

The curse of oil, taxes, and democracy in oil- dependent countries: The application of the systematic GMM approach

Marzieh Rasouli*

Hamid Sepherdoost**

Sayyed Ahsan Hosseini Doost***

Abstract

In the past few decades, the harmful effect of dependence of governments on the income of abundant oil resources in the economy of developing countries has received a lot of attention; So that the discussion about its results, such as the wealth of abundant oil resources, can negatively affect the governance and state of democracy of a country has been raised. The political and economic inefficiency known as the "curse of oil" is a complex and structural phenomenon that is mainly caused by poor management or poor investment of oil revenues by the governments of oil-producing countries. The purpose of this research is to compare the relationship between oil revenues and tax revenues on democracy in oil-dependent countries with medium income and also oil-dependent countries with high income using the Systemic Generalized Moments (SYS-GMM) approach. For this purpose, data related to the dependent variable of democracy and independent variables, oil revenues, tax revenues, economic growth, GDP per capita, and population for 10 countries with high oil income and 21 countries with medium oil income including Iran during the years 1980 to 2018 was analyzed. In summary, the results of the study and estimation of the model showed that with the increase of oil and tax revenues in countries with high oil income, the level of democracy has improved; while for countries with medium oil income, the increase in oil and tax revenues leads to a decrease in the level of democracy and the phenomenon of oil curse is confirmed.

Keywords: Democracy, Oil Revenues, Tax Revenues, Oil-rich Countries, GMM.

Classification JEL: O57, P16, Q38, Q34.

* Doctoral student of Economics, Bo Ali Sina University, Hamedan, m_rasuli83@yahoo.com.

** Professor of Economics, Bo Ali Sina University, Hamadan (corresponding author), hamidbasu1340@gmail.com.

*** Assistant Professor of Economics, Bo Ali Sina University, Hamedan, hosseinidoust@basu.ac.ir.

نفرین نفت، مالیات و دموکراسی در کشورهای وابسته به نفت:

کاربرد استفاده از رویکرد GMM سیستمی

مرضیه رسولی*

حمید سپهر دوست**

سید احسان حسینی دوست***

چکیده

در چند دهه گذشته، اثر زیان بار وابستگی دولت‌ها به درآمد منابع فراوان نفتی در اقتصاد کشورهای در حال توسعه مورد توجه زیادی قرار گرفته است؛ به طوری که بحث در مورد نتایج آن از جمله این موضوع مطرح شده است که ثروت منابع فراوان نفتی می‌تواند بر حاکمیت و وضعیت دموکراسی یک کشور تأثیر منفی بگذارد. ناکارآمدی سیاسی و اقتصادی معروف به «نفرین نفت» نشان‌دهنده یک پدیده پیچیده و ساختاری است که به‌طور عمده ناشی از مدیریت یا سرمایه‌گذاری ضعیف درآمدهای نفتی توسط دولت‌های کشورهای تولیدکننده نفت است.

هدف از این پژوهش، بررسی مقایسه‌ای رابطه درآمدهای نفتی و درآمدهای مالیاتی بر دموکراسی در کشورهای وابسته به نفت با درآمد متوسط و کشورهای وابسته به نفت با درآمد بالا با استفاده از رویکرد گشتاورهای تعمیم‌یافته سیستمی (SYS-GMM) است. برای این منظور داده‌های مرتبط با متغیر وابسته دموکراسی و متغیرهای مستقل، درآمدهای نفتی، درآمدهای مالیاتی، رشد اقتصادی، تولید ناخالص داخلی سرانه و جمعیت برای ۱۰ کشور با درآمد بالای نفتی و ۲۱ کشور با درآمد متوسط نفتی شامل ایران طی سال‌های ۱۹۸۰ الی ۲۰۱۸ تجزیه و تحلیل شد. به‌طور خلاصه، نتایج مطالعه و تخمین مدل نشان داد که با افزایش درآمدهای نفتی و مالیاتی در کشورهای با درآمد بالای نفتی، سطح دموکراسی بهبود یافته است؛ در حالی که برای کشورهای با درآمد متوسط نفتی، افزایش درآمدهای نفتی و مالیاتی به کاهش سطح دموکراسی منجر و پدیده نفرین نفت تأیید می‌شود.

واژگان کلیدی: دموکراسی، درآمدهای نفتی، درآمدهای مالیاتی، کشورهای نفت‌خیز، روش گشتاورهای

تعمیم‌یافته سیستمی (GMM)

طبقه‌بندی JEL: Q34, Q38, P16, O57

۱. مقدمه

نفت و وابستگی اقتصاد جامعه به فعالیت‌های مرتبط با آن، از موضوعاتی است که از آن به‌عنوان چالش جدی برای توسعه پایدار کشورهای نفت‌خیز یاد می‌شود و پدیده‌هایی همچون بیماری هلندی و نفرین منابع از آثار زیان‌بار این وابستگی است. در این رابطه، حکومت‌هایی که دارای منابع سرشار نفتی هستند، تمایل دارند از ابزار درآمدهای حاصل از فروش نفت خود به همراه کاهش یا حذف مالیات‌ها برای کاهش فشارهای اجتماعی در کشور استفاده کنند که ممکن است به درخواست برای پاسخگویی بیشتر حکومت منجر شود.

هم‌اکنون، اصطلاح نفرین نفت به دلیل وابستگی بیشتر فعالیت‌های اقتصادی به نفت، ریشه مشکلات بسیاری از کشورها مانند ونزوئلا و اکوادور محسوب می‌شود؛ درحالی‌که برخورداری از ذخایر نفتی برای برخی دیگر از کشورها مانند نروژ، از آن به‌عنوان موهبت یاد کرده و کشور را به یکی از ثروتمندترین اقتصادهای جهان تبدیل نموده است. در واقع، تجربه کشورهای مختلف در مواجهه با این موضوع یعنی وجود نفت متفاوت است؛ به طوری که فراوانی نفت توانسته برای توسعه کشورهایمانند سیرالئون، لیبیا و جمهوری دموکراتیک کنگو کمک‌کننده باشد؛ درحالی‌که برای کشورهایمانند استرالیا، آفریقای جنوبی یا بوتسوانا این مورد صدق نمی‌کند.

به‌عنوان مثال، کشور بوتسوانا به‌عنوان یکی از سریع‌ترین اقتصادهای جهان در ۳۰ سال گذشته بوده است (رایت، ۲۰۱۵^۱). در همین کشور، حزب دموکرات بوتسوانا از زمان استقلال در سال ۱۹۶۶ کنترل کاملی بر دولت داشته و پس از انتخابات با هیچ مخالفتی روبه‌رو نشده است. این کشورها معمولاً در استفاده از درآمدهای نفتی هدف دیگری هم دارند و آن مدیریت و حفظ قدرت است (راس، ۲۰۰۱^۲).

طی چند دهه گذشته، مطالعات بسیاری توسط پژوهشگران و سیاست‌گذاران برای توضیح طیف گسترده‌ای از بیماری‌های اقتصادی مانند بیماری هلندی در کشورهای دارای منابع سرشار نفتی، به‌ویژه در آفریقا، خاورمیانه، آمریکای لاتین، اتحاد جماهیر شوروی سابق و دیگر کشورهای مبتلابه صورت پذیرفته که هدف اصلی آن پاسخ به این سؤال بود که آیا ثروت منابع طبیعی مانند نفت به اختلال در عملکرد سیاسی منجر می‌شود؟ در همین رابطه ابتکارات جدیدی برای جلوگیری از نفرین نفت توسط بانک جهانی، گروه بیست کشور بزرگ (G20) و برنامه توسعه سازمان ملل آغاز شد؛ به طوری که از سال ۲۰۰۱ تا ۲۰۱۳ شواهد قابل توجهی وجود دارد که نشان می‌دهد تحت برخی شرایط، نفت به‌جای موهبت، نعمت را ایجاد می‌کند.

1. Wright

2. Ross

اثرات نامطلوب درآمدهای نفتی یک کشور بر رفاه اقتصادی، اجتماعی یا سیاسی آن به‌عنوان نفرین نفت تعریف می‌شود. این اصطلاح برای نخستین بار توسط جغرافیدان اقتصادی آوتی^۱ در سال ۱۹۹۳ استفاده شد. در این رابطه، راس (۲۰۰۱) معتقد است که درآمد مستقیم و قابل توجه بخش منابع طبیعی در این کشورها، وابستگی دولت به درآمدهای مالیاتی را کاهش داده و تمایل دولت به پاسخگویی را کاهش می‌دهد. همچنین، دولت با توزیع درآمدهای حاصل از این نوع منابع طبیعی مانع از مطالبه جدی مردم جهت پاسخگویی بیشتر می‌شود (فلاحی و همکاران، ۱۳۹۳).

مجموعه‌ای از ناکارآمدی‌های سیاسی و اقتصادی که تقریباً همه کشورهای تولیدکننده نفت را تا حدودی تحت تأثیر قرار می‌دهد و از آن تحت عنوان نفرین نفت یاد می‌شود، مطالب زیادی نوشته شده است و به‌طور عمده بر روی این نکته تأکید دارند که حضور نفت در یک کشور می‌تواند مزایای عمده‌ای داشته باشد و به‌طور خودکار به این امر منجر نمی‌شود. اگر دولت درآمدهای نفتی را درست یا کارآمد مدیریت نکند، هجوم عظیم درآمدهای نفتی می‌تواند مبانی اقتصادی کشور را مخدوش و فساد را تشدید کند. کشورهایی که نفت دارند دو برابر بیشتر از کشورهایی که نفت ندارند، درگیری‌های سیاسی و اقتصادی را تجربه می‌کنند (الجمال و مایرز جافه، ۲۰۰۹).

مسئله اصلی پژوهش، پاسخ به این سؤال است که آیا ارتباط معناداری بین دولت‌های رانتی با تکیه بیشتر بر درآمدهای حاصل از منابع طبیعی و تجدیدنپذیر مانند نفت و تکیه کمتر به درآمد مالیاتی و سطح دموکراتیک بودن نظام حکومتی در حوزه پاسخگویی به مردم وجود دارد؟ و چنانچه پاسخ مثبت است آیا به‌طور مقایسه‌ای تفاوت معناداری بین کشورهای بالا درآمدی و پایین درآمدی از این لحاظ وجود دارد؟

درواقع، این علیت از سمت متغیرهای اقتصادی هست؛ درحالی‌که در بیشتر مطالعات که در قسمت پیشینه آورده شده است علیت از سمت متغیر سیاسی دموکراسی بر متغیرهای اقتصادی بررسی شده است. همچنین، در مطالعات مرتبط، تمامی کشورهای نفتی اعم از درآمد بالا و متوسط و پایین در یک دسته با هم مطالعه شدند که نتیجه مبنی بر وجود نفرین برای تمامی کشورهاست؛ درحالی‌که مثلاً کشوری مانند نروژ از نفرین در امان بوده و مطالعات زیادی از جمله هلدن^۳ (۲۰۱۳) نیز به این مهم اشاره کرده‌اند.

