

فصلنامه نظریه‌های کاربردی اقتصاد/ سال هشتم/ شماره ۴/ زمستان ۱۴۰۰/ صفحات ۲۰۰-۱۶۱

## آثار غیرخطی مخارج عمومی دولت بر رفاه اجتماعی (رهیافت NARDL)<sup>۱</sup>

نرگس احمدوند

دانشجوی دکتری اقتصاد دانشگاه لرستان، [narges.ahmadvand.4630@gmail.com](mailto:narges.ahmadvand.4630@gmail.com)

محمد علیزاده\*

دانشیار اقتصاد دانشگاه لرستان، [alizadeh\\_176@yahoo.com](mailto:alizadeh_176@yahoo.com)

محمدحسن فطرس

استاد اقتصاد دانشگاه بوعلی سینا، [fotros.fotros@basu.ac.ir](mailto:fotros.fotros@basu.ac.ir)

محبوبه دلفان

استادیار اقتصاد دانشگاه لرستان، [delfan.m@lu.ac.ir](mailto:delfan.m@lu.ac.ir)

تاریخ دریافت: ۱۴۰۰/۰۸/۱۱ تاریخ پذیرش: ۱۴۰۰/۱۱/۲۴

### چکیده

از وظایف دولت در جهت برقراری عدالت و افزایش رفاه اجتماعی افراد جامعه، ارائه صحیح خدمات مالی و عمومی، حفظ نظم از طریق وضع قوانین و اعمال حاکمیت صحیح در تنظیم روابط دستگاه‌های دولتی و مردم با یکدیگر با کمک دستگاه قضا است. هدف از پژوهش حاضر بررسی اثرگذاری مخارج دولت در امور عمومی و زیر فصول مربوطه، شامل: قانون-گذاری، خدمات عمومی، قضایی، خدمات مالی و توسعه علوم بر شاخص رفاه اجتماعی آمارتیا سن در طی دوره‌های رکود و رونق در اقتصاد ایران است. در مطالعه حاضر از مدل خود توضیح غیر خطی با وقفه‌های گسترده (NARDL) جهت برآورد داده‌های سری زمانی در طی دوره زمانی سال‌های ۱۳۹۸-۱۳۵۲ بهره گرفته شده است. نتایج تحقیق نشان دهنده آن است که در اقتصاد ایران شوک‌های مثبت مخارج دولت در فصول توسعه علوم، قانون‌گذاری و عمومی در طی ادوار تجاری موجب افزایش و در فصل قضایی در طی ادوار تجاری موجب کاهش رفاه اجتماعی به طور معنادار شده‌اند. شوک منفی مخارج دولت در امور عمومی و فصول قانون‌گذاری، عمومی و خدمات مالی در طی ادوار تجاری و فصل قضایی تنها در دوره‌های رکود موجب افزایش رفاه اجتماعی به طور معنادار شده است. شوک منفی مخارج دولت در فصل توسعه علوم نیز به ترتیب در دوره‌های رکود و رونق موجب افزایش و کاهش رفاه اجتماعی به طور معنادار شده‌اند. بنابراین، مخارج دولت در امور عمومی و زیر فصول مربوطه در طی ادوار تجاری دارای آثار نامتقارن بر رفاه اجتماعی هستند.

**واژه‌های کلیدی:** امور عمومی، ادوار تجاری، شاخص رفاه اجتماعی آمارتیا سن، NARDL.  
**طبقه‌بندی JEL:** O40, D63, C22.

<sup>۱</sup> این مقاله مستخرج از رساله دکترای نویسنده اول در دانشگاه لرستان است.

\* نویسنده مسئول مکاتبات

## ۱-مقدمه

با بروز بحران عمیق مالی در دوره زمانی ۲۰۰۹-۲۰۰۸، دولت‌ها دست به بسته‌های محرک مالی بزرگ زدند (افسونو، اگنلو و فورکری<sup>۱</sup>، ۲۰۱۰). دولت‌ها از طریق تخصیص صحیح منابع مالی خود سعی بر کاهش نوسانات کردند. یکی از حوزه‌های تخصیصی منابع دولت در این راستا امور عمومی بوده که نقشی بنیادی در شکل‌گیری بسترهای اقتصادی و اجتماعی برای جلوگیری از نوسانات بیشتر و افزایش رفاه شهروندان دارد. امور عمومی به‌عنوان عاملی درونی و تاثیرگذار بر رفاه شناخته می‌شود. عیسی زاده و احمد زاده<sup>۲</sup> (۱۳۸۸) بیان می‌کنند دولت‌ها می‌توانند نقشی مثبت در افزایش توانمندی‌های خود با نهادینه کردن قوانین داشته تا از این طریق مقامات دولتی طبق منافع جامعه عمل کنند. همچنین، آن‌ها اشاره می‌کنند دادگاه‌ها و مجامع قانون‌گذاری باعث حمایت بیشتر از حقوق مالکیت، افزایش رشد اقتصادی و در پی آن افزایش رفاه آحاد جامعه می‌شوند. دل انگیزان، پشته‌کشی و نظری<sup>۳</sup> (۱۳۹۶) وجود قانون جهت تضمین حقوق مالکیت و حسن اجرای قراردادها را کلیدی برای هدایت صحیح منابع و سرمایه‌گذاری‌های مولد، گسترش اشتغال و تولید و در نتیجه رفاه شهروندان می‌دانند. بامول<sup>۴</sup> (۲۰۰۲) دستگاه قضایی را به‌عنوان متولی برقراری نظم، حفظ امنیت اجتماعی و حقوق مالکیت، کیفیت و ضمانت اجرایی قوانین و مقررات، تعیین‌کننده ساختار انگیزشی مربوط به انواع مختلف فعالیت‌های اقتصادی و در نتیجه تعیین‌کننده مسیر رشد اقتصادی می‌داند. به دلیل این که مردم در جستجوی منافع شخصی بوده فقط زمانی به انجام کار سخت و سرمایه‌گذاری می‌پردازند که احتمال منتفع شدن از تلاش‌شان را داشته باشند. به همین علت، خصیصه‌های رسمی در محیط‌های نهادی مانند کیفیت قوانین و مقررات و کارایی دستگاه قضا در این راستا نقش مهمی را بازی کرده و برای بررسی علت تفاوت سطح رشد و توسعه کشورها بسیار مهم هستند (زبیری و صلاحی کجور<sup>۵</sup>، ۱۳۹۸). بانک جهانی<sup>۶</sup> (۱۹۸۹) ارائه خدمات عمومی کارآمد، نظام قضایی قابل

<sup>1</sup> Afonso et al.

<sup>2</sup> Isazadeh & Ahmadzadeh (2009)

<sup>3</sup> Del Angizan et al. (2017)

<sup>4</sup> Baumol

<sup>5</sup> Zubairi & Salahy Kojoor (2019)

<sup>6</sup> World Bank

اعتماد و نظام اداری پاسخگو را نشان دهنده عملکرد مناسب دولت در حوزه سیاست-های مالی دولت در امور عمومی می‌داند (استوا، ۱۹۹۲). همچنین، بانک جهانی (۱۹۸۹) شیوه مدیریت و اداره کشور و رابطه شهروندان با حکومت کنندگان را در حوزه اداره امور عمومی دانسته و آن را متأثر از نحوه و میزان تخصیص مخارج دولت می‌داند. ایران به‌عنوان کشوری در حال توسعه برای طی کردن مسیر توسعه و افزایش رفاه آحاد جامعه نیازمند لوازم و مقدماتی بوده که از طریق ارکان قانون‌گذاری، مولفه‌های حقوقی و قضایی قابل دستیابی هستند. نقش این ارکان و مولفه‌ها در سند چشم‌انداز جمهوری اسلامی ایران در افق ۱۴۰۴ هجری شمسی طی هفده بند با هدف تضمین عدالت قضایی و تضمین حقوق فردی و اجتماعی جهت افزایش رفاه آحاد مردم به دقت ارائه شده‌اند (محبی<sup>۲</sup>، ۱۳۸۹). بنابراین، اهمیت فصول مربوط به امور عمومی جهت افزایش رفاه اجتماعی موجب شده نحوه تخصیص منابع دولت در حوزه‌های نام برده با برنامه و تدبیر بیشتری صورت پذیرد. به طوری که در روند بودجه‌ریزی دولت امور عمومی پس از امور اقتصادی، اجتماعی، دفاعی و قبل از امور متفرقه قرار گرفته است (احمدوند و همکاران<sup>۳</sup>، ۱۳۹۹). نمونه‌ای از مخارج دولت در زیر فصول مربوط به امور عمومی عبارتند از: فصل قانون‌گذاری، شامل؛ اجرای مفاد اسناد رسمی لازم‌الاجرا، ابلاغ ساختار سازمانی و مقررات شهرداری‌ها و دهیاری‌های کشور، ثبت و تغییرات شناسنامه ملی و غیره. در فصل قضا، شامل؛ خدمات قضایی و انتظامی، امور دادگاه‌ها، زندان‌ها، بازرسی و ارزیابی عملکرد نهادها و مدیران سطح استان‌ها و غیره. در فصل خدمات مالی، شامل؛ نظارت بر اجرای بودجه، ارائه پیش‌نویس قوانین و تدوین مقررات مالی و اقتصادی دولت، ارائه اوراق بهادار، نظارت بر شرکت‌های دولتی، نظارت بر بیمه، بانک‌ها و صندوق‌ها، ارائه خدمات به مودیان مالیاتی، نظارت بر اموال منقول و غیر منقول، برگزاری مزایده و مناقصه، پاسخ به استعلامات حوزه مالی دولت، هویت و نشانی افراد، تنظیم اسناد رسمی و غیره. در فصل خدمات عمومی، شامل: اطلاع‌رسانی مناقصات و مزایده‌ها و قراردادهای کشوری، ارائه تاییدیه صلاحیت کارکنان دولت، نظارت بر کیفیت ارائه خدمت و تولید کالا، عرضه و واگذاری سهام ترجیحی، گزینش، صدور مجوزهای

---

<sup>1</sup> Stowe

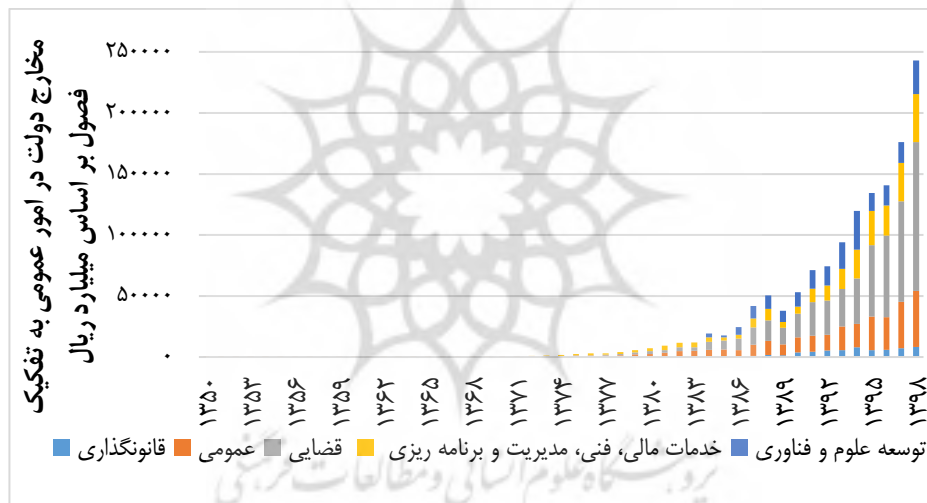
<sup>2</sup> Mohebbi (2008)

<sup>3</sup> Ahmadvand et al. (2020)

پرداخت حقوق کارمندان دولت و غیره. در فصل توسعه علوم، شامل: ارائه خدمات آموزشی و پژوهشی به شهرداری‌ها و دهیاری‌ها، حمایت از توسعه فناوری‌های راهبردی، مشاوره پژوهشی در حوزه نظام اداری، شناسایی و حمایت از طرح‌ها، ارائه خدمات شبکه ملی آزمایشگاهی و غیره<sup>۱</sup>.

مخارج دولت در فصول مربوط به امور عمومی در نمودار (۱) نشان می‌دهد، بیشترین بودجه دولت در این امور به ترتیب به فصول توسعه علوم و فناوری، خدمات مالی، فنی، مدیریت و برنامه‌ریزی، قضایی، عمومی و قانون گذاری اختصاص یافته است. کلیه مخارج دولت در فصول نام برده در طی دوره زمانی پژوهش به طور کلی روند افزایشی داشته‌اند. لازم به ذکر است تنها در سال ۱۳۸۸ کلیه مخارج دچار کاهش شدید شده‌اند.

نمودار(۱): مخارج اسمی دولت به تفکیک فصول (امور عمومی)



منبع: وزارت امور اقتصاد و دارایی

بسیاری از اقتصاددانان در بحث مربوط به سیاست‌های مالی دولت و نحوه تخصیص مخارج دولت به نقش ادوار تجاری در اثرگذاری سیاست‌های مالی نگاهی ویژه داشته‌اند. عدم تقارن مخارج دولت و میزان آن متاثر از نوع مخارج دولت و قرار گرفتن سیاست اعمال شده در دوره‌های رکود یا رونق است. در این زمینه، رافیک و زئوفاک<sup>۲</sup> (۲۰۱۲) بیان می‌کنند میزان اثر گذاری مخارج دولت بستگی به نوع مخارج دولت دارد. برای

<sup>۱</sup> برگرفته از سامانه مدیریت خدمات دولت: [www.Khadamat.mardom.ir](http://www.Khadamat.mardom.ir)

<sup>۲</sup> Rafiq & Zeufack

مثال آن‌ها عنوان می‌کنند در طول دوران رکود مخارج سرمایه‌گذاری دولت اثرگذاری بیشتری نسبت به مخارج مصرفی دولت دارد. بنابراین، با علم به اینکه دوره‌های رکود و رونق نقش موثری در اثرگذاری سیاست‌های دولت بر متغیرهای کلان اقتصادی دارند، بر اساس مطالعات احمدوند و همکاران (۱۳۹۹) می‌توان یکی از علل روند نزولی بودن شاخص رفاه اجتماعی آمارتیا سن<sup>۱</sup> در ایران را به خصوص در سال‌های اخیر ناشی از وجود دوره‌های رکود و رونق یا به عبارت دیگر نوسانات اقتصادی بالا دانست.

با توجه به عدم پژوهش لازم در زمینه اثرات غیرخطی مخارج دولت در امور عمومی و زیر فصول مربوطه بر رفاه اجتماعی در طی ادوار تجاری ایران، این هدف، موضوع پژوهش حاضر قرار گرفته است. به کارگیری مدل خود رگرسیون غیر خطی با وقفه‌های توزیعی (NARDL) برای بررسی اثرگذاری مخارج دولت در طی ادوار تجاری برای امور عمومی و فصول مربوط به آن از جنبه‌های نوآوری پژوهش حاضر است. بر این اساس، پژوهش به پنج بخش تنظیم شده است. در بخش اول پس از بیان مقدمه، مبانی نظری در ارتباط با دخالت دولت و نقش آن در کاهش فقر و افزایش رفاه اجتماعی مورد بحث قرار گرفته است. در بخش سوم به پیشینه پژوهش پرداخته شده و در بخش چهارم، الگوی اقتصادسنجی و یافته‌ها ارائه شده است. در نهایت بخش پایانی، به بحث و پیشنهادات اختصاص داده شده است.

