فصلنامه سیاست‌های مالی و اقتصادی

سال هفتم، شماره ۲۵، بهار ۱۳۹۸، صفحات ۵۷–۳۱

بررسی تأثیر جهانی شدن و رشد اقتصادی بر فقر در ایران

سید مرتضی افقه

استادیار دانشگاه شهید چمران اهواز، دانشکده اقتصاد و علوم اجتماعی

morteza.afghah@Gmail.com

مرجان مطلب‌نژاد

کارشناس ارشد علوم اقتصادی، توسعه اقتصادی و برنامه‌ریزی، دانشگاه آزاد اسلامی واحد اهواز (نویسنده مسئول)

motalebnejad@gmail.com

عبدالخالق غبیشاوی

کارشناسی ارشد و مربی دانشگاه آزاد اسلامی واحد ماهشهر

ghobeyshavik@yahoo.com

جهانی شدن امر مهمی در جهان امروز محسوب می‌شود. عده‌ای از اقتصاددانان بر این عقیده‌اند که جهانی شدن منجر به اقتصادی باثبات برای کشورهای فقیر و در حال توسعه و درنهایت ارتقای رفاه اقتصادی و رشد آن‌ها خواهد شد. در مقابل عده‌ای مخالف این امر هستند. یکی از مواردی که برای کشورهای در حال توسعه اهمیت دارد تأثیر جهانی شدن بر معضلات مهم اقتصادی کشورها به‌خصوص فقر و توزیع درآمد است. مقاله حاضر به بررسی رابطه جهانی شدن و رشد اقتصادی با فقر در ایران طی دوره زمانی ۱۳۹۵- ۱۳۶۱ پرداخته است. برای این منظور از شاخص جامع جهانی شدن KOF و تکنیک‌های اقتصادسنجی شامل روش یوهانسن- جوسیلیوس و مدل تصحیح خطا، استفاده شده است. شاخص KOF سه جنبه مهم اقتصادی، اجتماعی و سیاسی را در بر می‌گیرد. نتایج حاصل از برآورد الگو نشان می‌دهد جهانی شدن و رشد اقتصادی اثر مثبت و معناداری بر فقر دارند و با افزایش این دو ضریب از طریق افزایش صادرات که منجر به رشد اقتصادی و جذب سرمایه‌گذاری که ناشی از جهانی شدن است باعث کاهش فقر و نابرابری در کشور می‌شوند. همچنین ضریب تصحیح خطا سرعت بالای تعدیل عدم تعادل در کوتاه‌مدت و تمایل به تعادل در بلندمدت را نشان می‌دهد.

طبقه‌بندی JEL: C50 ،F31 ،F1

واژگان کلیدی: جهانی شدن، رشد اقتصادی، فقر، شاخص KOF، یوهانسن- جوسیلیوس.

* تاریخ دریافت: ۱۳۹۷/۸/۲۹ تاریخ پذیرش: ۱۳۹۷/۱۲/۲۷

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

۱. مقدمه

اگرچه تاکنون تاریخ شاهد رشد اقتصادی قابل توجهی در جهان بوده است، اما فقر و نابرابری همچنان در بسیاری از نقاط جهان بالا است. بنابراین همواره کاهش فقر و نابرابری درآمد یکی از دغدغه‌های اصلی هر اقتصاد به شمار می‌رود و اقتصاددانان و اندیشمندان در سراسر جهان می‌کوشند تا راهکارهای مناسبی را جهت مقابله با فقر و کاهش آن به دست آورند.

سیاست‌های مختلفی در جهت کاهش فقر و نابرابری تاکنون ارائه شده است. استفاده از ظرفیت تجارت خارجی با دیگر کشورها یکی از این سیاست‌هاست. گسترش تجارت بین کشورها به مباحث جدیدی منجر شده که یکی از آن‌ها مسئله جهانی شدن است که توجه اقتصاددانان و سیاست‌گذاران را به خود جلب کرده است. یکی از موارد مورد بحث در زمینه جهانی شدن، بررسی اثرات آن بر فقر و نابرابری و توزیع درآمد میان گروه‌های درآمدی است.

از سال ۱۹۹۰ به بعد اقتصاد بسیاری از کشورهای جهان رشد قابل توجهی را تجربه کرده است. با این وصف، میزان فقر در جهان همچنان بسیار بالا است. بر اساس آمار بانک جهانی در سال ۲۰۱۱ نیمی از جمعیت جهان در حال توسعه (۲/۲ میلیارد نفر) درآمدی کمتر از دو دلار در روز، و یک‌پنجم آن‌ها (۱/۲۵ میلیارد نفر) درآمدی کمتر از یک دلار در روز داشته‌اند. بر اساس تعریف بانک جهانی فقرا کسانی هستند که از منابع اقتصادی کافی برای تأمین نیازهای اساسی خود برخوردار نیستند (بانک جهانی[1]، ۲۰۱۵).

از طرفی یکی از مسائل مهم در حوزه جهانی شدن و تجارت جهانی، اثرگذاری آن بر فقر و توزیع درآمد است. با بهره‌گیری از تعریف «سازمان همکاری و توسعه اقتصادی» می‌توان جهانی شدن را الگوی تکامل یابنده‌ای از فعالیت‌های فرامرزی بنگاه‌ها و شرکت‌ها تعریف کرد که شامل سرمایه‌گذاری بین‌المللی، تجارت و همکاری برای ابداع و نوآوری و توسعه فرآورده‌های تازه و نو، تولید، منبع شناسی و بازاریابی است (سازمان همکاری و توسعه اقتصادی[2]، ۲۰۱۳). همچنین

1. World Bank
2. Organisation for Economic Co-operation and Development (OECD)

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

صندوق بین‌المللی پول جهانی شدن را «ادغام وسیع‌تر و عمیق‌تر» تعریف می‌کند. به عبارت دیگر جهانی شدن را رشد وابستگی متقابل اقتصادی کشورها در سراسر جهان از طریق افزایش حجم و تنوع مبادلات کالا و خدمات و جریان سرمایه در ماورای مرزها و همچنین از طریق پخش گسترده‌تر و وسیع‌تر تکنولوژی می‌داند (صندوق بین‌المللی پول[1]، ۱۹۹۷).

همچنین با توجه به موج آزادسازی تجارت در طول چند دهه گذشته، بحث در میان اقتصاددانان بر روی رابطه بین باز بودن تجارت و متغیرهای اقتصادی از جمله رشد و توزیع درآمد و کاهش فقر ادامه دارد. برخی مطالعات نشان می‌دهد که احتمالاً باز بودن اقتصاد می‌تواند از دو طریق مستقیم و غیرمستقیم بر فقر اثر بگذارد. تجارت می‌تواند با تأثیر بر توزیع درآمد به طور مستقیم و با اثر بر رشد اقتصادی به طور غیرمستقیم بر فقر اثر گذارد (اکبریان، ۱۳۹۰). باز بودن اقتصاد و گام برداشتن در جهت جهانی شدن در صورتی که تأثیری مثبت بر فقر داشته باشد می‌تواند به عنوان یک راهکار اساسی در دستور کار بسیاری از کشورها قرار گیرد. لذا بسیاری از کشورها از جمله کشورهای در حال توسعه به سمت افزایش تجارت جهانی و درجه باز بودن اقتصاد کشورشان در حرکت هستند. اما با این حال بسیاری از اقتصاددانان بر این باورند که با توجه به پیوند مثبت آزادسازی با کاهش فقر در کشورهای آسیای شرقی نمی‌توان گفت که این وضعیت تنها نتیجه مستقیم آزادسازی است زیرا عوامل بسیار دیگری نیز در دستیابی به این موفقیت‌ها نقش داشته‌اند (مک کالوچ[2]، ۲۰۰۱).

در رابطه با اثرات باز بودن اقتصاد بر فقر هنوز توافق عمومی ایجاد نشده است و این مقوله به یکی از موارد قابل بحث در جهان تبدیل شده است (وینترز[3]، ۲۰۰۰). با این حال بسیاری از اقتصاددانان عقیده دارند که در بلندمدت اقتصادهای باز بهتر از اقتصادهای بسته عمل می‌کنند؛ اما همچنان بیم آن می‌رود که در کوتاه‌مدت آزادسازی تجاری به گروه‌های فقیر جامعه بیشتر صدمه

1. International Monetary Fund (IMF)
2. Macculloch
3. Winters

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

بزند و حتی در بلندمدت نیز با وجود موفقیت‌های اقتصادی جهانی، ممکن است بعضی از مردم فقیر باقی بمانند (وینترز، ۲۰۰۴).

