

# بررسی اثر باز شدن تجاری و مالی بر فقر

kouchakpour@ymail.com

نجمه کوچک‌پور

کارشناسی ارشد مهندسی سیستم‌های اقتصادی و اجتماعی،  
مؤسسه عالی آموزش و پژوهش مدیریت و برنامه‌ریزی.

alimazyaki2000@yahoo.com

علی مزیکی

استادیار گروه اقتصاد مؤسسه عالی آموزش و پژوهش  
مدیریت و برنامه‌ریزی (نویسنده مسئول).

g\_farjadi@yahoo.com

غلامعلی فرجادی

دانشیار گروه اقتصاد مؤسسه عالی آموزش و پژوهش  
مدیریت و برنامه‌ریزی.

پذیرش: ۱۳۹۶/۰۳/۰۶

دریافت: ۱۳۹۵/۰۶/۳۰

**چکیده:** برای موفقیت پایدار فرآیند جهانی شدن، لازم است بررسی کنیم که گسترش ابعاد مختلف آن چگونه بر فقر تأثیر می‌گذارد. برای روشن شدن بعضی ابعاد این موضوع، در این پژوهش فرضیه وجود رابطه منفی میان باز بودن تجاری و مالی، و فقر را بررسی می‌کنیم. بدین منظور با استفاده از داده‌های ۳۱ کشور برای سال‌های ۲۰۱۲-۱۹۶۰، روش داده‌های تابلویی را به کار می‌بریم. همچنین، کشورها را به دو دسته توسعه‌یافته و در حال توسعه تقسیم می‌کنیم تا وجود تفاوت در تأثیر سیاست را شناسایی کنیم. به دلیل محدودیت اطلاعات، فقط از شاخص شدت تجاری (نسبت صادرات و واردات به تولید ناخالص داخلی) و نسبت سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی به تولید ناخالص داخلی، به عنوان معیارهایی برای ابعاد مختلف جهانی شدن استفاده می‌کنیم. نتایج چنین نشان می‌دهند که هرچند اثر مثبت باز بودن تجاری در کشورهای توسعه‌یافته و در حال توسعه بر افزایش درآمد متوسط فقرا و در نتیجه کاهش فقر را نمی‌توان رد کرد، اما از طرف دیگر اثر باز بودن مالی در کشورهای توسعه‌یافته و در حال توسعه متفاوت است؛ به شکلی که این اثر در کشورهای در حال توسعه یک اثر منفی بر درآمد فقراست. این نتیجه چنین پیشنهاد می‌کند که برای پایداری آثار مثبت باز شدن تجاری و مالی در کشورهای در حال توسعه، باز بودن تجاری باید مقدم بر باز بودن مالی باشد.

**کلیدواژه‌ها:** فقر، باز بودن تجاری، باز بودن مالی، سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی، جهانی شدن.

طبقه‌بندی JEL: F60, C23, P36

## مقدمه

جهان طی دو دههٔ پسین، شاهد تحولاتی مهم بوده است. فروپاشی نظام‌های اقتصادی مبتنی بر برنامه‌ریزی متمرکز و روی آوردن بیش‌تر آن‌ها به نظام اقتصادی مبتنی بر بازار، شکل‌گیری و ایجاد اتحادیه‌های گوناگون اقتصادی و تجاری، گسترش (گات) سازمان تجارت جهانی و ... فصلی جدید در عرصهٔ سیاست و تجارت جهانی گشوده است و پدیدهٔ نوظهور «جهانی شدن» محصول همین تحولات است. یکی از ویژگی‌های جهانی شدن، حذف مرزهای موجود بر راه تجارت کالا و خدمات و جابه‌جایی سرمایه است. به نظر می‌رسد پیشرفت در فرآیند اقتصادی، پُراهمیت‌ترین دستاورد جهانی شدن باشد؛ اما اثر آن بر فقر و توزیع درآمد در مطالعه‌های مختلف متفاوت است. در این راستا، پژوهش پیش‌رو به بررسی آثار آزادسازی تجاری، به عنوان حرکت به سمت تجارت آزاد از طریق کاهش در تعرفه‌ها و سایر موانع تجاری و آزادسازی مالی، به معنای کاهش موانع برای ورود سرمایه، بر فقر می‌پردازد. شناخت این آثار برای بیشینه کردن فرصت‌ها و کمینه کردن تهدیدها برای کشورهای که به سمت باز شدن تجاری و مالی در حرکت هستند، ضروری به نظر می‌رسد.

آزادسازی تجاری دارای موافقان و مخالفانی است که در دفاع از دیدگاه خود به جنبه‌های مثبت و منفی بسیاری اشاره دارند. باگواتی<sup>۱</sup> (۲۰۰۴) بیان می‌کند چین و هند طی دو دههٔ پسین به‌شدت به سمت باز کردن درهای اقتصادی خود پیش رفتند. درآمد حقیقی در چین با نرخ سالانه ۱۰ درصد و در هند با نرخ ۶ درصد در طی این دو دهه تا سال ۲۰۰۰ رشد پیدا کرد. فقر در چین از ۲۸ درصد در ۱۹۷۸ به ۹ درصد در ۱۹۹۸ کاهش یافت. گزارش‌های رسمی هند نیز سقوط فقر از ۵۱ درصد در ۱۹۷۸ به ۲۶ درصد در ۲۰۰۰ را نشان دادند. فیجینی و جورج<sup>۲</sup> با بررسی رابطهٔ میان حضور شرکت‌های چندملیتی و فقر در کشور ایرلند نشان داده‌اند که حضور این شرکت‌ها و ورود سرمایه خارجی، اگرچه در ابتدا نابرابری دستمزدها و فقر را افزایش می‌دهد، ولی با گذشت زمان نیروی کار غیرماهر به نیروی کار ماهر تبدیل می‌شود و سپس نابرابری کاهش می‌یابد. در نتیجه، فقر در کوتاه‌مدت افزایش، ولی در بلندمدت کاهش می‌یابد. البته وید<sup>۳</sup> (۲۰۰۴) با تشکیک در این آمارها، دلایلی ارائه می‌کند که بر اساس آن نمی‌توان اثر آزادسازی تجاری را به طور عمومی مثبت تلقی کرد. سان<sup>۴</sup> و همکاران (۲۰۰۰) اثرات آزادسازی تجاری و نرخ ارز را بر توزیع درآمد در کامرون،

