

Research Article

Analyzing the Asymmetric Effect of Economic Instability on Household Poverty and Income Inequality in Iran**

Delshad Rahman Maraneh¹ , Shahryar Zaroki^{*2} ,
Ahmad Jafari Samimi³ , Mani Motameni^{*2} 

1. Ph.D. Student in Public Sector Economics, Department of Theoretical Economics, Faculty of Economics and Administrative Sciences, University of Mazandaran, Babolsar, Iran.
2. Associate Professor, Department of Energy Economics, Faculty of Economic and Administrative Sciences, Mazandaran of University, Babolsar, Iran.
3. Professor, Department of Economics, Faculty of Economic and Administrative Sciences, Mazandaran of University, Babolsar, Iran.

Received 10 July 2025 Revise 14 December 2025 Accepted 15 December 2025 Publish 21 March 2026

Abstract

Economic stability is paramount for achieving sustainable growth and equitable income distribution. Addressing these critical issues within the Iranian context, this study investigates the asymmetric impacts of economic instability on household poverty and income inequality from 1984 to 2023. Employing the nonlinear autoregressive distributed lag (NARDL) approach, we compute the poverty gap index and the Foster–Greer–Thorbecke (FGT) indices using household income and expenditure data. The empirical findings reveal that economic instability has a direct and asymmetric long-run effect on poverty. Notably, reductions in economic instability lead to a more significant improvement in poverty metrics than the deterioration caused by increases in instability. Furthermore, while inflation and economic growth are found to exacerbate poverty, per capita income has a mitigating effect; the size of the government, however, shows no significant impact. Similar asymmetric and direct long-run effects are observed concerning income inequality, where a decrease in economic instability yields a more substantial benefit than the adverse consequences of increased instability. Additionally, inflation, the ratio of subsidies to government expenditures, and unemployment are identified as contributors to heightened income inequality. The study's findings on per capita income, showing a direct effect for the income variable and an inverse effect for its squared term, do not reject the Kuznets hypothesis.

Keywords: Household poverty, income inequality, Economic instability, Asymmetric approach, Iran

JEL Classification: I32, D63, C22

* **Corresponding Author:** Shahryar Zaroki

E-mail: Sh.zaroki@umz.ac.ir

Tel: +989116256572

** **Note:** This article is derived from the doctoral dissertation of *Delshad Rahman Maraneh* in Public Sector Economics at University of Mazandaran.

Cite This Article (APA): Rahman Maraneh, D., Zaroki, S., Jafari Samimi, A. & Motameni, M. (2026). Analyzing the Asymmetric Effect of Economic Instability on Household Poverty and Income Inequality in Iran. *Journal of Economic Policies and Research*, 5(1), 97-136. <https://doi.org/10.22034/jepr.2025.144051.1281>

Homepage of this Article: https://jepr.uok.ac.ir/article_64255.html?lang=en



© The Author(s), 2026. *Economic Policies and Research*, Published online by University of Kurdistan. This is an Open Access article distributed under the terms of the [Creative Commons Attribution 4.0 International License](https://creativecommons.org/licenses/by-nc/4.0/), which permits unrestricted use, distribution, and reproduction in any medium, provided the original author and source are credited.

Introduction

Reducing poverty and inequality is a central concern for policymakers worldwide, and international frameworks such as the Millennium Development Goals highlight the importance of poverty eradication. In Iran, the pursuit of social justice and the reduction of poverty and inequality have been emphasized in national strategic documents, including the Twenty-Year Vision Plan and the Five-Year Development Plans. However, unlike many countries, poverty in Iran has not declined, and international assessments suggest an upward trend. Income inequality also remains a persistent economic and social challenge, with adverse implications for economic growth, social well-being, and environmental quality. Poverty is a multidimensional concept defined either in absolute terms—reflecting the inability to secure a minimum standard of living—or in relative terms, referring to the inability to reach the living standards considered normal in society. Common poverty measures include the headcount ratio, poverty gap index, and the Foster–Greer–Thorbecke (FGT) index, which capture both the incidence and severity of poverty. Income inequality, on the other hand, stems from unequal access to resources and opportunities and is typically measured using indicators such as the Gini coefficient, Atkinson index, and Theil index. Economic instability—manifested through high inflation, exchange rate volatility, budget deficits, and balance of payments pressures—is recognized as a key determinant of poverty and inequality. Such instability undermines economic growth, reduces investment, and weakens social welfare, often producing asymmetric effects. Evidence suggests that economies experiencing greater instability tend to exhibit more unequal income distribution and lower welfare levels. Thus, analyzing the specific role of economic instability in shaping poverty and inequality is essential for designing effective policy interventions. Using the poverty gap and FGT indices and constructing an instability index based on ARCH and GARCH models, this study examines the asymmetric effects of economic instability on poverty and income inequality in Iran from 1984 to 2023 through the NARDL framework, aiming to provide more effective policy insights.

Methodology

The present study aims to examine the asymmetric effects of economic instability on poverty and income inequality in Iran. To this end, the nonlinear autoregressive distributed lag (NARDL) approach is employed, which allows for distinguishing between the effects of increases and decreases in economic instability on the dependent variables. The research is conducted in two parts: the first part investigates the asymmetric impact of economic instability on poverty using the poverty gap index and the Foster–Greer–Thorbecke.

$$\begin{aligned} \Delta PI_t = & \rho PI_{t-1} + \gamma^+ EcoII_{t-1}^+ + \gamma^- EcoII_{t-1}^- + \theta_1 EG_{t-1} + \theta_2 IPC_{t-1} + \theta_3 Inf_{t-1} + \\ & \theta_4 GS_{t-1} + \sum_{i=1}^{p-1} \rho_i \Delta PI_{t-i} + \sum_{i=0}^{q_1-1} \gamma_i^+ \Delta EcoII_{t-i}^+ + \sum_{i=0}^{q_2-1} \gamma_i^- \Delta EcoII_{t-i}^- + \\ & \sum_{i=0}^{r-1} \theta_i \Delta EG_{t-i} + \sum_{i=0}^{r-1} \theta_i \Delta IPC_{t-i} + \sum_{i=0}^{r-1} \theta_i \Delta Inf_{t-i} + \sum_{i=0}^{r-1} \theta_i \Delta GS_{t-i} + \vartheta_t \end{aligned} \quad (1)$$

The second part examines the similar effect on income inequality, using the expenditure ratio of the highest to the lowest decile, which is calculated based on Equation (2).

$$\begin{aligned} \Delta Ten_t = & \rho Ten_{t-1} + \gamma^+ EcoII_{t-1}^+ + \gamma^- EcoII_{t-1}^- + \theta_1 IPC_{t-1} + \theta_2 IPC_{t-1}^2 + \\ & \theta_3 SubR_{t-1} + \theta_4 Inf_{t-1} + \theta_5 UnEm_{t-1} + \sum_{i=1}^{p-1} \rho_i \Delta Ten_{t-i} + \sum_{i=0}^{q_1-1} \gamma_i^+ \Delta EcoII_{t-i}^+ + \\ & \sum_{i=0}^{q_2-1} \gamma_i^- \Delta EcoII_{t-i}^- + \sum_{i=0}^{r-1} \theta_{1i} \Delta IPC_{t-i} + \sum_{i=0}^{s-1} \theta_{2i} \Delta IPC_{t-i}^2 + \sum_{i=0}^{u-1} \theta_{3i} \Delta SubR_{t-i} + \\ & \sum_{i=0}^{v-1} \theta_{4i} \Delta Inf_{t-i} + \sum_{i=0}^{w-1} \theta_{5i} \Delta UnEm_{t-i} + \vartheta_t \end{aligned} \quad (2)$$

the volatility of inflation, budget deficits, exchange rates, and external debt. In addition to economic instability, economic growth, per capita income, inflation, government size, unemployment, and the ratio of subsidies to government expenditures are included as control variables. The data were collected from the Statistical Center of Iran and the Central Bank of Iran. Table (1) presents the variables and a summary of the calculation methods.

Table 1. Definitions and Calculations Methods of Variables

| Variable | Symbol | Definition | Calculation Method | Data Source |
|--|--------|---|---|------------------------------|
| poverty | PI | Inability to achieve a certain standard of living deemed necessary or desirable in the current society. | Poverty gap index and Foster–Greer–Thorbecke (FGT) | Calculated by the researcher |
| Income Inequality | Ten | Unequal distribution of resources and opportunities among individuals, groups within a population, or countries. | Expenditure ratio of the highest to the lowest decile | Calculated by the researcher |
| Macroeconomic Instability | Ecoll | A verage instability of macroeconomic variables such as inflation rate, exchange rate, budget deficit-to-GDP ratio, and external debt-to-GDP ratio. | A utoregressive Conditional Heteroskedasticity (ARCH) model | Calculated by the researcher |
| Inflation Rate | Inf | Growth rate of the general price index | CPI growth rate | Statistical Center of Iran |
| Per Capita Income | IPC | Ratio of Gross Domestic Product (GDP) to population | GDP divided by population | Statistical Center of Iran |
| Government Size | GS | Ratio of total government expenditure to GDP | Total government expenditure divided by GDP | Central Bank of Iran |
| Unemployment | UnEm | Ratio of unemployed labor force to total labor force | U nemployed labor force divided by total labor force | Statistical Center of Iran |
| S ubsidy-to-Government Expenditure Ratio | Subr | Ratio of government expenditure on subsidies | - | Central Bank of Iran |

Results and Discussion

Using the nonlinear autoregressive distributed lag (NARDL) model, the asymmetric effects of economic instability on poverty and income inequality were examined. Prior to estimation, stationarity tests including the Augmented Dickey-Fuller (ADF) and Phillips-Perron tests were performed, showing that some variables are stationary at levels while others require first differencing. The bounds test confirmed the existence of long-run relationships among poverty, income inequality, and explanatory variables. Diagnostic tests for normality, heteroskedasticity, serial correlation, and cumulative residuals confirmed the validity and stability of the model. Short-run results indicated that both increases and decreases in economic instability have a direct positive effect on poverty, with the impact of decreases being stronger than that of increases. Per capita income and government size exert negative effects, while economic growth and inflation increase poverty. In the long run, the asymmetric effect persists, with reductions in instability having a stronger impact on poverty. Per capita income and inflation also play a significant role in reducing household welfare and exacerbating inequality. Regarding income inequality, short-run effects reveal a direct and asymmetric impact of economic instability, with the Wald test confirming significant differences between the effects of increases and decreases. Per capita income and the subsidy-to-government-expenditure ratio negatively affect inequality, while inflation has a positive indirect effect, consistent with the inverted U-shaped Kuznets hypothesis. In the long run, economic instability continues to affect inequality asymmetrically, with reductions exerting stronger effects. Unemployment significantly increases inequality, and inflation particularly impacts low-income groups. Overall, the findings underscore that economic instability directly and asymmetrically affects both poverty and income inequality. Effective economic stabilization policies can therefore improve welfare, reduce disparities, and provide more equitable growth outcomes.

Conclusion

This study examined the effects of macroeconomic instability on poverty and income inequality in Iran over the period 1984–2023 using an asymmetric approach. The results indicate that macroeconomic instability has a direct and asymmetric long-run effect on both poverty and income inequality, with reductions in instability producing stronger effects than increases. Inflation and economic growth contribute to higher poverty, while real per capita income has a negative effect on poverty. Income inequality is also influenced by economic instability, inflation, subsidies, and unemployment, with the Kuznets hypothesis being supported. Based on the findings, it is recommended that governments reduce economic instability, control inflation, design targeted subsidies, enhance public expenditure efficiency, promote inclusive growth and employment, and focus on human development to mitigate poverty and inequality. Thus, sustainable economic stability, an efficient government, and inclusive growth emerge as three key pillars for effective policymaking.

Additional information

Authors' Contributions

This article is derived from the Doctoral dissertation of *Delshad Rahman Maraneh* in the field of Public Sector Economics, conducted under the supervision of Dr. **Shahryar Zaroki** and Dr. **Ahmad Jafari Samimi** with the advisement of Dr. **Mani Motameni**, in the Department of Theoretical Economics, University of Mazandaran, Babolsar, Iran.

Conflict of interest

The authors declare that there is no conflict of interest regarding the publication of this article.

Financial Support

The authors received no financial support for the research, authorship, and publication of this article.

ORCID

-  *Delshad Rahman Maraneh* <https://orcid.org/0009-0002-0727-6299>
-  *Shahryar Zaroki* <https://orcid.org/0000-0002-7078-4547>
-  *Ahmad Jafari Samimi* <https://orcid.org/0000-0002-9047-6189>
-  *Mani Motameni* <https://orcid.org/0000-0002-4814-3276>



تحلیل اثر نامتقارن بی‌ثباتی اقتصادی بر فقر خانوار و نابرابری در آمد در ایران**

دلشاد رحمان مرانه^۱، شه‌ریار زرورکی^{۲*}، احمد جعفری صمیمی^۳، مانی مؤتمنی^۲

۱. دانشجوی دکتری اقتصاد بخش عمومی، گروه اقتصاد نظری، دانشکده علوم اقتصادی و اداری، دانشگاه مازندران، بابلسر، ایران.
۲. دانشیار، گروه اقتصاد انرژی، دانشکده علوم اقتصادی و اداری، دانشگاه مازندران، بابلسر، ایران.
۳. استاد، گروه اقتصاد، دانشکده علوم اقتصادی و اداری، دانشگاه مازندران، بابلسر، ایران.

تاریخ دریافت: ۱۴۰۴/۰۴/۱۹ تاریخ بازنگری: ۱۴۰۴/۰۹/۲۳ تاریخ پذیرش: ۱۴۰۴/۰۹/۲۴ تاریخ انتشار: ۱۴۰۵/۰۱/۰۱

چکیده

کاهش فقر و نابرابری از مهم‌ترین اهداف سیاست‌گذاری اقتصادی است و ثبات اقتصادی نقش اساسی در ایجاد زمینه رشد پایدار و بهبود توزیع درآمد دارد. در ایران نیز باتوجه به اهمیت این مسائل، پژوهش حاضر به بررسی اثر نامتقارن بی‌ثباتی اقتصادی بر فقر خانوار و نابرابری درآمد طی دوره ۱۳۶۳-۱۴۰۲ می‌پردازد. در این مطالعه، شاخص شکاف فقر و شاخص فوستر - گریر - توربک بر اساس داده‌های درآمد - هزینه خانوار محاسبه و الگوی اقتصادسنجی با استفاده از رهیافت خود توضیح با وقفه‌های گسترده غیرخطی برآورد شده است. نتایج نشان می‌دهد که بی‌ثباتی اقتصادی در بلندمدت اثری مستقیم و نامتقارن بر فقر دارد، به گونه‌ای که کاهش بی‌ثباتی تأثیر مطلوب بیشتری نسبت به اثر نامطلوب افزایش آن دارد. همچنین تورم و رشد اقتصادی موجب افزایش فقر و درآمد سرانه موجب کاهش آن می‌شود، درحالی‌که اندازه دولت اثر معناداری ندارد. یافته‌ها درباره نابرابری درآمد نیز نشان می‌دهد که بی‌ثباتی اقتصادی در بلندمدت اثری مستقیم و نامتقارن دارد و کاهش بی‌ثباتی اثر مطلوب بیشتری نسبت به افزایش آن دارد. علاوه بر این، تورم، نسبت یارانه به مخارج دولت و بیکاری نابرابری را افزایش می‌دهند و باتوجه به اثر مستقیم درآمد سرانه و اثر معکوس مجذور آن، فرضیه کوزنتس رد نمی‌شود.

واژگان کلیدی: فقر خانوار، نابرابری درآمد، بی‌ثباتی اقتصادی، رهیافت نامتقارن، ایران

طبقه‌بندی JEL: C22, D63, I3

* نویسنده مسئول: شه‌ریار زرورکی آدرس رایانامه: Sh.zaroki@umz.ac.ir تلفن تماس: ۰۹۱۱۶۲۵۶۵۷۲

** یادداشت: مقاله حاضر برگرفته از رساله دکتری **دلشاد رحمان مرانه** در رشته اقتصاد بخش عمومی در دانشگاه مازندران است.

استناد به مقاله: رحمان مرانه، دلشاد، زرورکی، شه‌ریار، جعفری صمیمی، احمد، مؤتمنی، مانی. (۱۴۰۵). تحلیل اثر نامتقارن بی‌ثباتی اقتصادی بر فقر خانوار و نابرابری درآمد در ایران. *نشریه سیاست‌ها و تحقیقات اقتصادی*، ۵(۱)، ۹۷-۱۳۶.

<https://doi.org/10.22034/jepr.2025.144051.1281>

صفحه اصلی مقاله در سامانه نشریه: https://jepr.uok.ac.ir/article_64255.html



۱. مقدمه

یکی از مهم‌ترین اهداف سیاست‌گذاران در هر کشوری کاهش فقر و نابرابری است. همان‌طور که از اهداف توسعه هزاره^۱ هم مشخص است، اولین هدف این مجموعه از بین‌بردن فقر است. در ایران نیز یکی از ویژگی‌ها در افق چشم‌انداز بیست‌ساله، برخورداری از فرصت‌های برابر و دور از فقر است. یکی از سیاست‌های مهم برنامه‌های توسعه در ایران نیز که هر پنج سال یک‌بار ارائه داده می‌شود، کاهش فقر است. علی‌رغم اینکه در اکثر کشورهای جهان فقر در حال کاهش است، در ایران روند فقر افزایشی است. به طور مثال، بانک جهانی در ارزیابی اخیر خود نشان می‌دهد که فقر در ایران با معیاری بالاتر از ۵ دلار در روز در حال افزایش است (World Bank, 2020).

نابرابری نیز در سال‌های اخیر همچنان چالشی مهم برای اکثر کشورهای در حال توسعه محسوب می‌شود (Kaulihowa & Adjasi, 2018). نابرابری درآمد، قادر به تأثیرگذاری بر متغیرهای مختلف اقتصادی و اجتماعی نظیر رشد اقتصادی، تراز حساب جاری، سلامت اجتماعی جامعه، میزان جرم و جنایت و کیفیت محیط‌زیست است (زرزکی و همکاران، ۱۴۰۰). باتوجه به اثرپذیری دیگر متغیرها از نابرابری درآمد، می‌توان اظهار داشت که توزیع درآمد بر زندگی افراد جامعه در ابعاد اقتصادی، اجتماعی و زیست‌محیطی تأثیرگذار است. موضوع نابرابری توزیع درآمد در ایران نیز مسئله‌ای جدی و قابل‌بحث است. بر اساس آمارهای بانک جهانی نابرابری توزیع درآمد در بیشتر کشورهای جهان کمتر از ایران است و از این منظر، تحلیل و بررسی نابرابری درآمد و عوامل اثرگذار بر آن باهدف کنترل و کاهش این پدیده، دارای اهمیت است. در این راستا لازم است پیش از هر اقدامی جهت سیاست‌گذاری و برنامه‌ریزی برای کاهش فقر و نابرابری، با استفاده از شاخص‌های مربوطه وضعیت فقر و نابرابری را مشخص کرد. بررسی دقیق فقر از دو نظر دارای اهمیت زیادی است. نخست این‌که افراد فقیر و آسیب‌پذیر شناسایی می‌شوند. دوم آنکه می‌توان از آن برای بررسی اثر سیاست‌های اجرا شده بر ابعاد مختلف فقر استفاده کرد و این یکی از مهم‌ترین چالش‌های پیشروی سیاست‌گذاران توسعه و رفاه است.

قبل از آنکه سن^۲ مفهوم فقر قابلیت‌ی را معرفی کند، فقر باتوجه به درآمد یا هزینه افراد و بر اساس یک مقدار حداقل از این متغیرها تعریف می‌شود. توافق عمومی وجود دارد که مشخصه فقر، نداشتن منابع کافی برای دسترسی به کالاها و خدمات لازم برای حداقل یا از نظر اجتماعی استاندارد قابل قبول زندگی است. فقر را می‌توان به‌عنوان یک مفهوم مطلق یا نسبی بسته به اینکه آستانه فقر چگونه تعریف می‌شود، نگرست. بحثی طولانی در مورد اینکه آیا باید از یک آستانه مطلق یا نسبی برای تصمیم‌گیری در مورد اینکه چه کسی فقیر است یا نه استفاده شود، وجود دارد (Ravallion, 2010; Gordon, 2006). به‌عنوان یک مفهوم مطلق، فقر به سطحی از منابع اشاره دارد که با تغییر استاندارد زندگی عمومی در طول زمان تغییر نمی‌کند. در این مفهوم مطلق، فقر اغلب با آستانه پایین همراه است. به‌عنوان یک مفهوم نسبی، سطح محرومیت مرتبط با فقیر بودن در راستای تغییرات در استاندارد زندگی عمومی تغییر می‌کند (Yang, 2017). رین‌واتر^۳ (۱۹۹۰) فقر را با استفاده از یک آستانه پولی تعریف کرد

1. Millennium Development Goals

2. Sen

3. Rainwater (1990)

که در درآمدی کمتر از آن برای برآورده کردن حداقل نیازهای یک زندگی سالم و مولد ناکافی تلقی می‌شد؛ بنابراین، مفهوم فقر مطلق با توانایی برآوردن مجموعه‌ای از حداقل نیازهای اساسی همراه است. مفهوم فقر نسبی معمولاً به تانسندا^۱ (۱۹۷۹) نسبت داده می‌شود. فقر نسبی به‌عنوان ناتوانی در کسب یک سطح معین از استانداردهای زندگی که در جامعه فعلی لازم یا مطلوب تشخیص داده می‌شود، تعریف شده است؛ بنابراین در تعریف فقر نسبی، به نابرابری در توزیع درآمد و ثروت بیش از میزان مطلق درآمد افراد توجه می‌شود. درحالی‌که فقر را می‌توان به‌عنوان یک مفهوم مطلق یا نسبی در نظر گرفت، نابرابری همیشه یک مفهوم نسبی است. نابرابری مربوط به توزیع نابرابر منابع و فرصت‌ها در بین افراد، بین گروه‌های یک جمعیت یا بین کشورهاست که در یک مقطع زمانی مشخص یا در طول زمان رخ می‌دهد. نابرابری اقتصادی به‌طور کلی بر تفاوت درآمد، ثروت و مصرف متمرکز است، اگرچه بسیاری از نابرابری‌های مرتبط دیگر مانند نابرابری در تحصیلات یا بهداشت می‌توانند در نتیجه آن ایجاد شوند.