از طرفی برخی معتقدند که توزیع درآمد بین تمام مردم جهان بیش از گذشته برابر شده است و طی دو دهه گذشته بعد از بیش از یک قرن و نیم فقر شدید کاهش یافته که علت این موضوع را یکپارچگی اقتصادی بین کشورها می‌دانند. بنابراین با توجه به نظرات متفاوتی که در این زمینه وجود دارد یکی از سؤالاتی که ذهن بسیاری از محققین علوم اجتماعی به‌خصوص اقتصاددانان را به خود مشغول کرده است این است که آیا جهانی شدن منجر به کاهش فقر و نابرابری می‌شود یا خیر؟ در راستای بررسی این سؤال، در این تحقیق تلاش می‌شود اثرات جهانی شدن و دیگر متغیرهای کلان اقتصادی با توجه مبانی نظری و مطالعات تجربی بر فقر در ایران مورد مطالعه قرار گیرد.

۲. مبانی نظری

۲-۱. تعریف فقر

به دلیل ماهیت چندبعدی فقر، بیان تعریف جامعی از فقر مشکل است و تعاریف مختلف و متعددی برای فقر ارائه شده است، بنابراین فقر را می‌توان از جهات گوناگون تعریف کرد:

تانسند[1] (۱۹۷۹)، فقر را به صورت فقدان یا عدم برخورداری مناسب از تغذیه، امکانات زندگی، خدمات و فعالیت‌های معمول و متداول در یک جامعه تعریف می‌کند.

سن[2] در سال ۱۹۸۱ اشاره کرده است که فقر را باید به صورت محرومیت از قابلیت‌های اساسی در نظر گرفت و نه صرفاً پایین بودن درآمدها که ضابطه متعارف شناسایی فقر است .البته محرومیت، خود مفهومی نسبی است که ممکن است در مکان‌ها و زمان‌های متفاوت، تعاریف

1. Townsend
2. Sen

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

متفاوتی داشته باشد. آنچه که چشم‌انداز قابلیتی در تحلیل فقر انجام می‌دهد این است که درک ما را از ماهیت و علل فقر و محرومیت گسترش می‌دهد (سن، ۱۹۸۱).

بر اساس تعریف سازمان ملل اساساً فقر به معنای عدم داشتن حق انتخاب و برخورداری از فرصت‌هاست و این به معنای نادیده گرفتن یک حق انسانی است. همچنین به معنای نبود امکان شرکت مؤثر در جامعه است. فقر به معنای نداشتن غذا و یا لباس کافی برای خانواده یا نبود مدرسه و درمانگاه است. همچنین به معنای نداشتن زمین برای کشت محصولات غذایی یا شغلی برای گذران زندگی است، به معنای عدم امنیت، نبود قدرت و خارج شدن از میان اشخاص، جمع خانواده و اجتماع است. از طرفی فقر به معنای احتمال خشونت نیز به کار برده می‌شود و غالباً تداعی‌کننده زندگی در مناطق حاشیه‌ای و آسیب‌پذیر بدون دسترسی به آب تمیز و بهداشتی است (سازمان ملل، ۲۰۱۱)[1].

۲-۲. جهانی شدن[2]

جهانی شدن، عبارت است از برقراری روابط متنوع و متقابل بین دولت‌ها و جوامع که به ایجاد نظام جهانی کنونی انجامیده است و نیز فرآیندی که از طریق آن، حوادث، تصمیمات و فعالیت‌ها در هر بخش از جهان می‌تواند پیامدهای مهمی برای سایر افراد و جوامع در بخش‌های دیگر کره زمین داشته باشد (کومسا، ۱۳۷۸). می‌توان گفت جهانی شدن اقتصاد روندی است که طی آن ادغام در اقتصاد جهانی از طریق این تحولات شدت گرفته است. مقررات‌زدایی‌های مختلف مربوط به تسهیل حرکت عوامل تولید؛ به‌ویژه سرمایه از مکانی به مکان دیگر، برچیدن مرزهای تعرفه‌ای و حمایتی به منظور ادغام هرچه بیشتر بازارهای ملی و منطقه‌ای در هم، برقراری نظام حقوقی بین‌المللی؛ به‌ویژه در چارچوب فعالیت‌های سازمان تجارت جهانی به منظور تنظیم امور و پیشرفت‌های فن شناختی به‌ویژه در حوزه رایانه و اطلاعات که امکان اتصال بازارهای مختلف را

1. United Nations
2. Globalization

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

در اقصی نقاط جهان ممکن کرده و به این صورت با حذف فاصله مکانی، زمان را فشرده و متراکم‌تر کرده است (میرجلالی، ۱۳۸۲).

نگاه خوش‌بینانه به پدیده جهانی شدن، بیان‌کننده این است که طی دهه‌های اخیر، جهانی شدن موجب رشد تولید ناخالص داخلی در جهان شده است و سرمایه‌گذاری خارجی، به‌ویژه در کشورهای در حال توسعه، از رشد سریعی برخوردار شده است. حذف تدریجی موانع تجاری و جابجایی سرمایه موجبات پیشرفت‌های فناوری و کاهش مستمر هزینه‌های حمل‌ونقل و ارتباطات را فراهم کرده؛ که این خود موجب افزایش سطح رفاه و فرصت‌های جدید اقتصادی برای همگان شده است. اما نگاه بدبینانه گویای این است که جهانی شدن حاکمیت هولناکی است که جنبه‌های ارزشمند اجتماعی، فرهنگی و اقتصادی کشورها را هدف قرار داده است. گروه اول جهانی شدن را مفید و اجتناب‌ناپذیر برای توسعه اقتصادی جوامع در آینده می‌دانند، در حالی که عده‌ای دیگر اعتقاد دارند که جهانی شدن موجب افزایش نابرابری بین کشورها شده و اشتغال، سطح زندگی و فرهنگ آن‌ها را تهدید می‌کند (حسن‌زاده، ۱۳۸۶). همچنین (حسینی، سلمانی و حکمتی فرید، ۱۳۹۳) در مقاله خود تحت عنوان بررسی تأثیر جهانی شدن بر توزیع درآمد در کشورهای عضو سازمان کنفرانس اسلامی طی دوره (۲۰۱۰- ۱۹۸۴) نشان می‌دهد که توزیع درآمد با افزایش درآمد سرانه واقعی بهبود یافته و با گسترش جهانی شدن نامتعادل‌تر می‌شود.

واژه globalization را به جهانی شدن و جهانی‌سازی ترجمه می‌کنند. فرایند جهانی شدن خواستار اصلاح، کاهش و حذف حمایت‌های دولتی از طریق مقررات زدایی و کاهش مالیات‌هاست. این حمایت‌های قانونی و دولتی اگرچه ظاهراً از نیروی کار و حداقل دستمزدها پشتیبانی می‌کند اما می‌تواند هزینه‌های اضافی برای تولیدکنندگان و دولت داشته باشد. در نظریه جهانی شدن اعتقاد بر آن است که فاصله‌ها از میان می‌رود و در واقع مناطق محلی و جهانی اهمیت پیدا می‌کند (درفان و شیخیانی، ۱۳۹۴).

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

۲-۳. رشد اقتصادی

در قرون ۱۸ و ۱۹ میلادی، رشد اقتصادی تا حدود زیادی به تعداد کمی از کشورهای جهان محدود بوده است. اما این مسئله در دهه‌های بعدی به تدریج به سایر نقاط جهان گسترش یافته و در حال حاضر موضوع مهمی برای تمام کشورهای دنیا است. گرچه نحوه‌ی گسترش رشد در کشورهای مختلف جهان برابر نبوده است و مطالعات زیادی به بررسی دلایل نابرابری‌ها پرداخته‌اند، لیکن در تمامی مطالعات، رشد اقتصادی تنها مکانیزم پرقدرت برای ایجاد افزایش بلندمدت در درآمد سرانه بوده است. بررسی علل و عوامل رشد همواره مورد توجه خاص اقتصاددانان بوده و مدل‌های رشد متعددی برای آن طراحی شده است. در تعریف رشد اقتصادی به تعبیر ساده، عبارت است از افزایش تولید یک کشور در یک سال خاص در مقایسه با مقدار آن در سال پایه، افزایش تولید ناخالص ملی (GNP) یا تولید ناخالص داخلی (GDP) در سال مورد بحث به نسبت مقدار آن در یک سال پایه، رشد اقتصادی محسوب می‌شود .علت اینکه برای محاسبه رشد اقتصادی، از قیمت‌های سال پایه استفاده می‌شود آن است که افزایش محاسبه‌شده در تولید ناخالص ملی، ناشی از افزایش میزان تولیدها باشد و تأثیر افزایش قیمت‌ها حذف شود (غلامرضا آزاد، ۱۳۹۲).

