

تأثیر حکمرانی خوب بر آزادی اقتصادی کشورهای منتخب منطقه منا

ابوالفضل شاه‌آبادی^۱

دانشیار دانشکده اقتصاد و علوم اجتماعی دانشگاه بوعلی سینا،
همدان

مهسا گنجی^۲

کارشناسی ارشد علوم اقتصادی، دانشگاه بوعلی سینا، همدان

تاریخ دریافت: ۱۳۹۲/۱۲/۸

تاریخ پذیرش: ۱۳۹۳/۶/۲۴

چکیده

از جمله راهبردهای رشد و توسعه اقتصادی، دستیابی به آزادی اقتصادی مطلوب است. عوامل متعددی بر شاخص آزادی اقتصادی تأثیرگذار هستند لذا به نظر می‌رسد دستیابی به آزادی اقتصادی مطلوب، در گرو شناخت دقیق عوامل تعیین‌کننده و مؤثر بر آن است. بهبود آزادی اقتصادی ارتباط تنگاتنگی با بهبود عملکرد شاخص‌های نهادی از جمله شاخص حکمرانی خوب دارد. لذا هدف این مطالعه تجزیه و تحلیل شاخص آزادی اقتصادی و بررسی تأثیر شاخص حکمرانی خوب بر شاخص آزادی اقتصادی کشورهای منتخب منطقه منای طی دوره زمانی ۲۰۱۰-۱۹۹۶ با استفاده از تحلیل عاملی اکتشافی و تأییدی است. نتایج تحلیل نشان می‌دهد شاخص آزادی اقتصادی تحت تأثیر شاخص حکمرانی خوب است تا جایی که شاخص سیستم قانونی و حقوق مالکیت که از جمله شاخص‌های آزادی اقتصادی است، ارتباط نزدیک‌تری با حکمرانی خوب دارد و در حد گسترده‌ای توسط شاخص‌های حکمرانی خوب تعیین می‌گردد. همچنین ارتباط متقابل بین شاخص آزادی اقتصادی و شاخص حکمرانی خوب نیز تأیید می‌گردد.

کلیدواژه‌ها: آزادی اقتصادی، حکمرانی خوب، تحلیل عاملی اکتشافی و تأییدی، منطقه منا.

۱- نویسنده مسئول: Shahabadia@gmail.com

۲- mahsaganji1@gmail.com

طبقه بندی JEL: P16, O11, H11

مقدمه

آزادی اقتصادی نشانگر آن است که یک اقتصاد تا چه اندازه مبتنی بر بازار عمل می‌نماید، به طوری که اجزای اقتصاد قادر به انجام مبادلات داوطلبانه و رقابت آزادانه هستند و درعین حال از افراد و اموال آنها محافظت به عمل می‌آید (Gwartney and Lawson, 2002). به عبارت دیگر می‌توان بیان داشت آزادی اقتصادی مستلزم آن است که افراد امکان ورود داوطلبانه به مبادلات آزاد را همراه با شرایطی از قبیل چارچوب قانونی پایدار و باثبات که از اجرای قراردادها و مالکیت خصوصی حمایت می‌نماید و محدودسازی درجه دخالت دولت از طرق وضع قوانین و دریافت مالیات داشته باشند. طبق گزارش سالیانه مؤسسه فریزر (Frazer Institute)، شاخص آزادی اقتصادی، شاخصی موزون و متشکل از ۵ شاخص، ۱- حجم و اندازه دولت، ۲- ساختار حقوقی و حمایت از حقوق مالکیت، ۳- دسترسی به نقدینگی سالم، ۴- آزادی تجارت خارجی و ۵- تنظیم قوانین مالی بازار اعتباری، بازار نیروی کار و کسب و کار، است. محدوده شاخص آزادی اقتصادی فریزر و اجزای تشکیل دهنده آن بین ۰ تا ۱۰ است و هرچه عدد شاخص به ۱۰ نزدیک‌تر گردد، نشانگر آزادی اقتصادی بیشتر است.

از لحاظ مفهومی، آزادی اقتصادی، محدوده بسیار گسترده‌ای از شاخص‌های اقتصادی را در بر می‌گیرد، لذا بدیهی است عوامل متعددی بر بهبود و یا تضعیف این شاخص دخیل هستند. بنابراین در صورت بررسی شاخص‌های آزادی اقتصادی و همچنین بررسی سایر مؤلفه‌های مؤثر بر شاخص آزادی اقتصادی می‌توان از نحوه عملکرد و سازوکار تأثیرگذاری هر یک از اجزای تشکیل دهنده آن درک شفاف‌تری به دست آورد. شاخص آزادی اقتصادی نه تنها از اجزای تشکیل دهنده خود تأثیر می‌پذیرد، بلکه از سوی دیگر به شدت تحت تأثیر سایر مؤلفه‌های نهادی همانند شاخص حکمرانی است؛ به طوری که بهبود شاخص‌های حکمرانی از کانال ایجاد ثبات سیاسی، افزایش کارایی دولت، مهار تورم و... بر فضای اقتصادی مؤثر بوده و همچنین ارتقای شاخص حکمرانی موجب بهبود شاخص آزادی اقتصادی نظیر تنظیم قوانین، ساختار قانونی و حقوق مالکیت و تنظیم بازارها خواهد گردید. به بیان دیگر بهبود شاخص حکمرانی بستر مناسبی جهت بهبود سایر مؤلفه‌های نهادی نظیر شاخص آزادی اقتصادی را فراهم می‌آورد. در نتیجه می‌توان آزادی اقتصادی را به عنوان یک متغیر وابسته در قبال متغیرهایی نظیر حکمرانی در نظر گرفت

