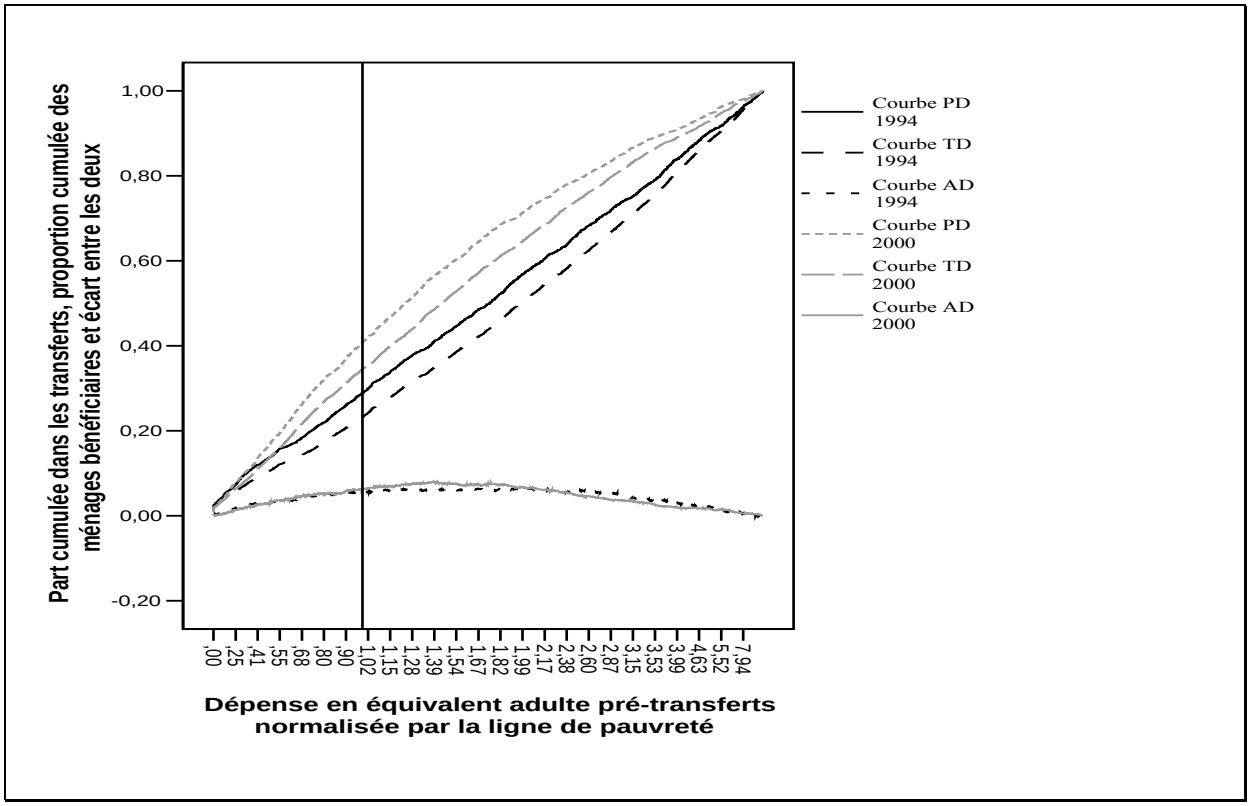
En premier lieu, quelle que soit l'année, la pauvreté pré-transferts est supérieure à la pauvreté post-transferts. En d'autres termes, la pauvreté appréhendée selon ses trois dimensions (incidence – intensité – inégalité) est plus importante en l'absence de transferts publics. A titre d'illustration, l'écart d'incidence de la pauvreté pré-transferts et post-transferts atteint plus de 6 points de pourcentage en 1994. Les écarts sont également prononcés pour l'intensité et l'inégalité de la pauvreté. D'ailleurs le test de nullité des différences de pauvreté à partir de la statistique η révèle que les écarts de pauvreté sont fortement significatifs, quelles que soient l'année et la dimension de la pauvreté considérées[18]. Ce premier résultat confère au système de protection sociale une certaine efficacité dans la réduction de l'incidence de la pauvreté, mais également dans la résorption des écarts de pauvreté que ceux-ci soient pondérés (P_2) ou non (P_1). En second lieu, les écarts entre la pauvreté pré-transferts et la pauvreté post-transferts sont en hausse entre 1994 et 2000, augmentation qui concerne à la fois les différences d'incidence et les différences d'intensité ou d'inégalité. L'écart d'incidence est ainsi passé de 6 points de pourcentage en 1994 à plus de 7 points en 2000. Pour l'intensité de la pauvreté, l'écart était de 4 points au début de la période et atteint plus de 5 points en 2000. Cette accentuation des écarts traduit une amélioration, certes légère, des performances du système de protection sociale, tout au long de la période d'étude.

B. Evolution des performances du système de transferts

Considérons la figure 2 présentant les courbes de *Program Dominance*, de *Targeting Dominance* et d'*Allocation Dominance* de second ordre pour l'ensemble du système de transferts en 1994 et 2000. Pour un niveau de dépense normalisée inférieur à 1, la courbe PD^2 en 2000 est strictement supérieure à la courbe PD^2 en 1994. Le système de transferts en 2000 est par conséquent

[18] Le test de nullité des différences de pauvreté est présenté par Kakwani (1990).

Figure 2 : Courbes PD, TD et AD de second ordre pour l'ensemble du système de transferts[1]. Russie 1994-2000.



Note : (1) Dépenses mensuelles exprimées en équivalent adulte aux prix de 1994. Ligne de pauvreté de 1828 roubles par adulte et par mois. Dépense pré-transferts estimée avec une c_{Tr} de 0,44.
Source : à partir des bases de données des enquêtes RLMS.

plus performant que celui de 1994 en termes de réduction de la pauvreté, confirmant par là même la conclusion précédente. D'après le tableau 4 donnant les valeurs prises par les courbes PD^2, TD^2 et AD^2 au niveau du seuil de pauvreté ou de la moitié du seuil de pauvreté, la part des pauvres dans le montant des transferts est de 41,5 % en 2000 pour seulement un peu plus de 30 % en 1994[19]. De plus, les quatre types de transferts ont vu leur performance s'améliorer ; la part des pauvres dans la dépense totale allouée aux indemnités chômage est par exemple passée de près de 12 % en 1994 à plus de 21 % en 2000.

La décomposition des courbes PD^2 en courbes de ciblage (TD^2) et d'allocation (AD^2) peut permettre d'expliquer cet écart de performance. Il apparaît d'une part que le système de transferts sociaux est mieux ciblé sur les pauvres en 2000 qu'en 1994 dans la mesure où la courbe TD^2 pour l'année 2000 est plus élevée que la courbe TD^2 pour 1994 et ce quel que soit le niveau de dépense pré-transferts. Ainsi, la proportion des pauvres dans la population des ménages bénéficiaires atteint 23,4 % en 1994 et près de 35 % en 2000. Le ciblage s'est amélioré pour les quatre catégories de transferts, et de manière très sensible pour les indemnités chômage et l'assistance sociale. Par exemple, la part des ménages pauvres dans la population des ménages bénéficiant d'une assistance sociale est passée de moins de 24 % à 36 %. En termes d'allocation, d'autre part, la supériorité de la courbe PD^2 par rapport à la courbe TD^2 pour les deux années suggère que la part dans le total des transferts des pauvres est supérieure à leur part dans le nombre de bénéficiaires, c'est-à-dire que le mécanisme d'allocation des transferts est favorable aux pauvres. Néanmoins, le profil des courbes AD^2 ne révèle pas de distinction claire dans les performances d'allocation, entre les deux années. En effet, la présence d'un point d'intersection entre les deux courbes pour des dépenses normalisées inférieures à l'unité signifie qu'on ne peut pas conclure sur la dominance d'une courbe par rapport à l'autre. Si l'on s'attarde sur le détail

[19] Cette part pour les pauvres extrêmes atteint respectivement de 15,5 % et 18,5 % en 1994 et 2000.

Tableau 4 : Valeurs associées aux courbes de Program Dominance, Targeting dominance et Allocation Dominance[1]. Russie 1994-2000.

