

Desigualdade Econômica Regional e *Spillovers* Espaciais: Evidências para o Nordeste do Brasil

RESUMO

Verifica se há dependência espacial entre as capitais das microrregiões do Nordeste do Brasil, bem como a existência de *spillovers* espaciais sobre o crescimento do PIB *per capita* entre estes municípios, no período 2000-2006. Para tal, estima um modelo econométrico espacial, utilizando uma matriz de pesos espaciais em que foram consideradas como vizinhas as capitais de microrregiões cujo tempo de deslocamento de uma para outra é de até duas horas, o que gerou uma amostra de 166 unidades geográficas de análise. Os resultados obtidos mostram que, no período analisado, o desempenho econômico das microrregiões nordestinas não foi afetado pelo desempenho das microrregiões vizinhas, ou seja, não existe presença de *spillovers* de localização entre os municípios presentes na amostra.

PALAVRAS-CHAVE

Nordeste. Crescimento. Localização. *Spillovers*.

Luzia Maria Cavalcante de Melo

- Doutoranda em Economia pelo Centro de Desenvolvimento e Planejamento Regional de Minas Gerais (Cedeplar) – Universidade Federal de Minas Gerais (UFMG).

Rodrigo Simões

- Professor do Cedeplar – UFMG.

1– INTRODUÇÃO

Ao olhar para o território brasileiro, uma das características mais marcantes que podem ser observadas é a distribuição desigual da atividade econômica no espaço. Mesmo com o forte crescimento e as mudanças na dinâmica econômica ocorridas nas últimas décadas nas regiões economicamente menos favorecidas, como as regiões Norte e Nordeste, a desigualdade econômica entre as macrorregiões ainda é fortemente evidente.

Dados das Contas Regionais do Instituto Brasileiro de Geografia e Estatística (IBGE) para o ano de 2006 mostram que a região Sudeste foi a responsável por 56,8% do Produto Interno Bruto (PIB) do Brasil, enquanto a região Nordeste foi responsável por 13,1% e a região Norte por apenas 5,1% do PIB do país. Apenas o Estado de São Paulo foi responsável por 33,9% do PIB nacional, percentual maior que o das regiões Norte, Nordeste e Centro-Oeste, que, juntas, correspondem a 26,9% do total do PIB.

A desigualdade espacial da atividade econômica pode ser observada não só entre as macrorregiões, mas também dentro das macrorregiões. Dentre as cinco macrorregiões brasileiras, a região Nordeste pode ser considerada o caso mais evidente de desigualdade econômica espacial. Nessa região, 60% da população vivem na faixa litorânea, onde são produzidos 80% do PIB. Todo o resto da região é ocupado por 40% da população e produz apenas 20% do PIB regional. (OLIVEIRA, 2011).

Até a década de 1960, enquanto as regiões Sudeste e Sul já haviam iniciado seu processo de industrialização, a economia nordestina ainda era predominantemente agroexportadora. A partir de então, investimentos e programas do setor público, além de investimentos também do setor privado, provocaram mudanças na dinâmica econômica da região, que passou de uma região predominantemente agroexportadora para uma região que já apresenta forte participação dos setores industrial e de serviços na composição do produto. (ARAÚJO, 2011).

Além de mudanças na configuração da atividade econômica, a região tem também apresentado, a

partir da década de 1960, permanentes taxas de crescimento, sendo essas taxas, em alguns períodos, até maiores que a média nacional de crescimento. Contudo, as mudanças estruturais e o crescimento econômico não foram suficientes para diminuir a desigualdade econômica intrarregional.

O conhecimento dos fatores que afetam o nível e o crescimento do produto de uma região é de suma importância para políticas de desenvolvimento econômico. A despeito dos muitos determinantes do produto encontrados na literatura, as desigualdades na distribuição da atividade produtiva no espaço têm chamado atenção para o componente espacial na determinação do produto das localidades. A localização das economias, bem como o desempenho econômico de seus vizinhos, tem sido um fator cada vez mais relevante na tentativa de se explicar o desempenho econômico de uma região.

Estudiosos da economia regional, como Myrdal (1957); Hirschman (1958); Lösch (1954); Christaller (1966) e Perroux (1967), já chamavam atenção para a distribuição e a concentração da atividade econômica no espaço, bem como para os determinantes e efeitos da localização dessas atividades. Mais recentemente, os trabalhos de Krugman (1991) e Fujita; Krugman e Venables (2002) retomam a discussão sobre a distribuição da atividade produtiva no espaço. Com uma abordagem matematicamente rigorosa, esse novo arcabouço teórico, denominado Nova Geografia Econômica, formaliza a existência de forças centrífugas e centrípetas que determinam a concentração e a dispersão da atividade econômica no espaço, bem como a extensão espacial dessas forças. Por extensão espacial dos determinantes da *performance* econômica de um determinado local entendem-se os efeitos de transbordamento de uma economia para outra, ou seja, os *spillovers* de localização. A existência de *spillovers* indica que o desempenho de uma economia pode ser condicionado, ao menos em partes, pela *performance* econômica das localidades vizinhas.

Observando o desempenho e a distribuição da atividade econômica na região Nordeste, percebe-se que, apesar das altas taxas de crescimento, nas últimas décadas e em especial nos últimos anos, a distribuição da atividade econômica nesse espaço

permanece fortemente concentrada. Isso pode ser uma indicação de que *spillovers* espaciais não atuam nesse espaço, ou atuam de forma a concentrar ainda mais a atividade produtiva. Assim, esse trabalho se propõe a investigar a existência de dependência espacial entre os municípios da região Nordeste, bem como a existência de *spillovers* espaciais sobre o crescimento do PIB *per capita* na região.

Este trabalho está dividido em quatro seções, além desta introdução. A próxima seção apresenta uma breve revisão das teorias da localização e uma análise do crescimento e da distribuição econômica da região em estudo: o Nordeste. A seção seguinte apresenta os aspectos metodológicos utilizados. A terceira seção apresenta e discute os resultados. Na última seção, são feitas as considerações finais.

2 – A DISTRIBUIÇÃO DA ATIVIDADE ECONÔMICA NO ESPAÇO

2.1 – Contribuições Teóricas

A desigualdade da distribuição da atividade econômica no espaço geográfico tem sido abordada desde a década de 1950 com as chamadas teorias da localização e do desenvolvimento desigual. Mais recentemente, o papel do espaço geográfico e sua influência no desempenho econômico das localidades têm ganhado destaque na teoria econômica através da chamada Nova Geografia Econômica (NGE), que formaliza o papel dos retornos crescentes de escala para o crescimento econômico e a distribuição da atividade econômica no espaço.

Segundo as teorias da localização, a dispersão geográfica de produtores indica a inexistência de interligações comerciais entre eles. Uma aglomeração de atividades produtivas surge em determinado lugar, em detrimento de outros, quando as economias de aglomeração (geradas devido à proximidade entre firmas e setores industriais) e os custos de transporte (inversamente proporcionais à distância percorrida até chegar ao consumidor) permitem que, estando naquele local, o produtor atinja a demanda de outras localidades a um menor preço. (LÖSCH, 1954).

As áreas de aglomeração produtiva constituem o que Christaller (1966) denominou Lugar Central. A

existência de lugares centrais e áreas de escala de produção inferior geram uma hierarquia urbana, de modo que lugares centrais de ordem superior serão centros de produção e consumo para lugares centrais de ordem inferior. Assim, uma região é constituída por uma rede urbana hierarquizada, que surge com o aumento dos fluxos de trocas entre vizinhos. Essa hierarquia de aglomerados econômicos indica uma desigualdade na distribuição da atividade econômica no espaço.

