

بررسی تأثیر تجارت و سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی بر توزیع درآمد در ایران با رویکرد الگوی خودتوضیح با وقفه‌های گسترده (ARDL)

کریم آذربایجانی

دانشیار گروه اقتصاد، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد خوراسگان (اصفهان)

حسن ملاسمعیلی دهشیری

کارشناسی ارشد اقتصاد، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد خوراسگان (اصفهان)

hmesmaili@gmail.com

سعید دائی کریم زاده

استادیار گروه اقتصاد، دانشگاه آزاد اسلامی، واحد خوراسگان (اصفهان)

بر توزیع درآمد در کشور ایران است. براساس مبانی نظری و مطالعات تجربی مدلی ارائه می‌گردد که در آن نابرابری درآمدی (ضریب جینی) تابعی از چند متغیر اعم از سهم تجارت در تولید ناخالص داخلی و سهم سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی در تولید ناخالص داخلی، در نظر گرفته می‌شود. فرضیه تحقیق تأثیرگذاری مثبت تجارت و سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی بر کاهش نابرابری درآمدی در کشور ایران است. روش خود توضیح با وقفه‌های گسترده برای بررسی وجود رابطه بلندمدت میان متغیرها به کار گرفته شده و ضرایب مربوط به مدل‌های بلندمدت و تصحیح خطا در مورد نابرابری درآمدی برای ۳۳ سال از سال ۱۳۵۷ تا ۱۳۸۹

تجارت / سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی / نابرابری درآمدی /

خود توضیح با وقفه‌های گسترده / مدل تصحیح خطا

چکیده

عدالت اقتصادی و توزیع عادلانه درآمد در کنار مباحث مهمی چون رشد و توسعه اقتصادی، کاهش نرخ تورم و بیکاری، همواره مورد دغدغه‌ی غالب اقتصاددانان بوده است. توزیع عادلانه درآمد و کاهش نابرابری درآمدی در یک جامعه اسلامی که دارای منابع بسیار است و همچنین شناسایی عوامل موثر بر نابرابری درآمدی به منظور سیاست‌گذاری صحیح یک امر ضروری و بدیهی است. هدف این مقاله بررسی اثر تجارت و سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی

برآورد گردیده‌اند. نتایج حاصله نشان دهنده وجود یک رابطه بلندمدت بین متغیرها است و اینکه افزایش تجارت منجر به کاهش نابرابری درآمدی و افزایش جذب سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی سبب افزایش نابرابری درآمدی در بلندمدت می‌شود.

مقدمه

فقر یکی از وجوه تشابه کشورهای در حال توسعه است و معضلی است که بیشتر جوامع در ادوار مختلف با آن روبرو بوده‌اند، همچنین فقر عامل بسیاری از معضلات دیگر نظیر افزایش مرگ و میر، کاهش زاد و ولد، ناامنی و فساد و ... می‌باشد. اندازه و وسعت فقر در هر کشور تابع دو عامل است: سطح متوسط درآمد ملی، درجه نابرابری در توزیع درآمد. واضح است که در هر سطحی از درآمد ملی سرانه، هرچه توزیع درآمد ناعادلانه‌تر باشد میزان فقر بیشتر است [۱]. توزیع نابرابر درآمد سبب افزایش فاصله و شکاف طبقاتی، کاهش انگیزه برای کار، فقر گسترده، تنش‌ها و درگیری‌های سیاسی و فساد فراگیر، می‌شود. در نظام سرمایه‌داری (کاپیتالیسم)، که جهان‌بینی حاکم بر آن فلسفه دئیسم می‌باشد و خداوند را تنها آفریدگار می‌دانند. راهکار مسلط رشد اقتصادی بالا است و باید درآمد ملی روز به روز افزایش یابد هر چند عادلانه توزیع نشود. در حالی که در نظام اسلامی تاکید بسیار بر عدالت و برابری شده است. در سوره نساء آیه ۳۵، خداوند مومنان را امر به برپائی قسط و عدل می‌کند و همچنین خداوند در قرآن مقصود خود را از فرستادن پیامبران، کتاب و میزان را برپائی قسط و عدل می‌داند. بنابراین عدالت و توزیع عادلانه درآمد اهمیت بسیار، خصوصا در جوامع اسلامی دارد. توزیع نابرابر درآمد از راه‌های مختلف برای رشد و توسعه اقتصادی مضر است. در تمام کشورهای جهان درجاتی از نابرابری درآمدی وجود دارد و اختلاف بسیاری بین درآمد اقشار ثروتمند و اقشار فقیر در هر دو گروه کشورهای توسعه یافته و در حال توسعه یافت می‌شود. اما شکاف بین قشر فقیر و غنی در کشورهای کمتر توسعه یافته معمولا از کشورهای توسعه یافته بیشتر است. از اینجاست که لزوم تحقیق و واکاوی عوامل موثر بر نابرابری درآمدی (که منجر به فقر می‌شود) آشکار می‌شود زیرا با تحقیق و شناسایی عوامل موثر بر نابرابری و

ایجاد یک سلسله از راهکارهای سیاستی و طرح ریزی شده برای کاهش نابرابری و عملیاتی کردن سیاست‌ها، باعث کاهش فقر شده و بسیاری از معضلات جامعه را رفع می‌کند.

امروزه تجارت بین‌الملل نقش اساسی در زندگی اقتصادی بازی می‌کند. حجم تجارت جهانی در دهه‌های اخیر به‌صورت قابل توجهی افزایش یافته و مشاهده می‌شود کشورهایی که با سیاست توسعه صادرات به‌جای جایگزینی واردات پیش رفته‌اند به سمت صنعتی شدن و توسعه بیشتر حرکت کرده‌اند، بنابراین تجارت تأثیر به‌سزایی در پیشرفت و شکوفایی اقتصادی دارد اینکه آیا افزایش تجارت با دیگر کشورها و افزایش سهم تجارت در تولید ناخالص داخلی چه تأثیری بر نابرابری درآمدی دارد، در ادامه به آن پرداخته می‌شود.

از طرفی به خاطر منافع ناشی از سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی [۲]، اکثر کشورها خواهان جذب بیشتر FDI هستند. سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی فرآیندی است که توسط آن، یک کشور (کشور مبدأ)، مالکیت برخی از دارائی‌ها را در یک کشور دیگر (کشور میزبان) به هدف کنترل تولید، توزیع و دیگر فعالیت‌ها به دست می‌آورد (رضایی، ۱۳۸۴).

هدف این تحقیق بررسی تأثیر تجارت و FDI بر نابرابری درآمدی است، لذا فرضیه تحقیق به صورت ذیل مطرح می‌گردد: تجارت و FDI در بلندمدت تأثیر مثبت و معناداری بر نابرابری درآمدی در اقتصاد ایران دارند و باعث کاهش نابرابری می‌شوند. روش تحقیق الگوی خودتوضیح با وقفه‌های گسترده (ARDL) می‌باشد و داده‌ها برای ۳۳ سال از ۱۳۵۷ تا ۱۳۸۹ در مورد اقتصاد ایران جمع‌آوری شده است. در ادامه بحث ابتدا مبانی نظری و تئوریک تشریح می‌شود. بعد از آن مطالعات تجربی صورت گرفته در این زمینه مورد بررسی قرار گرفته است، در بخش بعد براساس مبانی نظری و مطالعات تجربی گذشته مدل ارائه می‌شود و متغیرها تعریف می‌شوند و نتایج حاصل از تخمین مورد بحث و بررسی قرار می‌گیرد و در نهایت راهکارهای سیاستی و عملی ارائه می‌گردد.

۱. مبانی نظری

به تولید و نیروی کار برای صادرات و واردات آمریکا را محاسبه نمود. هاربرلر نظریه تقسیم کار ناقص را مطرح کرد و عقیده داشت که تقسیم کار بین الملل و نیز تجارت بین المللی، به هر کشوری که وارد اقتصاد جهانی شود توانایی های لازم را می بخشد تا قادر به تخصص در تولید کالاهایی باشد که تولید و صدور آنها به نحو بهتر و ارزان تر امکان پذیر است. در نظر وی تقسیم کار بین المللی و تجارت جهانی از جمله عوامل اساسی فراهم آوری بهزیستی اقتصادی و افزایش درآمد ملی است (اسپنسر [۶]، ۱۹۸۸).