1. Bhagwati
2. Fijini & Jorj
3. Wade
4. Sahn

گامبیا، ماداگاسکار و نیجر با تقسیم‌بندی خانوارها به غنی شهری، فقیر شهری، غنی روستایی و فقیر روستایی بررسی کرده‌اند. پژوهش‌های آن‌ها نشان می‌دهد که آزادسازی تجاری خانوارهای فقیر را در محیط‌های شهری و روستایی منتفع کرده و از این‌رو فقر را کاهش می‌دهد. باستین<sup>۱</sup> (۲۰۰۵) در کشور آفریقایی غنا به این نتیجه دست یافت که حذف موانع و تعرفه‌های وارداتی و صادراتی در صورتی که با افزایش در دریافت خارجی همراه باشد فقر را کاهش می‌دهد. بایر<sup>۲</sup> و همکاران (۱۹۹۹) با انجام مطالعه‌ای بر روی کشور شیلی نشان دادند که آزادسازی تجاری شکاف میان نیروی کار ماهر و غیرماهر را افزایش می‌دهد و این امر به فقر در کشور شدت می‌بخشد.

صدیقی<sup>۳</sup> و همکاران (۲۰۰۲) اثرات ورود سرمایه خارجی بر فقر و توزیع درآمد را در خانوارهای پاکستانی بررسی کردند. نتایج پژوهش آن‌ها نشان می‌دهد که آزاد سازی تجاری ضمن کاهش فقر، خانوارهای روستایی و نیروی کار غیرماهر را بیشتر منتفع می‌کند. فینسترا<sup>۴</sup> و همکاران (۱۹۹۷) در مطالعه‌ای در کشور مکزیک ضمن بررسی سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی و نابرابری دستمزدها نشان دادند که ورود سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی به کشورهای درحال توسعه باعث افزایش دستمزد کارگران ماهر در مقایسه با کارگران غیرماهر شده، در نتیجه فقر گسترش می‌یابد.

دالر و کرای<sup>۵</sup> (۲۰۰۴) با ارائه مدلی به بررسی رابطه میان باز بودن اقتصاد و تغییر در نابرابری در ۱۳۷ کشور جهان پرداختند. آن‌ها هیچ ارتباطی میان این متغیرها نیافته‌اند. راولیون<sup>۶</sup> این نتیجه‌گیری را تکمیل کرد<sup>۷</sup> و نشان داد که به طور متوسط، باز بودن بر نابرابری تأثیر نمی‌گذارد؛ اما در کشورهای کم درآمد، باز بودن اقتصاد با نابرابری‌های بیش‌تری همراه می‌شود. به طور کلی می‌توان دید که آزادسازی تجاری، بسته به سیاست‌های اتخاذی هر کشور، آثاری گوناگون روی آن‌ها دارد؛ ولی کشورهای درحال توسعه با فرآیند جهانی شدن، نیروی کار ارزان خود را در تولید و صادرات کالا به کار می‌گیرند و برای بهره‌مندی بیش‌تر از آن‌ها، به آموزش آن‌ها می‌پردازند که منجر به کم‌تر شدن افراد فقیر در جامعه می‌شود.

1. Bhastin
2. Beyer
3. Sediqui
4. Feenstra
5. Dollar & Kraay
6. Ravallion

۷. برای اطلاعات بیشتر «Globalization, Growth and Poverty»، تألیف پل کالیر و دیوید دالر، ترجمه

از مطالعه‌هایی که در ایران انجام شده است، می‌توان به احمدی و مهرگان (۱۳۸۴) اشاره کرد که نشان می‌دهد با فرض ثابت بودن متغیرهای دیگر، اگر درجه آزادی اقتصادی ایران به اندازه یک واحد افزایش یابد، ضریب جینی به طور متوسط  $0/0323$  واحد کاهش خواهد یافت. البته این ضریب در سطح ۱۶ درصد معنادار است؛ یعنی در سطح ۱۶ درصد، درجه آزادی ایران باعث کاهش نابرابری می‌شود.

همچنین، مطالعه ابریشمی و همکاران (۱۳۹۰) با به کار بردن کلمه جهانی شدن از دو شاخص باز بودن تجاری و ورود سرمایه‌گذاری خارجی در بررسی خود استفاده می‌کند. در ادامه می‌توان به مطالعه میدانی (۱۳۸۲) اشاره کرد که انواع شاخص‌های مختلف برای جهانی شدن را تبیین می‌کند؛ اما در مدل تجربی خود بر باز بودن تجاری تمرکز می‌کند و به هر حال، اثر «جهانی شدن» بر رشد اقتصاد ایران را بی‌معنا و بر کاهش نرخ بیکاری اندک برآورد کرده است. این مطالعه همچنین جهانی شدن را باعث شدت نابرابری درآمد و بدتر شدن فقر تخمین می‌زند. با این شرایط، به نظر می‌رسد به جای در نظر گرفتن جهانی شدن به عنوان یک متغیر، باید ابعاد مختلف جهانی شدن را در نظر گرفت. در این مطالعه، به دلیل محدودیت اطلاعات، فقط اثر شدت تجاری (نسبت صادرات و واردات به تولید ناخالص داخلی) و نسبت سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی به تولید ناخالص داخلی را به عنوان معیارهایی برای ابعاد مختلف جهانی شدن استفاده می‌کنیم.