در ایران توجه به مسئله فقر و فقرزدایی متأثر از یک موج جهانی بوده است که کشورهای توسعه‌نیافته را بیش از سایر کشورها تحت‌تأثیر قرار داده است. در ایران اگر چه اقدامات مربوط به تأمین اجتماعی و حمایت از فقرا و آسیب‌پذیران سابقه‌ای دست‌کم ۴۰ ساله دارد، ولی دستاورد برنامه‌ها از لحاظ آسیب‌پذیری درآمدی و کاهش فقر در کشور قابل‌توجه نیست (پیش‌بهار و همکاران، ۱۳۹۸). همچنین در ایران سیاست‌های مختلفی^۲ جهت مقابله با فقر اجرا شده است؛ ولی عواملی نظیر رکود اقتصادی، تورم بالا، بیکاری شدید، تغییرات جمعیتی و یارانه‌های عام و غیره‌دفعند باعث شده است تا اقتصاد ایران همچنان درگیر فقر و پیامدهای آن باشد؛ بنابراین پیش‌شرط اساسی توفیق در برنامه‌های کاهش فقر شناخت عوامل مؤثر بر فقر، سیاست‌گذاری و تدوین برنامه‌های مناسب برای کاهش فقر است. در این راستا و به‌طور ضمنی، حفظ ثبات اقتصادی برای کاهش فقر ضروری است. روی دیگر ثبات اقتصادی، بی‌ثباتی در آن است. وقتی در مورد بی‌ثباتی اقتصادی صحبت می‌شود، منظور افزایش یک یا چند شاخص از شاخص‌های بی‌ثباتی اقتصادی مانند نرخ تورم، نسبت کسری بودجه دولت به تولید ناخالص داخلی، انحراف در نرخ حقیقی ارز و نسبت بدهی به تولید ناخالص داخلی است که از سیاست یا راهکارهای اعمال شده توسط دولت ناشی می‌شود (Fischer, 1993). در صورتی که نسبت کسری بودجه به تولید ناخالص داخلی در سطح معقولی باشد و نرخ تورم نیز کم‌وبیش قابل‌پیش‌بینی باشد، نرخ حقیقی ارز رقابتی و نزدیک به سطح تعادلی و وضعیت نرخ بهره و تراز پرداخت‌ها مناسب رشد و توسعه باشد، اقتصاد شرایط با ثباتی خواهد داشت. ولی در صورتی که با نرخ‌های بالای تورم و کسری بودجه فزاینده و ناپایدار، نوسانات شدید نرخ حقیقی ارز و کسری مزمن تراز پرداخت‌ها مواجه باشیم، می‌توان گفت که محیط اقتصاد با شرایط بی‌ثباتی همراه است (Paul, 2002). از آنجا که کشورهای در حال توسعه غالباً با نرخ‌های بالای تورم، کسری بودجه فزاینده و ناپایدار، نوسانات شدید نرخ حقیقی ارز و کسری مزمن تراز پرداخت‌ها مواجه هستند، توجه به آن در سیاست‌گذاری‌های اقتصادی از جمله برنامه‌های کاهش فقر و نابرابری درآمد، ضروری به نظر می‌رسد (Heipertz et al, 2010).

1. Townsend (1979)

۲. مانند طرح سهمیه‌بندی و کوپن، مسکن مهر، سبد کالا، کمیته امداد، پرداخت‌های مستقیم دولت

باتوجه به اهمیت بی‌ثباتی اقتصادی بر فقر و نابرابری در این مطالعه تلاش بر آن است تا در گام نخست فقر در اقتصاد ایران با استفاده از داده‌های خام درآمد - هزینه خانوار و بر مبنای شاخص فوستر، گریر و توربک^۱ (FGT) محاسبه شود. در گام دوم نیز شاخص بی‌ثباتی اقتصادی بر مبنای بی‌ثباتی در چهار زیرشاخص با روش آرچ^۲ و گارچ^۳ برآورد شود. در گام سوم در قالبی نامتقارن و با استفاده از رهیافت خود توضیح با وقفه‌های گسترده غیرخطی اثر بی‌ثباتی اقتصادی بر فقر خانوار و نابرابری درآمد طی دوره ۱۴۰۲-۱۳۶۳ برآورد و تجزیه و تحلیل شد. بدین توضیح که وجود تفاوت در اثر افزایش‌ها در بی‌ثباتی اقتصادی بر فقر خانوار و نابرابری از اثر کاهش‌ها در بی‌ثباتی اقتصادی آزمون خواهد شد. در این راستا چارچوب مقاله بدین شرح است که در ادامه و بعد از مقدمه، بخش دوم به ادبیات پژوهش با تمرکز بر ادبیات نظری و تجربی اختصاص یافته است. در بخش سوم به تصریح الگوی پژوهش، محاسبه شاخص فقر، نابرابری، بی‌ثباتی اقتصادی و توصیف داده‌ها پرداخته شده است. در بخش چهارم، تحلیل نتایج برآورد الگو در قالب نامتقارن صورت می‌گیرد و در نهایت جمع‌بندی و پیشنهادهای پژوهش ارائه می‌شود.

۲. ادبیات پژوهش

۲-۱. مبانی نظری

۲-۱-۱. فقر

ارائه تعریف جامع و دقیقی از فقر مشکل است. فقر را می‌توان از جهات گوناگون تعریف کرد. تانسن^۴ در دهه‌های ۱۹۶۰ و ۱۹۷۰ اعتقاد داشت که افراد، خانوارها و گروه‌های جمعیتی را زمانی می‌توان فقیر به حساب آورد که با فقدان منابع برای کسب انواع رژیم‌های غذایی، مشارکت در فعالیت‌ها و شرایط و امکانات معمول زندگی مواجه باشند. از دیدگاه بانک توسعه آسیا (۲۰۱۱)^۵ فقر، محرومیت از دارایی‌ها و فرصت‌هایی است که هر فرد مستحق آنها است. روان‌تری و بوت^۶ نیز در اواخر قرن نوزدهم تلاش کردند که بین فقر نسبی و مطلق تمایز قائل شوند. از دیدگاه آنها فقر مطلق به‌عنوان ناتوانی در کسب حداقل استاندارد زندگی تعریف شده است و بستگی به چگونگی تعریف حداقل معاش دارد و فقر نسبی به‌عنوان ناتوانی در کسب یک سطح معین از استانداردهای زندگی که در جامعه فعلی، لازم یا مطلوب تشخیص داده می‌شود، تعریف شده است (ارضروم چیلر، ۱۳۸۴). فقر در واقع فقدان منابع و امکانات است که در نتیجه آن محرومیت در اشکال مختلف ظاهر می‌شود؛ بنابراین می‌توان فقر را به‌صورت مستقیم و با معیار درآمد (تک‌بعدی) و همچنین می‌توان به‌صورت غیرمستقیم و در نظر گرفتن معیارهایی که خانوار در صورت محرومیت از آن‌ها فقیر محسوب می‌شود (چندبعدی) سنجید. در رویکرد تک‌بعدی، شاخص فقر باتوجه به درآمد یا هزینه‌های مصرفی خانوار محاسبه می‌شود.

1. Foster, Greer & Thorbecke

2. ARCH

3. GARCH

4. Townsend

5. Asian Development Bank (2011)

6. Roentree & Booth

باتوجه به رویکرد درآمدی به فقر و تعریف‌هایی از فقر که بر اساس این رویکرد صورت گرفته است، شاخص‌هایی جهت اندازه‌گیری فقر درآمدی معرفی شده‌اند. یکی از این شاخص‌ها، شاخص نسبت افراد فقیر یا سرشمار است که برابر با تعداد افراد فقیر نسبت به تعداد کل افراد جامعه است. مقدار این شاخص زمانی که هیچ فقری در جامعه وجود ندارد صفر و زمانی که درآمد همه افراد جامعه کمتر از خط فقر باشد، یک است. کاربرد این شاخص باتوجه به برخی مشکلات با محدودیت‌هایی روبرو است. یکی از اشکالات اساسی این شاخص این است که به انتقال درآمد بین فقیرها و حتی بین فقیرها و غیر فقیرها و همچنین نسبت به کاهش درآمد فقرا حساس نیست. یکی دیگر از این شاخص‌ها، شاخص نسبت شکاف درآمدی یا شاخص شکاف فقر^۱ است که فاصله درآمد افراد فقیر تا خط فقر را به صورت نسبی از خط فقر بیان می‌کند. این شاخص نشان‌دهنده شدت و عمق فقر است. اگر دو شاخص نسبت افراد فقیر و نسبت شکاف درآمدی همراه هم به کار گرفته شوند، می‌توانند به صورت کامل و روشن‌تری فقر را نشان دهند. در نهایت می‌توان به شاخص فوستر، گریر و توریک که از دیگر شاخص‌های سنجش فقر بر اساس رویکرد درآمدی است، اشاره کرد که بیانگر عمق و شکاف فقر است و به صورت هم‌زمان درصد افراد فقیر، فاصله آن‌ها از خط فقر و شدت فقر را بررسی می‌کند و در آن فقر به صورت تابعی از نسبت شکاف فقر در نظر گرفته می‌شود (عصاری و مزینانی، ۱۳۹۰). باتوجه به رویکرد چندبعدی، ریشه و علت اصلی فقر را نمی‌توان فقط کمبود یا نبود درآمد دانست، بلکه ریشه‌های اصلی آن در فقدان شرایطی است که امکان خروج از وضعیت فقر را برای افراد فقیر فراهم می‌کند. سن معتقد است که هدف از توسعه بهبود و ارتقای توانایی‌های افراد و گسترش آن‌ها است؛ بنابراین نمی‌توان فقیر را به عنوان کسی که درآمد ندارد تعریف نمود. بلکه فقیر کسی است که توانایی خارج شدن از وضعیت فقر را ندارد.

۳-۱-۲. نابرابری درآمد

نابرابری مربوط به توزیع نابرابر منابع و فرصت‌ها در بین افراد، بین گروه‌های یک جمعیت یا بین کشورها است که در یک مقطع زمانی مشخص یا در طول زمان رخ می‌دهد. نابرابری اقتصادی به‌طور کلی بر تفاوت درآمد، ثروت و مصرف متمرکز است. اگرچه بسیاری از نابرابری‌های مرتبط دیگر مانند نابرابری در تحصیلات یا بهداشت می‌توانند در نتیجه آن ایجاد شوند. شاخص‌های نابرابری را می‌توان در دو طبقه کلی دسته‌بندی کرد. یک دسته از این شاخص‌ها میزان نابرابری را در یک مفهوم عینی اندازه‌گیری می‌کنند که معمولاً با استفاده از شاخص‌های آماری تغییر نسبی درآمد، مانند واریانس، ضریب تغییر و ضریب جینی صورت می‌گیرد. دسته دیگر این شاخص‌ها نابرابری را بر حسب مفهومی هنجاری از رفاه اجتماعی اندازه‌گیری می‌کنند. به نحوی که درجه نابرابری بیشتر منعکس‌کننده سطح پایین‌تر رفاه اجتماعی برای سطح معینی از درآمد کل است. از انواع این شاخص‌ها می‌توان به شاخص آتکینسون^۲ و تایل^۳ اشاره کرد (راغفر و همکاران، ۱۳۹۰). این موضوع که چگونه محیط اقتصاد بر توزیع درآمد تأثیر می‌گذارد از زمان کوزنتس^۴ (۱۹۵۵) بحث مهمی در میان اقتصاددانان و سیاست‌گذاران بوده

1. Poverty Gap
2. Atkinson
3. Tyle
4. Kuznets (1955)

است. در رابطه با ارتباط رشد اقتصادی و نابرابری درآمد، کوزنتس این فرض را بیان می‌کند که در مراحل اولیه توسعه اقتصادی، در اثر افزایش تولید (درآمد سرانه)، نابرابری درآمد افزایش می‌یابد تا اینکه به نقطه بیشینه (رسیدن به سطح مشخصی از توسعه) می‌رسد. سپس نابرابری درآمد در اثر افزایش تولید، روند کاهشی خواهد داشت. این الگوی حرکتی نابرابری درآمد در دو مرحله مختلف از توسعه اقتصادی را فرضیه U وارونه کوزنتس می‌نامند (Younsi & Bechtini, 2020).

۳-۱-۲. ثبات اقتصادی، فقر و نابرابری درآمد

مفهوم بی‌ثباتی اقتصادی، همچون برخی از مفاهیم پایداری علم اقتصاد دارای معنی روشن و ثابتی نیست. ولی آنچه کاملاً مشهود بوده این است که بی‌ثباتی اقتصادی با مسائلی چون نرخ‌های تورم بالا، نوسانات شدید نرخ ارز، بی‌ثباتی تراز پرداخت‌ها و کسری بودجه ارتباط دارد (Eghbali et al, 2003). وقتی در مورد بی‌ثباتی اقتصادی صحبت می‌شود، منظور افزایش یک یا چند شاخص از شاخص‌های بی‌ثباتی اقتصادی مانند نرخ تورم، نسبت کسری بودجه دولت به تولید ناخالص داخلی، انحراف در نرخ حقیقی ارز و نسبت بدهی به تولید ناخالص داخلی است که از سیاست یا راهکارهای اعمال شده توسط دولت ناشی می‌شود (Fischer, 1993). در صورتی که نسبت کسری بودجه به تولید ناخالص داخلی در سطح معقولی باشد و نرخ تورم نیز کم‌وبیش قابل‌پیش‌بینی باشد، نرخ حقیقی ارز رقابتی و نزدیک به سطح تعادلی و وضعیت نرخ بهره و تراز پرداخت‌ها مناسب رشد و توسعه باشد، اقتصاد شرایط با ثباتی خواهد داشت. ولی در صورتی که با نرخ‌های بالای تورم و کسری بودجه فزاینده و ناپایدار، نوسانات شدید نرخ حقیقی ارز و کسری مزمن تراز پرداخت‌ها مواجه باشیم، می‌توان گفت که محیط اقتصادی با شرایط بی‌ثباتی همراه است (Paul, 2002).

نوسانات اقتصادی به تغییرات کوتاه‌مدت متغیرهای اقتصادی مرتبط هستند. این متغیرها به‌عنوان مجراهای واسط نهادها و عوامل بی‌ثبات‌کننده اقتصادی عمل می‌کنند. آژانس توسعه بنگاه‌های نوژا، نوسان کوتاه‌مدت در متغیرهای اقتصادی از قبیل تولید ناخالص داخلی، تورم، کسری بودجه و حساب‌جاری را بی‌ثباتی اقتصادی تعریف می‌کند. در این دیدگاه بی‌ثباتی اقتصادی می‌تواند رشد بالقوه بلندمدت را از طریق کاهش در تمایل به سرمایه‌گذاری تضعیف کند. بر اساس ضوابط ماستریخت^۲ نیز ثبات اقتصادی از طریق تورم پایین و باثبات، نرخ بهره بلندمدت پایین، نسبت اندک بدهی به تولید ناخالص داخلی، کسری‌های پایین دولت و نرخ ارز باثبات سنجیده می‌شود (Financial Glossary, 2011). به‌طور کلی و بر اساس آنچه ذکر شد در تعریف یک محیط باثبات اقتصادی بر پنج شاخص نرخ تورم، نرخ ارز، نرخ بهره، وضعیت مالی دولت و وضعیت تراز پرداخت‌ها تأکید می‌گردد (Fischer, 1988). از آنجاکه کشورهای در حال توسعه غالباً با نرخ‌های بالای تورم، کسری بودجه فزاینده و ناپایدار، نوسانات شدید نرخ حقیقی ارز و کسری مزمن تراز پرداخت‌ها مواجه هستند، توجه به آن در سیاست‌گذاری‌های اقتصادی از جمله برنامه‌های کاهش فقر و نابرابری درآمد، ضروری به نظر می‌رسد (Heipertz et al, 2010).

ثبات اقتصادی که شرط اولیه ایجاد اعتماد در سرمایه‌گذاری و رسیدن به رشد پایدار است، یکی از مهم‌ترین جنبه‌ها در راهبردهای کاهش فقر و نابرابری نیز است. وجود و افزایش بی‌ثباتی اقتصادی به‌عنوان پدیده‌ای نامطلوب، هزینه‌های اقتصادی - اجتماعی زیادی برای جامعه به دنبال دارد. در مطالعه‌های صورت‌گرفته از سوی فریرا و کیلی^۱ (۱۹۹۹) و لوستیگ و والتون^۲ (۱۹۹۸) به مجراهای مختلفی اشاره شده که از طریق آن‌ها بی‌ثباتی اقتصاد کلان، فقر و نابرابری را متأثر می‌سازد. مجراهای مذکور را می‌توان به پنج دسته تقسیم کرد.

۱- تغییر قیمت‌های نسبی: تکانه‌ها از قبیل نوسان نرخ ارز، قیمت کالا، خدمات و سیاست‌ها از قبیل اصلاحات تجاری و تغییرات در مالیات یا یارانه، قیمت‌های نسبی را متأثر می‌کنند. این تغییرات قیمتی نیز سودآوری بخش‌ها و دستمزدهای اسمی و سطوح اشتغال را تحت‌تأثیر قرار می‌دهند. برای مثال کاهش ارزش پول ناشی از انقباض مالی حاکی از آن است که قیمت کالاهای قابل تجارت باید نسبت به دیگر کالاهای غیر قابل تجارت افزایش یابد. اگر فقرا عرضه‌کننده کالاهای قابل تجارت (غیر قابل تجارت) باشند و یا تمایل داشته باشند در صنایع تولیدکننده این کالاها کار کنند، از این انقباض مالی از طریق تغییر در قیمت‌های نسبی منفعت (زبان) خواهند برد.

۲- تغییر در تقاضای کار: تکانه‌ها در کوتاه‌مدت خانوارها را از طریق کاهش در تقاضای نیروی کار ناشی از کاهش در تقاضای کل برای کالاها و خدمات تحت‌تأثیر قرار می‌دهند.

۳- بازدهی دارایی‌های فیزیکی: تغییر بازدهی می‌تواند نرخ پس‌انداز خانوار را متأثر کند، درحالی‌که بخشی از درآمدهای غیرکاری از همین پس‌اندازها حاصل می‌شود. تغییر مذکور همچنین بر بدهی خانوارها و توانایی آن‌ها در مقابله با بی‌ثباتی اقتصاد کلان و تکانه‌های اقتصادی تأثیر می‌گذارد.

۴- انتقالات عمومی: کاهش پرداخت‌های انتقالی، ارائه خدمات اجتماعی و همچنین دسترسی فقرا به این خدمات را به‌ویژه در زمانی که درآمدهایشان کاهش یافته است محدود می‌کند.

۵- اثرات بر سرمایه اجتماعی: بی‌ثباتی و تکانه‌های اقتصاد کلان ممکن است مهاجرت را افزایش داده و به شکست میان گروه‌های قومی، اجتماعی و مذهبی بینجامد.