در این مطالعه دو گروه کشورها به‌طور مجزا بررسی شده‌اند. مطالعه حاضر، در رابطه با نفرین نفت، به بررسی رابطه بین دموکراسی و مالیات و درآمد نفتی در دو گروه کشورهای با درآمد بالا و

1. Auty

2. El-Gamal and Myers Jaffe

3. Holden

درآمد متوسط نفت خیز طی سال‌های ۲۰۱۸-۱۹۸۰ پرداخته است. وجه تمایز و نوآوری این مطالعه با پژوهش‌های پیشین در بررسی مقایسه‌ای این پدیده با اهمیت اقتصادی بین دو گروه درآمدی متوسط و بالا از کشورهای نفت خیز به همراه در نظرگیری وضعیت دیگر درآمدهای غیرنفتی کشورها یعنی مالیات‌ها، با استفاده از روش گشتاورهای تعمیم یافته سیستمی^۱ (SYS-GMM) است. پس می‌توان فرضیه این پژوهش را به این گونه نوشت: بررسی اثر دو نوع درآمد مالیاتی و درآمد نفتی در دو گروه کشورهای نفتی با درآمد بالا و درآمد متوسط بر سطح دموکراسی.

۲. ادبیات موضوع

۲-۱. درآمدهای نفتی و دموکراسی

اصطلاح دموکراسی به معنای حکومت توسط مردم، از واژه یونانی *dēmokratia*، شامل دو جزء مهم *dēmos* (مردم) و *kratos* (حکومت) در اواسط قرن پنجم قبل از میلاد گرفته شده و به نظام‌های سیاسی موجود در برخی از دولت‌شهرهای یونان به ویژه آتن اشاره دارد. دموکراسی از زمانی که پریکلس^۲ آن را حکومت مردم تعریف کرد تا به امروز که در مجامع مختلف نظریه پردازی غرب، تحکیم و گسترش آن کار اساسی و تخصصی دولت معرفی می‌شود، تحولات زیادی داشته است.

دموکراسی را نمی‌توان جدا از شرایط اقتصادی و اجتماعی زندگی بررسی کرد؛ بلکه باید وضع واقعی و عملی جامعه را در نظر داشت. در این رابطه، ادبیات اقتصاد سیاسی مدرن استدلال می‌کند که اتکای اقتصادی و مالی کشورها به نفت، گاز طبیعی و مواد معدنی، به ایجاد و تداوم رژیم‌های سیاسی اقتدارگرا در این کشورها کمک می‌کند. پیدایش این ایده را می‌توان در مطالعات بسیاری یافت که درآمدهای نفتی در کشورهای خاورمیانه منبع رانت است و به طور مستقیم توسط دولت‌ها تصرف می‌شود تا آنها را نسبت به شهروندان پاسخگو نکند (مهدوی، ۱۹۷۰).

به همین دلیل، هانتینگتون^۳ (۱۹۹۱) تأکید می‌کند وقتی درآمدهای نفتی به دولت تعلق می‌گیرد، این امر قدرت بوروکراسی دولتی را افزایش می‌دهد و با این عمل چون نیاز به درآمدهای مالیاتی کاهش می‌یابد یا از بین می‌رود، نیاز دولت به پاسخگویی نیز کاهش می‌یابد. همچنین، هرب^۴ (۲۰۰۵) می‌نویسد تأثیر منابع طبیعی بر نوع رژیم سیاسی حاکم بر جوامع، مشروط به عوامل

1. Generalized Method of Moments
2. Pericles
3. Huntington
4. Herb

دیگر مانند ویژگی‌های منابع طبیعی، حکمرانان و چارچوب و قوانین نهادی نیز هست؛ به طوری که دانیگ^۱ (۲۰۰۸) و مانزانو و مونالدی^۲ (۲۰۰۸) در بررسی‌های خود به این نتیجه اشاره می‌کنند که ذخایر نفت جهان دقیقاً در کشورهایی متمرکز شده است که ظرفیت دولتی ضعیفی دارند و همان طور که تعدادی از مطالعات موردی نشان داده‌اند، ظرفیت ضعیف دولت قبل از کشف نفت یا دیگر مواد معدنی در آن کشورها وجود دارد (هابر و همکاران، ۲۰۰۳).

دولت رانتی با اتکای به درآمد حاصل از فروش نفت، به دو دلیل در جایگاه قدرت نسبت به جامعه قرار می‌گیرد: نخستین و مهم‌ترین این دلایل، بی‌نیازی دولت‌ها نسبت به مالیات ستانی است و دلیل دوم که بی‌ارتباط با دلیل اول نیز نیست، بی‌نیازی آنها به توسعه اقتصادی است. در ارتباط با ویژگی‌های دولت رانتی متکی بر درآمدهای حاصل از فروش نفت، لوچیان^۴ (۱۹۸۷) با تأکید بر بیرونی بودن این گونه منابع درآمدی دولت، به تفکیک بین دولت رانتی و آنچه آنان دولت سرمایه‌داری یا مولد می‌نامیدند پرداخته و می‌نویسند دولت مولد به دلیل نیاز به تأمین هزینه‌های خود از طریق تولید داخلی ناچار به گسترش درآمدهای مالیاتی به همین واسطه است؛ در حالی که دولت رانتی می‌تواند اقتصاد خود را بدون داشتن یک بخش اقتصادی مولد پیش ببرد (ببلاوی،^۵ ۱۹۸۷). با توجه به نظریه دولت رانتی، ادبیات نفرین منابع سیاسی ادعا می‌کند که ثروت نفت، خودکامگی را ریشه‌دار می‌کند و مانع دموکراسی می‌شود (اندرسون، ۱۹۸۷؛ ببلاوی و لوسیانی، ۱۹۸۷؛ جنسن و وانتچکن، ۲۰۰۴؛ راس، ۲۰۰۱).

منتقدان ادعا می‌کنند که این ارتباط منفی دور از قطعیت است؛ اما در مناطق جغرافیایی مانند خاورمیانه و شمال آفریقا نفرین نفت وجود دارد. برخی دیگر استدلال می‌کنند که نفت ممکن است مانع دموکراسی نباشد و حتی می‌تواند در دیگر مناطق جغرافیایی مانند آمریکای لاتین موهبت باشد (اسمیت و کراوس،^۶ ۲۰۰۵؛ دانیگ، ۲۰۰۸).

۲-۲. درآمدهای مالیاتی و دموکراسی

مالیات به معنای پرداختی است که در آن مؤدیان داوطلبانه در ازای دریافت خدمات دولتی به حاکمان می‌دهند. شهروندان می‌توانند از این سیاست خارج شوند، تولید را کاهش دهند یا از

1. Dunning

2. Manzano & Monaldi

3. Haber et al.

4. Luciani

5. Beblawi

6. Krauss

مالیات فرار کنند که همه اینها برای حاکمان پرهزینه است. مالیات باعث افزایش توجه شهروندان به مسئولیت پذیری دولت در استفاده از درآمدهای مالیاتی می شود (بتس و لین،^۱ ۱۹۸۵؛ هانتینگتون، ۱۹۹۱؛ رایبسون، توریک و وردیر،^۲ ۲۰۰۶؛ پالر،^۳ ۲۰۱۳). از طرف دیگر، نفت و کمک های خارجی، دولت ها را از مالیات و در نتیجه پاسخگویی دور می کند؛ زیرا اعتقاد بر این است که بودجه حاصل از درآمد نفت و کمک ها با نوسان زیاد همراه است که باعث تخفیف بار مالیاتی و آرامش شهروندان می شود (موریسون،^۴ ۲۰۰۹ و ۲۰۱۵).

هابر و منالدو^۵ (۲۰۱۱) معیار انکای مالی را به عنوان سهم درآمد منابع نفتی فراوان از کل درآمد دولت تعریف می کنند. معمولاً فقط دولت هایی که از منابع مالی غیر مالیاتی مانند نفت برخوردارند، قادر به مقاومت در برابر مخالفت سیاسی از طریق سرکوب یا گسترش هزینه های عمومی و حمایت از آنها خواهند بود. به این دلیل، دولت هایی که به درآمد مالیاتی بسیار اعتماد می کنند، نیاز به معامله و همراهی با مؤدیان، پذیرفتن پاسخگویی و دموکراسی بیشتر در ازای پرداخت مالیات دارند. دولت مولد به دلیل نیاز به تأمین هزینه های خود از طریق تولید داخلی ناچار به گسترش درآمدهای مالیاتی است؛ در حالی که دولت رانته قادر است اقتصاد خود را بدون داشتن یک بخش اقتصادی مولد پیش ببرد.

بدیهی است که فقدان یک بخش اقتصادی مولدی که دولت به تولید آن متکی و به مالیات آن نیازمند باشد، دولت را هم از نظر اقتدار سیاسی در موقعیتی برتر و هم از نظر عدم اجبار به چانه زنی با جامعه قرار می دهد. مهم ترین بخش این استدلال، ناظر بر ارتباط میان مالیات ستانی و دموکراسی است. استدلالی که به طور خلاصه بیان می کند دولت رانته به دلیل عدم نیاز به مالیات ستانی از مردم، نیازی به پاسخگویی به مردم در مقام کنش گران سیاسی در مورد تصمیم گیری هایش نخواهد داشت؛ به دیگر سخن، استقلال سیاسی دولت به نحوی ساختاری نتیجه استقلال اقتصادی در معنای مالیاتی است و هرچقدر، درآمد حاصل از فروش نفت افزایش می یابد و سهم بزرگ تری از درآمد دولت را تشکیل می دهد، به همان اندازه بر میزان این استقلال افزوده می شود (بیلوی، ۱۹۸۷).

1. Bates & Lien

2. Robinson, Torvik & Verdier

3. Paler

4. Morrison

5. Haber & Menaldo

۲-۳. رشد اقتصادی و دموکراسی

در ادبیات اقتصادی، بین دو متغیر رشد اقتصادی و ساختار سیاسی رابطه متقابلی تحت عنوان اقتصاد سیاسی وجود دارد و بیان‌کننده این نکته مهم است که دوام هر ساختار سیاسی، چه ساختار دیکتاتوری و چه دموکراسی به رشد و توسعه و کیفیت سیاست‌های اقتصادی دولت وابسته است. به‌همین دلیل، برنامه‌ریزان تأکید دارند که آزادی سیاسی، آزادی اقتصادی، ثبات سیاسی و قابل‌پیش‌بینی بودن سیاست‌های اقتصادی، لازمه رشد و توسعه اقتصادی بلندمدت است؛ به‌طوری‌که مشروعیت سیاسی دولت لازمه رشد پایدار و پیوسته اقتصاد بوده و موجب ثبات سیاسی، کاهش ریسک سرمایه‌گذاری، جلب سرمایه‌گذاری خارجی و داخلی و درنهایت افزایش رشد اقتصادی می‌شود (زمانی، ۱۳۸۳).