مطالعه‌های بسیاری نیز به بررسی اثرات جهانی شدن و رشد اقتصادی بر نابرابری می‌پردازند. برای نمونه، مطالعه موسوی و همکاران (۱۳۸۸) چنین نتیجه می‌گیرند که به دنبال افزایش مشارکت ایران در عرصه تجاری اقتصاد جهان، نابرابری در میان خانوارهای شهری ایران به طور معناداری افزایش خواهد یافت. آن‌ها چنین نتیجه می‌گیرند که در خانوارهای روستایی، گسترش حضور ایران در عرصه جهانی از طریق مبادله تجاری، تأثیری چشمگیر بر توزیع درآمد روستایی نخواهد داشت. این مطالعه چنین اظهار می‌کند که در صورتی امید بهبود توزیع درآمد در میان خانوارهای روستایی نیز محتمل است که این گسترش حضور، همراه با افزایش سرمایه‌گذاری خارجی باشد. از طرف دیگر، گرچی و همکاران (۱۳۸۷) رابطه میان نابرابری درآمدی و درآمد سرانه ایران را به صورت U معکوس برآورد می‌کند. این نتیجه چنین پیشنهاد می‌کند که در صورت رشد درآمد سرانه، بر اثر جهانی شدن، توزیع درآمد در بلندمدت بهبود خواهد یافت؛ اما الزاماتی را برای این بهبود ارائه نمی‌کند. مطالعه مورد اشاره، شاخص شدت تجاری را به عنوان معیاری برای جهانی شدن استفاده می‌کند.

بر اساس مدل‌هایی گوناگون همچون الگوی سنتی تجارت (هکشر-اولین)، مدل‌های رشد درون‌زا

(رومر، بارو، سالا مارتین) و نظریه استاپلر ساموئلسون<sup>۱</sup> باز بودن تجاری، که معمولاً با شدت تجاری اندازه‌گیری می‌شود، با بهبود وضعیت اشتغال رشد اقتصادی و رشد فناوری ارتباط دارند. از طرف دیگر، مواردی گوناگون از جمله تسای<sup>۲</sup> و هوانگ<sup>۳</sup> (۲۰۰۷) و هوا<sup>۴</sup> (۲۰۰۲) از سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی به عنوان معیاری برای سنجش میزان ادغام در اقتصاد جهانی استفاده می‌کنند. سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی میزان انتقال سرمایه از کشورهای خارجی را اندازه می‌گیرد؛ به طوری که کشور سرمایه‌گذار دارای نفع مستمر باشد. ما در ادامه، بر اساس ادبیات موضوع اشاره شده، ابتدا مدل استفاده شده در این پژوهش را ارائه می‌کنیم. سپس آزمون‌های لازم برای برآورد مدل را انجام داده و سرانجام، نتایج را ارائه می‌کنیم.

## مدل

در این پژوهش برای بررسی اثر باز شدن تجاری و مالی بر فقر، از مدل پیشنهادی دالر و کرای (۲۰۰۲ و ۲۰۰۴) استفاده می‌کنیم. البته تسای و هوانگ (۲۰۰۷) هم با استفاده از این مدل به تفسیر آن در اثر «جهانی شدن» بر فقر در کشور تایوان پرداخته‌اند؛ اما مطالعه ما با استفاده از اطلاعات کشورها روش داده‌های تابلویی پویای کلان<sup>۵</sup> را به کار می‌برد. با این هدف، معادله

$$\ln Y_{it} = \alpha_0 + \alpha_1 \ln(gdpp_{it}) + \alpha_2 trg_{it} + \alpha_3 fdig_{it} + \alpha_4 seg_{it} + e_{it} \quad (1)$$

را در نظر بگیرید. زیرنویس (اندیس)  $i \in \{1, \dots, N\}$  مربوط به کشورها و زیرنویس  $t \in \{1, \dots, T\}$  مربوط به دوره زمانی است.  $Y$  درآمد متوسط  $p$  درصد کم‌درآمد جامعه است. همچنین،  $gdpp$  درآمد متوسط جامعه،  $trg$  نسبت حجم تجارت خارجی به تولید ناخالص داخلی،  $fdig$  نسبت سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی به تولید ناخالص داخلی و  $seg$  نسبت هزینه‌های تأمین اجتماعی به تولید ناخالص داخلی است.

1. Stapler Samuelson
2. Tsai
3. Hung
4. Hoa
5. Macro Dynamic Panel Data

۶. برای مثال می‌توان این متغیر را به شکل  $\ln Y_{it} = \frac{\ln(gdpp_{it} * frst_{it}^{20\%})}{0.2}$  تعریف کرد که در آن  $frst_{it}^{20\%}$  سهم درآمدی ۲۰ درصد کم درآمد جامعه در کشور  $i$ -ام در زمان  $t$  است. البته فقر دارای ابعاد مختلفی است، به عبارت دیگر فقر را بایستی به عنوان کمبود درآمد یا مصرف در برآورده ساختن نیازهای اساسی تعریف کرد (McCulloch, 2003). با این اوصاف و بر اساس محدودیت داده‌ها، ما از همین شاخص که مبتنی بر توزیع دهک‌های درآمدی خانوارهاست استفاده می‌کنیم.