Segundo as teorias da Nova Geografia Econômica, a distribuição das atividades econômicas no espaço depende do resultado de forças contrárias. Existem forças centrípetas, que levam à aglomeração das atividades em um determinado espaço; e as forças centrífugas, que levam à dispersão das atividades entre os espaços. Assim, diferenças entre o crescimento de cidades implicam que forças centrípetas se sobrepõem às forças centrífugas. Estas forças responsáveis pela aglomeração das atividades podem ser observadas na produção, distribuição e comercialização dos bens e serviços, ou seja, podem ser observadas através de conexões para trás (*backward linkages*), que são as transações de uma empresa com seus fornecedores de insumos, e conexões para frente (*forward linkages*), que são as transações de uma empresa com seus consumidores. (FUJITA; KRUGMAN; VENABLES, 2002).

Apesar de essa abordagem ser recente, a existência de desigualdades econômicas espaciais como produto da atuação de forças contrárias já havia sido tratada anteriormente pelos teóricos do desenvolvimento desigual. (MYRDAL, 1960; HIRSCHMAN, 1961). Segundo eles, o surgimento e a reprodução da desigualdade econômica regional são produtos da atuação de forças contrárias, de atração e repulsão, sobre o capital. Quando essas forças atuam de forma desequilibrada, como é o caso de quando as forças de atração se sobrepõem às forças de repulsão, isso favorece uma região em detrimento da outra. A região favorecida concentra os fatores de produção e a atividade produtiva e, portanto, torna-se um centro econômico, enquanto as regiões menos favorecidas formam uma região periférica em torno da região central. Nesse jogo desequilibrado de forças de atração e repulsão, cria-se o que os autores chamam de dinâmica centro-periferia de distribuição da atividade

produtiva no espaço, dinâmica esta que é reproduzida por meio de um processo circular cumulativo.

A dinâmica centro-periferia é reproduzida devido aos retornos crescentes de escala gerados pela produção aglomerada no território. A aglomeração reforça a demanda por fatores, aumenta a produção e, portanto, aumenta também a demanda por bens intermediários e finais. Ainda que a dinâmica do centro seja expandida para as localidades periféricas, seu alcance se limita às localidades vizinhas, mantendo-se assim a separação entre o centro e a periferia numa dinâmica que essa teoria chama de dispersão concentrada.

Myrdal (1957) argumenta de forma mais específica que a relação centro-periferia é dada pela dinâmica de expansão do capital no espaço. Para Myrdal (1957), uma vez que ocorre a acumulação do capital, este amplia sua área de ocupação por meio de efeitos de transbordamento (*spillovers* espaciais) para as áreas vizinhas. Assim, regiões que eram periféricas são incorporadas por regiões centrais, e outras regiões que estavam fora da economia de mercado são inseridas no processo de acumulação do capital, tornando-se assim novas áreas periféricas. Com isso, o capital expande suas fronteiras de acumulação, criando novas áreas de atividade econômica, reproduzindo a dinâmica centro-periferia e tornando constante o processo de mudança territorial.

Contudo, devem existir alguns condicionantes periféricos para que haja investimentos nessas regiões e, portanto, para que os efeitos de transbordamento das regiões centrais atuem nessas áreas e estas sejam incorporadas às áreas centrais. Como as regiões periféricas são áreas subdesenvolvidas, tecnologicamente limitadas, e há mais incerteza nos mercados, torna-se necessário que o investimento nessas áreas seja induzido. O conceito de investimento induzido foi criado por Hirschman (1961) como uma forma alternativa ao conceito de investimento autônomo de Keynes (1988), levando em consideração os determinantes da decisão de investir em regiões periféricas. Para Hirschman (1961), existem dois mecanismos de investimento induzido, sendo os dois complementares. Um mecanismo se dá através da indução de setores-chave que complementassem a matriz produtiva do local. Outro seria o investimento do

setor público em infraestrutura física como uma forma de atrair a atividade do setor produtivo privado.

Assim, segundo os teóricos do desenvolvimento desigual, esses investimentos criam condições para a atuação dos efeitos de transbordamento e geração das externalidades positivas no território. Investimentos nas áreas periféricas subdesenvolvidas são fundamentais para induzir investimentos privados, estimular a expansão da fronteira de atuação do capital e promover o desenvolvimento regional.

Poucas são as evidências de *spillovers* espaciais de crescimento para o Brasil. Segundo Silveira Neto (2001), os estudos que consideram efeitos espaciais na dinâmica de crescimento de estados e municípios no Brasil são raros. Em seu trabalho, são mostradas evidências empíricas de presença significativa de *spillovers* espaciais de crescimento entre os estados brasileiros para o período de 1985-1997.

Buscando contribuir para a investigação sobre a existência de *spillovers* espaciais, as próximas seções deste trabalho se dedicam a buscar evidências empíricas deste fenômeno em um dos recortes regionais que mais apresentam desigualdade na distribuição das atividades econômicas, bem como nas taxas de crescimento: o Nordeste.

2.2 – A Desigualdade Econômica Regional no Nordeste

A desigualdade econômica regional no Brasil tem sido uma marca permanente. Um fator determinante para essa desigualdade foi o processo de industrialização, que se deu de forma desigual no espaço, mais especificamente, de forma desigual entre as macrorregiões. Por diversas razões históricas, o processo de industrialização no país se concentrou na região Sudeste, em detrimento das regiões Norte e Nordeste. Além da desigualdade econômica entre as macrorregiões, é fato também a desigualdade intrarregional. A região Nordeste é um caso evidente deste fato.

Até a década de 1960, enquanto o setor industrial já impulsionava o crescimento econômico na região Sudeste, na região Nordeste, ainda prevalecia o setor primário-exportador, que já dava sinais de incapacidade

para impulsionar o crescimento e desenvolvimento da região. A partir de então, investimentos públicos – criação da Superintendência do Desenvolvimento do Nordeste (Sudene), em 1959, os incentivos fiscais do Fundo de Investimento no Nordeste (Finor), os investimentos da Petrobras (na Bahia) e da Vale do Rio Doce (no Maranhão), a disponibilidade de créditos públicos através do Banco Nacional de Desenvolvimento (BNDES) e do Banco do Nordeste do Brasil (BNB) – e os recursos próprios de importantes empresas locais, nacionais e multinacionais deram início ao processo de reversão do fraco dinamismo da economia nordestina. (ARAÚJO, 2011).

Atividades urbanas e industriais começaram a ganhar espaço na economia da região e passaram a comandar o crescimento econômico. De tradicional região produtora de bens de consumo não-duráveis (têxtil e alimentar, principalmente), o Nordeste vai-se transformando, nos anos pós-60, numa região industrial mais especializada em bens intermediários. Ao longo das últimas décadas, a atividade econômica na região acompanhou as oscilações cíclicas vivenciadas pelo país. Na década de 1970, durante o período do “milagre econômico”, o PIB da região apresentou altas taxas de crescimento, acompanhando a tendência nacional, contudo a uma taxa menor que a média nacional. No entanto, quando a economia nacional desacelerou seu ritmo de crescimento após o primeiro choque do petróleo, a economia nordestina continuava a crescer a taxas semelhantes à do período anterior. Na década de 1980, quando o desempenho econômico nacional declinou ainda mais, o Nordeste começou a apresentar taxas de crescimento menores, porém maiores que a média nacional. As taxas de crescimento da região diminuíram ainda mais durante a década de 1990, acompanhando o mesmo patamar do desempenho da média nacional. (ARAÚJO, 2011).