در زمینه اثرات حاصل از رشد و بهبود رفاه مادی بر دموکراسی تحقیقات بولن و چاکمن^۱ (۱۹۸۵) نشان داد که سطح رشد و توسعه اقتصادی تأثیر شایانی بر دموکراسی دارند. هانتینگتون (۱۹۹۱) و چن و فنگ^۲ (۱۹۹۹) در بررسی‌های خود دریافتند که گذار به سطوح متفاوتی از دموکراسی، به سطح خاصی از توسعه اقتصادی و هزینه برقراری و حفظ رژیم دموکراتیک بستگی دارد. همچنین، بارو^۳ (۱۹۹۴) در بررسی مورد مطالعه خود، به پشتوانه‌های محکمی در رابطه با اثر مثبت شکوفایی اقتصادی بر دموکراسی دست یافت و نتیجه گرفت که افزایش در استانداردهای زندگی، گرایش به افزایش تدریجی بیشتری در دموکراسی دارند. اندیشمندان علوم سیاسی نیز، همانند دال^۴ (۱۹۹۸) بر این نظرند که در بلندمدت، سرمایه‌داری بازار سبب رشد اقتصادی می‌شود و رشد اقتصادی نیز به نفع دموکراسی است؛ زیرا رشد اقتصادی، موجب از بین رفتن فقر شدید و بهبود سطح زندگی می‌شود و این امر به کاهش تضادهای اجتماعی و سیاسی منجر خواهد شد؛ بنابراین، می‌توان گفت اثر دموکراسی و رشد اقتصادی، رابطه دو سویه و تقویت‌کننده یکدیگر است.

۲-۴. تولید ناخالص داخلی سرانه و دموکراسی

در ارتباط با اثر تولید ناخالص داخلی سرانه و دموکراسی و برعکس، لیپست^۵ (۱۹۵۹) یک همبستگی قوی و مثبت بین درآمد سرانه و دموکراسی را در بخشی از کشورها گزارش کرد و با انجام

1. Bollen and Chakman

2. Chen and Feng

3. Barro

4. Dahl

5. Lipset

این کار، نه تنها پایه‌های نظریه مدرنیزاسیون را در سیاست تطبیقی پی‌ریزی نمود، بلکه در اقتصاد سیاسی بر رابطه بین درآمد و دموکراسی از طریق رابطه بین نهادهای سیاسی و توسعه اقتصادی، به تفسیری پویا و علی پرداخت. این درحالی است که یافته‌های پژوهش‌های همکاران^۱ (۲۰۰۰) به هنگام تخمین مدل‌های انتقال مارکوف، رابطه معناداری بین سطح درآمد سرانه و احتمال گذار به دموکراسی به دست نیاوردند.

منتقدان نظریه رابطه قوی بین درآمد سرانه و دموکراسی متعلق به لیپست، نظیر طرفداران نظریه مدرنیزاسیون و اقتدارگرایی بوروکراتیک (اودانل،^۲ ۱۹۸۶) استدلال می‌کنند که توسعه به شرایط مطلوب در جذب سرمایه‌گذاری بین‌المللی منجر می‌شود که ضمن تأمین شرایط اقتصادی مطلوب، می‌تواند از طریق سرکوب اجباری باشد یا محدودیت‌هایی را برای انتخاب سیاست‌های دولت‌های جهان سوم ایجاد کند (بتس و لین، ۱۹۸۵). در این رابطه، راس (۲۰۰۱) معتقد است که سه کانال وجود دارد که از طریق آنها رشد اقتصادی وابسته به درآمدهای حاصل از منابع طبیعی (نفت و مواد معدنی) مانع دموکراتیک شدن می‌شود:

اول، دولت‌هایی که درآمدهای نفتی زیادی دارند، می‌توانند فشارهای اجتماعی را کاهش دهند که در غیر این صورت ممکن است به مطالبات برای پاسخگویی بیشتر منجر شود. آنها این کار را از طریق دریافت مالیات کمتر از مردم، هزینه‌های حمایتی و جلوگیری از تشکیل گروه‌های اجتماعی مستقل انجام می‌دهند که تمایل بیشتری به مطالبه حقوق سیاسی دارند. معمولاً نهادهای دموکراتیک تمایل دارند که نسبت به نیروی کار دوستانه‌تر باشند؛ زیرا آنها با دستمزدهای بالاتر و سهم عوامل بیشتری برای نیروی کار در تولید مرتبط هستند (رودریک، ۱۹۹۷).

دوم، دولت‌های سرشار از منابع نفتی برای حفظ نظم و جلوگیری از آرمان‌های دموکراتیک شهروندان خود، هزینه‌های بیشتری را برای امنیت داخلی مانند نیروهای نظامی هزینه می‌کنند؛ سوم، اگر رشد مبتنی بر منابع به سطوح آموزش عالی و تخصص شغلی بیشتر منجر نشود، باید در ایجاد دموکراسی نیز شکست بخورد. به‌طور کلی، دموکراسی در کشورهایی ظهور می‌کند که بازدهی بالایی از سرمایه متحرک در بخش‌های مالی، جمعیت بسیار ماهر دارند نه به دلیل برخورداری از سرمایه ثابت نفت و درآمد بالای آن (بویکس و استاکس،^۳ ۲۰۰۳). در این دیدگاه، دموکراسی، انفجاری از تقاضاها برای مصرف فعلی را ایجاد می‌کند. این تقاضا به‌نوبه خود تهدیدی برای سود است. از این رو سرمایه‌گذاری را کاهش داده و رشد را به تأخیر می‌اندازند؛ به طوری که درآمد ملی

1. Przeworski et al.

2. Guillermo and O'Donnell's

3. Boix and Stokes

می تواند از طرف سرمایه گذاری به سمت مصرف حرکت کند و در نتیجه به کاهش رشد اقتصادی منجر می شود (هانتینگتون و دومینگوئز،^۱ ۱۹۷۵؛ پرزورسکی و لیمونگی،^۲ ۱۹۹۳).

۲-۶. جمعیت و دموکراسی

در حال حاضر دنیا در حال تجربه دو دگرگونی عمیق جمعیتی است که در دهه های آینده، حکومت ها و روابط بین الملل آنها را به چالش می کشد. چنانچه این تغییرات مداوم با چشم انداز، آینده نگری و انعطاف مدیریت شوند، می توانند بسیاری از دموکراسی های صنعتی پیشرفته به ویژه در آسیا و اروپا را به گونه ای تغییر دهند که آنها را متنوع تر، پویا تر و انعطاف پذیرتر نمایند. جمعیت ژاپن طی سال های ۱۹۵۵ تا ۱۹۷۵ به طور سالیانه ۱٪ تا ۱/۴٪ افزایش یافت. کشور کره در همان دوره، ۲٪ یا بیشتر در سال رشد کرد. کشورهای اروپای طی سال های ۱۹۵۰ الی ۱۹۶۵ با رشد ۱٪ تا ۱/۴٪ مواجه بوده است. همچنین، ایالات متحده تا سال ۲۰۰۰ نرخ رشد جمعیت را در سطح یا بالاتر از ۱٪ در سال داشت (سازمان ملل متحد،^۳ ۲۰۰۱).

مطالعات تجربی زیادی نشان دادند کشورهایی که دارای جمعیت به سرعت در حال رشد و بسیار جوان هستند و بیش از ۲٪ در سال رشد جمعیتی دارند، احتمال وقوع درگیری های سیاسی و اقتصادی در آنها بیشتر است. در این رابطه، سینکوتا^۴ (۲۰۱۶) نشان داده است که اگر رابطه بین سن متوسط و نمره های دموکراسی خانه آزادی^۵ بررسی شود، کشورهایی که در سال ۲۰۱۷ میانگین سنی ۲۵ سال یا کمتر داشتند، در سال ۲۰۱۸ تنها ۲۵٪ شانس داشتند که به عنوان کشور آزاد رتبه بندی شوند. میانگین سن از ۲۵ تا ۳۵ سال، این احتمال با افزایش سن به سرعت از ۲۵٪ به ۸۰٪ افزایش می یابد. برای کشورهایی با میانگین سنی ۳۶ سال و بالاتر، احتمال «آزاد» بودن به بیش از ۹۰٪ می رسد.

پیوند بین گذار جمعیتی و دموکراسی برای بسیاری عجیب به نظر می رسد؛ اما در واقع کاملاً منطقی است. اگر دموکراسی مستلزم استقلال شخصی و در نتیجه مخالف حمایت و وابستگی در نظر گرفته شود، به این معنا که وقتی مردم به دولت یا روابط غیر شخصی برای تأمین نیازهای ضروری مانند ایمنی فیزیکی، بیمه در مواقع بلایا، اطلاعات و دسترسی به مشاغل، اعتبار و اعتماد

1. Dominguez

2. Limongi

3. United Nations Population Division

4. Cincotta

۵. نشریه اصلی خانه آزادی، ارزیابی مقایسه ای استاندارد از حقوق سیاسی جهانی و آزادی های مدنی است که از سال ۱۹۷۲ هر سال منتشر می شود و رتبه بندی نظرسنجی و گزارش های روایتی در ۱۹۵ کشور و ۱۵ منطقه مرتبط و مورد مناقشه توسط سیاست گزاران، رسانه ها، شرکت های بین المللی، فعالان مدنی و مدافعان حقوق بشر را ارائه می دهد.

ندارند، به حامیان و خانواده بزرگ متکی خواهند شد (ولزل و اینگلهارت^۱ ۲۰۰۸). چنین شرایطی به شدت با دموکراسی دشمنی می‌کند؛ زیرا مردم از حامی یا گروه هویتی خود پیروی می‌کنند؛ رأی دادن به آنها در صورت برگزاری انتخابات اما صرف نظر از وفاداری به آنها. در این صورت، سیاست به رقابتی معنادار برای کسب آرا تبدیل نخواهد شد؛ بلکه به جنگ قدرت میان گروه‌های هویتی یا شبکه‌های حمایتی تبدیل خواهد شد. چنین رقابت‌هایی معمولاً به دموکراسی غیر لیبرال یا خشونت بین گروه‌ها ختم می‌شود که به شورش یا کودتا می‌انجامد (خان،^۲ ۲۰۰۵).

۳. مروری بر مطالعات پیشین

۳-۱. مطالعات داخلی

جعفری طادی و همکاران (۱۳۹۹) به بررسی اثر جایگزینی درآمد حاصل از نفت با درآمد مالیاتی بر شاخص نهادی حکمرانی در ایران پرداختند و الگوی اثر همزمان درآمدهای نفتی و مالیاتی بر شاخص کیفیت حکمرانی در ایران را با استفاده از روش رگرسیون انتقال ملایم (STR)^۳ طی دوره زمانی ۱۳۷۵-۱۳۹۶ تحلیل نمودند. نتایج بیان‌کننده وجود رابطه غیرخطی به شکل U معکوس بین سهم درآمد نفت از تولید ناخالص داخلی با شاخص نهادی حکمرانی خوب و رابطه مستقیم بین سهم درآمد مالیات از تولید ناخالص داخلی با شاخص یادشده است. از طرفی حد آستانه‌ای اثرگذاری درآمد نفت بر کیفیت حکمرانی برابر با ۲/۳۷۸ درصد بوده است. در مرحله بعدی اثر کاهش مسئولیت دولت از طریق کاهش فروش نفت و جایگزینی آن با درآمد مالیات به صورت سناریویی مبنی بر کاهش ۱۰٪ درآمد نفت و افزایش ۱۰٪ درآمد مالیات بررسی شد و نتایج نشان داد که این جایگزینی به ۱۱٪ بهبود در کیفیت حکمرانی در ایران منجر شده است.

