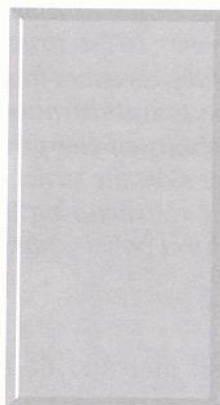


Ludwig A. Plata (Uniso)

O desemprego estrutural no Brasil na década de 90¹

¹ Este artigo foi apresentado no Encontro de Pesquisadores e de Iniciação Científica IV, UNISO, Sorocaba, (SP), outubro de 2001.



RESUMO

Este artigo estuda a taxa estrutural de desemprego, entendida como a tendência determinística da Taxa de Desemprego Total ajustada sazonalmente – TDTS, para mostrar as várias mudanças estruturais que esta taxa sofreu no período compreendido entre janeiro 1985 e dezembro de 1999. Estas mudanças no patamar (tanto do nível quanto da taxa de crescimento da tendência), na taxa estrutural de desemprego estariam associadas, de um lado, a questões conjunturais decorrentes da administração dos planos macroeconômicos de estabilização (administração da taxa de juros e de câmbio) para manter a estabilidade dos preços e a atratividade do mercado financeiro. De outro lado, a políticas estruturais, como abertura comercial, o que obrigou o setor industrial a se reestruturar a fim de ganhar competitividade. Este conjunto de políticas conjunturais e estruturais tem criado sinergias para manter uma taxa de desemprego crescendo persistentemente.

ABSTRACT

This paper analyzes the structural rate of unemployment, understood as the deterministic trend of the Total Rate of Unemployment seasonally adjusted – TDTS, in order to show several structural changes that this rate had between January 1985 and December of 1999. These level changes (as of the level and as of the trend growth rate), in the structural rate of unemployment would be associated, on a side, to subjects issues from the administration of the macroeconomic plans of stabilization (administration of the interest and exchange rate) in order to maintain the stability of the prices and the attractiveness of the financial market. On the other side, the structural politics, as commercial opening, forced the industrial sector restructuring in order to get competitiveness. This set of situation and structural policies has had created synergies to keep an increasing unemployment rate.

Palavras-chaves: mercado de trabalho, desemprego, taxa estrutural de desemprego.

Introdução

“O desemprego do homem deve ser tratado como tragédia humana, e não como estatística econômica”.

Papa João Paulo II

A pesar de todos os avanços tecnológicos que aconteceram no século XX e que melhoraram o bem-estar das pessoas, o novo milênio começa com um grande problema que terão que enfrentar todos os países do mundo: o desemprego. O desemprego será a principal preocupação a ser equacionada pelos governos neste século, já que é um problema estrutural que parece ter vindo para ficar.

O problema do desemprego da década de noventa no Brasil está fortemente relacionado com as políticas de estabilização que se aplicaram com o propósito de equacionar a instabilidade econômica, bem como a implementação de programas de reestruturação produtiva que buscaram preparar a economia para fazer frente aos desafios que colocaram o novo padrão mundial de produção e comércio.

Na década de noventa, por um lado, o Brasil implementou uma série de planos que tinham por objetivo equacionar a instabilidade macroeconômica, manifesta nas altas taxas de inflação e, de outro lado, realizou um conjunto de reformas cujo propósito foi o de melhorar a capacidade de concorrência das empresas nos mercados internacionais, preservando a estabilidade macroeconômica interna. Este conjunto de medidas, aliadas às mudanças experimentadas pela economia mundial, configurou na economia brasileira, um novo cenário caracterizado pelo processo de globalização em andamento, a privatização de empresas estatais, abertura comercial e financeira, assim como, pelas expectativas da população, que esperava que os benefícios dessas mudanças permitissem atingir uma economia mais sólida e estável e um Estado mais eficiente que disseminasse esses benefícios para a sociedade em seu conjunto.

A globalização trouxe consigo uma maior integração dos países na economia mundial, abriu novas oportunidades para a geração de emprego, que, por sua vez, afetaram os fatores determinantes do emprego e dos salários. A necessidade de aumentar a competitividade implica ajustes nos

salários que dependem do crescimento da produtividade do trabalho¹. Além disso, as mudanças na demanda agregada requerem uma maior capacidade de adaptação das organizações aos processos de produção e trabalho.

As reformas comerciais e financeiras implicaram a eliminação das barreiras ao comércio internacional. Tem-se eliminado em grande parte as restrições às importações e se tem reduzido o nível e dispersão das tarifas. Tudo isso tem vindo acompanhado por um processo de abertura dos mercados financeiros, gerando uma forte entrada de capitais externos.

Entretanto, o rápido processo de globalização dos mercados de capitais, na ausência de mecanismos de regulação financeira, incrementou excessivamente a dependência da economia no que diz respeito à dívida externa de curto prazo e dos empréstimos de alto risco. A volatilidade deste tipo de capitais foi o detonador da crise asiática que logo se estendeu à Rússia e ao Brasil. A crise financeira internacional forçou os países a adotarem políticas de ajuste recessivo que afetaram significativamente o nível de emprego.

O processo de privatização, isto é, a mudança de propriedade das empresas estatais, tem reduzido a participação do Estado tanto no nível de investimento quanto no nível do emprego. Neste processo, o Estado sofreu a reestruturação de seu marco institucional e, portanto, a reorientação de suas funções. Simultaneamente, aumentaram as responsabilidades do setor privado e a importância dos mercados na atribuição dos recursos.

Em relação ao emprego, a redução e reestruturação do setor público têm transferido a responsabilidade de criar novos postos de trabalho ao setor privado. Este último não apenas requer investimentos em bens de capital, mas também em capacitação, fator chave para melhorar a produtividade e a capacidade competitiva dos trabalhadores. De outra forma, embora o Estado tenha deixado de ser um empregador de última instância, ainda tem a responsabilidade de gerar as condições favoráveis para que os empregadores possam criar postos de trabalho e executar programas que

¹ Segundo A. Kandir ex-Ministro de Planejamento, "A introdução de novas tecnologias mudou radicalmente a relação de oferta de emprego e crescimento econômico. Isso significa que o problema do desemprego entrou para ficar na agenda dos problemas brasileiros neste final de século, mesmo na hipótese de que venhamos a crescer à taxa de 5% ou 6% ao ano". Na globalização, em que cada país, cada empresa, cada pessoa, concorre com todos os demais dos quatro cantos do planeta, a sociedade está sendo submetida a duras provas, a um feroz ambiente de competição. Nesse ambiente, é o emprego e não mais o consumismo que ronda as sociedades estáveis e estruturadas em classes (*Veja*, 26 de agosto de 1998).

resolvam problemas em áreas específicas, tais como: a capacitação dos jovens e a reconversão laboral.