منبع این نظریه را که بی‌ثباتی اقتصادی تأثیر منفی بر رفاه انسان دارد را می‌توان در مطالعه پتری^۳ (۱۹۹۳) پیدا کرد. افزایش بی‌ثباتی اقتصادی، ساختار و امنیت اقتصادی کشور را مختل می‌کند و با هزینه‌هایی که بر زندگی اشخاص وارد می‌کند، به کاهش در رفاه خانوارها منجر می‌شود (گیلک حکیم‌آبادی و همکاران، ۱۳۹۶). بی‌ثباتی اقتصادی همچنین باعث کاهش رشد اقتصادی، کاهش سرمایه‌گذاری و انباشت سرمایه بخش خصوصی و انحراف در توزیع درآمد می‌شود؛ بنابراین یکی از مهم‌ترین راهبردها در کاهش فقر و چشم‌انداز مثبت برای سرمایه‌گذاری و رسیدن به رشد پایدار و در نتیجه کاهش فقر و نابرابری، ثبات اقتصادی است. بی‌ثباتی در اقتصاد شرایطی را ایجاد می‌کند که برای بهره‌مندی از آن نیاز به هزینه‌های بالای مبادلات است. به دلیل اینکه که همه

1. Ferreira & Keely (1999)
2. Lustig & Walton (1998)
3. Petri (1993)

اعضای جامعه قادر نیستند این هزینه‌ها را پرداخت کنند، منافع بین اعضای جامعه به صورت برابر توزیع نمی‌شود که این امر باعث به وجود آمدن نابرابری شده و در نتیجه موجب کاهش توسعه اجتماعی می‌گردد. ادبیات نشان می‌دهد عوامل متعددی نظیر تورم بالا، بدهی‌های خارجی بسیار زیاد، نوسانات بالای نرخ حقیقی ارز و کسری تراز پرداخت‌ها باعث ایجاد فقر و نابرابری درآمد در کشورهای در حال توسعه می‌شود. در این زمینه هاسمن و گاوین^۱ (۱۹۹۶) نشان داده‌اند که در اقتصادهایی که بی‌ثباتی اقتصادی بیشتر است، توزیع درآمد نیز بسیار نامتعادل‌تر است. رامی و رامی^۲ (۱۹۹۴) نیز بر این باورند که در کشورهای در حال توسعه که تلاطم تولید و نوسانات اقتصادی بالاتر است، رفاه اجتماعی نیز کمتر است. مشاهده شده است که کشورهای توسعه‌یافته که دارای حداقل بی‌ثباتی اقتصادی هستند، نابرابری نسبتاً پایین و رشد اقتصادی باثباتی را تجربه کرده‌اند (Ditta & Hayat, 2017). پس از اهداف توسعه هزاره، کاهش اختلاف درآمد و بی‌ثباتی اقتصادی از اهداف اصلی کشورهای عضو سازمان ملل متحد است. بی‌ثباتی اقتصادی نه تنها هدف سیاست‌گذار طبیعی دولت‌ها است، بلکه می‌تواند به عنوان عامل مهمی بر توزیع درآمد نیز تلقی شود (Ali, 2016). دیمیری و ادیسون^۳ (۱۹۸۷) اشاره می‌کنند که افزایش تورم، کسری تراز پرداخت‌ها و کسری بودجه باعث ایجاد مشکلات توزیعی می‌شود.

۲-۲. پیشینه پژوهش

مطالعات متنوعی در ارتباط با تأثیر بی‌ثباتی اقتصادی بر فقر و نابرابری به صورت جداگانه و تأثیر زیرشاخص‌های بی‌ثباتی به صورت جداگانه بر فقر و نابرابری صورت گرفته است. در ادامه به برخی از این مطالعات اشاره می‌شود. نوفرستی و محمدی (۱۳۸۸) در مطالعه‌ای برای ایران طی دوره زمانی (۱۳۹۳-۱۳۸۳) با استفاده از روش خودرگرسیون برداری^۴ نشان دادند که علی‌رغم اینکه شوک نرخ ارز و تورم در مناطق روستایی اثر قابل توجهی بر نابرابری نداشته است، اما در مناطق شهری باعث افزایش نابرابری درآمدی می‌شود.

رحمانی و همکاران (۱۳۹۱) در مطالعه‌ای برای ۴۰ کشور در حال توسعه طی دوره زمانی (۲۰۱۰-۱۹۹۷) با استفاده از الگوی رگرسیونی مبتنی بر داده‌های تابلویی^۵ نشان دادند که افزایش بی‌ثباتی سیاست‌های اقتصادی موجب افزایش ضریب جینی شده و نابرابری درآمدی را افزایش می‌دهد.

کميجانی و محمدزاده (۱۳۹۳) در مطالعه‌ای در ایران طی دوره (۱۳۸۸-۱۳۶۳) با استفاده از روش رگرسیون به ظاهر نامرتبط^۶ نشان دادند که تورم، بیکاری، مخارج دولت و سهم ۱۰ درصد ثروتمند به فقیر باعث افزایش فقر و سهم ۴۰ درصد فقیر و افزایش یارانه کالاهای اساسی فقر را کاهش می‌دهند. علاوه بر این تورم، بیکاری، نسبت سهم ۱۰ درصد بالا به فقیر و یارانه کالاهای اساسی به نفع ثروتمند عمل کرده و باعث افزایش نابرابری می‌شود و افزایش سهم ۴۰ درصد فقیر نیز به نفع افراد با درآمد پایین عمل کرده و باعث کاهش نابرابری می‌شود.

1. Hausman & Gavin (1996)
2. Ramey & Ramey (1994)
3. Demery & Addison (1987)
4. Vector Autoregression
5. Panel Data Regression
6. Seemingly Unrelated Regression

ملکی (۱۳۹۴) در مطالعه‌ای برای ایران طی دوره زمانی (۱۳۹۰-۱۳۵۷) با استفاده از الگوی خود توضیح برداری به این نتیجه رسیدند که ناپایداری نرخ ارز، باعث افزایش در نابرابری درآمد می‌شود. علاوه بر این در کوتاه‌مدت رشد اقتصادی و مخارج دولتی نابرابری را افزایش و نرخ واقعی ارز آن را کاهش می‌دهد. ولی نرخ حقیقی ارز در بلندمدت باعث افزایش نابرابری می‌شود.

زروکی و همکاران (۱۴۰۰) طی دوره ۱۳۵۰ تا ۱۳۹۷ با استفاده از رهیافت خود توضیح با وقفه‌های گسترده غیرخطی^۱ برای ایران نشان دادند که در هر دو قالب متقارن و نامتقارن، بی‌ثباتی اقتصاد کلان، اثری مستقیم بر توزیع درآمد دارد؛ به‌نحوی که بر مبنای الگوی نامتقارن، افزایش‌ها در بی‌ثباتی اقتصاد کلان، نابرابری درآمد را افزایش (اثر نامطلوب)، و کاهش‌ها در آن، نابرابری را کاهش (اثر مطلوب) می‌دهد. از حیث اندازه اثر، کاهش‌ها در بی‌ثباتی اقتصاد کلان، بیش از افزایش‌ها در بی‌ثباتی بر نابرابری درآمد اثرگذار است. علاوه بر این، در هر دو قالب متقارن و نامتقارن، افزایش در مالیات مستقیم و قیمت انرژی، نابرابری درآمد را کاهش و افزایش در مالیات غیرمستقیم، نابرابری درآمد را افزایش می‌دهد. همچنین در این پژوهش، فرضیه کوزنتس رد نمی‌شود.

حبیبی و همکاران (۱۴۰۲) با استفاده از روش خود توضیح با وقفه‌های گسترده غیرخطی طی دوره زمانی ۱۳۵۹ تا ۱۴۰۰ برای کشور ایران نشان دادند که در کوتاه‌مدت و بلندمدت بلایای طبیعی، شاخص جهانی شدن، تولید ناخالص داخلی و نرخ تورم اثر مثبت و معناداری بر نابرابری درآمدی دارند. همچنین، شاخص آموزش، مجذور تولید ناخالص داخلی و توسعه مالی اثر منفی و معناداری بر نابرابری درآمدی دارند. نتایج رابطه درجه دوم نابرابری درآمد و رشد اقتصادی در این مطالعه فرضیه کوزنتس را تأیید می‌کند. همچنین، نتایج، اثر نامتقارن توسعه مالی و جهانی شدن بر نابرابری درآمدی را تأیید می‌کند.

رفعت میلانی و همکاران (۱۴۰۳) با استفاده از روش غیرخطی رگرسیون انتقال ملایم^۲ طی دوره ۱۳۷۰ تا ۱۴۰۱ برای اقتصاد ایران نشان دادند که اثرات اولیه بدهی‌های دولت بر متغیر شاخص فقر منفی و معنادار شده، ولی اثرات ثانویه مثبت و معنادار بوده است، لذا برآیند کل نشان داد که افزایش بدهی‌های دولت منجر به افزایش ۲/۸۰۱ درصدی در فقر خواهد شد. نرخ تورم و رشد جمعیت در هر دو رژیم دارای اثرات مثبت و معناداری بر فقر بودند. همچنین اثرات متغیرهای حکمرانی، توسعه انسانی و رشد تولید ناخالص داخلی در رژیم اول بر فقر مثبت بوده؛ ولی در رژیم دوم این اثرات منفی و کاهش‌دهنده فقر بوده است.

حاجیلی دوجی و علمی (۱۴۰۳) طی دوره زمانی ۲۰۰۸ تا ۲۰۲۱ برای کشورهای خاورمیانه و شمال آفریقا (منطقه منا)^۳ با استفاده از رویکرد گشتاورهای تعمیم‌یافته سیستمی^۴ نشان دادند که شاخص ثبات سیاسی، شاخص حق اظهارنظر و پاسخگویی، تولید ناخالص داخلی سرانه اثر منفی و متغیرهای شاخص کیفیت مقررات تنظیمی و اندازه دولت اثر مثبت بر نابرابری درآمدی دارند. همچنین متغیرهای نرخ تورم و سرمایه گذاری مستقیم خارجی با اثر مثبت بی معنی بودند.

-
1. Non-linear Autoregressive Distributed Lag (NARDL)
 2. Nonlinear Smooth Transition Regression Model (STR)
 3. MENA Region
 4. Systemic Generalized Moments Method

اوبی (۲۰۰۷)^۱ در مطالعه کشور نیجریه طی دوره زمانی (۱۹۷۰-۱۹۹۸) با استفاده از مدل تعادل عمومی (CGE) نتیجه گرفت که درآمد دولت به طور مثبت درآمد را بازتوزیع می‌کند؛ ولی مخارج دولت ابزار مهم و مؤثر بازتوزیع درآمد و کاهش فقر است.

علی (۲۰۱۶)^۲ در مطالعه‌ای برای پاکستان طی دوره زمانی (۱۹۸۰-۲۰۱۵) با استفاده از الگوی خودرگرسیون برداری به این نتیجه رسید که بین بی‌ثباتی و نابرابری درآمد در پاکستان رابطه بلندمدت وجود دارد. همچنین، نشان می‌دهد که بی‌ثباتی اقتصادی، تأثیر عمیقی بر نابرابری درآمد در پاکستان دارد.

دیتا و حیات (۲۰۱۷)^۳ در مطالعه‌ای برای کشورهای در حال توسعه طی دوره زمانی (۱۹۹۲-۲۰۱۴) با استفاده از روش خودرگرسیون با وقفه‌های توزیعی و میانگین گروهی تلفیقی نشان دادند که بی‌ثباتی اقتصادی به طور قابل توجهی باعث افزایش در نابرابری درآمد می‌شود. همچنین با افزایش سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی و هزینه‌های بهداشت عمومی در کشورهای در حال توسعه، نابرابری درآمد می‌تواند کاهش یابد.

بودئا و همکاران (۲۰۲۱)^۴ در مطالعه‌ای برای ۶۶ کشور طی دوره زمانی (۱۹۶۰-۲۰۰۹) با استفاده از روش گشتاورهای تعمیم‌یافته سیستمی و الگوی تصحیح خطا نشان دادند که وقوع بحران‌های بانکی، ارزی، تورمی و بدهی منجر به افزایش نابرابری درآمد در بلندمدت می‌شود. یافته‌های این تحقیق تأکید می‌کند که بی‌ثباتی‌های مالی می‌تواند به تشدید شکاف طبقاتی و افزایش آسیب‌پذیری گروه‌های کم‌درآمد منجر شود.

نگوبانه و همکاران (۲۰۲۳)^۵ در مطالعه‌ای طی دوره (سه‌ماهه اول ۲۰۰۰ تا سه‌ماهه چهارم ۲۰۲۱) برای آفریقای جنوبی با استفاده از روش‌های خودرگرسیون با وقفه‌های گسترده خطی و غیرخطی نشان دادند که بر اساس شواهد خطی، رشد اقتصادی در بلندمدت فقر را کاهش می‌دهد، در حالی که بیکاری در بلندمدت فقر را افزایش می‌دهد. شواهد نامتقارن تأیید کرد که اگرچه شوک‌های منفی رشد اقتصادی نرخ فقر را کاهش می‌دهد، شوک‌های مثبت رشد اقتصادی نرخ فقر را کاهش می‌دهد. از سوی دیگر، نرخ فقر به طور هم‌زمان در نتیجه شوک‌های مثبت و منفی نرخ بیکاری افزایش می‌یابد.

عبدی و همکاران (۲۰۲۵)^۶ در مطالعه خود برای کشور سومالی طی دوره ۱۹۹۰ تا ۲۰۲۰ با استفاده از رویکرد خود توضیح با وقفه‌های گسترده نشان دادند که تولید ناخالص داخلی سرانه در ابتدا نابرابری درآمد را افزایش می‌دهد و از فرضیه منحنی کوزنتس پشتیبانی می‌کند، اما این اثر با بلوغ اقتصاد کاهش می‌یابد. جهانی‌شدن به طور مداوم نابرابری درآمد را در بلندمدت و کوتاه‌مدت تشدید می‌کند. برعکس، سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی و کیفیت نهادی فقط در کوتاه‌مدت به طور قابل توجهی با کاهش نابرابری درآمد مرتبط هستند. نرخ بیکاری بالاتر و تورم به طور قابل توجهی نابرابری درآمد را در سومالی در هر دو بازه زمانی افزایش می‌دهند.

1. Obi (2007)

2. Ali (2016)

3. Hayat & Ditta (2017)

4. Bodea et al. (2021)

5. Ngubane

6. Abdi et al. (2025)

خالد و همکاران (۲۰۲۳)^۱ در مطالعه‌ای برای کشورهای آسیای جنوبی طی دوره زمانی (۲۰۲۱-۱۹۹۱) با استفاده از مدل اثرات ثابت نشان داد که بی‌ثباتی اقتصاد کلان و سرمایه مستقیم خارجی، نابرابری درآمد را به طور معناداری افزایش می‌دهد، درحالی‌که افزایش نرخ مشارکت نیروی کار موجب کاهش نابرابری می‌شود.

الشهوانی و الازهری (۲۰۲۴)^۲ در مطالعه ۲۷ استان کشور مصر طی دوره ۲۰۱۰ تا ۲۰۱۸ با استفاده از مدل رگرسیون دوطرفه با اثر ثابت^۳ نشان دادند که تنها هزینه‌های اجتماعی دولت به طور قابل توجهی بر کاهش فقر در سطح ملی تأثیر می‌گذارد. هزینه‌های بهداشت، آموزش و اجتماعی دولت، به‌ویژه در مصر علیا و قاهره، تأثیرات منفی قابل توجهی بر فقر در سطح منطقه نشان دادند.

مایر (۲۰۰۴)^۴ در مقاله‌ای برای کشورهای درحال توسعه طی دوره زمانی (۱۹۹۹-۱۹۷۰) با استفاده از روش گشتاورهای تعمیم‌یافته سیستمی نشان داد که سطوح بالای بدهی خارجی بدون اینکه اثر قابل توجهی بر نرخ رشد داشته باشد، اثر منفی بر سطح درآمد ۴۰ درصد فقیرترین افراد جامعه دارد. همچنین کاهش سطوح بدهی خارجی اثر مثبت بر فقرا دارد؛ ولی اگر تمام بدهی خارجی آزاد شود، برای فعالیتهای مربوط به کاهش فقر منابع لازم را به دست نمی‌دهد.

برین و گارسیا پنالوسا (۲۰۰۵)^۵ در مقاله‌ای برای کشورهای توسعه‌یافته و درحال توسعه طی دوره زمانی (۱۹۶۰-۱۹۹۰) با استفاده از روش حداقل مربعات معمولی^۶ نشان دادند که نوسان بیشتر ستاده که از طریق انحراف معیار نرخ رشد ستاده تعریف شده است با ضریب جینی بالاتر و سهم درآمدی دهک‌های بالاتر رابطه دارد. همچنین نشان دادند که یک کاهش در نوسان اقتصادی اثر زیادی بر نابرابری داشته است.

گلزر (۲۰۲۵)^۷ در مطالعه خود برای ۲۰ کشور آمریکای لاتین طی دوره زمانی ۲۰۰۱ تا ۲۰۱۴ با استفاده از روش گشتاورهای تعمیم‌یافته سیستمی نشان می‌دهد که درحالی‌که وجوه ارسالی عموماً نابرابری درآمدی را کاهش می‌دهند، اثر برابری آنها در محیط‌های تحت تأثیر جنگ به طور قابل توجهی تقویت می‌شود. بررسی‌های استحکام با استفاده از معیارهای نابرابری جایگزین نشان می‌دهد که این اثر در کاهش نابرابری بین فقیرترین و ثروتمندترین خانوارها بیشترین تأثیر را دارد و اثرات آن در بین گروه‌های با درآمد متوسط ضعیف‌تر است. سایر نتایج نیز نشان داد که نرخ بیکاری و درآمد سرانه اثر منفی و آزادسازی تجاری و تورم باعث افزایش نابرابری درآمدی شده است.

عبدی و همکاران (۲۰۲۵)^۸ در مطالعه خود برای کشور سومالی طی دوره ۱۹۹۰ تا ۲۰۲۰ با استفاده از رویکرد خود توضیح با وقفه‌های گسترده نشان دادند که تولید ناخالص داخلی سرانه در ابتدا نابرابری درآمد را افزایش می‌دهد و از فرضیه منحنی کوزنتس پشتیبانی می‌کند، اما این اثر با بلوغ اقتصاد کاهش می‌یابد. جهانی شدن به

1. Khalid et al. (2024)
2. Elshahawany & Elazhary
- 3 The Two-Way Fixed Effect Regression Model
4. Maier (2004)
5. Garsia-Penalosa & Breen (2005)
6. Ordinary least squares (OLS)
7. Glezer (2025)
8. Abdi et al. (2025)

طور مداوم نابرابری درآمد را در بلندمدت و کوتاه‌مدت تشدید می‌کند. برعکس، سرمایه‌گذاری مستقیم خارجی و کیفیت نهادی فقط در کوتاه‌مدت به طور قابل توجهی با کاهش نابرابری درآمد مرتبط هستند. نرخ بیکاری بالاتر و تورم به طور قابل توجهی نابرابری درآمد را در سومالی در هر دو بازه زمانی افزایش می‌دهند.

سیمونسکو (۲۰۲۵)^۱ در مطالعه ۲۷ کشور عضو اتحادیه اروپا طی دوره ۱۹۹۰ تا ۲۰۲۳ با استفاده از روش تکنیک پیشرفته هم‌جمعی^۲ نشان می‌دهد که توسعه مالی و اعتبار خصوصی، نابرابری درآمد را کاهش داده‌اند. با این حال، یک سیستم بانکی رقابتی‌تر و متمرکزتر، نابرابری را افزایش می‌دهد. یک سیستم مالی بازارمحورتر می‌تواند نابرابری درآمد را، به‌ویژه در طول بحران‌های بانکی، کاهش دهد. تجزیه و تحلیل مبتنی بر سایر معیارهای نابرابری، مانند سهم درآمد برای ۱ درصد و ۱۰ درصد برتر و ۵۰ درصد پایین، نشان می‌دهد که توسعه مالی سهم ثروتمندترین افراد را افزایش می‌دهد. همچنین آزادسازی تجاری و تولید ناخالص داخلی باعث کاهش نابرابری و ارزش بازار سرمایه باعث افزایش نابرابری درآمدی شده است.

آیاش و همکاران (۲۰۲۵)^۳ در مطالعه کشورهای آسی آن^۴ طی دوره ۱۹۹۱ تا ۲۰۲۳ با استفاده از روش خودرگرسیون با وقفه‌های گسترده افزایش یافته مقطعی^۵ نشان دادند که عوامل اقتصاد کلان، از جمله تشکیل سرمایه ناخالص، تورم، بیکاری و رشد جمعیت، نابرابری درآمد را افزایش دادند، در حالی که باز بودن تجارت آن را کاهش داد. همچنین رشد اقتصادی اثر مثبت و مجذور آن اثر منفی بود که فرضیه منحنی کوزنتس (KCH)^۶ در این کشورها صادق است.

۲-۳. جمع‌بندی ادبیات و نوآوری پژوهش

مرور ادبیات تجربی مرتبط با موضوع نشان می‌دهد که مطالعات انجام‌شده در این حوزه بسیار محدود بوده و پژوهش حاضر باهدف پر کردن این خلأ تحقیقاتی انجام شده است. بخش عمده‌ای از تحقیقات پیشین به‌صورت منفرد به بررسی متغیرهایی همچون تورم، بیکاری، کسری بودجه و سایر شاخص‌های کلان اقتصادی پرداخته‌اند. در این میان، تنها مطالعات خالد و همکاران (۲۰۲۳) و زروکی و همکاران (۱۴۰۰) از شاخص ترکیبی بی‌ثباتی اقتصاد کلان بهره گرفته‌اند. براین اساس، پژوهش حاضر از دو جهت اساسی با مطالعات پیشین تمایز دارد. نخست، اغلب تحقیقات گذشته مبتنی بر الگوهای خطی بوده‌اند، در حالی که در این مطالعه با استفاده از چارچوب روابط غیرخطی، اثر نامتقارن بی‌ثباتی اقتصادی بر فقر و نابرابری درآمدی بررسی و تحلیل شده است. دوم، در زمینه محاسبه شاخص بی‌ثباتی اقتصادی، این پژوهش برخلاف بسیاری از مطالعات پیشین که از روش‌های ساده یا مستقیم استفاده کرده‌اند، از مدل خودرگرسیونی واریانس ناهمسان شرطی (ARCH) بهره می‌گیرد که دقت بیشتری در اندازه‌گیری نوسانات و نااطمینانی‌های اقتصادی فراهم می‌سازد.