Entre fases de expansão e contração econômica, no período que vai da década de 1960 até a atual, a economia na região Nordeste cresceu, em média, mais que a média nacional e atingiu uma nova configuração. Atualmente, a economia da região Nordeste é impulsionada pelo setor privado e pelas atividades do setor de turismo. Contudo, a participação dos investimentos do setor público continua sendo fundamental para o desenvolvimento

dessa região. Exemplo disso é dado pela forte entrada de recursos federais, nos últimos anos, sob a forma de transferências diretas de renda e programas de incentivo à produção como Programa Nacional de Fortalecimento da Agricultura Familiar (Pronaf) e Microcrédito. (OLIVEIRA, 2011).

No entanto, mesmo apresentando altas taxas de crescimento e aumento da diversidade do setor produtivo, a região Nordeste continua num patamar economicamente inferior em relação às regiões Sudeste e Sul do país. O aumento do dinamismo nas últimas décadas também não foi suficiente para mudar o quadro de desigualdade intrarregional.

Como coloca Araújo (2011),

ao mesmo tempo em que diversos subespaços do Nordeste desenvolvem atividades modernas, em outras áreas a resistência à mudança permanece sendo a marca principal do ambiente socioeconômico: as zonas cacauceiras, canaveiras e o sertão semiárido são as principais e históricas áreas desse tipo. Quando ocorre, a modernização é restrita, seletiva, o que ajuda a manter um padrão predominantemente tradicional.

Assim, o Nordeste se mantém uma região com forte disparidade na distribuição da atividade produtiva.

Pela desigualdade que se pode observar até os dias atuais, apesar do aumento do dinamismo econômico e das altas taxas de crescimento, o capital parece não conseguir expandir sua área de atuação nessa região. Os efeitos de transbordamento gerados pelo crescimento ou não estão sendo transmitidos para as localidades vizinhas e, assim, não há uma inserção das regiões periféricas nas regiões centrais; ou então estão polarizando ainda mais as regiões centrais e reproduzindo o mesmo perfil centro-periferia desde sempre existente. As próximas seções desse trabalho investigam a existência de dependência espacial entre os municípios da região Nordeste, bem como a existência de *spillovers* espaciais sobre o crescimento do PIB *per capita* na região.

2.3 – Aspectos Metodológicos: Fonte de Dados, Matriz de Vizinhança e Modelo Estimado

A principal fonte de dados para esse trabalho foi a base PIB dos municípios do IBGE para os anos de

2000 e 2006, de onde foram obtidos o PIB *per capita* das 166 capitais de microrregiões nordestinas que compõem a amostra utilizada para esta análise. Para que se possam observar os efeitos de transbordamento entre as localidades, foi estabelecido um critério de proximidade para determinação dos vizinhos. Nos trabalhos empíricos que envolvem a influência espacial, esse critério de proximidade é determinado a partir de uma matriz *W* de pesos espaciais. Aqui, será adotada uma matriz que usa como critério de vizinhança a distância entre os municípios por tempo de viagem.

É comum a construção de matriz de pesos em trabalhos de econometria espacial usando distâncias geodésicas ou euclidianas. Contudo, no Brasil, e especialmente na região Nordeste, a malha rodoviária se distribui de forma desigual, sendo que vários trechos são constituídos por estradas em condições precárias. A heterogeneidade das condições viárias de acesso entre as localidades muda a relação de vizinhança entre si. Por exemplo, considerando que a distância entre o município A e o município B seja de 100km, e que a distância entre o município B e o município C seja também de 100km, pode-se dizer que as distâncias euclidianas de A para B e de B para C são iguais. Porém, se de A para B a rodovia de acesso tiver boas condições e de B para C a rodovia de acesso tiver condições precárias, as condições de acessibilidade e, conseqüentemente, de relações econômicas podem ser diferentes. Sendo assim, optou-se, nesse trabalho, por construir uma matriz de vizinhança usando o tempo de deslocamento entre os municípios.

Foi estabelecida, como critério de vizinhança, a distância de no máximo duas horas de viagem entre os municípios, ou seja, são considerados como vizinhos aqueles municípios cujo tempo de deslocamento de um para o outro é de até duas horas. A base de dados das distâncias por tempo de deslocamento utilizadas neste trabalho foi obtida do Estudo da Dimensão Territorial para o Planejamento. (BRASIL, 2011). Esta base foi elaborada pela empresa Mapalink, sendo calculado o tempo de deslocamento entre as capitais das microrregiões a partir das distâncias entre si, as condições das rodovias que as conectam e a velocidade média permitida em cada tipo de estrada.

Tabela 1 – Tipos de Vias e Velocidades para o Cálculo do Tempo de Viagem entre as Capitais das Microrregiões

Tipo	Velocidade
Pista Duplicada	100 km/h
Pista em Duplicação	90 Km/h
Pista Simples	80 Km/h
Pista Simples em Pavimentação e/ou em Obras	70 Km/h
Pista com Leito Natural (Terra)	40 Km/h
Pista em Mau Estado de Conservação	60 Km/h
Balsa (Hidrovia)	15 Km/h

Fonte: Brasil (2011).

A Tabela 1 mostra os tipos de vias e suas respectivas velocidades, consideradas para o cálculo do tempo de deslocamento entre as capitais das microrregiões.

Usando esse critério de distância, a matriz de pesos *W* é especificada seguindo Fingleton (2011). Contudo, aqui, a distância máxima de 1.000 milhas utilizada pelo autor será substituída pelo tempo de viagem, de um município a outro, de até 120 minutos, o que, para efeito desse estudo, é tomado como a distância máxima apropriada para se considerar um município como vizinho de outro. Assim, tem-se uma matriz de pesos com a seguinte especificação:

$$W_{ij} = \left(1 - \frac{d_{ij}}{120}\right)^2 \text{ se } d_{ij} \leq 120$$

$$W_{ij} = 0 \text{ se } d_{ij} > 120 \text{ ou } i = j \quad (1)$$

Onde, *i* e *j* representam os municípios que são capitais das microrregiões nordestinas.¹

Pelo critério de vizinhança estabelecido, dentre as capitais das microrregiões nordestinas, 21 não possuem vizinhos,² as quais foram excluídas

¹ Este trabalho considera apenas os municípios que são capitais das microrregiões devido as informações sobre o tempo de viagem só estarem disponíveis para estes municípios.

² Os municípios retirados da amostra foram: Barreirinhas, Carolina,

da amostra. Ficando com uma amostra de 166 municípios, temos uma matriz de pesos W constituída por 27.556 elementos.

A existência de dependência espacial é identificada por instrumentos como o Moran *scatterplot* e o cálculo do coeficiente de correlação espacial, Moran's I. O Moran *scatterplot* é uma ferramenta de visualização da autocorrelação espacial entre o valor de uma variável em um local e os valores dos seus vizinhos (*lags* espaciais). É uma regressão de Wy em y , onde y é a variável em questão e Wy é o conjunto de elementos de defasagem espacial para a variável y de acordo com o critério de vizinhança estabelecido para constituição da matriz de pesos W .

Quando y_i (valor da variável y para o local i) e Wy são similares, o Moran *scatterplot* mostra uma autocorrelação positiva, que indica um padrão de distribuição espacial alto-alto ou baixo-baixo, ou seja, valores altos cercados por valores altos e vice-versa. Quando y_i e Wy são dissimilares, o Moran *scatterplot* mostra uma autocorrelação negativa, que indica a existência de um padrão de distribuição espacial da variável alto-baixo ou baixo-alto, ou seja, locais com valor alto para a variável cercados por locais com valores baixos ou, locais com valor baixo cercado por locais com valores altos.