A liberalização dos mercados gera uma homogeneidade nas políticas econômicas. O mercado adquire maior importância na atribuição de recursos e na redefinição da função, tamanho e, especialmente, na forma de intervenção do Estado. No Brasil, a abertura dos mercados coincidiu com a necessidade de ajustar a economia seriamente desequilibrada. Isso levou à adoção de políticas de ajuste orientadas, primeiro, à estabilização macroeconômica e, depois, a uma mudança estrutural. Entre outras coisas, isto tem levado a um acelerado ritmo de privatizações, à redução do emprego público e a numerosas reformas legais, principalmente relacionadas com o mercado de trabalho a fim de conseguir a sua flexibilização.

As reformas trabalhistas têm produzido mudanças substanciais na legislação em dupla direção. Por um lado, modificaram-se as condições dos contratos, a duração e distribuição das horas de trabalho tornaram-se mais flexíveis, as causas de demissões ampliaram-se ao incluir razões econômicas, e o tempo de serviço para aposentadoria tem aumentado. Estas reformas tendem a facilitar a adaptação das empresas às novas condições econômicas. Por outro lado, introduziram-se reformas constitucionais e legais trabalhistas para reafirmar os princípios de liberdade sindical, assim como para assegurar as garantias dos trabalhadores para negociarem livremente. A intenção dessas reformas tem sido a de garantir o exercício das liberdades individuais e coletivas em um marco democrático.

Este processo de democratização do país foi a base fundamental para revitalizar as liberdades públicas, fortalecendo as organizações sociais e promovendo o diálogo e a negociação entre os atores sociais como meio para processar em nível institucional as divergências de interesses e conflitos. Esta revitalização do diálogo social se manifesta, em nível nacional, por meio de acordos macros e pactos sociais. Em nível micro, acontece mediante negociações coletivas nas próprias empresas ou em determinados ramos da atividade econômica. Ao contribuir à estabilidade, o diálogo social exerce uma influência positiva sobre o crescimento econômico e, particularmente, sobre os incentivos ao investimento estrangeiro, ao reduzir o “risco Brasil”.

Neste marco produz-se embargo, ou seja, uma situação paradoxal. A recuperada democracia política, assim como o reconhecimento da importância do diálogo entre os atores sociais e políticos, não foi acompanhada

de um adequado desenvolvimento das instituições representativas destes. Pelo contrário, hoje se assiste ao progressivo enfraquecimento dos sindicatos, dos grêmios empresariais e, também, dos partidos políticos.

Portanto, hoje o Brasil está experimentando a difícil coabitação de uma economia mais sólida e um sistema de representação política e social enfraquecido e incapaz, em muitos casos, de expressar e canalizar adequadamente as demandas sociais. Esta situação constitui um freio às possibilidades de consolidação e desenvolvimento da própria democracia política e da coesão social.

1. Evolução recente da taxa de desemprego

Neste fim de século, o desemprego é um dos grandes problemas sociais com que se defrontam os países desenvolvidos e em desenvolvimento. Nas últimas duas décadas a maioria dos países que formam a OCDE¹ experimentou um forte e sustentado crescimento de sua taxa de desemprego. Na Tabela 1, pode-se verificar estes acontecimentos. Na França a taxa de desemprego passou de 2,3% no período 1965-75, para 10,3%, no período 1987-94. Outros países da Europa, como a Alemanha e Itália, mostram desempenhos semelhantes nas suas taxas de desemprego². O Estados Unidos da América é o único país que mantém taxas baixas de desemprego nas últimas décadas.

Tabela 1. Taxas de desemprego, alguns países da OCDE.

País	1965-73	1974-79	1980-86	1987-94	1997
EUA	4,5	6,8	8,0	6,2	5,4
Alemanha	0,9	3,5	6,7*	n.d	9,6
França	2,3	4,5	8,6	10,3	12,4
Itália	5,8	6,7	9,6	11,4	N/d
Japão	1,2	1,9	2,5	2,4	3,3

* Esta taxa corresponde ao período 1980/90.

Fonte: World Employment 1996/97: National policies in a global context. In: ILO Report. Genebra, 1996.

² A taxa de desemprego na OCDE atingiu 7,5%, em janeiro de 1997, sendo idêntica à de janeiro 1996. Esta taxa tem diminuído em alguns países. Na Bélgica passou de 9,5% para 9,4%, na Irlanda de 11,8% para 11,7% na Suécia de 10,6% para 10,3% e no Reino Unido de 7,5% para 7,3%. A taxa de desemprego permaneceu estável no Canadá com 9,7%, Japão 3,3%, Austrália 8,6%, França 12,4%, Luxemburgo 3,5%, Portugal 7,2% e Espanha 21,6%. Entretanto, aumentou nos Estados Unidos de 5,3% para 5,4%, na Áustria de 4,0% para 4,1% e na Alemanha de 9,3% para 9,6%. (Revista da OCDE, 1997).

Quanto à América Latina, mais especificamente aos países que formam o Mercosul³, observa-se, em termos gerais, que estas taxas apresentam um desempenho crescente e persistente na década de 90 e começam a atingir os níveis dos países europeus a partir de 1995 (Tabela 2).

Tabela 2. Mercosul, Taxas anuais de desemprego urbano.

País	1991	1992	1993	1994	1995	1996	1997 ^a
Argentina	6,5	7,0	9,6	11,5	17,5	17,2	14,9
Brasil ^b	13,0	16,2	15,4	15,2	13,2	16,2	16,0
Paraguai	5,1	5,3	5,1	4,4	5,3	8,2	9,1
Uruguai	8,9	9,0	8,3	9,2	10,3	11,9	11,9
América Latina ^c	5,8	6,2	6,2	6,3	7,2	7,7	7,8

^a) dados preliminares, ^b) dados referentes à taxa de desemprego total para São Paulo, calculados pelo DIEESE/SEADE. Esta taxa considera o desemprego aberto e oculto, ^c) não inclui os países do Caribe.

Fonte: CEPAL.