در این پژوهش از داده‌های ۳۱ کشور برای سال‌های ۲۰۱۲-۱۹۶۰ که توسط بانک جهانی ارائه شده، استفاده کرده‌ایم. همچنین، کشورها را به دو دسته<sup>۱</sup> توسعه‌یافته (استرالیا، آلمان، انگلستان، کانادا، آمریکا، هلند، فرانسه، بلژیک، ایتالیا، اسپانیا، سنگاپور) و در حال توسعه (آلبانی، آرژانتین، برزیل، شیلی، چین، کلمبیا، هوندوراس، اندونزی، ایران، جامائیکا، ماداگاسکار، مکزیک، مالزی، پاکستان، پاراگوئه، رمانی، تاجیکستان، تونس، اوروگوئه و ویتنام) تقسیم کرده‌ایم تا در صورت وجود تفاوت در تأثیر سیاست‌شناسایی شود.

این پژوهش به دنبال بررسی اثر باز شدن تجاری و مالی بر فقر میان دو گروه کشورهای توسعه‌یافته و در حال توسعه است و از این‌رو، با توجه به میان‌کشوری کار کردن، نیاز به برآورد با مدل داده‌های تابلویی وجود دارد. این الگو از طریق به‌کارگیری داده‌های تابلویی و با استفاده از نرم‌افزار Stata برآورد می‌شود. سپس با استفاده از یکی از دو روش اثرات ثابت یا اثرات متغیر، مدل مورد نظر تخمین زده می‌شود. با معرفی این دو روش، پرسشی که پیش می‌آید این است که در عمل ما باید کدام یک از روش‌های بالا را استفاده کنیم. برای تصمیم‌گیری در این مورد از آزمون هاسمن کمک می‌گیریم که نتایج آن در بخش بعد آمده است.

همچنین، به طور معمول در رگرسیون فرض بر ایستا بودن متغیرهای توضیحی است و لازم است نخست ایستایی بودن متغیرها آزمون شود. به منظور اطمینان از نتایج پژوهش و ساختگی نبودن روابط موجود در رگرسیون، اقدام به انجام آزمون مانایی و محاسبه ریشه واحد متغیرهای پژوهش می‌کنیم. آزمون ریشه واحد داده‌های تابلویی به وسیله کالو<sup>۲</sup> (۱۹۹۹) پایه‌ریزی شد. بر این اساس، لوین<sup>۳</sup>، لین<sup>۴</sup> و چو<sup>۵</sup> (۲۰۰۲) روش LLC و ایم<sup>۶</sup>، پسران<sup>۷</sup> و شین<sup>۸</sup> (۲۰۰۳) روش IPS را گسترش داده‌اند. به گفته

۱. در مورد دسته‌بندی به کار رفته در این پژوهش، به پیشنهاد داور ناشناس، نتایج با دو دسته از کشورهای در حال توسعه دوباره آزمون شد و تفاوت معناداری بین آنها مشاهده نشد. البته از آنجاکه این موضوع ممکن است به دلیل اطلاعات محدود این پژوهش باشد انجام مطالعه‌های بیشتر در بررسی تفاوت آثار در کشورهای با ساختارهای حقوقی و تجاری مختلف پیشنهاد می‌شود.

2. Quah
3. Levin
4. Lin
5. Chu
6. Im
7. Pesaran
8. Shin

بالتاگی<sup>۱</sup> (۲۰۰۵) آزمون‌های LLC، برای داده‌های دارای دوره زمانی محدود، در مقایسه با سایر روش‌ها برای کنترل مانایی داده‌های تابلویی، از برتری نسبی برخوردارند.

### نتایج برآورد مدل

همان‌گونه که در بخش پیش بیان شد، برای برآورد مدل، ابتدا به آزمون مانایی متغیرهای مدل با استفاده از داده کل کشورها و برای دو گروه کشورهای توسعه‌یافته و در حال توسعه با استفاده از روش لوین لین چو پرداختیم. همچنین، گفتنی است که برای آزمون مانایی از روش شین و پسران نیز استفاده شد که در آن، مانایی با افزودن روند حاصل می‌شود. بنابراین، به نظر می‌رسد وارد کردن متغیرهای مجازی روند زمانی، بتواند نتایج را پُربارتر کند. در ادامه، ابتدا نتایج این آزمون‌ها ارائه شده و سپس، خلاصه نتایج برآورد با کنترل و بدون کنترل برای روند زمانی در جدول (۱) آمده است.

### آزمون‌های لازم برای تخمین مدل

برای دستیابی به نتایج مقایسه‌پذیر، کشورها را به سه دسته تقسیم می‌کنیم تا شاهد تفاوت‌ها یا شباهت‌های رفتار کشورها باشیم. در ادامه، ابتدا به برآورد کلی کشورهای منتخب می‌پردازیم؛ سپس کشورهای توسعه‌یافته و در حال توسعه را از هم جدا کرده و آزمون‌ها را برای هر سه دسته «همه کشورها»، «کشورهای در حال توسعه» و «کشورهای توسعه‌یافته» انجام می‌دهیم تا بتوان به نتیجه‌ای بهتر دست یافت. سپس، نتایج آزمون‌ها را برای حالت داده‌های همه کشورها ارائه می‌کنیم و نتایج سایر حالات در پیوست آمده است.