A estatística I de Moran é um teste para significância da autocorrelação espacial, ou seja, testar a significância do padrão mostrado no Moran *scatterplot*. Essa estatística é definida como:

$$I = \frac{n}{\sum \sum w_{ij}} \frac{\sum \sum w_{ij} (y_i - \bar{y})(y_j - \bar{y})}{\sum (y_j - \bar{y})^2} \quad (2)$$

Onde n é o número de unidades geográficas, w_{ij} são os elementos da matriz W e y a variável em

Chapadinha, Imperatriz, Santa Luzia e Turiçu; todos pertencentes ao Estado do Maranhão; Bom Jesus, Corrente e Uruçui; pertencentes ao Estado do Piauí; Araripina (Pernambuco); Barreiras, Ilhéus, Irecê, Itaberaba, Jacobina, Jequié, Macaúbas, Santa Rita de Cássia, Seabra, Teixeira de Freitas e Xique-Xique, todos no Estado da Bahia. Estes municípios foram retirados da amostra por não possuírem vizinhos de acordo com o critério de proximidade adotado nesse trabalho. As razões pelas quais esses municípios não possuem vizinhos por esse critério, sejam elas más condições das rodovias ou puramente distância rodoviária, não são investigados nesse trabalho.

questão, que, no caso desse trabalho, é a taxa de crescimento do PIB *per capita*, no período 2000-2006, dos 166 municípios nordestinos, capitais de microrregiões, que possuem vizinhos de acordo com o critério estabelecido aqui para a elaboração da matriz de pesos espaciais.

Para estimar a presença de *spillovers* espaciais na taxa de crescimento do PIB *per capita* desses municípios, esse trabalho segue o modelo adotado por Silveira Neto (2001), onde se busca explicar as taxas de crescimento das localidades a partir da relação com as taxas de crescimento dos vizinhos, de acordo com o critério de vizinhança assumido, e não através da estimação direta de modelos com tradicionais variáveis de determinação do crescimento. Segundo Silveira Neto (2001), isso se justifica pelo interesse de se verificarem os efeitos da relação espacial sobre o crescimento do produto e, também, pelo fato de as próprias variáveis explicativas do crescimento possuírem influências derivadas da localização ou serem os próprios veículos de interação espacial.

Considerando então a variável de interesse neste trabalho, a taxa de crescimento do PIB *per capita*, representada por y , o modelo que permite estimar a presença de *spillovers* de crescimento entre as unidades geográficas da amostra anteriormente especificada é:

$$y_i = \rho \sum_{j=1}^n w_{ij} y_j + \varepsilon_i, i = 1, \dots, n; \quad \text{ou} \quad (3)$$

$$y = \rho Wy + E \quad (4)$$

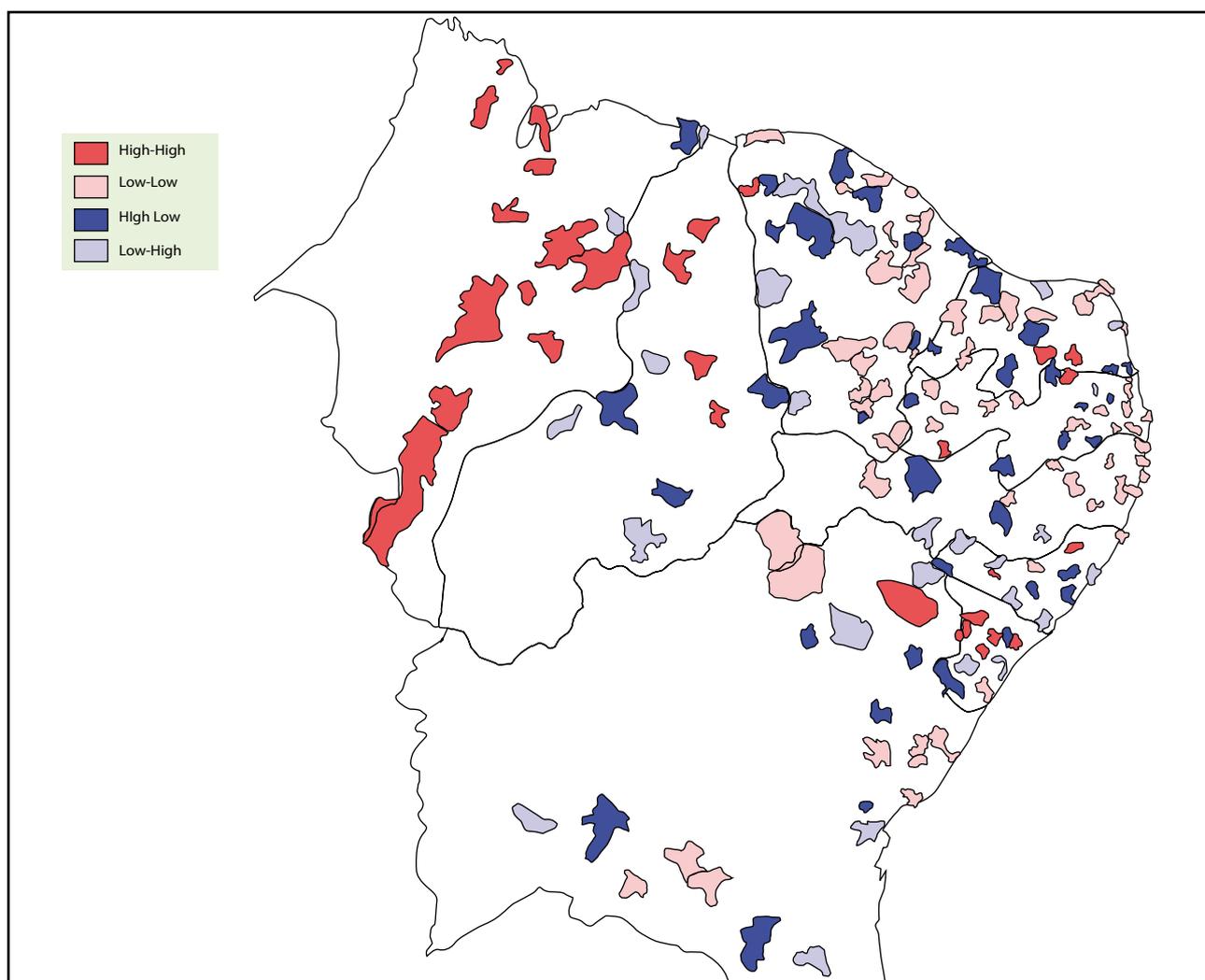
Onde w_{ij} são os elementos da matriz W , y_i a taxa de crescimento do PIB *per capita* do município i , y_j a média da taxa de crescimento do PIB *per capita* dos vizinhos do município i , e $E \sim N(0, I_s^2)$. Esse modelo explicita a dependência da taxa de crescimento dos municípios em relação às taxas de crescimento dos municípios vizinhos de acordo com o critério de vizinhança assumido. Apesar de não identificar os canais pelos quais estão-se manifestando os efeitos espaciais nas economias, esse modelo permite, em primeira instância, obter evidências sobre esses efeitos. (SILVEIRA NETO, 2001).

4 – RESULTADOS E INFERÊNCIAS

4.1 – Análise Exploratória

Nesta subseção, é apresentada uma análise exploratória dos dados, mais especificamente dos dados para a variável taxa de crescimento do PIB *per capita* para os municípios que constituem as capitais das microrregiões do Nordeste e possuem vizinhos de acordo com o critério adotado neste trabalho e especificado na seção anterior. Além disso, apresentam-se e discutem-se os resultados para a estatística I de Moran. Os Mapas 1, 2 e 4 apresentam o padrão de distribuição espacial, bem como sua significância.

