



EletoRevista

Revista Científica e Tecnológica

Institutional Business Consultoria Internacional

ISSN Nº: 1983-2168

MARÇO / 2009.

Professor Istvan Kasznar PhD.

Professor Titular da Fundação Getúlio Vargas, na EBAPE – Escola Brasileira de Administração Pública e de Empresas;

Professor – Conferencista do IBMEC; PUC – Pontifícia Universidade Católica e UERJ – Universidade do Estado do Rio de Janeiro.

Economista – Chefe da ACREFI

CEO da IBCI – Institutional Business Consultoria Internacional.

Conselheiro Econômico do Instituto Dannemann Siemsen da Propriedade Industrial – IDS.

istvan@fgv.br - istvan@acrefi.org.br - istvan@ibci.com.br

Produção e Modelo Completo de Economia Aberta

Professor Istvan Kasznar PhD.

O presente artigo se baseia em estudos feitos para a Tese Doutoral do autor, *intitulada **Business Cycles in Brazil: Models, Types, Evolution and Dominant Tendencies, by Industrial Sectors, between 1980 and 1.992***, defendida na Califórnia Coast University no dia 25 de julho de 1.995, na Universidade da Califórnia, em Santa Ana, Los Angeles, Estados Unidos da América.

Introdução

Do ponto de vista conceitual e da modelação econômica, a estrutura mais relevante é provavelmente a que diz respeito à produção, isto é, ao cálculo e determinação da geração anual de bens e serviços.

A produção significa a geração de bens e riquezas, com vistas a saciar a demanda e a fome por bens tangíveis e intangíveis. Quanto maior e mais regular for esta produção, com capacidade de atender a demanda, tanto melhor será para uma dada comunidade, que verá seu bem-estar crescer.

O produto gera renda, porque para produzir e mediante seu ato, cada fator de produção haverá de ser e quererá ser, supostamente ao menos, remunerado. E havendo renda, surge a

capacidade de compra, que permite a tomada de decisão dos agentes econômicos: ou gastam em consumo, ou poupam para formar um capital próprio maior, recebê-lo no futuro com maior poder aquisitivo.

Uma economia fechada limita-se apenas ao espaço nacional. A localidade onde se faz a produção, a circulação de renda e o dispêndio, é uma dada unidade geográfica.

Contudo, viver numa autarquia, isolado do mundo globalizado, de outros vizinhos, ilhado, é cada vez mais impensável. Nem tudo se produz e extrai localmente das disponibilidades e facilidades de materiais primas, recursos humanos e tecnologias nacionais. É preciso abrir-se ao exterior, e fazer trocas comerciais, nas quais as importações – o consumo que se faz com bens e serviços produzidos no exterior – e as exportações – o consumo internacional saciado com a produção nacional – passam pelo exercício sadio da transação e da mobilidade dos fatores.

Desta forma, as economias abertas são as economias modernas, do nosso tempo. E a evolução tecnológica, ao reduzir custos de produção, facilitar transportes, e otimizar comunicações, impõe um ritmo crescente de abertura e comercialização internacionalização entre as nações.

Na seção que segue, apresenta-se um modelo clássico e relevante de Economia Aberta ao Exterior.

Ao avaliarmos um modelo completo de economia aberta no qual a produção venha a ser considerada a variável mais marcante a ser analisada em função dos estudos do ciclo de negócios, verificaremos que as categorias de créditos e de débitos das cinco contas articuladas e montadas, geradoras de um sistema econômico, são formadas essencialmente por dezenove variáveis.

Para entendermos claramente estas variáveis, usaremos alguns símbolos, formando, então, um conjunto de equações gerador do sistema econômico simplificado de uma nação.