## ۲- ادبیات موضوع

بحث میان مکاتب مختلف اقتصادی پیرامون چگونگی تخصیص مخارج دولت در امور عمومی از دیرباز وجود داشته است. اختلاف نظرهای موجود در این ارتباط به طور عمده ناشی از تفاوت در مفروضاتی است که هر نظریه بر آن استوار است. برای مثال در مکتب فیلسوفان باستان و قرون وسطا دولت برقرار کننده عدالت در جامعه، تقبیح کننده رباخواری، فعالیت‌های سوداگرانه و محدود کننده مالکیت ارضی است. در مکتب مرکانتالیست‌ها دولت وظیفه تولید کالای عمومی و برقراری امنیت را بر عهده دارد. در مکتب فیزیوکرات‌ها دولت متضمن مقررات نظام طبیعت و امور مربوط به امنیت و عدالت است. در دولت کلاسیکی دولت سه وظیفه مهم در این حوزه را بر عهده دارد: اول؛ ایجاد امنیت داخلی خارجی، دوم؛ برقراری عدالت از طریق ایجاد نهادهای قانون-

<sup>۱</sup> Amartya Sen Social Welfare Index

گذاری و نظارتی و تصویب قوانینی از قبیل کار، مالکیت و غیره، سوم؛ عرضه کالاهای عمومی. در مکتب سوسیالیسم وظایف عمده برنامه ریزی، اجرا و نظارت در سازمان‌های متفاوت تولیدی و خدماتی اقتصادی و اجتماعی به عهده دولت بوده و در این شرایط دولت بیشترین حضور را در فعالیت‌های اقتصادی در همه جنبه‌ها دارد. در مکاتب نئوکلاسیکی دخالت دولت در موارد شکست بازار، در دولت کینزی برای ایجاد ثبات اقتصادی و جلوگیری از بیکاری و رکود، در دولت رفاه شامل حداقل زندگی برای تمام مردم در حد معشیت شرافتمندانه و در نهایت در نظریه انتخاب عمومی حفاظت از حقوق مالکیت است. بنابراین، اهمیت امور عمومی در کلیه مکاتب اقتصادی تحت عناوینی همچون؛ عرضه کالا و خدمات عمومی، وجود نهادهای قانون‌گذاری و وجود مقررات برای حفظ حقوق مالکیت مورد توجه قرار گرفته است (امیری و همکاران<sup>۱</sup>، ۱۳۹۱). همچنین، مطالعات متعدد در زمینه اثرگذاری مخارج دولت بر رشد و توسعه اقتصادی نشان می‌دهند، پیشرفت و رفاه شهروندان تنها از کانال محرک‌های اقتصادی صورت نمی‌گیرد بلکه محرک‌های نهادی از کانال دستگاه قضا، حاکمیت قانون و نظم، و خدمات مالی و عمومی در این میان نقش اساسی بازی می‌کنند. در این زمینه عاصم اوغلو و رابینسون<sup>۲</sup> (۲۰۰۵) بیان می‌کنند کشورها با یکدیگر متفاوت بوده زیرا بر اساس نهادهای تشکیل دهنده هر کشور قوانین موثر بر عملکردهای اقتصادی متفاوت هستند. آنان بیان می‌کنند وجود نهادهای اقتصادی متفاوت در هر کشور که نشأت گرفته از نهادهای سیاسی هر کشور بوده بر توزیع منابع اثر گذار است. به طوری که، اگر قدرت سیاسی در دست یک دستگاه یا فرد خاص قرار بگیرد ایجاد نهادهای اقتصادی که از طریق آن بتوان به تضمین حقوق مالکیت و ایجاد فرصت‌های برابر برای آحاد جامعه پرداخت کار سختی خواهد بود (عاصم اوغلو و رابینسون، ۲۰۰۵). بنابراین، هر چقدر مخارج دولت در امور عمومی که متشکل از نهادهای سیاسی و نظام اداری - قضایی کشور است با تدبیر و برنامه‌ریزی دقیق‌تر صورت بپذیرد بالتبع نتایج بهتری در توزیع منابع در سطح جامعه برای کاهش فقر و افزایش رفاه اجتماعی دارد.

دیدگاه‌های موجود در زمینه اثرگذاری مخارج عمومی دولت بر رفاه اجتماعی همچون سایر مخارج دولت به دو دیدگاه اصلی تقسیم می‌شود. دیدگاه‌ها اول مربوط به

<sup>1</sup> Amiri et al. (2012)

<sup>2</sup> Acemoğlu et al.

اقتصاددانانی است که نظریات خود را بر مبنای رابطه خطی بین مخارج دولت و رفاه اجتماعی بنا کرده‌اند (کالدور<sup>۱</sup>، ۱۹۶۶؛ کورمندی و مگوئر<sup>۲</sup>، ۱۹۸۶؛ فورته و مگزینو<sup>۳</sup>، ۲۰۱۱). دیدگاه دوم مربوط به آن دسته از اقتصاددانانی است که رابطه بین مخارج دولت و رفاه اجتماعی را بر اساس منحنی آرمی<sup>۴</sup> U شکل غیر خطی در نظر گرفته‌اند (دیویس<sup>۵</sup>، ۲۰۰۹؛ مونه، امبسیا و منیسا<sup>۶</sup>، ۲۰۱۵؛ فارنیر و جوهانسون<sup>۷</sup>، ۲۰۱۶). آرمی<sup>۸</sup> (۱۹۹۵) در این زمینه اشاره می‌کند، افزایش مخارج دولت تا حدی موجب افزایش تولید شده ولی پس از آن افزایش مخارج دولت به اقتصاد کمکی نکرده زیرا با شروع قانون بازده نزولی اقتصاد دچار رکود و افول می‌شود. وی بیان می‌کند، در نبود دولت هیچ قانونی حکم فرما نیست. بدون حمایت از حقوق مالکیت افراد قدرتمند می‌توانند دارایی‌های کشور را بدزدند و افراد ضعیف انگیزه کمی برای پس‌انداز و سرمایه‌گذاری خواهند داشت (ودر و گالوی<sup>۹</sup>، ۱۹۹۸). شیهی<sup>۱۰</sup> (۱۹۹۳) در توجیه رابطه بین اندازه دولت و رفاه اجتماعی بیان می‌نماید که دولت با اندازه کوچک در تأمین کالاهای عمومی، تأمین اجتماعی افراد جامعه، دفاع از مالکیت‌های معنوی و غیره موفق‌تر است و همزمان با افزایش اندازه دولت، افزایش نرخ مالیات‌ها منجر به خروج سرمایه، کاهش رشد و رفاه اقتصادی می‌شود (محمود زاده، صادقی و صادقی<sup>۱۱</sup>، ۱۳۹۰).

در این میان ادوار تجاری به عنوان یکی از مشخصه‌های اقتصادی کشورهای در حال توسعه به عنوان یکی از عوامل وجود رابطه غیرخطی بین مخارج دولت و رفاه اجتماعی شناخته شده و نقش مهمی در برنامه‌ریزی‌های دولت بازی می‌کنند. وجود نوسانات اقتصادی، دولت‌ها را به اعمال سیاست‌های ضد ادواری جهت ایجاد ثبات و در پی آن افزایش رفاه اجتماعی سوق می‌دهد. اما سوالی که در اینجا مطرح می‌شود این است که

<sup>1</sup> Kaldor

<sup>2</sup> Kormendi & Meguire

<sup>3</sup> Forte & Magazzino

<sup>4</sup> Armeiy Curve

<sup>5</sup> Davies

<sup>6</sup> Munene et al.

<sup>7</sup> Fournier & Johansson

<sup>8</sup> Armeiy

<sup>9</sup> Vedder & Gallaway

<sup>10</sup> Sheehy

<sup>11</sup> Mahmoudzadeh et al. (2011)

در همه کشورها سیاست‌های ضد ادواری قابل اعمال می‌باشد یا خیر. مطالعات نشان می‌دهند مخارج دولت در طی ادواری تجاری در کشورهای مختلف دارای اثرگذاری متفاوتی بر متغیرهای حقیقی اقتصاد از جمله رشد و رفاه اجتماعی بوده‌اند. برای مثال در مطالعات تجربی باووم و کوستر<sup>۱</sup> (۲۰۱۱)، بوسویلین و دوفرنوت<sup>۲</sup> (۲۰۱۱)، فورکری و زدیزنیکا<sup>۳</sup> (۲۰۱۰)، گلا اید و اواد<sup>۴</sup> (۲۰۱۷) به اثرات متفاوت و نامتقارن مخارج دولت در طی دوره‌های رکود و رونق اقتصادی اشاره شده است. به طوری که در این مطالعات شاهد رفتار موافق ادواری و ضد ادواری مخارج دولت در دوره‌های رکود و رونق هستیم. بنابراین، همواره امکان اجرای سیاست‌های مالی ضد ادواری برای کاهش نوسانات امکان پذیر نیست. گاوین و پروتی<sup>۵</sup> (۱۹۹۷) از دلایل موافق ادواری بودن سیاست‌های مالی را وجود محدودیت در استقراض هنگام مواجه شدن با رکود اقتصادی، ناتوانی دولت و کاهش مخارج دولت در دوره‌های رکود مطرح می‌کند. همچنین، با توجه به رتبه ۱۴۶ ایران در فساد اداری و اقتصادی بر اساس گزارش شفافیت بین الملل<sup>۶</sup> در سال ۲۰۲۰، وجود فساد اقتصادی و سیاسی باعث کاهش اثر بخشی مخارج دولت در امر بهبود رفاه افراد می‌شود. وابستگی به درآمدهای نفتی که تحت تاثیر قیمت‌های جهانی ناپایدار بوده برای تأمین هزینه‌های دولت (هزینه‌های جاری و سرمایه‌ای) موجب بی ثباتی‌های اقتصادی و در نتیجه آسیب پذیری اقتصاد در برابر ادوار تجاری شود. که این امر دولت‌ها را مجبور به انتشار اوراق قرضه و وام گرفتن برای پوشش کسری بودجه خود در دوره‌های رکود اقتصادی می‌کند. این استقراض‌ها فشارهایی را بر نقدینگی داخلی ایجاد می‌کند که بر رشد تولید ناخالص داخلی خصوصی و رفاه اجتماعی تأثیر منفی می‌گذارد. بنابراین، نوسانات درآمدهای نفتی از جمله عوامل موثر در اثر بخشی سیاست‌های مالی دولت محسوب می‌شود (جوهرجی و استار<sup>۷</sup>، ۲۰۱۱).

<sup>1</sup> Baum & Koester

<sup>2</sup> Bouthevillain & Dufrénot

<sup>3</sup> Furceri & Zdzienicka

<sup>4</sup> Galal Eid & Awad

<sup>5</sup> Gavin & Perotti

<sup>6</sup> Transparency International

<sup>7</sup> Joharji & Starr



علاوه بر این، موضوع عدم تقارن در میزان اثرگذاری سیاست‌های مالی در طی چرخه‌های تجاری به فرضیه راتچد بیر (۱۹۷۱) برمی‌گردد (انیسان اکینلو و اولایمی جمیلوی<sup>۱</sup>، ۲۰۱۸). بلانچارد<sup>۲</sup> (۱۹۹۰)، ساترلند<sup>۳</sup> (۱۹۹۵) نیز علت عدم تقارن را ناشی از سطح بدهی عمومی می‌دانند (کوار و همکاران<sup>۴</sup>، ۲۰۱۳). پروتی<sup>۵</sup> (۱۹۹۹، ۲۰۰۴) با اشاره به متفاوت بودن مخارج دولت در مراحل چرخه‌های اقتصادی، افزایش محدودیت‌های نقدینگی و انقباض مصرف خصوصی جمعی به دلیل انگیزه‌های ریکاردویی در زمان رکود اقتصادی را عاملی برای بزرگ‌تر بودن و منفی بودن تأثیر شوک مخارج دولت در دوران رکود به شمار می‌آورد.

بنابراین، با توجه به متفاوت بودن اثرگذاری مخارج دولت در طی ادوار تجاری، شکل‌گیری صحیح سیاست‌های مالی در حوزه امور عمومی و فصول مربوط به آن در کاهش نوسانات اقتصادی و افزایش رفاه اجتماعی حائز اهمیت است.

افزون بر اهمیت مخارج عمومی دولت بر رفاه اجتماعی، باید به شناخت سایر عوامل تاثیر گذار بر رفاه اجتماعی نیز پرداخت. نرخ تورم به عنوان یکی از اصلی‌ترین فاکتورهای اثرگذار بر رفاه اجتماعی بوده به طوری که تورم کم می‌تواند اثر برابرگر در توزیع درآمد و افزایش رفاه اجتماعی داشته باشد. در مقابل نرخ‌های تورم بالا، اثر نابرابرگر در توزیع درآمد و در نتیجه کاهش رفاه اجتماعی داشته باشد (بایلر، ۲۰۰۱). مونین<sup>۶</sup> (۲۰۱۴) اشاره دارد نرخ تورم پایین با ایجاد انگیزه برای سرمایه‌گذاری موجب افزایش فعالیت‌های اقتصادی و افزایش رفاه اجتماعی می‌شود. این در حالی است که تورم زیاد موجب شده دهک‌های بالای درآمدی از طریق دسترسی به رانت‌های اطلاعاتی قبل از افزایش شدید قیمت‌ها، سرمایه‌گذاری‌های خود را به نحوی تغییر دهند تا از تورم، بهره‌مند شوند. در نتیجه، با تغییر در قیمت‌های نسبی و ایجاد نا اطمینانی ثروت در جامعه به نفع ثروتمندان و به زیان گروه‌های فقیر انباشته می‌شود. کی نایت و سبوت<sup>۷</sup>

<sup>1</sup> Enisan Akinlo & Olayemi Jemiluyi

<sup>2</sup> Blanchard

<sup>3</sup> Sutherland

<sup>4</sup> Kaur et al.

<sup>5</sup> Perotti

<sup>6</sup> Monnin

<sup>7</sup> Knight & Sabot

(۱۹۸۳) اثر آموزش بر توزیع درآمد و در نتیجه رفاه اجتماعی را شامل دو اثر ترکیبی<sup>۱</sup> و اثر فشار دستمزد<sup>۲</sup> می‌دانند. اثر ترکیبی اشاره بر این دارد که در ابتدا اگر تمام نیروی-کار از تحصیلات یکسانی برخوردار باشند، افزایش آموزش موجب افزایش دستمزد در این دسته از افراد شده که این امر موجب اثرات نامطلوب بر توزیع درآمد و رفاه اجتماعی می‌شود. البته ادامه روند افزایش آموزش در افراد در نهایت سبب اثرات مطلوب خواهد شد. از سوی دیگر، بر مبنای اثر فشار دستمزد اگر هم‌زمان با افزایش نسبی در عرضه نیروی کار آموزش دیده در مقایسه با نیروی کار تحصیل نکرده، پاداش آموزش کاهش یابد، درآمدها به طور مطلوب‌تر توزیع شده و در نتیجه رفاه اجتماعی افزایش می‌یابد. بنابراین، تاثیر نرخ باسوادی بر رفاه اجتماعی بستگی به اثرات مذکور دارد.