Como mostra a Mapa 1, não há uma clara segregação na distribuição espacial das taxa de crescimento do PIB *per capita* entre as unidades geográficas de análise. Com exceção do Estado do Maranhão, onde predomina o padrão em que municípios com altas taxas de crescimento do PIB *per capita* estão cercados por municípios que também possuem altos valores para essa variável (padrão alto-alto), o restante da região possui predominantemente um padrão de municípios de baixas taxas de crescimento rodeados por municípios que também possuem baixas de crescimento (baixo-baixo) ou municípios com alta taxa de crescimento com um



Mapa 1 – Moran Scatterplot: Taxa de Crescimento das Capitais das Microrregiões Nordestinas – 2000-2006

Fonte: Elaboração Própria dos Autores a partir de Dados do PIB *Per Capita* do IBGE, para os Anos de 2000 e 2006, com a Utilização do Programa ArcView.

entorno que apresenta baixo crescimento (alto-baixo), os chamados *outliers* espaciais.

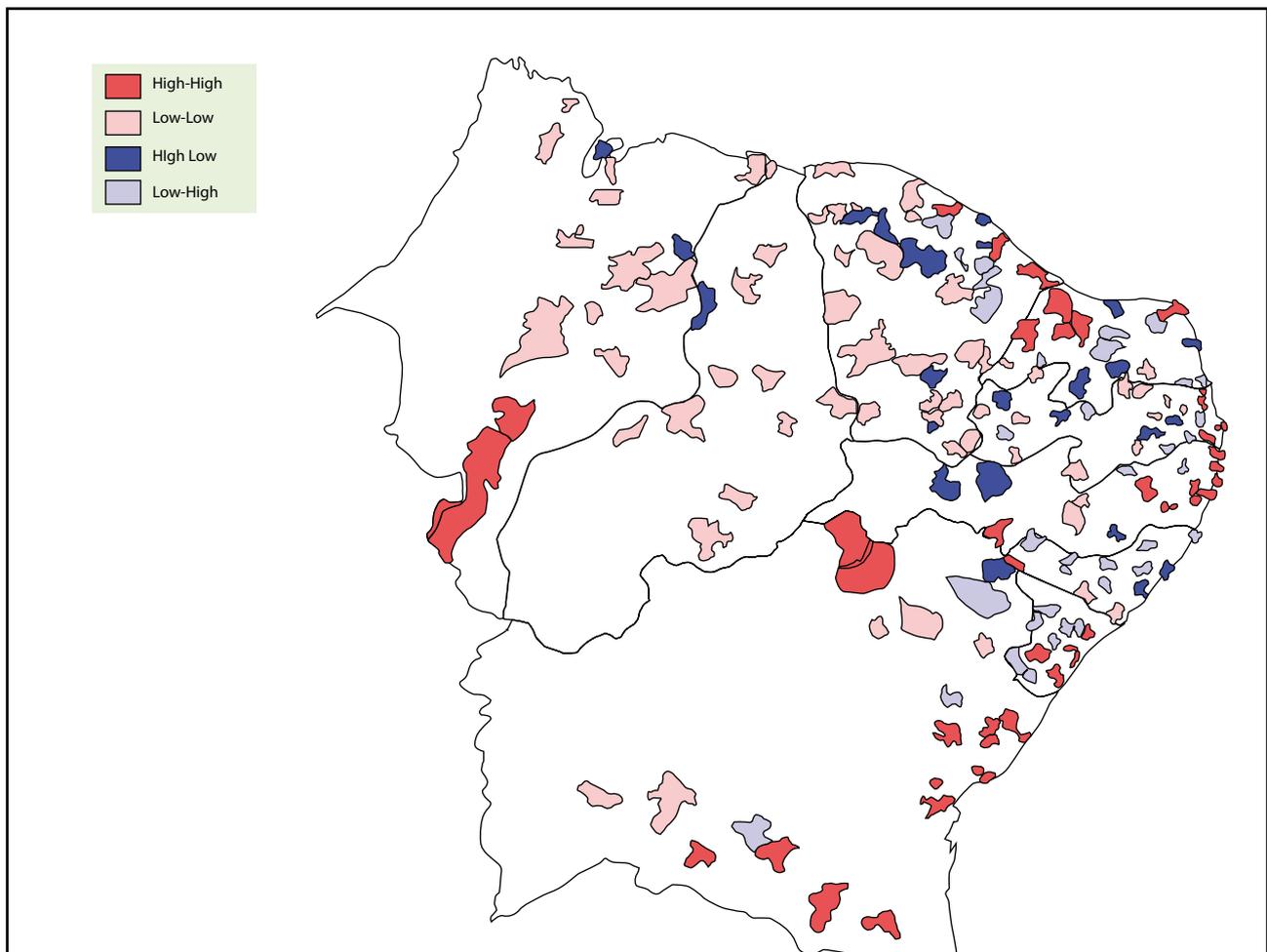
O Mapa 3 mostra o padrão de distribuição espacial do PIB *per capita* para os municípios da amostra no ano de 2006. Como se pode observar, o padrão de distribuição espacial dessa variável é bem diferente do observado para as taxas de crescimento do PIB *per capita*.

Comparando o Mapa 1 com o Mapa 2, pode-se observar que o padrão de distribuição espacial praticamente se reverte, especialmente para os Estados do Maranhão e Piauí, Sertão do Estado do Ceará e toda a faixa litorânea. Ou seja, no período entre os anos de 2000 e 2006, grande parte dos municípios de alta

renda foram os que apresentaram as menores taxas de crescimento, enquanto os municípios de baixa renda foram os que mais cresceram.

O Gráfico 1 mostra a representação gráfica do Moran *Scatterplot*. A reta do gráfico equivale à estatística I de Moran para a variável taxa de crescimento do PIB *per capita* no período 2000-2006. Essa estatística mede a dependência espacial nessa variável, ponderada pela matriz de distância por tempo de deslocamento entre os municípios vizinhos.

O Moran *Scatterplot* é dividido em quatro quadrantes correspondentes aos quatro tipos de associação espacial local entre unidades geográficas e seus vizinhos. No quadrante I, são exibidas as



Mapa 2 – Moran Scatterplot: Produto Interno Bruto das Capitais das Microrregiões Nordestinas no ano de 2006

Fonte: Elaboração Própria a partir de Dados do PIB *Per Capita* do IBGE, para o ano de 2006, com a Utilização do Programa ArcView.