مدل هکشر، اوهلین [۷] (۱۹۵۲) به عنوان مدل استاندارد تجارت بین الملل با فرض وجود رقابت کامل در بازار عوامل تولید، عامل اساسی و تعیین کننده مزیت نسبی در کشورها را وفور نسبی عوامل تولید (زمین، منابع طبیعی، نیروی کار و سرمایه) می داند. براساس این نظریه، کشورهای توسعه یافته در تجارت خود با کشورهای در حال توسعه کالاها و خدمات متکی بر سرمایه و نیروی کار ماهر را صادر و در مقابل کالاها و خدمات متکی بر نیروی کار کم مهارت را وارد می نمایند. لذا در پی آزادسازی و رفع موانع تجاری، افزایش تجارت بین این دو گروه از کشورها باعث کاهش تقاضا برای کارگران غیرماهر در کشورهای توسعه یافته خواهد شد و این کاهش تقاضا با فرض ثابت بودن سایر شرایط، به کاهش دستمزدهای نسبی آنها منتهی می گردد که بزرگی این تأثیرگذاری بر دستمزدها به میزان حساسیت دستمزدها به تغییرات تقاضا بستگی دارد. در کشورهایی با دستمزدهایی انعطاف پذیر همچون آمریکا و کانادا، افزایش تجارت با کشورهای در حال توسعه به کاهش دستمزد نسبی کارگران کم مهارت منجر خواهد شد و در کشورهایی که دستمزدها انعطاف ناپذیری بیشتری دارند، مانند کشورهای اروپایی، افزایش تجارت با کشورهای در حال توسعه عمدتاً به بیکاری بیشتر کارگران کم مهارت خواهد انجامید (ماسی [۸]، ۱۹۹۷).

دو قضیه معروف از مدل هکشر، اوهلین به دست می آید که در ارتباط مستقیم با اثرات تجارت بر دستمزدها و قیمت دیگر عوامل تولید هستند، قضیه استالپر، ساموئلسون [۹] و قضیه برابری قیمت نهادهها. قضیه استالپر، ساموئلسون آثار وضع تعرفه را بر توزیع

عوامل زیادی بر سطح نابرابری درآمدی موثر هستند. کالسا (۲۰۰۳) این عوامل را به پنج دسته رشد و توسعه اقتصادی، عوامل جمعیت شناسی، عوامل سیاسی، عوامل تاریخی، فرهنگی و طبیعی و عوامل اقتصاد کلان تقسیم بندی می کند. یکی از عواملی که اخیراً مورد توجه محققین قرار گرفته است جهانی شدن می باشد که در اکثر تحقیقات داخلی تنها شاخص باز بودن تجارت وارد مدل شده و مورد بحث قرار گرفته است. اما در تحقیقات محققین خارجی نظیر کاسترو [۳] (۲۰۱۰)، باسو و جورجیا [۴] (۲۰۰۷)، هرزر و نانکمپ [۵] (۲۰۱۱) علاوه بر تجارت، سرمایه گذاری مستقیم خارجی نیز وارد مدل شده است. در ادامه به بیان مبنای نظری تأثیر تجارت و FDI بر توزیع درآمد پرداخته می شود.

۱-۱. تجارت و نابرابری در آمدی

سیر تجارت در دنیا، کشورهای با اقتصادی بسته را به سیستم های باز اقتصادی به صورت پویا، تغییر داده است. در این راستا می توان از نظریه مزیت مطلق آدام اسمیت در سال ۱۷۷۶ میلادی یاد کرد که کشورها تشویق به تولید و صادرات کالاهایی می شدند که در آن مزیت مطلق داشته باشند. پس از آدام اسمیت، ریکاردو نظریه مزیت نسبی را مطرح نمود که به نظریه هزینه نسبی نیز معروف است. که در این نظریه ریکاردو اثبات نمود که هر کشوری که در تولید یک کالا یا خدمت مزیتی نسبی داشته باشد، اگرچه مزیت مطلق نداشته باشد، موفق خواهد بود و عایدی و سود آن به تمامی کشورهایی که به این مبادله می پردازند، تعلق خواهد گرفت. هکشر- اوهلین نظریه وفور عوامل را مطرح نمودند و اقتصاددانان دیگری مانند جانسون، جونز، استالپر، ساموئلسن، آن دو را کامل کردند. بنابراین نظریه، هر کشور کالاهایی را صادر خواهد کرد که برای تولید آنها از منابع پر وفور خود نسبتاً به مقدار زیاد استفاده کرده است و کالاهایی را وارد خواهد کرد که عوامل تولید آنها در کشور کمیاب هستند. سپس نخستین کسی که نظریه هکشر- اوهلین را به بوتاه آزمایش گذاشت لئونتیف بود که برای آزمون فوق نسبت سرمایه

درآمد بین عوامل تولید بررسی می‌کند. افزایش قیمت کالاهای داخلی به دلیل وضع تعرفه‌های بالاتر و یا حمایت‌های غیر تعرفه‌ای (چون وضع سهمیه) باعث افزایش قیمت واقعی نهاده‌ای خواهد شد که در تولید آن کالا سهم بیشتری دارد. مثلاً اگر در تولید رایانه نیروی کار بیشتر و زمین کمتر و در تولید گندم زمین بیشتر و نیروی کار کمتر به کار گرفته می‌شود، این قضیه نشان می‌دهد که با وضع تعرفه بر واردات رایانه دستمزد واقعی کارگران نسبت به اجاره زمین افزایش خواهد یافت. بحث به این صورت است که در یک کشور کوچک وضع تعرفه قیمت کالاهای وارداتی را نسبت به کالاهای صادراتی به مقدار تعرفه افزایش می‌دهد که با فرض همگن بودن کالاها افزایش مشابه در قیمت کالاهای داخلی جایگزین واردات را در پی خواهد داشت و این امر نیز به نوبه خود باعث انتقال منابع از تولید کالاهای صادراتی به تولید کالاهای جایگزین واردات خواهد گردید. در نتیجه تقاضا و به تبع آن دستمزد نسبی نهاده‌ای که در صنایع جایگزین واردات شدت کاربری فراوان‌تری دارد، نسبت به نهاده‌ای که شدت کاربری کمتری دارد افزایش می‌یابد. از آنجا که کالاهای جایگزین واردات از نهاده‌ای بیشتر استفاده می‌کنند که در کشور کمیاب‌تر است، با وضع تعرفه قیمت نسبی این نهاده‌ها افزایش می‌یابد (وولف [۱۰]، ۲۰۰۰). بنابراین آزادسازی تجارت در هر کشور تقاضا را برای نهاده تولیدی که نسبتاً در آن کشور فراوان‌تر است، افزایش خواهد داد و به تبع آن قیمت آن نهاده نیز بالاتر خواهد رفت. از آنجا که در کشورهای توسعه یافته نیروی کار ماهر و در کشورهای در حال توسعه نیروی کار غیرماهر دارای فراوانی نسبی می‌باشند، آزادی تجارت بین این دو گروه از کشورها، باعث افزایش تقاضا و دستمزد کارگران ماهر در کشورهای توسعه یافته خواهد شد، اما در کشورهای در حال توسعه بر تقاضا و دستمزد کارگران غیرماهر افزوده خواهد شد. در نتیجه آزادسازی تجارت در کشورهای در حال توسعه بر خلاف کشورهای توسعه یافته، نابرابری را کاهش خواهد داد (نجاززاده و مهدوی راسخ، ۱۳۸۹).

قضیه دوم قضیه برابری قیمت نهاده‌ها می‌باشد، طبق این قضیه با وجود رژیم آزاد تجاری، قیمت عوامل تولید در بین کشورهای طرف تجاری به یکدیگر نزدیک و در نهایت یکسان

خواهد گردید. به عبارت دیگر تجارت آزاد بین‌المللی موجب برابری دستمزدهای واقعی نیروی کار یکسان و نیز برابری نرخ‌های بهره واقعی سرمایه‌های یکسان در دو کشور می‌شود. بنابراین تجارت آزاد در کشورهای طرف تجاری توزیع درآمد را تحت تأثیر قرار می‌دهد. البته به دلیل غیر واقعی بودن برخی از فرض این نظریه همچون وجود شرایط رقابت کامل در یک دنیای دوکالایی و نیز فرض عدم وجود هزینه‌های حمل و نقل، نظریه برابری قیمت نهاده‌ها فاقد ساختار تئوریک می‌باشد (همان منبع).