امینی و علمی (۱۳۹۵) به بررسی، مقایسه و ارزیابی رویکردها در زمینه نفرین منابع طبیعی پرداختند و نتیجه گرفتند که صرف برخورداری از منابع طبیعی فراوان و ثروت مواد معدنی ضرورتاً به توسعه نیافتگی اقتصادی و سیاسی منجر نمی‌شود؛ بلکه به جای آن بهتر است به فراوانی منابع به عنوان شمشیری دو لبه نگاه کرد که هم مزایا و هم خطرهایی در پی دارد. به همان اندازه که برخورداری از منابع طبیعی فراوان ممکن است صرف امور غیرکارآمد شود، به کارگیری مناسب همراه با صرفه‌جویی و افزایش بهره‌وری در مصرف آن می‌تواند منافع بی‌شماری را به ارمغان آورد. همچنین، صامتی و اسمعیل درجانی (۱۳۹۲)، به بررسی تأثیر وفور منابع طبیعی بر

1. Welzel & Inglehart

2. Khan

3. Smooth Transition Regressions

سیاست‌های مالی دولت در ایران طی دوره ۱۳۸۷-۱۳۵۷ که در آن درآمدهای حاصل از صادرات نفت بخش مهمی بودجه سالانه ایران را تشکیل می‌داد با تأکید بر فرضیه نفرین منابع طبیعی در قالب یک مدل خطی پرداختند. یافته‌های تحقیق نشان داد ثروت بادآورده ناشی از منابع نفتی نیاز به مالیات ستانی را کاهش می‌دهد و کارایی سیستم مالیاتی را پایین می‌آورد.

۳-۲. مطالعات خارجی

بروکس و کورتز^۱ (۲۰۲۲) هزینه تولید و درآمد حاصل از تولید نفت را طی سال‌های ۱۹۸۰ تا ۲۰۱۲ برای کشورهای دارنده منابع زیرزمینی نفت اندازه‌گیری کردند تا پتانسیل رانت‌زایی آن را برای کشورهای یادشده با استفاده از همبستگی‌های مهم آن محاسبه کنند. نتایج نشان داد در کشورهای که هزینه تولید نفت پایین و سودآوری آن بالاست، نتایج زیان‌بار بر رژیم سیاسی مطابق با ادعاهای نفرین نفت مشاهده می‌شود؛ اما اگر هزینه تولید نفت بالا باشد، این ارتباط از دست می‌رود و ممکن است سرانجام با نتایج به‌نسبت دموکراتیک‌تر همراه شود. به‌دیگرسخن، تنها «تولید نفت با هزینه پایین» ممکن است نفرینی برای توسعه دموکراتیک باشد.

براهیم و سیدمنصوب^۲ (۲۰۲۰) به بررسی پیوند بین نفت و دموکراسی و مواجه شدن با چالش رویکرد نفرین نفت به کمک مجموعه داده‌های دموکراسی V-DEM برای یکصد کشور درحال توسعه شامل دو نمونه کوچک و بزرگ طی سال‌های ۱۹۳۵-۲۰۱۴، پرداختند. با نگاهی به منابع نفتی در دو منطقه آمریکای لاتین و خاورمیانه نتایج این بررسی، تفاوت‌های ظریفی در رابطه با نفت و دموکراسی را برجسته می‌کند.

اول اینکه، اگر نهادهای از پیش موجود کنترل نشوند که دموکراسی را ترویج می‌کنند، شواهد درظاهر برای نفرین منابع سیاسی وجود دارد؛ دوم، هنگامی که نمونه را به منابع نفتی کوچک و بزرگ تجزیه کردند، نفرین منابع سیاسی برای آمریکای لاتین از بین می‌رود؛ درحالی‌که برای اقتصادهای وابسته به نفت در خاورمیانه و شمال آفریقا همچنان باقی است؛ سوم، پس از کنترل کیفیت نهادی از قبل موجود که با حاکمیت قانون سنجیده می‌شود، به نظر می‌رسد احتمال نفرین منابع سیاسی کاهش می‌یابد.

پریچارد و همکاران^۳ (۲۰۱۸) رابطه بین مالیات، درآمد غیرمالیاتی و دموکراسی را برای کشورهای نفتی در دوره زمانی ۲۰۱۲-۱۹۹۰ مطالعه کردند و نشان دادند که یک رابطه

1. Brooks and Kurtz

2. Brahim & Syed Mansoob

3. Prichard et al.

طولانی مدت به جای تغییرات کوتاه مدت در ثروت منابع برقرار است که می تواند به تغییرات عمده سیاسی از جمله تأثیر منفی وجود منابع بر دموکراسی منجر شود. آنها توانستند شواهدی در مورد جزئیات خاص رابطه اساسی ارائه نمایند: اول، ثروت منابع طبیعی ضددموکراتیک است نه صرفاً تثبیت کننده؛ دوم، اساساً ناشی از تغییرات در ترکیب درآمد دولت است و سوم، به عنوان یک رابطه طولانی مدت درک می شود و تغییرات کوتاه مدت در ثروت منابع به سرعت به تغییرات عمده سیاسی تبدیل می شود و این تغییرات سیاسی ثروت نفت نسبت به منابع کانی و معدنی بیشتر است؛ زیرا دولت ها در تبدیل ثروت نفتی به درآمدهای دولت به نسبت مؤثر هستند که نفرین منابع سیاسی را به دنبال دارد.

به اختصار، مطالعات زیادی در رابطه با تأثیر نفرین منابع طبیعی (نفت) بر مؤلفه دموکراسی با استفاده از مدل های خطی انجام شده است. هدف از این پژوهش، بررسی مقایسه ای رابطه درآمدهای نفتی و درآمدهای مالیاتی بر دموکراسی در کشورهای وابسته به نفت با درآمد متوسط و همچنین کشورهای وابسته به نفت با درآمد بالا با استفاده از رویکرد گشتاورهای تعمیم یافته سیستمی و متغیرهای دموکراسی، درآمدهای نفتی، درآمدهای مالیاتی، رشد اقتصادی، تولید ناخالص داخلی سرانه و جمعیت کشورهای مورد مطالعه طی سال های ۱۹۸۰ الی ۲۰۱۸ است. وجه تمایز و نوآوری مطالعه حاضر با پژوهش های پیشین در بررسی مقایسه ای این پدیده با اهمیت اقتصادی بین دو گروه درآمدی متوسط و بالا از کشورهای نفت خیز به همراه در نظرگیری وضعیت دیگر درآمدهای غیرنفتی کشورها یعنی مالیات ها، با استفاده از روش گشتاورهای تعمیم یافته سیستمی^۱ (SYS-GMM) است.

۴. روش شناسی پژوهش

۴-۱. معرفی مدل

مطالعه حاضر با تأکید بر دو گروه کشورهای پردرآمد نفت خیز^۲ و کشورهای نفت خیز با درآمد متوسط^۳ شامل ایران و تحلیل رابطه بین مالیات، درآمد نفتی و دموکراسی در دوره زمانی ۲۰۱۸-۱۹۸۰ انجام شده است. در این مطالعه متغیر اصلی و وابسته همان دموکراسی است که با یک وقفه نیز برای مدل سازی دموکراسی در طول زمان و برای محاسبه پویایی بازگشت بالقوه در نظر

1. Generalized Method of Moments

۲. عربستان، کویت، قطر، نروژ، بحرین، امارات متحده عربی، کانادا، عمان، بروئی، ترینیداد و توباگو.

۳. ایران، عراق، روسیه، گابن، لیبی، الجزایر، آذربایجان، قزاقستان، ونزوئلا، مکزیک، آنگولا، نیجریه، سودان، ترکمنستان، بولیوی، موریتانی، اندونزی، گینه استوایی، جمهوری کنگو، غنا، مصر.

گرفته می‌شود. با الهام از مطالعه پریچارد و همکاران (۲۰۱۸) مدل مورد بررسی به صورت رابطه ۱ ارائه شده است:

$$Demo_{i,t} = \alpha Demo_{i,t-1} + \beta_1 Taxr_{i,t} + \beta_2 Oilr_{i,t} + \beta_3 Growth_{i,t}, \quad (1)$$

$$+ \beta_4 Lgdp_{i,t} + \beta_5 Lpop_{i,t} + \alpha_i + \lambda_t + e_{i,t}$$

با توجه به رابطه (۱) داریم:

دموکراسی (Demo): دموکراسی به‌عنوان متغیر وابسته این پژوهش، به وضعیتی از حکومت اشاره دارد که در آن مردم، اقتدار برای انتخاب قانون و قانون‌گذار دارند. موضوعات اصلی دموکراسی عبارت‌اند از: آزادی اجتماع، آزادی بیان، شهروندی، رضایت از حکومت، حق زندگی و حقوق اقلیت‌ها (میرشکاری، ۱۳۸۸). نهاد حکمرانی دموکراتیک و باثبات، نهادی است که از آزادی‌های سیاسی حمایت می‌کند و محیط لازم را برای مشارکت مدنی فراهم می‌آورد. نهادی منصف و پاسخگو است که مردم به آن اعتماد دارند. چنین نهادی در حال حرکت به سمت سطوح بالاتر رشد و توسعه و رفاه است و در محاسبه این شاخص رتبه خوبی را در زمینه حکمرانی کسب می‌کند.

در زیر شاخص‌های حکمرانی چنین سؤالاتی سنجیده می‌شود: آیا از تلاش حکومت برای حل مشکل فقر راضی هستید؟ آیا به نتیجه انتخابات اعتماد دارید؟ آیا به ارتش، سیستم قضایی و به طور کلی حکومت ملی اعتماد دارید؟ آیا صدای شما در طی یک سال گذشته به گوش یکی از مقامات رسمی رسیده است؟ همچنین، مواردی چون حقوق سیاسی، فساد دولتی، محدودیت‌های سیاسی، کارایی حکومت نیز مطالعه و بررسی می‌شوند. داده‌های مربوط به دموکراسی از پایگاه داده‌ای Polity Data Series گرفته شده است. برای بررسی اثر دموکراسی از شاخص دموکراسی (polity2) استفاده می‌شود که سالانه کشورها را در بازه ۱۰+ تا ۱۰- طبقه‌بندی می‌کند؛ به طوری که ۱۰+ معرف کشور کاملاً دموکراتیک و ۱۰- کشوری کاملاً غیردموکراتیک هست.

درآمد مالیاتی کل (Taxr): درآمد مالیاتی کل به‌عنوان متغیر اصلی مستقل و برحسب تعریف سازمان همکاری و توسعه اقتصادی (OECD) پرداختی است لازم، اجباری و بلاعوض از طرف اشخاص حقیقی و حقوقی در شکل‌های متنوع مالیات بر درآمد، مصرف و دارایی به سمت دولت. منبع جمع‌آوری داده‌های مرتبط با درآمدهای مالیاتی دولت و درآمدهای نفتی، سامانه ICTD GRD¹ است که حاوی داده‌های کامل‌تر و دقیق‌تری در مورد ترکیب درآمد دولت است و این امکان را می‌دهد که تأثیر تغییر در ترکیب درآمد دولت بر سطح دموکراسی مستقیماً آزمایش شود. این پایگاه داده‌ای، دارای چندین

1. Government Revenue Dataset

مزیت مهم در مقایسه با مجموعه داده‌های درآمدی دولت در بانک جهانی است که دو مورد مهم آنها پوشش بهبودیافته و تمایز سازگارتر بین منابع درآمد مالیاتی و غیرمالیاتی است.