(Berggren, 2003). بانک جهانی حکمرانی را شیوه استفاده از قدرت در مدیریت منابع اقتصادی و اجتماعی برای دستیابی به توسعه پایدار معرفی می کند (Lateef, 1991). همچنین بر اساس تعریف دیگری از بانک جهانی، حکمرانی خوب در اتخاذ سیاست‌های پیش‌بینی‌شده، آشکار و صریح دولت (که نشان‌دهنده شفافیت فعالیت‌های دولت است)، بوروکراسی شفاف، پاسخگویی دستگاه‌های اجرایی در قبال فعالیت‌های خود، مشارکت فعال مردم در امور اجتماعی و سیاسی و نیز برابری همه افراد در برابر قانون تبلور می‌یابد (Sabagh Kermani and Baskha, 2009).

هدف مطالعه حاضر بررسی اجزای شاخص آزادی اقتصادی از طریق تجزیه و تحلیل عاملی و تبیین ارتباط آزادی اقتصادی با اجزای شاخص نهادی حکمرانی خوب است. لذا در مطالعه حاضر بررسی می‌گردد که بهبود آزادی اقتصادی تا چه اندازه به بهبود حکمرانی خوب وابسته است. جامعه آماری مورد مطالعه، ۱۱ کشور منتخب منطقه شامل کشورهای الجزایر، جمهوری اسلامی ایران، بحرین، مصر، اردن، کویت، عمان، مراکش، تونس، سوریه و امارات متحده عربی هستند و دوره زمانی مطالعه سال‌های ۲۰۱۰-۱۹۹۶ است. کشورهای منطقه منا (خاورمیانه و شمال آفریقا) کشورهای عمده تولیدکننده نفت هستند. این منطقه دارای ۶۰ درصد منابع نفتی و ۴۵ درصد منابع گازی جهان است. در جدول ذیل، درصد صادرات نفتی از کل صادرات کالایی در کشورهای مورد مطالعه نمایش داده شده است. همان‌طور که ملاحظه می‌گردد صادرات نفت امارات متحده عربی، بحرین، الجزایر، مصر، کویت، عمان و سوریه بیش از ۵۰ درصد صادرات کالایی کشورهای فوق‌الذکر را به خود اختصاص داده است؛ درحالی‌که درصد صادرات نفت در کل صادرات کشورهای اردن، مراکش و تونس کمتر از ده درصد است.

شایان توجه است در این مطالعه به منظور شناخت آزادی اقتصادی و تبیین دقیق‌تر تأثیر شاخص حکمرانی خوب بر شاخص آزادی اقتصادی، از روش تحلیل عاملی اکتشافی (Exploratory Factor Analysis) و تحلیل عاملی تأییدی ((Confirmatory Factor Analysis استفاده شده است.

از این رو در بخش دوم مقاله، پیشینه تحقیق ارائه می‌گردد، سپس در بخش سوم ضمن تشریح متغیرها و داده‌ها، نمودار خوشه‌ای نمایش داده می‌شود و سپس تجزیه و تحلیل عاملی اکتشافی و تأییدی شامل مراحل تهیه ماتریس کوواریانس از متغیرهای مشاهده شده، استخراج عامل‌ها، چرخش عامل‌ها انجام و نهایتاً در بخش چهارم نتیجه‌گیری و پیشنهادها بیان می‌گردد.

جدول ۱-: نسبت تولید نفت خام به تولید ناخالص داخلی

| کشور | ۲۰۰۵ | ۲۰۰۶ | ۲۰۰۷ | ۲۰۰۸ | ۲۰۰۹ | ۲۰۱۰ | ۲۰۱۱ |
|---------|------|------|------|------|------|------|------|
| امارات | ۵۷/۸ | -- | ۶۵/۳ | ۶۴/۹ | -- | -- | -- |
| بحرین | ۷۸/۲ | ۸۰/۶ | ۸۰/۹ | ۶۹/۱ | ۶۸/۶ | ۷۴/۴ | ۷۱/۸ |
| الجزایر | ۹۸/۱ | ۹۷/۹ | ۹۷/۸ | ۹۷/۶ | ۹۷/۷ | ۹۷/۴ | ۹۷/۲ |
| مصر | ۵۱/۳ | ۵۶/۴ | ۵۲/۵ | ۴۴/۴ | ۲۸/۹ | ۲۹/۸ | ۳۰/۹ |
| ایران | ۸۲/۶ | ۸۲/۸ | -- | -- | -- | ۷۰/۸ | ۷۰/۹ |
| اردن | ۲/۱۸ | ۱/۰ | ۰/۸۳ | ۰/۱۵ | ۰/۵۸ | ۱/۱۰ | ۰/۱۹ |
| کویت | -- | ۹۶/۵ | ۹۶/۳ | ۹۶/۵ | ۹۳/۲ | -- | -- |
| مراکش | ۲/۳۸ | ۱/۸۵ | ۲/۲۷ | ۲/۱۵ | ۲/۳۳ | ۱/۰۷ | ۲/۶۱ |
| عمان | ۹۱/۸ | ۹۱/۴ | ۸۹/۱ | ۸۶/۴ | ۷۵/۱ | ۷۷/۸ | ۷۴/۴ |
| سوریه | ۶۷/۷ | ۴۰/۱ | ۴۱/۱ | ۳۸/۶ | ۳۷/۸ | ۴۹/۹ | -- |
| تونس | ۱۲/۹ | ۱۳/۰ | ۱۶/۲ | ۱۷/۳ | ۱۳/۶ | ۱۴/۲ | ۱۴/۶ |

*منبع: داده‌های بانک جهانی <http://data.worldbank.org/>

* برای سال‌هایی که آمار موجود نبوده است خط تیره قرار گرفته است.