	(1) Part des ménages pauvres dans le montant total des différents transferts[2]		(2) Part des ménages pauvres dans la population des bénéficiaires des différents transferts[3]		(3) Ecart entre (1) et (2)[4]	
	z = 1828,63[5]	z = 914,315[5]	z = 1828,63[5]	z = 914,315[5]	z = 1828,63[5]	z = 914,315[5]
1994						
Pensions	31,71	16,66	29,59	14,98	2,12	1,68
Prestations familiales	12,85	2,34	10,83	2,64	2,02	-0,30
Dont:						
Allocation enfance	*13,45*	*2,83*	*11,45*	*2,86*	*2,00*	*-0,03*
Allocation étudiant	*10,84*	*0,72*	*7,66*	*1,28*	*3,18*	*-0,56*
Indemnités chômage	11,85	9,06	12,96	7,41	-1,11	1,65
Assistance sociale	33,41	19,09	23,44	10,94	9,97	8,15
Ensemble des transferts	30,14	15,55	23,40	10,96	6,74	4,59
2000						
Pensions	43,00	19,36	39,25	17,14	3,75	2,22
Prestations familiales	18,81	4,13	19,57	4,62	-0,76	-0,49
Dont:						
Allocation enfance	*22,69*	*5,36*	*22,73*	*5,36*	*-0,04*	*0,00*
Allocation étudiant	*9,80*	*1,27*	*13,44*	*2,69*	*-3,64*	*-1,42*
Indemnités chômage	21,38	1,17	32,00	8,00	-10,62	-6,83
Assistance sociale	36,97	17,39	36,01	13,47	0,96	3,92
Dont:						
Allocation chauffage	*16,14*	*2,02*	*32,14*	*7,14*	*-16,00*	*-5,12*
Allocation logement	*37,11*	*15,47*	*36,34*	*13,45*	*0,77*	*2,02*
Autre assistance sociale	*54,26*	*38,32*	*46,43*	*16,07*	*7,83*	*22,25*
Ensemble des transferts	41,46	18,45	34,66	14,39	6,80	4,06

Notes : (1) Ménages ordonnés par dépense pré-transferts (estimée avec une c_{Tr} de 0,44). (2) Valeurs associées à la courbe PD². (3) Valeurs associées à la courbe TD². (4) Valeurs associées à la courbe AD². (5) Roubles mensuels par adulte.
Source : à partir des bases de données des enquêtes RLMS.

Tableau 5 : Montant moyen des transferts en pourcentage de l'écart de pauvreté moyen sur la base de la dépense pré-transferts parmi les ménages pauvres bénéficiant des différents transferts[1]. Russie 1994-2000.

	Pensions	Prestations familiales	Indemnités chômage	Assistance sociale	Ensemble des transferts
1994	160,4	37,7	50,2	80,6	155,0
2000	136,3	26,7	48,8	17,9	134,9

Notes : (1) Transferts et la dépense pré-transferts exprimés en roubles mensuels en équivalent adulte aux prix de 1994. Ligne de pauvreté de 1828 roubles par adulte et par mois. Dépense pré-transferts estimée avec une c_{Tr} de 0,44.
Source : à partir des bases de données des enquêtes RLMS.

des transferts, on peut remarquer que le mécanisme d'allocation des pensions s'est amélioré alors qu'il s'est détérioré, voire très nettement détérioré, pour les trois autres catégories de bénéfices. A titre d'exemple, d'après le tableau 5, le montant moyen des transferts exprimé en pourcentage de l'écart de pauvreté pré-transferts moyen pour les ménages pauvres bénéficiaires a sensiblement décliné, passant de 155 % à 135 %. En conclusion, la supériorité du système de protection sociale en 2000 par rapport à 1994 s'explique essentiellement par l'amélioration du ciblage des transferts publics. Si le système de transferts semble jouer un rôle plus important en 2000 qu'en 1994 dans la réduction de la pauvreté, son efficacité doit être relativisée dans la mesure où on a assisté sur l'ensemble de la période à une diminution des montants alloués aux différents bénéfices, diminution qui explique que le mécanisme d'allocation du système de transferts ne soit pas plus performant en 2000 qu'en 1994.

C. Performances des différents transferts en 2000

Il s'agit dans ce paragraphe d'analyser l'efficacité des quatre types de transferts (pensions – prestations familiales – indemnités chômage – assistance sociale) dans la réduction de la pauvreté. A cet égard, la figure 3 présente respectivement les courbes PD^2, TD^2 et AD^2 en 2000 pour les différents bénéfices publics. Nos commentaires s'appuient également sur les résultats reportés dans les tableaux 4 et 5.

Premièrement, le graphique des courbes de *Program Dominance* indique que les pensions sont les transferts les plus efficaces en termes de réduction de la pauvreté. En effet, la courbe PD^2 sur les pensions domine les courbes associées aux autres transferts, quel que soit le niveau de dépense pré-transferts. Cette supériorité s'explique à la fois par la composante d'allocation (courbe AD^2)[20] et par la composante de ciblage (courbe TD^2). En fait, ce résultat est assez logique du fait de l'importance relative des ménages de retraités. Ces familles ont un revenu constitué pour l'essentiel des pensions et sont donc pour la plupart classées comme pauvres sur la base de la dépense pré-transferts[21]. Le système vieillesse joue par conséquent un rôle important dans la lutte contre la pauvreté en accordant un revenu à des ménages dépendants. Pour preuve, le montant moyen des pensions pour les ménages pauvres bénéficiaires représente 136 % de l'écart de pauvreté pré-transferts moyen [Tableau 5]. Cependant, de nombreux ménages de retraités perçoivent des pensions insuffisantes pour combler l'écart de pauvreté, les contraignant à rechercher des sources de revenu alternatives : prolongement de l'activité professionnelle (formelle ou informelle), vente d'actifs, recours à la production domestique, aux transferts privés[22]. En guise d'illustration, d'après les données RLMS de 2000, 61,3 % des ménages de retraités recouraient à la production domestique et plus de 23 % recevaient des transferts privés.

Deuxièmement, si en termes d'effet réducteur de la pauvreté, l'assistance sociale se classe au second rang des transferts derrière les pensions, la part des pauvres pré-intervention dans le montant total de l'assistance sociale ne s'élève qu'à 37 %. Le rôle de l'assistance sociale est par conséquent limité et ce d'autant plus qu'il s'agit de la seule catégorie de transferts reposant sur des mécanismes de ciblage. Trois arguments viennent à l'appui de ce résultat. D'une part, si l'on se reporte aux courbes TD^2, le ciblage de l'assistance sociale est moins performant que celui des pensions. Pour l'assistance sociale, la proportion de pauvres parmi les ménages bénéficiaires atteint seulement 36 %. Autrement dit, le ciblage de l'assistance sociale en Russie est particulièrement déficient ; il est à l'origine d'erreurs d'inclusion (des ménages non pauvres perçoivent des aides au titre de l'assistance sociale) et d'erreurs d'exclusion (des ménages pauvres ne perçoivent pas d'aides)[23]. D'autre part, le mécanisme

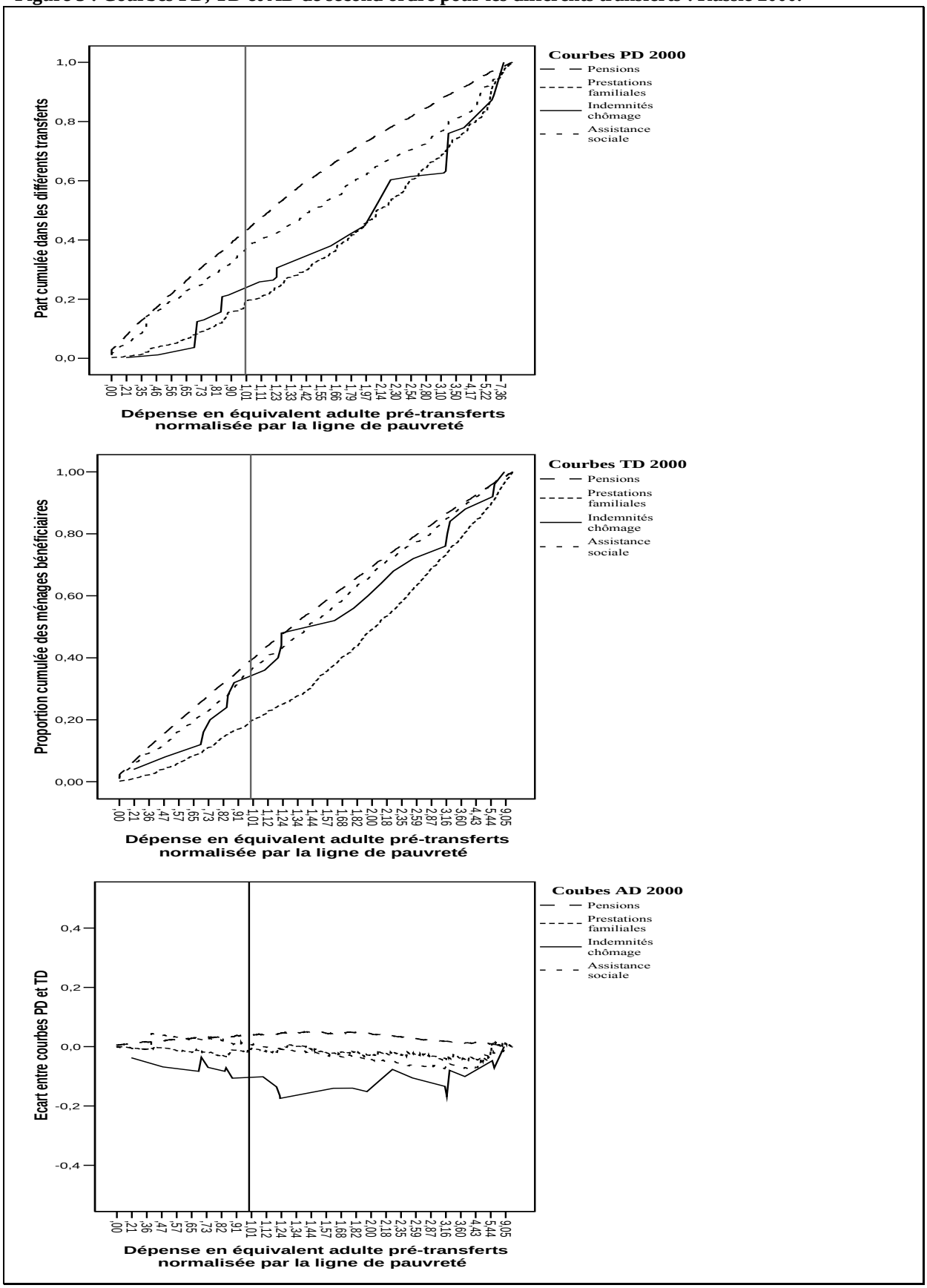
[20] Il y a toutefois un point d'intersection entre la courbe AD^2 associée aux pensions et celle associée à l'assistance sociale pour des dépenses normalisées inférieures à un. Si l'on se réfère au tableau 4, le mécanisme d'allocation des pensions est plus favorable aux pauvres que le mécanisme d'allocation de l'assistance. En revanche, c'est l'inverse lorsque l'on se focalise sur les pauvres extrêmes.