پدیده نابرابری درآمد که از دلایل عمده فقر در کشورهای در حال رشد است، یکی از عوامل کند کننده رشد اقتصادی نیز محسوب می‌شود. از این رو، بحث و قضاوت در خصوص تأثیرات متقابل رشد اقتصادی و توزیع درآمد در کنار گسترش مدل‌های رشد اهمیت یافته است (نژادعبداله، محتشمی برزادران، ۱۳۹۲).

در میان تئوری‌های مختلف توسعه، نظریه مراحل رشد روستو[1]، نظر اکثر اقتصاددانان را به خود جلب کرد. تمامی این نظریه‌پردازان معتقد بودند که رشد درآمد ملی از طریق بهبود نسبی سطح اشتغال، سبب کاهش فقر خواهد شد. این اندیشه با فرضیه دورهای باطل نورکس[2] گسترش

1. Rostow
2. Nurkse

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

یافت. برای از بین بردن دورهای باطل و گذر از مرحله جهش اقتصادی، مدل‌های متعددی که بیشتر بر پایه نظریات کینز بود با تأکید بر نقش سرمایه، دانش فنی، تکنولوژی و ارز خارجی طراحی شد (پروین، ۱۳۷۲).

نیازهای انسان در پایین‌ترین سطح ممکن نیاز به خوراک، پوشاک، آب و سرپناهی برای زندگی است. اگر کسی از این منابع محروم شود فقیر مطلق نامیده می شود. گونه دوم فقر، فقر نسبی است که مفهومی به‌مراتب عام‌تر دارد. این دسته توانایی برآوردن نیازهای اولیه خود را دارند اما نسبت به سایر افراد توانایی تأمین سایر نیازهای خود را به دلیل محدودیت مالی ندارد. برای مثال ممکن است کارمندی که برای خرید امکانات معمول در جامعه مثل خرید تلویزیون، کامپیوتر، دوچرخه و... یا تدارک برای یک مسافرت یا دعوت مهمان به خانه، مجبور باشد بیشتر از حد معمول کار کند فقیر به‌حساب می‌آید. به مفهوم ساده این فرد نسبت به افرادی که درآمد آن‌ها برای تأمین این نیازها کافی است فقیر محسوب می‌شود. فقر نسبی متناسب با فرهنگ و شرایط اجتماعی هر کشور متفاوت است. برای مثال فردی که در یک کشور کوچک آفریقایی زندگی می‌کند و دسترسی به نیازهای اولیه دارد و امکانات آموزشی و بهداشتی نیز در سطح تقریباً مناسبی برای او فراهم است، در آن کشور فقیر به حساب نمی‌آید. اما فردی که در خانه کوچکی اطراف شهر لندن با همین امکانات زندگی می‌کند فقیر محسوب می‌شود یا فقرای نیویورک وضع به‌مراتب بهتری نسبت به مردم شهر بمبئی هند دارند، جایی که بیش از ۵۰ درصد جمعیت آن در محله‌های زاغه‌نشین زندگی می‌کنند. همچنین توزیع درآمد که شاخص جهت اندازه‌گیری فقر است به تشریح چگونگی سهم افراد یک کشور از درآمد ملی می پردازد و درجه نابرابری موجود بین درآمد افراد یک کشور را توصیف می کند. منظور از درآمد نیز ارزش پولی افراد در مقابل خدماتی که ارائه می‌دهند است (پل و روبین[1]، ۲۰۰۹).

1. Krugman, Paul, and Robin, 2009

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

۳. شاخص جهانی شدن KOF[1]

در این مطالعه از شاخص KOF که یک شاخص جامع و ترکیبی است به عنوان شاخص جهانی شدن استفاده می‌شود. واژه KOF مخفف عبارت آلمانی، به معنای مؤسسه تحقیقات در زمینه کسب‌وکار، عنوان یک مؤسسه اقتصادی در سوئیس است که در قسمت فدرال تکنولوژی دانشگاه ETH[2] در گروه‌های مدیریت، فناوری و اقتصاد فعالیت می‌کند. شاخص جهانی شدن KOF سالانه از سوی این مؤسسه منتشر می‌شود و همراه با آن زیر شاخص‌های جهانی‌شدن اقتصادی، جهانی‌شدن اجتماعی و جهانی‌شدن سیاسی نیز ارائه می‌شود. شاخص جهانی‌شدن در سال ۲۰۰۲ توسط این مؤسسه ساخته شده است و در هر و همکاران[3] (۲۰۰۸) آن را بسط داده‌اند (بچل[4]، ۲۰۱۴). جنبه اقتصادی این شاخص شامل جریان‌های واقعی تجارت، سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی و سرمایه‌گذاری در پرتفولیو و همچنین موانع تجارت از قبیل محدودیت‌ها و تعرفه‌ها بر روی جریان‌های واقعی است. همچنین این شاخص دو جنبه مهم اجتماعی و سیاسی را نیز در بر می‌گیرد.

ابعاد سه‌گانه شاخص جهانی شدن KOF به صورت زیر است:

- جهانی شدن اقتصادی: که توسط جریان فاصله طولانی کالا، سرمایه و خدمات و همچنین اطلاعات با مبادلات بازار مشخص می‌شود؛
- جهانی شدن سیاسی: که با دایره نفوذ سیاست‌های دولت مشخص می‌شود؛
- جهانی شدن اجتماعی: که به صورت گسترش ایده‌ها و اطلاعات است.
- به طور کلی جهانی شدن اقتصادی دارای دو بعد است. جریان واقعی اقتصادی که برای اندازه‌گیری جهانی شدن مورد استفاده قرار می‌گیرد و دوم محدودیت‌های تجاری و سرمایه است.

1. Konjunkturforschungsstelle
2. Eldgenossische Technische Hochschule Zurich
3. Dreher et al.
4. Bechtel

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

شاخص فرعی در جریان واقعی اقتصادی شامل اطلاعات تجاری، سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی و سرمایه‌گذاری پرتفوی است. داده‌ها در مورد تجارت، توسط بانک جهانی و سهم سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی (نرمال شده توسط تولید ناخالص داخلی) توسط سایت UNCTADSTAT ارائه می‌شود. سرمایه‌گذاری پرتفوی نیز از آمارهای صندوق بین‌المللی پول تهیه می‌شود. تجارت به طور کلی از مجموع صادرات و واردات کشور و سرمایه‌گذاری پرتفوی از مجموع سهم یک کشور از دارایی‌ها و بدهی‌ها است که توسط تولید ناخالص داخلی نرمال شده‌اند. داده‌های استفاده شده در این تحقیق به صورت سالانه گردآوری شده است.

٤. مطالعات تجربی

در زیر به برخی مطالعات در زمینه اثر جهانی شدن و رشد اقتصادی بر فقر و توزیع درآمد می‌پردازیم:

٤-١. مطالعات داخلی

عطرکار روشن و هاشمی (۱۳۹۵) در بررسی رابطه بین باز بودن تجارت و فقر در ایران طی سال‌های ۱۳۹۲- ۱۳۵۲ با استفاده از روش سیستم معادلات هم‌زمان بیان داشتند که: یافته‌ها حاکی از تأثیر باز بودن تجارت بر فقر بوده است. بر این اساس، باز بودن تجارت از طریق رشد اقتصادی موجب کاهش فقر در طول سال‌های مورد مطالعه در ایران شده است. بر اساس نتایج حاصل، رشد اقتصادی در مراحل اولیه توسعه موجب افزایش نابرابری شده و مجذور رشد اقتصادی که بیانگر رشد اقتصادی در مراحل بعدی توسعه است، موجب کاهش نابرابری شده است. از متغیرهای مهمی که می‌تواند سبب کاهش فقر شود، تولید ناخالص داخلی است. این شاخص از جهات مختلف حائز اهمیت است. افزایش آن سبب بالا رفتن درآمد سرانه شده و به لحاظ کاهش فقر نقش بااهمیتی را ایفا می‌کند.

حکمتی فرید و جهانگیری (۱۳۹۴). نتایج برآورد مدل پژوهش نشان می‌دهد که شاخص آزادسازی تجاری و رعایت حقوق مالکیت دارای تأثیر معنادار و منفی بر روی شاخص فقر انسانی

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

است، پس درنتیجه هرچقدر میزان موانع تجارت در یک کشور کم باشد و کشور به سمت جهانی شدن بیشتر حرکت کند انتظار بر این است که در آن کشور فقر انسانی پایین‌تری مشاهده شود. در این خصوص لازم است دولت سیاست برداشتن موانع تجارت آزاد و نیز عضویت در سازمان تجارت جهانی و همچنین تعیین و تقویت مزیت‌های نسبی کشور در زمینه‌های مختلف را پیگیری کند.