پیشینه تحقیق

آزادی اقتصادی شامل ابعاد جداگانه‌ای است که همگی به نهادها و سیاست‌های حاکم بر اقتصاد کشور مربوط می‌گردند. کشورها از کانال بهبود فضای آزادی اقتصادی، موانع پیش‌روی فعالین اقتصادی را از کانال‌های افزایش سهم بخش خصوصی، تدوین سیستم پولی کارآمد، به‌کارگیری سیاست‌های پولی منسجم، ایجاد ساختار قانونی مستحکم و قوه قضاییه مستقل، حمایت از حقوق مالکیت، رفع موانع تجارت بین‌الملل و ورود به عرصه رقابت جهانی، تنظیم قوانین بازارهای اعتباری، نیروی کار و کسب‌وکار برطرف می‌سازند (Shirazi et al., 2009). جهت آشنایی بیشتر با آزادی اقتصادی، در جدول ۲، تعاریف جزئی از شاخص‌های آزادی اقتصادی ارائه گردیده است.

آزادی اقتصادی معمولاً از جمله رویکردهایی به سمت رشد اقتصادی مستمر و باثبات تلقی می‌گردد. اما هنوز توافقی جهانی در مورد اینکه آیا صرفاً بهبود آزادی اقتصادی می‌تواند به اهداف غایی اقتصادی بیانجامد، وجود ندارد و در این زمینه اختلاف نظرهایی مشاهده شده است (Cohen, 2011). تا قبل از دهه ۱۹۸۰، اکثر کشورهای در حال توسعه شاهد رقابت بین طرفداران نظام

سرمایه‌داری و سوسیالیسم بوده‌اند. از دهه ۱۹۸۰ به بعد گرایش کشورها به آزادی اقتصادی افزایش یافته است، به طوری که حتی کشورهای سوسیالیستی نیز به نظام بازار روی آورده‌اند.

جدول ۲- اجزای اصلی شاخص آزادی اقتصادی

| مؤلفه | شرایطی که موجب افزایش آزادی اقتصادی می‌گردد |
|---|---|
| اندازه دولت، مخارج و مالیات‌ها | دولتی با مصرف کمتر، نقل و انتقالات کمتر، یارانه کمتر، سرمایه‌گذاری و تملک کمتر و مالیات کمتر |
| آزادی تجارت بین‌الملل | تعرفه‌های ثابت و پایین، موانع نظارتی کمتر بر سر راه تجارت، تعیین نرخ ارز رسمی توسط بازار، بخش‌های تجاری نسبتاً بزرگ، کنترل کمتر بازار سرمایه |
| مقررات بازار اعتباری، نیروی کار و تولید | بانکداری خصوصی، گسترش بانکداری بین‌المللی، اعتبار دهی به بخش خصوصی، کنترل کمتر نرخ بهره، رعایت حداقل دستمزدها، کنترل قیمت‌ها |
| دسترسی به پول سالم | تورم بدون نوسان و پایین، رشد پایین عرضه نقدینگی (M1) و عدم محدودیت برای حساب‌های بانکی خارجی |
| سیستم قانونی و حمایت از حقوق مالکیت | قوه قضاییه مستقل، دادگاه‌های بی‌طرف، حمایت از حقوق مالکیت، عدم دخالت نظامی در سیاست و دادگاه‌ها، حاکمیت قانون، اجرای حقوقی قراردادهای، اعمال مقررات کم برای املاک و مستغلات |

منبع: (Gwartney and Lawson, 2010).

بررسی روند تغییرات شاخص‌های آزادی اقتصادی در دو دهه اخیر کم‌ویش حکایت از یک جهت‌گیری عام به سمت آزادسازی اقتصادی در مناطق مختلف جهان دارد. طرفداران اقتصاد بازار معتقدند شکوفای کردن بازارهای رقابتی، خصوصی کردن بنگاه‌های دولتی، تجارت آزاد، جذب سرمایه‌های خارجی و حذف مقررات زائد دولتی و انحرافات قیمتی موجبات بالا رفتن کارایی و رشد اقتصادی را فراهم می‌آورند. در مقابل، منتقدین آزادسازی اقتصادی پیامدهایی نظیر کاهش اقتدار دولت، افزایش نابرابری در آمدی و خروج سرمایه‌های ملی از کشور را مطرح می‌سازند (Samimi and H. Azarmand, 2005)، لذا جهت‌گیری به سمت گسترش آزادی اقتصادی نیازمند برنامه‌ریزی جامع و بسترسازی مناسب است. به بیان دیگر دو دیدگاه کلی در رابطه با آزادی اقتصادی به چشم می‌خورد: اول آنکه افزایش آزادی اقتصادی همواره نتایج و آثار مثبت اقتصادی به همراه دارد؛ دوم اینکه حرکت به سمت بهبود آزادی اقتصادی، بخصوص در کشورهای در حال توسعه، به دلایلی نظیر کاهش اقتدار دولت، افزایش نابرابری در آمدی حتماً اقتصاد را به سمت اهداف کلان اقتصادی پیش نمی‌برد و این امر مستلزم مهیاسازی پیش‌زمینه‌هایی است. ولیکن با توجه به ارتباط مثبت آزادی اقتصادی با بهبود وضعیت کلان اقتصادی بخصوص در

کشورهای موفق، ضروری است بسترهای بهبود آزادی اقتصادی به نوعی در کلیه کشورها مهیا گردد.