1. Simionescu (2025)

2. Continuously Updated and Bias-Corrected (CUP-BC) Estimates

3. Ayyash

4. ASEAN-5

5. The Cross-sectionally Augmented Auto-regressive Distributed Lag (CS-ARDL)

6. Kuznets curve hypothesis (KCH)

۳. روش‌شناسی پژوهش

این پژوهش باهدف بررسی اثر نامتقارن بی‌ثباتی اقتصادی بر فقرخانوار و نابرابری درآمد در ایران انجام شده است. از این رو تمرکز در تصریح الگوی پژوهش، بر آن است تا اثر افزایش‌ها در بی‌ثباتی از اثر کاهش‌ها در آن تفکیک گردد؛ لذا جهت برآورد الگوی پژوهش از رویکرد خود توضیح با وقفه‌های گسترده غیرخطی (NARDL) ارائه شده توسط شین و دیگران (۲۰۱۴)^۱ استفاده شده است. در مطالعه یاد شده بحث عدم تقارن ضریب یک عامل اثرگذار بر متغیر وابسته در شرایط رونق و رکود مطرح شده است؛ بنابراین این برآوردگر یک رگرسیون نامتقارن است که در آن نیاز است تا متغیرهای مستقل به صورت جزئی‌تر تجزیه شود. یعنی متغیر مستقل بی‌ثباتی اقتصادی به شکل تجزیه می‌شود. به نحوی که انباشت جزئی در تغییرات بی‌ثباتی اقتصادی به شکل رابطه (۱) است.

$$\begin{cases} EcoII_t^+ = \sum_{j=1}^t \Delta EcoII_j^+ = \sum_{j=1}^t \text{Max}(\Delta EcoII_j, 0) \\ EcoII_t^- = \sum_{j=1}^t \Delta EcoII_j^- = \sum_{j=1}^t \text{Min}(\Delta EcoII_j, 0) \end{cases} \quad (1)$$

بنابراین، الگوهای پژوهش با توجه به اهداف و ادبیات موضوع مبتنی بر رهیافت خودرگرسیون با وقفه‌های توزیعی غیرخطی به صورت روابط ۱ تا ۳ تصریح می‌شوند.

$$FGT_t = \beta + \gamma_1 EcoII_t^+ + \gamma_2 EcoII_t^- + \theta_1 EG_t + \theta_2 IPC_t + \theta_3 Inf_t + \theta_4 GS_t + \varepsilon_t \quad \text{مدل ۱} \quad (2)$$

$$PGR_t = \beta + \gamma_1 EcoII_t^+ + \gamma_2 EcoII_t^- + \theta_1 EG_t + \theta_2 IPC_t + \theta_3 Inf_t + \theta_4 GS_t + \varepsilon_t \quad \text{مدل ۲} \quad (3)$$

$$\begin{aligned} Ten_t = \beta + \gamma_1 EcoII_t^+ + \gamma_2 EcoII_t^- + \theta_1 IPC_t + \theta_2 IPC_t^2 + \theta_3 SubR_t + \theta_4 Inf_t \\ + \theta_5 UnEm_t + \varepsilon_t \end{aligned} \quad \text{مدل ۳} \quad (4)$$

متغیر وابسته رابطه ۲ و ۳ شاخص فقر است که با توجه به نحوه محاسبه آن از شاخص فوستر، گریر و توریک (FGT) در مدل ۱ و شاخص شکاف فقر (PGR) در مدل ۲ استفاده شده است. متغیر وابسته مدل ۳ نیز نابرابری درآمد (Ten) است که برای سنجش میزان نابرابری از نسبت هزینه دهک بالا (ثروتمندترین) به دهک پایین (فقرترین) استفاده شده است. تغییرات جزئی مثبت ($EcoII^+$) و تغییرات جزئی منفی ($EcoII^-$) بی‌ثباتی اقتصادی متغیر مستقل اصلی در الگوهای پژوهش هستند. همچنین رشد اقتصادی (EG)، درآمد سرانه (IPC)، تورم (Inf) و اندازه دولت (GS) به عنوان متغیرهای کنترل در مدل ۱ و ۲ لحاظ شده است. در صورتی که متغیرهای درآمد سرانه (IPC)، مجذور درآمد سرانه (IPC^2)، نسبت یارانه به مخارج کل دولت ($SubR$)، تورم (Inf) و نرخ بیکاری ($UnEm$) متغیرهای کنترل در مدل ۳ هستند. در الگوهای فوق، β ضریب ثابت، γ پارامتر نامتقارن برآوردی شاخص بی‌ثباتی اقتصادی و θ نشان‌دهنده پارامترهای برآوردی متغیرهای کنترل هستند.

برای سنجش بی‌ثباتی اقتصادی از مدل خودرگرسیون واریانس ناهمسان شرطی (ARCH) استفاده شده است. در این روش که توسط انگل^۲ (۱۹۸۲) ارائه شده، نوسانات متغیرهای کلان اقتصادی از طریق واریانس شرطی جملات خطا مدل‌سازی می‌شود؛ بنابراین در این پژوهش ابتدا واریانس شرطی چهار متغیر تورم ($InfII$)، نسبت کسری بودجه به تولید ($BDRII$)، نرخ ارز ($ExRGI$) و نسبت بدهی خارجی به تولید ($EDRII$) با روش گارچ برآورد و به عنوان شاخص بی‌ثباتی هر کدام از این متغیرها مورد استفاده قرار گرفته و سپس با میانگین‌گیری

1. Shin et al (2014)

2. Engle (1982)

از آنها، شاخص بی‌ثباتی اقتصادی به‌دست‌آمده است. این روش، باتوجه‌به قابلیت آن در نمایش نوسانات پویای متغیرهای کلان، نسبت به معیارهای سنتی دقت بیشتری در سنجش بی‌ثباتی فراهم می‌کند. لازم به توضیح است که جهت محاسبه فقر از داده‌های خام درآمد - هزینه خانوار (مرکز آمار ایران) استفاده شده است. همچنین داده‌ها و مشاهدات سایر متغیرها برای دوره زمانی (۱۴۰۲-۱۳۶۳) از بانک مرکزی و مرکز آمار ایران دریافت شده است. در جدول (۱) متغیرها و خلاصه روش محاسبه آنها گزارش شده است.

جدول ۱: تعریف و روش محاسبه متغیرها

| منبع داده | روش محاسبه | نماد | متغیر |
|-------------------------|--|-------|---------------------------|
| محاسبه شده توسط پژوهشگر | محاسبه با استفاده از شاخص فوستر، گریر و توربک | FGT | فقر |
| | محاسبه با استفاده از شاخص شکاف فقر | PGR | فقر |
| | نسبت هزینه دهک بالا به دهک پایین | Ten | نابرابری درآمد |
| | میانگین بی‌ثباتی متغیرهای نرخ تورم، نرخ ارز، نسبت کسری بودجه به تولید و نسبت بدهی خارجی به تولید که با استفاده از روش خودرگرسیون واریانس ناهمسان شرطی (ARCH) محاسبه شده است. | EcoII | بی‌ثباتی اقتصاد کلان |
| بانک مرکزی | رشد تولید ناخالص داخلی | EG | رشد اقتصادی |
| مرکز آمار ایران | نسبت تولید ناخالص داخلی به جمعیت | IPC | درآمد سرانه |
| مرکز آمار ایران | شاخص قیمت مصرف‌کننده | Inf | نرخ تورم |
| بانک مرکزی | نسبت مخارج کل دولت به تولید ناخالص داخلی | GS | اندازه دولت |
| مرکز آمار ایران | نسبت جمعیت فعال بیکار به کل جمعیت فعال | UnEm | بیکاری |
| بانک مرکزی | نسبت یارانه به مخارج دولت | SubR | نسبت یارانه به مخارج دولت |

منبع: یافته‌های پژوهش.

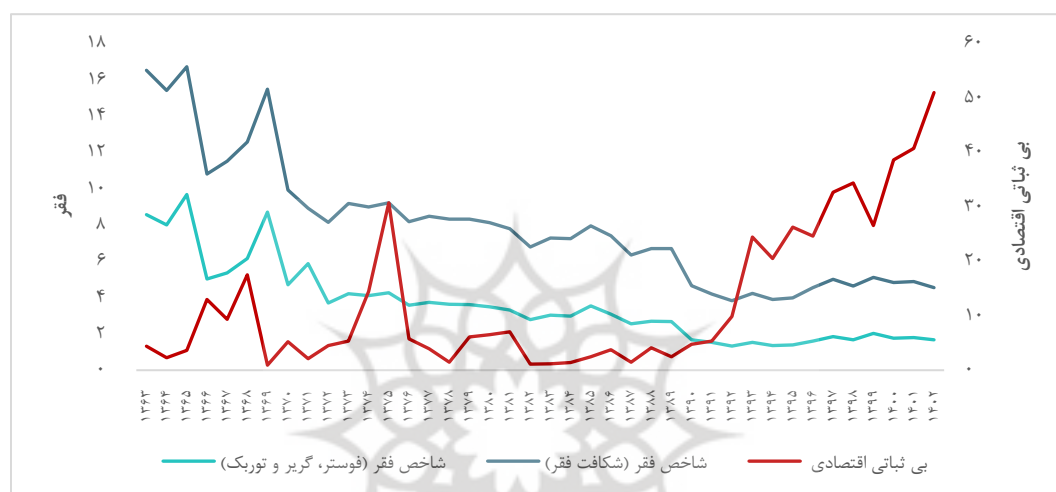
۴. یافته‌های پژوهش

۴-۱. توصیف داده‌ها

بررسی شاخص‌های توصیفی ارائه‌شده در جدول ۲ نشان می‌دهد که متغیرهای مرتبط با فقر و بی‌ثباتی اقتصادی از نوسانات قابل توجهی برخوردار بوده و الگوی توزیع آنها عمدتاً از نرمالیتی فاصله دارد. در این مطالعه، فقر با دو شاخص «فوستر - گریر - توربک» و «شکاف فقر» سنجیده شده است. میانگین شاخص فقر بر اساس معیار فوستر - گریر - توربک طی دوره ۱۳۶۳ تا ۱۴۰۳ برابر با ۳/۶۱ است. مطابق شکل ۱، کمترین مقدار این شاخص در سال ۱۳۹۳ با رقم ۱/۳۳ و بیشترین مقدار آن در سال ۱۳۶۵ با مقدار ۹/۶۸ ثبت شده است.

میانگین شاخص شکاف فقر طی دوره مورد بررسی ۷/۹۴ بوده است؛ به‌گونه‌ای که کمترین مقدار آن در سال ۱۳۹۲ معادل ۳/۸۳ و بیشترین مقدار در سال ۱۳۶۵ برابر با ۱۶/۷۲ به‌دست‌آمده است. بالاترین میانگین شاخص فقر به دوره ۱۳۶۹-۱۳۶۳ مربوط می‌شود. بااین‌حال، پس از پایان جنگ در سال ۱۳۶۷ و هم‌زمان با افزایش قیمت نفت در بازارهای جهانی و آغاز روند بازسازی کشور از سال ۱۳۶۹، مقدار این شاخص کاهش یافته است. کمترین میانگین شاخص فقر نیز در دوره ۱۳۹۵-۱۳۹۰، مقارن با اجرای برنامه پنجم توسعه، مشاهده می‌شود. همچنین نتایج آزمون نرمالیتی نشان می‌دهد که توزیع هر دو شاخص فقر از الگوی نرمال تبعیت نمی‌کند.

میانگین نابرابری درآمدی برابر با ۱۵/۴۷ است. کمترین مقدار این شاخص در سال ۱۳۶۷ معادل ۱۰/۶۷ و بیشترین مقدار آن در سال ۱۳۷۰ برابر با ۱۹/۲۰ ثبت شده است. باتوجه به انحراف معیار نسبتاً پایین، این متغیر در مقایسه با شاخص‌های فقر از ثبات بیشتری برخوردار است و نتایج آزمون نرمالیتی نیز نشان می‌دهد که توزیع آن با الگوی نرمال تطابق دارد. شکل ۱ بیانگر آن است که بی‌ثباتی اقتصادی طی دوره مورد بررسی با نوسانات قابل توجهی همراه بوده است؛ به‌گونه‌ای که کمترین مقدار آن در سال ۱۳۶۹ با رقم ۰/۹۲ درصد و بیشترین مقدار در سال ۱۴۰۲ با مقدار ۵۰/۹۹ درصد مشاهده شده است. میانگین شاخص بی‌ثباتی اقتصادی نیز ۱۲/۵۶ برآورد شده است. افزون بر این، نتایج آزمون نرمالیتی نشان می‌دهد که این متغیر از توزیع نرمال پیروی نمی‌کند.



شکل ۱: روند مقدار شاخص‌های فقر و بی‌ثباتی اقتصادی طی دوره مورد مطالعه

جدول ۲: آمار توصیفی متغیرهای پژوهش

| متغیر | نماد | میانگین | بیشترین | کمترین | انحراف معیار | جاک-برا ^۱ (احتمال) |
|---------------------------|-------|---------|---------|--------|--------------|-------------------------------|
| شاخص فقر | FGT | ۳/۶۱ | ۹/۶۸ | ۱/۳۳ | ۲/۱۶ | (۰/۰۰) ۱۲/۶۸ |
| شاخص شکافت فقر | PGR | ۷/۹۴ | ۱۶/۷۲ | ۱/۸۳ | ۳/۵۱ | (۰/۰۲) ۸/۰۵ |
| نابرابری درآمد | TEN | ۱۵/۴۷ | ۱۹/۲۰ | ۱۰/۶۸ | ۲/۱۲ | (۰/۱۵) ۳/۷۵ |
| بی‌ثباتی اقتصادی | ECOII | ۱۲/۵۶ | ۵۰/۹۹ | ۰/۹۲ | ۱۳/۳۴ | (۰/۰۱) ۱۰/۲۱ |
| رشد اقتصادی | EG | ۳/۱۰ | ۱۷/۱۴ | -۱۰/۹۵ | ۵/۰۹ | (۰/۱۲) ۴/۲۹ |
| اندازه دولت | GS | ۲۰/۲۹ | ۲۸/۵۴ | ۱۳/۶۱ | ۳/۶۴ | (۰/۷۲) ۰/۶۷ |
| تورم | INF | ۲۲/۵۲ | ۴۹/۴۰ | ۶/۹۰ | ۱۲/۱۱ | (۰/۱۰) ۴/۶۹ |
| درآمد سرانه | IPC | ۴۹/۶۹ | ۷۲/۶۸ | ۲۲/۵۹ | ۱۳/۹۰ | (۰/۳۱) ۲/۳۱ |
| نسبت یارانه به مخارج دولت | SUBR | ۷/۹۶ | ۱۴/۶۶ | ۱/۹۷ | ۳/۸۲ | (۰/۳۴) ۲/۱۵ |
| بیکاری | UNEM | ۱۱/۵۲ | ۱۴/۳۰ | ۸/۱۰ | ۱/۵۵ | (۰/۶۷) ۰/۸۱ |

منبع: یافته‌های پژوهش

میانگین نرخ رشد اقتصادی طی دوره مورد مطالعه برابر با ۳/۱۰ درصد بوده است؛ به گونه‌ای که بیشترین مقدار آن ۱۷/۱۴ درصد و کمترین مقدار ۱۰/۹۵- درصد ثبت شده است؛ بنابراین، نرخ رشد اقتصادی در این دوره نوسانات قابل توجهی را تجربه کرده است. کمترین میانگین نرخ رشد اقتصادی مربوط به دوره ۱۳۶۷-۱۳۶۳، مقارن با سال‌های جنگ ایران و عراق، برابر با ۴/۹- درصد است. در این زیر دوره، وقوع جنگ و پیامدهای اقتصادی آن باعث کاهش قابل ملاحظه رشد اقتصادی کشور شده است. متغیر یارانه (به عنوان درصدی از تولید ناخالص داخلی) در دوره مورد بررسی به طور متوسط ۷/۹۶ درصد بوده و مقادیر حداقل و حداکثر آن به ترتیب ۱/۹۷ و ۱۴/۶۶ درصد برآورد شده است. نسبت یارانه به کل مخارج دولت در دوره ۱۳۶۷-۱۳۶۳ با میانگین ۲/۹۴ درصد کمترین مقدار را داشته است. علت این امر را می‌توان در افزایش نقش دولت در تهیه و توزیع کالاهای اساسی باهدف جلوگیری از کمبود و کنترل قیمت‌ها در شرایط جنگ جست‌وجو کرد؛ با این حال، فشارهای وارده بر بودجه دولت موجب کاهش تعداد اقلام مشمول یارانه شد.

در ادامه، قانون هدفمندی یارانه‌ها از سال ۱۳۸۹ در دو محور اصلی آزادسازی تدریجی قیمت‌ها (به ویژه در بخش حامل‌های انرژی) و توزیع هدفمند یارانه‌ها به اجرا درآمد. در نتیجه، نسبت یارانه‌ها به مخارج کل دولت در دوره اجرای برنامه چهارم توسعه با میانگین ۱۲/۷۰ درصد به بیشترین سطح خود رسیده است. در خصوص درآمد سرانه نیز، کمترین میانگین آن برابر با ۳۳/۵ میلیون ریال مربوط به سال‌های برنامه اول توسعه است. وقوع انقلاب و جنگ در این دوره، درآمد سرانه کشور را به طور محسوسی کاهش داده است. بیشترین مقدار میانگین درآمد سرانه ایران معادل ۶۶/۱ میلیون ریال و مربوط به دوره برنامه چهارم توسعه است؛ دوره‌ای که به دلیل رشد قیمت نفت در بازارهای جهانی و افزایش درآمدهای نفتی، کشور از رشد قابل توجه درآمد سرانه برخوردار بوده است. همچنین نتایج آزمون نرمالیتی نشان می‌دهد که این متغیر از توزیع نرمال پیروی می‌کند.

میانگین اندازه دولت طی دوره مورد مطالعه برابر با ۲۰/۲۹ درصد است؛ به گونه‌ای که حداقل و حداکثر مقادیر آن به ترتیب ۳/۶۱ درصد و ۲۸/۵۴ درصد ثبت شده‌اند. روند تغییرات این شاخص نشان می‌دهد که اندازه دولت در طول دوره مورد بررسی مسیر کاهشی را تجربه کرده است. نتایج آزمون نرمالیتی نیز بیانگر آن است که این متغیر از توزیع نرمال تبعیت می‌کند. میانگین درآمد سرانه در این دوره برابر با ۴۹/۶۹ میلیون ریال بوده و مقادیر حداقل و حداکثر آن به ترتیب ۲۲/۵۹ و ۷۲/۶۸ میلیون ریال محاسبه شده است. مطابق آزمون نرمالیتی، این متغیر نیز از الگوی توزیع نرمال پیروی می‌کند. بیشترین نرخ تورم طی دوره مورد مطالعه برابر با ۴۹/۴۰ درصد و کمترین مقدار آن ۶/۹۰ درصد بوده است. میانگین نرخ تورم در این دوره ۲۲/۵۲ درصد به دست آمده است که نشان‌دهنده وجود فشارهای تورمی مستمر در اقتصاد ایران است. کمترین میانگین نرخ تورم مربوط به دوره برنامه چهارم توسعه با مقدار ۱۴/۱ درصد و بیشترین مقدار مربوط به برنامه ششم توسعه با میانگین ۳۷/۵ درصد است. تشدید تحریم‌های نفتی، افزایش نرخ ارز ناشی از کاهش عرضه آن و اثرپذیری گسترده قیمت‌های داخلی از نرخ ارز، به همراه تقویت فعالیت‌های غیرمولد و سوداگری در دوره برنامه ششم از جمله عوامل اصلی افزایش تورم در این دوره به شمار می‌روند. نتایج آزمون نرمالیتی نشان می‌دهد که نرخ تورم نیز از توزیع نرمال تبعیت می‌کند.

میانگین متغیر نرخ بیکاری طی دوره مورد مطالعه در اقتصاد ایران برابر با مقدار ۱۱/۵۲ درصد بوده است. همچنین، مقادیر حداقل و حداکثر نرخ بیکاری به ترتیب ۸/۱۰ درصد و ۱۴/۳۰ درصد برآورد شده است. بیشترین میانگین نرخ بیکاری مربوط به سال‌های برنامه سوم توسعه با مقدار ۱۲/۶۸ درصد و کمترین مقدار آن متعلق به سال‌های برنامه ششم توسعه با میانگین ۱۰/۴۷ درصد است. در نهایت طبق نتایج آزمون نرمالیتی، نرخ بیکاری نیز از توزیع نرمال پیروی می‌کند.