درآمدهای نفتی (Oilr): به‌عنوان متغیر اصلی مستقل، درآمدهای نفتی به درآمدهای حاصل از صادرات نفت و فرآورده‌های نفتی به‌عنوان بزرگ‌ترین منبع درآمد در بودجه کشورهای صادرکننده نفت و مؤثر بر تولید ناخالص داخلی آنها اشاره دارد. به‌طور کلی، دولت‌ها در کشورهای مورد مطالعه این پژوهش، درآمد خود را از دو طریق جمع می‌کنند: ۱. مالیات بر شرکت‌های بزرگ و شرکت‌های سرمایه‌گذاری نفتی، و ۲. انواع حق امتیازات نفتی. از دیدگاه اقتصاد سیاسی، هر دو نوع درآمد باید به‌عنوان درآمد بدون مالیات طبقه‌بندی شوند. پایگاه داده‌ای ICTD GRD این امکان را می‌دهد که مالیات شرکت‌های بزرگ را به‌عنوان درآمد بدون مالیات طبقه‌بندی کند. در حالی که در سیستم آمارهای مالی دولت^۱ (GFS) که یک نظام هماهنگ بین‌المللی برای گزارشگری فعالیت‌های مالی و بودجه‌ای دولت توسط صندوق بین‌المللی پول^۲ (IMF) برای کشورهای عضو هست، این نوع طبقه‌بندی وجود ندارد. در ادامه، با الهام از مطالعه پریچارد و همکاران (۲۰۱۸)، متغیرهای فرعی یا کنترلی مستقل به شرح ذیل هستند:

رشد اقتصادی (Growth): رشد اقتصادی از شاخص‌های توسعه جهانی است که داده‌های مرتبط با آن از پایگاه داده‌ای بانک جهانی (World Bank) گرفته شده است.

تولید ناخالص داخلی سرانه (LGDP): لگاریتم تولید ناخالص داخلی سرانه است که داده‌های مرتبط با آن از پایگاه داده‌ای بانک جهانی (World Bank) استخراج شده است.

شاخص جمعیتی (Lpop): لگاریتم اندازه جمعیت کشورهای مورد مطالعه است و داده‌های مرتبط با آن نیز از پایگاه داده‌ای بانک جهانی (World Bank) گرفته شده است.

۲-۴. مدل گشتاورهای تعمیم‌یافته سیستمی

در این مطالعه برای برآورد الگوی معرفی شده پژوهش، از چهار آزمون استحکام^۳ شامل OLS ترکیبی، اثرات ثابت (FE)، مدل‌های Diff-GMM و SYS-GMM استفاده می‌شود؛ اما تأکید اصلی بر روش GMM-SYS به دلیل ویژگی‌های خاص آن است. در روش اول، یک مدل OLS ترکیبی ساده با وقفه متغیر وابسته انجام می‌شود. البته از نقاط ضعف مدل OLS ترکیبی، حذف اثرات ثابت مقاطع است. در روش دوم، با اجرای یک مدل با اثرات ثابت (FE)، ناهمگنی کشورها

1. Government Finance Statistics

2. International Monetary Fund

3. Robustness

کنترل می‌شود. البته اجرای تخمین‌ها با اثرات ثابت (FE)، به دلیل همبستگی بین متغیر وابسته با وقفه و عبارت خطا، سوگیری دارند (نیکل،^۱ ۱۹۸۱).

در روش سوم، با پیروی از آسلاکسن^۲ (۲۰۱۰) و به منظور برآورد یک فرایند پویا با اثرات ثابت ترجیح داده می‌شود از برآوردگرهای GMM استفاده شود. مدل‌های GMM برای فرآیندهای پویا با اثرات ثابت و درجایی که به‌طور بالقوه رگرسیون‌های درون‌زا و اختلالات خاص وجود دارد بهترین برآوردگر در نظر گرفته می‌شوند. در روش چهارم، هرگاه سطوح وقفه‌دار برآوردگرها متغیر ابزاری ضعیفی برای تفاضل مرتبه اول برآوردگرها باشند، از نسخه تعمیم‌یافته GMM یعنی SYS GMM استفاده می‌شود. روش GMM سیستمی معمولاً با بهبود دقت و کاهش تورش حجم نمونه، برآوردهای کارتر و دقیق‌تری در مقایسه با DGMM ارائه می‌کند (بالتاجی،^۳ ۲۰۰۸).

در روش GMM سیستمی، برخلاف روش حداقل مربعات معمولی (OLS)، فرض نرمال بودن داده‌ها وجود ندارد و ناهمسانی واریانس مجاز است. همچنین، با استفاده از سطوح وقفه متغیرها، اطلاعات از بین رفته مربوط به تفاوت‌های بین مقاطع را زمانی حفظ می‌کند که تنها اولین معادله متمایز تخمین زده می‌شود و می‌تواند نسبتاً کارآمدتر باشد (بلندل و باند،^۴ ۱۹۹۸). بالتاجی و همکاران (۲۰۰۹) نیز استدلال دارند که به هنگام مواجه شدن با داده‌های نسبتاً محدود و وجود اثرات مستمر در روابط میان متغیرها، روش گشتاورهای تعمیم‌یافته سیستمی به دلیل حذف اثرات ثابت به هنگام تفاضل‌گیری از متغیرهای مدل، حذف تورش‌های رگرسیون‌های مقطعی و لحاظ نمودن ناهمسانی فردی، بهترین نتایج را ارائه می‌دهد. از جمله مزیت‌های دیگر روش گشتاورهای تعمیم‌یافته (SYS-GMM) می‌توان به حل مشکل درون‌زا بودن متغیرهای توضیحی، کاهش یا رفع هم‌خطی در مدل و حذف متغیرهای ثابت طی زمان اشاره نمود.

۵. برآورد مدل و تجزیه و تحلیل یافته‌ها

۵-۱. بررسی مانایی متغیرها

پیش از برآورد مدل، مانایی متغیرها بررسی شد؛ زیرا در صورت مانانبودن متغیرهای مدل، احتمال ایجاد رگرسیون ساختگی وجود دارد. برای این منظور از آزمون ریشه واحد استفاده شد که جزء معمول‌ترین آزمون‌های تشخیص مانایی است. جهت آزمون ریشه واحد داده‌های پانل بررسی مانایی متغیرهای مدل، از میان آزمون‌های مختلفی مانند لوین، لین و چو، آزمون ایم، پسران و شیم

1. Nickell

2. Aslaksen et al.

3. Baltagi

4. Bludell & Bond

آزمون فیشر دیکي فولر تعمیم یافته، آزمون فیشر-فیلیس پرون و هادری، در این پژوهش به دلیل نامتوازن بودن پانل از آزمون ایم، پسران و شین (IPS) استفاده شد. در اجرای این نوع آزمون، فرض می شود که هر واحد پارامتر اتورگرسیو خاص خود را دارد و پنل می تواند نامتوازن نیز باشد. نتایج آزمون مانایی در جدول ۱ آورده شده و نشان می دهد که متغیرهای درآمدهای نفتی، رشد اقتصادی، لگاریتم تولید ناخالص داخلی سرانه و لگاریتم جمعیت در سطح $I(0)$ مانا هستند؛ اما متغیرهای دموکراسی و درآمدهای مالیاتی نامانا هستند و با یکبار تفاضل گیری مانا می شوند؛ از این رو با توجه به اینکه دو تا از متغیرها با یکبار تفاضل گیری مانا شدند، لازم است که هم انباشتگی متغیرها بررسی شود.

جدول ۱. نتایج آزمون ریشه واحد در سطح و تفاضل داده ها برای گروه کشورهای نفتی با درآمد بالا

| درجه مانایی | آزمون IPS در سطح متغیرها | | آزمون IPS در سطح متغیرها | | متغیر |
|-------------|--------------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|---------|
| | سطح احتمال | مقدار آماره آزمون | سطح احتمال | مقدار آماره آزمون | |
| I(1) | ۰/۰۰۰ | -۸/۲۴ | ۰/۸۵ | ۱/۰۵ | Polity2 |
| I(0) | - | - | ۰/۰۰۰۷ | -۳/۲۱ | Oilr |
| I(1) | ۰/۰۰۰ | -۵/۱۳ | ۰/۳۵ | ۰/۶۳ | Taxr |
| I(0) | - | - | ۰/۰۰۰ | -۸/۲۰ | Growth |
| I(0) | - | - | ۰/۰۰۰ | -۱۴/۵۶ | Lgdp |
| I(0) | - | - | ۰/۰۰۰ | -۱۰/۰۹ | Lpop |

۵-۲. آزمون هم انباشتگی

از آنجایی که تخمین مدل در حالت نامانا بودن متغیرها ممکن است باعث ایجاد رگرسیون کاذب شود، به همین دلیل برای جلوگیری از اتکاء به رگرسیون کاذب از روش های تفاضل گیری و آزمون هم انباشتگی استفاده می شود. البته هنگام استفاده از تفاضل متغیرها در برآورد ضرایب الگو اطلاعات ارزشمندی در رابطه با سطح متغیرها از دست می رود؛ از این رو این روش برای جلوگیری از اتکا به رگرسیون کاذب مناسب نیست. برای رفع این مشکل می توان از آزمون هم انباشتگی استفاده کرد که تداعی کننده وجود یک رابطه تعادلی بلندمدت است که سیستم اقتصادی در طول زمان به سمت آن حرکت می کند (نوفرستی، ۱۳۸۹).

بدیهی است در صورت نامانایی متغیرهای مدل اگر بین آنها هم انباشتگی برقرار باشد، نتایج حاصل از تخمین مدل قابل اعتماد خواهد بود. در این مطالعه، به منظور بررسی آزمون هم انباشتگی در مدل های مورد استفاده از روش کائو^۱ (۱۹۹۹) استفاده شده است. کائو آزمون هم انباشتگی تعمیم یافته دیکي فولر

1. Kao

را با فرض این ارائه کرده است که بردارهای هم‌انباشتگی در هر مقطع همگن باشد. این آزمون با استفاده از آماره آزمون‌های ریشه واحد DF و ADF انجام می‌شود. در این آماره‌ها فرضیه صفر برابر نبود هم‌انباشتگی و فرضیه مخالف آن وجود هم‌انباشتگی بین متغیرهای مدل است. خلاصه نتایج آزمون هم‌انباشتگی کائو با استفاده از آماره ADF برای مدل تخمینی، در جدول ۲ نشان داده شده است.

جدول ۲. نتایج آزمون هم‌انباشتگی کائو گروه کشورهای با درآمد بالا

| آماره | نتیجه آزمون |
|------------------|--|
| -۲/۳۷ (۰/۰۰۸) | فرضیه صفر مبنی بر عدم هم‌انباشتگی در مدل رد می‌شود |

نتایج در جدول ۲ نشان می‌دهد فرضیه صفر در سطح اطمینان ۹۵ درصد رد می‌شود؛ بنابراین، براساس آماره ADF آزمون کائو، هم‌انباشتگی در مدل برقرار است و بدین ترتیب مشکل رگرسیون کاذب در مدل تخمینی وجود نخواهد داشت. پس از تأیید وجود هم‌انباشتگی بین متغیرهای مدل، بدون نگرانی از بروز مشکل رگرسیون کاذب، می‌توان مدل را برآورد کرد. جدول ۳، نتایج حاصل از انجام چهار آزمون متعارف استحکام برای تخمین مدل شامل OLS ترکیبی، اثرات ثابت، مدل‌های Diff-GMM و SYS-GMM را نشان می‌دهد.