Os trabalhos teóricos e empíricos que buscam desvendar a questão do desemprego no mercado de trabalho têm procurado algumas explicações, entre elas:

- Na mudança do padrão tecnológico, produto da terceira revolução industrial, que tem como consequência o aumento da produtividade do trabalho que, por sua vez, produz mudanças na composição do emprego e gera aumento na demanda de trabalho qualificado (Rifkin, 1996);
- Nas políticas estruturais para promover eficiência e flexibilidade do aparelho produtivo, com o propósito de conseguir concorrer no mercado mundial, levando as empresas a substituir mão-de-obra por capital. Esse fato vem agudizando-se com o processo de mundialização da produção econômica e financeira, que localiza os centros de produção segundo os interesses das grandes empresas (Thurrow, 1993 e Chesnais, 1996);
- Na carga fiscal, nos elevados salários reais e nas regulações impostas pelas políticas de bem-estar social (*Welfare State*), implementadas na Europa e que em parte foram adotadas por outros países. Tais políticas tornariam os empresários relutantes em criar novos empregos

³ Mercado Comum do Sul – Mercosul foi criado oficialmente em 1991 com o Tratado de Asunción (Paraguai), congregando Brasil, Argentina, Uruguai e Paraguai.

enquanto que o nível relativamente generoso dos benefícios em caso de desemprego tornou os trabalhadores relutantes em aceitar os baixos salários que ajudam a manter o desemprego comparativamente mais baixo nos Estados Unidos da América (Krugman, 1997).

As mudanças estruturais na taxa de desemprego assumem uma característica bastante peculiar. Devido a fatores presentes na formação do mercado de trabalho, pode-se observar que a elevada taxa de desemprego tem sido acompanhada por um processo muito notório de precarização do mercado de trabalho. Tem-se criado, conforme afirma Mattoso: "... novas e, mais restritas relações de trabalho, mas também acentuando as características de exclusão econômica e social do sistema capitalista e recriando condições aparentemente superadas durante os anos dourados do pós-guerra" (Mattoso, 1995:70).

Quanto ao Brasil, para explicar a configuração do mercado de trabalho atual, ao menos dois conjuntos de hipóteses podem ser levantados neste sentido. Para alguns autores, o acelerado crescimento da taxa de desemprego, nesta década, está associado a dois aspectos de caráter microeconômico relacionados ao funcionamento do mercado de trabalho. De um lado, está a rigidez na determinação dos salários reais promovida pela ampliação dos benefícios sociais e do grau de sindicalização; de outro lado, a alteração no padrão tecnológico vigente, que produz alterações na estrutura ocupacional do emprego e aumento na demanda de mão-de-obra melhor qualificada.

Para outros autores, a ascensão do desemprego não se restringe aos aspectos microeconômicos. Ela está profundamente relacionada a aspectos macroeconômicos e a um conjunto de reformas estruturais necessárias para superar o esgotamento do antigo modelo de desenvolvimento interno e se adaptar às novas tendências delineadas pelo cenário internacional. Na economia brasileira, segundo Baltar e Matoso, além das razões apresentadas para os países da OCDE, o desemprego também é explicado por fatores macroeconômicos que estariam inibindo o crescimento e que muitas vezes atuam em conjunto, tais como: abertura comercial indiscriminada, ausência de políticas capazes de orientar a reestruturação industrial, desregulamentação dos mercados e da concorrência, sobrevalorização cambial, elevadas taxas de juros provocando mudanças na estrutura produtiva, o encolhimento na geração de empregos e o desvio de recursos monetários para a esfera financeira em detrimento da esfera produtiva (Baltar e Matoso, 1997). Ainda segundo estes autores, as empresas no Brasil tendem a trans-

ferir para empresas menores ou para empresários terceirizados parcelas menos rentáveis da produção e, por sua vez, estes contratam trabalhadores menos qualificados quase sempre driblando a legislação trabalhista do país, o que eleva ainda mais o nível de precarização do mercado.

Para Pastore, a rigidez do mercado de trabalho brasileiro seria o principal responsável pelo desempenho dos indicadores de emprego no país. A magnitude e a rigidez dos encargos sociais existentes seriam os responsáveis pela dificuldade de ampliação do número de empregos e pelo elevado grau de informalização do vínculo de trabalho. O peso excessivo dos encargos sociais e a impossibilidade de sua flexibilização levariam a utilização de trabalhadores informalmente contratados. Para o autor: "O Brasil tem sido considerado o campeão de impostos e de encargos sociais. Argumenta-se que o Brasil é um país de encargos altos e salários baixos, o que faz o trabalhador receber pouco e custar muito para a empresa" (Pastore, 1994).

Amadeo e Soares, que estudaram a produtividade do trabalho em vários ramos da indústria brasileira, constataram que existe uma mudança estrutural na produtividade horária do trabalho, que estaria acontecendo por volta de 1990 como resultado das políticas liberalizantes da economia (Amadeo e Soares, 1996). O aumento da produtividade⁴ estaria influenciando para baixo o nível de empregos, uma vez que se pode verificar para o período um aumento do produto, consequência da modernização organizacional e tecnológica. Nesta perspectiva, as perdas de emprego resultantes da modernização tecnológica ou organizacional seriam apenas transitórias e compensadas mais adiante com o crescimento econômico (Franco, G. 1996).

3. Modelagem econométrica da taxa estrutural de desemprego TED

Neste item, modela-se econometricamente a taxa de desemprego total, ajustada sazonalmente a fim de identificar a sua tendência de longo prazo. Formalmente, a série TDTS, que passamos a chamar de y_t , está formada por

⁴ Franco, que foi um dos principais expoentes da política de desenvolvimento, do primeiro governo de Fernando Henrique, identifica na abertura comercial o fator impulsionador do crescimento da produtividade, dos ganhos salariais e da estabilidade monetária indispensáveis para retomar o crescimento econômico. (Franco, G. 1996)

dois componentes, o primeiro componente é uma tendência estocástica, m_t , que captura o seu nível e a sua taxa de crescimento no tempo – essa tendência que representa a taxa estrutural de desemprego - TED; o segundo componente é uma perturbação aleatória, e_t , que pode ser descrita como um ruído branco, (Plata, L. e Silva E. 1999).

No estudo da evolução da taxa de desemprego será utilizado um modelo em que a tendência é constante. Este modelo é chamado de **tendência Determinística** representado pela equação (1)

$$y_t = \alpha_t + \beta_t + \mu_t \quad (\text{eq. 1})$$

onde, α e β são parâmetros reais desconhecidos e μ_t é um ruído não necessariamente branco.