[21] En 2000, d'après les données RLMS, les ménages de retraités représentent 24 % de la population totale.

[22] Pour plus de précisions sur les stratégies mises en œuvre par les retraités, se reporter à Foley (2003).

[23] D'après les données RLMS de 2000, 20,5 % des ménages non pauvres sur la base de la dépense pré-transferts reçoivent des bénéfices au titre de l'assistance sociale.

Figure 3 : Courbes PD, TD et AD de second ordre pour les différents transferts[1]. Russie 2000.



Note : (1) Dépenses mensuelles exprimées en équivalent adulte aux prix de 1994. Ligne de pauvreté de 1828 roubles par adulte et par mois. Dépense pré-transferts estimée avec une c_{Tr} de 0,44.

Source : à partir des bases de données des enquêtes RLMS.

d'allocation sous-jacent n'est pas particulièrement favorable aux pauvres. En effet, pour des valeurs de dépense normalisées inférieures à l'unité, la courbe *AD²* présente des valeurs proches de 0 signifiant que la part des ménages pauvres dans l'assistance sociale est équivalent à leur part dans le nombre de bénéficiaires. En d'autres termes, les ménages pauvres ne reçoivent pas des bénéfices relativement plus importants que les non pauvres. Enfin, les montants alloués au titre de l'aide sociale sont faibles. En 2000, parmi les ménages pauvres bénéficiaires, le rapport entre le montant moyen de l'assistance sociale et l'écart de pauvreté pré-transferts moyen est inférieur à 18 % [Tableau 5][24]. Si l'on désagrège l'assistance sociale, il apparaît que l'allocation chauffage exerce un effet réducteur de la pauvreté négligeable notamment en raison d'un mécanisme d'allocation particulièrement défavorable aux pauvres. L'allocation logement semble plus performante, mais reste néanmoins insuffisamment ciblée et ce d'autant plus qu'elle repose sur un test de ressources[25]. En définitive, ce sont les autres mécanismes d'assistance sociale, gérés par les municipalités, qui sont les plus favorables aux pauvres : 54 % du montant total destiné à ces aides sont reçus par les ménages pauvres. Et ces mécanismes locaux sont à la fois performants en termes de ciblage et d'allocation. Toutefois, seuls 1,5 % des ménages y ont accès et les bénéfices sont trop faibles pour exercer un rôle décisif : leur montant, exprimé en pourcentage de la ligne de pauvreté, atteint en 2000 parmi les ménages pauvres un peu plus de 20 %.

Considérons troisièmement le cas des indemnités chômage. Mises en place en 1991 pour faire face au développement du chômage inhérent au processus de réformes, elles restent très rudimentaires en 2000 puisque moins de 1 % des ménages les perçoivent alors que 9,6 % d'entre eux ont au moins un chômeur au sens du BIT. La forme en dents de scie de la courbe *PD²* associée à ces indemnités est imputable à ce faible nombre de bénéficiaires. La position de la courbe indique par ailleurs que les indemnités chômage sont peu performantes ; les ménages pauvres sur la base de la dépense pré-transferts ne perçoivent que 21 % du montant total alloué aux indemnités chômage, et les ménages en situation d'extrême pauvreté à peine plus de 1 %. En outre, le mécanisme d'allocation des indemnités est particulièrement défavorable aux pauvres. En effet, pour des valeurs de dépense pré-transferts inférieures au seuil de pauvreté, la courbe *AD²*, qui représente la différence entre les courbes *PD²* et *TD²*, présente des valeurs fortement négatives. Finalement, sachant que le chômage est un facteur clé dans l'explication de la pauvreté, ces résultats traduisent l'inefficacité du système d'assurance chômage russe à protéger les ménages dont un membre est touché par la perte d'un emploi.

Les prestations familiales, enfin, contribuent peu à la diminution de la pauvreté étant donné que seuls 19 % du montant alloué à ces bénéfices vont aux ménages pauvres. En outre, si l'on se réfère aux courbes *TD²*, il s'agit du transfert le moins bien ciblé : moins de 20 % des ménages bénéficiaires sont pauvres sur la base de la dépense pré-transferts. Le mécanisme d'allocation est également défavorable aux pauvres, mais dans une moindre mesure que les indemnités chômage si l'on considère que la courbe *AD²* associée aux prestations familiales est supérieure à celle relative aux indemnités chômage, pour tout niveau de dépense inférieure à la ligne de pauvreté. Dans la mesure où l'allocation familiale est la composante principale des prestations familiales, ce résultat suggère que le nombre d'enfants n'est pas un facteur décisif dans l'explication de la pauvreté et qu'un transfert ciblé en fonction du nombre d'enfants ne peut prétendre être un outil performant dans la lutte contre la pauvreté en Russie[26]. De plus, le caractère universel de l'allocation familiale, c'est-à-dire l'absence de conditionnalité de ressources, justifie la faiblesse des montants alloués aux familles avec enfants. A titre d'illustration, le montant moyen des prestations familiales pour les ménages pauvres bénéficiaires exprimé en pourcentage de l'écart de pauvreté *ex-ante* moyen atteint moins de 27 % en 2000.

[24] Précisons également que ce rapport est en très nette baisse entre 1994 et 2000, baisse imputable à la diminution des montants de l'allocation chauffage.

[25] En fait, même si l'allocation logement repose sur un test de ressources, elle n'est pas directement ciblée sur les pauvres. En effet, le revenu est comparé non pas à la ligne de pauvreté mais à un seuil défini sur la base de la taille de la famille et de la superficie du logement.

[26] Pourtant, la création d'une allocation familiale universelle en 1990 visait à venir en aide aux familles avec enfants, celles-ci étant alors plus vulnérables que la moyenne.

Au total cette analyse d'incidence statique a permis de souligner l'amélioration des performances du système de transferts dans la lutte contre la pauvreté, intervenue entre 1994 et 2000. Nous avons nuancé ce résultat en montrant que cette amélioration tenait essentiellement à un progrès du ciblage, mais que la baisse des montants alloués aux différents transferts avait engendré une dégradation de l'aptitude du système à résorber les écarts de pauvreté. Enfin, nous avons pointé le rôle décisif des pensions et insisté sur le caractère limité des autres bénéfices, en termes de pourcentages de bénéficiaires pour l'assurance chômage ou les mécanismes d'assistance sociale locaux et en termes de montants moyens pour les prestations familiales ou l'allocation logement. Cette analyse sur l'incidence des transferts sociaux ne saurait toutefois rendre compte de tous les enjeux relatifs à la politique sociale en Russie. Il convient de dépasser ce cadre statique en recourant aux données de panel, de manière à déterminer la capacité du système à tirer les ménages les plus précaires hors de la pauvreté et à protéger les ménages non pauvres face à un risque de pauvreté.