تاثیر مثبت متغیر شاخص باز بودن اقتصاد ناشی از پیامدهای مثبت افزایش این شاخص شامل افزایش کارایی عوامل تولید، ارتقای سرمایه گذاری در نیروی انسانی و سرمایه فیزیکی، رشد تولید در بخش‌هایی که از مزیت نسبی برخوردارند، شفاف شدن ارتباط میان کارگر و کارفرما، رقابتی شدن بازار کار و حذف انحراف قیمت عوامل تولید از جمله کار و سرمایه در اقتصاد است (امینی و مرادزاده<sup>۳</sup>، ۱۳۹۴). افزایش نرخ شهرنشینی و پیامدهای مطلوب آن برای مهاجرین بر اساس مطالعه زمانی شبخانه و مهرگان<sup>۴</sup> (۱۳۹۲) به وجود صنایع مختلف در نقاط شهری به خصوص صنایع کاربر برگشته که به عنوان عاملی برای جذب نیروی کار بوده و با توجه به بیشتر بودن دستمزد در نقاط شهری این خود عاملی جهت مهاجرت روستائیان برای افزایش درآمد به نقاط شهری است. همچنین، جاذبه‌های بیشتر شهر برای روستائیان از جمله فرصت‌های شغلی بهتر، وجود مراکز تفریحی، فعالیت‌های فرهنگی، دسترسی به سیستم حمل و نقل، بازارهای مختلف، بستر مناسب برای رشد خلاقیت‌های فردی و اجتماعی، شرایط خوب محیط کار و زندگی همانند مسکن و خدمات رفاهی و فرصت‌های کسب آموزش‌های حرفه‌ای از سایر عوامل مهاجرت به شهرها و تاثیرات مطلوب آن بر رفاه افراد محسوب می‌شود (شمس‌الدینی و گرجیان<sup>۵</sup>، ۱۳۹۰).

<sup>1</sup> Composition effect

<sup>2</sup> Wage Compression Effect

<sup>3</sup> Amini & Moradzadeh (2015)

<sup>4</sup> Zamani Shabkhaneh & Mehregan (2014)

<sup>5</sup> ShamsAldini & Gorjian (2010)

جوینی<sup>۱</sup> (۲۰۱۸) با استفاده از روش مارکوف سوئیچینگ (MSAR) در طی دوره زمانی ۱۹۶۹-۲۰۱۵ نشان داد، مخارج دولت دارای تاثیر مثبت و نامتقارن بر روی تولید ناخالص داخلی در طی دوره‌های رکود و رونق بوده است. برای سرمایه‌گذاری نیز واکنش‌ها نسبت به شوک افزایش مخارج دولت نسبت به رژیم رکود مثبت بوده است. با این حال، شواهدی از تأثیر منفی مخارج دولت بر سرمایه‌گذاری در رژیم رونق وجود دارد. همچنین، واکنش مصرف به شوک سیاست مالی در هر دو رژیم منفی و قابل توجه است. اثر شوک‌های مالی بر تمام متغیرهای فوق‌الذکر در دوره‌های رکود بیشتر از دوره‌های رونق است. شواهد همچنین رویکرد کینزی را در اقتصاد عربستان نشان می‌دهد. پراگیدیس، تسینتزوس و پلاکندراس<sup>۲</sup> (۲۰۱۸) با بکارگیری روش خود رگرسیون برداری آستانه (TVAR) با استفاده از داده‌های فصلی کشور آمریکا طی دوره زمانی ۲۰۱۴-۱۹۷۳ نشان دادند، شوک مثبت مخارج دولت در طی دوره‌های رکود بیشتر از دوره‌های رونق است.

بوسویلین و دوفرنوت (۲۰۱۱) با استفاده از روش تغییر یافته مارکوف سوئیچینگ (TVPMs) در طی دوره زمانی ۲۰۰۹-۱۹۷۰ اثرات مخارج دولت در دو رژیم که رکود متوسط (دوره‌های عادی) و حالتی که بحران به صورت شدید است (رکود بزرگ) را بر تولید ناخالص داخلی در فرانسه بررسی می‌کنند. نتایج نشان دادند، اثر مخارج دولت در زمان بحران و حالت عادی مثبت بوده ولی این اثرگذاری در دوران رکود بزرگ قابل توجه است. در حالی که در دوران عادی این اثرگذاری ناچیز است که نشان از عدم تقارن سیاست‌های مالی دارد. ضرایب اثرگذاری در بلند مدت با هم یکسان هستند. ماهیت سیاست‌های مالی در دو رژیم کینزی است.

ویانا و مولیک<sup>۳</sup> (۲۰۱۸) در طی دوره زمانی ۲۰۱۵-۱۹۹۶ برای کشورهای آمریکای لاتین نشان می‌دهند عدم توسعه کشورهای لاتین ناشی از نبود بسترهای مناسب در زمینه قانون بوده و نحوه تخصیص مخارج عمومی و پاسخ‌گویی مالی، نقش قابل توجهی در اثرگذاری سیاست‌های مالی دارد.

<sup>1</sup> Jouini

<sup>2</sup> Pragidis et al.

<sup>3</sup> Vianna & Mollick

اورباج و قورو دنیجنکو (۲۰۱۲) با بهره‌گیری از روش خود رگرسیون برداری انتقال ملایم (STAR) و با استفاده از داده‌های فصلی در طی دوره زمانی ۲۰۰۸-۱۹۴۷ در آمریکا نشان دادند ضریب فزاینده سیاست مالی در دوره‌های رکود بزرگتر از دوره رونق است. مقدار این ضریب در دوران رونق نزدیک به صفر و با وارد شدن به دوران رکود افزایش می‌یابد.

فشاری<sup>۱</sup> (۱۳۹۶) با استفاده از روش مارکوف سوئیچینگ در طی دوره زمانی ۱۳۹۴-۱۳۶۹ در ایران نشان دادند، رابطه بین شوک‌های مثبت و منفی مخارج دولت و رشد اقتصادی در ایران غیرخطی است و شوک مثبت مخارج دولت در دوره‌های رکود تأثیر منفی و در دوره‌های رونق اثر مثبتی بر رشد اقتصادی ایران دارد. همچنین شوک منفی در دوره‌های رکود تأثیر مثبت و در دوره‌های رونق اثر منفی بر رشد اقتصادی در دوره زمانی مورد بررسی دارد. بنابراین، مخارج دولت در اقتصاد ایران ماهیت ادواری دارد. قاسمی و مهاجری<sup>۲</sup> (۱۳۹۴) با استفاده از فیلتر هودریک پرسکات<sup>۳</sup> (HP) و به کارگیری مدل فضا-حالت در طی دوره زمانی ۱۳۹۱-۱۳۴۵ نشان دادند فرضیه ضد ادواری بودن سیاست‌های مالی در ایران رد می‌شود.

بختیاری، مویدفر و سرخوش‌سرا<sup>۴</sup> (۱۳۹۳) با استفاده از رهیافت داده‌های تابلویی در طی دوره زمانی ۲۰۱۰-۱۹۹۶ نشان دادند در امور عمومی مخارج موزون دولت برای کشورهای در حال توسعه و توسعه یافته مثبت بوده اما این ضریب در کشورهای توسعه یافته بی معنا می‌باشد. وزن فصل خدمات عمومی با اثرگذاری منفی کمتر از فصل نظم و امنیت عمومی با اثرگذاری مثبت بر توسعه و رفاه کشورهای توسعه یافته بوده است. در کشورهای در حال توسعه نیز هر دو فصل دارای اثرگذاری مثبت بوده و این اثرگذاری در فصل خدمات عمومی بیشتر است.

حسینی و همکاران<sup>۵</sup> (۱۳۸۷) با استفاده از روش سیستم معادلات همزمان در قالب مدل رشد بارو در طی دوره زمانی ۱۳۸۳-۱۳۵۷ به بررسی اثرگذاری انواع مخارج دولت به تفکیک امور اقتصادی، اجتماعی و فرهنگی، عمومی، دفاعی و امنیتی بر رشد اقتصادی

<sup>1</sup> Feshari (2017)

<sup>2</sup> Ghasemi & Mohajeri (2015)

<sup>3</sup> Hodrick-Prescott

<sup>4</sup> Bakhtiari et al.. (2014)

<sup>5</sup> Hosseini et al. (2008)

پرداخته‌اند. در امور عمومی فصول مربوط به حفظ امنیت داخلی کشور، اداره امور نیروی کار، آمار و خدمات عمومی و فنی، اجرای سیاست داخلی کشور، ساختمان‌ها و تاسیسات دولتی، اداره روابط خارجی، اطلاعات و ارتباطات جمعی، تنظیم روابط قوای سه گانه به ترتیب دارای تاثیر مثبت و معنادار بر روی رشد اقتصادی بوده‌اند. فصول اداره عمومی کشور، اداره امور مالی، قانون‌گذاری، امور قضایی، ثبتي و موقوفات به ترتیب دارای تاثیر منفي و معنادار بر رشد اقتصادی بوده‌اند. همچنین، نتایج نشان دادند پس از امور دفاعی بیشترین اثرگذاری مخارج دولت بر روی رشد در امور عمومی بوده است.

پژوهش‌های صورت گرفته در زمینه اثرگذاری مخارج دولت در امور عمومی و زیر فصول مربوطه تنها بخش‌هایی از هدف پژوهش حاضر را در بر دارند. برای مثال، مطالعات بختیاری، مویدفر و سرخوش‌سرا (۱۳۹۴)، حسینی و همکاران (۱۳۸۷) که به طور اخص به بررسی برخی از فصول امور عمومی پرداخته‌اند از روش‌های خطی بهره‌جسته‌اند و یا متغیر وابسته در این پژوهش‌ها بیشتر معطوف بر رشد اقتصادی بوده است. در سایر پژوهش‌ها همچون جوینی (۲۰۱۸)، پراقیدیس، تسینتروس و پلاکندراس (۲۰۱۸)، بوسوبیلین و دوفرنوت (۲۰۱۱)، اورباچ و قورو دنیچنکو (۲۰۱۲)، فشاری (۱۳۹۶)، قاسمی و مهاجری (۱۳۹۴) که از روش‌های غیر خطی بهره‌گرفته‌اند، هیچ کدام به طور اخص بر روی امور عمومی و زیر فصول مربوط به آن تمرکز نکرده‌اند. به طور کلی، در هیچ یک از پژوهش‌ها به طور توأم به نقش ادوار تجاری در اثرگذاری غیرخطی مخارج دولت در امور عمومی و زیر فصول مربوط به آن بر رفاه اجتماعی تمرکز نکرده‌اند. در نهایت، برجسته‌ترین نوآوری پژوهش حاضر آن بوده که در کار شین و همکاران (۲۰۱۴) فرض بر آن بوده که متغیر یا متغیرهای آستانه‌ای که به دو نیم تقسیم شده در طی دوره‌های رکود و رونق دارای اثرات ثابتی هستند. در حالی که، یکی از بارزترین ویژگی‌های اقتصادهای در حال توسعه وجود نوسانات اقتصادی یا به عبارت دیگر دوره‌های رکود و رونق در بطن اقتصاد است. با توجه به اینکه بسیاری از مطالعات این عامل مهم را در اثرگذاری سیاست‌های دولت در نظر نمی‌گیرند؛ پژوهش حاضر یک قدم فراتر رفته و اثرات شوک-های مثبت و منفي مخارج دولت را در طی دوره‌های رکود و رونق به شکلی متفاوت فرض کرده و به بررسی آن می‌پردازد. از این رو، پژوهش حاضر از جنبه‌های مختلف دارای نوآوری است.

## ۳- طراحی الگوی مدل

## ۳-۱- ارائه و توصیف مدل

بر اساس مبانی نظری و مطالعات تجربی ارائه شده از هالیه و نینو زرزوا<sup>۱</sup> (۲۰۱۸) و خانزادی، فتاحی و مرادی<sup>۲</sup> (۱۳۹۴) در زمینه متغیر رفاه اجتماعی متغیرهای کنترلی مدل‌ها انتخاب شده است. بنابراین، از مدل‌های زیر برای برآورد اثرات مخارج دولت در امور عمومی و زیر فصول مربوط به آن بر رفاه اجتماعی در طی ادوار تجاری استفاده شده است.

$$\begin{aligned} \text{Log}(W) = & \alpha + \beta_0 \text{WL} + \beta_1 \text{Log}(\text{Other\_EXP}) + \beta_2 \text{Log}(\text{In}_t) + \\ & \beta_3 \text{Log}(\text{Urban}_t) + \beta_4 \text{Log}(\text{Open}_t) + \beta_5 \text{Log}(\text{Literacy}_t) + \beta_6 \text{Subsidy}_t + \\ & \beta_7 (\text{Shock}_{\text{POS}} * \text{RECESION})_t + \beta_8 (\text{Shock}_{\text{POS}} * \text{BOOM})_t + \beta_9 (\text{Shock}_{\text{NEG}} * \\ & \text{RECESION})_t + \beta_{10} (\text{Shock}_{\text{NEG}} * \text{BOOM})_t + u_t \end{aligned} \quad (1)$$

در روابط بالا،  $\text{Log}(W)$ : لگاریتم شاخص رفاه اجتماعی آمارتیا سن یوده که از رابطه  $W = \mu(1 - G)$  حاصل شده است. در این رابطه  $\mu$ : میانگین هزینه‌های خانوارهای شهری به شاخص قیمت مصرف کننده به قیمت ثابت ۱۳۹۵ بوده و  $G$ : مقادیر ضریب جینی است.  $\text{WL}$ : وقفه اول رفاه اجتماعی است.  $\text{Log}(\text{Urban})$ : لگاریتم نسبت شهرنشینی بوده که از نسبت جمعیت ساکن در مراکز شهری یک کشور یا منطقه در یک مقطع زمانی معین به کل جمعیت همان کشور یا منطقه در همان مقطع زمانی حاصل می‌شود.  $\text{Log}(\text{Literacy}_t)$ : لگاریتم نرخ با سواد بودن بوده که به شکل درصدی از جمعیت ۱۵ تا ۲۴ سال که قادر به درک، خواندن و نوشتن هستند تعریف می‌شود.  $\text{Log}(\text{In})$ : لگاریتم شاخص قیمت مصرف کننده به قیمت ثابت ۱۳۹۵ است.  $\text{Log}(\text{Open})$ : لگاریتم شاخص درجه باز بودن اقتصاد بوده که بر اساس نسبت مجموع صادرات و واردات به تولید ناخالص داخلی محاسبه می‌شود.  $\text{Log}(\text{Other\_EXP})$ : لگاریتم مخارج دولت در سایر امور و فصول به جزء امور و فصول مورد برآورد بوده که از تفاوت کل مخارج دولت با امور یا فصول مورد بررسی حاصل می‌شود. (Subsidy)، متغیر مجازی هدفمندسازی یارانه‌ها بوده که مقدار این متغیر از سال ۱۳۸۹ به بعد برابر یک و در سایر سال‌ها، صفر است.

<sup>1</sup> Haile & Nino-Zarazua

<sup>2</sup> Khanzadi et al. (2014)

$X_t^+ \times Recesion; Shock_{POS} * Recesion$ : اثر شوک‌های مثبت لگاریتم مخارج دولت در امور و فصول مورد بررسی در دوره‌های رکود بوده که از حاصل ضرب اثر تجمعی تغییرات ( $\Delta$ ) مثبت مخارج دولت در امور عمومی و زیر فصول مربوطه در هر سال نسبت به سال قبل در متغیر مجازی دوره‌های رکود با مقدار یک بدست آمده و برای دوره‌های رونق برابر با صفر است.