Estas dão origem, no sistema de contas nacionais, a um modelo que possui uma consistência matricial significativa e que tem sido utilizado dentro do âmbito das diversas nações para mensurarem o seu PIB e as suas relações internacionais. As estatísticas com as quais trabalharemos, e que exporemos através de quadros mais adiante, se referem a estas variáveis. As notações mais importantes que utilizaremos ao longo deste projeto serão as seguintes:

Y = produto líquido ao custo dos fatores

CP = consumo das unidades familiares

CG = consumo do governo

IP = formação bruta de capital fixo das empresas privadas

IG = formação bruta de capital fixo do governo

D = depreciação do capital fixo, máquinas e equipamentos

SP = poupança das unidades familiares

SG = poupança do governo

SE = lucros não distribuídos pelas empresas

TI = impostos indiretos

TD = impostos diretos (imposto de renda retido na fonte)

TC = outras receitas correntes do governo

GT = transferências

GS = subsídios

X = exportação de bens e serviços

M = importação de bens e serviços

SF = saldo do balanço, de pagamentos em conta corrente

YF = renda líquida enviada para o exterior

E = variação líquida dos estoques

Consideradas estas notações, as equações básicas do sistema econômico são:

1) A conta de produção, gerando a equação:

$$Y + (TI - GS) + D + M = CP + CG + IP + IG + X - M$$

2) Apropriação:

$$CP + TD + TC + YF + SP = (Y - SE) + GT$$

3) Conta consolidada de capital:

$$IP + IG + E = SP + SE + SG + D + SF$$

4) Conta corrente do governo:

$$CG + GS + GT + SG = TI + TD + TC$$

5) Transações com o exterior

$$X + SF = M + YF$$

Há vários tipos de definições de produção.

Geralmente, ao se definirem os conceitos de PIB (Produto Interno Bruto) a preços de mercado, PNB (Produto Nacional Bruto) a preços de mercado e PNL (Produto Nacional Líquido) a preços de mercado e a custos de fatores no modelo completo de economia aberta, pode-se proceder ao uso de algumas equações básicas, que agora veremos.

O valor bruto da produção da economia é igual ao valor agregado bruto mais do valor das transações intermediárias. Raciocinando inversamente: o valor bruto da produção da economia menos o valor das transações intermediárias é igual ao valor agregado bruto.

Se deste deduzirmos os subsídios, obteremos o Produto Interno Bruto a preços de mercado.

Se subtrairmos do PIB a renda líquida enviada ao exterior, obteremos o Produto Nacional Bruto a preços de mercado.

Em se subtraindo a depreciação do capital do PNB, obteremos o Produto Nacional Líquido a preços de mercado.

Subtraindo-se os impostos indiretos mais os subsídios, obter-se-á o Produto Nacional Líquido ao custo dos fatores, de tal sorte que o Produto Nacional Líquido ao custo dos fatores é idêntico à Renda Nacional.

Vejamos como isto funciona na prática. O principal órgão que divulga informações da atividade industrial é a Fundação IBGE (Fundação e Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística).

As estatísticas existentes são divulgadas e distribuídas segundo como temas: a indústria extrativa mineral e de transformação; a indústria de construção; energia; indicadores conjunturais e propriedade industrial.

Para a indústria extrativa mineral e de transformação, composta de dados gerais e produção em consumo. Ela tem como finalidade mapear a estrutura e acompanhar a evolução do setor industrial.

O IBGE também divulga os indicadores conjunturais da indústria, através dos quais reúne informações de curto prazo acerca da evolução da atividade fabril, de forma a possibilitar sua mensuração, o estabelecimento de relações e o fornecimento de indicadores que venham a propiciar a base empírica necessária para o conhecimento e a explicação da tendência da produção e as análises prospectivas do comportamento fabril.

Naturalmente, existem nomenclaturas, conceitos e definições variadas utilizadas pelo IBGE. Neste sentido, através do censo industrial e no âmbito dele, os censos econômicos de 1985 perscrutaram as empresas cujas atividades principais eram a indústria, o comércio, os serviços, a construção e os transportes, com diversas qualificações que são a seguir apresentadas.

No que tange às atividades, os censos econômicos de 1985 compreendem as atividades das indústrias extrativa mineral, de transformação e de construção, que inclui a incorporação e o loteamento: comércio, serviços e transporte, de acordo com as descrições da classificação de atividades econômica do IBGE, na versão atualmente vigente, desde os censos de 1985.

Para a atividade industrial devem ser consideradas algumas ressalvas.

O censo industrial incluiu a autoprodução contínua de energia elétrica. Não foram pesquisadas neste censo as atividades de abate autônomo de animais, abatedouros municipais e as atividades realizadas por garimpeiros e faiscadores, nem tampouco instalações que beneficiam e transformam produtos agropecuários, ou quaisquer outros tipos de atividades fabris que não viessem a atender as exigências que caracterizassem os estabelecimentos no censo industrial de 1985.