ابتدا به آزمون مانایی بر اساس روش LLC می‌پردازیم؛ نتایج جدول (۱) نشان می‌دهند که برای همه متغیرها به جز  $trg$ ، فرضیه صفر که وجود ریشه واحد است، در سطح  $0/01$  برای روند زمانی تعدیل شده، رد نمی‌شود و برای  $trg$  با لحاظ روند و در سطح  $0/05$  نیز رد نمی‌شود؛ در نتیجه، متغیرها مانا هستند. البته این مدل باید به گونه‌ای روندزایی شود که به هنگام برآورد مدل به آن می‌پردازیم.

1. Baltagi
2. Adjusted t

جدول ۱. آزمون مانایی برای همه کشورها (Levin-Lin-Chu unit-root test)

| متغیر  | روند | t تعدیل نشده | t تعدیل شده* |
|--------|------|--------------|--------------|
| Lnly   | خیر  | -۱۰/۴۸۱۲     | -۹/۵۶۷۳***   |
| Lngdpp | خیر  | -۹/۶۸۱۲      | -۸/۰۳۵۴***   |
| trg    | بله  | -۶/۰۵۱۶      | -۲/۲۳۷۰**    |
| fdig   | خیر  | -۱۰/۷۲۴۸     | -۳/۷۵۶۳***   |
| seg    | خیر  | -۱۸/۶۸۸۷     | -۲۰/۳۸۹۳***  |

\*\*\* p<0.01, \*\* p<0.05, \* p<0.1

الف) تعداد ستاره‌ها اشاره می‌کند به رد فرضیه صفر اشاره می‌کند که شامل معناداری آزمون ریشه واحد در سطح بیان شده در بالا هستند.

بنابر نتایج جدول (۱)، متغیر trg در حالت داده‌های همه کشورها، باید روندزدایی شود. نتایج آزمون مانایی در حالت کشورهای توسعه‌یافته یا در حال توسعه در پیوست آمده است و بنابر آن، نتایج مشابه است؛ به جز متغیر Lnly که در حالت کشورهای در حال توسعه نیاز به روندزدایی دارد. همچنین، هنگام استفاده از روش داده‌های تابلویی با استفاده از آزمون هاسمن، نشان می‌دهیم که اثر ثابت مدل مناسب‌تر است. در ادامه، مدل نهایی را تخمین زده و نتایج آن را تفسیر می‌کنیم.

### تفسیر نتایج

در نتایج جدول (۲)، مدلی که در رابطه (۱) ارائه شد، با استفاده از استخر داده‌ها<sup>۱</sup> و روش داده‌های تابلویی برآورد شده است. در همه تخمین‌های داده‌های تابلویی از روش اثر ثابت استفاده شده است. البته با توجه به لزوم روندزدایی بر اساس آزمون‌های انجام شده در بخش پیش، متغیرهای Lnly و trg در حالت کشورهای در حال توسعه روندزدایی شده‌اند.



جدول ۲: نتایج برآورد

| متغیرها      | استخر داده‌ها |              |             | داده‌های تابلویی |              |             |
|--------------|---------------|--------------|-------------|------------------|--------------|-------------|
|              | همه کشورها    | در حال توسعه | توسعه یافته | همه کشورها       | در حال توسعه | توسعه یافته |
| Lngdpp       | ۰/۹۶***       | ۰/۹۷***      | ۱/۰۶***     | ۰/۸۵***          | ۰/۸۶***      | ۱/۰۵***     |
|              | (۰/۰۰۷)       | (۰/۰۱۲)      | (۰/۰۱۹)     | (۰/۰۱۷)          | (۰/۰۲۴)      | (۰/۰۱۹)     |
| trg          | ۰/۰۰۱***      | ۰/۰۰۱*       | -۰/۰۰۰۱     | -۰/۰۰۰۱*         | ۰/۰۰۰۵       | -۰/۰۰۰۴***  |
|              | (۰/۰۰۰۲)      | (۰/۰۰۰۴)     | (۰/۰۰۰۱)    | (۰/۰۰۰۴)         | (۰/۰۰۰۵)     | (۰/۰۰۰۳)    |
| fdig         | -۱/۳***       | -۲/۳۹***     | ۰/۲۹        | -۰/۷۶***         | -۱/۲۸***     | -۰/۱۹       |
|              | (۰/۳۸۷)       | (۰/۶۳۱)      | (۰/۲۳۷)     | (۰/۲۹)           | (۰/۴۷۶)      | (۰/۱۹۷)     |
| seg          | ۳/۲۳E۰۷-      | -۰/۰۰۹***    | ۰/۰۰۶***    | ۰/۰۰۷***         | -۰/۰۱۵***    | ۰/۰۰۷***    |
|              | (۰/۰۰۰۷)      | (۰/۰۰۱)      | (۰/۰۰۰۵)    | (۰/۰۰۰۲)         | (۰/۰۰۰۴)     | (۰/۰۰۰۱)    |
| Constant     | -۰/۸۴۹***     | ۰/۴۸۶***     | -۱/۹۰۵***   | -۰/۰۹            | ۰/۴۲         | -۱/۷۶***    |
|              | (۰/۰۵۷)       | (۰/۰۹۱)      | (۰/۱۹)      | (۰/۱۲۴)          | (۰/۱۴)       | (۰/۱۶۷)     |
| مشاهده‌ها    | ۱۶۴۳          | ۱۰۶۰         | ۵۸۳         | ۱۶۴۳             | ۱۰۶۰         | ۵۸۳         |
| R مربع       | ۰/۹۲۵         | ۰/۸۰۳        | ۰/۸۸۶       | ۰/۷۳             | ۰/۶۷         | ۰/۹۳۶       |
| تعداد کشورها |               |              | ۳۱          | ۲۰               | ۱۱           |             |

خطای استاندارد در پراتز

الف:  $p < 0.01$ ,  $p < 0.05$ ,  $p < 0.1$ \*\*\*, \*\*, \*

ب: All مربوط به برآورد با داده تمام کشورها، Developing برای کشورهای در حال توسعه و Developed برای کشورهای توسعه یافته است.