$X_t^+ \times Boom; Shock_{POS} * Boom$ : اثر شوک‌های مثبت لگاریتم مخارج دولت در امور و فصول مورد بررسی در دوره‌های رونق بوده که از حاصل ضرب اثر تجمعی تغییرات ( $\Delta$ ) مثبت مخارج دولت در امور عمومی و زیر فصول مربوطه در هر سال نسبت به سال قبل در متغیر مجازی دوره‌های رونق با مقدار یک بدست آمده و برای دوره‌های رکود برابر با صفر است.

$X_t^- \times Recesion; Shock_{Neg} * Recesion$ : اثر شوک‌های منفی لگاریتم مخارج دولت در امور و فصول مورد بررسی در دوره‌های رکود بوده که از حاصل ضرب اثر تجمعی تغییرات ( $\Delta$ ) منفی مخارج دولت در امور عمومی و زیر فصول مربوطه در هر سال نسبت به سال قبل در متغیر مجازی دوره‌های رکود با مقدار یک بدست آمده و برای دوره‌های رونق برابر با صفر است.

$X_t^- \times Boom; Shock_{Neg} * Boom$ : اثر شوک‌های منفی لگاریتم مخارج دولت در امور و فصول مورد بررسی در دوره‌های رونق بوده که از حاصل ضرب اثر تجمعی تغییرات ( $\Delta$ ) منفی مخارج دولت در امور عمومی و زیر فصول مربوطه در هر سال نسبت به سال قبل در متغیر مجازی دوره‌های رونق با مقدار یک بدست آمده و برای دوره‌های رکود برابر با صفر است.

لازم به ذکر است، دوره‌های رکود و رونق به ترتیب شکاف تولید منفی و مثبت بوده که از روش فیلتر هودریک پرسکات،  $HPGDP_t = GDP_t - SEGD_t$  محاسبه شده که در این رابطه  $SEGD_t$ : انحراف از روند طبیعی (شکاف تولید)؛  $GDP$ : مقدار واقعی تولید ناخالص داخلی؛  $HPGDP$ : نوسانات یا فیلتر تولید ناخالص داخلی است.

به منظور برآورد اثرات مخارج دولت بر رفاه اجتماعی داده‌های پژوهش برای محاسبه متغیر رفاه اجتماعی از پایگاه‌های مرکز آمار ایران و بانک مرکزی، متغیر نرخ باسوادی و نرخ شهرنشینی از بانک جهانی داده‌ها<sup>۱</sup>، متغیر شاخص درجه باز بودن اقتصاد از بانک مرکزی و متغیرهای مربوط به مخارج دولت از پایگاه داده‌های وزارت اقتصاد و امور دارایی گردآوری شده‌اند. همچنین، بر اساس اینکه تمام متغیرها به شکل لگاریتم در مدل‌ها لحاظ شده‌اند، واحد آن‌ها بر اساس درصد بیان خواهد شد.

### ۳-۲- چارچوب متدولوژی

در ابتدا جهت بررسی اثرات کوتاه‌مدت مخارج دولت در امور عمومی بر رفاه اجتماعی در طی ادوار تجاری به استخراج دوره‌های رکود و رونق اقتصادی براساس فیلتر هودریک-پرسکات پرداخته شده است.

براساس مطالعه کولی و پرسکات<sup>۲</sup> (۱۹۹۵) اگر یک سری زمانی مشاهده شده  $x_t$  را بتوان در قالب مجموع یک جزء نوسانی و یک جزء روند تشریح کرد و اگر  $a$  پارامتری باشد که بیان کننده واریانس نسبی جزء روند در مقابل نوسان باشد، در این صورت پارامتر مذکور بیانگر چگونگی کنترل همواری مسیر روند است. با معلوم شدن پارامتر  $a$  مسئله فیلتر هودریک-پرسکات عبارت است از حداقل کردن مجموع مجذورات  $T_t$ ، انحراف متغیر سری زمانی  $x_t$  از روند  $(T)$ . در واقع، مقادیر روند فیلتر هودریک پرسکات مقادیری هستند که رابطه زیر را حداقل می‌کند:

$$j = \sum_{t=1}^T (x_t - \tau_{x,t})^2 + a \sum_{t=2}^{T-1} [(\tau_{x,t} - \tau_{T-1})]^2 \quad (2)$$

که در آن،  $T$ ، تعداد مشاهدات،  $a$  پارامتر عامل موزون است که میزان هموار بودن روند را تعیین می‌کند. مقدار متعارف آن برای داده‌های سالانه برابر با ۱۰۰ و برای داده‌های فصلی ۱۶۰۰ می‌باشد. تأثیر این پارامتر در این است که از آمار سری زمانی دوره مورد بررسی، دوره‌هایی با فرکانس کمتر از ۸ سال را حذف می‌کند. این فیلتر دوطرفه بوده و از این رو مشکل تغییر فاز دوره را از بین می‌برد. مشکل این روش فیلتر، نامشخص بودن دقیق پارامتر  $a$  است که مقدار انحراف را با تغییر مواجه می‌سازد، به گونه‌ای که اگر پارامتر مذکور کاهش و یا افزایش یابد، در این صورت مقدار روند دائمی و موقت تغییر می‌کند.

<sup>۱</sup> WDI

<sup>۲</sup> Cooley & Prescott



در پژوهش حاضر براساس فیلتر هودریک- پرسکات اندازه روند تولید ناخالص داخلی با نفت را استخراج کرده و آن را HPGDP می‌نامیم. در ادامه نوسانات تولید ناخالص داخلی با نفت را نام گذاری نموده و سپس بر اساس آن دوره‌های رکود و رونق را استخراج می‌کنیم. اگر مقدار GDP از روند طبیعی خود بیشتر باشد، در این صورت رونق اقتصادی حاکم و در سال تولیدهایی که مقدار ناخالص داخلی حقیقی از روند طبیعی خود کمتر باشد، براساس تعریف در آن سال رکود اقتصادی وجود خواهد داشت. بدین ترتیب می‌توان از تفاوت مقدار فیلتر تولید ناخالص داخلی و مقدار واقعی آن، انحراف از روند طبیعی، SEGDP، را به شرح زیر بدست آورد:

$$\begin{aligned} \text{SEGDP}_t &= \text{GDP}_t - \text{HPGDP}_t \\ \text{BOOM}_t &= \text{Max}(0, \text{SEGDP}_t) \\ \text{REC}_t &= \text{Min}(\text{SEGDP}_t, 0) \end{aligned} \quad (3)$$

که در آن REC, Boom به ترتیب نشان دهنده مقدار انحراف تولید ناخالص داخلی با نفت از روند طبیعی آن در سال‌های رونق و رکود اقتصادی است. با معلوم شدن مقادیر انحراف از روند (شوک‌های موقت) می‌توان رکود و رونق را به صورت زیر معلوم کرد:

DUBOOM برای نشان دادن دوران رونق اقتصادی و DUREC نیز برای نشان دادن دوران رکود اقتصادی به کار گرفته می‌شوند. لذا براساس ادبیات اقتصادسنجی متغیرهای موهومی<sup>۱</sup> برای شرایط حقیقی اقتصاد دو حالت رکود و رونق در نظر گرفته می‌شود. حال اگر در الگوی اقتصادسنجی از متغیر موهومی DUBOOM استفاده شود، مقدار آن برای دوران رونق برابر با یک و در شرایط رکود صفر است، اما چنانچه از متغیر موهومی DUREC استفاده شود مقدار این متغیر برای سال‌های رکود یک و برای سال‌های رونق اقتصادی مقدار صفر است (رضایی پور و آقای آخوندابی<sup>۲</sup>، ۱۳۹۰).

پس از استخراج ادوار تجاری برای بررسی اثرات کوتاه‌مدت مخارج دولت در امور عمومی بر رفاه اجتماعی از الگوی خود رگسیون غیرخطی با وقفه‌های گسترده ارائه شده توسط شین، یو و گرین‌وود نیمو<sup>۳</sup> (۲۰۱۴) استفاده شده است. این الگو یکی از روش‌های هم-انباشتگی نامتقارن تلقی می‌شود. در پژوهش‌های اخیر روش هم انباشتگی نامتقارن در مدل خود رگسیون با وقفه‌های توزیعی به گونه‌ای گسترش یافته که در آن مجموعه

<sup>1</sup> Dummy Variables

<sup>2</sup> Rezaei-pour & Aghaei Akhondabi (2011)

<sup>3</sup> Shin et al.

مولفه‌های مثبت و منفی متغیرها کمک می‌کند تا تاثیرات نامتقارن متغیرهای توضیحی در کوتاه‌مدت و بلندمدت شناسایی شوند. در واقع خصوصیات روش خود رگسیون غیرخطی با وقفه‌های گسترده این اجازه را به ما می‌دهد تا تحلیل مشترکی از مسائل مربوط به نامانایی و غیر خطی بودن در مدل تصحیح خطای نامقید<sup>۱</sup> داشته باشیم. در حقیقت روش خود رگسیون غیرخطی با وقفه‌های گسترده نیز همانند روش خطی آن، نسبت به سایر روش‌های آزمون هم انباشتگی مزیت‌هایی دارد. اول اینکه، می‌توان این آزمون را صرف نظر از این که متغیرهای مدل  $I(0)$  یا  $I(1)$  یا به صورت متقابل هم انباشته باشند، به کار برد. دوم این که، این روش پویایی‌های کوتاه مدت را در بخش تصحیح خطا وارد نمی‌کند (بنرجی و همکاران<sup>۲</sup>، ۱۹۹۳). سوم این که، این روش را می‌توان با تعداد مشاهدات اندک نیز به کار برد (نارایان و نارایان<sup>۳</sup>، ۲۰۰۴). در نهایت، چهارمین مزیت این است که، استفاده از این روش حتی در زمانی که متغیرهای توضیحی درونزا هستند، ممکن است (آلام و کوازی<sup>۴</sup>، ۲۰۰۳).

پیش از توسعه مدل خود رگسیون غیرخطی با وقفه‌های گسترده، با فرض دو متغیر وابسته  $y$  و مستقل  $x$  رابطه زیر را بر اساس مطالعه گرنجر و یون<sup>۵</sup> (۲۰۰۲) تعریف می‌کنیم:

$$y_t = \beta^+ x_t^+ + \beta^- x_t^- + u_t \quad (4)$$

$$x_t = x_0 + x_t^+ + x_t^- \quad (5)$$

به گونه‌ای که

$$x_t^+ = \sum_{j=1}^t \Delta x_j^+ = \sum_{j=1}^t \max(\Delta x_j, 0); x_t^- = \sum_{j=1}^t \Delta x_j^- = \sum_{j=1}^t \min(\Delta x_j, 0) \quad (6)$$

این رویکرد ساده برای مدل سازی نامتقارن هم انباشتگی بر اساس تجزیه مجموع تجمعی مولفه‌ها توسط شودرت<sup>۶</sup> (۲۰۰۱) در زمینه رابطه غیر خطی بین بیکاری و تولید مطرح شد.

با توجه به تعریف گرنجر و یون (۲۰۰۲)، دو سری زمانی به طور نامتقارن هم انباشته‌اند هرگاه مولفه‌های مثبت و منفی آن‌ها با یکدیگر هم انباشته باشند. همچنین، آن‌ها نشان

<sup>1</sup> Unrestricted Error Correction Model

<sup>2</sup> Banerji et al.

<sup>3</sup> Narayan & Narayan

<sup>4</sup> Alam & Quazy

<sup>5</sup> Granger & Yoon

<sup>6</sup> Schorderet

دادند که هم انباشتگی خطی استاندارد (متقارن)، حالت خاصی از هم انباشتگی پنهان است و هم انباشتگی پنهان مورد خاصی از هم انباشتگی نامتقارن است. رابطه هم انباشتگی خطی مولفه‌های مجموع تجمعی مثبت و منفی به صورت زیر خواهد بود:

$$Z_t = \beta_0^+ y_t^+ + \beta_0^- y_t^- + \beta_1^+ x_t^+ + \beta_1^- x_t^- \quad (7)$$

اگر  $Z_t$  انباشته از مرتبه  $I(0)$  باشد، در این صورت گفته می‌شود که  $y_t$  و  $x_t$  به صورت نامتقارن هم انباشته‌اند. به طوری که اگر  $\beta_1^+ = \beta_1^-$  و  $\beta_0^+ = \beta_0^-$  باشد، در این صورت هم انباشتگی متقارن خواهد بود (شودرت، ۲۰۰۳).

حال با در نظر گرفتن مولفه‌های مثبت و منفی که از رابطه (۷) استخراج شده است و وارد کردن آن در یک مدل  $ARDL(p,q)$ ، به مدل  $NARDL(p,q)$ ، به صورت زیر خواهیم رسید:

$$y_t = \sum_{j=1}^p \varphi_j y_{t-j} + \sum_{j=0}^q (\theta_j^+ x_{t-j}^+ + \theta_j^- x_{t-j}^-) + \varepsilon_t \quad (8)$$

که در رابطه فوق  $p$  و  $q$  تعداد وقفه‌های بهینه،  $\varphi_j$  ضرایب وقفه‌های متغیر وابسته،  $\theta_j^+$  و  $\theta_j^-$  ضرایب نامتقارن وقفه‌های متغیر مستقل و  $\varepsilon_t$  جمله اخلاص با میانگین صفر و واریانس ثابت (همسان) است.

علاوه بر این، در فرم زیر که در حقیقت فرم مورد نظر است، یک زیر مجموعه از رگسورها نیز به صورت متقارن وارد رابطه شده است:

$$y_t = \beta^+ x_t^+ + \beta^- x_t^- + \lambda_w w_t + u_t \quad (9)$$

که در آن  $x_t = x_0 + x_t^+ + x_t^-$  یک بردار  $1 \times k$  شامل رگسورهای نامتقارن و  $w_t$  یک بردار  $1 \times g$  شامل رگسورهای متقارن در مدل هستند.