۴-۲. آزمون ریشه واحد متغیرها

پیش از برآورد الگو، انجام آزمون پایایی متغیرهای مورد استفاده در مدل‌های پژوهش ضروری است. برای این منظور از آزمون‌های ریشه واحد دیکی - فولر تعمیم‌یافته (ADF) و فیلیپس - پرون (PP) استفاده شده است. نتایج ارائه شده در جدول (۳) نشان می‌دهد که متغیرهای وابسته، شامل شاخص‌های فقر و نابرابری درآمد، در تفاضل مرتبه اول پایا هستند. در میان متغیرهای مستقل، متغیرهای رشد اقتصادی و تورم در سطح پایایی قرار دارند؛ درحالی‌که متغیرهای بی‌ثباتی اقتصادی، درآمد سرانه، نرخ بیکاری، اندازه دولت و نسبت یارانه به کل مخارج دولت پس از یکبار تفاضل‌گیری پایا شده‌اند. با توجه به نتایج آزمون‌های ریشه واحد و قرار گرفتن متغیرها در مراتب ترکیبی $I(0)$ و $I(1)$ ، استفاده از رهیافت خود توضیح با وقفه‌های گسترده غیرخطی (NARDL) به منظور برآورد الگو مناسب و امکان‌پذیر است.

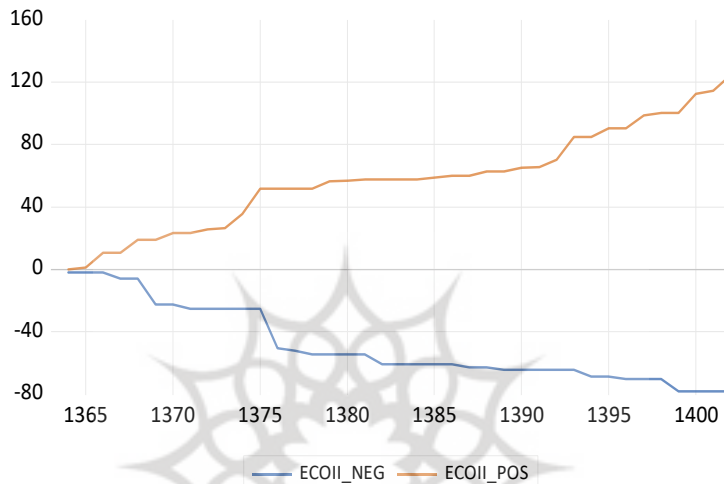
جدول ۳: نتایج آزمون‌های ریشه واحد

| متغیر | نماد | دیکی - فولر تعمیم‌یافته | | | | فیلیپس - پرون | | | |
|---------------------------|-------|-------------------------|--------|-----------------|--------|---------------|--------|-----------------|--------|
| | | در سطح | | تفاضل مرتبه اول | | در سطح | | تفاضل مرتبه اول | |
| | | آماره | احتمال | آماره | احتمال | آماره | احتمال | آماره | احتمال |
| فقر | FGT | -۲/۲۶ | ۰/۱۸۹ | -۱۰/۳۸ | ۰/۰۰۰ | -۲/۴۷ | ۰/۱۲۸ | -۱۴/۰۵ | ۰/۰۰۰ |
| فقر | PGR | -۲/۴۵ | ۰/۱۳۴ | -۷/۹۵ | ۰/۰۰۰ | -۲/۵۹ | ۰/۱۰۲ | -۹/۷۸ | ۰/۰۰۰ |
| نابرابری درآمد | Ten | -۱/۴۵ | ۰/۵۴۷ | -۵/۵۵ | ۰/۰۰۰ | -۱/۴۵ | ۰/۵۴ | -۵/۵۵ | ۰/۰۰۰ |
| بی‌ثباتی اقتصاد کلان | EcoII | -۰/۶۳ | ۰/۸۵ | -۸/۰۸ | ۰/۰۰۰ | -۰/۰۱ | ۰/۹۵۱ | -۸/۳۲ | ۰/۰۰۰ |
| رشد اقتصادی | EG | -۳/۸۵ | ۰/۰۰۵ | - | - | -۳/۸۵ | ۰/۰۰۵ | - | - |
| درآمد سرانه | IPC | ۰/۵۰ | ۰/۸۲۱ | -۲/۲۴ | ۰/۰۲۵ | -۲/۶۸ | ۰/۲۴۸ | -۶/۷۷ | ۰/۰۰۰ |
| نرخ تورم | Inf | -۳/۲۳ | ۰/۰۲۵ | - | - | -۲/۶۲ | ۰/۰۹۵ | - | - |
| اندازه دولت | GS | -۲/۸۸ | ۰/۱۷۷ | -۵/۵۱ | ۰/۰۰۰ | -۳/۰۷ | ۰/۱۲۶ | -۵/۵۱ | ۰/۰۰۰ |
| بیکاری | UnEm | -۱/۱۳ | ۰/۹۱۰ | -۷/۱۵ | ۰/۰۰۰ | -۰/۹۷ | ۰/۹۳۶ | -۷/۱۵ | ۰/۰۰۰ |
| نسبت یارانه به مخارج دولت | SubR | -۱/۸۳ | ۰/۳۶۰ | -۵/۶۶ | ۰/۰۰۰ | -۲/۱۱ | ۰/۲۴۱ | -۵/۶۶ | ۰/۰۰۰ |

منبع: یافته‌های پژوهش

۳-۴. نتایج برآورد الگوهای پژوهش

این مطالعه بر مبنای فرض وجود اثرات نامتقارن بی‌ثباتی اقتصادی بر فقر و نابرابری درآمد انجام شده است. از این رو، به منظور تحلیل این نامتقارنی در الگوهای پژوهش، متغیر بی‌ثباتی اقتصادی به دو مؤلفه مثبت و منفی تجزیه شده است. این دو مؤلفه مطابق رابطه (۱)، بیانگر انباشت تغییرات مثبت و منفی بی‌ثباتی اقتصادی هستند که از طریق یک فرایند شرطی محاسبه شده‌اند. نتایج این تجزیه در شکل (۲) ارائه شده است. در ادامه، یافته‌ها به تفکیک اثرات بی‌ثباتی اقتصادی بر فقر و نابرابری درآمد گزارش می‌شود.



شکل ۲: تجزیه سری زمانی شاخص بی‌ثباتی اقتصادی

منبع: یافته‌های پژوهش

۳-۴-۱. برآورد اثر نامتقارن بی‌ثباتی اقتصادی بر فقر

در این مطالعه، متغیر وابسته فقر با استفاده از دو شاخص «فوستر-گریر-توربک» و «شکاف فقر» محاسبه شده است؛ از این رو، در این بخش دو مدل جداگانه مورد تحلیل قرار گرفته است. در رهیافت خود توضیح با وقفه‌های گسترده غیرخطی، برآورد الگو مستلزم تعیین وقفه بهینه است. بر این اساس و با توجه به تعداد مشاهدات، الگوی وقفه بهینه بر مبنای معیار شوارتز - بیزین برای مدل نخست (۳،۳،۱،۰،۳،۲) و برای مدل دوم (۳،۳،۱،۰،۳،۳) به عنوان ساختار بهینه انتخاب شده است. نتایج برآورد مدل‌ها در جدول (۴)، نشان می‌دهد که در کوتاه‌مدت و بلندمدت، تمامی متغیرهای توضیحی به جز اندازه دولت اثر آماری معناداری بر شاخص‌های فقر دارند.

بر اساس نتایج جدول (۴)، افزایش‌های بی‌ثباتی اقتصادی ($ECOII^+$) اثر منفی و معناداری بر فقر در هر دو مدل دارد. به گونه‌ای که با افزایش یک درصدی در تغییرات مثبت شاخص بی‌ثباتی اقتصادی، نرخ فقر در مدل اول به میزان ۰/۰۹ درصد و در مدل دوم به میزان ۰/۱۲ درصد در کوتاه‌مدت کاهش می‌یابد. در مقابل، کاهش‌های بی‌ثباتی اقتصادی ($ECOII^-$) در کوتاه‌مدت اثری مثبت و معنادار بر فقر دارند؛ به طوری که به ازای یک درصد افزایش در کاهش‌های بی‌ثباتی اقتصادی، مقدار فقر در مدل اول حدود ۰/۰۶۶ درصد و در مدل دوم حدود ۰/۱۳ درصد افزایش پیدا می‌کند.

آزمون والد^۱ که برای بررسی وجود نامتقارنی در اثر بی‌ثباتی اقتصادی به کاررفته است، نشان می‌دهد که در کوتاه‌مدت، اثرات بی‌ثباتی اقتصادی بر هر دو شاخص فقر به صورت نامتقارن عمل می‌کند. مطابق نتایج، در مدل ۱ افزایش‌های بی‌ثباتی با ضریب ۰/۰۷ و کاهش‌های آن با ضریب ۰/۲ اثر مثبت بر فقر دارند؛ همچنین در مدل ۲ افزایش‌ها در بی‌ثباتی با ضریب ۰/۱۳ و کاهش‌ها با ضریب ۰/۲۸ موجب افزایش فقر می‌شوند. نتایج آزمون والد بیانگر آن است که نخست، شدت اثر کاهش‌های بی‌ثباتی اقتصادی تفاوت معناداری با شدت اثر افزایش‌های آن دارد؛ دوم، اثر کاهش‌های بی‌ثباتی بر فقر در مدل اول حدود ۰/۱۲ واحد و در مدل دوم حدود ۰/۱۵ واحد بیش از اثر افزایش‌های بی‌ثباتی است؛ بنابراین وجود اثر نامتقارن بی‌ثباتی اقتصادی بر فقر در کوتاه‌مدت تأیید می‌شود. اما در بلندمدت، الگوی اثرگذاری تغییر می‌کند؛ به گونه‌ای که با افزایش یک درصدی در شاخص بی‌ثباتی اقتصادی، نرخ فقر به ترتیب در مدل اول ۰/۰۴ درصد و در مدل دوم ۰/۱۱ درصد افزایش می‌یابد. همچنین ضرایب بلندمدت برای اثرات نامتقارن به ترتیب ۰/۱۳ و ۰/۲۴ در دو مدل محاسبه شده‌اند که در هر دو حالت نشان می‌دهد بی‌ثباتی اقتصادی در بلندمدت نیز موجب افزایش فقر در ایران می‌شود.

نتایج نشان می‌دهد که رشد اقتصادی در هر دو مدل فقر دارای اثری مثبت و معنادار است. به گونه‌ای که با افزایش یک درصدی در رشد اقتصادی، میزان فقر در مدل‌های اول و دوم به ترتیب ۰/۰۷ و ۰/۰۴ درصد در کوتاه‌مدت افزایش می‌یابد. متغیر درآمد سرانه نیز در هر دو مدل اثر منفی و معناداری بر شاخص‌های فقر دارد. به طوری که با یک درصد افزایش در درآمد سرانه، شاخص‌های فقر به ترتیب به میزان ۰/۰۳ و ۰/۰۹ درصد در کوتاه‌مدت کاهش می‌یابند. بر اساس نتایج، نرخ تورم نیز در سطح خطای یک درصد اثر معناداری بر شاخص‌های فقر نشان می‌دهد؛ به این معنا که افزایش یک درصدی نرخ تورم موجب کاهش شاخص‌های فقر به میزان ۰/۰۴ و ۰/۰۶ درصد در کوتاه‌مدت می‌شود. متغیر اندازه دولت تنها در مدل اول و در سطح خطای ۱۰ درصد اثر معناداری بر فقر دارد، در حالی که در مدل دوم این اثر از نظر آماری معنادار نیست. ضرایب جمله تصحیح خطا در هر دو مدل منفی بوده و بیانگر وجود فرایند تعدیل به سمت تعادل بلندمدت است. بر این اساس، با گذار از یک سال به سال بعد، به ترتیب ۵۲ درصد و ۱۶ درصد از انحراف شاخص‌های فقر توسط متغیرهای مدل اصلاح می‌شود. پیش از برآورد اثرات بلندمدت متغیرهای توضیحی بر فقر، ضروری است وجود رابطه بلندمدت میان متغیرها مورد بررسی و تأیید قرار گیرد.

برای بررسی وجود رابطه بلندمدت میان متغیرها از آزمون کرانه‌ها^۲ استفاده شده است. در این آزمون، فرضیه صفر بر مبنای عدم وجود رابطه بلندمدت بین متغیرها تعریف می‌شود. نتایج آزمون، مطابق جدول (۴)، نشان می‌دهد که مقدار آماره F برای مدل اول برابر با ۵/۸۹ و برای مدل دوم برابر با ۶/۷۷ است. این مقادیر از حدود بالایی و پایینی کرانه‌ها در سطوح معنی‌داری ۱، ۵ و ۱۰ درصد بزرگ‌تر هستند؛ بنابراین فرضیه صفر رد می‌شود. در نتیجه، شواهد تجربی نشان می‌دهد که رابطه بلندمدت میان شاخص‌های فقر، بی‌ثباتی اقتصادی و سایر متغیرهای توضیحی برقرار است.

1. wald

2. Bounds test approach

جدول ۴: نتایج برآورد اثر نامتقارن بی‌ثباتی اقتصادی بر فقر

| مدل ۱: وابسته (فقر فوستر، گریز و توربک) | | | | مدل ۲: وابسته (شاخص شکافت فقر) | | | | متغیرها |
|---|--------------|-------------|------------|--------------------------------|--------------|------------|-------------------------------|--------------|
| ضریب | انحراف معیار | آماره t | احتمال | ضریب | انحراف معیار | آماره t | احتمال | |
| الگوی کوتاه‌مدت | | | | | | | | |
| -۰/۰۹ | ۰/۰۲۵ | -۳/۷۹ | ۰/۰۰۲ | -۰/۱۲ | ۰/۰۳۷ | -۳/۴۲ | ۰/۰۰۵ | $D(EcoII^+)$ |
| ۰/۰۶۶ | ۰/۰۲۸ | ۲/۳۴ | ۰/۰۳۴ | ۰/۱۳ | ۰/۰۲۸ | ۴/۸۵ | ۰/۰۰۰ | $D(EcoII^-)$ |
| ۰/۰۰۷ | ۰/۰۲۰ | -۰/۳۴ | ۰/۷۳۴ | ۰/۰۴ | ۰/۰۱۷ | ۲/۷۴ | ۰/۰۱۹ | $D(EG)$ |
| -۰/۰۳ | ۰/۰۱۴ | -۲/۲۳ | ۰/۰۴۴ | -۰/۰۹ | ۰/۰۲۳ | -۴/۲۰ | ۰/۰۰۱ | $D(IPC)$ |
| -۰/۰۴ | ۰/۰۰۹ | -۴/۸۹ | ۰/۰۰۰ | -۰/۰۶ | ۰/۰۱۵ | -۳/۸۰ | ۰/۰۰۲ | $D(Inf)$ |
| -۰/۰۸ | ۰/۰۴۴ | -۱/۹۸ | -۰/۰۶۸ | ۰/۰۲ | ۰/۰۵۰ | -۰/۴۳ | ۰/۶۷۳ | $D(GS)$ |
| ۱۵/۰۶ | ۲/۲۳۹ | ۲/۷۲۸ | ۰/۰۰۰ | ۱۶/۵۰ | ۲/۹۰ | ۵/۶۷ | ۰/۰۰۰ | C |
| -۰/۵۲ | ۰/۰۶۱ | -۸/۵۱ | ۰/۰۰۰ | -۰/۱۶ | ۰/۰۱۷ | -۹/۴۱ | ۰/۰۰۰ | CointEq |
| الگوی بلندمدت | | | | | | | | |
| -۰/۰۴ | ۰/۰۱۶ | ۲/۹۵ | ۰/۰۱۱ | ۰/۱۱ | ۰/۰۲۴ | ۴/۵۵ | ۰/۰۰۰ | $EcoII^+$ |
| -۰/۱۳ | ۰/۰۱۲ | ۱۰/۸۵ | ۰/۰۰۰ | ۰/۲۴ | ۰/۰۲۴ | ۱۰/۱۶ | ۰/۰۰۰ | $EcoII^-$ |
| -۰/۰۷ | ۰/۰۲۵ | ۳/۰۸ | ۰/۰۰۸ | ۰/۱۵ | ۰/۰۳۰ | ۵/۳۰ | ۰/۰۰۰ | EG |
| -۰/۰۲ | ۰/۰۱۰ | -۲/۱۳ | ۰/۰۵۲ | -۰/۰۲ | ۰/۰۱۳ | -۲/۱۷ | ۰/۰۵۲ | IPC |
| -۰/۰۱ | ۰/۰۰۷ | ۱/۹۴ | ۰/۰۷۳ | ۰/۰۳ | ۰/۰۱۳ | ۲/۲۲ | ۰/۰۴ | Inf |
| -۰/۰۵ | ۰/۰۳۷ | -۱/۳۵ | ۰/۱۹۸ | ۰/۰۹ | ۰/۰۷۰ | ۱/۳۷ | ۰/۱۹۷ | GS |
| ۹/۸۶ | ۰/۶۹ | ۱۴/۱۶ | ۰/۰۰۰ | ۱۴/۱۹ | ۱/۲۸ | ۱۱/۰۱ | ۰/۰۰۰ | C |
| آزمون والد جهت بررسی وجود عدم تقارن | | | | | | | | |
| متغیر | آماره F | احتمال | مقدار ضریب | آماره F | احتمال | مقدار ضریب | متغیر | |
| برآیند اثر $EcoII^+$ | ۷/۳۰ | ۰/۰۱۸ | ۰/۰۷۳ | ۱۶/۶۰ | ۰/۰۰۱ | ۰/۱۳۲ | برآیند اثر $EcoII^+$ | |
| برآیند اثر $EcoII^-$ | ۴۸/۰۷ | ۰/۰۰۰ | ۰/۲۰۰ | ۶۷/۳۸ | ۰/۰۰۰ | -۰/۲۸۷ | برآیند اثر $EcoII^-$ | |
| برآیند اثر $EcoII^+, EcoII^-$ | ۵۵/۷۳۵ | ۰/۰۰۰ | -۰/۱۲۷ | ۱۱۰/۶۲ | ۰/۰۰۰ | -۰/۱۵۵ | برآیند اثر $EcoII^+, EcoII^-$ | |
| آزمون کرانه‌ها جهت بررسی رابطه بلندمدت | | | | | | | | |
| سطح خطا | آماره آزمون | کرانه پایین | کرانه بالا | آماره آزمون | کرانه پایین | کرانه بالا | سطح احتمال | |
| ۱ درصد | ۵/۸۹ | ۳/۵۰ | ۵/۱۲ | ۶/۷۷ | ۲/۸۸ | ۳/۹۹ | ۰/۵۹۴ | |
| ۵ درصد | | ۲/۶۱ | ۳/۸۱ | | ۲/۲۷ | ۳/۲۸ | | |
| ۱۰ درصد | | ۲/۲۱ | ۳/۳۱ | | ۱/۹۹ | ۲/۹۴ | | |
| آزمون‌های تشخیصی | | | | | | | | |
| آزمون | آماره | سطح احتمال | آماره | سطح احتمال | | | | |
| نرمالیتی | ۱/۸۵ | ۰/۳۹۶ | ۱/۰۳ | ۰/۵۹۴ | | | | |
| ناهمسانی واریانس | ۰/۴۲ | ۰/۹۶۴ | ۰/۷۱ | ۰/۷۶۴ | | | | |
| خودهمبستگی سریالی | ۰/۲۸ | ۰/۶۰۳ | ۰/۰۰۲ | ۰/۹۶۰ | | | | |
| آزمون رمزی ریست | ۲/۴۰ | ۰/۲۰۹ | ۲/۷۸ | ۰/۱۷۳ | | | | |

منبع: یافته‌های پژوهش

نتایج حاصل از مدل‌های نامتقارن در بلندمدت نشان می‌دهد که افزایش‌های بی‌ثباتی اقتصادی در مدل‌های اول و دوم به ترتیب با ضرایب $0/04$ و $0/11$ و کاهش‌های بی‌ثباتی اقتصادی با ضرایب $0/13$ و $0/24$ اثر مستقیم بر فقر دارند. براین اساس، در بلندمدت نیز بی‌ثباتی اقتصادی با اثرات نامتقارن بر فقر همراه است و شدت این اثر در زمان کاهش بی‌ثباتی اقتصادی به مراتب بیشتر از اثر افزایش آن است. در مورد اثر مستقیم بی‌ثباتی اقتصادی بر فقر می‌توان چنین نتیجه گرفت که افزایش بی‌ثباتی، ساختار و امنیت اقتصادی کشور را مختل کرده و با تحمیل هزینه‌های اقتصادی و اجتماعی بر خانوارها، موجب کاهش رفاه آن‌ها می‌شود. علاوه بر این، بی‌ثباتی اقتصادی باعث کاهش رشد اقتصادی، کاهش سرمایه‌گذاری و انباشت سرمایه بخش خصوصی و همچنین ایجاد انحراف در توزیع درآمد می‌گردد. تغییرات نامطلوب در متغیرهای کلان اقتصادی، از جمله تورم، نرخ ارز، کسری بودجه و بدهی خارجی، نیز منجر به کاهش قدرت خرید، افزایش نااطمینانی اقتصادی، فرار سرمایه و کاهش فرصت‌های شغلی می‌شود.