6. Une évaluation dynamique de l'efficacité des transferts publics

Dans la partie précédente, nous avons implicitement supposé que les pauvres constituaient un groupe homogène pourvu de caractéristiques communes et permanentes. Les ménages et les individus ont pourtant une histoire et un vécu ; leur niveau de vie évolue dans le temps de manière plus ou moins régulière et marquée. Ceci suggère que les trajectoires de bien-être des ménages sont distinctes et la prise en compte de la dimension temporelle dans l'analyse est indispensable afin de mettre à jour l'hétérogénéité des pauvres. Compte tenu de la nature de la pauvreté, il est fondamental de compléter l'étude statique sur l'incidence des transferts publics par une analyse dynamique qui tienne compte des trajectoires de pauvreté des ménages. Si une telle analyse peut être menée à partir de données transversales[27], une démarche plus intuitive et plus robuste consiste à recourir aux données de panel. Les investigations présentées dans cette section porte sur deux aspects. Il importe, dans un premier temps, d'évaluer l'impact du système de transferts publics sur la durée et la persistance de la pauvreté. Il s'agit plus précisément de déterminer dans quelle mesure l'allocation des transferts tient compte de la nature chronique ou transitoire de la pauvreté. Dans un second temps, la prise en compte des mouvements de pauvreté dans le cadre de politiques de réduction de la pauvreté exige de distinguer l'objectif de protection de l'objectif de promotion. Il s'agit plus précisément de déterminer la capacité du système de transferts russe à protéger les ménages non pauvres contre un risque d'entrée dans la pauvreté (objectif de protection) et à promouvoir les ménages pauvres, c'est-à-dire à faciliter leur sortie de la pauvreté (objectif de promotion).

1. Pauvreté persistante, pauvreté temporaire et transferts publics

Depuis une dizaine années, de nombreuses études insistent sur la nécessité d'identifier les différentes *formes de pauvreté*, c'est-à-dire de distinguer la pauvreté qui revêt un caractère durable de celle qui est de nature transitoire. La prise en compte des formes de la pauvreté doit en effet permettre de proposer des modèles explicatifs plus robustes mais également de mieux spécifier le contenu des politiques de lutte contre la pauvreté. Dans cette optique, il importe d'évaluer la contribution de système de protection sociale à la réduction de la pauvreté persistante et de la pauvreté transitoire. En premier lieu, après avoir précisé la méthode d'évaluation des formes de la pauvreté retenue, nous proposons de comparer l'ampleur de la pauvreté persistante et de la pauvreté transitoire sur la base du bien-être pré-transferts et du bien-être post-transferts. Dans un second temps, nous cherchons à déterminer la capacité du système de transferts et des différents bénéfices à cibler ces différentes formes de pauvreté.

[27] Voir Bourguignon, Pereira da Silva (2003).

Tableau 6 : Répartition des ménages selon les formes de la pauvreté[1] estimées sur la base de la dépense pré-transferts et de la dépense post-transferts. Russie 1994-2000.

Dépense pré-transferts[2]	Dépense post-transferts			
	Non pauvres	Pauvres temporaires	Pauvres persistants	Total
Non pauvres	41,2	-	-	41,2
Pauvres temporaires	8,6	44,5	-	53,1
Pauvres persistants	0,0	2,4	3,3	5,7
Total	49,8	46,9	3,3	100,0

Notes : (1) Formes de la pauvreté identifiées selon l'approche de périodes. (2) Dépense pré-transferts estimée avec une c_{Tr} de 0,44.
Source : à partir du panel équilibré (2088 ménages). RLMS.

A. Formes de la pauvreté pré-transferts et post-transferts

Afin d'identifier les différentes formes de la pauvreté, nous adoptons l'approche dite « *de périodes* »[28]. Cette approche, qui vise à appréhender la pauvreté selon sa durée ou sa persistance, consiste à compter le nombre de périodes, c'est-à-dire le nombre de vagues du panel, que chaque ménage a passé en situation de pauvreté. On obtient alors la répartition des ménages selon la durée de la pauvreté. Le choix de la durée minimum de pauvreté à partir de laquelle un ménage peut être considéré comme pauvre persistant est pour le moins arbitraire. Traditionnellement, on parle de pauvreté persistante pour les ménages ayant passé cinq ans dans la précarité [Hulme *et al.* (2001), Hulme, Shepherd (2003)]. Mais tout dépend de la durée couverte par le panel. En ce qui nous concerne, et dans la mesure où le panel s'étale sur seulement quatre périodes espacées de deux ans, nous avons décidé de considérer un ménage pauvre persistant s'il est pauvre à chaque période. Il s'agit alors d'identifier trois catégories: (i) les ménages non pauvres à toutes les périodes (*non pauvres*) ; (ii) les ménages pauvres à toutes les périodes (*pauvres chroniques ou persistants*) ; (iii) les ménages pauvres à certaines dates (*pauvres transitoires ou temporaires*)[29]. Le tableau 6 croise la répartition des ménages selon les trois catégories identifiées par l'approche de périodes, avant et après l'allocation des transferts publics.

Préalablement à l'étude sur l'impact du système de transfert, il importe de remarquer que la pauvreté en Russie est essentiellement un phénomène de nature transitoire puisque sur la base de la dépense post-transferts, seuls 3,3 % des ménages ont connu la pauvreté de manière ininterrompue entre 1994 et 2000 alors qu'ils sont 46,9 % à avoir fait face à une privation temporaire. Ces estimations confirment les résultats antérieurs de Mroz, Popkin (1995), Lokshin, Popkin (1999) et Clément (2003). Les résultats issus de l'approche de périodes confirment également l'effet favorable exercé par le système de transferts en termes de réduction de la pauvreté et indiquent que cet impact favorable se répercute sur les deux formes de pauvreté. Le système de transferts permet manifestement de réduire la part des familles en situation de pauvreté temporaire et persistante au profit de la catégorie des non pauvres. La part des ménages pauvres persistants en termes de dépense pré-transferts atteint 5,7 % mais n'est plus que de 3,3 % après l'intervention publique. Parallèlement, la part des pauvres temporaires diminue de plus de 6 points passant de 53,1 % à 46,9 %. Les mouvements entre catégories sont néanmoins très limités puisqu'au total, seuls 11 % des ménages changent de catégorie. A titre d'illustration, les transferts permettent seulement à 42 % des pauvres

[28] Deux approches alternatives ont également été proposées : l'approche de composantes et l'approche mixte, conciliant les deux premières méthodologies. Pour une présentation détaillée, se reporter à Clément (2003).
[29] Pour les limites conceptuelles relatives à l'approche de périodes, voir Clément (2003), pp. 18-19.

persistants sur la base de la dépense pré-transferts de passer dans la strate des pauvres temporaires. Et

Tableau 7 : Ciblage des transferts publics en fonction des formes de la pauvreté (sur la base de la dépense pré-transferts)[1]. Russie 1994-2000.

	Non pauvres		Pauvres temporaires		Pauvres persistants	
	% de bénéficiaires	Montant moyen[2]	% de bénéficiaires	Montant moyen[2]	% de bénéficiaires	Montant moyen[2]
Pensions	47,8	996,90	67,6	1150,80	88,2	1107,74
Prestations familiales	18,7	176,15	14,4	158,36	10,1	104,98
Dont:						
Allocation enfants	*13,6*	*158,55*	*11,5*	*158,34*	*8,4*	*119,61*
Allocation étudiants	*6,2*	*185,09*	*3,5*	*134,08*	*1,7*	*31,80*
Indemnités chômage	0,6	294,77	0,7	344,15	0,8	27,34
Assistance sociale	19,1	111,81	23,4	159,74	32,8	102,54
Dont:						
Allocation chauffage	*1,5*	*166,94*	*1,6*	*224,03*	*1,7*	*30,36*
Allocation logement	*17,9*	*95,47*	*21,7*	*104,30*	*31,9*	*98,09*
Autres transferts	*0,9*	*183,20*	*1,6*	*677,91*	*1,7*	*105,46*
Ensemble des transferts	62,4	852,69	77,5	1084,38	93,3	1095,49

Notes : (1) Formes de la pauvreté identifiées selon l'approche de périodes, sur la base de la dépense pré-transferts. Dépense pré-transferts estimée avec une c_{Tr} de 0,44. (2) Roubles mensuels exprimés en équivalent adulte aux prix de 1994.
Source : à partir du panel équilibré (2088 ménages). RLMS.

aucun ménage n'est passé de la catégorie des pauvres persistants à celle des non pauvres. En définitive, l'effet du système de transferts sur les formes de pauvreté est réel mais doit être nuancé dans la mesure où la proportion de ménages changeant de catégorie reste faible.

B. Formes de la pauvreté et ciblage / allocation des transferts

Afin d'évaluer dans quelle mesure les différents transferts tiennent compte de la durée de la pauvreté, le tableau 7 présente le pourcentage de bénéficiaires et le montant moyen des transferts en 2000, les ménages étant classés en fonction des trois catégories de l'approche de périodes, sur la base du bien-être pré-transferts. De manière générale, le système de transferts est convenablement ciblé sur les formes de pauvreté puisque que le pourcentage de bénéficiaires et le montant moyen des transferts parmi les bénéficiaires s'accroît lorsqu'on se déplace de la catégorie des non pauvres vers celle des pauvres persistants. Par exemple, 93,3 % des ménages en situation de privation de long terme avant l'intervention publique reçoivent des transferts, alors que cette proportion n'est que de 62,4 % pour les non pauvres. Autrement dit, on peut considérer que le système de transferts russe est « progressif » ou « pro-pauvres » en termes de formes de la pauvreté. Si l'on s'attache au détail des bénéfices, il apparaît que cette progressivité s'explique principalement par les pensions. Ces dernières, qui représentent rappelons-le environ 90 % de l'ensemble des transferts, sont perçues par plus de 88 % des pauvres persistants et par moins de 50 % des ménages non pauvres. Le mécanisme d'allocation des pensions tient cependant moins compte de la durée de la pauvreté puisque leur montant moyen parmi les pauvres temporaires bénéficiaires est supérieur au bénéfice moyen perçu par les ménages en situation de pauvreté chronique.