از طرفی دیگر، تأثیر تجارت بر رفاه و به نوعی کاهش فقر و نابرابری را می‌توان اینگونه بیان کرد که در صورت تجارت کشور با دنیای خارج قیمت کالاهای قابل مبادله در کشورها تغییر می‌کند همچنین امکان دسترسی بهتر به کالاها و محصولات جدید فراهم می‌آید. همچنین تجارت بر درآمدهای دولت از محل مالیات‌های تجاری تأثیر می‌گذارد. در صورت آزاد بودن تجارت با پایین بودن قیمت کالاهای وارداتی و رقابت با کالاهای تولید داخل و کاهش سطح عمومی قیمت‌ها درآمدهای واقعی مردم افزایش یافته مخصوصاً در طبقه‌های پایین درآمدی جامعه، و بر نابرابری درآمدی تأثیر می‌گذارد. همچنین افزایش صادرات یک مشوق برای تولید و درآمد بیشتر است و نتیجتاً اشتغال بیشتر و سطح دستمزد بیشتر را خواهیم داشت. سیاست‌های دولت در جهت افزایش تجارت بعضاً منجر به افزایش درآمد می‌شود به‌عنوان نمونه دولت با کم کردن تعرفه‌های بالا انگیره فساد و قاچاق را کاهش می‌دهد. بنابراین می‌توان تأثیر تجارت بر رفاه و نابرابری درآمدی را به صورت ذیل دسته‌بندی کرد: اول: تغییر قیمت کالاهای قابل مبادله و دسترسی بهتر و آسان‌تر آنها به محصولات جدید، دوم: تغییر دستمزدهای نسبی نیروی کار ماهر و غیر ماهر و هزینه سرمایه و در نتیجه تأثیر بر اشتغال افراد فقیر، سوم: تأثیر بر درآمدهای دولت از محل مالیات‌های تجاری و کاهش توانایی آن برای تامین اعتبار برنامه‌هایی برای فقیران، چهارم: ایجاد تغییر در انگیزه‌های سرمایه‌گذاری و نوآوری و تأثیر بر رشد اقتصادی، پنجم: تأثیر بر میزان آسیب‌پذیری اقتصاد در برابر شوک‌های منفی خارجی (بنیستر و تاوگ، ۱۳۸۱).

با میان آوردن بحث تجارت در ایران ذهن به سمت صادرات نفتی می‌رود چرا که ایران با داشتن منابع عظیم نفت و گاز از کشورهای ثروتمند و غنی در جهان است. صادرات نفتی زیر بنای اقتصاد ایران است و ضروری است که بیشتر درآمد نفتی صرف سرمایه‌گذاری در بخش‌های مولد گردد. هر ساله بودجه بخش‌های مختلف کشور بر اساس قیمت نفت تقسیم می‌شود وابستگی بیش از حد اقتصاد ایران به صادرات نفتی یکی از بزرگترین معضلات اقتصاد کشور است که بحث آن در این مقاله نمی‌گنجد.

در بخش صادرات غیر نفتی، فروش کالاهای مازاد تولید و مصرف منجر به افزایش تولید ملی می‌شود و به‌دست آوردن بازارهای جدید باعث ایجاد سرمایه‌گذاری، اشتغال و درآمدزایی بیشتر می‌شود. اما اگر کالایی از کشور صادر شود که مورد نیاز مصرف‌کنندگان داخلی باشد ممکن است به کاهش مصرف منجر شود و این دقیقاً همان اتفاقی است که می‌تواند برای اقتصاد ایران رخ داده باشد زیرا بسیاری از کالاهای صادراتی (به خصوص محصولات کشاورزی) همچنان مورد نیاز مصرف‌کنندگان داخلی است و صادرات آنها سبب کاهش مصرف داخلی و افزایش قیمت آنها می‌شود (تقوی و غروی نخجوانی، ۱۳۸۲). همین افزایش قیمت و صادرات کالاهای مورد نیاز داخل بر قدرت خرید اقشار ضعیف و کم درآمد منفی می‌گذارد و منجر به نابرابری بیشتر می‌شود پس نمی‌توان گفت که صادرات در همه موارد منجر به کاهش نابرابری درآمدی می‌شود.

یکی از اهداف اصلی توسعه صادرات، ارتقای کیفیت محصولات و بالا بردن سطح دانش و فن آوری در کشور است. این همان هدفی است که مهمترین ویژگی راهبرد توسعه صادرات تلقی می‌شود و از آن رو اعمال همزمان دو راهبرد جانشینی واردات و توسعه صادرات در کشورهای آسیایی موفق بوده است که گسترش و توسعه صادرات موجبات رقابت و در پی آن بهبود کیفیت و فن آوری را در محصولاتی که تولید آنها متکی بر سیاست جانشینی واردات بوده فراهم کرده است. این در حالی است که در ایران این مسئله به دست فراموشی سپرده شده است و از یک سو به دلیل درآمدهای نفتی، جذابیت تبلیغات سیاسی و ذینفع بودن دولت در برخی از صنایع سودآور، سیاست

جانشینی واردات ادامه می‌یابد و از سوی دیگر، تکیه بر صادرات کالاهایی می‌شود که تولید آنها مبتنی بر سنتی‌ترین و ابتدایی‌ترین فن‌آوری‌های جوامع بشری است (تقوی و غروی نخجوانی، ۱۳۸۲). این در صورتی است که اگر توسعه صادرات در ایران با جدیت بیشتر و با فراهم شدن امکانات و زیر ساخت‌های لازم اجرایی می‌شد تأثیر بسزایی بر فقر و نابرابری می‌داشت چرا که اقشار آسیب پذیر با اشتغال بیشتر در کارخانه‌های تولیدی و همچنین منتفع شدن از کالاهای ارزان ناشی از واردات به سطح بالاتری از رفاه می‌رسیدند. این امکان نیز وجود دارد که در صورت آزادسازی تجاری و بیشتر شدن سطح واردات بجای صادرات و ورود کالاهای ارزان قیمت باعث از بین رفتن صناعی که قدرت رقابت‌پذیری ندارند شود و منجر به بیکاری تعداد وسیعی از اقشار ضعیف و کم درآمد گردد و منجر به بدتر شدن توزیع درآمد گردد. بنابراین اینکه سطح تجارت بالا با دنیای خارج چه تأثیری بر نابرابری درآمدی خواهد گذاشت بستگی به شرایط اقتصادی، اوضاع و رقابت‌پذیری بنگاه‌های تولیدی داخل دارد.

۲-۱. FDI و نابرابری در آمدی

رقابت در عرصه‌های جهانی و در قلمرو اقتصادی از راه سرمایه‌گذاری در بخش‌های مختلف اقتصادی برای ایجاد فرصت‌های شغلی صورت می‌پذیرد. در کشورهایی که پس‌انداز ملی کمی دارند یکی از بهترین روش‌های تامین مالی جهت سرمایه‌گذاری، جذب FDI است که تأثیرات مثبت و منفی بر کشور میزبان خواهد گذاشت. کشورهایی که دارای سرمایه لازم نبوده‌اند از گام نهادن در جهت توسعه و پیشرفت اقتصادی عقب مانده‌اند که همین امر سبب رواج فقر و نابرابری، رکود اقتصادی و بیکاری گردیده است. سرمایه کالا یا ثروتی است که می‌توان آن را با دیگر عوامل تولید ترکیب کرد تا به تولید کالاها یا افزایش ثروت منجر شود و سرمایه‌گذاری تغییرات حجم سرمایه موجود در یک دوره معین است، به‌عبارتی سرمایه‌گذاری در حقیقت تشکیل سرمایه است. UNCTAD سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی را اینگونه تعریف می‌کند: سرمایه‌گذاری که طی

یک دوره بلندمدت، کنترل سود پیوسته شخصیت حقیقی یا حقوقی مقیم یک کشور خارجی را در شرکتی واقع در کشور میزبان عهده‌دار است. به طور کلی در خصوص تأثیر جذب FDI بر کشور میزبان دو دیدگاه موافق و مخالف وجود دارد.

تودارو استدلال‌های موافق سرمایه‌گذاری خارجی را بیشتر نتیجه تحلیل‌های سنتی نئوکلاسیک‌ها در مورد عوامل تعیین‌کننده رشد اقتصادی می‌داند. او بیان می‌کند سرمایه‌گذاری خصوصی خارجی به طور معمول به عنوان راهی برای پر کردن شکاف‌های میان موجودی داخلی پس‌انداز، ارزش خارجی، درآمد دولت و مهارت‌ها، و سطح برنامه‌ریزی شده این منابع مورد نیاز برای نیل به هدف‌های توسعه است. بنابراین مهمترین و اصلی‌ترین کمک FDI به توسعه ملی پر کردن شکاف منابع میان سرمایه‌گذاری مورد نظر یا مطلوب و پس‌اندازهای تجهیز شده داخلی است. دومین کمک، پر کردن شکاف میان نیازهای ارزش خارجی مورد نظر و نیازهای حاصل از درآمدهای خالص ناشی از صادرات است. شکاف میان درآمدهای مالیاتی مورد نظر دولت و مالیات‌هایی که دولت اخذ می‌کند با سرمایه‌گذاری‌های خارجی برطرف خواهد شد. به طور خلاصه موافقان جذب FDI علت را اثرات مثبت جذب FDI بر اقتصاد کشور میزبان نظیر تامین سرمایه، انتقال تکنولوژی پیشرفته، انتقال مهارت مدیریت و دانش و ارتقای توان نیروی کار، توسعه منابع مالی و انسانی، گسترش بازرگانی خارجی، برانگیخته شدن حس رقابت در بین بنگاه‌ها و شرکت‌های تولیدی کشور میزبان، تسهیل شدن ورود به بازارهای جهانی می‌دانند.