مطابق با نتایج الگوی کوتاه‌مدت، درآمد سرانه اثری منفی و معنادار در بلندمدت بر فقر دارد. به طوری که در مدل‌های اول و دوم، با افزایش یک میلیون ریالی درآمد سرانه، میزان فقر به ترتیب $0/02$ واحد کاهش می‌یابد. در نظریه‌های رشد اقتصادی، افزایش درآمد سرانه به‌عنوان یکی از شاخص‌های کلیدی بهبود رفاه جامعه قلمداد می‌شود. بر اساس تحلیل‌های کلاسیک و نئوکلاسیک، افزایش درآمد سرانه موجب ارتقای فرصت‌های شغلی و سطح دستمزدها می‌شود و منابع بیشتری برای سرمایه‌گذاری در بخش‌های خدمات اجتماعی، آموزش و بهداشت فراهم می‌آورد که در مجموع منجر به کاهش نرخ فقر می‌گردد.

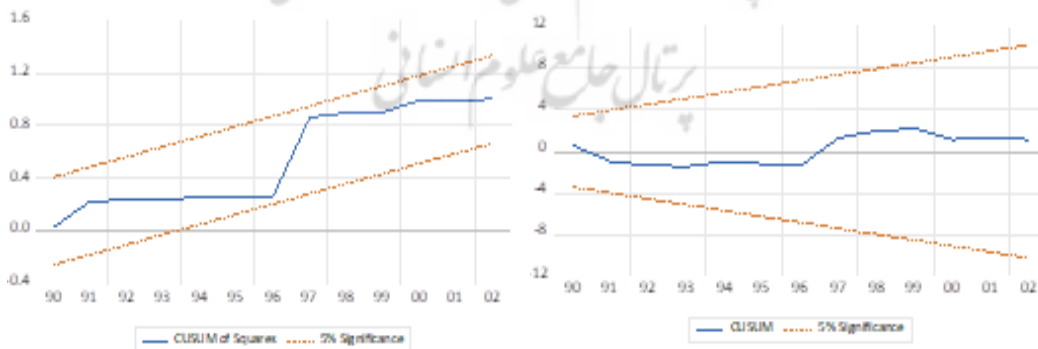
بر اساس نتایج پژوهش در جدول (۴)، متغیر نرخ رشد اقتصادی در بلندمدت با ضریب $0/07$ در مدل اول و ضریب $0/03$ در مدل دوم اثر معنادار مستقیمی بر فقر دارد. در تحلیل اثر رشد اقتصادی بر فقر، دو دیدگاه عمده وجود دارد. دیدگاه نخست معتقد است که رشد اقتصادی به طور مطلق منجر به کاهش فقر می‌شود. برای نمونه، مطالعه دلار و کرای (۲۰۰۰)^۱ نشان می‌دهد که با رشد اقتصادی، بدون توجه به ماهیت آن، درآمد افراد فقیر افزایش می‌یابد و در راستای فرضیه کوزنتس (۱۹۵۵)^۲، رشد اقتصادی منجر به کاهش فقر می‌شود. دیدگاه دوم بر اهمیت نابرابری در فرایند کاهش فقر تأکید دارد. از این منظر، رشد اقتصادی اثر غیرمستقیمی بر فقر دارد و این اثر از طریق توزیع درآمدها اعمال می‌شود. مطابق لوپز^۳ (۲۰۰۵)، در سطح معینی از نرخ رشد اقتصادی، افزایش نابرابری باعث کاهش میزان کاهش فقر خواهد شد. به گفته وایت و اندرسون (۲۰۰۰)^۴، رشد اقتصادی زمانی حامی فقرا است که الگوی رشد سهم درآمدی جمعیت فقیر جامعه را افزایش دهد. به بیان دیگر، رشد اقتصادی تنها زمانی حامی فقرا محسوب می‌شود که نرخ رشد درآمد فقرا بیش از نرخ رشد درآمد متوسط کل جامعه باشد. در چنین شرایطی، نابرابری نیز کاهش یافته و سهم فقرا از درآمد کل جامعه به تناسب سهم جمعیتی آنان افزایش می‌یابد.

1. Dollars and Cry (2000)
2. Kuznets (1955)
3. Lopez. (2005)
4. White & Anderson (2000)

نتایج نشان می‌دهد که در بلندمدت طی دوره مورد مطالعه نرخ تورم با ضریب 0.01 در مدل اول و 0.03 در مدل دوم اثر معنی‌دار و مستقیمی بر فقر دارد. در تحلیل اثر مثبت تورم بر فقر می‌توان گفت که نرخ بالای تورم و نوسانات آن در فضای بی‌ثبات اقتصادی موجب کاهش دستمزد واقعی فقرا می‌شود. این موضوع، همراه با واکنش سرمایه‌گذاران به تورم - که معمولاً از طریق کاهش تولید صورت می‌گیرد - به ازدست‌رفتن فرصت‌های شغلی برای افراد فقیر منجر می‌شود. از سوی دیگر، تورم بالا باعث کاهش رشد اقتصادی می‌شود و در نتیجه، توزیع درآمد به ضرر گروه‌هایی که توانایی کمتری در دفاع از منافع خود دارند، تغییر می‌یابد. همچنین، نرخ بالای تورم منجر به ناپایداری شدید در قیمت‌های نسبی شده و چشم‌انداز سرمایه‌گذاری را مبهم و پرریسک می‌کند که خود موجب کاهش سطح سرمایه‌گذاری در اقتصاد می‌شود.

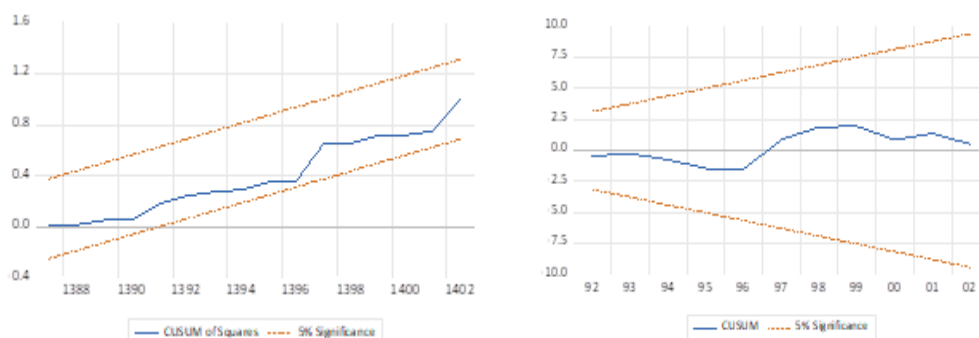
نتایج ارائه‌شده در جدول (۴) مربوط به بخش آزمون‌های تشخیصی شامل نرمالیتی، خودهمبستگی، ناهمسانی واریانس جملات پسماند و آزمون ریست رمزی نشان می‌دهد که با توجه به مقادیر آماره آزمون و سطح معناداری، فرضیه صفر مبنی بر نرمال بودن توزیع خطاها، عدم وجود خودهمبستگی و همسانی واریانس جملات پسماند پذیرفته می‌شود و هر دو مدل از فرم تابعی درست برخوردار هستند.

پس از برآورد مدل، به منظور اطمینان از پایداری و اعتبار نتایج حاصل از مدل خود توضیح با وقفه‌های گسترده غیرخطی، آزمون‌های ثبات ساختاری شامل پسماند تجمعی^۱ و مجذور پسماند تجمعی^۲ انجام شد. در این آزمون‌ها، مقادیر آماره برآوردی در بازه دو مرز بحرانی در سطح اطمینان ۹۵ درصد رسم می‌شوند. به طور خاص، اگر نمودار پسماند تجمعی و مجذور پسماند تجمعی در میان دو مرز بحرانی قرار گیرد، فرضیه صفر مبنی بر عدم وجود شکست ساختاری پذیرفته می‌شود. در غیر این صورت، فرضیه جایگزین مبنی بر وجود شکست ساختاری مورد تأیید قرار خواهد گرفت. خروجی این آزمون‌ها برای مدل نخست در شکل‌های (۲) و (۳) ارائه شده است. بر اساس این نتایج، می‌توان نتیجه گرفت که ضرایب برآوردی پایدار بوده و هیچ‌گونه شواهدی دال بر وجود شکست ساختاری مشاهده نمی‌شود.



شکل ۲: آزمون ثبات ساختاری پسماند تجمعی و مجذور پسماند تجمعی در مدل ۱ (معیار FGT)

1. Cumulative Sum of Residuals (CUSUM)
2. Cumulative Sum of Squared Residuals (CUSUMQ)



شکل ۳: آزمون ثبات ساختاری پسماند تجمعی و مجذور پسماند تجمعی در مدل ۲ (معیار PGR)

منبع: یافته‌های پژوهش

۳-۲-۳. برآورد اثر نامتقارن بی‌ثباتی اقتصادی بر نابرابری در آمد

با فرض وجود اثر نامتقارن بی‌ثباتی اقتصادی بر نابرابری درآمد، برآورد مربوط به این اثر در این بخش ارائه می‌شود. برای تحلیل اثر نامتقارن، شاخص بی‌ثباتی اقتصادی به دو مؤلفه مثبت و منفی تجزیه شده است. این دو مؤلفه، مشابه رابطه (۱)، بیانگر انباشت تغییرات مثبت و منفی شاخص بی‌ثباتی اقتصادی هستند که از طریق یک فرایند شرطی محاسبه شده‌اند. نتایج این تجزیه در شکل (۱) ارائه شده است. در این بخش نیز، برآورد الگوی نابرابری درآمد با استفاده از رویکرد خود توضیح با وقفه‌های گسترده غیرخطی انجام شده است. برای تعیین وقفه بهینه، از معیار شوارتز - بیزین، الگوی وقفه بهینه (۳،۳،۳،۰،۳،۱،۳،۲،۳) انتخاب شده است.

برای بررسی وجود رابطه بلندمدت، از آزمون کرانه‌ها استفاده شده است. فرض صفر در این آزمون، عدم وجود رابطه بلندمدت میان متغیرها است. نتایج آزمون ارائه شده در جدول (۴) نشان می‌دهد که مقدار آماره آزمون برای مدل نابرابری برابر با $3/65$ است که از مقادیر کرانه‌های بالا و پایین در سطوح اطمینان ۱، ۵ و ۱۰ درصد بزرگ‌تر است؛ بنابراین، فرض صفر رد شده و امکان وجود رابطه بلندمدت بین شاخص‌های نابرابری درآمد، بی‌ثباتی اقتصادی و سایر متغیرهای توضیحی تأیید می‌شود. همچنین، ضریب نتایج نشان می‌دهد که جمله تصحیح خطا منفی بوده و نشان می‌دهد که با گذر از یک سال به سال بعد، حدود ۳۲ درصد از انحراف نابرابری درآمد توسط متغیرهای مدل اصلاح می‌شود. الگوی برآوردی نیز در جدول (۵) ارائه شده است.

مطابق جدول (۵)، در کوتاه‌مدت و بلندمدت، افزایش‌ها و کاهش‌ها در بی‌ثباتی اقتصادی اثر معناداری بر نابرابری درآمد دارند. به‌گونه‌ای که افزایش یک‌درصدی در بی‌ثباتی اقتصادی موجب افزایش نابرابری درآمد به میزان ۰/۱۲ درصد در کوتاه‌مدت و ۰/۶۲ درصد در بلندمدت می‌شود. در مقابل، کاهش یک‌درصدی بی‌ثباتی اقتصادی در کوتاه‌مدت موجب کاهش نابرابری درآمد به میزان ۰/۱۷ درصد می‌گردد، اما در بلندمدت، نابرابری درآمد به میزان ۰/۱۹۴ درصد افزایش می‌یابد. آزمون والد برای بررسی نامتقارنی اثر بی‌ثباتی اقتصادی (برآیند اثر افزایش‌ها و کاهش‌ها) بر نابرابری درآمد نشان می‌دهد که نخست، اندازه اثر کاهش‌ها در بی‌ثباتی تفاوت معناداری با اثر افزایش‌ها دارد؛ و دوم، میزان اثر کاهش‌ها بر نابرابری درآمد ۰/۴۰ واحد بیشتر از اثر افزایش‌ها است؛ بنابراین، در کوتاه‌مدت وجود اثر مستقیم و نامتقارن بی‌ثباتی اقتصادی بر نابرابری درآمد تأیید می‌شود.

نتایج حاصل از الگوی نامتقارن در بلندمدت برخلاف نتایج کوتاه‌مدت نشان می‌دهد که افزایش‌ها و کاهش‌ها در بی‌ثباتی اقتصادی اثر مستقیم و معناداری بر نابرابری درآمد دارند. به‌گونه‌ای که در بلندمدت نیز بی‌ثباتی اقتصادی با اثر نامتقارن بر نابرابری درآمد همراه است و شدت اثر در زمان کاهش بی‌ثباتی اقتصادی به‌مراتب بیشتر از اثر افزایش آن است. در تحلیل اثر مستقیم بی‌ثباتی اقتصادی بر نابرابری درآمد می‌توان گفت که افزایش بی‌ثباتی موجب کاهش رشد اقتصادی، کاهش سرمایه‌گذاری و انباشت سرمایه بخش خصوصی و ایجاد انحراف در توزیع درآمد می‌شود. بی‌ثباتی اقتصادی شرایطی را به وجود می‌آورد که بهره‌مندی از فرصت‌ها مستلزم پرداخت هزینه‌های بالای مبادلات است. از آنجا که همه اعضای جامعه قادر به پرداخت این هزینه‌ها نیستند، منافع اقتصادی به طور نابرابر توزیع می‌شود؛ این امر منجر به افزایش نابرابری و در نهایت کاهش توسعه اجتماعی می‌گردد.

نتایج الگوی کوتاه‌مدت در جدول (۵) نشان می‌دهد که متغیر درآمد سرانه با ضریب $-۰/۶۰$ اثر منفی و مجذور آن با ضریب $۰/۰۱$ اثر مثبت و معناداری بر نابرابری درآمد در ایران داشته است. در مقابل، در الگوی بلندمدت، درآمد سرانه با ضریب $۶/۷۷$ اثر مثبت و مجذور آن با ضریب $-۰/۰۴$ اثر منفی و معناداری بر نابرابری درآمد طی دوره مورد مطالعه نشان می‌دهد. با توجه به ضریب مثبت درآمد سرانه و ضریب منفی مجذور آن، فرضیه کوزنتس مبنی بر شکل U وارونه^۱ میان تولید ناخالص داخلی و نابرابری درآمد در الگوی بلندمدت رد نمی‌شود. بر اساس چارچوب نظری، افزایش تولید ناخالص داخلی (درآمد سرانه) در مراحل اولیه توسعه موجب افزایش نابرابری درآمد می‌شود؛ اما پس از رسیدن به نقطه اوج نابرابری و سطوح بالاتر توسعه، افزایش تولید ناخالص داخلی منجر به کاهش نابرابری درآمد می‌گردد.

نتایج الگوی کوتاه‌مدت در جدول (۵) نشان می‌دهد که متغیر نسبت یارانه به مخارج دولت با ضریب $-۰/۳$ اثری منفی و معنادار در سطح احتمال یک درصد بر نابرابری درآمد دارد. با این حال، همان‌طور که در جدول نتایج مشخص است، در بلندمدت این اثر معکوس تغییر یافته و نسبت یارانه به مخارج دولت با اثر مستقیم بر نابرابری درآمد همراه است؛ به‌گونه‌ای که افزایش یک‌درصدی در نسبت یارانه به کل مخارج دولت، موجب افزایش $۱/۲۱$ درصدی نابرابری درآمد می‌شود. بر اساس چارچوب نظری، یارانه‌ها آثار اجتماعی و اقتصادی متعددی در جامعه بر جای می‌گذارند. از جمله آثار مثبت هدفمندی یارانه‌ها^۲ می‌توان به تحقق عدالت در تخصیص بهینه منابع، مدیریت مصرف انرژی، جلوگیری از اسراف و تبذیر منابع^۳، افزایش فرهنگ پس‌انداز و ارتقای رفاه اجتماعی اشاره کرد. در مقابل، پیامدهای منفی ناشی از پرداخت یارانه‌ها شامل ایجاد فشار تورمی و تشدید اثرات آن بر اقشار پایین جامعه، افزایش نابرابری و گسترش فقر است. نتایج الگوی کوتاه‌مدت نشان می‌دهد که نرخ تورم با علامت منفی اثر غیرمعناداری بر نابرابری درآمد داشته است. با این حال، در الگوی بلندمدت، تورم با ضریب $۱/۴۰$ اثر مستقیم و معناداری در سطح احتمال ۵ درصد بر نابرابری درآمد دارد.

1. Inverted U
2. Targeted Subsidies Project
3. Prodigality of Resources

بر اساس مبانی نظری، تورم که یکی از مهم‌ترین عوامل بی‌ثبات‌کننده اقتصادی محسوب می‌شود. به طوری که تورم می‌تواند به‌عنوان نوعی مالیات نزولی^۱ در نظر گرفته شود که اثر آن بیشتر متوجه افراد فقیر و اقشار کم‌درآمد جامعه است. مطابق دیدگاه استرلی^۲ (۱۹۹۸)، این وضعیت دو دلیل عمده دارد: نخست آنکه فقرا و افراد کم‌درآمد جامعه اغلب دارایی‌های خود را به‌صورت نقد نگه می‌دارند و کمتر به روش‌های درآمدزا مانند خرید اوراق قرضه^۳ یا سهام روی می‌آورند؛ دوم آنکه توانایی این گروه از افراد جامعه در حفظ ارزش دارایی‌ها و درآمدشان در برابر تورم، به‌مراتب کمتر از افراد ثروتمند است. در نتیجه، دارایی‌ها و درآمد افراد فقیر بیشتر در معرض کاهش ارزش ناشی از تورم قرار می‌گیرد.

با این حال، در خصوص مکانیسم‌های اثرگذار شاخص تورم بر نابرابری درآمد می‌توان به چند مسیر اشاره کرد. نخست، تورم موجب انتقال درآمد از دست مزدبگیران به صاحبان سرمایه می‌شود و از این طریق نابرابری درآمد افزایش می‌یابد. دوم، تورم با کاهش دستمزد حقیقی، درآمد افراد فقیر را کاهش می‌دهد (Tyson, 1998). سوم، از آنجاکه فقرا بخش عمده‌ای از دارایی‌های خود را به‌صورت پول نقد نگه می‌دارند، تورم موجب کاهش قدرت خرید و بی‌ارزش شدن دارایی‌های آن‌ها می‌شود، درحالی‌که ثروتمندان دارای ترکیبی از پول نقد و دارایی سرمایه‌ای هستند و اثر تورم بر دارایی آن‌ها کمتر است. چهارم، تورم باعث کاهش ارزش پرداخت‌های انتقالی دولت می‌شود؛ از آنجاکه این پرداخت‌ها عمدتاً به اقشار کم‌درآمد تعلق دارد، تورم می‌تواند موجب افزایش نابرابری و فقر در جامعه شود.

نتایج الگوی کوتاه‌مدت در جدول (۵) نشان می‌دهد که نرخ بیکاری با ضریب $-۱/۳۵$ اثر منفی و معناداری بر نابرابری درآمد دارد. با این حال، بر اساس نتایج الگوی بلندمدت، نرخ بیکاری با ضریب $۱۲/۸۳$ تأثیر مستقیم و معناداری در سطح احتمال ۱۰ درصد بر نابرابری درآمد نشان می‌دهد؛ لذا، بر اساس نتایج نرخ بیکاری در کوتاه‌مدت باعث کاهش نابرابری می‌شود؛ اما در بلندمدت باعث افزایش آن طی دوره مورد مطالعه شده است. به‌طور کلی، هنگامی که اقتصاد دچار نوسانات می‌شود، ترکیب تقاضای نیروی کار، ساختار بیکاری و دستمزدهای حقیقی و نیز سطوح تجربه و مهارت کارگران دستخوش تغییرات ادواری می‌گردد. در این شرایط، نخست هزینه‌های مربوط به نیروی کار کارفرمایان را وادار می‌کند تا کارگران کم‌تجربه و کم‌مهارت را به‌صورت دوره‌ای و قراردادی استخدام کنند؛ به طوری که در دوران رکود اقتصادی آن‌ها را اخراج و در دوران رونق دوباره به استخدام آن‌ها روی می‌آورند. این گروه از کارگران که معمولاً در بخش پایینی توزیع درآمد قرار دارند، در معرض نوسانات شدید دستمزد قرار می‌گیرند. دوم، فقرا به‌ویژه در کشورهای در حال توسعه دسترسی محدود به بیمه‌های بیکاری^۴ دارند و نمی‌توانند اثرات منفی بیکاری را جبران کنند. سوم، کارگرانی که در شغل خود باقی می‌مانند نیز در طول دوره‌های بیکاری از پایین بودن دستمزد حقیقی رنج می‌برند. با توجه به این عوامل، به‌طور کلی اثر بیکاری بر نابرابری درآمد مثبت است و افزایش نرخ بیکاری منجر به تشدید نابرابری در جامعه می‌شود.