آذربایجانی و همکاران در مطالعه‌ای در سال (۱۳۹۳) تحت عنوان «آزادسازی تجاری و سرمایه انسانی بر رشد اقتصادی ایران» به این نتیجه رسیدند که شاخص آزادسازی در دوره کوتاه‌مدت بر رشد اقتصادی اثر مثبت و معناداری دارد، ولی در بلندمدت تنها بر رشد اقتصاد کل معنی‌دار است.

صابونچی و رشید زاده (۱۳۹۳)، در مقاله‌ای تحت عنوان «جهانی شدن و سرمایه‌گذاری خارجی بر روی توزیع درآمد در ایران» به تحلیل اثر جهانی شدن بر توزیع درآمد در ایران طی دوره زمانی (۱۳۹۰- ۱۳۵۳) با روش خود همبسته با وقفه توزیع‌شده (ARDL) پرداخته است. نتایج به‌دست‌آمده حاکی از این است که نظریه کوزنتس در رابطه بین رشد اقتصادی و نابرابری درآمدی صادق است. همچنان یافته‌ها نشان داده که با افزایش سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی و آزادسازی تجاری، نابرابری درآمدی به موازات افزایش همگرایی اقتصاد ایران به سوی اقتصاد جهانی کاهش می‌یابد.

حسن‌زاده و مسلمیان (۱۳۸۹)، در پژوهشی با عنوان «ارزیابی آثار جهانی شدن بر فقر، مطالعه موردی کشورهای در حال توسعه» با استفاده از یک الگوی تجربی و با روش‌های آماری و رگرسیون و آزمون داده‌های تابلویی برای پانزده کشور در حال توسعه به بررسی آثار جهانی شدن می‌پردازد. نتایج این مطالعه حاکی از آن است که در کوتاه‌مدت به دلیل ضرورت انجام اصلاحات و تعدیلات مورد نیاز اقتصاد، بیکاری و فقر افزایش یافته است. همچنین عدم توجه به بخش‌های آسیب‌پذیر اقتصاد و فقدان یک نظام برنامه‌ریزی مدرن کارآمد برای حرکت در این مسیر خصوصاً

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

پیرامون سرمایه‌گذاری‌های خارجی، همراه با تبعات سیاسی ناشی از ادغام در اقتصاد جهانی و توسعه سرمایه انسانی می‌تواند آثار منفی را تشدید کند.

اکبریان و زارع حقیقی (۱۳۸۹)، در مقاله «بررسی تأثیر باز بودن اقتصاد و رشد اقتصادی بر فقر» رشد اقتصادی و مخارج دولتی بر فقر در ایران مورد بررسی قرار گرفته است. برای برآورد کوتاه‌مدت و بلندمدت از الگوی خود بازگشت با وقفه‌های توزیعی استفاده شده است و آمارهای دوره زمانی (۱۳۸۵- ۱۳۵۰) را پوشش می‌دهد. نتایج الگوهای کوتاه‌مدت و بلندمدت نشان می‌دهد که رشد اقتصادی در کوتاه‌مدت باعث کاهش فقر شده اما بر نابرابری بی‌تأثیر بوده است. در بلندمدت اگرچه رشد اقتصادی فقرزدا بوده است اما موجب افزایش نابرابری شده است.

هسنیجه و خوش‌اخلاق (۱۳۸۸)، در پژوهشی با عنوان «باز بودن تجارت و تأثیر آن بر نابرابری درآمد» اثرات ناشی از باز بودن تجارت در ایران و ده شریک اصلی تجاری ایران را در سه گروه نیروی کار بی‌سواد، کم‌سواد و باسواد طی سال‌های (۲۰۰۶- ۱۹۹۵) مورد بررسی قرار می‌دهد. الگوی اقتصادسنجی برای بررسی تأثیر باز بودن تجارت بر نابرابری درآمد، با روش داده‌های تابلویی برآورد شده است. نتایج بیانگر این مطلب هستند که باز بودن تجارت تنها نابرابری را در کشورهایی که نیروی کار تحصیل‌نکرده کمتری نسبت به نیروی کار دارای تحصیلات ابتدایی و عالی دارند، کاهش می‌دهد.

باقری (۱۳۸۷)، در مطالعه خود به این نتیجه دست یافت که رشد اقتصادی در اغلب سال‌های (۱۳۸۳- ۱۳۶۸) در مناطق روستایی و شهری به نفع فقرا عمل کرده است. یعنی در این سال‌ها علاوه بر اینکه افزایش درآمد افراد فقیر بیش از افراد غیر فقیر بوده، نابرابری بین خانوارهای فقیر نیز کاهش یافته است.

ابونوری (۱۳۸۶)، در مطالعه‌ای اثر خالص رشد اقتصادی بر فقر را در ایران برآورد کرده است. نتایج حاکی از آن است که در طول دوره ۱۳۶۷- ۱۳۶۱ فقر افزایش یافته است؛ با تجزیه فقر مشخص شد که کاهش در جزء نابرابری موجب تخفیف فقر ناشی از رکود اقتصادی شده است؛ یعنی کاهش سهم خانوارهای پردرآمد، به صورت نسبی بیشتر از کاهش سهم خانوارهای

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

کم‌درآمد بوده است. گرچه فقر در طول این دوره افزایش یافته است، اما خانوارهای فقیر در مقایسه با دیگران کمتر آسیب دیده‌اند. طی برنامه‌های توسعه اقتصادی- اجتماعی اول، دوم و سوم، رشد نسبی ناچیز اقتصادی در ایران به استثنای برنامه سوم، در سایر دوره‌ها، فقرزدا نبوده است. به عبارت دیگر، افزایش سهم خانوارهای پردرآمد، به صورت نسبی همواره بیشتر از افزایش سهم خانوارهای کم‌درآمد بوده است.

٤-٢. مطالعات خارجی

دواشیش، میترا (۲۰۱۶)[1] این تحقیق بر اساس رویکردهای مختلف و شامل مطالعات بین کشورهاست که نشان می‌دهد جهانی شدن و تجارت بین‌الملل می‌تواند به رشد اقتصادی کمک کند و به همین دلیل می‌تواند فقر را کاهش دهد. با این حال، محیط داخلی باید برای تحقق این اهداف فراهم شود.

لیم و مک نیلز (۲۰۱۴)[2]، در پژوهشی به بررسی روابط ضریب جینی با آزادسازی تجارت، کمک و جریان سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی می‌پردازد. برآورد داده‌های پانل برای مجموعه داده‌های کلی (حداقل ۴۲ کشور با درآمدهای متوسط) ارائه شده است. به صورت تجربی بیان شده است که آزادسازی تجارت نسبت به سرمایه‌گذاری‌های مستقیم خارجی یا کمک‌های خارجی برای تغییر نابرابری‌های درآمد مؤثرتر است اما اثر آن بستگی به مرحله توسعه دارد. پس از آن به توسعه یک مدل کوچک از اقتصاد با درجات مختلف از آزادسازی می‌پردازد و این نتیجه حاصل می‌شود که کشورهایی با شدت نیروی کار بالا در تولید و باز بودن بیشتر، مولد کاهش نابرابری در پاسخ به شوک‌های مثبت تقاضای صادرات و شرایط تجارت هستند. نتایج برآمده از هر دو مدل شبیه‌سازی‌شده و تجربی پیشنهاد می‌کند که تجارت و آزادسازی مالی می‌تواند سیاست

1. Devashish, Mitra
2. Lim, McNelis

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

تأثیرگذاری برای کاهش نابرابری در کشورهای کم‌درآمد باشد مشروط بر اینکه منافع حاصل از سرمایه مجدد توزیع شود.

برگ و نیلسون (۲۰۱۴)[1]، در مقاله خود با استفاده از اطلاعات از ۱۱۴ کشور (۲۰۰۷– ۱۹۸۳)، به بررسی رابطه بین جهانی شدن و برآورد فقر مطلق بانک جهانی می‌پردازد. با اتکا به روش‌های اقتصادسنجی از جمله پانل دیتا موفق به کشف همبستگی منفی معنی‌داری میان فقر و جهانی شدن می‌شود. نتایج نشان می‌دهد به طور خاص محدودیت‌های تجارت آزاد قویاً به فقر مطلق پایین‌تر وابسته است.

دانگ (۲۰۱۴)[2]، به بررسی تأثیر اقتصاد باز بر استاندارد زندگی و نابرابری درآمد در هشت کشور می‌پردازد. این مطالعه نشان می‌دهد که سرانه رشد تولید ناخالص داخلی پس از آزادسازی نسبت به پیش از آزادسازی سریع‌تر افزایش می‌یابد و کاهش چشمگیری در رکود مالی پس از آزادسازی نسبت به رکود قبل از آن خواهد داشت.