جدول ۳. نتایج برآورد وجود نفرین نفت در گروه کشورهای نفتی با درآمد بالا با روش‌های مختلف

| (۱) Variable | (۲) Pooled Ols | (۳) FE | (۴) Diff-GMM Two-Step | (۵) SYS-GMM Two-Step |
|-----------------|-------------------|-------------------|--------------------------|-------------------------|
| Polity2(-1) | ۰/۰۹۸ (۰/۰۶) | ۰/۲۹ (۰/۰۷) | -۰/۳۳ (۰/۰۰۰) | -۰/۳۱۰ (۰/۰۰۰)* |
| Oilr | ۰/۰۳۵ (۰/۰۰۰) | ۰/۰۳۸ (۰/۰۰۰) | ۰/۰۴۷ (۰/۰۰۰) | ۰/۰۵۸ (۰/۰۰۰) |
| Taxr | ۰/۰۷۴ (۰/۰۰۰) | ۰/۰۷۵ (۰/۰۰۰) | ۰/۰۹ (۰/۰۰۰) | -۰/۰۹۲ (۰/۰۰۰) |
| Growth | -۰/۰۰۴ (۰/۳۱۰) | -۰/۰۰۸ (۰/۱۱۷) | -۰/۰۰۰۶ (۰/۶۸) | -۰/۰۱۲ (۰/۰۰۰) |
| Lgdp | ۰/۰۶۷ (۰/۸۸) | ۰/۱۲۶ (۰/۷۹۸) | -۰/۰۸۸ (۰/۲۸۴) | -۰/۰۷۵ (۰/۴۹۸) |
| Lpop | ۲/۲۶ ۰/۰۰۰ | ۲/۸۱ (۰/۰۰۰) | ۱/۲۷ (۰/۰۰۰) | ۲/۵۳۳ (۰/۰۰۰) |
| Cons | -۲۳/۶۶ (۰/۰۰۰) | -۲۶/۳۱ (۰/۰۰۰) | -۲۲/۶۹ (۰/۰۰۰) | -۲۹/۰۹ (۰/۰۰۰) |
| Sargan | | | ۲۸/۸۲(۰/۱۴) | ۳۳/۴۳(۰/۲۶) |
| AR(1) | | | ۰/۴۳ | ۰/۰۰۷ |
| AR(2) | | | ۰/۱۳ | ۰/۲۳ |

توجه: مقادیر داخل پرانتز احتمال هستند.

همان‌طور که در جدول ۳ مشاهده می‌شود، در مدل OLS ترکیبی یک ضریب مثبت و قابل توجه در درآمد مالیاتی کل (با تأخیر) ایجاد می‌کند. در مدل اثرات ثابت (FE) خاص کشور، این ضریب هم مثبت و به‌طور قابل توجهی معنادار است. با توجه به تخمین‌های GMM، نتایج در هنگام استفاده از برآوردگر Diff-GMM نیز در سطح ۵٪ مثبت و معنادار هستند. براساس مطالب پیش‌گفته، به پیروی از آسلاکسن^۱ (۲۰۱۰)، وقتی از SYS-GMM استفاده می‌شود نتایج معتبرتر و قوی‌تری را به این واقعیت نسبت می‌دهند. برآوردگر SYS-GMM از طیف گسترده‌تری از اطلاعات استفاده می‌کند و بنابراین زمانی که متغیرهای مهم به آرامی تغییر می‌کنند کارآمدتر است. با نگاهی به جدول ۳، درمی‌یابیم که نتیجه نفرین نفت در این گروه کشورها رد شده و ضرایب به‌دست آمده در درآمدهای نفتی در همه مدل‌ها از نظر آماری مثبت و معنادار است. همچنین، ضریب درآمد کل مالیاتی دارای علامت مثبت و معنادار در همه آزمایش‌هاست. در ادامه، برای گروه کشورهای نفتی با درآمد متوسط نیز نتایج بررسی و آزمون مانایی متغیرها در جدول ۴ آورده شده که نشان می‌دهد متغیرهای دموکراسی، درآمدهای مالیاتی، رشد اقتصادی، لگاریتم تولید ناخالص داخلی سرانه و لگاریتم جمعیت در سطح $I(0)$ مانا هستند؛ اما متغیر درآمدهای نفتی ناماناست و با یک‌بار تفاضل‌گیری مانا می‌شود؛ از این‌رو با توجه به اینکه دو تا از متغیرها با یک‌بار تفاضل‌گیری مانا شدند، لازم است که هم‌انباشتگی متغیرها بررسی شود.

جدول ۴. نتایج آزمون ریشه واحد در سطح و تفاضل داده‌ها برای گروه کشورهای نفتی با درآمد متوسط

| متغیر | آزمون IPS در سطح متغیرها | | آزمون IPS در تفاضل مرتبه اول متغیرها | | درجه مانایی |
|---------|--------------------------|------------|--------------------------------------|------------|-------------|
| | مقدار آماره آزمون | سطح احتمال | مقدار آماره آزمون | سطح احتمال | |
| Polity2 | -۵/۱۴ | ۰/۰۰۰ | - | - | $I(0)$ |
| Oilr | -۰/۶۷ | ۰/۲۵ | -۱۰/۱۲ | ۰/۰۰۰ | $I(1)$ |
| Taxr | -۱/۶۴ | ۰/۰۵ | - | - | $I(0)$ |
| Growth | -۱۰/۶۷ | ۰/۰۰۰ | - | - | $I(0)$ |
| Lgdp | -۳/۱۳ | ۰/۰۰۰۹ | - | - | $I(0)$ |
| Lpop | -۱۶/۳۵ | ۰/۰۰۰ | - | - | $I(0)$ |

نتایج مرتبط با آزمون هم‌انباشتگی برای گروه کشورهای با درآمد متوسط در جدول ۵ نشان می‌دهد که فرضیه صفر در سطح اطمینان ۹۵ درصد رد نمی‌شود. براساس آماره ADF آزمون کائو، هم‌انباشتگی در مدل برقرار نیست و مشکل رگرسیون کاذب در مدل تخمینی وجود خواهد داشت؛ بنابراین متغیرهای ناماننا با تفاضل در تخمین وارد می‌شوند.

1. Aslaksen et al.

جدول ۵. نتایج آزمون هم‌انباشتگی کائو گروه کشورهای با درآمد متوسط

| نتیجه آزمون | آماره |
|---|------------------|
| فرضیه صفر مبنی بر عدم هم‌انباشتگی در مدل رد نمی‌شود | -۰/۶۷۱ (۰/۲۵) |

نتایج جدول ۶ نشان می‌دهد در مدل OLS ترکیبی یک ضریب منفی و قابل توجه در درآمد مالیاتی کل (با تأخیر) ایجاد می‌کند. در مدل اثرات ثابت خاص (FE) کشورها، این ضریب منفی و معنادار است. با توجه به تخمین‌های GMM، نتایج در هنگام استفاده از برآوردگر Diff-GMM نیز به‌شدت در سطح ۵ درصد منفی و معنادار هستند. نتایج SYS-GMM هم منفی و معنادار است. نتایج نفرین نفت در این گروه کشورها تأیید می‌شود و نشان می‌دهد که ضرایب درآمدهای نفتی در همه مدل‌ها از نظر آماری منفی و معنادار است. همچنین، ضریب درآمد کل مالیاتی دارای علامت منفی و معنادار در همه آزمایش‌هاست. آزمون سارگان به پیشنهاد آرلانو و بلندل و باند^۱ و آرلانو و باور برای بررسی اعتبار متغیرهای ابزاری تعریف شده در مدل استفاده می‌شود (بالتاجی، ۲۰۰۵).

جدول ۶. نتایج برآورد وجود نفرین نفت در گروه کشورهای نفتی با درآمد متوسط با روش‌های مختلف

| (۵) SYS-GMM Two-Step | (۴) Diff-GMM Two-Step | (۳) FE | (۲) Pooled Ols | (۱) Variable |
|-------------------------|--------------------------|-------------------|--------------------|-----------------|
| -۰/۲۰۱ (۰/۰۰۰)* | -۰/۳۲۵ (۰/۰۰۰) | -۰/۰۵۶ (۰/۴۸۳) | -۰/۰۶۶ (۰/۱۹) | Polity2(-1) |
| -۰/۰۰۴ (۰/۰۰۰) | -۰/۰۰۴ (۰/۰۰۰) | -۰/۰۰۳ (۰/۰۲) | -۰/۰۰۳ (۰/۰۱) | Oilr |
| -۰/۰۰۲ (۰/۰۰۰) | -۰/۰۰۱ (۰/۰۰۰) | -۰/۰۰۲ (۰/۱۸۴) | -۰/۰۰۱ (۰/۴) | Taxr |
| ۰/۰۰۵ (۰/۰۰۰) | ۰/۰۰۲ (۰/۰۲) | ۰/۰۰۱ (۰/۵۲) | ۰/۰۰۲ (۰/۱۸) | Growth |
| ۰/۰۰۵ (۰/۰۰۰) | ۰/۴۵۵ (۰/۸۲) | ۰/۳۸ (۰/۳۷) | ۰/۶۳۶ (۰/۱) | Lgdp |
| ۱/۲۴ (۰/۰۰۰) | ۱/۰۸۷ (۰/۰۰۰) | ۱/۵۵ (۰/۰۰۰) | ۱/۵۲ ۰/۰۰۰ | Lpop |
| -۲۶/۳۳ (۰/۰۰۰) | -۲۲/۴۴ (۰/۰۰۰) | -۲۸/۳۳ (۰/۰۰۰) | -۳۰/۰۰۷ (۰/۰۰۰) | Cons |
| ۳۲/۵۹ | ۳۱/۲۷ | | | Sargan |
| ۰/۰۰۰۱ | ۰/۰۰۰۱ | | | AR(1) |
| ۰/۱۲۹ | ۰/۰۱۳۲ | | | AR(2) |

توجه: مقادیر داخل پرانتز احتمال هستند.

1. Arellano-Bover & Blundel-Bond

همان‌طور که نتایج جداول ۳ و ۶ برای هر دو گروه از کشورهای نشان می‌دهد، مقدار ارزش احتمال (P-Value) در این آزمون بزرگ‌تر از ۰/۰۵ بوده و فرضیه صفر پذیرفته شده است که حاکی از مناسب بودن مدل ساختاری ارائه شده است. آزمون دوم، آزمون همبستگی پسماندهای مرتبه اول (AR (۱) و مرتبه دوم (AR (۲) است. این آزمون نیز برای بررسی اعتبار و صحت متغیرهای ابزاری به کار می‌رود. آرانو و باند (۱۹۹۱) بر این باور هستند که در تخمین GMM باید جملات اخلاص دارای همبستگی سریالی مرتبه اول (AR(۱) بوده و دارای همبستگی سریالی مرتبه دوم (AR(۲) نباشند که این آزمون نیز برای هر دو گروه کشورها برقرار است.