آزادی اقتصادی از جمله شاخص‌های نهادی و سیاستی است و جایگاه آن به طور گسترده‌ای توسط سیاست‌گذاران و مجریان قانونی کشورها محقق می‌گردد، به طوری که اجزای تشکیل‌دهنده آن نظیر ساختار قانونی و مقررات و ضوابط مربوط به حقوق مالکیت، درجه باز بودن اقتصاد، از برآیند مبانی قانونی و حکمرانی کشورها حاصل می‌گردد، لذا درمی‌یابیم ارتباطاتی بین اجزای تشکیل‌دهنده آزادی اقتصادی با شاخص حکمرانی برقرار است. زیرا حکمران خوب با بسترسازی ایجاد کارایی، ثبات سیاسی، حمایت هر چه بیشتر از حاکمیت قانون و مهار فساد قادر است به بهبود شاخص آزادی اقتصادی از جمله تنظیم قوانین، ساختار قانونی و حمایت از حقوق مالکیت و تجارت آزاد کمک نماید. به دیگر عبارت، حکمران خوب ابتدا با نگرش همه‌جانبه بر ساختار اقتصادی و شناخت ظرفیت‌ها و نقاط قوت و ضعف اقتصاد، دامنه مناسب شاخص‌های اقتصادی را تعیین می‌نماید و بستر را برای ارتقای شاخص‌های اقتصادی نظیر آزادی اقتصادی مهیا می‌سازد.

لذا با توجه به مطالب مطروحه، اجزای شاخص آزادی اقتصادی ارتباط تنگاتنگی با اجزای شاخص حکمرانی داراست و می‌توان اذعان نمود بهبود شرایط حکمرانی هر کشور موجب بهبود آزادی اقتصادی می‌گردد. لذا به نظر می‌رسد در شرایط عدم بهبود حکمرانی، آزادی اقتصادی نیز میسر نخواهد گشت و مزایای حاصل از آن حاصل نخواهد گردید. بانک جهانی، حکمرانی خوب را بر اساس شش شاخص حق اظهارنظر و پاسخگویی، شاخص ثبات سیاسی و نبود خشونت، شاخص حاکمیت قانون، شاخص مهار و کنترل فساد، شاخص کارایی و اثربخشی دولت و شاخص کیفیت قوانین و مقررات یا همان کیفیت تنظیم‌کنندگی تعریف می‌نماید. تعاریفی مختصر از شاخص‌های حکمرانی خوب در جدول ۳، ارائه گردیده است.

نظریه حکمرانی، نحوه اداره کشور، شیوه تصمیم‌گیری و چگونگی تعامل بین دولت و مردم است و در نهایت نظریه حکمرانی خوب به عنوان بنیان توسعه پدیدار گشته است. این نظریه به دنبال یافتن ویژگی‌ها و پیش‌نیازهای توسعه است و بیش از هر عامل دیگری بر تحول نهادها و ساختارهای درونی و قوانین رسمی و غیر رسمی جوامع برای دست یافتن به آن تأکید می‌ورزد. به طور کلی تعاریف دهه‌های اخیر حکمرانی خوب شامل دمکراتیزه نمودن سیاست (شامل انتخابات، پاسخگویی و حقوق بشر) و آزادسازی اقتصادی بوده است (Jasbi and Nafari,

2009). البته در ادبیات حکمرانی گفته شده است حکمرانی خوب یک اصطلاح هنجاری است که می‌بایست به اقتضای بستر تعریف گردد (Landman, 2003).

جدول ۳- تعاریف جزئی شش شاخص حکمرانی خوب

| شاخص | تعریف |
|-------------------------|---|
| حق اظهارنظر و پاسخگویی | مقصود از این شاخص میزان مشارکت شهروندان در انتخاب دولت و نظام سیاسی است. این شاخص همچنین بیانگر میزان آزادی بیان، آزادی احزاب و تشکلهای اجتماعی، و آزادی رسانه‌های جمعی است. |
| ثبات سیاسی و نبود خشونت | این شاخص بیانگر آن است که چه میزان احتمال دارد یک حکومت و نظام سیاسی از راه‌های غیرقانونی یا ابزارهای خشونت‌آمیز در معرض بی‌ثباتی و سرنگونی و براندازی است. در اینجا عواملی همچون تروریسم و خشونت‌های سیاسی مدنظر هستند. |
| حاکمیت قانون | اینکه تا چه میزان قوانین در یک جامعه واقعی‌اند و می‌توان به اجرای آنها اطمینان داشت با این شاخص ارزیابی می‌شود. در این شاخص به‌ویژه کیفیت اجرای قراردادهای، عملکرد پلیس و محاکم قضایی، و همچنین میزان احتمال جرم و خشونت در یک جامعه مدنظر است. |
| مهار فساد | آنچه در این شاخص مدنظر قرار می‌گیرد این است که قدرت عمومی و دولتی تا چه حد مورد سوءاستفاده و در خدمت تحقق منافع شخصی و خصوصی قرار می‌گیرد. این شاخص، هم فسادهای جزئی و کوچک و هم فسادهای بزرگ و کلان را شامل می‌شود. |
| اثربخشی دولت | در این شاخص، کیفیت خدمات عمومی، خدمات شهروندی و میزان استقلال آنها از فشارهای سیاسی مدنظر است. همچنین کیفیت تدوین و اجرای خط‌مشی‌های عمومی و دولتی، و میزان تعهدی که دولت در برابر این سیاست‌ها دارد در کانون ارزیابی قرار می‌گیرد. |
| کیفیت تنظیم‌گری | منظور از این شاخص، توانمندی دولت در تدوین و اجرای سیاست‌ها و مقررات و نظاماتی است که سبب گسترش نفوذ و دامنه فعالیت‌های بخش خصوصی می‌شود. |