ج: متغیر وابسته در تمام این برآوردها  $\ln y$  متوسط درآمد ۲۰٪ کم درآمد جامعه است.

این نتایج نشان می‌دهند که افزایش تولید ناخالص داخلی در همه کشورهای منجر به افزایش درآمدی متوسط فقرا می‌شود. در حقیقت، بنابر انتظار، رشد اقتصادی اثر مثبت بر درآمد فقرا دارد و موجب افزایش درآمد فقرا و در نتیجه کاهش فقر می‌شود. به جز این متغیر، سایر عوامل اثری متفاوت در کشورهای توسعه یافته و در حال توسعه می‌گذارند. با استفاده از استخر داده‌ها، نسبت تجارت به تولید ناخالص داخلی در کشورهای در حال توسعه، اثر مثبت و معنادار بر درآمد فقرا دارد؛ اما باز بودن مالی، اثر منفی بر درآمد فقرا دارد. این نتیجه آخر با استفاده از داده‌های تابلویی هم تأیید می‌شود. می‌توان گفت که این نتیجه در مورد کشورهای توسعه یافته برعکس است. باز بودن تجاری اثری

کاهنده بر درآمد فقرا دارد. با توجه به سایر مطالعه‌های این حوزه می‌توان علت احتمالی این امر را وجود دستمزد بالا در کشورهای توسعه‌یافته دانست که بعد از افزایش تجارت، باعث ورود کالاهایی شود که با دستمزد پایین تولید شده‌اند. در نتیجه این امر، امکان دارد سطح بیکاری در این کشورها افزایش و فقر گسترش یابد.

نتیجه‌ی اخیر با نتایج تی سای و هوانگ (۲۰۰۷) که در کشور تایوان بررسی شده بود، چنین پیشنهاد می‌کند که اثر افزایش تجارت و افزایش سرمایه‌گذاری خارجی در کشورهای در حال توسعه در مقایسه با کشورهای توسعه‌یافته متفاوت است. به طور کلی می‌توان چنین پیشنهاد کرد که دو اثر معکوس در رابطه با بودن تجاری و مالی و فقر وجود دارد. یک اثر از طریق سرمایه‌گذاری خارجی و اثر دیگر از طریق گسترش تجارت؛ نتایج این مطالعه نشان می‌دهد که اثر این دو عامل بر فقر، برعکس یکدیگر هستند؛ از یک طرف در رابطه میان تجارت و فقر، گسترش تجارت برای کشورهای در حال توسعه موجب گسترش مقیاس فعالیت‌ها در این کشورها شده و به سبب وجود نیروی کار ارزان‌تر بیکاری کاهش پیدا می‌کند. این موضوع عامل کاهش فقر نیز خواهد بود. اما در کشورهای توسعه‌یافته، گسترش تجارت موجب ورود کالاهایی می‌شود که با نیروی کار ارزان‌تر تولید شده‌اند و با توجه به بالا بودن دستمزدها در کشورهای توسعه‌یافته ممکن است بالا رفتن حجم تجارت موجب افزایش بیکاری در این کشورها شود.

از طرف دیگر، در رابطه میان سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی و فقر، چون چنین سرمایه‌گذاری‌هایی معمولاً با استفاده از فناوری‌های سرمایه‌برتر صورت می‌گیرد، چنان‌چه هدف، سرمایه‌گذاری کشورهای در حال توسعه باشد، افزایش سرمایه‌گذاری ممکن است با افزایش بیکاری و در نتیجه گسترش فقر همراه شود. در مقابل، چنان‌چه این سرمایه‌گذاری خارجی به کشورهای توسعه‌یافته ورود کند، چون از فناوری متفاوت‌تری نسبت به کشورهای مقصد برخوردار نخواهد بود، بدون تغییر چندان، فناوری موجب ایجاد رونق در این کشورها و در نتیجه کاهش فقر خواهد شد.

همچنین، اثر هزینه‌های تأمین اجتماعی بر فقر در کشورهای در حال توسعه و توسعه‌یافته متفاوت است. چنین نتیجه‌ای می‌تواند بدین دلیل باشد که نظام تأمین اجتماعی در کشورهای در حال توسعه نمی‌تواند به اندازه کشورهای توسعه‌یافته کارآمد باشد. بنابراین، ممکن است افزایش این‌گونه هزینه‌ها در کشورهای در حال توسعه، موجب ازدیاد درآمد فقرا نشود. البته این موضوع ممکن است به دلیل تأمین نیازهای فقرا از راه‌های غیرنقدی در کشورهای در حال توسعه نیز باشد که خود را در داده‌ها نشان نمی‌دهد.