Les prestations familiales, qu'il s'agisse des allocations liées à l'enfance ou de l'allocation étudiant, sont en revanche très mal ciblées. Seuls 10 % des ménages pauvres permanents perçoivent des prestations familiales en 2000, contre 13,6 % des non pauvres. De plus, le mécanisme d'allocation est nettement défavorable aux pauvres puisque le montant moyen diminue lorsqu'on se déplace de la catégorie des non pauvres vers celle des pauvres de long terme. Concernant les indemnités chômage, les résultats indiquent qu'elles exercent un effet quasi-négligeable. Quelle que soit la catégorie, moins

de 1 % des ménages en bénéficient. Il est par conséquent difficile d'accorder une signification aux différences dans les montants moyens.

Les résultats ayant trait à l'assistance sociale sont intéressants à plus d'un titre. Les mécanismes d'assistance sociale pris dans leur ensemble sont correctement ciblés, dans la mesure où le pourcentage de bénéficiaires augmente lorsqu'on se déplace de la strate des non pauvres vers celle des pauvres persistants. Toutefois, le pourcentage de bénéficiaires parmi les pauvres (qu'ils soient temporaires ou chroniques) reste insuffisant et les familles en situation de privation chronique sont celles qui, en moyenne, reçoivent les aides les plus faibles. Si l'on désagrège l'aide sociale, le transfert le mieux ciblé est l'allocation logement ; elle est respectivement reçu en 2000 par 31,9 % des pauvres de long terme et 25,4 % des pauvres temporaires. Le montant des bénéfices est néanmoins faible et peu discriminant par rapport aux autres composantes de l'assistance sociale. En dépit d'un faible nombre de bénéficiaires, le ciblage des autres transferts (aides locales) est satisfaisant. Par contre, le mécanisme d'allocation sous-jacent est essentiellement favorable aux pauvres temporaires. En effet, parmi cette catégorie, le montant moyen des aides locales est respectivement 3,7 et 6,4 fois plus important que celui des non pauvres et des pauvres persistants. En d'autres termes, ces mécanismes locaux peuvent s'avérer efficaces pour faire face à une dégradation temporaire du bien-être des ménages mais jouent un rôle restreint dans l'élimination de la pauvreté chronique. Enfin, si on n'observe pas de différences saillantes dans le pourcentage de bénéficiaires de l'allocation chauffage, le mécanisme d'allocation sous-jacent est particulièrement défavorable aux pauvres persistants.

Finalement, alors que d'un point de vue institutionnel l'allocation des différents transferts ne tient pas compte de la durée de la pauvreté, le système de protection sociale semble, dans une certaine mesure, intervenir dans la réduction des deux formes de pauvreté, notamment à travers les pensions. Néanmoins, l'existence d'imperfections dans le ciblage et le mécanisme d'allocation des autres transferts traduit l'incapacité du système à éliminer la pauvreté persistante.

2. Mouvements de pauvreté et transferts publics : protection versus promotion

Drèze, Sen (1989) sont les premiers à intégrer, dans le cadre d'un système de sécurité sociale, la distinction entre l'objectif de *protection* et l'objectif de *promotion*. De manière générale, une politique de protection vise à prévenir un déclin des conditions de vie comme cela peut se produire durant une phase de récession économique. Appliqué à la pauvreté, l'objectif de protection consiste donc à protéger les ménages non pauvres contre un risque d'entrée dans la pauvreté. Par ailleurs, on entend par promotion l'accroissement général du niveau de vie ; ce deuxième objectif doit donc être vu comme un objectif de long terme incluant en particulier l'élimination de la pauvreté persistante. Appliqué à la pauvreté, il consiste à tirer les ménages pauvres hors de la pauvreté. Tout en étant clairement distincts, ces deux objectifs ne sont pas pour autant indépendants. Par exemple, si on assiste à une amélioration globale du niveau de vie (promotion), l'objectif de protection devient moins crucial puisque moins de personnes sont susceptibles de faire face à une érosion de leur bien-être. De la même manière, si le système de sécurité sociale remplit son rôle de protection, les ménages peuvent consacrer l'intégralité de leurs dotations en actifs à l'objectif de promotion. L'appréhension de ce double objectif de la politique sociale exige là aussi de recourir aux données de panel de manière à appliquer la méthodologie de Ravallion *et al.* (1995) visant à mesurer l'ampleur du degré de protection et du degré de promotion.

A. Taux de protection et de promotion : concepts et méthodes

L'idée générale sous-jacente à l'analyse de Ravallion *et al.* (1995) est de comparer deux distributions « jointes », l'une incluant les transferts et l'autre non. Soient x_t un indicateur du bien-être à la période t ($t = 1,2$) dont la valeur est comprise dans l'intervalle $[0,x_{max}]$ et F et G deux distributions. On suppose que $F(x_1,x_2)$ représente le pourcentage de ménages ayant un niveau de bien-être inférieur à

x_1 en période 1 et inférieur à x_2 en période 2. Les distributions marginales associées sont notées $F_1(x_1)$ et $F_2(x_2)$[30]. Il est possible de définir les mêmes grandeurs, associées à la distribution *G*.

Si l'on note *z* la ligne de pauvreté, $F(z,z)$ représente le pourcentage de ménages pauvres aux deux périodes, dans la distribution *F*. De même, $F_1(z)$ et $F_2(z)$ sont respectivement le pourcentage de ménages pauvres à la période 1 et le pourcentage de ménages pauvres à la période 2, dans la distribution *F*. On peut alors définir $F_2(z) - F(z,z)$ comme la proportion de ménages pauvres en période 2 et non pauvres en période 1 dans la distribution *F*, c'est-à-dire la part des ménages entrés dans la pauvreté. Symétriquement, $F_1(z) - F(z,z)$ représente le pourcentage de ménages pauvres à la période 1 et non pauvres à la période 2, c'est-à-dire la proportion de ménages sortis de la pauvreté.

Supposons que *F* soit la fonction de distribution associée au bien-être post-transferts et *G* la fonction de distribution relative au bien-être pré-transferts. On dit que *F* protège mieux que *G* si $F_2(z) - F(z,z) < G_2(z) - G(z,z)$, en d'autres termes si la proportion de ménages entrés dans la pauvreté dans la distribution *F* est inférieure à la proportion de ménages entrés dans la pauvreté dans la distribution *G*. Le degré de protection de *F* par rapport à *G*, noté *PROT(z)*, est alors mesuré par[31] :

$$PROT(z) = G_2(z) - G(z,z) - F_2(z) + F(z,z) \quad (5)$$

De manière symétrique, on considère que *F* aide mieux à sortir de la pauvreté que *G* (meilleure promotion) si $F_1(z) - F(z,z) > G_1(z) - G(z,z)$, c'est-à-dire si la proportion de ménages sortis de la pauvreté dans la distribution *F* est supérieure à la proportion de ménages sortis de la pauvreté dans la distribution *G*. Le degré de promotion de *F* par rapport à *G*, noté *PROM(z)*, est alors mesuré par[32] :

$$PROM(z) = F_1(z) - F(z,z) - G_1(z) + G(z,z) \quad (6)$$

Si l'approche de Ravallion *et al.* (1995) permet d'apprécier la contribution du système de transferts aux objectifs de promotion et de protection, il est possible d'appliquer la même méthodologie en vue d'appréhender l'impact de la *variation* des transferts entre deux dates, sur ces deux objectifs. Dans ce cas, la distribution *G* classe la population sur la base du bien-être post-transferts à la période 1 et sur la base du bien-être sans la variation des transferts entre les deux dates, à la période 2. La distribution *F* range quant à elle la population sur la base du bien-être post-transferts aux deux périodes.

B. Evidence empirique : un déficit de promotion

Le tableau 8 présente les valeurs des taux de promotion et de protection pour l'ensemble du système de transferts et pour chaque bénéfice, en fonction des différentes périodes[33].

En premier lieu, pour l'ensemble du système de transferts, le taux de promotion présente des valeurs négatives, quelle que soit la période considérée. En d'autres termes, la part des ménages sortis de la pauvreté sur la base de la dépense pré-transferts est supérieure à la part des ménages sortis de la pauvreté sur la base de la dépense post-transferts. Non seulement le système de transferts n'aide pas à

[30] Avec $F_1(x_1) = F(x_1, x^{max})$ et $F_2(x_2) = F(x_2, x^{max})$.