4. Análise empírica

4.1. Análise da série de dados de desemprego

As metodologias mais conhecidas para calcular a taxa de desemprego no Brasil são as do Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística (IBGE), que utiliza sua Pesquisa Mensal de Emprego (PME), e a do Convênio Fundação Estadual de Análise de Dados (SEADE), com Departamento Intersindical de Estatística e Estudos Sócio-Econômicos (DIEESE), que utiliza sua Pesquisa Emprego e Desemprego (PED). A diferença entre eles é significativa. Por exemplo, no mês de outubro/98, para a Região Metropolitana de São Paulo, a PME encontrou desemprego de 7,4% da População Economicamente Ativa, enquanto a PED encontrou 18,1%. Entre outras, a causa fundamental desta diferença é que a PED é bem mais abrangente do que a PME; enquanto a PME mede apenas o desemprego aberto, a PED mede o desemprego aberto e o desemprego oculto. O desemprego aberto corresponde somente às pessoas que procuraram emprego nos últimos 30 dias. O desemprego oculto pode sê-lo por atividades precárias (desemprego “mascarado” por ocupações passageiras, “bicos”) ou por desalento (a pessoa desanimou de procurar), [NESE-NÚCLEO DE ESTUDOS SOCIO-ECONÔMICOS, dez/97, <http://www.stcecilia.br/nese/index.htm>].

Neste trabalho será utilizada a Taxa de Desemprego Total (TDT) para a Região Metropolitana de São Paulo que é estimada pelo convênio DIEESE/

SEADE, a partir da Pesquisa de Emprego e Desemprego – PED, e mostra a situação de ociosidade involuntária em que encontram as pessoas que compõem a força de trabalho desta região. A sua dimensão matemática é representada pelo quociente entre a população desempregada total (DT)⁵ e a População Economicamente Ativa (PEA). A TDT também é igual à soma da Taxa de Desemprego Aberto (TDA) mais a Taxa de Desemprego Oculto (TDO), sendo que esta última é formada pelo desemprego por trabalho precário mais o desemprego oculto por desalento.

No Gráfico 1, que apresenta a evolução TDT para Região Metropolitana de São Paulo, no período compreendido entre janeiro de 1985 e dezembro de 1999, observa-se que ela mostra movimentos ascendentes e descendentes, com um comportamento periódico de repetição anual, embora este movimento seja variável no tempo. Esta dinâmica da TDT permite identificar dois componentes estocásticos dentro da série: um que diz respeito à tendência e outro à sazonalidade.

Dada a existência de sazonalidade, os valores originais da série mensal TDT, em geral, não aceitam uma análise intra-anual, apenas admitem comparações entre meses iguais de anos diferentes, por exemplo, abril de 1996 com abril de 1997. Isto acontece porque os distintos setores da atividade econômica apresentam oscilações cíclicas dentro do ano (sazonalidade) que não necessariamente são atribuíveis à uma tendência de longo prazo no nível da atividade econômica, mas a causas naturais, climáticas e/ou institucionais regulares, tais como ciclos vegetais ou animais, períodos de férias, datas comemorativas, calendários fiscais, etc. Portanto, se faz necessário ajustar sazonalmente as séries, isto é, eliminar esses componentes cíclicos intra-anuais, a fim de permitir: a) a comparação entre meses consecutivos;

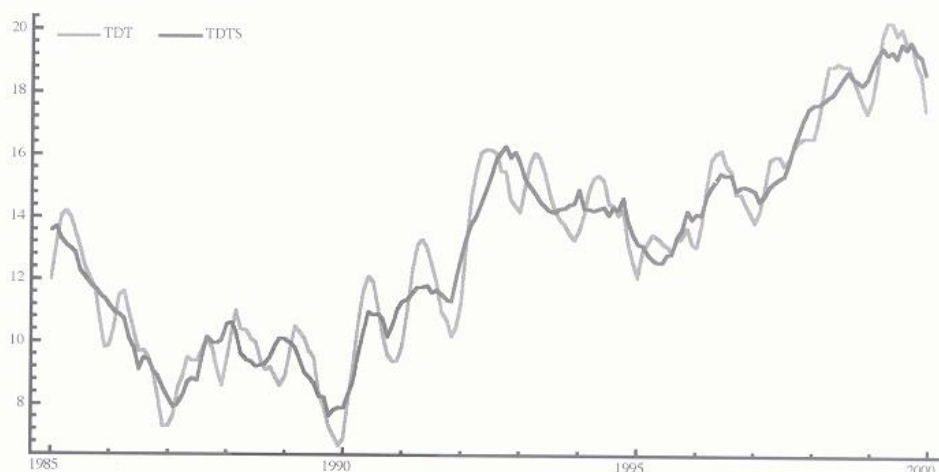
⁵ Desempregados: são os indivíduos que se encontram em uma das seguintes situações: a) Desemprego Aberto: pessoas que procuraram trabalho de maneira efetiva nos 30 dias anteriores ao da entrevista e não exerceram nenhum tipo de atividade nos 7 últimos dias; b) Desemprego Oculto pelo Trabalho Precário: pessoas que, para sobreviver, exerceram algum trabalho, de auto-ocupação, de forma descontínua e irregular, ainda que não remunerado em negócios de parentes e, além disso, tomaram providências concretas, nos 30 dias anteriores ao da entrevista ou até 12 meses atrás, para conseguir um trabalho diferente deste; c) Desemprego Oculto pelo Desalento e Outros: pessoas que não possuem trabalho nem procuraram nos últimos 30 dias, por desestímulo do mercado de trabalho ou por circunstâncias fortuitas, mas apresentaram procura efetiva de trabalho nos últimos 12 meses; e; d) Inativos: são os indivíduos maiores de dez anos que não estão ocupados ou estão desempregados.

b) estabelecer uma tendência de curto e de longo prazo, c) comparar a evolução de séries com diferente sazonalidade⁶.