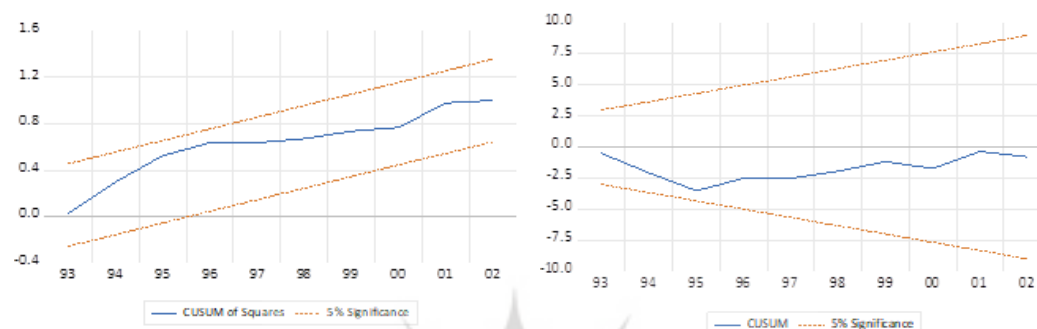
1. Regressive Tax
2. Esterly (1998)
3. Bond (finance)
4. Unemployment benefits

جدول ۵: برآورد اثر نامتقارن بی ثباتی اقتصادی بر نابرابری درآمد

| متغیرها | ضریب | انحراف معیار | آماره t | احتمال |
|---|-------------|--------------|------------|--------|
| الگوی کوتاه مدت | | | | |
| $D(EcoII^+)$ | ۰/۱۲ | ۰/۰۵۰ | ۲/۵۱ | ۰/۰۳۰ |
| $D(EcoII^-)$ | -۰/۱۷ | ۰/۰۳۳ | -۵/۱۷ | ۰/۰۰۰ |
| $D(IPC)$ | -۱/۶۰ | ۰/۲۸۴ | -۵/۶۵ | ۰/۰۰۰ |
| $D(IPC^2)$ | ۰/۰۱ | ۰/۰۰۲ | ۵/۵۸ | ۰/۰۰۰ |
| $D(SubR)$ | -۰/۳۹ | ۰/۰۷۸ | -۵/۰۲ | ۰/۰۰۰ |
| $D(Inf)$ | -۰/۰۰۱ | ۰/۰۱۴ | -۰/۰۸ | ۰/۹۳۴ |
| $D(UnEm)$ | -۱/۳۵ | ۰/۲۴۱ | -۵/۵۹ | ۰/۰۰۰ |
| C | ۱۰۴/۱۰ | ۱۴/۱۳۷ | ۷/۳۷ | ۰/۰۰۰ |
| CointEq | -۰/۳۲ | ۰/۰۴۲ | -۷/۶۹ | ۰/۰۰۰ |
| الگوی بلندمدت | | | | |
| $EcoII^+$ | ۰/۶۲ | ۰/۳۳۰ | ۱/۸۸ | ۰/۰۸۹ |
| $EcoII^-$ | ۱/۹۴ | ۰/۹۰۷ | ۲/۱۴ | ۰/۰۵۷ |
| IPC | ۶/۷۷ | ۳/۰۳۵ | ۲/۲۳ | ۰/۰۴۹ |
| IPC^2 | -۰/۰۴ | ۰/۰۲۱ | -۲/۲۵ | ۰/۰۴۷ |
| SubR | ۱/۲۱ | ۰/۶۳۰ | ۱/۹۲ | ۰/۰۸۲ |
| Inf | ۱/۴۰ | ۰/۶۰۷ | ۲/۳۰ | ۰/۰۴۳ |
| UnEm | ۱۲/۸۳ | ۵/۸۵۰ | ۲/۱۹ | ۰/۰۵۳ |
| C | -۳۱۹/۷۳ | ۱۵۲/۶۸ | -۲/۰۹ | ۰/۰۶۲ |
| آزمون والد جهت بررسی وجود عدم تقارن | | | | |
| متغیر | آماره F | احتمال | مقدار ضریب | |
| برآیند اثر $EcoII^+$ | ۳۰/۵۱ | ۰/۰۰۰ | -۰/۲۰ | |
| برآیند اثر $EcoII^-$ | ۴۴/۹۹ | ۰/۰۰۰ | -۰/۶۳ | |
| برآیند اثر $EcoII^+, EcoII^-$ | ۴۰/۱۵ | ۰/۰۰۰ | ۰/۴۳ | |
| آزمون کرانه‌ها جهت بررسی رابطه بلندمدت | | | | |
| سطح خطا | آماره آزمون | کرانه پایین | کرانه بالا | |
| ۱ درصد | ۳/۶۵ | ۲/۷۳ | ۳/۹ | |
| ۵ درصد | | ۲/۱۷ | ۳/۲۱ | |
| ۱۰ درصد | | ۱/۹۲ | ۲/۸۹ | |
| آزمون‌های تشخیصی | | | | |
| آزمون | آماره | سطح احتمال | | |
| نرمالیتی | ۰/۰۸۶ | ۰/۹۵۷ | | |
| ناهمسانی واریانس | ۲/۳۷ | ۱/۰۰۰ | | |
| خودهمبستگی سریالی | ۱/۵۴ | ۰/۲۳۲ | | |
| رمزی ریست | ۱/۲۶ | ۰/۳۷۹ | | |

منبع: یافته‌های پژوهش

پس از برآورد مدل، به منظور اطمینان از پایداری و اعتبار نتایج حاصل از مدل خود توضیح با وقفه‌های گسترده غیرخطی، آزمون‌های ثبات ساختاری شامل پسماند تجمعی و مجذور پسماند تجمعی انجام شد. در این آزمون‌ها، مقادیر آماره برآوردی در بازه دو مرز بحرانی در سطح اطمینان ۹۵ درصد رسم می‌شوند. خروجی این آزمون‌ها برای نتایج مدل سوم در شکل (۴) ارائه شده است. بر اساس نتایج، ضرایب برآوردی پایدار بوده و شواهدی دال بر وجود شکست ساختاری مشاهده نمی‌شود.



شکل ۴: آزمون ثبات ساختاری پسماند تجمعی و مجذور پسماند تجمعی مدل ۳

منبع: محاسبات پژوهش.

۵. نتیجه‌گیری و پیشنهادها

پژوهش حاضر باهدف تحلیل اثر نامتقارن بی‌ثباتی اقتصادی کلان بر فقر و نابرابری درآمد، بر اساس رهیافت خودرگرسیون با وقفه‌های گسترده غیرخطی طی بازه زمانی ۱۳۶۳ تا ۱۴۰۲ انجام شده است. شاخص بی‌ثباتی اقتصادی بر مبنای چهار زیرشاخص شامل: بی‌ثباتی کسری بودجه نسبت به تولید ناخالص داخلی، نرخ تورم، نسبت بدهی خارجی به تولید ناخالص داخلی و نرخ ارز، با استفاده از روش‌های آرچ و گارچ محاسبه گردیده است. به منظور تحلیل اثرات بی‌ثباتی اقتصادی، سه مدل بر اساس محاسبه فقر با دو شاخص شکاف فقر و شاخص فوستر-گریر-توربک و همچنین متغیر نابرابری درآمد که با شاخص نسبت هزینه دهک بالاتر (ثروتمندترین) به دهک پایین‌تر (فقیرترین) اندازه‌گیری شده است، تصریح و برآورد شده‌اند.

نتایج پژوهش نشان داد که افزایش‌ها در بی‌ثباتی اقتصادی در کوتاه‌مدت موجب کاهش فقر شده، اما هم‌زمان باعث افزایش نابرابری درآمد می‌شوند. در مقابل، در بلندمدت، افزایش بی‌ثباتی اقتصادی هر دو شاخص فقر و نابرابری درآمد را در ایران افزایش داده است. از سوی دیگر، کاهش‌ها در بی‌ثباتی اقتصادی در کوتاه‌مدت موجب افزایش فقر و کاهش نابرابری درآمد می‌شوند، اما در بلندمدت، کاهش بی‌ثباتی اقتصادی منجر به افزایش فقر و نابرابری درآمد در ایران شده است. برآیند این نتایج نشان می‌دهد که بی‌ثباتی اقتصادی طی دوره مورد مطالعه به‌طور کلی باعث افزایش فقر و نابرابری درآمدی در ایران شده است. این یافته‌ها با نتایج مطالعات رحمانی و همکاران (۱۳۹۱)، ملکی (۱۳۹۴)، زروکی و همکاران (۱۴۰۰)، برین و گارسیا پنالوسا (۲۰۰۵)، دیتا و حیات (۲۰۱۷)، علی (۲۰۱۶)، خالد و همکاران (۲۰۲۳) و بودئا و همکاران (۲۰۲۱) هم‌راستا است.

نتایج نشان داد که رشد اقتصادی در کوتاه‌مدت و بلندمدت منجر به افزایش فقر شده است. این یافته‌ها با نتایج مطالعه ملکی (۱۳۹۴) در الگوی کوتاه‌مدت و همچنین با مطالعه رفعت میلانی و همکاران (۱۴۰۳) که نشان دادند رشد تولید ناخالص داخلی در رژیم اول اثر مثبتی بر فقر دارد، همسو است. با این حال، این نتایج با یافته‌های رفعت میلانی و همکاران (۱۴۰۳) و نگوبانه و همکاران (۲۰۲۳) که نشان دادند رشد اقتصادی در رژیم دوم و در بلندمدت منجر به کاهش فقر می‌شود، همسو نیست.

نتایج نشان داد که درآمد سرانه در کوتاه‌مدت منجر به کاهش فقر و نابرابری درآمد شده است. با این حال، در بلندمدت، درآمد سرانه همچنان باعث کاهش فقر می‌شود، اما هم‌زمان موجب افزایش نابرابری درآمد نیز می‌گردد. یافته‌های کوتاه‌مدت با مطالعات حاجیلی دوجی و علمی (۱۴۰۳)، گلزر (۲۰۲۵) و سیمونسکو (۲۰۲۵) همسو است.

علاوه بر این، نتایج نشان داد که مجذور درآمد سرانه در کوتاه‌مدت باعث افزایش نابرابری درآمد و در بلندمدت منجر به کاهش آن می‌شود؛ بنابراین، یافته‌های بلندمدت مربوط به نابرابری درآمد با فرضیه منحنی کوزنتس (KCH) ^۱ همسو بوده و آن را پشتیبانی می‌کند. این نتایج با مطالعات حبیبی و همکاران (۱۴۰۲)، زروکی و همکاران (۱۴۰۰)، عبدی و همکاران (۲۰۲۵) و آیش و همکاران (۲۰۲۵) که نشان دادند فرضیه کوزنتس در پژوهش‌های آن‌ها صادق است، تطابق دارد.

نتایج نشان داد که نرخ تورم در کوتاه‌مدت موجب کاهش فقر شده است، اما اثر معنی‌داری بر نابرابری درآمد ندارد. با این حال، در بلندمدت، افزایش نرخ تورم منجر به افزایش هم فقر و هم نابرابری درآمد می‌شود. این یافته‌ها با مطالعات کمیجانی و محمدزاده (۱۳۹۳)، رفعت میلانی و همکاران (۱۴۰۳)، نوفرستی و محمدی (۱۳۸۸)، حبیبی و همکاران (۱۴۰۲)، عبدی و همکاران (۲۰۲۵)، آیش و همکاران (۲۰۲۵) و گلزر (۲۰۲۵) که نشان دادند تورم باعث افزایش نابرابری درآمد می‌شود، همسو است.

همچنین، اندازه دولت در کوتاه‌مدت و تنها در مدل ۱ اثر منفی و معناداری داشته و باعث کاهش فقر شده است. این نتایج با مطالعات کمیجانی و محمدزاده (۱۳۹۳)، ملکی (۱۳۹۴) و حاجیلی دوجی و علمی (۱۴۰۳) که نشان دادند مخارج دولت و اندازه دولت اثر مثبت بر نابرابری درآمد دارند، همسو نیست. علاوه بر این، نسبت یارانه به مخارج دولت در کوتاه‌مدت باعث کاهش نابرابری و در بلندمدت موجب افزایش نابرابری شده است. این نتایج با مطالعه کمیجانی و محمدزاده (۱۳۹۳) که نشان داد یارانه کالاهای اساسی باعث افزایش نابرابری می‌شود، همسو نیست.

نتایج نشان داد که نرخ بیکاری در کوتاه‌مدت باعث کاهش نابرابری درآمد می‌شود، اما در بلندمدت منجر به افزایش نابرابری می‌گردد. یافته‌های بلندمدت این مطالعه با نتایج مطالعات کمیجانی و محمدزاده (۱۳۹۳)، خالد و همکاران (۲۰۲۳)، گلزر (۲۰۲۵)، عبدی و همکاران (۲۰۲۵) و آیش و همکاران (۲۰۲۵) که نشان دادند نرخ بیکاری به طور قابل توجهی نابرابری درآمد را افزایش می‌دهد، همسو است.

1. Kuznets curve hypothesis (KCH)

باتوجه به نتایج حاصله در این پژوهش پیشنهاد می‌شود که سیاست‌گذاران اقتصادی، سیاست‌هایی را در پیش بگیرند که منجر به کاهش بی‌ثباتی در نرخ تورم، نسبت کسری بودجه به تولید ناخالص داخلی، نسبت بدهی خارجی به تولید ناخالص داخلی و نرخ ارز شود تا از مجرای آن ضمن کاهش بی‌ثباتی اقتصاد کلان، فقر نیز کاهش یابد و توزیع درآمد نیز برابرتر گردد. در این راستا تقویت استقلال بانک مرکزی، شفافیت سیاست‌های مالی و پایبندی به انضباط بودجه‌ای می‌توان نقش مؤثری ایفا کند. از سوی دیگر، یافته‌ها نشان دادند که اثر کاهش بی‌ثباتی به مراتب قوی‌تر از افزایش آن است، بنابراین دولت‌ها باید نه تنها از تشدید بی‌ثباتی جلوگیری کنند، بلکه برنامه‌های هدفمند برای کاهش تدریجی بی‌ثباتی طراحی نمایند. علاوه بر این باتوجه به تأثیر منفی نسبت یارانه به کل مخارج دولت در این پژوهش روی نابرابری درآمد، اهمیت سیاست پرداخت یارانه‌ها و نیز مزایا و معایب این سیاست و با عنایت به اینکه هدف از اجرای این سیاست افزایش رفاه و کاهش فقر و نابرابری در جامعه و حمایت از قشرهای آسیب‌پذیر بوده، دولت می‌تواند با بررسی تمام جنبه‌های این سیاست شرایطی را فراهم آورد که این پرداخت‌ها باعث افزایش توانمندی قشرهای کم‌درآمد و آسیب‌پذیر گردد. در واقع جایگزین کردن سیاست‌های حمایتی بهتر با سیاست‌های تورم‌زا، سطح درآمد حقیقی و رفاه خانوارها را جامعه افزایش می‌دهد و در نتیجه آن فقر و نابرابری نیز کاهش می‌یابند. به نظر می‌رسد به منظور نیل به این اهداف، دولت باید سازوکاری دقیق با حداقل خطا را برای شناسایی قشرهای نیازمند حمایت‌های یارانه‌ای برنامه‌ریزی و ایجاد کند. یافته‌ها همچنین نشان دادند که درآمد سرانه حقیقی اثر منفی و معناداری بر فقر دارد. بدین معنا که رشد اقتصادی پایدار و فراگیر می‌تواند موجب کاهش فقر شود. از این رو پیشنهاد می‌شود سیاست‌های رشد اقتصادی با تمرکز بر اشتغال‌زایی، ارتقای بهره‌وری و توسعه زیرساخت‌های انسانی (به‌ویژه آموزش و سلامت) دنبال شوند تا منافع رشد به صورت عادلانه‌تری میان طبقات مختلف جامعه توزیع گردد. در خصوص اندازه دولت، یافته‌ها نشان می‌دهد که گسترش بیش از حد دولت می‌تواند از طریق افزایش هزینه‌های غیرمولد و کسری بودجه، موجب تشدید بی‌ثباتی و در نهایت افزایش فقر و نابرابری شود؛ بنابراین کاهش تدریجی اندازه دولت همراه با افزایش کارایی هزینه‌های عمومی و تمرکز بر مخارج توسعه‌ای و حمایتی می‌تواند به بهبود توزیع درآمد و کاهش فقر منجر شود. پیشنهاد آخر آنکه باتوجه به تأثیر مستقیم تورم و بیکاری روی فقر و نابرابری درآمد، پیشنهاد می‌شود دولت در کنار کنترل تورم از طریق سیاست‌های پولی منسجم، برنامه‌های جامع‌تری برای کاهش بیکاری، به‌ویژه در میان جوانان و زنان، تدوین کند. ایجاد مشاغل پایدار، حمایت از بنگاه‌های کوچک و متوسط و آموزش‌های مهارتی می‌تواند در این زمینه مؤثر باشد. در مجموع ثبات اقتصادی پایدار، دولت کارآمد و رشد فراگیر می‌تواند به عنوان سه محور اساسی در سیاست‌گذاری برای کاهش فقر و نابرابری مدنظر قرار گیرند.

توضیحات تکمیلی

مشارکت نویسندگان

این مقاله برگرفته از رساله دکتری **دلشاد رحمان مرانه** در رشته اقتصاد بخش عمومی است که تحت راهنمایی دکتر شهریار زروکی و دکتر احمد جعفری صمیمی و با مشاوره دکتر مانی مؤتمنی در گروه اقتصاد نظری، دانشگاه مازندران انجام شده است.

تضاد منافع

نویسندگان اعلام می‌کنند که هیچ‌گونه تضاد منافع در این پژوهش وجود ندارد.

حامی مالی

نویسندگان هیچ‌گونه حمایت مالی برای تحقیق، تألیف و انتشار این مقاله دریافت نکرده‌اند.