منبع: (Kaufmann et al., 2007)

شایان توجه است با بهبود شاخص‌های حکمرانی، شاهد بهبود شاخص آزادی اقتصادی در بلندمدت خواهیم بود. لذا می‌توان بیان داشت حکمرانی خوب و آزادی اقتصادی اغلب به‌طور تجربی بر یکدیگر منطبق هستند، به‌طوری که کشورهایی با حکمرانی بهتر، دارای شاخص آزادی اقتصادی بالاتری می‌باشند. با این حال اصلاحات چشمگیر در یکی از آنها شامل اصلاحات متناسب چشمگیر در دیگری نمی‌گردد و حداکثر سازی یکی به معنای حداکثر سازی دیگری نیست. در واقع دلایل قابل توجهی برای این باور وجود دارد که حکمرانی و آزادسازی اقتصادی دو مرحله مجزا در یک روند هستند (Gwartney and Lawson, 2008). لذا به نظر می‌رسد حکمرانی و آزادی اقتصادی ارتباط نزدیکی با یکدیگر دارند، ایجاد حکمرانی خوب لازمه بهبود آزادی اقتصادی است و در راستای بهبود آزادی اقتصادی، به مؤلفه‌هایی همچون حکمرانی باید

توجه نمود.

شاخص‌های حکمرانی منتشره توسط بانک جهانی ضمن پذیرش دخالت منطقی دولت، بر نقش تسهیل‌گری آن تأکید می‌نمایند و با رویکرد توسعه سیاسی و دموکراسی بر نقش مهم دولت بر بسترسازی به منظور تقویت نهادهای مدنی، آزادی‌های اجتماعی تأکید می‌ورزند. شایان توجه است اجزای شاخص آزادی اقتصادی نظیر حجم دولت، تنظیم مقررات، ساختار قانونی و حمایت از حقوق مالکیت نیز با این نظریه هم عقیده است. همچنین در حکمرانی خوب بین سه رکن اصلی دولت، جامعه مدنی و بخش خصوصی ارتباط نزدیکی وجود دارد، شراکت موجود سبب می‌شود از امور عمومی به شکل صحیح‌تر و بهینه‌تری بهره‌برداری گردد. ارتباط صحیح موجود بین سه رکن فوق‌زمینه را برای تحقق حکمرانی خوب در ابعاد مختلف میسر می‌سازد و از طرفی، بهبود آزادی اقتصادی را نیز میسر می‌سازد (Komijani and Salatin, 2008).

در تحلیل‌های آزادی اقتصادی دو نوع راهبرد وجود دارد. راهبرد اول، روابط اجزای شاخص آزادی اقتصادی را با خروجی‌های اقتصاد (شامل نرخ رشد اقتصادی، درآمد، فقر و...) بررسی می‌نماید. راهبرد دوم، با به‌کارگیری تحلیل عاملی اکتشافی به تبیین ارتباط دقیق شاخص‌های آزادی اقتصادی با سایر شاخص‌های مورد نظر، جهت ارزیابی تفاوت‌ها و شباهت‌ها در ساختارهای اساسی آن‌ها می‌پردازد. در این مطالعه نیز از روش تحلیل عاملی اکتشافی به بررسی تأثیر اجزای شاخص حکمرانی خوب بر شاخص آزادی اقتصادی و همچنین بررسی ارتباط متقابل بین آن‌ها می‌پردازیم. Cohen (۲۰۱۱) در مطالعه‌ای تحت عنوان "آیا آزادی اقتصادی همان نظام سرمایه‌داری است؟ تجزیه و تحلیل شاخص آزادی اقتصادی" بیان داشته است شاخص آزادی اقتصادی معمولاً به درستی تعبیر نمی‌گردد و عموماً به عنوان شاخص بازار آزاد بکار گرفته می‌شود، اما نکته قابل تأمل آن است که آزادی اقتصادی ترکیبی از حداقل دو مفهوم متمایز و مرتبط به یکدیگر است که شامل آزادسازی اقتصادی (Economic Liberalism) و حکمرانی خوب است. در اینجا منظور از آزادسازی اقتصادی، آزادی تجارت بین‌الملل و اقتصاد باز است. Cohen از طریق تجزیه و تحلیل عاملی اکتشافی و تأییدی برای کشورهای توسعه یافته (OECD) طی دوره زمانی ۱۹۹۵-۲۰۰۸ نشان داده است شاخص ساختار قانونی و حقوق مالکیت که از جمله عوامل تعیین‌کننده شاخص آزادی اقتصادی است، ارتباط نزدیک‌تری با اجزای تشکیل‌دهنده حکمرانی خوب دارد، لذا بررسی دقیق و علمی آزادی اقتصادی به شدت نیازمند آن است که اجزای تشکیل‌دهنده حکمرانی

خوب نیز به همراه آن مورد توجه قرار گیرد.