## نتیجه‌گیری

در این پژوهش، به بررسی اثر باز شدن تجاری و مالی، به عنوان دو بُعد از ابعاد مختلف جهانی شدن، بر فقر پرداختیم. بدین منظور، تأثیر بازبودن تجاری و سرمایه‌گذاری مستقیم و رشد اقتصادی بر فقر، با در نظر گرفتن مدل دالر و کرای مورد توجه قرار گرفت و پس از افزودن متغیرهای مستقل مناسب، مدل نهایی به‌دست آمد و در دو گروه کشورهای در حال توسعه و توسعه‌یافته طی دوره زمانی ۲۰۱۲-۱۹۶۰ بررسی شد. متغیرهای توضیحی مورد استفاده در این پژوهش عبارتند از: تولید ناخالص داخلی سرانه، نسبت تجارت و سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی به تولید ناخالص داخلی و نسبت هزینه‌های دولت روی تأمین اجتماعی به تولید ناخالص داخلی. برای برآورد الگوی مورد نظر، از یک الگوی داده‌های تابلویی استفاده شد. پس از به‌دست آمدن شکل نهایی مدل، به بررسی برقراری رابطه با توجه به داده‌های به‌دست آمده پرداختیم. از محاسبات پژوهش به این نتایج رسیدیم که احتمالاً در کشورهای در حال توسعه، باز بودن تجارت اثر مثبت بر درآمد فقرا داشته؛ ولی باز بودن مالی اثر منفی بر درآمد فقرا داشته و ممکن است موجب افزایش فقر شود. از طرف دیگر، در کشورهای توسعه‌یافته روندی برعکس مشاهده می‌شود.

نتایج این مطالعه ابعادی جدید را از رابطه میان آزادسازی تجاری و مالی و فقر را که پیش‌تر در مطالعه تسای و هوانگ (۲۰۰۷) برآورد شده بود، آشکار می‌کند. برای نمونه، رابطه میان باز بودن تجاری و فقر به میزان توسعه‌یافتگی کشورها بستگی دارد و اثر منفی سرمایه‌گذاری خارجی در آن مطالعه احتمالاً به علت در حال توسعه بودن کشور مورد بررسی بوده و ورود سرمایه خارجی در کشورهای توسعه‌یافته اثری مثبت بر درآمد متوسط فقرا دارد؛ در حالی که در مورد آزادسازی تجاری می‌توان استدلالی معکوس انجام داد.

در پایان می‌توان چنین نتیجه‌گیری کرد که در کشورهای در حال توسعه با توجه به تأثیر مفید آزادسازی تجاری بر رشد اقتصادی و فقر، لازم است دولت نسبت به رفع موانع تجارت آزاد و نیز عضویت در سازمان تجارت جهانی اقدام نماید. اگرچه لازمه موفقیت در این زمینه ایجاد زیرساخت‌ها و نهادهای مناسب است، که به عنوان نمونه می‌توان به افزایش حمایت از اقشار آسیب‌پذیر در اثر آزادسازی در کوتاه مدت اشاره کرد. بنابراین، در صورت جذب سرمایه‌گذاری خارجی در کشورهای در حال توسعه، لازم است سیاست‌هایی مکمل شامل حمایت از فقرا انجام شود. با این شرایط شاید بتوان گفت که در کشورهای در حال توسعه، بر خلاف کشورهای توسعه‌یافته، آزادسازی تجاری بر جذب سرمایه‌گذاری خارجی مقدم است.

برای ادامه این پژوهش پیشنهاد می‌شود در صورت دسترسی از شاخص‌های دیگر فقر مانند شاخص فقر چندبُعدی استفاده شود. همچنین، چون «جهانی شدن» مقوله‌ای چندبُعدی است، لازم است چنین پژوهش‌هایی با به‌کار بردن متغیرهای مناسب دیگری چون شاخص کوف<sup>۱</sup> سایر ابعاد جهانی‌سازی را نیز منعکس کنند.

## منابع

### الف) فارسی

- احمدی، محمد علی و مهرگان، نادر (۱۳۸۴). تأثیر سیاست‌های تعدیل اقتصادی بر توزیع درآمد در ایران. *مجله تحقیقات اقتصادی*، دانشکده اقتصاد دانشگاه تهران، شماره ۷۰، صص ۲۳۲ - ۲۰۹.
- ابریشمی، حمید؛ مهدوی، ابوالقاسم و احراری، مهدی (۱۳۹۰). اثرات جهانی شدن بر اشتغال و تقاضای نیروی کار ماهر و غیر ماهر ایران. *فصلنامه پژوهشنامه بازرگانی*، شماره ۵۸، صص ۱۰۷-۱۴۱.
- گرچی، ابراهیم و برهانی‌پور، محمد (۱۳۸۷). اثر جهانی شدن بر توزیع درآمد در ایران. *پژوهش‌های اقتصادی ایران*، شماره ۳۴ (۱۰)، صص ۱۲۴-۹۹.
- موسوی، نعمت‌اله؛ بخشوده، محمد؛ محمدی، حمید؛ یزدانی، سعید و طاهری، فرزانه (۱۳۸۵). آثار جهانی شدن بر شاخص‌های فقر. *فصلنامه پژوهشی رفاه اجتماعی*، شماره ۲۴، صص ۲۷۹-۲۵۹.
- میدانی ناجی، علی‌اکبر (۱۳۸۲). *آثار جهانی شدن اقتصاد بر رشد، اشتغال و توزیع درآمد*. رساله دکتری دانشگاه تربیت مدرس.
- کالیر، پل و دالر، دیوید (۱۳۸۳). *جهانی‌شدن، رشد و فقر*. مترجم غلامحسین فیروزفر، تهران: انتشارات موسسه عالی آموزش و پژوهش مدیریت و برنامه‌ریزی.