O gráfico 1, também apresenta a Taxa de Desemprego Total com ajuste Sazonal – TDTS, ela mostra que os movimentos ascendentes e descendentes com comportamento periódico de repetição anual têm desaparecido, embora ainda estão presentes na série de desemprego TDTS, o componente tendência e irregular

A figura 2, mostra a contribuição da componente sazonal à TDT. Essa contribuição mostrou-se variável no período analisado e aparece crescente, no período 1985-91. Alcançando sua maior influência, nos primeiros três

Gráfico 1. Região Metropolitana de São Paulo. Taxa de Desemprego Total - TDT e taxa de desemprego com ajuste sazonal -TDTS (jan/1985 dez/ 1999)

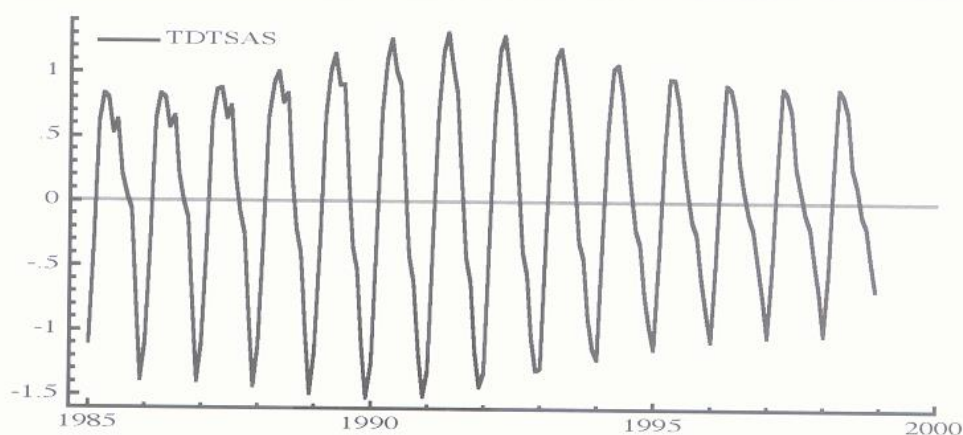


Fonte: Pesquisa de Emprego e Desemprego na Região metropolitana de São Paulo, Banco de Dados do DIEESE.

⁶ O método, conhecido como X-11/ARIMA/88 foi utilizado para ajustar sazonalmente as séries de desemprego. O software Econométrico Eviews 3.1 permite fazer diretamente a dessazonalização das séries. É importante assinalar que os métodos de ajuste sazonal apenas eliminam das séries de tempo os fatores distorsivos regulares, isto é, os que se apresentam de maneira cíclica e de período menor de um ano. Porém, existem fatores institucionais, climáticos ou naturais não regulares que não são eliminados por esses métodos: enchentes, saídas súbitas de capitais, entre outras. A presença deste componente irregular, nas séries sazonalmente ajustadas, deve ser levada em conta no momento de interpretar os movimento de curto prazo.

anos da década de 90. No período de 1992-1999, a influência do padrão sazonal sobre TDT tem sido decrescente, colocando, claramente, em evidência, que os efeitos sazonais sobre a taxa de desemprego, na época do Plano Real, são cada vez menores⁷. Neste último período, a contribuição sazonal mensal à TDT estaria, em média, no intervalo $[-1, 1]$ pontos percentuais.

Gráfico 2. Contribuição da componente sazonal à Taxa de Desemprego Total – TDT, no período jan/85 – dez/99



Fonte: Pesquisa de Emprego e Desemprego na Região metropolitana de São Paulo, Banco de Dados do DIEESE.

4.2. Estimativa da taxa estrutural de desemprego (TED).

A taxa estrutural de desemprego é estimada a partir do modelo determinístico (eq. 1). Este modelo, que pressupõe uma tendência constante, é estimado a partir de duas alternativas: a) à média de um período prolongado da TDTS; b) a partir de uma tendência linear. Já o Modelo estocástico pressupõe que a tendência é variável no tempo.

⁷ M. Portugal; L. Garcia (1996), verificaram também o amortecimento do padrão sazonal sobre taxa de desemprego nos últimos anos, trabalhando com dados sobre desemprego estimados a partir da Pesquisa Mensal de Emprego pelo IBGE.

4.2.1. Estimativa da TND a partir de um modelo determinístico de médias

Este modelo consiste em determinar a média da taxa de desemprego observada na economia durante um período de tempo suficientemente prolongado. A idéia central deste método é que a média a longo prazo, nivela os desvios cíclicos do desemprego, acima e abaixo da taxa estrutural, Sachs & Larrain (1995:569).

O modelo de médias é uma versão reduzida da equação 1, é representado pela equação (2)

$$y_t = \alpha_t + \mu_t \quad (\text{eq 2})$$

onde, y_t é a TDTS, α é média identificada com TED e μ_t é um ruído não necessariamente branco.

Na tabela 3, apresenta-se a TDTS média para os quatro últimos governos (1985-1998) e coloca em evidência o crescimento significativo e persistente da situação de ociosidade involuntária nos últimos quinze anos na Região Metropolitana de São Paulo. A TDTS média que no, governo Sarney, estava ao redor de 10% com uma taxa de crescimento negativa (-0,73%), já no governo de Cardoso atinge o patamar de 15,5%. Embora mostre uma desaceleração, ela continua crescendo e mantendo um nível muito elevado.

Há de ressaltar que, de um governo para outro, a TDTS média não apenas atinge níveis maiores, mas também os incrementos que experimentam são cada vez maiores. Isto coloca em evidência um processo crescente e persistente da taxa de desemprego.

Tabela 3. Região Metropolitana de São Paulo, Taxa de Desemprego – TDTS*, para o período 1985:1 1998:12.

	Média	Taxa de Cresc. (%)	Mínimo	Máximo	Desvio Padrão
Sarney (1985:1-89:12)	10,0	-0,73	7,8	13,4	1,52
Collor (1990:1-92:12)	12,2	1,87	8,1	16,1	2,2
I. Franco (1993:1-94:12)	14,5	-0,59	13,5	15,5	0,42
Collor/I. Franco (1990:1-94:12)	13,1	0,88	8,2	16,1	2,1
FHC (1995:1-98:12)	15,5	0,61	12,4	18,8	1,92
(1985:1-1998:12)	12,7	0,23	7,8	18,8	2,9

* Todas as variáveis foram ajustadas sazonalmente, pelo método X-11/ARIMA/88.

Fonte: estimada pelo convênio DIEESE/SEADE, a partir da Pesquisa de Emprego e Desemprego – PED para a Região Metropolitana de São Paulo.

Outro problema que não está diretamente relacionado com a grandeza da TDTS média, mas com o padrão de evolução, pode ser analisado através da taxa de crescimento TDTS média, e com o desvio-padrão da mesma. A magnitude crescente TDTS média e o seu desvio-padrão colocam em evidência que esta se torna cada vez mais instável, levando à conclusão de que o problema de desemprego no Brasil não vem apenas piorando pela dimensão crescente e persistente de sua taxa média de desemprego, mas também pelos fatores de instabilidade que a induzem. Portanto, o problema do desemprego no longo prazo não pode ser associado somente a uma taxa crescente, mas também a uma alta taxa de desemprego que parece haver-se instaurado permanentemente.