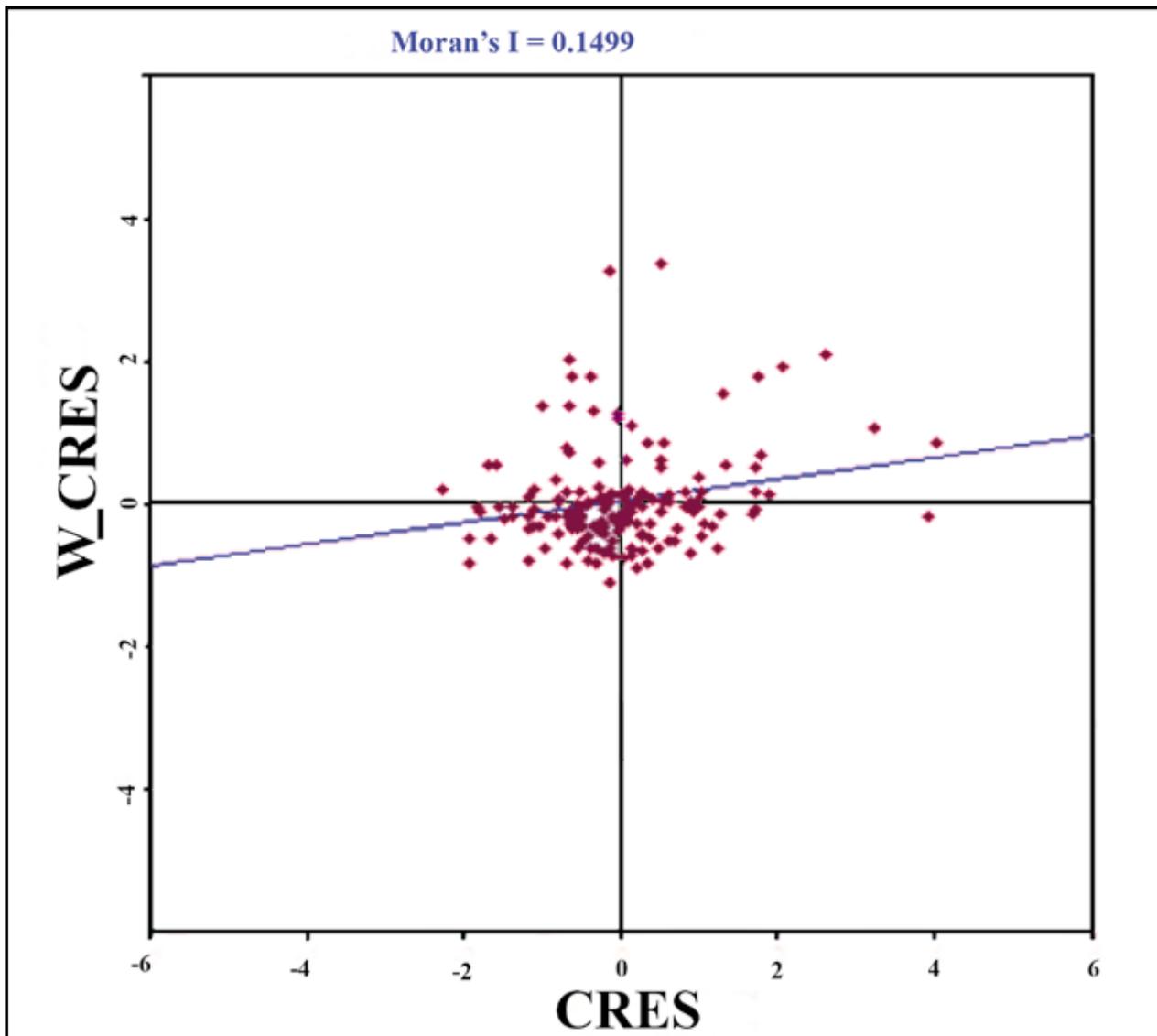


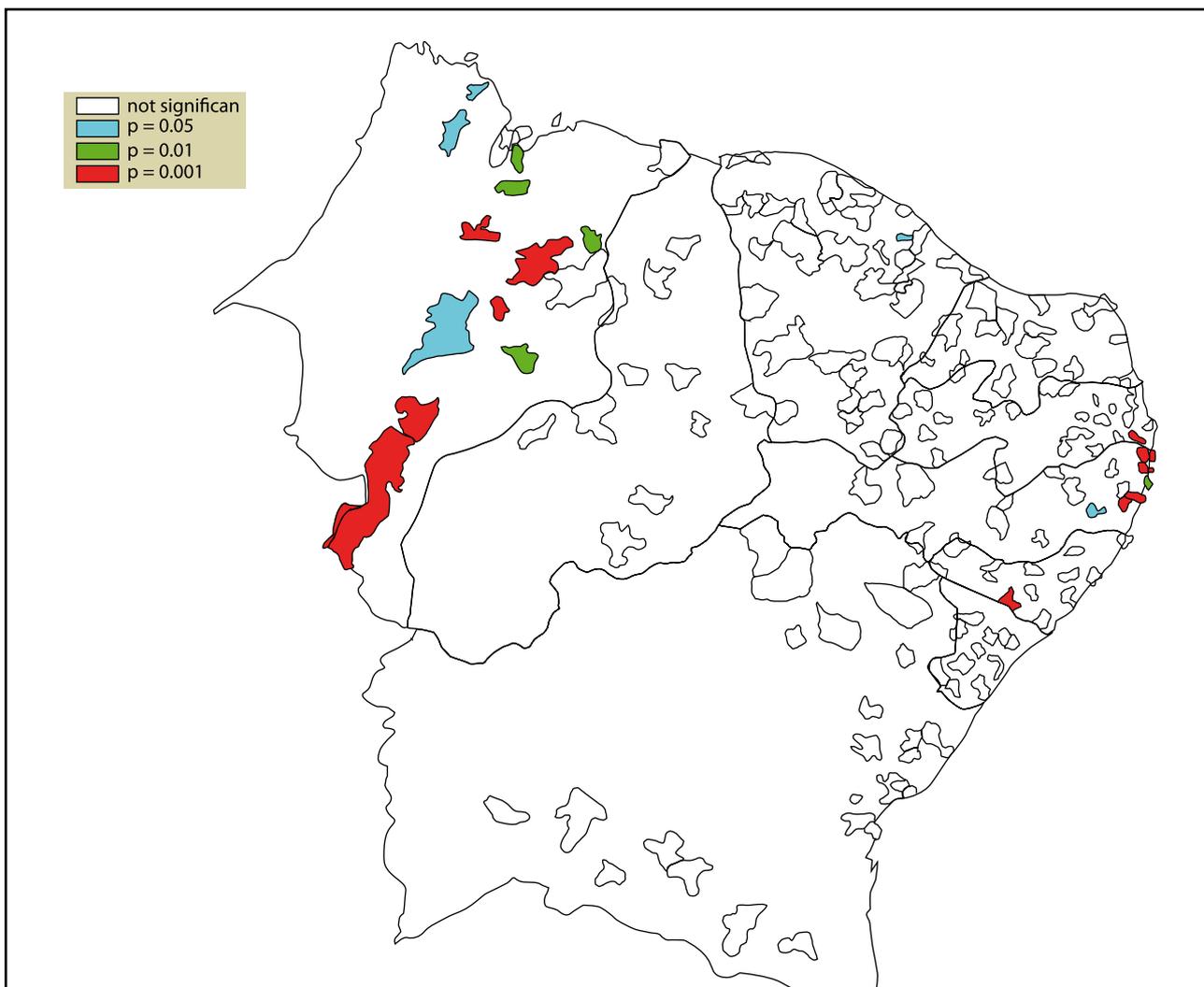
Gráfico 1 – Moran Scatterplot da Taxa de Crescimento do PIB Per Capita no período 2000-2006

Fonte: Elaboração Própria a partir de Dados do PIB Per Capita do IBGE, para os Anos de 2000 e 2006, com a Utilização do Programa ArcView.

unidades geográficas que possuem alto valor para a variável em questão (acima da média) cercada por unidades geográficas que também possuem alto valor para a variável (padrão alto-alto). No quadrante II, são exibidas as unidades geográficas que possuem baixos valores para a variável em questão e que estão cercadas por unidades geográficas que possuem altos valores para essa variável (baixo-alto). O quadrante III exibe o mesmo padrão de associação espacial positivo mostrado no quadrante I, porém para unidades

geográficas com baixos valores para a variável (baixo-baixo). O quadrante IV exibe as unidades geográficas que possuem altos valores para determinada variável e que estão cercadas por locais de baixos valores (alto-baixo).