Jasbi and Nafari (۲۰۰۹)، در مطالعه‌ای تحت عنوان "طراحی الگوی حکمرانی خوب بر پایه نظریه سیستم‌های باز" بیان داشته‌اند حکمرانی خوب هم در رابطه با تمهیدات و فرایندهاست (آنچه که انجام می‌دهیم) و هم در رابطه با نتایج و پیامدهاست (آنچه که به دست می‌آوریم). بر این اساس حکمرانی خوب نه تنها در برگیرنده ویژگی‌های فرایندی مانند مشارکت‌سازی، شفاف-سازی، تصمیم‌گیری و قانونمند نمودن امور است، بلکه ویژگی‌های غایت‌مندانه و ارزشی مانند آزادی و عدالت را نیز شامل می‌گردد.

بنابراین مطابق با پیشینه پژوهش، شاخص آزادی اقتصادی به شدت وابسته به حکمرانی خوب است. به عبارت دیگر از جمله عوامل مؤثر و تعیین‌کننده آزادی اقتصادی، شاخص حکمرانی خوب است. لذا در ادامه جهت تبیین روشنی از رابطه بین آزادی اقتصادی و حکمرانی خوب، به تجزیه و تحلیل عاملی بین ۵ شاخص آزادی اقتصادی و ۶ شاخص حکمرانی خوب پرداخته شده است.

تجزیه و تحلیل

روش انجام کار

در این مطالعه ابتدا با استفاده از روش تحلیل خوشه‌ای (Complete-linkage hierarchical cluster analysis)، کشورهای منتخب منطقه منا را مطابق با بیشترین فاصله بین گروهی (Farthest Euclidian (L2) distances between groups) به گروه‌های متشابه تقسیم می‌نماییم. سپس به این موضوع می‌پردازیم که آیا آزادی اقتصادی و حکمرانی خوب دو مفهوم مجزا می‌باشند، یا اینکه در ارتباط با یکدیگر هستند و آزادی اقتصادی تحت تأثیر شاخص حکمرانی خوب قرار می‌گیرد. قابل توجه است آمار شاخص آزادی اقتصادی، از گزارش‌های مؤسسه فریزر (Fraser Institute) و آمار شاخص حکمرانی خوب نیز از گزارش حکمرانی خوب منتشره توسط بانک جهانی (Worldwide Governance Indicators) استخراج شده است. در مطالعه حاضر روش تحلیل عاملی بکار گرفته شده است. هدف اصلی تحلیل عاملی، بیان کوارینانس میان بسیاری از متغیرها بر اساس چند کمیت تصادفی غیر قابل مشاهده است که عامل‌ها (Factors) نامیده می‌شوند. به عبارت ساده و کاربردی‌تر، هنگامی که تعداد بسیار زیادی متغیر وجود دارد، می‌توان

تعدادی از این متغیرها را که همبستگی بالایی با هم دارند، در قالب یک متغیر یا عامل جدید خلاصه نمود. به عبارت دیگر تحلیل عاملی روشی است که با کشف ساختار یک مجموعه از متغیرها و کاهش آن‌ها به تعداد محدود، به بررسی متغیرهای اساسی تر یعنی عامل‌ها می‌پردازد.

تحلیل عاملی دو مرحله تکمیلی تحت عناوین تحلیل عاملی اکتشافی و تأییدی را شامل می‌گردد. تحلیل عاملی اکتشافی رویکردی جهت کاهش متغیرها و شناسایی عواملی است که ممکن است به طور تجربی وجود نداشته باشند. روش تحلیل عاملی تأییدی روش قوی‌تری برای تحلیل مدل‌های اندازه‌گیری است که با در نظر گرفتن یک طبقه‌بندی مفروض برای داده‌ها بر اساس تئوری، معنی‌داری این طبقه‌بندی‌ها را برای پیش‌بینی رابطه بین متغیرها می‌آزماید؛ به عبارت دیگر تجزیه و تحلیل عاملی تأییدی گروه‌بندی داده را در معرض تأیید یا رد قرار می‌دهد.

همانطور که قبلاً نیز خاطر نشان گردید شاخص حکمرانی خوب از شش شاخص حق اظهار نظر و پاسخگویی، شاخص ثبات سیاسی و نبود خشونت، شاخص حاکمیت قانون، شاخص مهار و کنترل فساد، شاخص کارایی و اثربخشی دولت و شاخص کیفیت قوانین و مقررات یا همان کیفیت تنظیم‌گری تشکیل شده است که جنبه‌های مختلف حکمرانی خوب را در نظر گرفته‌اند. دو شاخص حاکمیت قانون و کنترل فساد، از لحاظ مفهومی، همپوشانی بسیار زیادی با شاخص ساختار قانونی و حقوق مالکیت که یکی از شاخص‌های آزادی اقتصادی است، دارا هستند. لذا متغیرهای یادشده را جهت انجام تحلیل عاملی حذف می‌نماییم. همچنین مشاهده می‌گردد مؤلفه کیفیت تنظیم‌گری که از شاخص‌های حکمرانی خوب است، بیشتر در سیاست تفسیر می‌گردد و به طور خاص بر توانمندسازی بخش خصوصی تمرکز دارد. هدف این مطالعه تشخیص رابطه بین شاخص آزادی اقتصادی و شاخص‌های غیر سیاسی و صرفاً اقتصادی حکمرانی خوب است، لذا نادیده پنداشتن این متغیر نیز خللی در تحلیل وارد نمی‌سازد.