Para desvendar o alto nível de desemprego observado, é necessário relacionar a taxa de desemprego observada com a taxa estrutural de desemprego. Se utilizarmos como medida da taxa estrutural de desemprego TDTS média, em dois períodos em que a economia paulista teve mais ou menos um desempenho semelhante – quais sejam: o período 1985:1-1992:12, o período compreendido entre o governo Sarney e Collor, e o período do Plano Real 1993:1-1998:8, (I. Franco e FHC) – a taxa estrutural de desemprego foram 10,0% e 15,5% respectivamente. Este fato confirma que a taxa estrutural de desemprego não é uma constante imutável, mas seu valor muda através do tempo.

4.2.2. Estimativa da taxa estrutural de desemprego a partir modelo determinístico de tendência linear

Neste caso a taxa estrutural de desemprego é representada por uma reta com nível e declividade. Utiliza-se a série de TDTS como variável dependente, estima-se pelo método de Mínimos Quadrados Ordinários – MQO, o modelo de tendência determinística, apresentado na equação 1. A implementação para a estimação da equação 1 é feita através da equação (3).

$$TDTS_t = a + bt + e_t \quad (\text{eq.3})$$

onde, a é uma constante, b é a declividade da tendência e e_t é ruído branco, $(a+bt)$, representando a tendência de longo prazo que é identificada com o TND. A estimativa deste modelo foi feita a partir da amostra: janeiro 1985:1-

1999:12 compreendendo os quatro últimos governos: Sarney, Collor, Itamar e FHC.

Os resultados obtidos para os parâmetros da equação 3 são apresentados na Tabela 4, da qual pode-se fazer os seguintes comentários:

- Estatisticamente todos os parâmetros dos modelos são significativos ao 5% de nível de significação, e o valor da estatística R^2 é aceitável.
- No período compreendido entre 1985–1999, a taxa de desemprego total estrutural tem crescido positivamente a uma média de 0,05% mensal.
- No período do governo Sarney a taxa de desemprego teve uma tendência decrescente de 0,06% por mês. A tendência decrescente do desemprego estrutural, do período 1985-1989, estaria associada com o crescimento da economia, produto do crescimento das exportações e da expansão do mercado interno catalisada pelo Plano Cruzado. Deve-se também ter presente, neste período, que a taxa de juros real, em média, era negativa. Isto acarretou um maior nível de investimento e, portanto, um maior crescimento do PIB. Nos últimos anos da década de 80, instaurou-se na economia brasileira um processo de alta inflação que teve como consequência a diminuição da taxa de crescimento do PIB, que por sua vez, acarretou o crescimento positivo da taxa de desemprego.
- No período do governo Collor a taxa de desemprego total cresceu a uma taxa de 0,2% mensal. Neste período, a política recessiva do plano Collor I e II, bem como o incremento da produtividade do trabalho, produto do processo de modernização das empresas junto com a política de juros reais positivos e a liberalização comercial, seriam os responsáveis pelo rápido crescimento da taxa de desemprego.
- No período do governo Itamar a taxa de desemprego voltou a decrescer a uma taxa de 0,04% mensal. A partir de 1993, o produto cresceu puxado pela produção industrial, mas o nível de emprego não. A política de dólar barato do Plano Real, a partir de 1994, permitiu o incremento tanto do investimento de reposição, quanto do líquido. Estes novos investimentos permitiram a reestruturação do setor produtivo industrial através da propagação de uma série de inovações, tais como: de produto, de processos; enfim organizações que poupam em grande escala o uso de mão-de-obra. E colocam em evidência no setor industrial brasileiro os efeitos do desemprego tecnológico.

- No período do governo de FHC, a taxa de desemprego voltou a crescer a uma taxa de 0,12% mensal. A partir de 1995, a sustentação do Plano Real demandou uma política de sobrevalorização da moeda nacional, de abertura comercial e juros elevados para manter um nível

Tabela 4. São Paulo. Estimativa da tendência determinada da Taxa estrutural de desemprego.

	A (t)*		b (t)*	R ²
Sarney (1985:1–1989:12)	11,954	42,492	-0,064 -8,004	0,52
Collor (1990:1–1992:12)	-3,830 -3,980		0,2039 16,775	0,89
Itamar (1993:1–1994:12)	19,227	17,864	-0,044 -4,437	0,47
FHC (1995:1–1999:12)	-2,990 -4,830		0,1279 31,299	0,94
Período Total (1985:1–1999:12)	8,379 31,52		0,0523 20,550	0,703

* Valor do estatístico T-Students.

Fonte: Regressões calculadas por Mínimos Quadrados Ordinários em base aos dados de Desemprego do Convênio DIEESE/SEADE (1985:1–1999:12).

adequado de reservas internacionais. Tudo isto tem ocasionado um desempenho fraco no crescimento do PIB e uma aceleração no crescimento da taxa de desemprego. Temos que ressaltar também que a crise mexicana de 1995, a crise asiática no fim de 1997 e a crise russa de 1998 implicaram na elevação drástica da taxa de juros real brasileira, embora, o recuo da mesma, em períodos posteriores, não tenha sido muito significativo para incrementar o nível de investimento. Isto permitiu, por sua vez, que o nível de desemprego estrutural continuasse muito alto.

5. Comentários finais e conclusões

A taxa estrutural de desemprego, entendida como a tendência determinística da série de Taxa de Desemprego Total ajustada sazonalmente – TDTS, apresenta várias mudanças estruturais no período compreendido entre janeiro 1985 e dezembro de 1998.

Estas mudanças no patamar (tanto do nível quanto da taxa de crescimento da tendência) na taxa estrutural de desemprego estariam associadas, de um lado, a questões conjunturais decorrentes da administração dos planos macroeconômicos de estabilização, como, por exemplo, a administração da taxa de juros e de câmbio para manter a estabilidade dos preços; por outro, às altas taxas de juros praticadas no Plano Real para manter atrativo o mercado financeiro, mantendo asfixiado o setor produtivo da economia a tal ponto de instaurar um processo recessivo com altos níveis de desemprego. Também a sobrevalorização da moeda nacional tornou mais barato os produtos estrangeiros, os quais, por sua vez, ao entrarem no país, destruíram grande quantidade de postos de trabalho. Estes dois efeitos têm puxado para cima a taxa estrutural de desemprego.