### ب) انگلیسی

- Baltagi, B. (2008). *Econometric Analysis of Panel Data*. John Wiley & Sons.
- Beyer, H.; Rojas, P.; & Vergara, R. (1999). Trade Liberalization and Wage Inequality. *Journal of Development Economics*, 59(1), pp.103-123.
- Bhagwati, J. & Srinivasan, T. N. (2002). Trade and Poverty in the Poor Countries. *The American Economic Review*, 92(2), pp.180-183.
- Dollar, D. (2005). Globalization, Poverty, and Inequality since 1980. *The World Bank Research Observer*, 20(2), pp.145-175.
- Dollar, D. & Kraay, A. (2002). Growth is Good for the Poor. *Journal of Economic Growth*, 7(3), pp.195-225.

- Dollar, D. & Kraay, A. (2004). Trade, Growth, and Poverty. *The Economic Journal*, 114(493), pp.22-49.
- Feenstra, R. C. & Hanson, G. H. (1997). Foreign Direct Investment and Relative Wages: Evidence from Mexico's Maquiladoras. *Journal of International Economics*, 42(3), pp.371-393.
- Hoa, N., & Hemmer, H. R. (2002). Contribution of Foreign Direct Investment to Poverty Reduction: the Case of Vietnam in the 1990s. *Discussion Papers in Development Economics, Institute for Development Economics*.
- Hung, T. T. (2005). Impacts of Foreign Direct Investment on Poverty Reduction in Vietnam. *Discussed Paper, GRIPS, Vietnam*.
- Im, K. S.; Pesaran, M. H. & Shin, Y. (2003). Testing for unit Roots in Heterogeneous Panels. *Journal of Econometrics*, 115(1), pp.53-74.
- Levin, A.; Lin, C. F. & Chu, C. S. J. (2002). Unit Root Tests in Panel Data: Asymptotic and Finite-sample Properties. *Journal of Econometrics*, 108(1), pp.1-24.
- McCulloch, N.; Winters, L. A., & Cirera, X. (2001). *Trade Liberalization and Poverty: A Handbook*. Centre for Economic Policy Research.
- Tsai, P. L. & Huang, C. H. (2007). Openness, Growth and Poverty: *The Case of Taiwan*. *World Development*, 35(11), pp.1858-1871.
- Wade, R. H. (2004). Is Globalization Reducing Poverty and Inequality? *World Development*, 32(4), pp.567-589.

## پیوست

جدول ۳. آزمون مانایی برای کشورهای در حال توسعه (Levin-Lin-Chu unit-root test)

| متغیر  | روند | t تعدیل نشده | t تعدیل شده* |
|--------|------|--------------|--------------|
| Lnly   | بله  | -۳/۱۹۰۲      | -۰/۳۵۳۱*     |
| Lngdpp | خیر  | -۴/۹۱۵۱      | -۲/۵۹۳۸***   |
| Trg    | بله  | -۵/۳۷۴۴      | -۲/۱۹۰۵**    |
| Fdig   | خیر  | -۷/۹۷۶۷      | -۲/۳۳۲۱***   |
| Seg    | خیر  | -۱۶/۰۲۴۸     | -۱۷/۸۵۶۵***  |

\*\*\*p<۰,۰۱, \*\*p<۰,۰۵, \*p<۰,۱

جدول ۴. آزمون مانایی برای کشورهای توسعه یافته (Levin-Lin-Chu unit-root test)

| متغیر  | روند | t تعدیل نشده | t تعدیل شده* |
|--------|------|--------------|--------------|
| Lnly   | بله  | -۱۰/۳۵۳۱     | -۱۰/۹۷۱۶***  |
| Lngdpp | بله  | -۹/۴۲۳۸      | -۹/۶۶۸۷***   |
| Trg    | خیر  | -۳/۰۱۲۳      | -۰/۸۶۸۴*     |
| Fdig   | خیر  | -۸/۱۹۵۸      | -۳/۸۰۸۰***   |
| Seg    | خیر  | -۹/۷۰۵۱      | -۹/۷۳۰۶***   |

\*\*\*p<۰,۰۱, \*\*p<۰,۰۵, \*p<۰,۱

## Financial and Trade Openness on Poverty

Najmeh Kouchakpour<sup>1</sup>

| kouchakpour@ymail.com

Ali Mazyaki<sup>2</sup>

| alimazyaki2000@yahoo.com

Gholam Ali Farjadi<sup>3</sup>

| g\_farjadi@yahoo.com

**Abstract** For the sustainable success of "globalization", it is important to investigate how expanding its aspects affect poverty. To determine the dimensions of this subject, in this study we hypothesize negative relationship between poverty and financial or trade openness, using the model by Dollar and Kraay. We employ a panel data method using data for the years 1960-2012 on 31 countries. We have also categorized countries into two parts including developed and developing ones and identified a significant difference in the impact of policies. Because of data limitations we only use the two variables "ratio of exports and imports to GDP", and "foreign direct investment relative to GDP", as the two criteria of various aspects of globalization. The results show that while the positive effect of trade openness in developing countries on increment of average income of the poor cannot be rejected; on the other side, effects of financial openness in developed and developing countries are different. So that it negatively, affects the income of the poor in the developing countries. This result suggests that to achieve sustainable success of financial and trade openness in developing countries, the latter should precede the former.

**Keywords:** Poverty, Trade Openness, Financial Openness, Foreign Direct Investment, Globalization.

**JEL Classification:** F60, C23, P36.

1. M.A. in Socio-economic Systems Engineering, Institute for Management and Planning Studies, Tehran, Iran.

2. Assistant Professor of Economics, Institute for Management and Planning Studies, Tehran, Iran, (Corresponding Author).

3. Associate Professor of Economics, Institute for Management and Planning Studies, Tehran, Iran.