استدلال‌های اساسی علیه سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی عبارتند از: ۱- با اینکه شرکت‌های چند ملیتی فراهم‌کننده سرمایه هستند ولی ممکن است نرخ‌های پایین‌تر پس‌انداز داخلی و سرمایه‌گذاری را به اشکال زیر کاهش دهند: با از بردن رقابت، کوتاهی در سرمایه‌گذاری مجدد بخش اعظم سودهای خود، ایجاد درآمدهای محلی برای گروه‌هایی که تمایل به پس‌انداز کمتری دارند، جلوگیری از گسترش شرکت‌های داخلی که ممکن است عرضه‌کننده کالاهای واسطه‌ای به این شرکت‌ها باشند با وارد کردن این گونه کالاها از شعبات وابسته خارجی خود

و وضع بهره زیاد بر سرمایه‌های قرض گرفته شده توسط دولت‌های میزبان. ۲- اگرچه تأثیر اولیه سرمایه‌گذاری شرکت‌های چند ملیتی بهبود وضع ارزش خارجی شرکت دریافت‌کننده است، تأثیر بلندمدت آن ممکن است کاهش دریافتی‌های ارزی حساب‌های جاری و سرمایه‌ای این کشورها باشد. بدتر شدن وضع حساب‌های جاری احتمالاً به سبب افزایش واردات کالاهای واسطه‌ای و سرمایه‌ای است، در حالی که خراب شدن وضع حساب سرمایه ممکن است به دلیل برگشت دادن منافع، حق امتیازها و حقوق مدیریت و خروج سرمایه به خارج از کشور باشد. ۳- در حالی که شرکت‌های چند ملیتی از طریق مالیات‌هایی که دولت بر شرکت‌ها می‌بندد به درآمدهای دولتی کمک می‌کنند، ولی می‌توانند این درآمدها را با استفاده از امتیازات مالیاتی، کمک به سرمایه‌گذاری اضافی، کمک‌های مخفی دولتی و حمایت تعرفه‌ای کشور میزبان کاهش دهند. ۴- مدیریت، مهارت‌های کار فرمایی، تکنولوژی و بالاخره تماس‌های خارجی شرکت‌های چند ملیتی ممکن است تأثیر بسیار ناچیزی در توسعه منابع داخلی این مهارت‌ها و منابع داخلی به دلیل حاکمیت شرکت‌های چند ملیتی بر ابزارهای داخلی، محدود کند (تودارو، ۱۳۸۳). به طور خلاصه مخالفان معتقدند ورود شرکت‌های خارجی به بازار داخل تعادل بازار را برهم زده و منجر به فشار بر بنگاه‌های داخلی می‌شود و اثرات منفی دیگری نظیر غارت منابع طبیعی و وابستگی اقتصادی بر جا خواهد گذاشت.

شاخص عملکرد ورود FDI به یک کشور نسبت سهم آن کشور در جریان FDI جهانی به سهم آن کشور در GDP جهانی است (رضایی، ۱۳۸۴). یعنی هر چه سهم یک کشور از GDP جهانی بیشتر باشد سرمایه خارجی بیشتری جذب می‌کند و باعث اشتغال بیشتر و افزایش سطح دستمزد می‌شود و بر توزیع درآمد در جامعه موثر است. با وجود تجارت آزادانه بین کشورها انگیزه‌های جدید سرمایه‌گذاری و نوآوری ایجاد می‌شود. اصلاحات تجاری معمولاً باعث ترغیب FDI می‌شود و سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی سبب ورود تکنولوژی و فناوری‌های جدید می‌شود. ورود روش‌های تجاری و فناوری‌های

نوین باعث افزایش بهره‌وری، رشد بنگاه‌های داخلی و همچنین اشتغال بیشتر می‌شود و از این طریق بر توزیع درآمد تأثیرگذار است. در مورد اقتصاد ایران در سال‌های پس از پیروزی انقلاب اسلامی مسئله فقر و نابرابری بیشتر مورد توجه بوده و منابع و امکانات قابل ملاحظه‌ای تحت عنوان کمک به اقشار محروم و مناطق دور افتاده صرف شده است ولی این برنامه‌ها کارایی چندانی در جهت کاهش نابرابری نداشته است. قسمت عظیمی از منابع عمومی صرف یارانه‌ها شده که آن هم بیشتر عاید قشر ثروتمند و مرفه گردیده و حتی موجب نابرابری بیشتر شده است. ولی با سیاست‌های جدید تحت عنوان هدفمندسازی یارانه‌ها در راستای جهاد اقتصادی امید برای کاهش نابرابری بیشتر شده است. حسن زاده در مورد عوامل موثر بر فقر در ایران فرضیاتی را مطرح می‌کند که یکی از آنها این است که صنعتی شدن از عوامل کاهنده فقر است. جذب FDI را می‌توان یکی از عوامل صنعتی شدن، افزایش اشتغال و تولید دانست و می‌تواند بر فقر و نابرابری تأثیر مثبت داشته باشد. در مجموع می‌توان گفت که تجارت از طریق ورود کالای ارزان‌تر نسبت به داخل، ایجاد فرصت‌های شغلی، افزایش درآمد و FDI از طریق ورود تکنولوژی و فناوری بر توزیع درآمد تأثیرگذار است.

۲. پیشینه تحقیق

در مورد نابرابری درآمدی در ایران تحقیقات بسیاری صورت گرفته است که قسمتی از آن به صورت زیر مطرح می‌شود:

ابونوری و خوشکار (۱۳۸۷) به بررسی عوامل موثر بر نابرابری اقتصادی در ایران با استفاده از ریز داده‌ها پرداختند آنها به این نتیجه رسیدند که نسبت اشتغال و درآمدهای مالیاتی بر حسب خانوار به ترتیب قوی‌ترین عامل کاهنده و افزایش‌دهنده نابرابری اقتصادی بوده است. اما اثر نابرابرگر درآمدهای مالیاتی بر حسب خانوار از اثر برابرگر نسبت اشتغال بیشتر بوده است. آنها سیاست‌گذاری در جهت افزایش فرصت‌های اشتغال مولد در کنار اصلاح‌های اساسی و ساختاری در نظام مالیاتی به‌ویژه در حوزه اجرایی و جمع‌آوری مالیات را پیشنهاد کرده‌اند. هادی و زنور (۱۳۸۴) در تحقیقی نابسامانی‌های ناشی از جنگ، تحریم‌های

اقتصادی، تورم بالا و رشد سریع جمعیت را عوامل افزایش دهنده نابرابری در دوره بعد از انقلاب ذکر می‌کنند.

تأثیر تورم بر نابرابری به گونه‌ای که با افزایش تورم نابرابری افزایش می‌یابد در مورد اقتصاد ایران در چندین مطالعه تأیید شده از جمله صمدی (۱۳۷۱)، ابونوری (۱۳۷۶)، پروین و زیدی (۱۳۸۰)، ابونوری و خوشکار (۱۳۸۵). مهربانی (۱۳۸۷) تأثیر آموزش بر نابرابری را مورد مطالعه قرار داده او از بعد نظری، با انتخاب رویکرد کینزی، نشان می‌دهد که آموزش از سطح فقر و نابرابری درآمدها می‌کاهد و از بعد تجربی با استفاده از ۱۱۱ مشاهده از ۹۱ کشور با سطوح توسعه انسانی متفاوت به این نتیجه رسیده است که نرخ ثبت نام در مقطع دبیرستان دارای رابطه‌ای معکوس و معنادار با فقر و نابرابری درآمدها است و نسبت مخارج آموزشی به GNP نیز از سطح فقر و نابرابری درآمدها به طرز معناداری کاسته است. از دیگر یافته‌های او این است که تأثیر مخارج آموزش عالی بر فقر و نابرابری از تأثیر مخارج آموزش در مقاطع ابتدایی و متوسطه بر فقر و نابرابری بزرگتر است.

نجم زاده و مهدوی راسخ (۱۳۸۹) در مقاله‌ای تأثیر جهانی شدن بر توزیع درآمد در کشورهای عضو گروه دی هشت را به‌روش داده‌های تابلویی طی دوره ۱۹۹۵ تا ۲۰۰۴ مورد بررسی قرار داده‌اند. یافته‌های تحقیق آنها حاکی از آنست که آزادسازی تجاری منجر به بهبود توزیع درآمد و کاهش نابرابری در کشورهای مورد مطالعه می‌شود.

بابا زاده و همکاران (۱۳۸۹) به بررسی تجربی ارتباط میان توزیع درآمد و تجارت خارجی در اقتصاد ایران پرداخته‌اند. نتایج بررسی تجربی آنها نشان می‌دهد که تجارت خارجی موجب کاهش نابرابری درآمدی در ایران می‌شود ولی دارای اثر چشمگیری نمی‌باشد. همچنین صادرات غیرنفتی اثر معنی‌دار بر توزیع درآمد ندارد ولی در مقابل صادرات نفتی منجر به افزایش نابرابری درآمدی در ایران می‌شود و واردات نیز موجب بهبود شاخص توزیع درآمد در ایران می‌شود.