بر اساس رابطه (۹) مدل پژوهش به صورت زیر خواهد بود:

$$W_t = \beta^+ \text{Exp}_t^+ + \beta^- \text{Exp}_t^- + \lambda_w \text{In}_t + \lambda_w \text{Urban}_t + \lambda_w \text{Open}_t + \lambda_w \text{literacy}_t + \lambda_w \text{Subsidy}_t + \lambda_w \text{Other} - \text{Exp}_t + u_t \quad (10)$$

در مدل بالا، ضرایب  $\text{Exp}^+$  و  $\beta^-$ ؛ شوک‌های مثبت و منفی متغیر مخارج دولت در امور عمومی و زیر فصول مربوط مربوط به آن بر اساس پژوهش شین و همکاران (۲۰۱۴) است. با توجه به اینکه شین و همکاران (۲۰۱۴) اثر دوره‌های رکود و رونق را در شوک‌های مثبت و منفی مخارج دولت ثابت فرض کرده است، در پژوهش یک قدم فراتر رفته و با حاصل ضرب متغیرهای مجازی رکود و رونق در شوک‌های مثبت و منفی

مخارج دولت، اثرات دوره‌های رکود و رونق را در شوک‌های مذکور متفاوت فرض کرده است بنابراین، در مدل نهایی خواهیم داشت:

$$W_t = \beta_0^+ \text{Exp}_t^+ * \text{Recession} + \beta_1^+ \text{Exp}_t^+ * \text{Boom} + \beta_2^- \text{Exp}_t^- * \text{Recession} + \beta_3^- \text{Exp}_t^- * \text{Boom} + \lambda_1 \text{In}_t + \lambda_2 \text{Urban}_t + \lambda_3 \text{Open}_t + \lambda_4 \text{literacy}_t + \lambda_5 \text{Subsidy}_t + \lambda_6 (\text{Other} - \text{Exp}_t) + u_t \quad (11)$$

در رابطه بالا مقادیر  $\beta_0^+$  و  $\beta_1^+$  به ترتیب ضرایب شوک‌های مثبت مخارج دولت در طی دوره‌های رکود و رونق بوده که فرض بر آن بوده این ضرایب متفاوت هستند.  $\beta_2^-$  و  $\beta_3^-$  به ترتیب ضرایب شوک‌های منفی مخارج دولت در طی دوره‌های رکود و رونق بوده که فرض بر آن بوده این ضرایب نیز متفاوت هستند. ضرایب  $\lambda$ ، ضرایب سایر متغیرهای کنترلی در الگوها شامل، نرخ تورم، نرخ شهرنشینی، نرخ با سواد، شاخص درجه باز بودن اقتصاد، مخارج دولت در سایر امور و فصول دولت به جزء امور و فصول مورد بررسی و یارانه‌ها هستند.

سپس با استفاده از آزمون ارائه شده توسط آبراهام والد<sup>۱</sup> تحت عنوان آزمون استاندارد والد<sup>۲</sup> به بررسی عدم تقارن  $x_t$  با آزمون  $\theta^+ = \theta^-$  پرداخته می‌شود. مزیت آزمون والد نسبت به سایر آزمون‌های بررسی قیدهای رگرسیون از قبیل آزمون ضرایب لاگرانژ و نسبت درست‌نمایی این است که این آزمون تنها نیاز به تخمین مدل غیرمقید دارد. به طور شهودی، هر چه اختلاف بین رگرسیون مقید و غیرمقید، بیشتر باشد، احتمال برقراری قید کمتر است. با وجود اینکه توزیع آزمون والد در نمونه‌های محدود، ناشناخته است؛ اما به طور مجانبی می‌توان از توزیع  $\chi^2$  دو و  $F$  برای بررسی معناداری فرضیه استفاده کرد. اگر مقدار  $F$  محاسباتی از مقدار بحرانی بیشتر باشد، فرض صفر مبنی بر برابری ضرایب رگرسیون مقید و غیرمقید یا به عبارت دیگر فرضیه عدم تقارن رد خواهد شد (سوری<sup>۳</sup>، ۱۳۹۸).

همچنین، برای رفع مشکلات احتمالی، آزمون‌های تشخیص خودهمبستگی<sup>۴</sup>، فرض نرمال بودن توزیع باقیمانده‌ها<sup>۵</sup> و ناهمسانی واریانس انجام شده است.

<sup>1</sup> Wald

<sup>2</sup> wald's Standard Test

<sup>3</sup> Suri (2019)

<sup>4</sup> Serial Corrolation (LM Test)

<sup>5</sup> Normality Test

## ۴- تحلیل‌های تجربی

## ۴-۱- آماره‌های توصیفی متغیرها

جدول (۱): آماره‌های توصیفی متغیرهای پژوهش<sup>۱</sup>

متغیرهای مدل‌ها	میانگین	میانه	انحراف معیار	چولگی	کشیدگی
مخارج امور عمومی	۲۷۸۲۴	۱۵۷۸	۵۲۸۵۵	۲/۳۶	۸/۲۷
مخارج قانون‌گذاری	۱۲۸۴	۵۹	۲۳۷۹	۱/۸۲	۴/۸۷
مخارج عمومی	۵۷۸۱	۵۶۵	۱۰۲۷۶	۲/۳	۷/۹۹
مخارج قضایی	۱۱۳۵۲	۲۸۹	۲۴۲۹۷	۲/۸۹	۱۱/۵۸
مخارج خدمات مالی	۵۰۴۴	۶۶۵	۹۲۱۹	۲/۲۶	۷/۲۶
مخارج توسعه علوم	۱۴۲۵۲	۱۴۷۶۳	۸۲۶۰	۰/۵۳	۲/۸۳
نرخ تورم	۱۸/۶۲	۱۶/۶	۹/۳۴	۱/۱	۴/۲۱
نرخ باسوادی	۷۹/۸۱	۸۴/۴۴	۱۰/۳۴	-۰/۵۹	۱/۹۳
نرخ شهرنشینی	۶۰/۰۰	۶۰/۳۴	۹/۹۷	-۰/۱۱	۱/۷۸
شاخص باز بودن	۰/۴۴	۰/۴۴	۰/۱۲	۰/۱۲	۳/۶۴
شاخص رفاه اجتماعی	۸۵/۲۶	۸۴/۶۸	۱۳/۶۱	۰/-۱۵	-۰/۴۷

منبع: یافته‌های تحقیق

## ۴-۲- آزمون‌های تشخیص

بر اساس آزمون برونش-گادفری در هیچ یک از مدل‌های پژوهش در سطح اطمینان ۹۵ درصد، فرض عدم وجود خودهمبستگی رد نمی‌شود. بر اساس نتایج آزمون جاک-برا نیز در هیچ یک از مدل‌ها فرض نرمال بودن باقیمانده‌های رگرسیون رد نمی‌شود. بر اساس آماره وایت که وجود ناهمسانی واریانس در باقیمانده‌های رگرسیون را ارزیابی می‌کند در تمام مدل‌های تخمینی ناهمسانی واریانس وجود دارد. به منظور رفع مشکل ناهمسانی واریانس از ماتریس واریانس-کواریانس به صورت مقاوم<sup>۲</sup> نسبت به واریانس استفاده شده است.

<sup>۱</sup> واحد مخارج دولت در امور عمومی و زیر فصول مربوط به آن میلیارد ریال و نرخ‌های تورم، باسوادی، شهرنشینی و شاخص درجه باز بودن اقتصاد بر اساس درصد است.

<sup>۲</sup> Robust

## جدول (۲): نتایج آزمون‌های تشخیص

سطح معناداری آماره	سطح معناداری آماره	سطح معناداری آماره	امور و فصول بودجه
جاک-برا	بریوش-گادفری	واپت	امور عمومی
۰/۱۲۶	۰/۰۷۳	۰/۰۰۰۲	قانون‌گذاری
۰/۲۴۱	۰/۳۶۹	۰/۰۰۰۱	عمومی
۰/۴۱۸	۰/۲۴۴	۰/۰۰۶	قضایی
۰/۴۳۳	۰/۰۶۹	۰/۰۰۰	خدمات مالی
۰/۷۷۸	۰/۱۳۳	۰/۰۰۰۳	توسعه علوم
۰/۸۹۲	۰/۲۸۲	۰/۴۰۲	

منبع: یافته‌های پژوهش

## ۴-۳- آزمون مانایی و ریشه واحد

مدل سازی سری‌های زمانی بر فرض مانایی متغیرها استوار است. اگر متغیرها مورد استفاده در مدل، مانا نباشد، برآورد ممکن است به یک رگرسیون کاذب منجر شود. برای بررسی مانایی متغیرها در پژوهش حاضر از آزمون دیکی فولر با لحاظ شکست ساختاری استفاده شده است. نتایج این آزمون در جدول (۳) ارائه شده است.

## جدول (۳): آزمون دیکی فولر با لحاظ شکست ساختاری

وضعیت مانایی	آماره T با عرض از مبدا و روند		نام متغیر
	یکبار تفاضل‌گیری	سطح	
مانا	-	-۶/۱۶۹۱۶۷***	لگاریتم شاخص رفاه اجتماعی آمارتیا سن
مانا	-	-۶/۷۶۸۸۳۸***	لگاریتم نرخ تورم
مانا	-	-۶/۲۲۶۴۱۹***	لگاریتم نرخ شهر نشینی
مانا	-	-۵/۰۰۷۱۷۶**	لگاریتم نرخ با سواد
مانا	-	-۵/۳۵۵۹۳۸***	لگاریتم درجه باز بودن اقتصاد
مانا	-۵/۷۸۴۴۹۳***	-۳/۰۰۴۲۳۴	لگاریتم کل مخارج
مانا	-۷/۲۳۸۹۰۲***	-۳/۹۷۵۴۱۶	لگاریتم مخارج امور عمومی
مانا	-۱۲/۱۴۹۷۲***	-۳/۸۸۶۳۱۰	لگاریتم مخارج قانون‌گذاری
مانا	-۱۰/۱۷۸۵۱***	-۳/۶۴۹۳۷۹	لگاریتم مخارج قضایی
مانا	-۱۰/۳۶۰۶۴***	-۵/۵۶۹۵۲۳	لگاریتم مخارج عمومی
مانا	-۸/۷۸۸۴۶۳***	-۴/۶۷۶۴۱۴	لگاریتم مخارج خدمات مالی
مانا	-۶/۳۸۴۸۰۱***	-۵/۳۸۷۹۷۱	لگاریتم مخارج توسعه علوم

منبع: یافته‌های پژوهش

بر اساس نتایج جدول (۳) سال‌هایی که در آن متغیرهای مدل‌ها دچار شکست ساختاری بوده‌اند برای شاخص رفاه اجتماعی، نرخ تورم، نرخ شهرنشینی، نرخ با سواد، درجه باز بودن اقتصاد، کل مخارج دولت، مخارج دولت در امور عمومی، مخارج دولت در فصول قانون‌گذاری، قضایی، عمومی، خدمات مالی و توسعه علوم به ترتیب سال‌های؛ ۱۳۷۹، ۱۳۷۸، ۱۳۷۰، ۱۳۸۵، ۱۳۶۵، ۱۳۶۸، ۱۳۵۷، ۱۳۵۸، ۱۳۸۹، ۱۳۷۲، ۱۳۵۷، ۱۳۸۸ بوده است. همچنین، بر اساس نتایج این جدول کلیه متغیرهای الگوها به جزء مخارج دولت در امور عمومی و زیر فصول مربوط به آن مانا هستند. متغیرهای مذکور نیز با یک بار تفاضل‌گیری مانا می‌شوند. با توجه به اینکه متغیرهای مدل در سطوح مختلف  $I(0)$  و  $I(1)$  بوده بنابراین روش مورد استفاده در پژوهش روش خود رگرسیون غیرخطی با وقفه‌های گسترده خواهد بود.

#### ۴-۴- نتایج برآورد اثرات غیرخطی اجزای مخارج دولت در امور عمومی و زیر فصول مربوطه بر رفاه اجتماعی در طی ادوار تجاری با استفاده از روش NARDL

پیش از برآورد مدل‌ها لازم به ذکر این نکته است که در مدل‌های برآوردی به روش NARDL به دلیل ماهیت ادوار تجاری و نقش آن‌ها در اجرای سیاست‌های مالی هدف پژوهش شناخت اثرات کوتاه مدت مخارج دولت در دوره‌های رکود و رونق بوده است. بنابراین، لزومی به ذکر نتایج بلندمدت و الگوی تصحیح خطا نخواهد بود. در ابتدا شاخص رفاه اجتماعی آمارتیا سن بر اساس رابطه  $W = \mu(1 - G)$  محاسبه شده که در این رابطه مقادیر ضریب جینی بین صفر و یک بوده و میانگین هزینه‌های خانوارهای شهری به شاخص قیمت مصرف کننده به قیمت ثابت ۱۳۹۵ بر اساس واحد هزار ریال می‌باشد. نتایج در جدول (۴) ارائه شده است.

جدول (۴): مقادیر شاخص رفاه اجتماعی آمارتیا سن

سال	۱۳۵۲	۱۳۵۳	۱۳۵۴	۱۳۵۵
مقادیر رفاه	۱۰۶۵۷۰/۰۰۸۷	۱۵۲۶۳۶/۸۱۵۸	۱۹۸۴۷۰/۵۷۶۵	۱۹۹۸۱۸/۲۱۶۸
سال	۱۳۵۶	۱۳۵۷	۱۳۵۸	۱۳۵۹
مقادیر رفاه	۱۸۹۸۶۷/۱۹۵۵	۱۹۸۹۲۶/۲۹۹۳	۱۸۵۸۰۴/۲۲۸۲	۱۷۲۷۳۶/۱۴۱۵
سال	۱۳۶۰	۱۳۶۱	۱۳۶۲	۱۳۶۳
مقادیر رفاه	۱۸۳۶۹۵/۲۱۷۸	۱۷۷۶۴۷/۱۸۳۸	۱۹۰۵۲۰/۶۲۳۸	۲۰۸۱۵۷/۵۴۸۵

آثار غیر خطی مخارج عمومی دولت بر رفاه اجتماعی (رهیافت NARDL)				۱۸۴
سال	۱۳۶۴	۱۳۶۵	۱۳۶۶	۱۳۶۷
مقادیر رفاه	۲۰۵۶۷۱/۳۵۱۵	۱۷۰۱۰۸/۳۸۱۵	۱۴۸۶۷۸/۸۹۸	۱۳۹۲۷۹/۹۲۰۷
سال	۱۳۶۸	۱۳۶۹	۱۳۷۰	۱۳۷۱
مقادیر رفاه	۱۳۶۴۸۸/۴۰۸۷	۱۴۰۵۸۷/۲۰۶۸	۱۵۴۴۵۲/۳۱۹۳	۱۵۷۲۱۵/۹۴۴۳
سال	۱۳۷۲	۱۳۷۳	۱۳۷۴	۱۳۷۵
مقادیر رفاه	۱۵۳۱۸۱/۴۸۶۶	۱۵۲۶۸۱/۰۱۴۷	۱۴۳۵۷۶/۳۵۶۹	۱۴۹۰۲۵/۴۶۶۳
سال	۱۳۷۶	۱۳۷۷	۱۳۷۸	۱۳۷۹
مقادیر رفاه	۱۵۰۴۱۱/۷۵۵۳	۱۶۰۷۵۶/۳۰۴۷	۱۶۵۰۲۲/۶۰۵۱	۱۷۱۶۵۲/۴۳۵۱
سال	۱۳۸۰	۱۳۸۱	۱۳۸۲	۱۳۸۳
مقادیر رفاه	۱۷۸۷۸۶/۸۹۴۳	۱۸۶۱۱۵/۰۴۳۳	۱۸۹۷۵۰/۷۶۸۳	۲۱۲۵۱۳/۳۶۷۵
سال	۱۳۸۴	۱۳۸۵	۱۳۸۶	۱۳۸۷
مقادیر رفاه	۲۲۰۱۵۱/۶۹۱۲	۲۲۴۶۹۸/۹۵۹۶	۲۲۷۶۴۰/۱۷۰۶	۲۱۷۰۱۷/۵۶۵
سال	۱۳۸۸	۱۳۸۹	۱۳۹۰	۱۳۹۱
مقادیر رفاه	۲۰۳۶۰۹/۷۹۷۴	۲۱۱۹۲۰/۷۸۹۹	۲۰۵۷۱۸/۰۱۲۹	۱۹۲۴۴۸/۸۰۹۶
سال	۱۳۹۲	۱۳۹۳	۱۳۹۴	۱۳۹۵
مقادیر رفاه	۱۷۵۶۷۰/۰۴۶	۱۷۱۹۹۰/۱۴۸	۱۷۲۰۰۵/۴۴۷۸	۱۶۹۵۸۱/۸۲۸
سال	۱۳۹۶	۱۳۹۷	۱۳۹۸	۱۳۹۹
مقادیر رفاه	۱۸۰۰۷۴/۲۱۸	۱۶۵۷۱۳/۱۸۶۴	۱۴۴۱۲۳/۴۱۵۶	-

منبع: یافته‌های پژوهش

همان طور که در فصل پیش توضیح داده شد در ابتدا به استخراج ادوار تجاری به روش فیلتر هودریک پرسکات پرداخته می‌شود. بر اساس این روش دوره‌های رکود و رونق که به ترتیب بر اساس شکاف تولید منفی و مثبت می‌آیند در جدول (۵) ذکر شدند.