Neste caso, tais atividades produtivas foram incorporadas e analisadas enquanto secundárias em estabelecimentos não-industriais, ou foram consideradas excluídas do âmbito dos censos econômicos de 1985.

Não foram pesquisados e perscrutados os serviços industriais de utilidade pública, como as atividades de produção e distribuição de energia elétrica, de limpeza pública, de remoção de lixo, de abastecimento de água e de esgotamento sanitário. Excluíram-se também no âmbito dos censos econômicos de 1985 os órgãos de administração pública direta, como os ministérios, as secretarias de estado, as prefeituras, os estabelecimentos penais e configurações similares, entidades beneficentes, entidades caritativas, igrejas e outras unidades sem fins lucrativos, como instituições de pesquisa, de estudo, institutos, clubes, órgãos de classe e afins. Estas entidades foram recenseadas em situações especiais, como por exemplo quando são mantidas predominantemente através de atividades produtivas destinadas ao mercado e não de doações ou dotações orçamentárias provenientes do governo.

A classificação de atividades é o instrumento que cria possibilidades para o levantamento de estatísticas comparáveis. Sua aplicação, durante a coleta de dados, orienta a identificação das organizações, das empresas e dos diversos tipos de atividades; permite, ainda, o desdobramento das unidades locais em estabelecimentos e a definição de suas modalidades, organizando as informações durante a apuração, publicação e armazenamento dos resultados e dando condições, portanto, de que se faça uma descrição em separado de cada atividade específica. Isto é especialmente importante para nós que estaremos procurando analisar e retratar diversos subsetores da indústria nacional.

A sistematização e a agregação dos dados de cada atividade industrial classificada, agregados em categorias hierarquizadas, geralmente conhecidas como classe, gênero, grande grupo, grupo e subgrupo, visa tornar homogêneas as informações pertinentes às atividades estudadas e investigadas num determinado censo e nas demais pesquisas do IBGE.

As variáveis obtidas no censo industrial dividem-se em duas tipologias: as variáveis diretas, que são publicadas exatamente tal como elas são coletadas pelos questionários vinculados a uma pesquisa; e as variáveis derivadas, que são aquelas que representam a soma de quesitos de questionários e que visam traduzir conceitos econômico-contábeis.

As variáveis das contas nacionais do primeiro tipo são de três categorias:

1) Aquelas que medem a produção bruta do setor industrial, conhecidas como valor bruto da produção industrial (VBPI) ou valor bruto da produção (VBP).

2) As que mensuram o consumo intermediário, referente àquela produção conhecida como custos das operações industriais (COI) ou consumo intermediário (CI); e

3) Aquelas que mensuram a participação do setor industrial na produção total da nação, medida pelo valor da transformação industrial (VTI) ou valor adicionado (VA).

O diferencial entre o VBPI e o VBP é que o primeiro é restrito à atividade industrial, enquanto o segundo absorve a produção do estabelecimento fabril, incluindo, como consequência, as produções secundárias desenvolvidas em seu interior.

As variáveis VBP, CI e VA são comumente conhecidas e muito utilizadas pelas contas nacionais.

Bibliografia

1. Burns, A.F. & Mitchell, W. C. *Measuring Business Cycles*. Nova Iorque: NBER, 1943.
2. Burns, A.F. *Progress Towards Economic Stability*. *American Economic Review*. Março 1960, Vol. 50, Nº 1.
3. Keynes, J. M. *The General Theory of Employment, Interest and Money*. Nova Iorque: Harcourt Brace, 1936, 371.