Por outro lado, questões estruturais como abertura comercial, obrigaram o setor industrial a se reestruturar a fim de ganhar competitividade. Este processo de reestruturação das empresas tem sido feito a partir da introdução de inovações de produto, processos e formas organizacionais intensivas em capital, que têm destruído grande quantidade de empregos e criado uma demanda de trabalhadores de alta qualificação.

Em síntese, a administração da taxa de juros e câmbio para manter a estabilidade econômica, a abertura comercial que catalisou um processo de reestruturação industrial intensivo em capital, estes fatores juntos criaram sinergias para manter o histerese da taxa estrutural de desemprego.

Para a economia paulista, a constatação é que a taxa estrutural de desemprego está sendo puxada pelos altos níveis de desemprego observado. Isso sugere duas questões: quais são os fatores que fizeram a taxa de desemprego permanentemente crescente? De que forma esse impacto inicial transmitiu seus efeitos para o resto da economia paulista, que de tal maneira a taxa estrutural de desemprego mostra uma mudança estrutural na sua performance?

Para dar resposta à primeira questão, é suficiente lembrar, que, no período 1985-1989, a política econômica brasileira caracterizava-se principalmente pela expansão fiscal. Neste cenário, a expansão do gasto fiscal que inicialmente, acelerava de forma fraca a produção e o nível de preços, acabava em uma espiral custos-preços e, em um processo que somente deixava como resultado final um nível de inflação cada vez mais alto. Nessa linha política, não é estranho que o processo de aquecimento, que sofreu a eco-

nomia paulista, tenha terminado em um processo hiper-inflacionário e recessivo nunca visto antes⁸.

É importante ainda assinalar dois fatos. O primeiro está relacionado com a flutuação da taxa de juros real, que no período passava de taxas negativas à positivas com muita facilidade⁹. E o segundo fato, relaciona-se com o processo de abertura comercial iniciado no governo Collor.

A política de gasto fiscal e os dois últimos fatos assinalados criaram sinergias para o aumento da taxa estrutural de desemprego no período seguinte. No período 90/92 o patamar da TDTS média ficou em torno de 12,2% ao mês, e sua taxa de crescimento sofreu uma fortíssima alta, passando de -0,73% para 1,87% ao mês, fazendo com que a TDTS chegasse a patamares até então nunca verificados.

Com relação à segunda questão, temos que analisar o que aconteceu com a política de ajuste macroeconômico do Plano Real.

Anteriormente ao Plano Real, ainda no governo Collor, a rápida abertura da economia colocou a concorrência externa à indústria nacional, obrigando esta a empreender aceleradamente seu processo de reestruturação. Neste processo, vários ramos industriais não conseguiram se reestruturar para competir com os produtos importados, ocasionando grandes perdas para o emprego. Os ramos industriais que conseguiram se reestruturar o fizeram com a introdução de modernas técnicas (de produto, processo e formas organizacionais), que pouparam em grande escala o uso de mão-de-obra e elevaram rapidamente a produtividade do trabalho, colocando em evidência, no setor industrial brasileiro, os efeitos do desemprego tecnológico (Mattoso & Baltar, 1996).

⁸ Ao final do governo Sarney, em 1989 e, ao final do governo Collor 1992, as taxas anuais de crescimento do PIB foram negativas, -0,1% e -0,8%, respectivamente. As taxas anuais de inflação para os mesmos anos foram de 1.783% e 1.158%, respectivamente. Segundo Modiano, "Apesar da ênfase da política econômica no combate a inflação, a taxa anual quadruplicou entre início de 1985 e o final do ano de 1988. Após a queda proporcionada pelo último programa de estabilização (Plano Verão), já se projetava agora no segundo semestre de 1989 o retorno a uma taxa de inflação de 20% ao mês, ou cerca de 1000% ao ano." (Modiano, 1990:382).

⁹ No governo Sarney flutuava de taxas de juros reais negativas a positivas com muita facilidade. No governo Collor, a política de juros reais positivos, com o propósito de encantar o capital internacional, acabou por encarecer o crédito para as pequenas e médias empresas ocasionando com isto grandes perdas de vagas no setor. Verificou-se, ao longo de 1991, um forte movimento de recursos externos em função da abertura da economia, iniciada no ao anterior, e do diferencial entre juros internos e externos. (ANDIMA, 1997).

Todavia, a nova recuperação que ocorreu no período seguinte – de 1992 a 1995, se dá sem repercussão no emprego regular não trazendo consigo os empregos perdidos na fase anterior. Até então, as oscilações nos postos de emprego se davam da maneira clássica, isto é, quando desaquece a economia cai o emprego, e quando retoma o crescimento, as taxas de emprego voltam a crescer.

A política de dólar barato do Plano Real, a partir de 1994, permitiu o incremento tanto do investimento de reposição, quanto do líquido. Estes novos investimentos catalisaram, ainda mais, o processo de reestruturação do setor produtivo industrial. O aumento da demanda ocasionada pela redução da inflação obrigou o governo a acelerar o processo de abertura para facilitar as importações e atender a demanda. Essas maiores importações foram facilitadas pela sobrevalorização cambial da moeda nacional. A sobrevalorização cambial encarece os preços dos fatores produtivos nacionais, principalmente os salários, ocasionando à substituição de trabalho pelos insumos importados barateados por essa política¹⁰.

A partir de 1995, a sustentação do Plano Real demandou uma política de sobrevalorização da moeda nacional, de abertura comercial e juros elevados para manter um nível adequado de reservas internacionais. Tudo isso tem ocasionado um desempenho fraco do crescimento do PIB e uma aceleração no crescimento da taxa de desemprego. A partir dos dados da tabela 3, podemos verificar que a média da taxa de desemprego para o período FHC, ficou em torno de 15,5%, sendo que a taxa mínima registrada para o período foi de 12,4% e a máxima de 19,2% com uma taxa de crescimento médio positivo de 0,61% ao mês.