کستیل هو (۲۰۱۲)[3]، در پژوهشی با عنوان آزاد کردن تجارت، نابرابری و فقر در کشور برزیل به مطالعه اثرات ناشی از جهانی شدن بر روی نابرابری درآمد خانوار و فقر با استفاده از اطلاعات دقیق در سراسر کشور برزیل از سال ۱۹۸۷ تا ۲۰۰۵ می‌پردازد. نتایج نشان می‌دهد که آزاد کردن تجارت به افزایش فقر و نابرابری در مناطق شهری دامن می‌زند و ممکن است به کاهش نابرابری (و احتمالاً فقر) در مناطق روستایی منجر شود. از منظر یکپارچگی مشاهده‌ها در بازارهای جهانی دریافتند در برزیل هر دو جنبه فقر و نابرابری با در معرض صادرات قرار گرفتن کاهش می‌یابد اما دولت فقر را به وسیله افزایش واردات افزایش می‌دهد.

پائلینو (۲۰۱۲)[4]، در یک بررسی بر اساس نظرسنجی‌های تئوریک و تحقیقات تجربی بر روی چگونگی تأثیرگذاری تجارت و آزاد کردن تجارت بر روی فقر و توزیع درآمد می‌پردازد. تأثیر

1. Bergh, Nilsson
2. Dong
3. Castilho
4. Paulino

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

جهانی شدن بر کاهش فقر نامتوازن است اما یافته‌های موجود در ادبیات به انتخاب مدل حساس هستند. آزاد کردن تجارت در مجموع رفاه را بهبود می‌بخشد اما سود حاصل از آن محدود و توزیع آن نابرابر است. اثرات رفاهی اساساً از طریق تغییرات قیمت، تمرکز بر روی اثرات تقاضاهای وابسته برای عوامل داخلی تولید و به طور خاص، تقاضا برای نیروی کار ماهر نسبت به غیر ماهر سنجیده می‌شود. تحقیقات نشان می‌دهد که منشأ محدودیت‌های فقر ناشی از منابع مختلفی از جمله زیرساخت‌ها، مهارت، بازارهای ناقص و سیاست‌گذاری‌ها است.

دلار و کری (۲۰۰۴)[1]، با استفاده از یک رگرسیون بین کشوری برای ۹۶ کشور نشان می‌دهند که بین تغییرات در حجم تجارت و میانگین درآمد فقرا ارتباطی نیافتند، در حالی که رشد اقتصادی رابطه یک به یک با درآمد متوسط فقرا داشته است.

۵. اهداف تحقیق

اهداف تحقیق عبارتند از:

۱. بررسی تأثیر جهانی شدن بر فقر؛
۲. بررسی تأثیر رشد اقتصادی بر فقر؛
۳. بررسی تأثیر بیکاری بر فقر.

با مشخص شدن تأثیر جهانی شدن بر فقر و توزیع درآمد، برنامه‌ریزان کشور می‌توانند در جهت رسیدن به هدف کاهش فقر و بهبود توزیع درآمد اقدامات لازم را با آگاهی بیشتری انجام دهند. در این مقاله به دنبال تعیین روابط بلندمدت و کوتاه‌مدت بین متغیرهای موجود در مدل هستیم. مدل‌سازی اقتصادسنجی سری زمانی مبتنی بر فرض پایایی متغیرهای سری زمانی است. روش‌های زیادی برای تشخیص پایایی یک سری زمانی وجود دارد. این روش‌ها آزمون‌های ریشه

1. Dollar and Kraay

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

واحد[1] مانند آزمون دیکی فولر[2]، آزمون دیکی فولر تعمیم‌یافته، آزمون پایایی بر اساس نمودار همبستگی نگار، آزمون ریشه واحد برای پایایی و آزمون فیلیپس و پرون است (نوفرستی، ۱۳۸۹).

٦. معرفی مدل و متغیرهای الگو

در این بخش به بررسی تجربی رابطه بین فقر، جهانی شدن و رشد اقتصادی در ایران با استفاده از تحلیل‌های هم‌انباشتگی می‌پردازیم. الگوی اقتصادسنجی مورد نظر بر اساس مطالعات دلار و کری (۲۰۰۴)[3] و برگ و نیلسون (۲۰۱۴)[4] تصریح می‌شود. همچنین داده‌های آماری به صورت سری زمانی برای سال‌های ۱۳۹۵- ۱۳۶۱ است. الگوی مربوط به بررسی اثرات جهانی شدن و رشد اقتصادی بر فقر به صورت زیر بررسی می‌شوند:

$$Pov = f (KOF, GDP, U) \quad (1)$$

$$Lpov = \alpha_0 + \alpha_1 LKOF + \alpha_2 LGDP + \alpha_3 LU \quad (2)$$

متغیرهای مدل به شرح زیر است:

LPOV: لگاریتم شاخص فقر. داده‌های فقر با استفاده از روش حداقل انرژی دریافتی محاسبه شد.

LKOF: لگاریتم شاخص جهانی شدن (KOF). با استفاده از اطلاعات موجود در سایت مؤسسه تحقیقات تجاری سوئیس KOF استخراج شده‌اند.

LGDP: لگاریتم رشد اقتصادی. اطلاعات مربوط به رشد اقتصادی از بانک جهانی جمع‌آوری شده‌اند.

LU: لگاریتم شاخص بیکاری، اطلاعات مربوط به این شاخص از سایت مرکز آمار ایران استخراج شده‌اند.

1. Unit roots test
2. Dicky-Fuller test
3. Dollar and Kraay (2004)
4. Bergh and Nilsson (2014)

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

٦-١. نتایج آزمون پایایی

در این مقاله، روش هم‌انباشتگی چندگانه[1] که یوهانسن و جوسیلیوس (۱۹۹۰)[2] پیشنهاد کرده‌اند، برای تعیین بردارهای هم انباشته ممکن از متغیرهای مدل، استفاده شود. روش فوق، از اعتبار لازم برخوردار است، زیرا بر اساس نسبت راست‌نمایی استوار شده است. به‌علاوه روش یوهانسن به تکنیک انگل- گرنجر ترجیح داده می‌شود؛ زیرا همان‌طور که ارایز و درات (۱۹۹۴)[3] اشاره می‌کنند، اولاً خواص سری‌های داده‌ها را که برای آن‌ها مطرح است به طور کامل در بر می‌گیرد. ثانیاً تخمین‌های کلیه بردارهای هم‌انباشته کننده را فراهم می‌کند که بین متغیرها وجود دارند. ثالثاً آماره‌های لازم را برای تعداد بردارهای هم انباشته کننده در نظر می‌گیرد و نهایتاً اینکه این روش به فرضیه‌ها اجازه می‌دهد تا ضرایبی که وارد بردارهای هم‌انباشته می‌شوند مستقیماً آزمون شوند.

به منظور بررسی وجود رابطه هم‌جمعی بین متغیرهای موجود ضروری است که از ایستایی متغیرها اطمینان حاصل شود. آماره مورد استفاده در این تحقیق آماره دیکی فولر تعمیم‌یافته (ADF)[4] است. آزمون ریشه واحد یا (پایایی) متغیرهای مورد نظر در این تحقیق با استفاده از نرم‌افزار eviews8 مورد بررسی قرار گرفته و در جدول (۱) نشان داده شده است.

بر این اساس، سری زمانی تمامی متغیرها در سطح داده‌ها، ناپایا هستند. به عبارتی، آماره محاسباتی برای تمامی متغیرها در وقفه بهینه از قدر مطلق آماره آزمون محاسبه‌شده کمتر بوده و فرضیه صفر یا ناپایایی متغیرها را در سطح اطمینان ۹۵٪ را نمی‌توان رد کرد. سپس آزمون فوق برای تفاضل مرتبه اول متغیرها به کار گرفته می‌شود. همان‌طور که نتایج جدول نشان می‌دهند، تمام متغیرها در تفاضل پایا هستند. به عبارت دیگر تفاضل‌گیری متغیرها این امکان را به ما می‌دهد که متغیرهای ناپایا با رفع خودهمبستگی جملات خطا به متغیرهای پایا تبدیل شوند. در آزمون پایایی متغیرها، اگر تعدادی از متغیرها با دو بار تفاضل‌گیری پایا شوند، I(2) هنوز امکان وجود

1. Multivariate Cointegration Methodology
2. Johansen and Juselius (1990)
3. Arize and Darrat (1994)
4. Augmented Dicky Fuller

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

الگوی هم‌انباشتگی (هم‌جمعی) بین متغیرها وجود دارد، مشروط بر اینکه بین متغیرهای I(2) یک ترکیب خطی I(1) وجود داشته باشد تا بتواند با سایر متغیرهای I(1) یک ترکیب خطی به وجود آورد (محمد نوفرستی، ۱۳۸۹). این موضوع را هاشم پسران و شین در مقاله‌ای با عنوان «مدل خود توضیح با وقفه‌های برداری»؛ روشی برای تحلیل‌های همگرایی، مورد بررسی قرار داده‌اند (پسران و شین، ۲۰۰۱).[1]