گالبرایت [۱۱] (۲۰۰۸) در مورد رابطه نابرابری، بیکاری و رشد بیان می‌کند که افزایش بیکاری باعث افزایش نابرابری می‌شود.

۳. روش شناسی تحقیق و ارائه مدل

یکی از مدل‌های پویا که برای رابطه‌ی ایستای بلندمدت بین متغیرهای توضیحی و متغیر وابسته می‌توان بیان داشت مدل خود توضیح با وقفه‌های گسترده (ARDL) [۱۳] است. زمانی که در سری داده‌ها شکست ساختاری مشاهده نشود می‌توان با استفاده از این مدل به برآوردهای نسبتاً بدون تورشی از ضرایب بلندمدت دسترسی پیدا نمود. یکی از دلایل برتر دانستن رویکرد ARDL این است که این روش صرف نظر از اینکه متغیرهای موجود در مدل I(0) یا I(1) هستند، قابل کاربرد است. دلیل دیگر اینکه این روش در نمونه‌های کوچک یا محدود کارایی نسبتاً بیشتری در مقایسه با روش‌های دیگر نظیر هم‌انباشتگی انگل-گرنجر دارد. باید توجه داشت که تکنیک ARDL را در صورت وجود سری‌های زمانی I(2) در مدل، نمی‌توان به کار برد. مدل خود توضیح با وقفه‌های گسترده $ARDL(p, q_1, q_2, \dots, q_k)$ به صورت زیر می‌باشد:

$$\alpha(L, P)y_t = \alpha_0 + \sum_{i=1}^k \beta_i(L, P)x_{it} + \lambda w_t + \varepsilon_t \quad (1)$$

جایی که:

$$\alpha(L, P)y_t = 1 - \alpha_1 L - \alpha_2 L^2 - \dots - \alpha_p L^p$$

$$\beta_i(L, q_i) = \beta_{i0} + \beta_{i1} L + \beta_{i2} L^2 + \dots + \beta_{iq_i} L^{q_i} \quad i = 1, 2, \dots, k$$

در معادله فوق y_t متغیر وابسته، α جزء ثابت، L عملگر وقفه (مانند $Ly_t = y_{t-1}$) و w_t بردار $1 \times S$ از متغیرهای قطعی، نظیر عبارت عرض از مبدأ، روندهای زمانی یا متغیرهای برون‌زا با وقفه‌های ثابت می‌باشد. در معادله فوق، ضرایب بلندمدت به صورت زیر محاسبه می‌شود:

$$H = \frac{\hat{\lambda}(\hat{p}, \hat{q}_1, \hat{q}_2, \dots, \hat{q}_k)}{1 - \hat{\alpha}_1 - \hat{\alpha}_2 - \dots - \hat{\alpha}_p}$$

که رابطه $\hat{\lambda}(\hat{p}, \hat{q}_1, \hat{q}_2, \dots, \hat{q}_k)$ تخمین‌های OLS از λ را در معادله (۱) برای مدل ARDL انتخابی معرفی می‌کند.

مدل تصحیح خطا (ECM) مرتبط با $ARDL(\hat{p}, \hat{q}_1, \hat{q}_2, \dots, \hat{q}_k)$ با نوشتن معادله (۱) برحسب سطوح وقفه داده شده و تفاضل مرتبه اول متغیرهای y_t ، $x_{1t}, x_{2t}, \dots, x_{kt}$ و w_t به دست می‌آید:

کاسترو (۲۰۱۰) به بررسی تأثیر تجارت و FDI بر نابرابری درآمدی در ۹۳ کشور می‌پردازد. او نابرابری درآمدی خانوارها را تابعی از تجارت، FDI، تورم و آموزش در نظر می‌گیرد. روش تحقیق وی داده‌های تابلویی می‌باشد. او همچنین در مورد پایداری، اقتصاد کلان و حکمرانی بحث می‌کند و به این نتیجه می‌رسد که تجارت تأثیر مثبت بر توزیع درآمد دارد در حالی که FDI و تورم باعث افزایش نابرابری می‌شوند و در بلندمدت اشتغال در صنعت، تجارت و صادرات کارخانه‌ای می‌تواند تأثیر منفی FDI و تورم را بر نابرابری کاهش دهد. باسو و جورجیا (۲۰۰۷) به بررسی تأثیر FDI بر نابرابری و رشد در مورد ۱۱۹ کشور در حال توسعه به روش داده‌های تابلویی پرداختند آنها به این نتیجه رسیدند که FDI افزایش دهنده نابرابری و رشد در کشورهای در حال توسعه است و سبب کاهش سهم کشاورزی در GDP می‌شود. دالر و کری [۱۲] (۲۰۰۰) به بررسی رشد اقتصادی و درآمد متوسط افراد فقیر در مورد ۹۲ کشور پرداختند. آنها به این نتیجه رسیدند که مولفه‌های رشد اقتصادی اثر بسیار کمی بر سهم درآمد فقیرترین افراد دارد و متوسط درآمد ۵۰ درصد افراد فقیر جامعه با متوسط درآمد کل به یک نسبت افزایش می‌یابد.

هرزر و نانکمپ (۲۰۱۱) رابطه میان FDI و نابرابری درآمدی را در مورد اروپا تحقیق کردند و آنها از طریق داده‌های تابلویی و آزمون علیت، ۱۰ کشور با درآمدهای سرانه متفاوت را طی ۲۰ سال از ۱۹۸۰ تا ۲۰۰۰ مورد بررسی قرار دادند و یافته خود را در چهار قسمت بیان کرده‌اند: نخست اینکه FDI یک تأثیر مثبت در کوتاه‌مدت بر نابرابری در اروپا دارد. دوم: اگرچه در بلندمدت FDI به طور متوسط تأثیر منفی بر نابرابری دارد. سوم: اما آزمون علیت بیان می‌کند در بلندمدت افزایش در FDI کاهش نابرابری را دارد و نابرابری بالاتر باعث کاهش جریان FDI می‌شود. و در نهایت، در مورد تأثیر بلندمدت FDI بر نابرابری درآمدی در بلندمدت تفاوت زیادی در مورد دو کشور ایرلند و اسپانیا وجود دارد که نشان‌دهنده یک رابطه مثبت بین FDI و نابرابری درآمدی است.

تولید ناخالص داخلی، \inf و edu به ترتیب نشان دهنده نرخ تورم سالانه و نرخ سواد (شاخص ثبت نام شدگان در مقطع متوسطه) در کشور هستند. همچنین gdpp تولید ناخالص داخلی سرانه واقعی و gdpp^2 مربع تولید ناخالص داخلی سرانه واقعی را نشان می‌دهد. داده‌ها از سایت مرکز آمار ایران و شاخص‌های توسعه جهانی که توسط بانک جهانی منتشر می‌شود جمع آوری شده است.

۳-۱-۳. برآورد مدل

برآورد مدل مطرح شده به روش ARDL طی مراحل زیر صورت می‌گیرد:

۳-۱-۱. آزمون ریشه واحد

یک فرآیند تصادفی هنگامی ایستا [۱۵] است که میانگین و واریانس طی زمان ثابت باشد و مقدار کوواریانس بین دو دوره‌ی زمانی، تنها به فاصله یا وقفه‌ی بین دو دوره بستگی دارد و ارتباطی به زمان واقعی محاسبه‌ی کوواریانس نداشته باشد. وجود متغیرهای نامانا باعث می‌شود که آزمون‌های F و t از اعتبار برخوردار نباشند و رگرسیون به یک رگرسیون کاذب تبدیل گردد. لذا در مرحله اول آزمون دیکی فولر تعمیم یافته (ADF) برای بررسی ایستایی سری‌های زمانی مورد نظر انجام گرفته، که نتایج آن در جدول (۱) مشاهده می‌گردد:

جدول ۱- نتایج آزمون دیکی فولر تعمیم یافته برای

بررسی مانایی متغیرها

متغیرها	مقادیر اصلی		تفاضل مرتبه اول	
	با عرض از مبدا و بدون روند	با عرض از مبدا و روند	با عرض از مبدا و بدون روند	با عرض از مبدا و روند
gini	-۳/۷۰	-۳/۹۶	-	-
tragdp	-۱/۰۶	-۳/۳۰۷	-۴/۶۵۴	-۴/۷۰۷
fdigdp	-۲/۲۳۱	-۳/۱۳۲	-۵/۷۹۰	-۵/۶۶۳
inf	-۴/۰۷۴	-۴/۱۰۷	-	-
edu	-۲/۸۵۸	-۰/۲۴۱	-۳/۴۳۹	-۴/۱۲۱
gdpp	-۲/۴۱۱	-۲/۴۶۱	-۴/۵۷۴	-۴/۷۵۶
gdpp2	-۰/۰۲۶	-۰/۸۴۳	-۴/۲۳۸	-۴/۵۰۶
مقدار بحرانی در سطح ۵٪	-۲/۹۵۷	-۳/۵۵۷	-۲/۹۶۰	-۳/۵۶۲