É importante ressaltar que a crise mexicana de 1995, a crise asiática de fim de 1997 e a crise da moratória Russa de julho de 1998, implicaram a elevação drástica da taxa de juros real brasileira para evitar a fuga de capitais. Muito embora esta política de juros altos não tivesse sido suficiente para evitar a perda de reservas de dólares, o governo teve que implementar dois pacotes recessivos que visam à redução do déficit fiscal. Estas medidas

¹⁰ Em uma economia perfeitamente concorrencial, o ajuste via mercado apenas se aplica quando os preços macroeconômicos são estabelecidos corretamente pelo governo. Se estes preços macroeconômicos, isto é, a taxa de juros e a taxa de câmbio, estão sendo administradas erroneamente pelo governo, os agentes individuais, que procuram o máximo lucro, utilizaram no processo de produção os fatores produtivos mais baratos.

terão grande influência sobre a taxa de desemprego, o que indica que esta taxa continuará, no futuro, ainda muito elevado.

No primeiro governo de FHC a sustentação do Plano Real (estabilização) foi feita através de uma taxa de juros alta e uma taxa de câmbio sobrevalorizada. Neste cenário, as empresas substituíram trabalho por insumos importados, e por sua vez criaram desequilíbrios na economia tanto no setor externo quanto no mercado de trabalho.

A distorção da taxa de câmbio, fixada arbitrariamente pelo Banco Central, determinou um déficit comercial que deve ser financiado a um alto custo. Para induzir o sistema financeiro a atrair esse financiamento, foi necessário que as taxas de juros fossem permanentemente mais altas que as internacionais, especialmente as taxas de juros de curto prazo. Enquanto existiu financiamento por via de um constante endividamento e/ou venda de ativos, a taxa de câmbio se manteve sobrevalorizada.

O desequilíbrio no mercado de trabalho ocorre porque o empresário industrial doméstico, perante o grande fluxo de importações competitivas, tratou de se adaptar ao novo leque de preços relativos existentes. Esta adaptação ou ajuste, que o empresário faz a fim de reduzir os seus custos e aumentar seus benefícios, se dá com o aumento da proporção de insumos importados, usados no processo produtivo. O insumo ideal a substituir é o trabalho nacional em razão de que o salário nacional, em termos relativos, fica mais caro devido à sobrevalorização cambial.

Por outro lado, o país pode estar presenciando os efeitos do desemprego tecnológico. Ele seria o resultado da ampla reestruturação da economia brasileira provocada pela abertura econômica registrada nesta década. Estas mudanças têm implicado a difusão da automação microeletrônica e da informática e nas inovações organizacionais com base nos sistemas japoneses de produção. Portanto, haveria queda estrutural na capacidade do sistema econômico absorver novos empregos (Boletim DIEESE, n. 194, maio de 1997).

É fatível, pois, esperar que, como consequência da persistência desse alto desemprego em um espaço de tempo bastante prolongado, a economia tenha criado as condições para configurar uma situação de histerese do desemprego que em termos simples significa que a taxa estrutural de desemprego segue atrás da taxa de desemprego observada.

Concluindo, pode-se dizer que todos estes fatos apontam que a economia paulista e a brasileira, em geral, ingressa neste novo século com uma

taxa estrutural de desemprego bastante alta, obrigando os responsáveis pela política econômica a realizar profundas mudanças estruturais que procurem assegurar os inegáveis resultados que o processo de estabilização da economia tem conseguido.

REFERÊNCIAS

- AMADEO, A. J.; ESTEVÃO, M. *A teoria econômica do desemprego*. S. Paulo: Hucitec, 1994.
- MADEO, E.; SOARES, R. *Quebra estrutural da relação entre produção e emprego na indústria brasileira*. In: XVIII Encontro Brasileiro de Econometria. Águas de Lindóia, 11-13, dez. 1996.
- ANDERTON, R.; BARREL, R. The ERM and structural change in European labour markets: a study of 10 countries. *Rev. of World Economics*. Institut fur Weltwirtschaft Kiel, 1995.
- BASTOS, F.; CAVALCANTI, M. Desemprego tecnológico: uma evidência empírica. Brasília, *Lab. de Economia*, Setembro de 1997.
- BALTAR, P.; MATOSSO, J. *Transformações estruturais e emprego nos anos 90*. Ensaio FEE. Porto Alegre, v.18, n. 1, p. 13-40, 1997.
- BLANCO DE DIEGUEZ, M.; CHHAB, N. Desestacionalización del Producto Bruto Manufacturero. Serie de *Trabajos Metodológicos y Sectoriales*, Gerencia de Investigaciones y Estadísticas Económicas, BCRA, No. 29, 1987.
- CACCIAMALI, M. C. e BEZERRA, L. DE L. Produtividade e emprego industrial no Brasil. *Revista Brasileira de Economia*. Rio de Janeiro, v. 51, n. 1, jan-mar. 1997.
- CASTRO DE SOUZA, R. *17º Colóquio Brasileiro de Matemática*. Inst. de Mat. Pura e Aplicado do CNPQ. Rio de Janeiro: IMPA, 1989.
- ENDERS, W. *Applied econometric time series*. Iowa State University: John Wiley & Sons, Inc. New York, 1995.
- FRANCO, G. *Inserção externa do desenvolvimento*. Jul. 1996. (mimeo).
- GORDON, R. *Macroeconomia*. Mexico: CECSA, 1996.
- HARVEY, A. *Times Series Models*. 2. ed. New York: Harvester Wheatsheaf, 1993.
- PASTORE, J. *Flexibilização e contratação coletiva*. São Paulo: LTR, 1994.
- PLATA, L.; SILVA, E. Taxa natural de desemprego na região metropolitana de São Paulo. In *Emprego e desenvolvimento tecnológico*. São Paulo: DIEESE/CESIT, 1999.
- PORTUGAL, M.; GARCIA, L. Notas sobre o desemprego estrutural no Brasil. In: XVIII Encontro Brasileiro de Econometria. Águas de Lindóia, 11-13 dez de 1996.

MATTOSSO, J. *A desordem do trabalho*. São Paulo: Scritta, 1995.

SACHS; LARRAIN. *Macroeconomia*. São Paulo: Makron Books, 1995.

SEADE. *Pesquisa de emprego e desemprego na região metropolitana de São Paulo*. Jan. 1985- abr. 1998.

THE OECD OBSERVER. Paris, 1997 e 1998. (vários números).

THUROW, L. C. *O futuro do capitalismo: como as forças econômicas de hoje modelam o mundo*. Rio de Janeiro: Rocco, 1993.

WORD EMPLOYMENT. *National policies in a global context*. Genebra: ILO, 1996.

Endereço do autor:

Rua Marechal Hermes da Fonseca, 76
13085-803 – CAMPINAS, SP