

Monitorando movimentos macro, meso e micro

Marcelo Neri

“Tsunami ou marolinha?” eis a questão que muitos se perguntaram, nos últimos 17 meses, acerca dos efeitos da crise internacional de setembro de 2008 no Brasil. Afinal, qual foi o impacto da crise no bolso dos brasileiros? Qual é o balanço completo até dezembro de 2009? Em geral, respondemos estas perguntas sob uma perspectiva macro que olham para o comportamento dos grandes agregados. Por exemplo, a média e a desigualdade e a pobreza já se recuperaram da ressaca de janeiro do ano que passou? E a nova classe média brasileira? Continuou crescendo ou submergiu?

Há um nível intermediário de análise denominado meso, que olha para as mesmas estatísticas em grupos específicos da sociedade: quem perdeu mais com a crise? Os da in-

dústria, os mais educados ou os da periferia? Há ainda um nível micro que examina a trajetória de cada indivíduo, avaliando o risco de cada um progredir, ou de regredir e não apenas o saldo líquido de movimentos em direções opostas. E o risco individual de cair da classe alta já voltou aos padrões pré-crise? Mal comparando, o nível macro descreve a floresta, o meso detalha os bosques, enquanto o micro compara o desenvolvimento de cada árvore ao longo do tempo.

Este artigo é o epílogo da série “crônica de uma crise anunciada” que monitora os efeitos da turbulência externa através dos microdados trabalhistas da Pesquisa Mensal de Emprego (PME/IBGE) nas seis principais regiões metropolitanas brasileiras. O

artigo que deu origem à série, escrito há exatos 12 meses, não evidenciou até dezembro de 2008 qualquer sinal de retrocesso dos indicadores sociais baseados em renda domiciliar *per capita* a não ser pelas classes AB. A segunda crônica “contra-ataque na crise” ilustrou o período crítico: a ressaca de janeiro de 2009, erodindo parte dos ganhos passados. Daí em diante mostramos de forma salpicada ao longo do ano tendência a recuperação dos indicadores. Mas findo o calendário gregoriano de 2009, o ano da crise, onde de fato estamos em termos de pobreza, composição da população em classes econômicas (E, D, C e AB) e seus determinantes próximos como crescimento da média e da desigualdade de renda?

Macro

Exemplicamos a partir da soma das classes ABC aquela que subiu 31,9 milhões entre 2003 e 2008 (metade da França), segundo nossos estudos anteriores. Em dezembro de 2009, as classes ABC se encontram no recorde histórico com 69,21%. Entretanto, a diferença é ínfima frente ao segundo melhor ponto da série, os 69,14% de dezembro de 2008, o ponto de referência pré-chegada da crise. Observamos não somente nesta mais em todas as séries macro-sociais mais do mesmo: um empate com muitos gols ao longo de 2009, com fortes perdas em janeiro e recuperação já desde fevereiro. Dezembro de 2009 e de 2008, independentemente da operação de efeitos sazonais, são os picos das séries, como cristas de ondas. Se esta manutenção do *status quo* da distribuição de renda em dezembro pode ser considerado um bom resultado em época de crise, por outro lado esconde uma parada súbita da melhora prévia dos indicadores.

Dezembro 2009 também constitui um indicativo mais atual do estado das coisas que a média do ano, por exemplo. Seguindo nesta linha, abrimos a última pesquisa mensal em ondas semanais até a última semana de dezembro de 2009, onde centramos nossa análise como indicador antecedente

de curto prazo. Na última semana do ano passado, 67,7% da população estava nas classes ABC, sugerindo viés de piora em relação à totalidade do mês de dezembro de 2009. Em dezembro observamos pelo Cadastro Geral de Empregados e Desempregados (Caged) a destruição de 416 mil postos de trabalho, queda acima do ajuste normal do mês, interrompendo a recuperação de agosto a novembro, depois recobrada em janeiro, quando vínhamos quebrando o recorde do respectivo mês da série. O saldo líquido no final de 2009, de 995 mil novos postos de trabalho, é um resultado razoável no contexto da crise internacional quando a maioria dos países destruiu postos de trabalho, mas sugere que apesar de retomada de tendência ascendente, o balanço das séries ainda não são águas passadas.

Meso

Levando em conta que as diversas séries acima discutidas monitoram os movimentos macros das séries sociais, passamos agora à análise dos meses das séries, acompanhando as flutuações de subgrupos específicos. Na parte final do artigo detalhamos os movimentos micros fruto das trajetórias dos mesmos indivíduos ao longo do tempo. Discutimos, a seguir, a evolu-

Quem perdeu
mais status
com a crise
foram os mais
instruídos (24%
a mais), os da
indústria (11%),
mas não os do
setor financeiro

ção das capitais e periferias metropolitanas. Apesar dos maiores níveis de renda apresentados pelas primeiras (R\$ 791 contra R\$ 495 nas periferias), quando consideramos os últimos seis anos há marcada redução das diferenças das classes ABC entre os dois tipos de áreas.

O crescimento das classes ABC foi 33,9% nas periferias contra 25,8% ao das capitais. Restringindo a análise ao último ano, que capta os impactos da crise, notamos uma taxa de crescimento de 1,08% nas periferias e uma queda de -0,55% nas capitais. Ou seja, a manutenção do tamanho agregado das classes ABC es-

Após setembro de 2009, a probabilidade de quem estava nas classes ABC baixar o status caiu não só em relação à crise, mas também a pré-crise

conde progressão na periferia e regressão nas capitais. Esta convergência de *status* entre capital e periferia no pós-crise foi até menor que o antes da crise. Apresentamos em www.fgv.br/cps/c2010 o espectro de variáveis sociais com cortes para gênero, escolaridade, idade entre outras.