[31] L'expression de l'erreur type associée à *PROT(z)*, notée *SET(z)*, est : $SET(z) = [T(z)[1-T(z)](2/n)]^{1/2}$, avec $T(z) = [G_2(z) - G(z,z) + F_2(z) - F(z,z)] / 2$. Le ratio *PROT(z) / SET(z)* est asymptotiquement normalement distribué et permet de tester la significativité de l'indice de protection.

[32] L'expression de l'erreur type associée à *PROM(z)*, notée *SEM(z)*, est : $SEM(z) = [M(z)[1-M(z)](2/n)]^{1/2}$, avec $M(z) = [F_1(z) - F(z,z) + G_1(z) - G(z,z)] / 2$. Le ratio *PROM(z) / SEM(z)* est asymptotiquement normalement distribué et permet de tester la significativité de l'indice de promotion.

[33] Il convient de préciser que pour le calcul des taux *PROM* et *PROT* relatifs aux transferts pris individuellement, la dépense pré-intervention correspond à la dépense courante diminuée de 0,44 fois le montant du transfert considéré. Autrement dit, on a supposé que la c_{Tr} déterminée pour l'ensemble des transferts s'appliquait à chaque transfert.

Tableau 9 : Taux de promotion et de protection pour le système de transferts et les différents bénéfices[1]. Russie 1994-2000.

	1994-1996		1996-1998		1998-2000		1994-2000	
	Prom (%)	Prot (%)	Prom (%)	Prot (%)	Prom (%)	Prot (%)	Prom (%)	Prot (%)
Pensions	-2,4	1,4	-0,2	2,3	-0,2	1,3	-1,3	3,3
	*(-3,38***)*	*(1,16)*	*(-0,21)*	*(2,02**)*	*(-0,18)*	*(1,29)*	*(-1,71*)*	*(2,66***)*
Prestations familiales	-0,2	0,1	-0,1	0,1	-0,2	0,1	-0,3	-0,1
	(-0,25)	*(0,08)*	*(-0,11)*	*(0,09)*	*(-0,18)*	*(0,10)*	*(-0,41)*	*(-0,08)*
Indemnités chômage	0,0	0,0	0,0	0,0	-0,1	0,0	0,0	0,0
	(0,00)	*(0,00)*	*(0,00)*	*(0,00)*	*(0,09)*	*(0,00)*	*(0,00)*	*(0,00)*
Assistance sociale	0,0	0,1	0,1	0,3	0,1	0,2	0,0	0,2
	(0,00)	*(0,08)*	*(0,11)*	*(0,27)*	*(0,09)*	*(0,20)*	*(0,00)*	*(0,17)*
Transferts autres que pensions	-2,0	2,2	-1,5	2,5	-2,1	1,7	-1,8	2,4
	(-2,41**)	(1,80*)	(-1,53)	(2,19**)	(-1,86*)	(1,67)	(-2,34**)	(1,95*)
Ensemble des transferts	**-2,5**	**1,5**	**-0,1**	**2,7**	**-0,8**	**1,3**	**-1,5**	**3,4**
	*(-2,94***)*	*(1,24)*	*(-0,11)*	*(2,17**)*	*(-0,72)*	*(1,19)*	*(-1,95*)*	*(2,74***)*

Notes : (1) Taux de protection et de promotion calculés selon les équations (5) et (6). Dépense pré-transferts estimée avec une c_{Tr} de 0,44. Les erreurs types sont indiquées entre parenthèses.
* significatif à 10 % ; ** significatif à 5 % ; *** significatif à 1 %.
Source : à partir du panel équilibré (2088 ménages). RLMS.

sortir de la pauvreté, mais il contribue même à réduire les chances de sortie de la pauvreté. On parlera dans ce cas d'effet d'*anti-promotion*. Si cet effet n'est pas significatif pour les périodes 1996-1998 et 1998-2000, il l'est sur le long terme (1994-2000) pour un seuil de 10 %, et surtout pour 1994-1996. Pour cette sous période, la proportion de ménages sortis de la pauvreté en termes de dépense pré-transferts excède de 2,5 points la part des ménages sortis de la pauvreté en termes de dépense post-transferts, résultat qui doit être relié à la crise du système de protection sociale de 1996. La généralisation des arriérés dans le versement des différents bénéfices a entraîné une diminution de la dépense post-transferts entre 1994 et 1996 et explique que la part des ménages sortis de la pauvreté après l'intervention publique soit limitée. Un tel phénomène est pour l'essentiel imputable au système d'assurance vieillesse, le taux de promotion pour les pensions atteignant -2,4 % entre 1994 et 1996. Les autres transferts pris individuellement n'exercent aucun effet de promotion significatif. Par contre, lorsqu'ils sont agrégés, ils exercent un effet d'anti-promotion qui est statistiquement significatif pour 1994-1996, mais également pour 1998-2000 et 1994-2000.

En second lieu, concernant l'objectif de protection, les résultats présentés dans le tableau 4-14 indiquent que le système de transferts publics russe exerce un effet de prévention assez net. Les taux de protection présentent en effet des valeurs positives à toutes les périodes, signifiant par là même que la proportion de ménages entrés dans la pauvreté sur la base de la dépense pré-transferts est supérieure à la part des ménages entrés dans la pauvreté en termes de dépense post-transferts, quelle que soit la période considérée. Sur le long terme (1994-2000), le taux de protection atteint 3,4 % et est significatif à 1 % ; autrement dit, l'existence d'un système de transferts a permis de réduire de 3,4 points la part des ménages entrés dans la pauvreté entre 1994 et 2000. En termes de sous périodes, le taux de protection n'est significatif que pour 1996-1998, période marquée par la crise financière de 1998. De toute évidence, le système de transferts a permis à certains ménages de se prémunir face à un risque d'entrée dans la pauvreté, conséquence de l'érosion du niveau de vie imputable à la crise. Le fait de raisonner en termes dynamiques permet, dans une certaine mesure, de nuancer l'une des conclusions du *Poverty Assessment Report 2004* de la Banque Mondiale. En effet, le rapport met en avant le caractère pro-cyclique du système de protection sociale russe, c'est-à-dire son incapacité, en période de

crise, à venir en aide aux individus, alors que c'est là qu'ils sont les plus vulnérables [World Bank (2004)]. Si l'on s'intéresse au détail des transferts, il apparaît que le profil des taux de protection pour l'ensemble des transferts suit le profil des taux de protection associés aux pensions, résultat logique du fait de la part disproportionnée occupée par celles-ci dans le système de transferts. Comme pour les taux de promotion, les bénéfices autres que les pensions, pris individuellement, n'agissent que de manière négligeable. Par contre, lorsqu'ils sont agrégés, leur impact devient significatif (sauf pour 1998-2000). A titre d'illustration, le taux de protection associé aux autres transferts entre 1994 et 1996 atteint 2,2 % et est significatif pour un seuil de 10 %.

En définitive, la prise en compte des formes et des mouvements de pauvreté a permis d'apporter un éclairage supplémentaire sur le rôle des transferts publics. Le système de protection sociale russe permet, dans une certaine mesure, de prévenir les entrées dans la pauvreté et joue donc son rôle de « filet de protection ». En revanche, l'effet d'anti-promotion mis à jour par nos estimations traduit l'incapacité du système à venir en aide aux ménages déjà en situation de pauvreté.

7. Conclusion

L'ensemble de nos investigations a révélé l'impact réel mais limité du système de transferts en termes de réduction de la pauvreté. A titre d'illustration, en 2000, la part des pauvres dans le montant total des transferts atteint seulement 41,5 %. L'évaluation de l'efficacité d'un système de protection sociale repose sur plusieurs aspects. Il importe premièrement d'appréhender la qualité du ciblage, c'est-à-dire l'aptitude des transferts à venir en aide aux pauvres par rapport aux non pauvres, mais également à tenir compte des différentes formes de pauvreté (pauvreté chronique / transitoire). Nos différentes estimations indiquent que les pensions sont les transferts les mieux ciblés, notamment par rapport à l'assistance sociale, pourtant censée être attribuée sous condition de ressources. Deuxièmement, l'efficacité du système dépend du mécanisme d'allocation, autrement dit de la faculté des différents transferts à réduire l'écart de pauvreté. A ce titre, nous avons mis en exergue l'insuffisance des montants alloués au titre de l'assistance sociale et des prestations familiales. Enfin, dans une perspective dynamique, il semble important de prendre en compte la capacité du système de transferts à tirer les ménages pauvres hors de la pauvreté (objectif de promotion) et à prémunir les ménages non pauvres contre un risque d'entrée dans la pauvreté (objectif de protection). Alors que le système de transferts pris dans son ensemble semble plutôt répondre à l'objectif de protection, il exerce un effet d'anti-promotion important, traduisant son incapacité à réduire la pauvreté de long terme[34].