**جدول (۵): ادوار تجاری ایران بر اساس روش فیلتر هودریک پرسکات**

سال	۱۳۵۱	۱۳۵۲	۱۳۵۳	۱۳۵۴	۱۳۵۵	۱۳۵۶	۱۳۵۷	۱۳۵۸
شکاف تولید	۰/۸۴	۲/۵۳	-۵/۰۶	۱۶/۸۸	-۳/۸۶	-۱۱/۴۹	-۷/۲۶	-۲۰/۷۲
دوره	رونق	رونق	رکود	رونق	رکود	رکود	رکود	رکود
سال	۱۳۵۹	۱۳۶۰	۱۳۶۱	۱۳۶۲	۱۳۶۳	۱۳۶۴	۱۳۶۵	۱۳۶۶
شکاف تولید	-۲/۶۳	۲۴/۶۱	۱۱/۰۹	-۶/۶۳	۲/۲۰	-۹/۹۵	-۰/۶۹	-۶/۹۶



فصلنامه نظریه‌های کاربردی اقتصاد/ سال هشتم/ شماره ۴/ زمستان ۱۴۰۰								
دوره	رکود	رونق	رکود	رونق	رکود	رونق	رکود	رکود
سال	۱۳۶۷	۱۳۶۸	۱۳۶۹	۱۳۷۰	۱۳۷۱	۱۳۷۲	۱۳۷۳	۱۳۷۴
شکاف تولید	۳/۴۰	۱۰/۹۳	۸/۷۷	-۰/۶۲	-۲/۳۶	-۴/۶۱	-۱/۰۱	۱/۶۵
دوره	رونق	رونق	رونق	رکود	رکود	رکود	رکود	رونق
سال	۱۳۷۵	۱۳۷۶	۱۳۷۷	۱۳۷۸	۱۳۷۹	۱۳۸۰	۱۳۸۱	۱۳۸۲
شکاف تولید	-۲/۹۸	-۱/۷۶	-۲/۴۷	۱/۲۳	-۲/۶۴	۳/۲۰	۳/۳۷	-۰/۴۰
دوره	رکود	رکود	رکود	رونق	رونق	رونق	رونق	رکود
سال	۱۳۸۳	۱۳۸۴	۱۳۸۵	۱۳۸۶	۱۳۸۷	۱۳۸۸	۱۳۸۹	۱۳۹۰
شکاف تولید	۱/۳۹	۰/۴۶	۰/۹۸	۲/۸۲	-۳/۴۹	-۲/۹۳	۳/۲۴	۱/۰۱
دوره	رونق	رونق	رونق	رونق	رکود	رکود	رونق	رونق
سال	۱۳۹۱	۱۳۹۲	۱۳۹۳	۱۳۹۴	۱۳۹۵	۱۳۹۶	۱۳۹۷	۱۳۹۸
شکاف تولید	-۹/۳۶	-۱/۶۶	۲/۱۶	-۲/۲۸	۱۲/۲۶	۴/۱۰	-۴/۲۵	-۴/۵۵
دوره	رکود	رکود	رونق	رونق	رکود	رونق	رکود	رکود

منبع: یافته‌های پژوهش

پس از استخراج دوره‌های رکود و رونق بر اساس فیلتر هودریک پرسکات باید به بررسی متفاوت بودن ضرایب اثرگذاری اجزای مخارج دولت در طی دوره‌های رکود و رونق پرداخت. بر این اساس نتایج آزمون والد در جدول (۶) ذکر شده است.

جدول (۶): آزمون برابری ضرایب (والد) شوک‌های مثبت و منفی مخارج دولت در امور

عمومی در دوره‌های رکود و رونق

شوک منفی		شوک مثبت		مدل‌ها
سطح معناداری	آماره F	سطح معناداری	آماره F	
۰/۰۱۸	۶/۱۶۳	۰/۰۰۲	۱۰/۷۶۱	امور عمومی
۰/۷۸۲	۰/۰۷۸	۰/۶۰۸	۰/۲۶۸	قانونگذاری
۰/۰۰۰	۱۶۰/۳۰۵	۰/۰۰۰	۴۴/۲۵۴	عمومی
۰/۰۰۰	۱۷/۱۲۳	۰/۰۱۳	۶/۸۲۴	قضایی

آثار غیرخطی مخارج عمومی دولت بر رفاه اجتماعی (رهیافت NARDL)				۱۸۶
۰/۴۶۲	۰/۵۵۴	۰/۳۴۵	۰/۹۱۶	خدمات مالی
۰/۰۰۲	۳۶۴/۶۵۳	۰/۰۰۰	۴۱۲/۰۰۲	توسعه علوم

منبع: یافته‌های پژوهش

بر اساس جدول (۶) چنانچه سطح معناداری کمتر از ۰.۰۵ باشد در سطح اطمینان ۹۵ درصد فرض صفر مبنی بر برابری ضرایب در دوره‌های رکود و رونق رد می‌شود. به استثناء فصول قانون‌گذاری و خدمات مالی، در امور عمومی و فصول عمومی، قضایی و توسعه علوم اثرات شوک‌های مثبت و منفی مخارج دولت بر رفاه اجتماعی در دوره‌های رکود و رونق با یکدیگر تفاوت معنادار آماری دارند.

جدول (۷): نتایج برآورد اثرات متغیرهای توضیحی بر رفاه اجتماعی - امور عمومی و

زیر فصول مربوطه به روش NARDL

شاخص رفاه اجتماعی Log(W)			سایر متغیرهای کنترلی مدل‌ها
مدل مربوط به امور عمومی (PG)	مدل مربوط به قانون‌گذاری (LG)	مدل مربوط به امور عمومی (PAG)	
۰/۳۳۸***	۰/۴۴۳***	۰/۳۰۷***	وقفه رفاه (WL)
-۸/۸۳۹***	-۸/۰۰۹***	-۹/۰۹۱***	عرض از مبدا ( $\alpha$ )
-۰/۰۶۲***	-۰/۰۷۳***	-۰/۰۶۹***	لگاریتم نرخ تورم Log(In)
-۳/۴۵۷***	-۲/۷۷۲***	-۴/۲۹۵***	لگاریتم نرخ باسوادی Log(Literacy)
۰/۱۱۱***	۰/۱۹۲***	۰/۱۱۱***	لگاریتم شاخص درجه باز بودن اقتصاد Log(Open <sub>t</sub> )
۱۱/۲۱۴***	۹/۶۱۸***	۱۲/۴۲۳***	لگاریتم نرخ شهرنشینی Log(Urban <sub>t</sub> )
۰/۱۲۳***	۰/۰۸۹***	۰/۱۵۰***	لگاریتم مخارج دولت در سایر امور و فصول به جز امور یا فصل مربوطه Log(Other_EXP)
۰/۰۰۳	۰/۰۲۲*	۰/۰۲۲*	یارانه‌ها (Subsidy <sub>t</sub> )
۰/۰۲۷***	۰/۰۴۸***	-۰/۰۰۹	شوک‌های مثبت در زمان رکود (Shock <sub>POS</sub> * Recesion)
۰/۰۴۶***	۰/۰۵۱***	-۰/۰۰۱	شوک‌های مثبت در زمان رونق

فصلنامه نظریه‌های کاربردی اقتصاد/ سال هشتم/ شماره ۴/ زمستان ۱۴۰۰			
۱۸۷			
			(Shock <sub>POS</sub> * Boom)
۰/۰۱۰	۰/۰۶۸**	۰/۱۹۶**	شوک‌های منفی در زمان رکود (Shock <sub>NEG</sub> * Recesion)
۰/۱۰۸***	۰/۰۷۱**	۰/۲۴۸**	شوک‌های منفی در زمان رونق (Shock <sub>NEG</sub> * Boom)
-۰/۰۴۶***	-۰/۰۴۲***	-۰/۰۴۴***	روند زمانی (Timetrend)
شاخص رفاه اجتماعی Log(W)			سایر متغیرهای کنترلی مدل‌ها
مدل مربوط به مخارج توسعه علوم (SDG)	مدل مربوط به مخارج خدمات مالی (FSG)	مدل مربوط به مخارج قضایی (JG)	
۱/۴۹۷***	۰/۳۶۸***	۰/۳۹۱***	وقفه رفاه (WL)
-۱۹/۱۲۰***	-۸/۰۱۰***	-۸/۲۴۰***	عرض از مبدا ( $\alpha$ )
-۰/۰۷۰***	-۰/۰۷۴***	-۰/۰۶۳***	لگاریتم نرخ تورم Log(In)
۸/۱۹۲***	-۳/۱۱۱***	-۵/۰۵۷***	لگاریتم نرخ باسوادی Log(Literacy)
۰/۱۹۵***	۰/۰۹۸***	۰/۱۶۸***	لگاریتم شاخص درجه باز بودن اقتصاد Log(Open <sub>t</sub> )
۰/۶۳۹***	۱۰/۳۳۶***	۱۲/۴۵۴***	لگاریتم نرخ شهرنشینی Log(Urban <sub>t</sub> )
-۰/۰۶۱**	۰/۰۶۱***	۰/۰۷۷***	لگاریتم مخارج دولت در سایر امور و فصول به جز امور یا فصل مربوطه Log(Other_EXP)
۰/۰۵۸***	۰/۰۳۱	-۰/۰۰۷	یارانه‌ها (Subsidy <sub>t</sub> )
۰/۰۸۱***	۰/۰۰۶	-۰/۰۵۶**	شوک‌های مثبت در زمان رکود (Shock <sub>POS</sub> * Recesion)
۰/۰۱۷*	۰/۰۱۰	-۰/۰۶۱**	شوک‌های مثبت در زمان رونق (Shock <sub>POS</sub> * Boom)
۰/۲۱۴***	۰/۰۶۷***	۰/۲۷۶***	شوک‌های منفی در زمان رکود

آثار غیرخطی مخارج عمومی دولت بر رفاه اجتماعی (رهیافت NARDL)			۱۸۸
			(Shock <sub>NEG</sub> * Recession)
-.۰/۰۱۴*	.۰/۰۷۸**	.۰/۱۰۲	شوک‌های منفی در زمان رونق (Shock <sub>NEG</sub> * Boom)
-.۰/۰۱۲***	-.۰/۰۴۱***	-.۰/۰۳۴***	روند زمانی (Timetrend)

\*\*\* معنادار در سطح ۹۹ درصد، \*\* معنادار در سطح ۹۵ درصد، \* معنادار در سطح ۹۰ درصد

منبع: یافته‌های پژوهش

بر اساس جدول (۷) شوک‌های فزاینده و کاهنده مخارج دولت در امور عمومی و زیر فصول مربوط به آن در دوره‌های رکود و رونق اثر متفاوتی بر رفاه اجتماعی دارند. اثر شوک‌های افزایشی مخارج دولت در امور عمومی بر رفاه اجتماعی در دوره‌های رکود و رونق منفی بوده، همچنین از نظر آماری معنادار نیست. با این حال اثر شوک‌های کاهنده مخارج دولت بر رفاه اجتماعی در هر دو دوره رکود و رونق مثبت و معنادار بوده است. برخلاف انتظار، شوک‌های کاهنده مخارج دولت به ویژه در دوره‌های رونق در امور عمومی در مقایسه با شوک‌های فزاینده تاثیر بیشتری بر رفاه اجتماعی دارند. اثر شوک‌های افزایشی و کاهشی مخارج دولت در فصل قانون‌گذاری بر رفاه اجتماعی در دو دوره رکود و رونق مثبت و از نظر آماری معنادار بوده‌اند. با این حال اثر شوک‌های کاهنده مخارج دولت به ویژه در دوره‌های رونق دارای اثرگذاری بیشتری نسبت به شوک‌های فزاینده بر رفاه اجتماعی در این فصل هستند. اثر شوک‌های افزایشی و کاهشی مخارج دولت در فصل عمومی بر رفاه اجتماعی در دو دوره رکود و رونق مثبت و به استثناء شوک افزایشی مخارج دولت در دوره رونق از نظر آماری معنادار بوده‌اند. بنابراین، برخلاف انتظار شوک‌های کاهنده مخارج دولت به ویژه در دوره‌های رونق در مقایسه با شوک‌های فزاینده تاثیر بیشتری بر رفاه اجتماعی در فصل عمومی دارند. اثر شوک‌های افزایشی مخارج دولت در فصل قضایی بر رفاه اجتماعی در دوره رکود و رونق منفی و معنادار بوده است. با این حال اثر شوک‌های کاهنده مخارج دولت بر رفاه اجتماعی در هر دو دوره رکودی و رونق مثبت و به ترتیب معنادار و غیر معنادار بوده است. این موضوع دو یافته مهم در بردارد. اول، اینکه (با در نظر گرفتن هر دو دوره رکود و رونق) برخلاف انتظار شوک‌های کاهنده مخارج دولت در فصل قضایی در مقایسه با شوک‌های فزاینده تاثیر بیشتری بر رفاه اجتماعی دارند. دوم، اثر شوک کاهنده مخارج

دولت در فصل قضایی در دوره‌های رکود در مقایسه با سایر شوک‌ها تاثیر بیشتری بر رفاه اجتماعی در ایران دارد. اثر شوک‌های افزایشی و کاهش‌ی مخارج دولت در فصل خدمات مالی بر رفاه اجتماعی در دو دوره رکود و رونق مثبت و به استثناء شوک‌های افزایشی از نظر آماری معنادار بوده‌اند. با این حال اثر شوک‌های کاهنده مخارج دولت به ویژه در دوره‌های رونق دارای اثرگذاری بیشتری نسبت به شوک‌های فزاینده بر رفاه اجتماعی در فصل خدمات مالی هستند. اثر شوک‌های افزایشی و کاهش‌ی مخارج دولت در فصل توسعه علوم بر رفاه اجتماعی در دوره‌های رکود و رونق به استثناء شوک کاهنده مخارج دولت در دوره رونق مثبت و معنادار بوده است. همچنین، با در نظر گرفتن هر دو دوره رکود و رونق، به ترتیب شوک‌های کاهش‌ی و افزایش‌ی مخارج دولت در فصل توسعه علوم در دوره‌های رکود در مقایسه با دوره‌های رونق تاثیر بیشتری بر رفاه اجتماعی دارند.