جدول ۱. نتایج آزمون پایایی دیکی–فولر تعمیم‌یافته در سطح و تفاضل متغیرها

نتایج آزمون در سطح متغیرها				نتایج آزمون در تفاضل متغیرها			
حالت وجود عرض از مبدأ و روند خطی در داده‌ها				حالت وجود عرض از مبدأ و بدون روند خطی در داده‌ها			
نام متغیر	Prob	آماره ADF بر اساس SBC	مقدار بحرانی ADF در سطح ۹۵٪	وضعیت پایایی متغیرها	Prob	آماره ADF بر اساس SBC	مقدار بحرانی ADF در سطح ۹۵٪	وضعیت پایایی متغیرها
Lpov	۰/۹۹	۱/۴۳	-۳/۶۲	ناپایا	۰/۰۰۰۴	-۴/۹۷	-۲/۹۶	پایا
Lkof	۰/۵۴	-۲/۰۶	-۳/۵۶	ناپایا	۰/۰۰۰۶	-۴/۸۰	-۲/۹۶	پایا
Lgdp	۰/۸۰	-۱/۵۱	-۳/۵۶	ناپایا	۰/۰۲۴۸	-۳/۲۸	-۲/۹۶	پایا
Lu	۰/۱۰	-۳/۱۹	-۳/۵۷	ناپایا	۰/۰۰۹۸	-۳/۶۸	-۲/۹۶	پایا

مأخذ: محاسبات محقق

بنابراین، برای بررسی پایایی متغیرها، از آزمون دیکی- فولر (ADF) استفاده شده است. هیچ‌کدام از متغیرهای مدل در سطح ایستا نبوده و نتایج ارائه‌شده در جدول (۱) نشان می‌دهند که کلیه متغیرهای مدل با یک مرتبه تفاضل‌گیری ایستا شده‌اند. پس می‌توان نتیجه گرفت که همه متغیرها I(1) هستند. پس شرط لازم برای استفاده از روش یوهانسن- جوسیلیوس فراهم است.

1. Pesaran and Shin (2001)

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

٦-٢. تعیین وقفه بهینه مدل VAR

در اینجا برای تعیین وقفه بهینه از معیار شوارز- بیزین استفاده شده است چراکه این معیار اهمیت بسیاری به‌سادگی سیستم یا کاهش پارامترها در برابر برازش بهتر داده و در تعداد وقفه‌ها صرفه‌جویی می‌کند؛ که این امر موجب بیشتر شدن درجه آزادی تخمین خواهد شد (پسران و شین، ۲۰۰۱). بر این اساس همان‌طور که در جدول (۲) نشان داده شده است، طول وقفه بهینه بررسی شده است. نتایج جدول نشان می‌دهد که وقفه بهینه متغیرهای مدل با توجه به معیار شوارتز- بیزین برابر با ۱ است.

جدول ۲. تعیین وقفه بهینه

تعداد وقفه	معیار شوارتز- بیزین
۰	-۷/۴۸
۱***	-۱۴/۷۴
۲	-۱۳/۹۰
وقفه بهینه=۱****	

مأخذ: محاسبات محقق

٦-٤. تعیین بردارهای هم‌جمعی

پس از تعیین وقفه بهینه مدل خودرگرسیون برداری، در مرحله بعدی با استفاده از آماره‌های آزمون ماتریس اثر[1] و حداکثر مقادیر ویژه[2]، تعداد بردارهای هم انباشتگی تعیین می‌شود. با توجه به نتایج مندرج در جداول (۳)، و با استفاده از آزمون‌های λ_{max} و λ_{trace} الگوی مناسب و تعداد بردارهای هم‌جمعی را تعیین می‌کنیم.

جدول ۳. تعیین الگوی بهینه بر اساس بردارهای هم‌جمعی

آزمون	الگوی ۱	الگوی ۲	الگوی ۳	الگوی ۴	الگوی ۵
Trace	۲	۲	۱	۰	۱
Max-Eig	۲	۱	۱	۰	۰

مأخذ: محاسبات محقق

1. Trace Test
2. Maximum Eigen Value Test

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

بر اساس جدول (۳) و دو آزمون λ_{max} و λ_{trace} الگویی بهینه است که دارای کمترین بردارهای هم‌جمعی باشد. حال با توجه به اینکه آماره آزمون ماتریس اثر تعداد بردارهای کمتری را اعلام می‌کند پس در تعیین تعداد بردارهای هم‌انباشتگی، این آماره آزمون، ملاک عمل قرار می‌گیرد. بنابراین الگوی بهینه در این تحقیق الگوی ۳ است. برای یافتن این بردار هم‌جمعی ابتدا فرضیه صفر مبتنی بر صفر بردار هم‌جمعی r=0 در برابر فرضیه مقابل مبنی بر وجود یک بردار هم‌جمعی r=1 را مورد آزمون قرار می‌دهیم. تمامی کمیت‌های آماره آزمون مندرج در سطر اول برای الگوی سوم جدول (۴) از مقادیر بحرانی ارائه‌شده توسط یوهانسن و جوسیلیوس در سطح ۹۵ درصد بزرگ‌تر هستند. درنتیجه فرضیه r=0 بر اساس آزمون اثر و حداکثر مقدار ویژه در الگوی یادشده رد می‌شود.

همچنین فرضیه صفر مبنی بر وجود یک بردار هم‌جمعی در برابر فرضیه مبتنی بر وجود دو بردار هم‌جمعی یا بیشتر به استناد هر دو آزمون در الگوی مورد بررسی فقط یک بردار هم‌جمعی در الگوی مورد نظر است.

جدول ۴. کمیت آماره آزمون اثر به منظور تعیین الگوی مناسب و تعداد بردارهای هم‌جمعی

الگوی سوم				فرضیه‌ها	
آماره آزمون حداکثر مقدار ویژه	مقدار بحرانی	آماره آزمون اثر	مقدار بحرانی	H_1	H_0
۲۷/۵۸	۲۸/۴۰	۴۷/۸۵	۳۹/۵۲	r=1	r=0
۲۱/۱۳	۱۷/۷۷	۲۹/۷۹	۹۸/۲۶	r=2	r≤1
۱۴/۲۶	۷/۸۷	۱۵/۴۹	۲۰۸/۹	r=3	r≤2
۳/۸۴	۱/۳۳	۳/۸۴۱	۳۳۴/۱	r=4	r≤3

مأخذ: محاسبات محقق

پس از بررسی‌های لازم و تطبیق بردارهای الگوها با مبانی و اصول اقتصادی بردار هم‌جمعی، الگوی سوم بر مبنای آماره آزمون اثر برای رابطه بلندمدت بین متغیرها تخمین زده شده و بردارهای نرمال شده نسبت به متغیر درون‌زای اول انتخاب می‌شود. حال با توجه به بردار بهینه انتخاب‌شده در این مطالعه، معادله هم‌انباشتگی یا رابطه تعادلی بین متغیرهای مدل به صورت زیر به

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

دست می‌آید. این بردار بایستی از نظر علامت ضرایب متناسب با تئوری‌های اقتصادی بوده و همچنین ضرایب متغیرهای توضیحی به لحاظ آماری معنی‌دار باشند.

با توجه به نتایج به‌دست‌آمده طی دوره زمانی مورد مطالعه، متغیرهای جهانی شدن و رشد اقتصادی اثر مثبت بر فقر دارند، در حالی که بیکاری بر فقر اثر منفی دارد. بنابراین رابطه تعادلی بلندمدت میان فقر و متغیرهای مستقل جهانی شدن، رشد اقتصادی و بیکاری به‌صورت زیر به دست می‌آید:

$$\mathrm{LPOV} = -1.432LKOF - 0.547LGDP + 0.012LU \qquad (۳)$$

ضرایب در این معادله کشش‌ها را نشان می‌دهند. در اینجا کشش فقر نسبت به جهانی شدن بیشتر از کشش فقر نسبت به رشد اقتصادی است و این بدین معناست که یک درصد افزایش در شاخص جهانی شدن KOF موجب کاهش بیشتر در فقر در بلندمدت می‌شود. بنابراین افزایش جهانی شدن، کاهش فقر را در پی خواهد داشت و تأثیر آن به‌مراتب بیشتر از تأثیر رشد اقتصادی بر فقر است. همچنین کشش فقر نسبت به بیکاری بدین معناست که یک درصد افزایش در بیکاری موجب ۰/۰۱۲ درصد افزایش فقر می‌شود. البته باید در نظر داشت که این رابطه، یک رابطه بلندمدت بوده و چه بسا ممکن است در کوتاه‌مدت از این تعادل بلندمدت انحراف داشته باشیم. بنابراین برای نشان دادن این انحرافات و رابطه پویای کوتاه‌مدت و بلندمدت از الگوی تصحیح خطای برداری که تغییرات کوتاه‌مدت و رابطه بلندمدت را به هم پیوند می‌دهد استفاده می‌شود.