همچنین، نتایج اصلی برای مقایسه بین دو گروه از کشورهای با درآمد بالا و درآمد متوسط در جدول ۳ و ۶ نشان می‌دهد که با احتمال قوی افزایش درآمدهای نفتی به اندازه ۰/۰۵۸ و درآمدهای مالیاتی به میزان ۰/۰۹۲، در کشورهای با درآمد بالای نفتی نظام حاکمیتی این کشورها را به سمت دموکراسی تغییر خواهد داد. متغیر رشد اقتصادی به میزان ۰/۰۱۲ بر دموکراسی اثر منفی دارد و رابطه جمعیت با دموکراسی به اندازه ۲/۵۳ مثبت ارزیابی شده است. در حالی که برای کشورهای با درآمد متوسط نفتی، نفرین نفت تأیید شده و با افزایش درآمدهای نفتی سطح دموکراسی به اندازه ۰/۰۰۴ کاهش می‌یابد. همچنین، درآمدهای مالیاتی هم به کاهش دموکراسی در این گروه کشورها به اندازه ۰/۰۰۲ منجر می‌شود و رشد اقتصادی و درآمد سرانه هر دو به میزان ۰/۰۰۵ بر دموکراسی اثر مثبت و معناداری دارد. نیز جمعیت به اندازه ۱/۲۴ بر دموکراسی اثر مثبت و معناداری دارد. دلیل استفاده از چهار روش ذکر شده در قسمت برآورد مدل برای استحکام مدل است.

۶. بحث و نتیجه‌گیری

در پژوهش حاضر به بررسی تأثیر درآمدهای نفتی و مالیاتی در دو گروه کشورهای نفتی با درآمد بالا و متوسط در دوره زمانی ۲۰۱۸-۱۹۸۰ در قالب رویکرد GMM سیستمی پرداخته شد. همچنین، برای بررسی و آزمون استحکام مدل از چهار روش OLS ترکیبی، مدل اثرات ثابت (FE) خاص کشور، و برآوردهای Diff-GMM و SYS-GMM استفاده شد. طبق نتایج به دست آمده، رابطه بین درآمدهای نفتی و دموکراسی در گروه کشورهای درآمدی بالا مثبت است. در مقابل برای گروه کشورهای با درآمد متوسط درآمدهای نفتی به کاهش سطح دموکراسی منجر شده است. اثر مالیات بر دموکراسی برای گروه کشورهای با درآمد بالا مثبت به دست آمد؛ در حالی که برای گروه کشورهای با درآمد متوسط که طیف بیشتری از کشورها از خاورمیانه،

آمریکای لاتین و کشورهای آفریقایی را در بر می‌گیرد رابطه منفی بین درآمدهای کل مالیاتی و دموکراسی به دست آمد.

بدیهی است افزایش رانت نفت^۱ یک کشور وابستگی آن به مالیات را کاهش می‌دهد و برعکس کشورهای نفتی که رانت نفت بیشتری دارند، وابستگی کمتری به مالیات از خود نشان می‌دهند. رانت‌های نفتی بالاتر به‌یقین درآمدهای دولت را افزایش می‌دهد؛ یعنی حتی اگر درآمدهای مالیاتی دولت بدون تغییر باشد، اتکای دولت به مالیات به‌عنوان نسبی از کل درآمدهای دولت کاهش می‌یابد؛ زیرا تولید نفت باعث کاهش مالیات غیرنفتی به‌عنوان بخشی از اقتصاد می‌شود و اتکای دولت به مالیات را کاهش می‌دهد.

به‌طورکلی، کاهش اتکا به مالیات در کشورهای وابسته به درآمدهای نفتی می‌تواند مانع از انتقال دموکراتیک رژیم‌های حاکمیتی شود و هرگونه کاهش مالیات‌های ناشی از تولید نفت شامل مالیات بر شرکت‌های بزرگ و شرکت‌های سرمایه‌گذاری نفتی و همچنین، انواع حق امتیازات نفتی از منظر اقتصاد سیاسی، به توضیح اثرات ضد دموکراتیک نفت کمک می‌کند. در این بین، عدم گزارش کشورهای تولیدکننده نفت به اندازه واقعی تولید خود به سوگیری در معیار مالیات بر کالاها نیز منجر می‌شود.

اگر ثروت نفت به کاهش مالیات منجر شود و مالیات‌های پایین‌تر تقاضای عمومی برای دموکراسی را کاهش دهد، در این صورت شهروندان کشورهای تولیدکننده نفت نسبت به شهروندان دیگر مناطق علاقه کمتری به دموکراسی نشان خواهند داد. طبق نتایج این پژوهش، اثر تولید ناخالص داخلی سرانه بر دموکراسی در کشورهای با درآمد متوسط مثبت و معنادار است و این متغیر در گروه کشورهای با درآمد بالا بی‌معنا ارزیابی شده است. در حالی که مطالعات قبلی درباره دموکراسی‌سازی نشان می‌دهد که احتمال دموکراتیک شدن کشورها با تولید ناخالص سرانه بالاتر، بیشتر است. بدین معنا که درآمد یک عامل حیاتی است و زمانی که درآمدها افزایش می‌یابد، احتمال دموکراتیک شدن یک دولت استبدادی نیز افزایش می‌یابد.

درآمدهای بالاتر احتمال کاهش دموکراسی‌ها را کمتر می‌کند؛ اما تأثیری بر احتمال تبدیل شدن دولت‌های استبدادی به دموکراسی ندارد. اثر رشد اقتصادی بر دموکراسی (متغیر رشد اقتصادی که به‌عنوان تغییر سالیانه در درآمد سرانه اندازه‌گیری می‌شود) در گروه کشورهای با درآمد بالا منفی و معنادار و در مقابل در کشورهای با درآمد متوسط این اثر مثبت و معنادار است. در این رابطه مطالعات گذشته نیز نشان می‌دهند که رشد به بقای خودکامگی‌ها یعنی کاهش سطح

۱. برخورداری دولت از درآمدهای سرشار ناشی از صدور نفت، تمایل برای بهره‌برداری از این درآمدها در افراد صاحب نفوذ را بالا برده و در نتیجه با ایجاد شبکه‌های حامی-پیرو دست به رانت‌جویی می‌زنند.

دموکراسی کمک می‌کند. تولید نفت تقریباً به یقین بر رشد اقتصادی یک کشور تأثیر می‌گذارد، اگرچه تأثیر دقیق آن مشخص نیست. گروهی از پژوهشگران، رابطه بین دموکراسی و رشد را مثبت ارزیابی می‌کنند و بر این نظرند که کارایی اقتصادی ناشی از آزادی انتخاب که حاصل دموکراسی است، موجب رشد اقتصادی می‌شود. اثر متغیر جمعیت در هر دو گروه کشورهای نفتی نشان می‌دهد که جمعیت بر سطح دموکراسی در هر دو گروه کشورهای نفت خیز با درآمد بالا و متوسط مثبت ارزیابی می‌شود.

تجربه کشورها^۱ در اجرای سیاست‌هایی برای در امان ماندن از نفرین نفت

نروژ کشوری که از نفرین نفت در امان مانده است. سیاست‌های زیر مسئول چنین موفقیتی هستند:

- محافظت و حمایت از برخی صنایع داخلی که تصور می‌شود برای مزیت نسبی بلندمدت حیاتی هستند؛
- سرمایه‌گذاری هنگفت در آموزش و دانش
- پیروی از سیاست‌های ضد چرخه‌ای
- اصلاح بازار کار برای افزایش سهم نیروی کار از جمعیت
- اجرای کنترل دستمزد و هماهنگی درآمد برای ایجاد نوعی قرارداد اجتماعی
- اعمال سیاست محدود کردن هزینه‌ها
- احتیاط مالی برای محافظت از اقتصاد در برابر اثرات مخارج (از جمله یک صندوق ثروت دولتی).

تولیدکنندگان عمده نفت در این دسته مانند نروژ، کانادا از دموکراسی‌های لیبرال باثبات هستند. کشور امارات متحده عربی از سال ۱۹۷۱ تلاش‌های قابل توجهی برای فرار از نفرین نفت با پیروی از سیاست‌هایی انجام داده است که عمدتاً با هدف انباشت ذخایر سرمایه‌ای فراتر از آنچه برای بهره‌برداری از مواهب غنی منابع طبیعی مورد نیاز است. افزون‌براین، بخش مهمی از درآمدهای عظیم نفتی دریافتی ابوظبی در خارج از کشور در یک صندوق دارایی مستقل سرمایه‌گذاری شده است که امنیت را برای سرمایه‌گذاران خارجی و داخلی در مقابل پایداری ارز به ارمغان می‌آورد. از سوی دیگر، دولت کشور امارات تلاش‌های قابل توجهی برای توسعه سرمایه اجتماعی و حمایت از طرح‌های بخش خصوصی انجام داده است. در نتیجه، امارات متحده عربی از نظر

۱. مانند نروژ، امارات و ترینیداد و توباگو و عمان

زیرساخت‌های جاده‌ای، بندر، فرودگاه‌ها و ارتباطات از راه دور در میان کشورهای برتر جهان قرار دارد. در عمان از ثروت نفت مستقیماً برای ساخت بیمارستان‌ها، مدارس و زیرساخت‌هایی استفاده می‌شود. کشور ترینیداد و توباگو به دموکراسی نزدیک‌تر است، اقتصاد ترینیداد و توباگو به شدت تحت تأثیر صنعت نفت و پتروشیمی قرار دارد و بعد از نفت، صنعت توریسم نیز در این کشور رونق دارد.

توصیه‌های سیاستی

برای حل معضل وابستگی به نفت و غلبه بر مشکلات الگوی توسعه نفت‌محور، برنامه توسعه اقتصاد سیاسی این‌گونه کشورها به‌ویژه ایران باید به‌گونه‌ای باشد که از شکل‌گیری و پویا شدن ساختار و سازوکارهای رانتی جلوگیری کند. به‌لحاظ سیاسی، انجام این امر مستلزم استقرار یک نظام سیاسی شفاف و دموکراتیک و تقویت نهادهای جامعه مدنی است که از تمرکز قدرت در دست یک گروه خاص جلوگیری کند و به جامعه اجازه دهد تا به‌نحوی مؤثر و کارآمد نظارت خود را بر دولت اعمال نماید.

در ایران نبود شفافیت سیاسی و پاسخگویی در طول چند دهه به ایجاد سیستمی ناکارآمد در صنعت نفت به‌طور خاص و در اقتصاد کشور به شکل کلی منجر شده است. سیستمی که در آن نه اتحادیه‌های کارگری فعال و مؤثر وجود دارند که دولت و شرکت‌ها را به سرمایه‌گذاری در ایمنی محل کار و آموزش مجبور کنند و این امر منجر به افزایش تخصص و بهره‌وری نیروی کار شود و نه نهادهای مستقل بازرسی مناسبی وجود دارد که روند اکتشاف و توسعه میادین نفت و گاز را کنترل کنند. این نبود شفافیت و پاسخگویی در حوزه کلان اقتصادی در تلاقی با درآمدهای نفتی سبب شده که تجربه ایران از برخورداری موهبت‌آمیز ثروت نفتی به کابوسی سیاسی، اقتصادی و زیست محیطی تبدیل شود.