En fait, l'efficacité limitée du système de protection sociale russe tient à ce que celui-ci est pour grande part hérité du système soviétique, c'est-à-dire d'un système pensé en l'absence de pauvreté (officiellement tout au moins). Si des adaptations du système ont été instaurées dès le début de la phase de transition économique pour tenir compte des conséquences sociales des réformes, elles sont pour le moins insuffisantes. Mais les autorités fédérales semblent dorénavant conscientes des enjeux inhérents à la politique sociale. En 2001, une vaste réforme du système d'assurance vieillesse a été mise en œuvre, avec pour objectif, d'une part de rapprocher le système russe des normes européennes et d'autre part d'assurer sa stabilité financière. Depuis le 1er janvier 2002, le système est constitué de trois composantes : (i) une retraite de base qui reprend l'ancien mécanisme ; (ii) une retraite complémentaire dont le montant dépend des salaires perçus par les individus tout au long de leur vie active ; (iii) une retraite par capitalisation constituée des contributions individuelles accumulées sur des comptes personnels et gérées comme des fonds privés[35]. Malgré l'introduction d'une retraite par capitalisation, la réforme est prudente et le nouveau système laisse la part belle au principe de solidarité entre générations. Si la pérennité financière semble assurer, au moins à moyen terme, aucun

[34] Les institutions économiques internationales et les autorités russes ont eu tendance à se focaliser sur le volet protection. Or un système de protection sociale ne peut se limiter à un « filet de sécurité sociale » (*social safety net*) visant, par le biais de mécanismes compensatoires (allocations chômage, assistance sociale, etc.), à aider les ménages faisant face à une érosion temporaire de leur bien-être [Lefèvre (2003)].

[35] Pour plus de précisions sur la réforme des retraites en Russie, se référer à Gurvich (2002), Polonskaya (2004).

argument social n'a été intégré à la réforme ce qui nous laisse à penser que le nouveau système ne sera pas nécessairement plus efficace dans la réduction de la pauvreté [Walter (2003)].

L'amélioration des performances du système de protection sociale passe également par une réforme des bénéfices autres que les pensions qui, rappelons-le, représentent une part restreinte du système de protection sociale. Nos investigations ont montré que l'allocation familiale était très peu favorable aux pauvres. En 1999, une loi prévoit de supprimer le caractère universel de l'allocation familiale en introduisant une conditionnalité de revenu. Cette limitation relative au niveau de ressources, qui n'a été jamais appliquée en pratique, permettrait pourtant de mieux cibler les ménages vulnérables et donc d'augmenter les montants alloués aux ménages bénéficiaires [OCDE (2001)]. Par ailleurs, le système d'assurance chômage semble bien incapable de protéger les individus touchés par la perte d'un emploi, et ce, du fait de deux imperfections. D'une part, le nombre de bénéficiaires est insuffisant comme en témoigne le décalage entre le taux de chômage officiel et le taux réel. La réduction de cet écart passe probablement par l'amélioration des performances des agences pour l'emploi en termes de réinsertion professionnelle afin d'éviter des désincitations à l'enregistrement. D'autre part, les indemnités chômage ne couvrent qu'une période d'un an et semblent à cet égard inadaptées pour venir en aide aux chômeurs de longue durée[36]. Un allongement de la durée d'indemnisation et la création d'une allocation pour chômeurs en fin de droit permettraient vraisemblablement de réduire sensiblement la part des pauvres persistants. Enfin, une profonde réforme de l'assistance sociale apparaît inévitable pour atteindre un objectif de réduction de la pauvreté, dans la mesure où il s'agit des seuls mécanismes reposant sur des critères de ressources. Il importe à la fois de réduire les erreurs de ciblage et d'augmenter les montants alloués aux familles éligibles[37]. Ceci passe par une meilleure coordination au niveau fédéral, même si la gestion décentralisée de ces aides ne doit pas être remise en cause. L'instauration d'un cadre institutionnel structurant les différents bénéfices apparaît indispensable, non seulement pour améliorer la lisibilité de l'assistance sociale mais également pour éviter les inégalités de traitement d'une municipalité à l'autre.

La réforme du système de protection sociale revêt une importance cruciale et l'éradication de la pauvreté en Russie tient en grande partie à la volonté des autorités de mener à bien ces réformes. Il reste à trouver le juste équilibre entre stabilité financière et amélioration des performances sociales. En outre, la politique de transferts de la Russie doit être conçue de manière plus globale en intégrant un ensemble de mécanismes de long terme s'attaquant aux causes et non plus seulement aux symptômes de la pauvreté. Il s'agit probablement là de l'une des clés de l'éradication de la pauvreté en Russie.

Références bibliographiques

Aslund, A. 1995, *How Russia Became a Market Economy*, The Brookings Institution, Washington DC.

Bourguignon, F., Pereira da Silva, L. (eds.) 2003, *The Impact of Economic Policies on Poverty and Income Distribution*, World Bank and Oxford University Press, Washington D.C.

Clarke, S. 1999, *The Formation of a Labour Market in Russia*, Edward Elgar, Northhampton.

Clément, M. 2003, *Dynamiques et Persistance de la Pauvreté en Russie,* Document de Travail du CED, n° 89, Centre d'Economie du Développement, Université Montesquieu-Bordeaux IV.

Coady, D., Grosh, M., Hoddinott, J. 2004, *Targeting of Transfers in Developing Countries: Review of Lessons and Experience*, World Bank and International Food Policy Research, Washington D.C.

[36] La part des chômeurs de longue durée parmi les chômeurs enregistrés auprès d'une agence pour l'emploi atteint 19 % en 1998, cette part étant bien supérieure lorsque le chômage est appréhendé sur la base de la définition du BIT [Kapeliouchnikov (1999)].

[37] Plusieurs études ont mis en évidence les limites des mécanismes d'assistance sociale en Russie. Voir World Bank (1995, 1999) et Klugman (1997).

Cox, D., Jakubson, G. 1995, The Connection Between Public Transfers and Private Interfamily Transfers, *Journal of Public Economics*, vol. 57, pp. 129-167.

Crosnier, M.A. 2003, Russie, la Protection Sociale Entre Deux Systèmes, Courrier des Pays de l'Est, n° 383, pp. 27-32.

Drèze, J., Sen, A. 1989, *Hunger and Public Action*, Clarendon Press, Oxford.

Duclos, J.Y., Makdissi, P., Wodon, Q. 2003, *Poverty-efficient Transfer Programs : the Role of Targeting and Allocation Rules*, CIRPEE cahier de recherché, n° 0305, Montréal.

Foley, M.C. 2003, *Pension Arrears and Survival Mechanisms of the Elderly in Russia During Transition*, Economics Department, Davidson College.

Foster, J., Greer, J., Thorbecke, E. 1984, A Class of Decomposable Poverty Measures, *Econometrica,* vol. 52, pp. 761-766.

Gallagher, L.J., Struyk, R.J. 2001, *Strengthening Local Administration of Social Assistance in Russia*, The Urban Institute, Moscou.

Greene, W.H. 1997, *Econometric Analysis*, Prentice Hall, Third Edition, London.

Gurvich, E. 2002, *The Distributional Impact of Pension Reform in Russia*, New Economic School, Working Paper, n° 2202 / 031, Moscow.

Hulme, D., Moore, K., Shepherd, A. 2001, *Chronic Poverty: Meanings and Analytical Frameworks*, CPRC working paper n° 2, Chronic Poverty Research Centre, University of Manchester.

Hulme, D., Shepherd, A. 2003, Conceptualizing Chronic Poverty, *World Development*, vol. 31(3), pp. 403-423.

Jensen, R.T., Richter, K. 2002, *Social Security, Income Volatility and Health: Evidence from the Russian Pension Crisis*, Paper presented at the Development Economics Conference on Social Services Delivery, World Bank, 21-22 février.

Jovanovic, B. 2000, Russian Roller Coaster: Expenditure Inequality and Instability in Russia 1994-1998, *Review of Income and Wealth,* vol. 47, pp. 251-271.

Kakwani, N. 1990, *Testing for Significance of Poverty Differences With an Application to Côte d'Ivoire*, LSMS Working Paper n° 62, World Bank.

Kapeliouchnikov, R. 1999, *Russia's labour market: adjustment without restructuring*, Russian Academy of Sciences, Moscow.

Klugman, J. (ed.) 1997, *Poverty in Russia: Public Policy and Private Responses*, EDI Development Studies, World Bank, Washington D.C.

Lefèvre, C. 1993, Le Rôle Social de l'Entreprise Industrielle en Russie, *Courrier des Pays de l'Est*, n° 383, pp. 33-39.

Lefèvre, C. 1995, Le Système de Protection Sociale Russe : Héritages et Transformations, *Revue d'Etudes Comparatives Est-Ouest*, vol. 4, pp. 25-54.

Lefèvre, C. 2001, La Municipalisation Complexe de la Sphère Sociale des Entreprises Russes: un Aspect Important et Méconnu de la Transition Economique et Sociale, *Revue d'Etudes Comparatives Est-Ouest*, vol. 32(4), pp. 125-151.