As unidades geográficas localizadas nos quadrantes I e III possuem autocorrelação espacial positiva, ou seja, aglomeração espacial de locais que possuem variáveis com valores similares; já os quadrantes II e IV representam autocorrelação espacial negativa,



Mapa 3 – LISA: Taxa de Crescimento do PIB *Per Capita* das Capitais de Microrregiões Nordestinas – 2000-2006

Fonte: Elaboração Própria a partir de Dados do PIB *Per Capita* do IBGE, para os Anos de 2000 e 2006, com a Utilização do Programa ArcView.

ou seja, aglomerações espaciais de locais que possuem variáveis com valores diferentes. Como pode ser observado no Gráfico 1, há predominância de municípios nos quadrantes III e IV, ou seja, há um padrão predominante de distribuição espacial baixo-baixo e alto-baixo.

O Moran *Scatterplot* é muito utilizado para calcular a autocorrelação espacial global entre os dados de uma variável. Contudo, ele não explicita a estrutura de correlação espacial em nível local, ou seja, ele não informa quais aglomerações são significativas nem quais são as observações que possuem maior influência sobre o indicador global. Para tal, usa-se

o mapa de significância da estatística I de Moran, também denominado *Local Indicator of Spatial Association* (LISA). O Mapa 3 apresenta significância do I de Moran local para a taxa de crescimento do PIB *per capita*, no período de 2000-2006, nas 166 capitais de microrregiões nordestinas incluídas na amostra.

O resultado mostrado no mapa aponta para significativa dependência espacial na taxa de crescimento do PIB *per capita* para apenas alguns poucos municípios nordestinos. A subseção seguinte estima o modelo de regressão espacial que busca identificar a presença de *spillovers* espaciais nas taxas de crescimento entre esses municípios.

4.2 – *Spillovers* de Crescimento: Evidências a partir do Modelo de Econometria Espacial

O objetivo desta subseção é fornecer evidências da existência e medida de *spillovers* espaciais entre os municípios que compõem a amostra da análise. O modelo estimado segue os modelos (3) e (4) apresentados na seção 2. A Tabela 1 mostra os resultados referentes às estimativas. O modelo 1 é referente à estimativa da presença de *spillovers* espaciais nas taxas de crescimento do PIB *per capita* no período 2000-2006 entre as capitais de microrregiões nordestinas, e o modelo 2 é referente à estimativa da presença de *spillovers* espaciais na variável PIB *per capita* no ano de 2006, para a mesma amostra.

Tabela 2 – Resultados das Regressões de *Spillovers* Brutos para o crescimento do PIB Per Capita no Período 2000-2006 e para o PIB Per Capita em 2006 nas Capitais de Microrregiões Nordestinas

	Modelo 01	Modelo 2
Constante	-14.10825 (0,000)	10.08648 (0,000)
ρ	-0.04687341 (0,502)	-0.1035677 (0,153)
σ	3.92619	0.493866
R ²	0.201639	0.091953

Fonte: Elaboração Própria dos Autores.

p-value entre parênteses. σ é o desvio-padrão dos resíduos da regressão.

Os parâmetros estimados para os modelos 1 e 2 são insignificantes; isso quer dizer que tanto as taxas de crescimento do PIB *per capita* no período 2000-2006 como o PIB *per capita* para o ano de 2006 não são afetados pelo crescimento e pelo nível do produto, respectivamente, dos seus vizinhos. Ou seja, não há presença de *spillovers* espaciais nas taxas de crescimento e no nível do PIB *per capita* entre os municípios presentes na amostra.

Esses resultados mostram que, apesar de esses municípios terem apresentado altas taxas de crescimento no período, o crescimento de um município não afeta o crescimento do seu vizinho, ou

seja, essas localidades são economicamente pouco integradas. Ou ainda, o processo de crescimento não tem feito com que o capital amplie sua área de ocupação por meio de efeitos de transbordamento.

Isso também é evidenciado pelos Mapas 1 e 2. Comparando-se aqueles dois mapas, é possível notar que os municípios que apresentaram maiores taxas de crescimento são os municípios de menor PIB. Contudo, ao se observar a distribuição do PIB na região, percebe-se que, apesar de terem apresentado altas taxas de crescimento, esses municípios ainda constituem as localidades de menor PIB, enquanto os municípios que apresentaram taxas de crescimento menores permanecem com os níveis mais altos de produto. Ou seja, o crescimento observado nos últimos anos não foi suficiente para reduzir a disparidade na distribuição da atividade produtiva na região.

Essa ausência de relação espacial entre as localidades analisadas aponta para ausência dos chamados *backward linkages* e *forward linkages*, ou pode estar indicando que as forças de atração e repulsão econômicas permanecem inalteradas. O fato de o crescimento dos municípios não afetar o crescimento dos seus vizinhos, ou seja, a ausência de efeitos de transbordamento, sugere um aprofundamento sobre a questão dos determinantes do crescimento nessas localidades e sobre o porquê de esses determinantes não agirem como canais de transmissão do crescimento entre os municípios vizinhos.

Uma hipótese que parece ser plausível para explicar a ausência de efeitos de espacialidade entre esses municípios pode ser o fato de o crescimento estar relacionado a estímulos ao mercado interno, como transferências governamentais de renda, ou o crescimento desses municípios pode estar relacionado com economias externas à região de vizinhança. A determinação da estrutura de relação espacial, ou seja, a definição da matriz de pesos W também pode mudar os efeitos de espacialidade entre estas localidades. Assim, as evidências de ausência de *spillovers* espaciais contidas neste trabalho não esgotam a discussão sobre este fenômeno na região de análise.

5 – CONSIDERAÇÕES FINAIS

Esse trabalho investigou a existência de dependência espacial entre as capitais das microrregiões do Nordeste, bem como a existência de *spillovers* espaciais sobre o crescimento do PIB *per capita*, no período 2000-2006, entre estes municípios. Para obter os resultados, foram utilizadas técnicas de econometria espacial e estabelecido um critério de vizinhança, em que foram considerados como vizinhos os municípios cujo tempo de deslocamento de um para o outro é até duas horas. Com isso, a amostra de análise contou com 166 capitais de microrregiões nordestinas.

Estatísticas mostram que o Nordeste tem apresentado constantes taxas positivas de crescimento, sendo, em alguns períodos, até mesmo maior que a média nacional. Contudo, observa-se que a desigualdade na distribuição da atividade econômica não apresentou consideráveis mudanças. Ou seja, ainda que tenha ocorrido crescimento econômico, o capital parece não ter expandido sua área de ocupação e alterado a dinâmica centro-periferia existente na região.

Segundo teóricos do desenvolvimento desigual, o capital amplia sua área de ocupação por meio de efeitos de transbordamento (*spillovers* espaciais) para as áreas vizinhas. Com isso, regiões periféricas são incorporadas por regiões centrais, e outras regiões que estavam fora da economia de mercado são inseridas no processo de acumulação do capital, tornando-se assim novas áreas periféricas. O resultado encontrado através da estimativa de modelo de regressão de *spillovers* espaciais brutos mostra que este fenômeno não ocorre entre os municípios presentes que compõem a amostra da análise, dentro do critério de vizinhança adotado. Ou seja, não há *spillovers* de crescimento entre as localidades analisadas e, assim, o crescimento de um município não afeta o desempenho econômico dos seus vizinhos e vice-versa.

Entretanto, estes resultados não esgotam as inferências sobre os fatores relacionados ao processo de crescimento econômico na região, inclusive sobre a existência de efeitos de transbordamentos espaciais e os possíveis canais de transmissão pelos quais esses efeitos se manifestam. A inclusão, na amostra, da

região como um todo e/ou a mudança no critério de vizinhança podem vir a revelar diferentes resultados, permitindo uma investigação mais aprofundada da dinâmica de crescimento e distribuição da atividade econômica naquele espaço.