٦-۵. مدل تصحیح خطا

در این مرحله برای بررسی سرعت تعدیل خطای تعادل کوتاه‌مدت به سمت مقدار تعادلی بلندمدت از مدل تصحیح خطای برداری استفاده می‌کنیم. از آنجا که رگرسیون‌های بالا وجود رابطه بلندمدت را اثبات می‌کنند. مهم‌ترین بخش در مدل تصحیح خطا، ضریب جمله تصحیح خطا (ECM-1) است، که نشان‌دهنده سرعت تعدیل فرایند عدم تعادل به سمت تعادل در بلندمدت است. همان‌طور که در جدول (۵) ملاحظه می‌شود، این ضریب معنی‌دار، دارای علامت منفی بوده و هم‌جمعی بین متغیرها را تأیید می‌کند. ضریب این آماره در این تحقیق بدین معناست که در طول

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

یک دوره ۴۶٪ از عدم تعادل ایجادشده در متغیر وابسته، از مقادیر تعادلی بلندمدت خود در یک دوره، در دوره بعد تعدیل شده و از بین می‌رود. به بیان دیگر اگر شوک یا عدم تعادلی در نابرابری درآمد ایجاد شود، پس از تقریباً ۲ سال دوباره به تعادل بازخواهد گشت. بنابراین حرکت به سمت تعادل نسبتاً خوب است. علاوه بر این، معنی‌دار بودن ضریب تعدیل نشان می‌دهد که ارتباط علی بلندمدت بین متغیرها وجود دارد.

$$DLPOV = 0.045 - 1.12DLKOF + 0.49DLGDP + .44DLU - 0.46ECM(-1) \quad (۴)$$

جدول ۵. نتایج الگوی تصحیح خطا

نام متغیر	ضریب	انحراف معیار	مقدار آماره t	Prob
ECM (-1)	۰/۴۶	۰/۱۲	-۳/۶۱	۰/۰۰۱

منبع: محاسبات محقق

٦-٦. تجزیه واریانس

روش تجزیه واریانس، خطای پیش‌بینی قدرت نسبی زنجیره علیت گرنجر یا درجه برون‌زایی متغیر در ماورای نمونه را اندازه‌گیری می‌کند. منظور از محاسبه تجزیه واریانس این است که مشخص شود به طور نسبی میزان سهم و اهمیت یک تکانه ناشی از متغیر، در تغییرات خودش به تغییرات سایر متغیرها چقدر است. در این روش شوک‌های واردشده به متغیرهای گوناگون در واریانس خطای پیش‌بینی یک متغیر در کوتاه‌مدت و بلندمدت مشخص می‌شود. با تجزیه واریانس ما به دنبال این هستیم که با وارد کردن یک شوک به یک متغیر نشان دهیم که چند درصد از سهم این بی‌ثباتی ناشی از متغیر وابسته و چند درصد ناشی از سایر متغیرهاست. بدین ترتیب برای تعیین وزن هر یک از متغیرهای مورد بررسی بر فقر از تجزیه واریانس استفاده شده است. نتایج بیانگر آن است که در پنج‌ساله اول نزدیک به ۷۱ درصد متعلق به متغیر وابسته است، و سهم سایر متغیرها ناچیز است. در ده‌ساله اول نیز تقریباً ۵۷ درصد متعلق به متغیر فقر است، و بعد از آن بیشترین سهم را متغیر GDP با ۲۵ درصد دارد. این نتایج نشان می‌دهد که قدرت توضیح‌دهندگی رشد اقتصادی در بلندمدت بیشتر از سایر متغیرها است.

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

۷. نتیجه‌گیری

در این پژوهش با توجه به مبانی نظری فقر و مطالعات تجربی متغیر شاخص فقر که به صورت حداقل میزان انرژی به عنوان متغیر وابسته و شاخص جهانی شدن، رشد اقتصادی و بیکاری متغیرهای مستقل هستند؛ همچنین سعی شده با توجه به سال مورد بررسی و موجودیت دادها از شاخص جامع جهانی شدن اقتصادی KOF به عنوان متغیر توضیحی جهانی استفاده شود. این شاخص جهانی شدن هم جریان‌های واقعی تجارت از قبیل تجارت و سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی و سرمایه‌گذاری در پرتفولیو و هم موانع تجارت از قبیل محدودیت‌ها و تعرفه‌ها بر روی جریان‌های واقعی را در خود دارد. با توجه به مشخص شدن مانایی پس از انجام آزمون‌های ریشه واحد برای متغیرهای مدل که همگی با تفاضل مرتبه اول مانا هستند و تأییدیه بردار هم‌انباشتگی پس بررسی تمام حالت‌های آزمون یوهانسون از مقید تا غیرمقیدترین حالت، به منظور بررسی وجود روابط بلندمدت از آزمون همگرایی یوهانسن- جوسیلیوس استفاده شده است. نتایج حاکی از برآورد مدل نشان می‌دهند که تمام ضرایب از علامت‌های سازگار با تئوری برخوردار و از لحاظ آماری نیز در سطح بالایی معنی‌دار هستند. به طور کلی نتایج نشان می‌دهند که جهانی شدن و رشد اقتصادی باعث کاهش فقر و نابرابری در کشور، ولی بیکاری منجر به افزایش فقر در جامعه می‌شود. با توجه به نتایج حاصل، معنادار بودن ضریب تولید ناخالص داخلی (رشد اقتصادی) در الگوی بلندمدت نشان می‌دهد که رشد اقتصادی در بلندمدت فقر را کاهش می‌دهد. ضریب متغیر رشد اقتصادی در مدل بلندمدت بیانگر این است که با افزایش ۱ درصدی در تولید ناخالص داخلی میزان فقر به میزان ۰/۵۴ درصد کاهش می‌یابد. احتمالاً این امر به این دلیل است که با افزایش تولید ناخالص داخلی میزان محصولات داخلی یک کشور افزایش یافته، همچنین درآمدها افزایش می‌یابد، قدرت خرید مردم افزایش که این افزایش منجر کاهش میزان فقر می‌شود.

معنادار بودن ضریب جهانی شدن حاکی از کاهش فقر را دارد. با افزایش درجه جهانی شدن، فقر به میزان ۱/۴۳ درصد کاهش یافته است که علت این کاهش ناشی از ورود سرمایه‌گذاران خارجی و افزایش صادرات ناشی از مبادلات تجاری که می‌تواند از جهانی شدن یک کشور است.

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

معنادار بودن ضریب بیکاری در بلندمدت نشان می‌دهد که اثر بیکاری بر فقر موجب افزایش بیکاری که علت اصلی افزایش فقر است. در توضیح این متغیر کلیدی در این پژوهش می‌توان بیان کرد که احتمالاً با افزایش نرخ بیکاری توزیع درآمد نابرابرتر خواهد شد. بنابراین اشخاص بیکار دیگر قدرت خرید ندارند و هرچه این نرخ افزایش یابد، باعث افزایش دامنه فقر در جامعه خواهد شد.

با توجه به نتایج حاکی از تأثیر مثبت جهانی شدن و رشد اقتصادی بر فقر پیشنهاد می‌شود دولت سیاست‌های لازم جهت برداشتن موانع تجارت آزاد، تسهیل شرایط سرمایه‌گذاری و بهبود شرایط جهانی شدن را پیگیری کند. البته لازمه موفقیت در این زمینه ایجاد زیرساخت‌های مناسب است. همچنین می تواند با اعطای تسهیلات اعتباری به فعالان اقتصادی، افزایش سیاست‌های تشویقی جهت جذب سرمایه‌های خارجی، تأمین امنیت سرمایه‌گذاری و حرکت به سوی اقتصاد باز، شرایط را بهبود بخشند.

منابع

ابونوری، اسماعیل و رضا عباسی قادری (۱۳۸٦). «برآورد اثر رشد اقتصادی بر فقر در ایران». *فصلنامه پژوهش‌های اقتصادی ایران*. سال نهم. شماره ۳۰.

آذربایجانی، کریم؛ مرادپور اولادی، مهدی و زهرا نجفی (۱۳۹۳). «آزادسازی تجاری و سرمایه انسانی بر رشد اقتصادی ایران». *پژوهشنامه اقتصاد کلان*. سال نهم. شماره ۱۸. صص ۳۰-۱۳.