منبع: یافته‌های تحقیق

$$\Delta y_t = \Delta \alpha_o - \alpha(l, \hat{p})ECM_{t-1} + \sum_{i=1}^k \beta_{iq} \Delta x_{it} + \lambda' \Delta w_t - \sum_{j=1}^{p-1} \alpha_{oj} \Delta y_{t-j} - \sum_{i=1}^k \sum_{j=1}^{p-1} \beta_{ij} \Delta x_{i,t-j} + \varepsilon_t$$

ECM، مدل تصحیح خطا است و به صورت زیر تعریف

می‌شود:

$$ECM_t = y_t - \alpha - \sum \hat{\beta}_i x_{it} - \lambda' w_t \quad (2)$$

در معادله فوق، X_t برداری از متغیرهای اجباری و ε_t بردار جزء خطای تصادفی با میانگین صفر و واریانس - کوواریانس ثابت می‌باشد. وجود یک عبارت تصحیح خطا در میان تعدادی از متغیرهای همجمع شده، دلالت بر این دارد که تغییرات در متغیر وابسته تابعی از سطوح غیرتعادلی در رابطه همجمعی (معرفی شده به وسیله ECM) و نیز تابعی از تغییرات در متغیرهای توضیحی دیگر است و نشان می‌دهد که هر انحراف از تعادل بلندمدت، منجر به تغییرات در متغیر وابسته به منظور اجبار به حرکت به سمت تعادل بلندمدت خواهد شد. رویکرد ARDL شامل دو مرحله برای تخمین روابط بلندمدت است. مرحله اول، بررسی وجود رابطه بلندمدت میان تمامی متغیرهای موجود در معادله می‌باشد. مدل ARDL تعداد $(p + K)^t$ رگرسیون را به منظور به دست آوردن طول وقفه بهینه برای هر متغیر، برآورد می‌کند (P ماکزیمم تعداد وقفه‌ها و K تعداد متغیرهای موجود در معادله می‌باشد). مرحله دوم، تخمین ضرایب بلندمدت و کوتاه‌مدت معادل یکسان می‌باشد. مرحله دوم تنها زمانی انجام می‌شود که در مرحله اول به وجود رابطه بلندمدت میان متغیرها پی برده شود (شهباز اکمل [۱۴]، ۲۰۰۷).

با توجه به مباحث نظری مطرح شده درخصوص تأثیرگذاری تجارت و FDI بر نابرابری و همچنین مطالعات مطرح شده نظیر کاسترو (۲۰۱۰) و هرزر و نانکمپ (۲۰۱۱) مدل به صورت زیر ارائه می‌گردد:

$$gini_t = \beta_0 + \beta_1 \text{tragdp}_t + \beta_2 \text{fdigdp}_t + \beta_3 \text{inf}_t + \beta_4 \text{edu}_t + \beta_5 \text{gdpp}_t + \beta_6 \text{gdpp}^2_t + u_t \quad (3)$$

که در آن $gini$ نشان دهنده ضریب جینی، tragdp بیانگر سهم تجارت در تولید ناخالص داخلی، fdigdp نشان دهنده سهم fdi در

متغیر	ضریب برآورده شده	انحراف معیار	میزان احتمال
inf (-3)	۰/۰۱۳	۰/۰۰۶	۰/۰۲
edu	۰/۴۴	۰/۷۶	۰/۲۱
edu (-1)	-۰/۱۱	۱/۰۸	۰/۹۱
edu (-2)	-۱/۷۴	۰/۶۵	۰/۰۲
gdpp	-۰/۱۸	۰/۰۷۸	۰/۰۲۷
gdpp2	-۱/۶۷	۰/۷۰	۰/۰۲۷
gdpp2 (-1)	-۰/۱۲	۱/۰۸	۰/۸۹
gdpp2 (-2)	۲/۲۵	۰/۷۶	۰/۰۰
R-squared = 0.98			
R-Bar- squared = 0.98			
DW = 1.99			

منبع: یافته‌های تحقیق

به منظور بررسی اینکه وجود رابطه تعادلی بلندمدت در الگوی فوق، کاذب نیست آزمون حذف متغیرها صورت می‌گیرد. این آزمون در محیط Microfit برای به دست آوردن F مورد نظر پسران و شین (۲۰۰۱) انجام می‌شود. این F برای تعیین وجود ارتباط بلندمدت بین متغیرهای مدل تخمینی به کار گرفته می‌شود. برای اطمینان از وجود ارتباط بلندمدت با استفاده از این آزمون، ابتدا باید مشخص شود که متغیرها در چه سطحی پایا هستند، صرف نظر از آنکه متغیرها I(0) یا I(1) باشند. پسران و شین جدول مقادیر بحرانی صحیح را برای آزمون مذکور به ازای تعداد رگرسورهای مختلف (K) ارائه کرده‌اند. به علاوه این جدول بر حسب آنکه مدل ARDL شامل عرض از مبدا و روند گردد نیز متفاوت خواهد بود. دو مقدار بحرانی (حد بالا و پایین) برای هر مقدار K ارائه می‌شود. اگر تمامی متغیرها I(0) باشند مقدار بحرانی حد پایین صحیح خواهد بود که همان مقادیر بحرانی جداول استاندارد هستند. در صورت I(1) بودن کلیه متغیرها بحرانی حد بالا بایستی مینا قرار گیرد. چنانچه برخی متغیرها I(0) و برخی I(1) باشند مقدار بحرانی صحیح بین مقادیر بحرانی حد بالا و پایین قرار می‌گیرد. لذا در صورتی که آماره F بیشتر از مقدار بحرانی حد بالای جدول باشد به طور قاطع می‌توان فرضیه H_0 مبتنی بر هم انباشتگی را پذیرفت. چنانچه مقدار آماره F درون دامنه مذکور (بین حد بالا و پایین) قرار گیرد نتیجه گیری قطعی امکان پذیر نخواهد بود (ابریشمی، ۱۳۸۱). برای اینکه در مورد F درون دامنه تصمیم‌گیری شود باید به جدول t ارائه شده

نتایج آزمون مانایی مندرج در جدول (۱) حاکی از آن است که در سطح معنا داری ۰/۰۵ متغیرهای تورم و ضریب جینی I(0) و بقیه متغیرها I(1) هستند. با مطمئن شدن از اینکه هیچ یک از متغیرها I(2) و بیشتر نیستند می‌توان به ادامه برآورد الگو به روش ARDL پرداخت.

۳-۱-۲. تعیین تعداد وقفه بهینه

معمولاً در نمونه‌های کم‌تر از ۱۰۰ مشاهده از معیار شوارز - بیزین جهت تعیین وقفه بهینه هر یک از متغیرها استفاده می‌شود تا درجه آزادی زیادی از دست نرود. تعداد وقفه بهینه بر اساس معیار شوارز - بیزین در جدول (۲) ارائه شده است:

جدول ۲- تعداد وقفه بهینه سری‌های زمانی در

مدل

متغیر	وقفه بهینه
gini	۲
tragdp	۰
fdigdp	۰
inf	۳
edu	۲
gdpp	۰
gdpp2	۲

منبع: یافته‌های تحقیق

۳-۱-۳. نتایج حاصل از الگوی پویای ARDL

بر اساس تعداد وقفه محاسبه شده در بند قبل، نتایج الگوی ARDL در جدول (۳) تبیین شده است.