به‌لحاظ اقتصادی حل مشکلات الگوی توسعه نفت‌محور مستلزم آن است که از چیره شدن دولت بر اقتصاد جلوگیری شود و شکوفایی یک بخش خصوصی نیرومند، کارآمد و رقابتی مورد حمایت قرار گیرد و استفاده عقلایی از ثروت نفت و کنترل ریسک‌ها و مخاطرات آن به‌نحوی مطلوب و مؤثر در چارچوب قوانین و برنامه‌های بلندمدت کشور نهادینه شود. برای تقویت مکانیسم‌های جمع‌آوری مالیات جهت رسیدن به هدف کاهش وابستگی به درآمدهای نفتی نیازی نیست که تولید را کاهش داد یا خود را از پول نفت محروم کرد؛ بلکه باید از پول نفت برای سرمایه‌گذاری هرچه بیشتر برای توسعه و صنعتی کردن کشور استفاده کرد و کمتر از آن به‌عنوان

محلی برای تأمین نیازهای مالی جاری، کم بازده و غیرمولد استفاده کرد که بخش قابل توجهی از آن به هزینه‌های دولت بازمی‌گردد.

همچنین، اتخاذ سیاست‌هایی برای تنوع در اقتصاد که وابستگی به درآمدهای نفتی را کاهش دهد، مانند توسعه بخش‌های کشاورزی، گردشگری و گسترش بازارهای مالی می‌تواند مؤثر باشد. بخش گردشگری می‌تواند هزاران شغل ایجاد کند و به ورود ارز به کشور منجر شود. گسترش بازارهای مالی هزاران شغل پردرآمد ایجاد می‌کند. همچنین، می‌تواند مزایای گسترده‌تری از جمله افزایش دسترسی به منابع مالی داشته باشد.

منابع

۱. امینی، عباس و زهرا علمی (۱۳۹۵)، «مقایسه و ارزیابی رویکردها در زمینه نفرین منابع طبیعی». اقتصاد تطبیقی، پژوهشگاه علوم انسانی و مطالعات فرهنگی، ۳ (۲)، ص ۱-۴۴.
۲. جعفری طادی، مولود؛ مرتضی سامتی؛ مصطفی رجبی و سارا قبادی (۱۳۹۹)، «اثر جایگزینی درآمد نفت با درآمد مالیات بر شاخص نهادی حکمرانی در ایران»، فصلنامه علمی مطالعات اقتصادی کاربردی ایران، ۹ (۳۴)، ص ۱۳۷-۱۶۱.
۳. صامتی، مجید و نجمه اسمعیل درجانی (۱۳۹۲)، «تأثیر وفور منابع طبیعی بر سیاست‌های مالی دولت در ایران طی دوره (۱۳۸۷-۱۳۵۷) با تأکید بر فرضیه نفرین منابع طبیعی»، فصلنامه سیاست‌های مالی و اقتصادی، ۱ (۳)، ص ۵۳-۷۰.
۴. زمانی، هادی (۱۳۸۳)، دموکراسی و توسعه پایدار، تجربه اقتصاد ایران، سوند، انتشارات ارزان.
۵. فلاحی، محمدعلی؛ محمدحسین مهدوی عادل و فرشته جندقی میدی (۱۳۹۳)، «رانت منابع طبیعی و فساد در کشورهای عضو اوپک: کاربرد الگوی داده‌های تابلویی»، پژوهشنامه اقتصاد انرژی ایران، ۳ (۱۱)، ص ۱۹۵-۲۲۷.
۶. میرشکاری، جواد (۱۳۸۸)، مردم سالاری، تهران: انتشارات فرهنگستان زبان و ادب فارسی.
7. Anderson, L. (1987), "The State in the Middle East and North Africa", *Comparative Politics*, 20 (1); 1-18.
8. Arellano, M. and Bond, S. (1991), "Some tests of specification for panel data: Monte Carlo evidence and an application to employment equations", *Review of Economic Studies*; 97: 58-277.
9. Aslaksen, S. (2010), "Oil and democracy: More than a cross-country correlation?", *Journal of Peace Research*, 47 (4); 421-431.
10. Auty, R. (1993), *Sustaining development in mineral economies: The resource curse thesis*, London, UK, and New York: Routledge.
11. Baltagi, B. H. (2005), *Econometric Analysis of Panel Data*, Third Edition, New York, John Wiley and Sons.
12. Baltagi, B. H., Demetriades, P.O. and Law, S.H. (2009), "Financial Development and Openness: Evidence from Panel Data", *Journal of Development Economics*, 89(2); 285-296. <https://doi.org/10.1016/j.jdeveco.2008.06.006>.

13. Barro, R. J. (1994), "Democracy and Growth", *Working Paper*, 4909.
14. Bates R, and Lien D–HD. (1985), "A note on taxation, development, and representative government", *Polit. Soc*, 14(2); 53–70.
15. Beblawi, H., & Luciani, G. (1987), *The Rentier State*, Kent: Croom Helm Ltd.
16. Blundell, R. and S. Bond. (1998), "Initial Conditions and Moment Restrictions in Dynamic Panel Data Models", *Journal of Econometrics*, 87; 115–143.
17. Boix, C., and Stokes, S. (2003), "Endogenous Democratization", *World Politics*, 55 (4): 517–549.
18. Bollen, K. and R. Jackman. (1985), "Political Democracy and the Size of Distribution of Income", *American Sociological Review*, 48; 468–479.
19. Brahim, B and Syed Mansoob, M. (2020), "New evidence on the oil–democracy nexus utilising the Varieties of Democracy data", *Resources Policy*, 69 (C). DOI: 10.1016/j.resourpol.2020.101905.
20. Brautigam, D., Fjeldstad, O–H., and Moore, M. (2008), *Taxation and State–Building in Developing Countries: Capacity and Consent*. New York: Cambridge Univ. Press.
21. Brooks, S.M. and Kurtz, M.J. (2022), "Oil “Rents” and Political Development: What Do We Really Know About the Curse of Natural Resources?", *Comparative Political Studies*, 55(10).DOI.ORG/10.1177/00104140211060281.
22. Chen, B and Feng, Yi. (1999), "Economic development and the transition to democracy: A formal model", *Social Choice and Welfare*, 16(1), //pp.....//
23. Chen, B. and Feng, Yi. (1999), "Economic development and the transition to democracy: A formal model", *Social Choice and Welfare*, 16(1); 1–16.
24. Cincotta, R. (2016), *The Age–structural theory of state behavior*, Oxford Research Encyclopedia of Politics, Oxford University Press.
25. Cincotta, R. (2017), "The Age-structural theory of state behavior", *Oxford Research Encyclopedia of Politics*, Oxford University Press.
26. Dahl, R. A. (2000), *On Democracy*, Yale University Press, Philosophy, 217.
27. Dunning, T. (2008), *Crude Democracy: Natural resource wealth and political regimes*, Cambridge: Cambridge University Press.
28. El–Gamal, M. and Myers Jaffe, A. (2009), "Oil, Dollars, Debt, and Crises", Cambridge University Press, DOI: <https://doi.org/10.1017/CBO9780511812323>.

29. Haber, S., and Menaldo, V. (2011), "Do Natural Resources Fuel Authoritarianism? A Reappraisal of the Resource Curse", *Forthcoming, American Political Science Review*, 105 (1); 1–26.
30. Haber, S., Armando Razo, A. and Noel Maurer, N. (2003), "The Politics of Property Rights: Political Instability, Credible Commitments, and Economic Growth in Mexico 1876-1929", *Cambridge University Press*, 119(3); 399–567. <https://doi.org/10.1017/CBO9780511615610>.
31. Herb, M. (2005), "No Representation without Taxation? Rents, Development and Democracy", *Comparative Politics*, 37 (3); 297–316.
32. Holden, S. (2013), "Avoiding the resource curse the case Norway", *Energy Policy*, 63(C); 870–876. DOI:10.1016/j.enpol.2013.09.010.
33. Huntington, S. (1991), *The Third Wave: Democratization in the Late Twentieth Century*, Norman, OK: University of Oklahoma Press.
34. Huntington, S., and Dominguez, J. (1975), *Political Development. Greenstein (Ed.)*, Handbook of Political Science, Boston, Addison–Wesley.
35. Jensen, N., & Wantchekon, L. (2004), "Resource wealth and political regimes in Africa", *Comparative Political Studies*, 37 (7); 816–841.
36. Khan, M. H. (2005), "Governance, economic growth and development since the 1960s", *DESA Working Paper No. 54*, Available at: www.un.org/esa/desa/papers/2007/wp54_2007.
37. Lipset, S. M. (1959), "Some Social Requisites of Democracy: Economic Development and Political Legitimacy", *American Political Science Review*, 53; 69–105.
38. Luciani, G. (1987), *Allocation versus the Production States: A Theoretical Framework The Rentier State*, New York: Croom Helm.
39. Mahdavy, H. (1970), *The Patterns and Problems of Economic Development in the Rentier States: The Case of Iran*, In *Studies in Economic History of the Middle East*, Ed London: Oxford University, MA Cook, 6 (2); 428–467.
40. Manzano, O., and Monaldi, F. (2008), "The Political Economy of Oil Production in Latin", *America. Economía*, 9 (1); 59–98.
41. Morrison, K. (2009), "Oil, nontax revenue, and regime stability", *International Organization*, 63 (1); 107–138.

42. Morrison, K. (2015), "Non-taxation and Representation: The fiscal foundations of political Stability", Cambridge University Press.
43. Nickell, S. (1981), "Biases in dynamic models with fixed effects", *Econometrica*, 49; 1417–1426.
44. O'Donnell's, G. (1986), "Democracy and Regime Change. International Institute of Social Studies", 46(4); 913–933. DOI: 10.1111/dech.121.
45. Paler, L. (2013), "Keeping the public purse: an experiment in windfalls, taxes, and the incentives to restrain", *American Political Science Review*, 107 (4); 706–725.
46. Prichard, W., Salardi, P., and Segal, P. (2018), "Taxation, non-tax revenue, and democracy: New evidence using new cross-country data". *World Development*, 109 (2018), 109 (C); 295–312.
47. Przeworski, A. and Limongi, F. (1993), "Political Regimes and Economic Growth", *Journal of Economic Perspectives*, 7 (3); 51–69.
48. Przeworski, A., Alvarez, M.E, Cheibub, J.A, and Limongi, F. (2000), *Democracy and Development: Political Institutions and Well-Being in the World, 1950–1990*. New York: Cambridge University Press.
49. Robinson, J. A, Torvik, R. and Verdier, T. (2006), "Political foundations of the resource curse", *Journal of Development Economics*, 79(2); 447 –468.
50. Rodrik, D. (1997), *Democracy and Economic Performance*, Manuscript, Harvard University.
51. Ross, M. L. (2001), "Does oil hinder democracy?", *World Politics*, 53; 325–361. <https://doi.org/10.1353/wp.2001.0011>.
52. Smith, B. and J. Kraus. (2005), "Democracy despite oil: transition and consolidation in Latin America and Africa", Manuscript, *Department of Political Science, University of Florida*.
53. Sorens, J. (2011), "Mineral production, territory, and ethnic rebellion: the role of rebel constituencies", *Journal of Peace Research*, 48(5); 571–585.
54. Welzel, C. and Inglehart, R. (2008), "The Role of Ordinary People in Democratization", *Journal of Democracy*, 19; 126–140.
55. Wright J, Frantz E, Geddes B. (2015), "Oil and autocratic regime survival", *Br. J. Polit. Sci.* 45; 287–306.