استخراج ماتریس کوواریانس و نمایش نمودار خوشه‌ای

گزارش‌های سالیانه آزادی اقتصادی بر این حقیقت تأکید می‌ورزند که ثروتمندترین کشورها، آزادترین کشورها هستند، این رابطه سبب تشویق کشورهای در حال توسعه به سمت آزادی اقتصادی بیشتر شده است (Gwartney and Lawson, 2008). ایده اساسی این امر اینکه کشورهای فقیر با تقلید از یک کشور ثروتمند می‌توانند ثروتمند شوند، اما اکثر محققان این گزاره

را نقد کرده‌اند (Chiot and Hall, 1982, Hettne, 1995 and Easterly, 2001)، به طوری که بیان داشته‌اند ساختار اقتصادی متفاوت کشورها، به انتخاب رویکردهای متفاوت رشد و توسعه اقتصادی از کانال شاخص‌های نهادی منجر می‌گردد.

جدول ۴- کوواریانس شاخص آزادی اقتصادی، شاخص حکمرانی خوب و تولید ناخالص داخلی سرانه در کشورهای منتخب منا (میانگین سالانه ۲۰۱۰-۱۹۹۶)

| | | (1) | (2) | (3) | (4) | (5) | (6) | (7) | (8) | (9) | (10) | (11) | (12) |
|------|-----------------------------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|
| (1) | <i>Per Capita GDP (log)</i> | 1.00 | | | | | | | | | | | |
| (2) | <i>EFW Govt. Size</i> | 0.47 | 1.00 | | | | | | | | | | |
| (3) | <i>EFW Legal Structure</i> | 0.51 | 0.36 | 1.00 | | | | | | | | | |
| (4) | <i>EFW Sound Money</i> | 0.39 | 0.39 | 0.32 | 1.00 | | | | | | | | |
| (5) | <i>EFW Free Trade</i> | 0.71 | 0.36 | 0.50 | 0.65 | 1.00 | | | | | | | |
| (6) | <i>EFW Regulation</i> | 0.61 | 0.45 | 0.62 | 0.59 | 0.78 | 1.00 | | | | | | |
| (7) | <i>GI Voice</i> | 0.40 | 0.27 | 0.48 | 0.22 | 0.38 | 0.45 | 1.00 | | | | | |
| (8) | <i>GI Pol. Stability</i> | 0.65 | 0.27 | 0.73 | 0.31 | 0.61 | 0.59 | 0.42 | 1.00 | | | | |
| (9) | <i>GI Govt. Eff</i> | 0.70 | 0.44 | 0.65 | 0.37 | 0.69 | 0.76 | 0.54 | 0.72 | 1.00 | | | |
| (10) | <i>GI Rule of Low</i> | 0.72 | 0.41 | 0.70 | 0.55 | 0.77 | 0.77 | 0.64 | 0.81 | 0.81 | 1.00 | | |
| (11) | <i>GI Contr. Corr</i> | 0.77 | 0.50 | 0.66 | 0.43 | 0.68 | 0.70 | 0.64 | 0.73 | 0.79 | 0.83 | 1.00 | |
| (12) | <i>GI Reg. Quality</i> | 0.70 | 0.47 | 0.48 | 0.46 | 0.74 | 0.79 | 0.58 | 0.65 | 0.85 | 0.85 | 0.77 | 1.00 |

منبع: محاسبات تحقیق

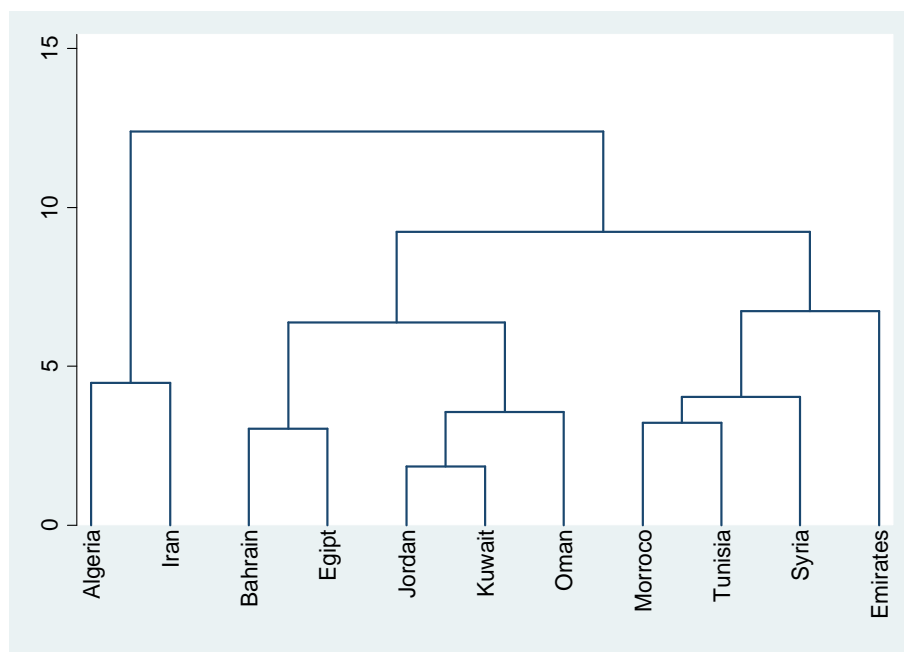
بنابراین با توجه به مطالب مذکور، به نظر می‌رسد بین شاخص آزادی اقتصادی، شاخص حکمرانی خوب و سطح ثروتمندی کشور که عموماً تولید ناخالص داخلی سرانه را معیاری برای آن در نظر می‌گیرند، ارتباط برقرار است. لذا در جدول ۴، ماتریس همبستگی بین لگاریتم تولید ناخالص داخلی سرانه، شاخص‌های آزادی اقتصادی و شاخص‌های حکمرانی خوب را نمایش می‌-