Lefèvre, C. 2003, Organismes Internationaux et Protection Sociale. Analyse de Trois Types de Discours des Années 90, *Courrier des Pays de l'Est*, n° 1040, pp. 16-25.

Lokshin, M., Popkin, B.M. 1999, The Emerging Underclass in the Russian Federation: Income Dynamics, 1992-1996, *Economic Development and Cultural Change,* vol. 47(4), pp. 803-830.

Matthews, M. 1986, *Poverty in the Soviet Union: the Life-styles of the Under-privileged in Recent Years*, Cambridge University Press, Cambridge.

McAuley, A. 1979, *Economic Welfare in the Soviet Union*, University of Wisconsin, Madison.

Milanovic, B. 1998, *Income, Inequality and Poverty During the Transition from Planned to Market Economy*, World Bank, Washington DC.

Mroz, T. A., Popkin, B. 1995, Poverty and the Economic Transition in the Russian Federation, *Economic Development and Cultural Change,* vol. 44, pp. 1-31.

OCDE 2001, *Fédération de Russie : la crise sociale*, OCDE, Collection Questions Sociales, Paris.

Okrasa, W., 1999, *The Dynamics of Poverty and the Effectiveness of Poland's Safety Net (1993-1996)*, Policy Research Working Paper, n° 2221, World Bank.

Polonskaya, J. 2004, *Pension reform in Russia*, Plekhanov Russian Academy of Economics, Moscow.

Ravallion, M., Van de Walle, D., Gautam, M. 1995, Testing a Social Safety Net, *Journal of Public Economics*, vol. 57(2), pp. 175-199.

Sachs, J. D. 1996, The Transition at Mid Decade, *American Economic Review*, Papers and Proceedings, vol. 86(2), pp. 128-133.

Sapir, J. 1999, *Chevauchant la Tempête. L'Economie Russe de la Crise Financière d'Août 1998 à la Fin de l'Eté 1999*, dans Tableau de Bord des Pays d'Europe Centrale et Orientale 1999*,* Les Etudes du CERI, n° 58.

Sevestre, P. 2002, *Econométrie des Données de Panel*, Dunod, Paris.

Struyk, R., Puzanov, A.S., Kolodeznikova, A. 1998, *An Assessment of Administrative Practices in Russia's Housing Allowance Program*, U.S. Agency for International Development.

Swafford, M. 1997, *Sample of the Russian Federation. Rounds V, VI and VII of the RLMS*, Technical Report, Paragon Research International.

Van de Walle, D. 2003, *Testing Vietnam's Public Safety Net*, Social Protection Discussion Paper, n° 0319, World Bank.

Walter, G. 2003, Les Réformes Economiques en Russie : un Tour d'Horizon, *Courrier des Pays de l'Est*, n° 1038, pp. 14-23.

World Bank 1995, *Poverty in Russia : an Assessment*, Report n° 14110-RU, Washington D.C.

World Bank 1999*, Russia. Targeting and the Longer-term Poor*, Report n° 19377-RU, Washington D.C.

World Bank 2004, *Russian Federation: Reducing Poverty through Growth and Social Policy Reform*, Report n° 28923-RU, Washington D.C.

Annexes

Tableau A-1 : Coefficients de régression des déterminants de la variation de la dépense des ménages[1]. Modèles à effets fixes en différence première. Russie 1994-2000.

	(1)		(2)		(3)		(4)	
	Echantillon total		1994-1996		1996-1998		1998-2000	
	LSDV		*MCO*		*MCO*		*MCO*	
	Coeff.	t	Coeff.	t	Coeff.	t	Coeff.	t
Constante			-1451,1727	-4,736***	-467,5064	-3,534***	367,3335	2,587***
Montant des transferts	0,4365	2,492**	0,4022	1,027	0,4261	2,242**	0,3729	1,415
Variables de contrôle								
Composition démographique								
Taille du ménage	367,6391	1,672*	779,6054	1,345	-78,9736	-0,317	388,7048	1,53
Nombre d'enfants de moins de 7 ans	-1097,262	-2,850***	-1713,4357	-1,741*	-525,2368	-1,226	-1088,8404	-2,320**
Nombre d'enfants de 7 à 15 ans	-926,5159	-2,982***	-1836,975	-2,192**	-496,0585	-1,411	-449,8645	-1,275
Nombre de retraités	-1008,968	-3,151***	-3142,2252	-3,720***	-236,0118	-0,651	175,434	0,469
Caractéristiques du chef de ménage								
Sexe	-1365,682	-3,120***	-3687,8238	-3,191***	-181,1272	-0,374	-500,6462	-0,97
Age	135,0134	1,880*	309,4891	1,609	-24,0997	-0,293	95,9943	1,17
Age au carré	-2,0758	-2,591***	-4,6764	-2,190**	-0,2097	-0,228	-1,2946	-1,411
Nombres d'années d'éducation	-105,5536	-1,239	-223,2441	-1,082	-69,817	-0,75	-23,1105	-0,207
Caractéristiques économiques								
Accès à la terre	1311,4	4,120***	1861,4508	2,381**	1305,9443	3,562***	652,0884	1,691*
Nombre d'actifs	61,0702	0,337	-240,7615	-0,535	298,7524	1,46	155,529	0,702
N	6264							
Test de Fisher	9,29 (0,000)***		4,23 (0,000)***		2,66 (0,002)***		1,85 (0,041)**	

Notes : (1) Dépense réelle mensuelle en équivalent adulte aux prix de 1994. (2) Variables en différence première. (3) Probabilité « two-tailed » que le coefficient soit égal à 0. Le t est le rapport entre le coefficient et l'erreur type. (4) Teste la significativité des coefficients pris simultanément.
* significatif à 10 % ; ** significatif à 5 % ; *** significatif à 1 %.
Source : à partir du panel cylindré (2088 ménages). RLMS.

Tableau A-1 (suite) : Coefficients de régression des déterminants de la variation de la dépense des ménages[1]. Modèles à effets fixes en différence première. Russie 1994-2000.

	(5) Echantillon total *DMC*		(6) Pauvres *LSDV*		(7) Non pauvres *LSDV*	
	Coeff.	t	Coeff.	t	Coeff.	t
Montant des transferts	0,7289	3,751***	0,6233	3,595***	0,4202	2,096**
Variables de contrôle						
Composition démographique						
Taille du ménage	372,1907	1,693*	-192,7831	-0,782	467,1484	1,882*
Nombre d'enfants de moins de 7 ans	-1099,5844	-2,855***	-341,7063	-0,846	-1254,4162	-2,853***
Nombre d'enfants de 7 à 15 ans	-927,2383	-2,983***	582,2612	1,654*	-1188,9709	-3,396***
Nombre de retraités	-1097,8247	-3,417***	-670,3083	-1,774*	-1031,8015	-2,876***
Caractéristiques du chef de ménage						
Sexe	-1376,691	-3,144***	268,5935	0,61	-1631,9823	-3,256***
Age	138,3019	1,925*	-23,1554	-0,323	164,3975	1,990**
Age au carré	-2,1442	-2,675***	-0,0294	-0,038	-2,4612	-2,657***
Nombres d'années d'éducation	-106,749	-1,253	-9,2021	-0,107	-138,3389	-1,419
Caractéristiques économiques						
Accès à la terre	1315,8771	4,133***	42,8025	0,125	1383,7205	3,842***
Nombre d'actifs	80,6314	0,445	409,4719	1,993**	-23,3436	-0,115
N	6264		816		5448	
Test de Fisher	9,07 (0,000)		6,17 (0,000)***		9,97 (0,000)***	
Test de Hausman	12,08 (0,357)					
Test de Chow			2,96 (0,001)***			

Notes : (1) Dépense réelle mensuelle en équivalent adulte aux prix de 1994. (2) Variables en différence première. (3) Probabilité « two-tailed » que le coefficient soit égal à 0. Le t est le rapport entre le coefficient et l'erreur type. (4) Teste la significativité des coefficients pris simultanément. (5) Test d'endogénéité basé sur la comparaison des estimateurs LSDV et DMC. (6) Test de permanence structurelle entre l'échantillon des pauvres et l'échantillon des non pauvres.
* significatif à 10 % ; ** significatif à 5 % ; *** significatif à 1
Source : à partir du panel cylindré (2088 ménages). RLMS.

Tableau A-2 : Valeurs de la dépense courante et de la dépense pré-transferts estimées pour les échantillons initiaux et le panel. Russie 1994-2000.

	1994		1996		1998		2000	
	Round V	Panel	Round VII	Panel	Round VIII	Panel	Round IX	Panel
Dépense courante	6431	6092	4812	4390	4462	3881	4819	4223
Dépense pré-transferts	6090	5743	4568	4143	4197	3596	4531	3901

Notes : (1) Dépenses mensuelles exprimées en équivalent adulte aux prix de 1994.
Source : à partir des données RLMS.