

UNIVERSIDADE DE COIMBRA  
FACULDADE DE DIREITO

# BOLETIM DE CIÊNCIAS ECONÓMICAS

HOMENAGEM AO PROF. DOUTOR ANTÓNIO JOSÉ AVELÃS NUNES

VOLUME LVII Tomo II

2 0 1 4

**Organizadores:**

LUÍS PEDRO CUNHA  
JOSÉ MANUEL QUELHAS  
TERESA ALMEIDA



COIMBRA

# ESTADO SOCIAL, QUANTIS, NÃO-LINEARIDADES E DESEMPENHO ECONÓMICO: UMA AVALIAÇÃO EMPÍRICA

## 1. Introdução

Desde a Revolução do Estado Social (doravante ES) após a II Guerra Mundial, a relação entre ES e desempenho económico (crescimento) faz parte da agenda de investigação em Economia (ver por exemplo: (BARR, 1992); (ATKINSON, 1995a); (HASSLER et al., 2003); (LINDERT, 2004)), apesar de o interesse ter sofrido oscilações ao longo do tempo. Fenómenos como a queda do Bloco Soviético, a tendência de envelhecimento nos países desenvolvidos, a globalização (sobre onexo entre globalização e ES, ver por exemplo: (RODRIK, 1998); e as sínteses da literatura de (MEINHARD e POTRAFKE, 2012), (SCHULZE e URSPRUNG, 1999) e (URSPRUNG, 2008)) levaram a um ressurgimento do tema nos anos 90. Mais recentemente, ganha um novo fôlego com o eclodir da crise financeira de 2007-2008 e principalmente com a crise da dívida soberana que atingiu vários países Europeus desde 2010 e os problemas subsequentes de sustentabilidade orçamental que daí advieram ((AFONSO e ALLEGRE, 2011), (ANDRADE et al., 2013), WS (DAMERAU, 2011) e (PIACHAUD, 2013)).

Desenvolvemos um estudo *cross-country* aplicado a um conjunto de países da OCDE no período 1980–2013 que visa analisar a relação macroeconómica de longo-prazo entre as despesas sociais públicas agregadas (doravante despesas sociais) e o produto. Em estudos deste tipo, a questão principal que está subjacente a qualquer estratégia de investigação é saber se ES (medido neste caso pelas despesas sociais) e desempenho macroeconómico (crescimento) não são objetivos opostos, ou seja, se não é preciso reduzir o primeiro para estimular o segundo (vide (ATKINSON, 1995b)). Mas o nosso estudo ao tentar elucidar aquela pergunta tem em conta características possíveis da relação entre aquelas duas variáveis já apontadas pela literatura: a interdependência provável entre as variáveis e problemas de causalidade associados (ver por exemplo: (HARTWIG, 2010), (WANG, 2011)); o problema da dimensão do Estado (ver por exemplo: (BARRO, 1990) e (BERGH e HENREKSON, 2011)) e a existência de não linearidades <sup>1</sup> (ver por exemplo: (FIC e GHATE, 2005),

---

<sup>1</sup> A publicação da *magnum opus* de Esping-Andersen (ESPING-ANDERSEN, G. 1990. *The three worlds of welfare capitalism*, Cambridge, Polity Press) esteve na origem da abordagem e temática dos regimes quer virtuais quer “reais” de ES. Temática de natureza teórica, mas também empírica, ao propor critérios e tipologias do ES reclama também um forte pendor normativo. Sobre o assunto ver por exemplo: ARTS W, GELISSEN J. (2002). Three worlds of welfare or more, *Journal of European Social Policy*, 12:137–158. ARCANJO, M. 2006. Ideal (and real) types of welfare state. *Department of Economics, ISEG, WP 6*. BAMBRA, C. 2007. Sifting the wheat from the chaff: a the two-dimensional discriminant analysis of welfare state regime theory, *Social Policy and Administration*, 41, pp. 1–28. SCRUGGS, L. A., e ALLAN, J. P. 2008. Welfare regimes for the twenty first century: revisiting the three worlds of welfare capitalism. *World Politics*, 60, 642–664. Para uma abordagem crítica sobre as metodologias utilizadas ver, EBBINGHAUS, B. 2012. Comparing welfare state regimes: are typologies and ideal or realistic strategy? *European Social Policy Analysis Network, ESPA net Conference*. Edinburgh, UK.

Através de um estudo de estatística descritiva e econométrica pretende-se elucidar e testar as seguintes hipóteses: *a*) a evolução das despesas sociais depende do nível de rendimento dos países; *b*) a relação entre as despesas sociais e o PIB depende da *dimensão* do ES e *c*) aquela relação (não sendo linear) depende de *regimes* do ES. Para além da análise de estatística descritiva, utiliza-se econometria de séries não estacionárias (o modelo DOLS) para evitar a aceitação de possíveis relações espúrias entre as variáveis e um modelo de *thresholds* (modelo de (HANSEN, 1999) para apurar da existência de vários regimes de *Estado Social*. Ao longo dos dois primeiros exercícios, considerou-se sempre duas distribuições, a do produto e a das despesas sociais, de forma a se poder ilustrar por quartis do rendimento ou das despesas sociais a relação entre estas duas variáveis, tendo-se assim em conta partes da distribuição das despesas sociais e do produto. Para o último exercício que testa a hipótese *c*), os países são agrupados através do modelo de *thresholds*. Os resultados confirmam as hipóteses *a*) e *c*) mas não a *b*).

Na secção 2 são analisados os mecanismos teóricos que elucidam o sinal da relação, assim como os respetivos mecanismos de transmissão. Na secção 3 é exposta a metodologia econométrica e resultados e, por último, na secção 4 conclui-se.

## **2. Poderá o Estado Social influenciar o desempenho em termos de crescimento económico? Revisão dos principais argumentos teóricos**

Na perspetiva do desempenho macroeconómico de longo prazo, a questão fundamental que tem sido colocada é a de saber se o alargamento do Estado Providência ou Estado Social (ES) e o crescimento económico sustentado são objetivos incompatíveis, ou seja, se é necessário reduzir o primeiro