#### ۵- نتیجه‌گیری

رفاه اجتماعی در یک جامعه به نهادهای اقتصادی و اجتماعی وابسته بوده و نحوه عملکرد این نهادها به نوبه خود بستگی به نهادهای سیاسی داشته که قدرت را در اختیار دارند. بنابراین، نحوه تخصیص مخارج دولت در امور عمومی و زیر فصول مربوطه نقش بسزایی در حفظ اعتماد و اطمینان در یک جامعه برای گسترش فعالیت‌های اقتصادی و افزایش رفاه اجتماعی دارند. بنابراین، با توجه به سیر نزولی رفاه اجتماعی و نبود پژوهش لازم در زمینه بررسی اثرات مخارج دولت در امور عمومی و زیر فصول مربوط به آن بر رفاه اجتماعی در طی ادوار تجاری ایران، این هدف، موضوع پژوهش حاضر قرار گرفته است.

با توجه به اهمیت اولویت بندی بودجه دولت در امور عمومی و همچنین نقش ادوار تجاری در تخصیص این منابع، پژوهش حاضر به بررسی اثرگذاری مخارج دولت در امور عمومی و فصول مربوط به آن بر شاخص رفاه اجتماعی آمارتیا سن در طی ادوار تجاری اقتصاد ایران برای دوره زمانی سال‌های ۱۳۹۸-۱۳۵۲ پرداخته است. به این منظور از مدل خود رگرسیون با وقفه‌های توزیعی بهره گرفته شده است.

نتایج تحقیق نشان دهنده آن است که در اقتصاد ایران شوک مثبت مخارج دولت در طی ادوار تجاری در فصول توسعه علوم، قانون‌گذاری و عمومی موجب افزایش رفاه

اجتماعی و در فصل قضایی موجب کاهش رفاه اجتماعی به طور معنادار شده است. شوک منفی مخارج دولت در امور عمومی و فصول قانون‌گذاری، عمومی و خدمات مالی در طی ادوار تجاری و فصل قضایی تنها در دوره‌های رکود موجب افزایش رفاه اجتماعی به طور معنادار شده است. شوک منفی مخارج دولت در فصل توسعه علوم نیز به ترتیب در دوره رکود و رونق موجب افزایش و کاهش رفاه اجتماعی به طور معنادار شده است. اثرگذاری منفی و مثبت مخارج دولت بر رفاه اجتماعی در طی ادوار تجاری به ترتیب به اثرات برون رانی<sup>۱</sup> و اثرات ضریب فزاینده درآمدی کینزی یا به عبارت دیگر اثر درون رانی<sup>۲</sup> برمی‌گردد (منلا و دمیتراکی<sup>۳</sup>، ۲۰۱۴). در اثرات درون‌رانی، اثرگذاری مخارج دولت بر نرخ بهره اندک بوده در نتیجه افزایش مخارج دولت موجب افزایش فعالیت‌های اقتصادی، ایجاد اشتغال، افزایش درآمد افراد و در نتیجه افزایش رفاه اقتصادی می‌شود (هانسول<sup>۴</sup>، ۲۰۱۶). در مقابل، در اثرات برون‌رانی در دیدگاه نئوکلاسیک‌ها سازو کار نرخ بهره در به تعادل رساندن بازار سرمایه در طی افزایش مخارج دولت به دلیل ایجاد بدهی داخلی جهت تامین کسری بودجه دولت به افزایش نرخ بهره منجر می‌شود. در این اثر به دلیل حساس بودن سرمایه‌گذاری نسبت به نرخ بهره، سرمایه‌گذاری و در نتیجه فعالیت‌های اقتصادی، اشتغال و درآمد کاهش یافته که ماحصل آن می‌تواند افزایش فقر و کاهش رفاه اجتماعی باشد (محمود زاده، صادقی و صادقی، ۱۳۹۰).

همچنین، با در نظر گرفتن شوک مثبت مخارج دولت، امور عمومی و فصل توسعه علوم دارای اثرگذاری بیشتر در دوره‌های رکود و فصول قانون‌گذاری، قضایی، خدمات مالی و عمومی دارای اثرگذاری بیشتر در دوره‌های رونق بر رفاه اجتماعی هستند. با در نظر گرفتن شوک منفی مخارج دولت نیز فصل قضایی و توسعه علوم دارای اثرگذاری بیشتر در دوره‌های رکود و امور عمومی و فصول قانون‌گذاری، خدمات مالی و عمومی دارای اثرگذاری بیشتر در دوره‌های رونق بر رفاه اجتماعی هستند. بنابراین، مخارج دولت در امور عمومی دارای اثرات نامتقارن بر روی رفاه اجتماعی هستند. این رفتار نامتقارن می‌تواند از سایر عواملی همچون وجود مازاد بودجه دولت در طی دوره رونق، محدودیت در نقدینگی در طی ادوار تجاری به خصوص در دوره‌های رکود و در نتیجه آن عدم

<sup>1</sup> Crowding Out Effect

<sup>2</sup> Crowding in Effect

<sup>3</sup> Menla & Dimitrakib

<sup>4</sup> Hasnul

سرمایه‌گذاری کافی در حوزه‌های مربوط به توسعه علوم و سیستم قضایی، فساد، پروسه طولانی مدت مراحل تصویب بودجه، اجرا و نظارت سیاست‌های مالی نشأت بگیرد. در ارتباط با سایر متغیرهای کنترلی مدل می‌توان گفت در کلیه مدل‌های برآوردی اجزای مخارج دولت در امور عمومی بر رفاه اجتماعی در طی ادوار تجاری اثرگذاری متغیر کنترلی نرخ تورم و نرخ باسوادی به جزء در فصل تحقیق و توسعه بر رفاه اجتماعی منفی و اثرگذاری متغیرهای کنترلی شاخص درجه باز بودن اقتصاد، نرخ شهرنشینی و هدفمندی یارانه‌ها مثبت بوده است. در ایران وجود تورم بالا با ایجاد تغییرات شدید در قیمت‌های نسبی موجب ایجاد ناطمینانی در اقتصاد شده و این امر مانع از تشکیل پس‌انداز و سرمایه‌گذاری به خصوص به وسیله افراد فقیر شده است. بنابراین، ثروت در جامعه به نفع ثروتمندان و به زیان گروه‌های فقیر تغییر یافته است. همچنین، تورم مانع عمده در جهت اتخاذ تصمیمات صحیح اقتصادی برای کارفرمایان و کارآفرینان اقتصادی شده و تمامی این عوامل دارای نقشی اثرگذار در کاهش رفاه اجتماعی هستند. در ارتباط با توجیه مربوط به اثرگذاری منفی نرخ باسوادی بر رفاه اجتماعی می‌توان گفت در ایران همچون سایر کشورهای در حال توسعه تخصیص مخارج دولت برای توسعه سرمایه انسانی از جمله ارتقاء نرخ سواد غالباً ناکارآمد و ناعادلانه بوده و بیشتر قشر ثروتمند از آن بهره می‌برند. این در حالی است که در الگو مربوط به فصل توسعه علوم افزایش نرخ باسوادی به شکلی کارا در افزایش خلاقیت، نوآوری و افزایش سرمایه‌های انسانی نقش داشته و دارای اثرگذاری مثبت بر رفاه اجتماعی بوده است. *ژورنال پژوهش‌های علمی و مطالعات فرسنگی*

تاثیر مثبت متغیر شاخص باز بودن اقتصاد بر رفاه در ایران ناشی از آن بوده که بر اساس الگوی هکشر- اوهلین<sup>۱</sup> ایران به علت فراوانی نیروی کار به صادرات کالاهایی می‌پردازد که در آن‌ها از عامل نیروی کار بیشتری استفاده می‌شود. بنابراین، آزادسازی تجاری در کشورهای در حال توسعه از جمله ایران باعث انتقال منابع به سمت تولید کالاهای صادراتی کاربر خواهد شد که در نتیجه افزایش تقاضا برای نیروی کار باعث کاهش فقر و افزایش رفاه اجتماعی می‌شود. همچنین، ارتقای سرمایه‌گذاری در نیروی انسانی و سرمایه فیزیکی، رشد تولید در بخش‌هایی که از مزیت نسبی برخوردارند،

---

<sup>۱</sup>. Hecksher-Ohlin

رقابتنی شدن بازار کار از سایر پیامدهای مطلوب این شاخص بر اقتصاد و رفاه اجتماعی در ایران است. اثرگذاری مثبت نرخ شهرنشینی بر رفاه اجتماعی به امتیازهای طبیعی موجود در مناطق شهری همچون دسترسی به سیستم حمل و نقل، و بازار، بیشتر بودن دستمزد در نقاط شهری، ایجاد فرصت‌های بیشتر برای دسترسی به مشاغل متنوع‌تر به خصوص مشاغل خدماتی در جهت افزایش درآمد برمی‌گردد. در مدل‌های برآوردی مربوط به رفاه اجتماعی در امور عمومی متغیر هدفمندی یارانه‌ها در تمامی فصول دارای اثرگذاری مثبت بوده اما نکته حائز اهمیت آن است که در فصل قضایی این اثرگذاری منفی بوده است. که از آن جهت که این فصل به طور غیر معناداری بر رفاه اجتماعی اثرگذار بوده است، تاثیر هدفمندی یارانه‌ها در این مدل از اهمیت ناچیز برخوردار بوده است. اما در سایر مدل‌ها اجرای طرح هدفمندی یارانه‌ها با افزایش مصرف و کاهش انباشت سرمایه در مجموع منجر به افزایش رفاه اجتماعی شده است.

بدین منظور بر اساس نتایج حاصل از پژوهش برای دستیابی به حداکثر رفاه اجتماعی پیشنهاد می‌شود، در صورتی که دولت به اعمال شوک‌های مثبت در مخارج در طی دوره‌های رکود بپردازد، مخارج خود را باید به ترتیب اولویت صرف فصول توسعه علوم، قانون‌گذاری و عمومی نماید. همچنین، با اعمال شوک‌های مثبت در طی دوره‌های رونق باید مخارج خود را به ترتیب صرف فصول قضایی، توسعه علوم، قانون‌گذاری و خدمات مالی نماید. در حالی که با اعمال شوک‌های منفی در طی دوره‌های رونق باید مخارج خود را به ترتیب اولویت به فصول عمومی، قضایی، خدمات مالی و قانون‌گذاری تخصیص نماید.

### تضاد منافع

نویسندگان نبود تضاد منافع را اعلام می‌دارند.



## فهرست منابع

۱. احمدوند، نرگس، علیزاده، محمد، فطرس، محمد حسن و دلفان، محبوبه (۱۳۹۹).  
حصول سهم بهینه مخارج دولت از تولید ناخالص داخلی با هدف حداکثرسازی رفاه  
اجتماعی (با تأکید بر امور و فصول بودجه عمومی دولت). *فصلنامه رفاه اجتماعی*، ۲۰  
(۷۹)، ۱۹۵-۱۵۳.
۲. امینی، علیرضا و مرادزاده، سلاله (۱۳۹۴). تحلیل تأثیر آزادسازی تجاری بر نرخ  
بیکاری: مطالعه موردی کشورهای منتخب در حال توسعه. *فصلنامه علوم اقتصادی*، ۹  
(۳۱)، ۷۷-۹۳.
۳. امیری، هادی، شهنازی، روح اله، دهقانی شبانی، زهرا و نادران، الیاس (۱۳۹۱)  
*اقتصاد بخش عمومی*. سازمان مطالعه و تدوین کتب علوم انسانی دانشگاه‌ها، مرکز  
تحقیق و توسعه علوم انسانی، تهران: ناشر پژوهشگاه حوزه و دانشگاه.
۴. بختیاری، صادق، موید فر، رزیتا و سرخوش سرا، علی (۱۳۹۳). تحلیل تأثیر اجزاء  
مخارج دولتی بر توسعه و رفاه: مقایسه تطبیقی کشورهای منتخب توسعه و درحال  
توسعه. *مجله اقتصاد و توسعه منطقه‌ای*، ۲۱(۸)، ۲۴-۴۸.
۵. حسینی، سید مهدی، عبدی، علیرضا، غیبی، علیرضا و فدایی، ایمان (۱۳۸۷). ترکیب  
اجزای مخارج دولت و تأثیر آن بر رشد اقتصادی با امور و فصول بودجه عمومی دولت.  
*فصلنامه پژوهش‌ها و سیاست‌های اقتصادی*، ۱۶(۴۸)، ۶۳-۳۷.
۶. خانزادی، آزاد، فتاحی، شهرام و مرادی، سارا (۱۳۹۴). بررسی اثرات مخارج بهداشت  
و درمان دولت بر توسعه انسانی در ایران. *فصلنامه اقتصاد و الگوسازی دانشگاه شهید  
بهشتی*، ۷(۲۵)، ۱۴۹-۱۳۰.
۷. دل انگیزان، سهراب، پشته کشی، مریم و نظری، سهیلا (۱۳۹۶). تأثیر کیفیت  
حکمرانی، نرخ شهرنشینی و آزادی اقتصادی بر نابرابری درآمدی. *اولین همایش بین-  
المللی برنامه‌ریزی اقتصادی، توسعه پایدار و متوازن منطقه‌ای، رویکردها و کاربردها،  
دانشگاه کردستان*.
۸. رافعی، میثم، بهرامی، جاوید و دانش جعفری، داوود (۱۳۹۳). ارزیابی سیاست مالی  
برای اقتصاد ایران در یک مدل تعادل عمومی پویای تصادفی مبتنی بر ادوار تجاری  
حقیقی. *فصلنامه پژوهشنامه اقتصادی*، ۱۴(۵۴)، ۶۵-۳۳.

۹. رضایی پور، محمد و آقای آخوندابی، مجید (۱۳۹۰). اثر شوک‌های مخارج یارانه‌ای دولت بر مصرف واقعی بخش خصوصی ایران. *فصلنامه پژوهش‌ها و سیاست‌های اقتصادی*، ۱۹(۶۰)، ۱۶۰-۱۳۹.
۱۰. زمانی شبخانه، صابر و مهرگان، نادر (۱۳۹۲). بررسی اثر شهرنشینی بر توزیع درآمد در ایران با تأکید بر نظریه کوزنتس. *فصلنامه برنامه ریزی و بودجه*، ۳(۱۸)، ۱۹-۳.
۱۱. زبیری، هدی و صلاحی کجور، سامان (۱۳۹۸). اثر استقلال قضایی بر تولید ناخالص داخلی (مطالعه بین کشوری با روش داده‌های تابلویی). *فصلنامه مدل‌سازی اقتصادسنجی*، ۳(۳)، ۶۳-۸۲.
۱۲. سوری، علی (۱۳۹۸). *اقتصادسنجی*. جلد اول، چاپ هشتم، تهران: نشر فرهنگ شناسی.
۱۳. سامانه مدیریت خدمات دولت: [www.Khadamat.mardom.ir](http://www.Khadamat.mardom.ir)
۱۴. شمس‌الدینی، علی و گرجیان، پروین (۱۳۸۹). عوامل مؤثر در مهاجرت روستائیان به شهرها، با تأکید بر شبکه مهاجرت (مورد: دهستان رستم دو). *فصلنامه مطالعات برنامه‌ریزی سکونت‌گاه‌های انسانی*، ۵(۱۱)، ۹۲-۷۵.
۱۵. عیسی زاده، سعید و احمدزاده، اکبر (۱۳۸۸). بررسی اثر عوامل نهادی بر رشد اقتصادی با تأکید بر نهادهای حاکمیتی (مطالعه موردی بین کشوری برای دوره ۲۰۰۵-۱۹۹۶). *فصلنامه پژوهش‌های اقتصادی ایران*، ۱۳(۴۰)، ۲۸-۱.
۱۶. فشاری، مجید (۱۳۹۶). بررسی ماهیت ادواری شوک‌های مخارج دولت بر رشد اقتصادی ایران (رهیافت غیرخطی الگوی چرخشی مارکوف)، *فصلنامه مدل‌سازی اقتصادسنجی*، ۲(۲)، ۱۱۶-۸۹.
۱۷. قاسمی، محمد و مهاجری، پریسا (۱۳۹۴). بررسی رفتار چرخه‌ای سیاست مالی در ایران. *فصلنامه پژوهش‌نامه اقتصادی*، ۱۵(۵۶)، ۱۰۴-۷۵.
۱۸. محمودزاده، محمود، صادقی، سمیه و صادقی، ثریا (۱۳۹۰). اثر مخارج مالی بر سرمایه‌گذاری خصوصی در ایران (آزمون فرضیه C.O.E). *فصلنامه علمی و پژوهشی برنامه‌ریزی و بودجه*، ۱۶(۲)، ۱۴۶-۱۳۱.
۱۹. محبی، ابوالفضل. (۱۳۸۹) بررسی مؤلفه‌های حقوقی و قضایی امنیت اقتصادی. *فصلنامه دیدگاه‌های حقوقی*، ۱(۱)، ۲۰۲-۲۲۶.