جدول ۳- برآورد الگو با استفاده از

روش ARDL(2,0,0,3,2,0,2)

متغیر	ضریب برآورده شده	انحراف معیار	میزان احتمال
gini (-1)	۰/۹۷	۰/۰۸۴	۰/۰۰
gini (-2)	-۰/۲۸	۰/۰۸۴	۰/۰۰
tragdp	-۰/۰۰۷	۰/۰۰۳	۰/۰۳
fdigdp	۰/۵۸۱	۰/۰۹۵	۰/۰۰
inf	۰/۰۰۴	۰/۰۰۵	۰/۸۴
inf (-1)	۰/۰۰۲	۰/۰۰۷	۰/۴۲
Inf (-2)	۰/۰۰۵	۰/۰۰۷	۰/۱۷

متغیر	ضرایب برآوردی	انحراف معیار	میزان احتمال
dfdi	۰/۵۸	۰/۰۹	۰/۰۰
dinf	۰/۰۰۴	۰/۰۰۵	۰/۲۳
dinf (-1)	-۰/۰۲	۰/۰۰۶	۰/۰۰
dinf (-2)	-۰/۰۱	۰/۰۰۶	۰/۰۴
dedu	۰/۴۴	۰/۷۴	۰/۳۱
dedu (-1)	۱/۷۲	۰/۶۵	۰/۰۳
dgdpp	-۰/۱۸	۰/۰۷	۰/۰۳
dgdpp2	-۱/۶۷	۰/۷۱	۰/۰۳
dgdpp2(-1)	-۲/۲۸	۰/۷۳	۰/۰۰
ecm(-1)	-۰/۲۹	۰/۰۶	۰/۰۰

R-squared = 0.58

منبع: یافته‌های تحقیق

معنی‌دار بودن ضریب ECM در جدول فوق یعنی منفی بودن و کوچکتر از یک بودن قدرمطلق آن، که تاییدی بر وجود رابطه بلندمدت و معنی‌دار بین متغیرهای الگوست. این ضریب نشان می‌دهد در هر دوره چند درصد از عدم تعادل متغیر وابسته تعدیل شده و به سمت رابطه بلندمدت نزدیک می‌شود. براساس نتایج ارائه شده ضریب $ECM(-1)$ برابر $-۰/۲۹$ است.

۳-۱-۵. نتایج حاصل از برآورد الگوی بلندمدت ARDL

نتایج مربوط به برآورد ضرایب بلندمدت در جدول (۵) ارائه شده است.

جدول ۵- ضرایب بلندمدت الگوی ARDL

متغیر	ضریب برآورد شده	انحراف معیار	میزان احتمال
tragdp	-۰/۰۲۴	۰/۰۱۴	۰/۰۷
fdigdp	۱/۹۷	۰/۴۳	۰/۰۰
inf	۰/۰۸۱	۰/۰۱۷	۰/۰۰
edu	-۴/۸۲	۰/۸۹	۰/۰۰
gdpp	-۰/۶۲	۰/۲۰	۰/۰۰
gdpp2	۱/۶۲	۰/۳۷	۰/۰۰

منبع: یافته‌های تحقیق

۳-۱-۶. آزمون‌های تشخیصی

نتایج آزمون‌های تشخیصی مانند عدم وجود همبستگی سریالی، فرم تبعی مناسب، توزیع نرمال و همسانی واریانس در جدول (۶) ارائه شده است:

توسط پسران و همکاران مراجعه کرده و بر حسب معنی‌دار بودن t وجود یا عدم وجود ارتباط بلندمدت مشاهده شود. آماره حاصل شده بنا بر آزمون حذف متغیرها $۳/۸۲$ می‌باشد. این مقدار با مشاهده به جدول و در نظر گرفتن تعداد رگرسورها (K) که هفت می‌باشد از مقدار بحرانی جدول که برابر $۳/۱۹۹$ است، بیشتر است بنابراین وجود رابطه بلندمدت تایید می‌شود.

۳-۱-۴. نتایج حاصل از الگوی تصحیح خطا

وجود هم‌انباشتگی بین مجموعه‌ای از متغیرهای اقتصادی مبنای آماری استفاده از الگوهای تصحیح خطا را فراهم می‌کند. مزایای این الگوها این است که نوسانات کوتاه‌مدت متغیرها را به مقادیر تعادلی بلندمدت ارتباط می‌دهد در واقع این مدل‌ها نوعی از مدل‌های تعدیل جزیبی‌اند که در آنها با وارد کردن پسماند پایا از یک رابطه بلندمدت، نیروهای موثر در کوتاه‌مدت و سرعت نزدیک شدن به مقدار تعادلی بلندمدت اندازه‌گیری می‌شوند. برآورد این مدل شامل دو مرحله است: مرحله اول شامل برآورد یک رابطه بلندمدت و حصول اطمینان از کاذب نبودن آن است. مرحله دوم وقفه پسماند رابطه بلندمدت را به عنوان ضریب تصحیح خطا استفاده کرده و مدل برآورد می‌شود. ضریب تصحیح خطا یعنی برآورد ضریب وقفه پسماند، در صورتی که با علامت منفی ظاهر شود که انتظار می‌رود چنین باشد، نشانگر سرعت تصحیح خطا و میل به تعادل بلندمدت خواهد بود. این ضریب نشان می‌دهد در هر دوره چند درصد از عدم تعادل متغیر وابسته تعدیل شده و به سمت رابطه بلندمدت نزدیک می‌شود (تشکینی، ۱۳۸۴).

ضرایب الگوی تصحیح خطا مربوط به عوامل موثر بر ضریب جینی در جدول (۴) ارائه شده است:

جدول ۴- ضرایب مربوط به الگوی تصحیح خطای

gini در ایران

متغیر	ضرایب برآوردی	انحراف معیار	میزان احتمال
dgini (-1)	۰/۲۷	۰/۰۸	۰/۰۰
dtra	-۰/۰۰۶	۰/۰۰۳	۰/۰۲

جدول ۶- نتایج آزمون‌های تشخیص

آزمون	آماره χ^2	آماره F
عدم همبستگی سریالی	۰/۳۲۸ (۰/۸۴)	۰/۲۵۱ (۰/۹۲)
فرم تبعی مناسب	۰/۵۴۵ (۰/۴۶)	۰/۷۵۴ (۰/۴۱)
نرمال بودن	۰/۵۴۳ (۰/۶۶۲)	-
واریانس همسانی	۰/۲۸۶ (۰/۸۸)	۰/۰۰۳ (۰/۹۶)

منبع: یافته‌های تحقیق

رشد اقتصادی و افزایش درآمد سرانه ناشی از افزایش پس‌انداز و سرمایه‌گذاری است.

شاخص آموزش با ضریب $4/82-$ کاهش دهنده نابرابری می‌باشد که این نتیجه نیز مطابق مطالعات قبلی نظیر مهربانی (۱۳۸۷) می‌باشد. و اما سهم تجارت در تولید ناخالص داخلی (شاخص تجارت) با ضریب $0/024-$ و با احتمال $0/07$ از لحاظ آماری معنادار و کاهش‌دهنده ضریب جینی است. بنابراین می‌توان انتظار داشت که افزایش تجارت منجر به بهبود توزیع درآمد در ایران می‌شود. چرا که همانطور که در قسمت مبانی نظری مطرح شد تجارت از طریق ورود کالای ارزان‌تر نسبت به داخل، ایجاد فرصت‌های شغلی، افزایش درآمد و... به کاهش نابرابری درآمدی کمک می‌کند. اثر مثبت تجارت در بهبود توزیع درآمد در مطالعات نجارزاده و مهدوی راسخ (۱۳۸۸) و بابازاده و همکاران (۱۳۸۹) تایید شده است.

سهم سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی در تولید ناخالص داخلی (شاخص FDI) با ضریب $1/97$ و با احتمال $0/00$ تأثیر مثبت و معنادار بر ضریب جینی دارد و افزایش دهنده نابرابری درآمدی می‌باشد. تاکنون مطالعه داخلی در خصوص اثر FDI بر نابرابری درآمدی صورت نگرفته ولی در میان مطالعات خارجی که اثر افزایش نابرابری درآمدی FDI، تایید شده می‌توان به کاسترو (۲۰۱۰)، باسو و جورجیا (۲۰۰۳) و هرزر و نانکمپ (۲۰۱۱) اشاره کرد. تأثیر منفی جذب FDI بر توزیع درآمد دلایل زیادی دارد. جذب FDI اگر در قالب شرکت‌های چند ملیتی باشد در صورت عدم نظارت و سیاست‌گذاری صحیح می‌تواند منجر به تقویت ساختار دوگانه اقتصادی از طریق افزایش دستمزد کارگران در بخشی از تولید شود، همچنین سبب انحرافات به سمت تولید کالاهای لوکس و گران قیمت که مورد تقاضای بخش ثروتمند جامعه هستند می‌گردد. تولید کالاهای نامناسب و طرح‌هایی که از نظر اجتماعی مطلوب نیستند و همچنین استفاده از تکنیک‌های نامناسب تولیدی (سرمایه‌بر) را می‌توان از دیگر دلایل تشدید نابرابری درآمدی عنوان کرد.

بنابراین طبق نتایج به‌دست آمده، در سطح معنی‌داری $0/05$ فرضیه صفر مبنی بر عدم وجود خود همبستگی سریالی همسانی واریانس و توزیع نرمال و وجود فرم تبعی مناسب رد نمی‌شود. بنابراین الگوی برآوردی از فیلتر آزمون‌های تشخیصی به خوبی عبور می‌کند.