ABSTRACT

The paper verifies if exists a spatial dependence among the main cities of the micro-regions of the Brazilian Northeast as well as for the existence of spatial spillovers on the growth rate of PIB per capita among these cities in the period between 2000- 2006. For this, a spatial econometric model was estimated using a matrix of spatial weights considered the cities as neighbors, which deslocation time between them takes up to 2 hours. This generated a sample of 166 geographical units of analysis. The results show that, in the period analyzed, the economic development of the micro regions in Northeast was not affected by the development of their neighbors, that is to say, there was no location spillovers between municipalities presented in the sample.

KEY WORDS

Northeast. Growth. Location. Spillovers.

REFERÊNCIAS

ARAUJO, T. B. **Nordeste, Nordeste:** que Nordeste?. Recife: Fundaj, 2002. Disponível em: <<http://www.fundaj.gov.br/observanordeste/obte013.doc>>. Acesso em: 8 jan. 2011.

BRASIL. Ministério do Planejamento, Orçamento e Gestão. **Estudo da dimensão territorial para o planejamento.** Brasília, DF, 2006. V. 3: Regiões de referência. Disponível em: <<http://www.cgee.org.br/busca/ConsultaProdutoNcomTopo.php?f=1&idProduto=3507>>. Acesso em: 12 jan. 2011.

CHRISTALLER, W. **Central places in Southern Germany.** New Jersey: Prentice-Hall, 1966.

FINGLETON, B. A. **Competing models of global**

dynamics: evidence from panel models with spatially correlated error components. Channel Islands: RSAI, 2006. Disponível em: <<http://econpapers.repec.org/article/eeeecmode/>>. Acesso em: 8 jan. 2011.

FUJITA, M.; KRUGMAN, P; VENABLES, A. J.
Economia espacial. São Paulo: Futura, 2002.

HIRSCHMAN, A. **The strategy of economic development.** New Haven: Yale University, 1961.

KEYNES, J. M. **A teoria geral do emprego, do juro e da moeda.** São Paulo: Nova Cultural, 1988.

KRUGMAN, P. **Geography and trade.** Cambridge: MIT, 1991.

LÖSCH, A. **The economics of location.** New Haven: Yale UP, 1954.

MYRDAL, G. **Economic theory and under-developed regions.** London: Duckworth, 1957.

OLIVEIRA, C. P. C. **Nordeste:** sinais de um novo padrão de crescimento: 2000/2008. Salvador: Anpec, 2008. Disponível em: <<http://www.anpec.org.br/encontro2008/artigos/200807211223330-.pdf>>. Acesso em: 8 jan. 2011.

PERROUX, F. **A economia do século XX.** Porto: Herder, 1967.

SILVEIRA NETO, R. Crescimento e spillovers: a localização importa?: evidências para os estados brasileiros, **Revista Econômica do Nordeste**, Fortaleza, v. 32, p. 524-545, nov. 2001. Número especial.

Recebido para publicação em 07.12.2009.

APÊNDICE

Municípios Incluídos na Análise (principais municípios de cada microrregião)					
Município	UF	Município	UF	Município	UF
Araioses	MA	Iguatu	CE	Upanema	RN
Bacabal	MA	Ipu	CE	Alagoa Grande	PB
Balsas	MA	Itapajé	CE	Aroeiras	PB
Barra do Corda	MA	Itapipoca	CE	Boqueirão	PB
Caxias	MA	Jaguaribe	CE	Cajazeiras	PB
Codó	MA	Juazeiro do Norte	CE	Campina Grande	PB
Coelho Neto	MA	Lavras da Mangabeira	CE	Catolé do Rocha	PB
Colinas	MA	Mauriti	CE	Coremas	PB
Cururupu	MA	Meruoca	CE	Cuité	PB
Itapecurumirim	MA	Morada Nova	CE	Esperança	PB
Pinheiro	MA	Ocara	CE	Guarabira	PB
Presidente Dutra	MA	Pacajus	CE	Itabaiana	PB
Rosário	MA	Pentecoste	CE	Itaporanga	PB
São Luís	MA	Pereiro	CE	João Pessoa	PB
São Raimundo das Mangabeiras	MA	Quixadá	CE	Mamanguape	PB
Campo Maior	PI	Santa Quitéria	CE	Monteiro	PB
Floriano	PI	São Gonçalo do Amarante	CE	Patos	PB
Landri Sales	PI	Sobral	CE	Pedras de Fogo	PB
Parnaíba	PI	Tauá	CE	Picuí	PB
Picos	PI	Tianguá	CE	Princesa Isabel	PB
Pio IX	PI	Várzea Alegre	CE	Santa Luzia	PB
Piripiri	PI	Açu	RN	Sapé	PB
Regeneração	PI	Angicos	RN	Solânea	PB
São João do Piauí	PI	Apodi	RN	Sousa	PB
São Raimundo Nonato	PI	Caicó	RN	Araripina	PE
Teresina	PI	Canguaretama	RN	Arcoverde	PE
Valença do Piauí	PI	Currais Novos	RN	Bonito	PE
Acopiara	CE	João Câmara	RN	Buíque	PE
Aracati	CE	Macau	RN	Cabo de Santo Agostinho	PE
Baturité	CE	Mossoró	RN	Caruaru	PE
Brejo Santo	CE	Natal	RN	Escada	PE
Camocim	CE	Nova Cruz	RN	Garanhuns	PE
Campos Sales	CE	Patu	RN	Goiana	PE
Canindé	CE	Pau dos Ferros	RN	Igaráçu	PE
Caririáçu	CE	Santa Cruz	RN	Limoeiro	PE
Cascavel	CE	Santana do Matos	RN	Petrolândia	PE
Coreaú	CE	São Gonçalo do Amarante	RN	Petrolina	PE
Crateús	CE	São Miguel	RN	Recife	PE
Fortaleza	CE	Touros	RN	Salgueiro	PE

Continua

Municípios Incluídos na Análise (principais municípios de cada microrregião)					
Município	UF	Município	UF	Município	UF
Santa Cruz do Capibaribe	PE	Capela	SE	Feira de Santana	BA
Serra Talhada	PE	Carira	SE	Guanambi	BA
Vitória de Santo Antão	PE	Estância	SE	Itapetinga	BA
Arapiraca	AL	Itabaiana	SE	Jeremoabo	BA
Atalaia	AL	Itabaianinha	SE	Juazeiro	BA
Delmiro Gouveia	AL	Japarutuba	SE	Livramento de Nossa Senhora	BA
Maceió	AL	Lagarto	SE	Monte Santo	BA
Maragogi	AL	Laranjeiras	SE	Paulo Afonso	BA
Mata Grande	AL	Nossa Senhora da Glória	SE	Ribeira do Pombal	BA
Olho d'Água das Flores	AL	Propriá	SE	Salvador	BA
Palmeira dos Índios	AL	Tobias Barreto	SE	Santa Maria da Vitória	BA
Penedo	AL	Alagoinhas	BA	Santo Antônio de Jesus	BA
Santana do Ipanema	AL	Bom Jesus da Lapa	BA	Senhor do Bonfim	BA
São Miguel dos Campos	AL	Brumado	BA	Serrinha	BA
Traipu	AL	Catu	BA	Valença	BA
União dos Palmares	AL	Entre Rios	BA	Vitória da Conquista	BA
Aracaju	SE				

Fonte: Elaboração Própria dos Autores.