شناسه ارکید (ORCID)

<http://orcid.org/0009-0002-0727-6299>

دلشاد رحمان مرانه



<http://orcid.org/0000-0002-7078-4547>

شهریار زروکی



<https://orcid.org/0000-0002-9047-6189>

احمد جعفری صمیمی



<https://orcid.org/0000-0002-4814-3276>

مانی مؤتمنی



منابع و مأخذ

ابونوری، اسمعیل و رضا، عباسی قادی. (۱۳۸۶). برآورد اثر رشد اقتصادی بر فقر در ایران. *پژوهش‌های اقتصادی ایران*، ۹(۳۰)، ۵۲-۲۳.

https://ijer.atu.ac.ir/article_3647.html

ارضروم چیلر، نسرين. (۱۳۸۴). ابعاد گوناگون فقر در ایران. *نشریه روند (روند پژوهش‌های اقتصادی)*، ۲۷(۲)، ۱۲-۳۶.

https://ijer.atu.ac.ir/article_3647.html

پارت، سمانه، خانزادی، آزاد و کریمی، محمد شریف. (۱۴۰۰). تأثیر راهبردهای حمایتی سرمایه اجتماعی با تأکید بر سیاست‌های

یارانه‌ای، سیاست‌های راهبردی و کلان. ۹(۳۳)، ۱۰۴-۱۳۳. <https://doi.org/10.30507/jmsp.2021.111383>

پیش بهار، اسماعیل، باقرپور، شبنم، و قهرمان‌زاده، محمد. (۱۳۹۸). بررسی شاخص‌های فقر روستایی و عوامل مؤثر بر آن در

ایران. *اقتصاد و توسعه کشاورزی (علوم و صنایع کشاورزی)*، ۳۳(۱)، ۴۱-۵۴. <https://doi.org/10.22067/jead2.v0i0.73388>

حاجیلی دوجی، معصومه و علمی، زهرامیلا. (۱۴۰۳). تأثیر حکمرانی خوب بر نابرابری درآمد با تأکید بر بی‌ثباتی سیاسی. *تحلیل‌های*

اقتصادی توسعه ایران، ۱۰(۱)، ۲۲۷-۲۵۰. <https://doi.org/10.22051/ieda.2024.46408.1406>

حبیبی، فاتح، عزیزی، وحید، منوچهری، صلاح‌الدین و علی مرادی افشار، پروین. (۱۴۰۲). بلایای طبیعی، جهانی شدن، توسعه مالی

و نابرابری درآمد در ایران. *پژوهش‌های برنامه و توسعه*، ۴(۴)، ۷-۴۲. <https://doi.org/10.22034/pbr.2024.198799>

- راغفر، حسین، خوش‌دست، فریبا، و یزدان‌پناه، محدثه. (۱۳۹۱). اندازه‌گیری نابرابری درآمد در ایران از ۱۳۶۳ تا ۱۳۸۹. *رفاه اجتماعی*، ۱۲(۴۵) فقر (۱)، ۲۴۱-۲۶۶. <http://refahj.uswr.ac.ir/article-1-1013-fa.html>
- رحمانی، تیمور، پوررحیم، پروین، و دهقان منشادی، محمد. (۱۳۹۱). بررسی رابطه بی‌ثباتی سیاست‌های اقتصاد کلان و توزیع درآمد در کشورهای درحال توسعه. *سیاست‌گذاری اقتصادی*، ۸(۴)، ۱۸۱-۲۰۱. <https://www.magiran.com/p1219330>
- رفعت میلانی، مژگان، حیدریان، مریم و عرب یارمحمدی، جواد. (۱۴۰۳). بررسی اثرات بدهی‌های دولت بر شاخص فقر در ایران؛ با رویکرد رگرسیون انتقال ملایم (STR). *سیاست‌ها و تحقیقات اقتصادی*، ۳(۱)، ۶۲-۸۹. <https://doi.org/10.22034/jep.2024.141551.1134>
- زارع چمازکتی، محمدرضا، کریمی موغاری، زهرا و زروکی، شهریار. (۱۴۰۱). تأثیر رشد اقتصادی بر فقر: مطالعات تطبیقی برنامه اول و سوم توسعه، *پژوهش‌نامه اقتصادی*، ۲۲(۸۵)، ۹۵-۱۱۸. <https://doi.org/10.22054/joer.2023.71903.1111>
- زروکی، شهریار، عبدی سیدکلایی، محمد و یوسفی بارفروشی، آرمان. (۱۴۰۰). تحلیل نقش بی‌ثباتی اقتصاد کلان بر نابرابری درآمد در ایران. *پژوهش‌ها و چشم‌اندازهای اقتصادی*، ۲۱(۴)، ۳۷-۶۶. <https://dor.isc.ac/dor/20.1001.1.17356768.1400.21.4.1.5>
- شاکری، عباس، جهانگرد، اسفندیار، و اقلامی، سمیه. (۱۳۹۲). اثر غیرخطی تورم بر نابرابری درآمد در ایران. *پژوهش‌های رشد و توسعه پایدار (پژوهش‌های اقتصادی)*، ۱۳(۴)، ۲۷-۵۳. <https://dor.isc.ac/dor/20.1001.1.17356768.1392.13.4.2.0.53-27>
- صامتی، مجید و بهنود، مرجان. (۱۳۹۱). تأثیر بی‌ثباتی اقتصادی بر توسعه انسانی در کشورهای منتخب آسیا، *تحقیقات توسعه اقتصادی*، ۵، ۵۳-۶۸. <https://dor.isc.ac/dor/20.1001.1.22285954.1397.8.3.1.1.8>
- عصاری، عباس و مزینانی، عاطفه (۱۳۹۰). روش‌ها و شاخص‌های اندازه‌گیری فقر و رفاه اقتصادی. *راهنبرد توسعه*، ۲۷(۲)، ۷۶-۱۰۱. <https://www.magiran.com/p949681>
- کارنامه حقیقی، حسن (۱۳۹۱). *پی‌آمد بی‌ثباتی اقتصاد کلان بر فقر در ایران (۱۳۶۳-۸۷)* (رساله دکتری). دانشگاه اصفهان، دانشکده علوم اداری و اقتصاد، اصفهان. <https://elmnet.ir/doc/10529675-21722>
- کمیحانی، اکبر، و محمدزاده، فریدون. (۱۳۹۳). تأثیر تورم بر توزیع درآمد و عملکرد سیاست‌های جبرانی. *پژوهش‌ها و سیاست‌های اقتصادی*، ۲۲(۶۹)، ۵-۲۴. <http://qjerp.ir/article-1-127-fa.html>
- گیلک حکیم‌آبادی، محمدتقی، زروکی، شهریار و حسن‌زاده، شهره. (۱۳۹۶). تأثیر بی‌ثباتی اقتصاد کلان بر جرائم مالی در ایران. *پژوهش‌های راهبردی امنیت و نظم اجتماعی*، ۶(۱)، ۲۹-۴۶. <https://doi.org/10.22108/ssoss.2017.21278>
- ملکی، پروین. (۱۳۹۴). *تأثیر نامیزانی نرخ ارز بر توزیع درآمد: مطالعه موردی اقتصاد ایران*. پایان‌نامه کارشناسی‌ارشد، دانشکده اقتصاد و علوم اداری دانشگاه مازندران. <https://elmnet.ir/doc/10833676-12461>
- نوفروستی، محمد و محمدی، فردین. (۱۳۸۸). بررسی اثرات شوک‌های اقتصاد کلان بر توزیع درآمد در اقتصاد ایران. *پژوهش‌های اقتصادی ایران*، ۱۳(۳۸)، ۳۱-۵۲. https://ijer.atu.ac.ir/article_3514.html

References

- Abdi, A. H., Mohamed, A. A., Mohamed, A. A., & Mohamed, A. A. (2025). Do globalization, foreign direct investment, and inflation drive income inequality? Evidence from Somalia within the Kuznets curve hypothesis. *Research in Globalization*, 100301. <https://doi.org/10.1016/j.resglo.2025.100301>
- Abounoori, E. & Abbasi Ghadi, R. (2007). Economic growth effect on poverty in Iran. *Iranian Journal of Economic Research*, 9(30), 23-52. (In Persian)
- Agénor, P. R. (2004). Macroeconomic adjustment and the poor: analytical issues and cross-country evidence. *Journal of economic surveys*, 18(3), 351-408. <https://doi.org/10.1111/j.0950-0804.2004.00225.x>
- Ali, A. (2016). Issue of income inequality under the perceptive of macroeconomic instability. *Pakistan Economic and Social Review*, 56(1), 121-155.
- Apergis, N., & Cooray, A. (2018). Asymmetric real exchange rates and poverty: The role of remittances. *Emerging Markets Review*, 35, 111-119. <https://doi.org/10.1016/j.ememar.2018.02.001>.
- Asari, A., & Mazinani, A. (2011). Methods and indicators for measuring poverty and economic well-being. *Development Strategy*, 27, 76-101. (In Persian)
- Asian Development Bank (2011). *Poverty, inequality, and inclusive growth in Asia: Measurement, policy issues, and country studies*. (Juzhong Zhuang (Ed.)). Anthem Press.
- Ayyash, M., Sek, S. K., & Kole, A. (2025). Income inequality dynamics in ASEAN-5: a panel data approach using CS-ARDL to examine macroeconomic factors. *Discover Sustainability*, 6(1), 465. <https://doi.org/10.1007/s43621-025-01068-1>
- Bodea, C., Houle, C., & Kim, H. (2021). Do financial crises increase income inequality? *World Development*, 147, 105635. <https://doi.org/10.1016/j.worlddev.2021.105635>.
- Breen, R., & Garcia-Peñalosa, C. (2005). Income inequality and macroeconomic volatility: An empirical investigation. *Review of Development Economics*, 9(3), 380-398. <https://doi.org/10.1111/j.1467-9361.2005.00283.x>.
- Bulir, A. (2001). Income inequality: Does inflation matter? *IMF Staff Papers*, 48(1), 139-159.
- De Barros, R. P., Corseuil, C., Mendonça, R., & Reis, M. C. (2000). Poverty, inequality and macroeconomic instability. *Economia Aplicada*, 4(4), 743-761. <https://hdl.handle.net/10419/220182>.
- Demery, L., & Addison, T. (1987). Stabilization Policy and Income Distribution in Developing Countries. *World Development*, 15(12), 1483-1498. [https://doi.org/10.1016/0305-750X\(87\)90232-4](https://doi.org/10.1016/0305-750X(87)90232-4)
- Ditta, A., & Hayat, M. A. (2017). Macroeconomic instability and its role on income inequality in developing countries. *Pakistan Economic and Social Review*, 55(2), 613-636.
- Dollar, D., & Kraay, A. (2002). Growth is good for the poor. *Journal of Economic Growth*, 7, 195-225. <https://doi.org/10.1023/A:1020139631000>.
- Eghbali, A.R., Hallafi, H.R., & Gaskari, R. (2003). The Effects of Some Variables on Private Investment: The Case of Iran. Fourth International Scientific Conference: Investment in the Future, Proceeding International House of Scientists, F.J. Curie, Varna-Bulgaria, PP.43-53.
- Elshahawany, D. N., & Elazhary, R. H. (2024). Government spending and regional poverty alleviation: evidence from Egypt. *Asia-Pacific journal of regional science*, 8(1), 111-135. <https://doi.org/10.1007/s41685-023-00318-2>

- Engle, R. F. (1982). Autoregressive conditional heteroscedasticity with estimates of the variance of United Kingdom inflation. *Econometrica*, 50(4), 987-1007. <https://doi.org/10.2307/1912773>
- Erzurum Ciller, N. (2005). Various dimensions of poverty in Iran. *Trend (Economic Research Trends)*, 27, 12-36. https://ijer.atu.ac.ir/article_3647.html. (In Persian)
- Eslami, M., & Hoseini, M. (2024). Poverty dynamics in Iran. *Planning and Budgeting*, 29(2), 173-40. <http://dx.doi.org/10.61186/jpbud.29.2.3>.
- Ferreira, F. H., & Keely, L. C. (2000). The World Bank and structural adjustment: Lessons from the 1980s. *The World Bank: Structure and policies*, 3, 159.
- Financial Glossary (2011). *Financial Glossary*. International Monetary Fund, April 2011 www.imf.org
- Fischer, S. (1988). Real balances, the exchange rate, and indexation: Real variables in disinflation. *The Quarterly Journal of Economics*, 103(1), 27-49. <https://doi.org/10.2307/1882641>.
- Fischer, S. (1993). The role of macroeconomic factors in growth. *Journal of Monetary Economics*, 32(3), 485-512. [https://doi.org/10.1016/0304-3932\(93\)90027-D](https://doi.org/10.1016/0304-3932(93)90027-D).
- Gilak Hakimabadi, M. T., Zaroki, S., & Hasanzade, S. (2017). The effect of macroeconomic instability on financial crimes in Iran. *Strategic Research on Social Problems*, 6(1), 29-46. <https://doi.org/10.22108/ssoss.2017.21278>. (In Persian)
- Glezer, E. (2025). How does conflict moderate the impact of remittances on income inequality in Latin American countries?. *UCL Journal of Economics*, 4(1), <https://doi.org/10.14324/111.444.2755-0877.2055>
- Gordon, D. (2006). The concept and measurement of poverty. In *Poverty and Social Exclusion in Britain* (pp. 29-70). Policy Press. <https://doi.org/10.51952/9781447366843.ch002>
- Grespo, R. J. (2004). *Macroeconomic Condition and Income Distribution in Venezuela*. University of Bristol. https://www.bristol.ac.uk/efm/media/workingpapers/working_papers/pdffiles/dp18703.pdf.
- Habibi, F., Azizi, V., Manochehri, S., & Ali Moradi Afshar, P. (2024). Natural disasters, globalization, financial development and income inequality in Iran. *Program and Development Research*, 4(4), 7-42. <https://doi.org/10.22034/pbr.2024.198799>
- Hajili Davaji, M., & Elmi, Z. (2024). The effects of good governance on income inequality with an emphasis on political instability. *Iranian Economic Development Analyses*, 10(1), 227-250. <https://doi.org/10.22051/ieda.2024.46408.1406>
- Hausmann, R., & Gavin, M. (1996). Securing stability and growth in a shock prone region: The policy challenge for Latin America (No. 315). Working Paper. <http://dx.doi.org/10.18235/0011583>
- Heipertz, M., & Verdun, A. (2010). *Ruling Europe: The politics of the stability and growth pact*. Cambridge University Press. <https://doi.org/10.1017/CBO9780511750380>
- Karnameh Haghighi, H. (2012). *The Consequences of Macroeconomic Instability on Poverty in Iran (1984-2008)*. PhD thesis. University of Isfahan, Faculty of Administrative Sciences and Economics, Isfahan. <http://qjerp.ir/article-1-127-fa.html> (In Persian)
- Kaulihowa, T., & Adjasi, C. (2018). FDI and income inequality in Africa. *Oxford Development Studies*, 46(2), 250-265. https://doi.org/10.1080/13600818.2017.1381233?urlappend=%3Futm_source%3Dresearchgate.net%26medium%3Darticle

- Kemal, A. R. (2001). Debt accumulation and its implications for growth and poverty. *The Pakistan Development Review*, 40(4), 263-281. <https://doi.org/10.30541/v40i41pp.263-281>
- Khalid, M., Khan, A. A., & Jafri, M. K. (2023). Impact of macroeconomic instability on income inequality in South Asian countries. *Journal of Management & Islamic Finance (GJMIF)*, 3(4). <https://gjmf.com/index.php/GJMIF/article/view/66>
- Khodadad Kashi, F., & Tash, M. N. S. (2014). Effects of macroeconomic variables on poverty in Iran (Application of bootstrap technique). *Theoretical and Applied Economics*, 21(5), 594. 10.22096/esp.2010.26222
- Komijani A., & Mohammadzadeh, F. (2014). The effect of inflation on income distribution and performance of compensation policies. *qjerp*, 22(69), 5-24. <http://qjerp.ir/article-1-127-en.html> (In Persian).
- Kuznets, S. (1955) Economic growth and income inequality. *The American Economic Review*, 45, 1-28.
- Loko, M. B., Nallari, R., Kalonji, M. K. D., & Mlachila, M. M. (2003). The impact of external indebtedness on poverty in low-income countries. International Monetary Fund. <https://doi.org/10.5089/9781451848199.001>
- Lustig, N., & Walton, M. (1999). Crises and the poor: a template for action. In Prepared for the Conference on Social Protection and Poverty in Washington, DC. <https://doi.org/10.2139/ssrn.2948956>
- Maier, R. (2004). Macroeconomic Policy for Pro-poor Growth, Ph.D. Thesis in Ludwig-Maximilians University, Munich. https://edoc.ub.uni-muenchen.de/3149/1/Maier_Rolf.pdf
- Maleki, P. (2015). The Effect of Exchange Rate Imbalance on Income Distribution: A Case Study of the Iranian Economy. Master's Thesis, Faculty of Economics and Administrative Sciences, University of Mazandaran. <https://elmnet.ir/doc/10833676-12461> (In Persian)
- Ngubane, M. Z., Mndebele, S., & Kaseeram, I. (2023). Economic growth, unemployment and poverty: Linear and non-linear evidence from South Africa. *Heliyon*, 9(10), e20267. <https://doi.org/10.1016/j.heliyon.2023.e20267>
- Noferesti, M. and Mohammadi, F. (2009). Analyzing the effects of macroeconomic shocks on income distribution in Iran. *Iranian Journal of Economic Research*, 13(38), 31-52. https://ijer.atu.ac.ir/article_3514.html?lang=en&lang=en&lang=en&lang=en (In Persian)
- Obi, B. O. (2007). Fiscal policy and poverty alleviation: Some policy options for Nigeria.
- Part, S., Khanzadi, A., & Karimi, M. (2021). Analyzing the effects of social capital supportive strategies: A focus on subsidy policies. *Quarterly Journal of The Macro and Strategic Policies*, 9(33), 104-133. <https://doi.org/10.30507/jmsp.2021.111383> (In Persian)
- Paul, J. (2002). Inflation and macroeconomic instability in Madagascar. University of Toulouse and Institute Universitaire Defrance, pp 2-10. <https://econpapers.repec.org/RePEc:csa:wpaper:2001-02>
- Petri, P. A. (1993). The Lessons of East Asia: Common Foundations of East Asian Success. World Bank. <http://documents.worldbank.org/curated/en/134881468770641850>
- Pishbahar, E., Bagherpour, S. & Ghahremanzadeh, M. (2019). Evaluation of rural poverty indicators and its' affecting factors in Iran. *Journal of Agricultural Economics & Development*, 33(1), 41-54. <https://doi.org/10.22067/jead2.v0i0.73388> (In Persian)
- Rafat Milani, M., Heidarian, M., & Arab YarMohammadi, J. (2024). Investigating the effects of government debt on the poverty in Iran; with smooth transition regression (STR) approach. *Economic Policies and Research*, 3(1), 62-89. <https://doi.org/10.22034/jep.2024.141551.1134>

- Raghfar H., Khoshdast F., & Yazdanpanah, M. (2012). Measurement of income inequality in Iran, 1984-2010. *refahj*, 12(45), 275-305. <http://refahj.uswr.ac.ir/article-1-1013-fa.html> (In Persian)
- Rahmani, T., Pourrahim, P., & Dehghan Manshadi, M. (2012). The examination of the relationship between macroeconomic policies instability and income distribution in developing countries. *The Journal of Economic Policy*, 4(8), 181-201. <https://www.magiran.com/p1219330> (In Persian)
- Rainwater, L. (1990). Poverty and equivalence as social constructions, 55. LIS Working Paper Series. <https://econpapers.repec.org/RePEc:lis:liswps:55>
- Ramey, G., & Ramey, V. A. (1994). Cross-country evidence on the link between volatility and growth. <http://www.jstor.org/stable/2950979?origin=JSTOR-pdf>
- Ravallion, M. (1997). Can high-inequality developing countries escape absolute poverty?. *Economics Letters*, 56(1), 51-57. [https://doi.org/10.1016/S0165-1765\(97\)00117-1](https://doi.org/10.1016/S0165-1765(97)00117-1)
- Ravallion, M. (2010). Poverty lines across the world. World bank policy research working paper, (5284). [https://doi.org/10.1016/S0165-1765\(97\)00117-1](https://doi.org/10.1016/S0165-1765(97)00117-1)
- Sameti, M., & Behnoud, M. (2012). The impact of economic instability on human development in selected Asian countries, *Economic Development Research*, 5, 53-68. <https://dor.isc.ac/dor/20.1001.1.22285954.1397.8.31.1.8> (In Persian).
- Shakeri, A., Jahangard, E., & Etamei, S. (2013). The nonlinear effect of inflation on income inequality in Iran. *Sustainable Growth and Development Research* (Economic Research), 13(4), 27-53. <https://dor.isc.ac/dor/20.1001.1.17356768.1392.13.4.2.0> (In Persian)
- Sheikh, M. R., & Alam, T. (2013). Does external indebtedness enhance the incidence of poverty in pakistan? An empirical evidence. *International Research Journal of Finance and Economics*, 106, 17-23. [https://doi.org/10.1016/S0165-1765\(97\)00117-1](https://doi.org/10.1016/S0165-1765(97)00117-1)
- Shin, Y., Yu, B., & Greenwood-Nimmo, M. (2014). Modelling asymmetric cointegration and dynamic multipliers in a nonlinear ARDL framework. *Festschrift in honor of Peter Schmidt: Econometric Methods and Applications*, 281-314. <https://doi.org/10.2139/ssrn.1807745>.
- Simionescu, M. (2025). Does finance contribute to income inequality in the European Union?. *Borsa Istanbul Review*, 25(6), 1116-1127. <https://doi.org/10.1016/j.bir.2025.06.010>
- Townsend, P. (1979) *Poverty in the United Kingdom*, London, Allen Lane and Penguin Books' if quoting from this book.
- Tyson, L. (1998). Commentary: how can economic policy strike a balance between economic efficiency and income equality. *Income Inequality: Issues and Policy Options*, 337-343. <https://econpapers.repec.org/RePEc:fip:fedkpr:y:1998:p:337-343>.
- Yang, L. (2017) The relationship between poverty and inequality: concepts and measurement. CASEpapers (205). Centre for Analysis of Social Exclusion, London, UK. <http://eprints.lse.ac.uk/id/eprint/103491>.
- Younsi, M., & Bechtini, M. (2020). Economic growth, financial development, and income inequality in BRICS countries: does Kuznets' inverted U-shaped curve exist?. *Journal of the Knowledge Economy*, 11, 721-742. <https://doi.org/10.1007/s13132-018-0569-2>.
- Zare Chamazakhti, M. R., Karimi Moughari, Z., & Zaroki, S. (2022). The impact of economic growth on poverty: A comparative study of the first and third development plans. *Economics Research*, 22(85), 95-118. <https://doi.org/10.22054/joer.2023.71903.1111>. (In Persian)
- Zaroki, S., Abdi Seyyedkolae, M., & Yousefi barfurushi, A. (2021). Analyzing the role of macroeconomic instability on income inequality in Iran. *Economic Research and Perspectives*, 21(4), 37-66. <https://dor.isc.ac/dor/20.1001.1.17356768.1400.21.4.1.5>

- Zaroki, S., Abdi Seyed Kolai, M., & Yousefi Barfuroshi, A. (2021). Analyzing the role of macroeconomic instability on income inequality in Iran. *Sustainable Growth and Development Research (Economic Research)*, 21(4), 37-63. <https://dor.isc.ac/dor/20.1001.1.17356768.1400.21.4.1.5> (In Persian).