4. Kalecki, M. Theory of Economic Dynamics: An Essay on Cyclical and Long-Run Changes in Capitalist Economy. Londres: George Allen & Unwin, 1954.
5. Kaldor, N. Alternative Theories of Distribution. The Review of Economic Studies, 1955-56.
6. Zarnowitz, V. Recent Work on Business Cycles in Historical Perspective: A Review of Theories and Evidence. Journal of Economic Literature, XXIII, 2 (Junho 1985), 523-580.
7. Zarnowitz, V. & Moore, G. H. Sequential Signals of Recession and Recovery. Journal of Business, vol. 55, Nº 1 (Janeiro 1982), 62.
8. Baumol, W. J. & Quandt. "The Transaction Demand for Cash: An Inventory Theoretical Approach." The Quarterly Journal of Economics, 1954, Nº 4.
9. Baumol, W. J. & Quandt. Economics Dynamics. 2ª edição, Macmillan, 1959.
10. Sayers, C. L. & Brock, W. A. Is the Business Cycle Characterized by Deterministic Chaos? Journal of Monetary Economics, 1988, Vol. 22, 71-90.
11. Friedman, M. The Role of Monetary Policy. American Economic Review, Março, 1968.
12. Friedman, M. Capitalism and Freedom. Chicago: University of Chicago Press, 1982.
13. Dornbusch, R. Macroeconomics. Tóquio: McGraw-Hill, 1962.
14. Furtado, C. Análise do modelo brasileiro. (An Analysis of the Brazilian Model.) Rio de Janeiro: Civilização Brasileira, 1978.
15. Gonçalves de Oliveira, Édén - 114 Sondagem Conjuntural da Indústria de Transformações, Janeiro/1995 - IBRE/Fundação Getúlio Vargas.
16. Kasznar, Istvan Karoly - Análise da Evolução do Produto Interno Bruto dos Estados da Federação do Brasil, 1970-1990, Janeiro/1990 - EBAPE - Escola Brasileira de Administração Pública e de Empresas, no Programa de Estudo dos Estados e Municípios - PEEM / Fundação Getúlio Vargas. PEEM/EBAPE/FGV.

17. Kasznar, Istvan Karoly - S mula. An lise da Evolu o do PIB - Produto Interno Bruto por Estados, 1970-1994, Janeiro/1995 - EBAP - Escola Brasileira de Administra o P blica, no Programa de Estudo dos Estados/Funda o Get lio Vargas. PEEM/EBAPE/FGV.
18. Kasznar, Istvan Karoly - Finan as Internacionais para Bancos e Ind strias. Ed. IBMEC, 1990.
19. Maddala, G. S. Econometrics. T quio: McGraw-Hill Kogakusha, 1977.
20. Markwald, R. A. Previs o da produ o industrial: indicadores antecedentes e modelo de s rie temporal. (Industrial Production Forecast: Background Indicators and Temporal Series Model.) Rio de Janeiro: IPEA, 1989.
21. Simonsen, M. H. Din mica macroecon mica. (Macroeconomic Dynamism.) S o Paulo: McGraw-Hill, 1983.
22. Simonsen, M. H. Infla o: Gradualismo X Tratamento de choque. (Gradualism X Shock Treatment.) Rio de Janeiro: APEC, 1970.
23. Zarnowitz, V. Major Macroeconomic Variables and Leading Indexes: Some Estimates of their Interrelations., Nova Iorque: NBER, 1990.
24. Valentine, Lloyd M. and Ellis, Dennis - Business Cycles and Forecasting, by South Western Publishing Company, 1991.
25. Anu rio Estat stico do Brasil, editado pelo IBGE - Funda o Instituto Brasileiro de Geografia e Estat stica, publica es de 1979 a 2007.

Autor: Istvan Karoly Kasznar   PhD. em Business Administration pela Calif rnia Coast University – CCU; Mestre em Economia pela Escola de P s Gradua o em Economia da FGV; T cnico em Administra o de Empresas P blicas e Privadas pela EBAPE – FGV; Economista pela Universidade Federal do Rio de Janeiro – UFRJ; Especialista em Banking pela Universidade de Berkeley – Calif rnia – USA. Professor Titular da Funda o Get lio Vargas, na EBAPE. Economista – Chefe da ACREFI; CEO da Institutional Business Consultoria Internacional; Conselheiro do SECIF e do Instituto Dannemann – Siemens de Propriedade Industrial. Membro – representante do Grupo de Estudos da Previd ncia, na FEBRABAN. Especialista em Macroeconomia; Banking; Estrat gias e Controles Banc rios Avan ados. Professor – conferencista do IBMEC; da PUC – Pontif cia Universidade Cat lica;

e da UERJ – Universidade do Estado do Rio de Janeiro (istvan@fgv.br ; istvan@acrefi.org.br; istvan@ibci.com.br). Telefone: 55 – 21 – 22637017.