O aspecto longitudinal dos microdados de renda domiciliar *per capita* do trabalho da PME/IBGE também nos fornecerá a evidência sobre o padrão de mobilidade entre classes, observados na prática. Para identificar a trajetória individual, precisamos con-

catenar os dados das mesmas pessoas e de suas famílias ao de diferentes instantes de tempo que apesar de pouco utilizada neste sentido a PME permite. A principal lição desta análise é que uma pessoa não é pobre (ou de elite), mas sim se ela está na pobreza (ou na elite econômica). Inicialmente quantificamos a magnitude das quedas das classes econômicas mais altas em diversos subperíodos. Medimos a evolução do risco de queda das classes mais altas dos indivíduos, depois de maneira controlada pelos atributos de cada um para depois identificarmos as características pessoais mais associadas com vulnerabilidade dos grupos de elite em relação à crise, tais como setor de atividade e educação, entre outras.

Micro

A análise de transição de estados complementa as de séries de tempo que mostram qual a parcela de cada classe de renda na população geral ou de grupos específicos, determinando a magnitude dos riscos envolvidos, ou seja, a pergunta do quanto à crise recente afetou risco de queda de classe. Por exemplo: como vimos, a parcela nas classes ABC mudou pouco entre os dois últimos meses de dezembro (passou de 69,14% para 69,21%). Entretanto,

uma calmaria dos grandes números pode esconder pequenas-grandes tormentas na vida de alguns indivíduos, como a perda de emprego. É preciso diferenciar situações onde os números macro e micro pouco mudam daquelas onde há quantidades similares de pessoas se movendo em direções opostas, suavizando os movimentos das séries agregadas. O ponto explorado aqui é avaliar os riscos de quem chegou às classes mais altas de regredir. Dos mesmos indivíduos observados em dezembro de 2008 e em dezembro de 2009, por exemplo, 14,38% caíram da classe mais alta. Agora, isto é pouco ou muito? Se compararmos com dezembro dos demais anos, o risco de regressão econômica só é maior que os de 2007 e de 2006, com 8,87% e 13,32%, respectivamente, anos de marcada expansão.

À guisa ainda da comparabilidade com os demais meses da crise recente, os 14,38% de risco de queda das classes ABC dos dados de dezembro de 2009, são inferiores aos de 11 dos últimos 12 meses do ano. O pior período da crise é aquele terminado em plena ressaca de janeiro de 2009, quando atinge 24,97%. Incidentalmente, este é o mês mais distante do último ano quando a crise chegou às nossas séries. Ambos os resultados parecem indicar que não só as classes

ABC se recuperaram no seu tamanho agregado dos choques externos, dos quais foi a primeira vítima preferencial logo ao início da crise, como em termos dos indivíduos, o risco de queda também se normalizou, indicando a superação do período mais crítico da crise.

Elite

No estágio seguinte, elaboramos um modelo estatístico que evidencia a chance de cada uma cair das classes ABC no período de 12 meses depois de setembro de 2008 (crise), que foi 5% maior que a apresentada no período imediatamente antes da crise iniciada em janeiro de 2007. Indo um passo adiante, decomparamos em dois períodos de crise compreendido entre setembro de 2008 e dezembro de 2009. As chances de queda das classes ABC durante o período findo em setembro de 2009 foram 3,6% maiores do que no período que vai do início de 2007 a setembro de 2009, mas no terminado entre outubro e dezembro de 2009 foram 5,48% menores do que na fase pré-crise. Ou seja, após a crise completar um ano de ocorrência em setembro de 2009, a probabilidade de quem estava inicialmente nas classes ABC descer de *status*, caiu não só em relação à crise

operante nos 12 meses anteriores, mas em relação ao pré-crise. O dispositivo disponível em http://www3.fgv.br/librecps/C2010/sim_pme/index.htm permite a cada um simular os impactos da crise sobre pessoas com os seus atributos próprios ou de interesse.

Finalmente, isolamos os atributos pessoais e econômicos de quem caiu das classes ABC durante a crise. Notamos que os ocupados na indústria sofreram quedas relativas em relação ao padrão dos demais setores (11% maiores). Já os vinculados ao setor financeiro não registraram deslocamentos vis-à-vis a sua posição relativa inicial. Estes dados, apesar de causarem alguma surpresa, pois afinal a crise teve origem no setor financeiro, são consistentes com a divergência de lucratividade das empresas industriais e bancárias em 2009. Já os com maior escolaridade sofreram relativamente mais que os sem instrução, o que contradiz a maior parte das recessões usuais, onde os não qualificados são os primeiros, geralmente, a ficarem desempregados. A chance de queda daqueles com pelo menos o segundo grau completo, vis-à-vis aos sem instrução, sobe 23,7% a mais. Por sua vez, os funcionários públicos e empregadores possuem, em geral, maior estabilidade nas classes ABC, mas a crise afeta

Findo 2009, pobreza, nova classe média e seus determinantes desigualdade e média de renda se recuperaram da ressaca de janeiro

a todas as pessoas em posições na ocupação e na desocupação de forma balanceada, não mudando a posição relativa entre elas. E a crise afligiu mais as capitais do que as periferias das nossas maiores cidades, assim como em termos de países, a crise afetou mais o centro do que a periferia do capitalismo. 

Marcelo Neri (Centro de Políticas
Sociais e EPGE/FGV)
(mcneri@fgv.br)