اصغرپور، حسین؛ سلمانی، بهزاد و صمد حکمتی فرید (۱۳۹۳). «بررسی تأثیر جهانی شدن بر توزیع درآمد». *فصلنامه سیاست‌های مالی و اقتصادی*. سال دوم. شماره ۶. صص ۱۴۰-۱۲۳.

اکبریان، رضا و نغمه زارع حقیقی (۱۳۹۰). «بررسی تأثیر باز بودن اقتصاد و رشد اقتصادی بر فقر: مورد ایران». *فصلنامه اقتصاد مقداری (بررسی‌های اقتصادی سابق)*. دوره ۸. شماره ۲. صص ۵۰-۲۵.

باقری، فریده و حسین کاوند (۱۳۸۷). «اثر رشد اقتصادی بر فقر و نابرابری در ایران (۱۳۸۴-۱۳۷۵)». *فصلنامه علمی پژوهشی رفاه اجتماعی*. سال هفتم. شماره ۲۸. صص ۱۹۱-۱۷۳.

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

پروین، سهیلا (۱۳۷۲). «زمینه‌های اقتصادی فقر در ایران» پایان‌نامه دکترا. دانشکده اقتصاد. دانشگاه تربیت مدرس.

حسن‌زاده، علی و مسعود فوز مسلمیان (۱۳۸۹). «ارزیابی آثار جهانی شدن بر فقر: مطالعه موردی کشورهای در حال توسعه». *پژوهشنامه اقتصادی*. سال دهم. شماره ۱. صص ۲۵۴-۲۲۳.

حسن‌زاده، علی (۱۳۸۷). «سیاست‌های مناسب به منظور جلوگیری از گسترش فقر در رابطه با عضویت در سازمان تجارت جهانی». کمیسیون اقتصاد کلان. بازرگانی و اداری- کمیته اقتصاد و تلفیق.

حکمتی فرید، صمد؛ جهانگیری، خلیل و امید مرادخانی (۱۳۹٤). «تأثیر جهانی شدن بر شاخص فقر انسانی (HPI)». *فصلنامه نظریه‌های کاربردی اقتصاد*. سال دوم. شماره ۲. صص ۸۰-۶۱.

درفان، لیلی و حمزه شیخیانی (۱۳۹٤). «اثرات جهانی شدن تجاری و مالی بر اندازه دولت در ایران». مجموعه مقالات کنفرانس بین‌المللی پژوهش‌های نوین در مدیریت. اقتصاد و حسابداری. موسسه ایده پرداز پایتخت ایلیا. استانبول. مرداد ۱۳۹۴. دانشگاه آزاد اسلامی واحد مرودشت.

روزبهان، محمود (۱۳۷۱). *مبانی توسعه اقتصادی* (چاپ اول). تهران: انتشارات مشعل آزادی.

صابونچی، محمدحسین و علی رشید زاده (۱۳۹۳). «اثر جهانی شدن و سرمایه‌گذاری خارجی بر روی توزیع درآمد در ایران». *مجله اقتصادی*. شماره‌های ۱ و ۲. صص ۱۳۴-۱۱۷.

عطر کار روشن، صدیقه و زهرا هاشمی (۱۳۹۵). «بررسی تأثیر باز بودن تجارت بر فقر در ایران با رویکرد سیستم معادلات هم‌زمان». *فصلنامه نظریه‌های کاربردی اقتصاد*، سال سوم. شماره ۱. صص ۲۰۴-۱۸۳.

کریمی هسنیجه، حسین؛ خوش‌اخلاق، رحمان و آزاده ملکی (۱۳۸۸). «باز بودن تجارت و تأثیر آن بر نابرابری درآمد در ایران و شرکای تجاری». مجموعه مقالات اولین همایش ملی اقتصاد. اسفند ۱۳۸۸. دانشگاه آزاد اسلامی واحد خمینی‌شهر.

کومسا، آسفائو (۱۳۷۸). جهانی شدن و منطقه گرایی و تأثیر آن بر کشورهای در حال توسعه. *اطلاعات سیاسی اقتصادی*. ترجمه اسماعیل مردانی گیوی. شماره‌های ۱۴۸ و ۱۴۷.

گیلیس، مالکوم؛ پرکینز، دوایت اچ؛ رومر، مایکل و دانلد آر اسنودگراس. *اقتصاد توسعه*. ترجمه غلامرضا آزاد. نشر نی. ۱۳۹۲.

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

میرجلالی، سید حسین (۱۳۸۲). «جهانی شدن و اقتصاد ایران». مجموعه گزارش‌های همایش چالش‌ها و چشم‌اندازهای توسعه ایران. مؤسسه آموزش و پژوهش مدیریت و برنامه‌ریزی. دفتر اول، خرداد ۱۳۸۲.

نژاد عبداله، معصومه؛ محتشمی برزادران، غلامرضا و مهدی یعقوبی اول ریابی (۱۳۹۲). «شاخص‌های توزیع درآمد در ایران». *مجله اقتصادی (دوماهنامه بررسی مسائل و سیاست‌های اقتصادی)*. شماره‌های ۹ و ۱۰. صص ۶۴-۴۹.

نوفرستی، محمد (۱۳۸۹). *ریشه واحد و هم‌جمعی در اقتصادسنجی (چاپ سوم)*. تهران: انتشارات آگاه.

Arize, A. A, Darrat (1994); "The Value Of Time and Recent U.S Mong Demand Instability", *Journal Southern Economic*, Vol. 60, PP. 564-578.

Bechtel, G. G. (2014), "Does globalization mitigate income inequality?", *Journal of Data Science*, Vol. 12: pp. 197-215.

Bergh, A.& Nilsson, T. (2014), "Is Globalization Reducing Absolute Poverty?" *World Development*, Vol. 62, pp. 42-61.

Castilho, M. (2012), "Trade liberation, Inequality, and Poverty in Brazilian States", *Word Developmen*t, Vol. 40, No, 4, pp. 821-835.

Dreher, A., Gaston, N., Martens, P. (2008), "Measuring globalization gauging its consequences", Springer: New York, *Journal of Globalization studies*, Vol. 1, pp. 166-185.

Dollar, D., Kraay, A. (2004), "Trade, Growth and Poverty", *The Economic Journal*, No. 114, pp. 22-49.

Dong, Fang. (2014), "The impact of economic openness on standard of living and income in equality in eight countries", *Emerging Markets Review*, No. 21(0): 234-264.doi: http://dx.doi.org/10.1016/j.ememar.2014.09.005.

IMF World Economic Outlook (1997), "Globalization Opportunities And Challenges", May 1997.

Johanson, Soren. And Katarina, Juselius. (1990), "Maximum Likelihood Estimation and inference on Cointegration with Application to The Demand for Money". *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*; Vol. 52, PP. 169-210.

Krugman, Paul, and Robin Wells (2009). *Macroeconomics 2*. New York City: Worth Publishers.

Lim, G. C., & McNelis, P. D. (2014). "Income Inequality, Trade and Financial Openness". Conference on "Macroeconomic Challenges Facing Low Income Countries". *Melbourne Institute Working*, Vol. 17, PP. 7-14.

Mitra, D. (2016), " Trade Liberalization and Poverty Reduction." *IZA World of Labor press*, Vol. 44 (272).

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

Mcculloch, N., and Baulch, B., and Cheel-Robson, M. (2001)," Poverty, Inequality and Growth in Zambia During the 1990s", Brighton: Institute of Development Studies, Working Paper 114.

Paulino, Amelia. U., (2012), "Trade, Income Distribution and Poverty in Developing Countries", United nation conference on Trade and Development, No. 207.

Pesaran, M. H., Shin, Y., Smith, R.J. (2001), "Bounds Testing Approaches to the Analysis of Level Relationships", *Journal of Applied Econometrics*, Vol. 16,No. 3, PP. 289-326.

Sen, Amartya. (1981), "Poverty and Famines. An Essay on Entitlement and Deprivation", *Clarendon Press*, Oxford, U.K. Vol. 32, pp. 881-886.

Townsend, P. (1979), "A Sociological Approach to Measurement of Poverty: A Rejoinder to Professor Amartya Sen", *Oxford Economic Papers*. Vol. 37, pp. 669-676.

Winters, L. (2000), "Trade, Trade Policy and Poverty: What are the links?", Discussion Paper, No. 2382. Vol. 25,pp. 1339-1367.

Winters, S. L., McCullouch, M. & McKay, A. (2004), "Trade Liberalization and Poverty: The Evidence So Far", *Journal of Economic Literature*, Vol. 42,No. 1, pp. 72–115.

World Bank. (2015). World Development Report Poverty 2015. New York: Oxford University Press.

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]

فصلنامه سیاست‌های مالی و اقتصادی

[Downloaded from qjfep.ir on 2026-11-11]