۲-۳. تحلیل نتایج

همانطور که از نتایج حاصل از برآورد ضرائب بلندمدت ARDL مشخص است شاخص تورم با ضریب $0/081$ اثر مثبت و معنادار بر ضریب جینی دارد بدین معنا که افزایش تورم منجر به افزایش نابرابری درآمدی در ایران می‌شود. شاخص GDP سرانه و مربع آن به ترتیب با ضرایب $0/62-$ و $1/62$ اثر مثبت و منفی بر ضریب جینی دارند. نتایج حاصل نشان‌دهنده عدم تایید فرضیه کوزنتس در ایران است چرا که بر اساس فرضیه کوزنتس در مراحل اولیه توسعه، نابرابری افزایش و در مراحل بالاتر توسعه نابرابری کاهش می‌یابد. این نتیجه با مطالعات بختیاری (۱۳۷۱)، ناجی میدانی (۱۳۷۵)، نیلی و فرخ بخش (۱۳۷۷)، ابونوری و خوشکار (۱۳۸۶)، مهرگان و همکاران (۱۳۸۷) که بررسی‌های آنها با استفاده از داده‌های سری زمانی برای ایران در دوره‌های متفاوت است مطابقت دارد. دلیل عدم تایید فرضیه کوزنتس در این مطالعات استفاده از داده‌های سری زمانی می‌باشد چرا که در یک بررسی سری زمانی نمی‌توان مدعی شد که کشورها در یک منحنی کوزنتس باقی بمانند. از طرفی به دلیل متفاوت بودن ساختار اقتصادی ایران، افزایش درآمد سرانه و رشد اقتصادی ناشی از افزایش درآمد نفتی است، در حالیکه در اکثر کشورهای جهان

پی‌نوشت

1. Todaro
2. Foreign Direct Investment
3. Catsro
4. Basu and Guariglia
5. Herzer and Nounkamp
6. Spencer
7. Heckscher-Ohlin
8. Masee
9. Stolper-Samuelson
10. Wolff
11. Galbraith
12. Dollar and Kraay
13. Auto Regressive Distributed Lag
14. Shahbaz Akmal
15. Stationary

منابع

- ابونوری، اسماعیل و خوشکار، آرش، «تجزیه و تحلیل عامل‌های موثر بر نابرابری اقتصادی در ایران با استفاده از ریز داده‌ها»، فصلنامه علمی پژوهشی اقتصاد اسلامی، سال هشتم، شماره ۳۰، صص ۹۹-۱۲۰، ۱۳۸۷.
- بابا زاده، محمد؛ قویدل، صالح و عموزادخلیلی، حسن، «بررسی عوامل موثر بر توزیع درآمد با تاکید بر نقش تجارت خارجی مطالعه موردی ایران بین سال‌های ۱۳۸۶-۱۳۵۶»، فصلنامه اقتصاد کاربردی، شماره ۲، صص ۱۸۶-۱۶۱، ۱۳۸۹.
- بنیستر، جی و تاوگ، کا، «تجارت بین الملل و کاهش فقر»، ترجمه محمد تقی ضیایی بیگدلی، ماهنامه اطلاعات سیاسی اقتصادی، شماره ۱۸۰-۱۷۹، ۱۳۸۱.
- تشکینی، احمد، اقتصاد سنجی کاربردی به کمک MICROFIT، چاپ اول، تهران: مؤسسه فرهنگی هنری دیباگران تهران، صص ۱۴۸، دی ماه ۱۳۸۴.
- تقوی، مهدی و غروی نخجوانی، احمد، «تورم رکودی در ایران»، پژوهشنامه اقتصادی، شماره ۹، صص ۷۰-۱۳، ۱۳۸۲.

دردنیای امروز همه کشورهای جهان خصوصاً کشورهای در حال توسعه سعی بر آن دارند تا در عرصه رقابت‌های جهانی در حل مشکلاتی مانند فقر، توزیع نامتعادل درآمد، تورم، بیکاری و... از یکدیگر عقب نمانند. موضوع توزیع عادلانه درآمد در کنار موضوع افزایش تولید و دستیابی به رشد و توسعه بالاتر همواره مورد توجه بوده بدلیل اینکه انحراف در توزیع درآمد منجر به بروز مشکلات اساسی می‌گردد، حکومت‌هایی که مشروعیت خود را از مردم دریافت کرده‌اند بیشتر به دنبال روش‌هایی بوده‌اند تا بتوانند توزیع عادلانه تر درآمد و ثروت را داشته باشند. تجارت و سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی همانطور که بیان شد به ترتیب تأثیر مثبت و منفی بر توزیع درآمد دارند. از عمده‌ترین دلایل تأثیرگذاری منفی FDI، ساختار نابسامان اقتصادی، سیاست‌های نادرست در زمینه تجارت بین‌الملل، اندازه بیش از حد دولت و دولتی بودن صنایع سودآور که منجر به کاهش رقابت‌پذیری بازار می‌شود را می‌توان نام برد. در پایان برخی از راهکارهای سیاستی در جهت بهبود توزیع درآمد، وضع تجارت و سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی و همچنین بهبود تأثیر این دو عامل مهم بر توزیع درآمد به صورت زیر پیشنهاد می‌گردد:

- بازنگری در قوانین دست و پاگیر و کاهش موانع تعرفه‌ای و غیرتعرفه‌ای (موانع بازرگانی خارجی) در جهت افزایش تجارت.
- تشویق به توسعه بازار و از بین بردن حق انحصارهای دولتی.
- توجه بیشتر به شیوه تأثیرگذاری تجارت و FDI بر درآمد و قدرت خرید اقشار ضعیف و کم درآمد.
- بازاریابی و توسعه صادرات در مورد کالاهای صنعتی کاربر تولید داخل که مازاد مصرف داخل هستند، در جهت افزایش تجارت خارجی.
- آموزش تخصصی نیروی کار و در نتیجه بالا بردن بهره‌وری نیروی کار.
- اتخاذ سیاست‌های مناسب و عملیاتی در جهت

Panel of US States”, Forthcoming in Economic Inquiry, 2011.

Dollar, D. and Kraay, A., “growth is good for for the poor”, World Bank, development research group, 2000.

Dollar, D. and Kraay, A., “Trade, Growth, and Poverty”, *The Economic Journal*, no.114, pp. 22-49, 2004.

Galbraith, J.K., “Inequality, Unemployment and Growth: New Measures for Old Controversies”, *Journal of Economic Inequality*, no.7, 189-206, 2009.

<http://econ.worldbank.org/>

<http://tsd.cbi.ir/>

<http://www.amar.org.ir/>

<http://www.cbi.ir/page/4275.aspx>

Masee, P., “Trade, Employment and Wages”, *A Review of the Literature*, P.213, 1997.

Shahbaz Akmal, M., “Stock Returns and Inflation: an ARDL Econometric Investigation Utilizing Pakistani data”, *Pakistan Economic and Social Review*, V. 45, No.1, pp. 89-105, 2007.

Spencer, B., “What Should Trade Policy Target?”, in: *Strategic Trade Policy and the New International Economics*, Edited by: Paul Krugman, The M.I.T press, 1988.

Wolff Edwards, N., “Trade and Inequality”, *A Review of the Literature*, May, P. 8, 2000.

تودارو، مایکل، توسعه اقتصادی در جهان سوم، ترجمه غلامعلی فرجادی، چاپ هفدهم، تهران: انتشارات کوهسار، ۱۳۸۳.

رضایی، مهدی، «تأثیر حکمرانی بر جذب سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی در ایران»، فصلنامه علمی پژوهشی رفاه اجتماعی، سال هفتم، شماره ۲۶، صص ۱۰۴-۸۵، ۱۳۸۴.

گجراتی، دامودار، مبانی اقتصاد سنجی، ترجمه حمید ابریشمی، جلد دوم، چاپ پنجم، تهران: انتشارات دانشگاه تهران، صص ۱۱۷۰، ۱۳۸۷.

مهربانی، وحید، «تأثیر آموزش بر فقر و نابرابری درآمدها» مجله تحقیقات اقتصادی، شماره ۸۲، صص ۲۲۵-۲۱۱، ۱۳۸۷.

نجم‌زاده، رضا و مهدوی راسخ، الهام، « بررسی تأثیر جهانی شدن بر توزیع درآمد در کشورهای عضو گروه دی هشت» فصلنامه پژوهشنامه بازرگانی، شماره ۵۴، بهار ۱۳۸۹، صص ۱۰۹-۸۷، ۱۳۸۹.

Basu, P., and A. Guariglia., “Foreign Direct Investment, Inequality, and Growth”, *Journal of Macroeconomics*, 29. 2007.

Catsro, G.A., “The Effect of Trade and Foreign Direct Investment on Inequality: Do Governance and Macroeconomic Stability Matter? ”, Fecha de Recepcion: 2 de junio de 2008; fecha de aceptacion: 9 de marzo de, 2010.

Chintrakarn, P., Herzer, D. and Nunnenkamp, P., “FDI and Income Inequality: Evidence from a