۲۰. نادمی، یونس و بهاروند، ناهید (۱۳۹۷). مدل سازی عوامل موثر بر رشد اقتصادی در ایران: رویکرد مارکوف سوئچینگ گارچ. فصلنامه سیاست‌های مالی و اقتصادی، ۶(۲۴)، ۳۳-۵۸.

- 1- Agenor, P.R. (2002). Does Globalization Hurt the Poor? *The World Bank Washington DC*, 20433, 1-51.
- 2- Ahmadvand, N., Alizadeh, M., Fotros, M. H., & Delfan, M. (2020). Achieving the Optimal share of Government Expenditures in GDP with the Aim of Maximizing Social Welfare (With Emphasis On the Affairs and Seasons of the State Budget), *Social Welfare Quarterly*, 20 (79), 153-195. (In Persian)
- 3- Afonso, A., Agnello, L. & Furceri, D. (2010). Fiscal Policy Responsiveness, Persistence and Discretion. *Public Choice*.
- 4- Armev, R. (1995). The Freedom Revolution. *Washington DC: Rognery Publishing Co*.
- 5- Acemoğlu, D., Johnson, S., & Robinson, J.A. (2005). Institutions as A Fundamental Cause of Long-Run Growth, Philippe Aghion and Steven N. Durlauf Eds.
- 6- Amini, A., & Moradzadeh, S. (2015). Analyzing the Impact of Trade Liberalization on the Unemployment Rate: A Case Study of Selected Developing Countries, *Quarterly Journal of Economic Sciences*, 9 (31), 93-77. (In Persian)
- 7- 26. Amiri, H., Shahnazi, R., Dehghani Shabani, Z., & Naderan, E. (2012). *Public Sector Economics*, Organization for the Study and Compilation of University Humanities Books, Humanities Research and Development Center, Tehran: Publisher of Hozeh and University Research Institute. (In Persian)
- 8- Alam, M.I., & Quazy, R.M. (2003). Determinant of Capital Flight: An Econometric Case Study of Bangladesh, *Review of Applied Economics*, 17, 85-103
- 9- Auerbach, A. J., & Gorodnichenko, Y. (2012). Measuring The Output Responses to Fiscal Policy. *American Economic Journal: Economic Policy*, 4(2), 1-27.
- 10- Barro, J. R., & Sala-i-Martin, X. (1995). Economic Growth. *New York: McGraw-Hill*, xviii, 539.
- 11- Baum, A., & Koester, G. B. (2011). The Impact of Fiscal Policy On Economic Activity Over the Business Cycle Evidence from A Threshold VAR Analysis. *Discussion Paper Series 1: Economic Studies*, 8.

- 12- Banerji, A., Dolado, J., Galbraith, J. W., & Hendry, D. F. (1993). Coe integration, Error Correction, and the Econometric Analysis of Non-Stationary Data, *Oxford University Press*.
- 13- Bakhtiari, S., Movaied Far, R., & Sarkhosh sara, A. (2014). Analyzing the Impact of Government Expenditure on Development and Welfare Components: A Comparative Study of Developed and Developing Countries. *Journal of Economy and regional Development*, 21 (8), 24-48. (In Persian)
- 14- Blanchard, O., (1990). Can Severe Fiscal Contractions Be Expansionary? Tales of Two Small European Countries: Comment. *NBER Macroeconomics*, 5, 111-116.
- 15- Baumol, W. (2002), The Free-Market Innovation Machine: Analyzing the Growth Miracle of Capitalism, *Princeton: Princeton University Press*.
- 16- Bulir, A. (2001). Income Inequality: Does Inflation Matter? *IMF Working Paper*, No.48, 45-63.
- 17- Bouthevillain, C., & Dufrénot, G. (2011). Are The Effects of Fiscal Changes Different in Times of Crisis and Non Crisis? The French Cas. *Daloz Revue D'économie Politique*, 121, 371-407.
- 18- Cooley, T., & Prescott, E. (1995). Economic Growth and Busines Cycle. In. T, Cooley, ed, *Frontier of Busines Cycle Research*, *Princeton University Press*, 1-38.
- 19- Darby, J., & Melitz, J. (2008). Social Spending and Automatic Stabilizers in The OECD. *Economic Policy*, 23 (56), 715-56.
- 20- Davies, A. (2009). Human Development and the Optimal Size of Government. *Journal of Socioeconomics*, 38, 326-330.
- 21- Del Angizan, S., Poshte keshi, M., & Nazari, S. (2017). The Impact of Governance Quality, Urbanization Rate and Economic Freedom on Income Inequality, First International Conference on Economic Planning, Sustainable and Balanced Regional Development, Approaches and Applications, University of Kurdistan. (In Persian)
- 22- Enisan Akinlo, A., & Olayemi Jemiluyi. O. (2018). Government Expenditure and Economic Growth Nexus in Nigeria: Evidence from Nonlinear ARDL and Causality Approaches. *Eview of Innovation and Competitiveness*, 4 (2), 5- 25.
- 23- Feshari, M. (2017). A Study of the Periodic Nature of Government Expenditure Shocks on Iran's Economic Growth (Markov Nonlinear Approach to Markov Rotation Model), *Econometric Modeling Quarterly*, 2 (2), 116- 89. (In Persian)

- 24- Furceri, D., & Zdzienicka, A. (2010). The Effects of Social Spending On Economic Activity: Empirical Evidence from A Panel of OECD Countries. *OECD and University of Palermo*, 1-30.
- 25- Fournier, J.M., & Johansson, A. (2016). The Effect of the Size and the Mix of Public Spending on Growth and Inequality. Organization of Cooperation and Development Economies Organization for Economic Co-operation and Development, *Economics Department Working Paper*, No. 1344.
- 26- Forte, F., & Magazzino, C. (2011). Optimal Size Government and Economic Growth in EU Countries. Article in Economic Political.
- 27- Gavin, M., & Perotti, R. (1997), Fiscal Policy in Latin America, in B. Bernanke and J. Rotemberg, eds., *NBER Macroeconomics Annual*.
- 28- Ghasemi, M., & Mohajeri, P. (2015). Investigating the Cyclical Behavior of Fiscal Policy in Iran. *Journal of Economic Research*, 15 (56), 104-75. (In Persian)
- 29- Galal Eid, A., & Awad, I.L. (2017). Government Expenditure and Private Sector Growth in Saudi Arabia: A Markov Switching Model Analysis. *Economic*, 22(2), 83-104.
- 30- Granger, C. W., & Yoon, G. (2002). Hidden Integration. University of California San Diego. *Economics Working Paper Series*, 2.
- 31- Haile, F., & Nino-Zarazua, M. (2018). Dose Social Spending Improve Welfare in Low-Income and Middle Income Countries? *Journal of International Development*, 30, 367-398.
- 32- Hasnul, A.G. (2016). The Effects of Government Expenditure On Economic Growth: The Case of Malaysia, INCEIF, Global University of Islamic Finance, *MPRA Paper*, No. 71254.
- 33- Hosseini, S. M., Abdi, A., Gheibi, A., & Fadaei, I. (2008). The Combination of the Components of Government Spending and its Impact on Economic Growth and the General Government Budget Chapters, *journal to Research and Economic Policies*, 16 (48), 63-37. (In Persian)
- 34- Isazadeh, S., & Ahmadzadeh, A. (2009). Investigating the Effect of Institutional Factors on Economic Growth with Emphasis on Governance Institutions (Interstate Case Study for 1996-2015). *Iranian Journal of Economic Research*, 13 (40). 28-1. (In Persian)
- 35- Jouini, J. (2018). Measuring The Macroeconomic Impacts of Fiscal Policy Shocks in The Saudi Economy: A Markov Switching Approach. *Romanian Journal of Economic Forecasting*, Xxi (4). 55-70.

- 36- Joharji, G, Starr, M. (2011). Fiscal Policy and Growth in Saudi Arabia. *Review of Middle East Economics and Finance*, 6(3), 24-45.
- 37- Kaur, B., Misra, S., & Suresh, A. K. (2013). Cyclicalities of Social Sector Expenditures: Evidence from Indian States. Reserve Bank of India *Occasional Papers*. 34(1 & 2). 1-36.
- 38- Khanzadi, A., Fattahi, Sh., & Moradi, S. (2014). Investigating the Effects of Government Health Expenditures on Human Development in Iran. *Quarterly Journal of Economics and Modeling*, Shahid Beheshti University, 7 (25), 149-130. (In Persian)
- 39- Kaldor, M. (1976). The military in development. *World Development*, 459-482.
- 40- Kormendi, R. C., & Meguire, P. (1986). Government debt, Government Spending, and Private Sector Behavior: Reply. *American Economic Review*, 76(5), 1180-1187.
- 41- Knight, J., & Sabot, R.H. (1983). Educational Expansion and the Kuznets Effect. *American Economic Review*, 73(5), 1132-1136.
- 42- MCCulloch, N., & Winter, L., & Cirera, X. (2003). Trade Liberalisation and Poverty: A Handbook. *Centre for Economic Policy Research*, 1-384.
- 43- Monnin, P. (2014). Inflation and Income Inequality in Developed Economies. *CEP Working Paper*, No.653, 23-45.
- 44- Munene, M.J., Mbuthia, A., & Manyasa, E. (2015). The Optimal Size of Government Expenditure and Economic Growth in KENYA 1963 – 2012, A Research Project Submitted to The Department of Economic Theory in Partial Fulfillment of the Requirements for a Ward of the Degree of Masters in Economics of Kenyatta University, 1-47.
- 45- Menla, A. F., & Dimitrakib, O. (2014). Military Spending and Economic Growth in China: A Regime-Switching Analysis. *Applied Economics*, 46(28), 3408-3420.
- 46- Mahmoudzadeh, M., Sadeghi, S., & Sadeghi, S. (2011). The Effect of Financial Expenditures on Private Investment in Iran (C.O.E. Hypothesis Test). *Journal of Planning and Budget*, 16 (2), 146-131. (In Persian)
- 47- Mohebbi, A. (2008). Economic Security Measures. *Quarterly Journal of Legal Perspectives*, 202-226. (In Persian)
- 48- Nademi, Y., & Baharvand, V. (1397). Modeling Factors Affecting Economic Growth in Iran: Markov Switching Garch Approach, *Quarterly Journal of Fiscal and Economic Policy*, 6 (24), 33-58. (In Persian)
- 49- Narayan, P. K., & Narayan, S. (2004). Estimating Income and Price Elasticity's of Imports for Fiji in a Cointegration Framework, *Economic Modeling*, 22, 423-438.

- 50- Perotti, R., (1999). Fiscal Policy When Things Are Going Badly. *Quarterly Journal of Economics*, 114, 1399–1436.
- 51- Perotti, R. (2004). Estimating The Effects of Fiscal Policy in OECD Countries. University of Bocconi, *Working Paper*, 276.
- 52- Pragidis, I. C., Tsintzos, P., & Plakandaras, B. (2018). Asymmetric Effects of Government Spending Shocks During the Financial Cycle. *Economic Modelling*, 68, 372-387.
- 53- Rafiq, S., & Zeufack, A. (2012). Fiscal Multipliers Over the Growth Cycle Evidence from Malaysia, *Policy Research Working Paper*, 5982.
- 54- Rezaeipour, M., & Aghaei Akhondabi, M. (2011). Where Government Spending is on the Actual Consumption of the Private sector. *Quarterly Journal of Economic Research and Policy*, 19 (60), 160-139. (In Persian)
- 55- Romer, R. (1992). What Ended the Great Depression? *The Journal of Economic History*, 52(4), 757-784.
- 56- ShamsAldini, A., & Gorjian, P. (2010). Factors affecting the migration of villagers to cities, with emphasis on the migration network (Case: Rostam Do village). *Human Settlement Planning Studies (Geographical Landscape)*, 5(11), 87-105. (In Persian)
- 57- Shin, Y., Yu, B., & Greenwood-Nimmo, M. (2014). Modelling Asymmetric Co Integration and Dynamic Multipliers in a Nonlinear ARDL Framework, *Festschrift in Honor of Peter Schmidt*. Springer, New York, 281–314.
- 58- Schorderet, Y. (2001). Revisiting Okuns Law: An Hysteric Perspective. Unpublished Manuscript, *University of California San Diego*.
- 59- Sheehey, A. J. (1993). The Effect of Government Size on Economic Growth. *Eastern Economic Journal*, 19(3), 321-328.
- 60- Schorderet, Y. (2003). Asymmetric Co Integration. University de Geneve Faculte des Sciences Economies at Socials. Revisiting Okun's Law: An Hysteretic Perspective. *Mimeo: University of California San Diego*.
- 61- Suri, Ali. (2019). *Econometrics*, Volume One, Eighth Edition, Tehran: Cultural geology Publishing. (In Persian)
- 62- Sutherland, A. (1997). Fiscal Crises and Aggregate Demand: Can High Public Debt Reverse the Effects of Fiscal Policy. *Journal of Public Economics*, 65.
- 63- Stowe, K. (1992), Good Piano Won't Play Bad Music: Administrative Reform and Good Governance, *Public Administration*, 70, 387-394.
- 64- Tornell, A., & Lane, P. (1999), The Voracity Effect, *American Economic Review*, 89, 22-46.

- 65- Transpaerency International. (2020). The Global coalition against corruptin. *Transpaerency International Report*.
- 66- Vedder, R.K., & Gallaway, L.E. (1998). Government Size and Economic Growth. Joint Economic Committee G-01 Dirksen Building Washington DC, 20510.
- 67- Vianna, A. C., & Mollick, A. V. (2018), Institutions: Key Variable for Economic Development in Latin America, *Journal of Economics and Business*, 96, 42-58.
- 68- Zubairi, H., & Salahi Kojoor, S. (2019). The Effect of Judicial Independence on GDP (inter-country Study Using Panel Data Method). *Quarterly Journal of Econometric Modeling*, 3 (3), 63-82. (In Persian)
- 69- Zamani Shabkhaneh, S., & Mehregan, N. (2014). Investigating the effect of urbanization on income distribution in Iran with emphasis on Kuznets theory. *Quarterly Journal of Planning and Budgeting*, 3 (18), 3-19. (In Persian).