دهد.

همانطور که ملاحظه می‌گردد شاخص‌های مورد مطالعه بخصوص اجزای شاخص حکمرانی، همبستگی بالایی با تولید ناخالص داخلی سرانه دارند. این امر بدین معنی است که آزادی اقتصادی و حکمرانی خوب منجر به حصول درآمد سرانه بالاتری می‌گردد.

از طرفی اجزای شاخص حکمرانی خوب همبستگی بالایی با یکدیگر دارند و از طرف دیگر اجزای شاخص حکمرانی خوب همبستگی بالایی با شاخص ساختار قانونی و حقوق مالکیت (یکی از اجزای شاخص آزادی اقتصادی) دارا هستند. قابل توجه است بین اجزای شاخص حکمرانی با اجزای شاخص آزادی اقتصادی ارتباط قوی‌تری نسبت به ارتباط بین خود اجزای شاخص آزادی اقتصادی وجود دارد. مشاهده می‌گردد کشورهای مورد مطالعه هر یک درجه متفاوتی از آزادی اقتصادی و حکمرانی خوب را در نظر گرفته‌اند که این گزاره مؤید این نکته است که همواره حداکثر سازی شاخص آزادی اقتصادی، هدف اولیه نیست، بلکه ابتدا باید با شناخت دقیق از شاخص اقتصاد و بهبود شاخص حکمرانی خوب زمینه را برای حرکت در مسیر بهبود شاخص آزادی اقتصادی فراهم آورد. تفاوت بین کشورها از لحاظ آزادی اقتصادی توسط تحلیل خوشه‌ای نمایش داده می‌شود. شکل ذیل نتیجه تحلیل خوشه‌ای را که با استفاده از میانگین شاخص‌های ۱۱ کشور منتخب منطقه مناجام شده است، نمایش می‌دهد. هدف از تحلیل خوشه‌ای آن است که در بین کشورهای مورد مطالعه، آن گروه از کشورها را که از لحاظ برخورد با سیاست‌های آزادی اقتصادی و حکمرانی خوب یکسان عمل نموده‌اند عضو یک گروه گردند.

تجزیه و تحلیل خوشه‌ای، ۱۱ کشور مورد مطالعه را به ۵ گروه تقسیم می‌نماید. گروه اول شامل الجزایر و جمهوری اسلامی ایران، گروه دوم شامل بحرین و مصر، گروه سوم شامل اردن، کویت و عمان، گروه چهارم شامل مراکش، تونس و سوریه و گروه پنجم شامل امارات متحده عربی می‌گردد. جهت تشخیص خصوصیات گروه‌های مذکور، جدول ذیل میانگین شاخص آزادی اقتصادی و حکمرانی خوب را در هر یک از گروه‌ها طی دوره ۲۰۱۰-۱۹۹۶ ارائه می‌دهد.



نمودار ۱- نمودار تحلیل خوشه‌ای شاخص‌های آزادی اقتصادی و حکمرانی خوب در کشورهای منتخب منطقه مناسی دوره (۱۹۹۶-۲۰۱۰)
*مأخذ: محاسبات تحقیق

مطابق با آمار جدول ۴، ملاحظه می‌گردد امارات متحده عربی، اردن، کویت و عمان از لحاظ شاخص آزادی اقتصادی و حکمرانی خوب بهترین رتبه‌ها را در بین سایر گروه‌ها کسب نموده‌اند. به عبارت دیگر، کشورهای مذکور (گروه دوم و پنجم)، به‌طور همزمان در راستای بهبود آزادی اقتصادی و حکمرانی حرکت نموده‌اند. البته تفاوت دو گروه مذکور در اولویت‌بندی اجزای آزادی اقتصادی و حکمرانی است. همچنین مشاهده می‌گردد گروه اول که شامل جمهوری اسلامی ایران و الجزایر است در هر دو شاخص مورد مطالعه ضعیف‌تر از سایر گروه‌ها عمل نموده، همواره در رده آخر قرار گرفته و عدد شاخص‌های اکتسابی آن‌ها از میانگین نیز پایین‌تر است. شایان توجه است کشورهای مورد مطالعه دارای منابع نفتی هستند، اما از لحاظ اقتصادی عملکردهای متفاوتی دارند. البته ذکر این نکته ضروری است که ماهیت نفت منجر به این امر نمی‌گردد، بلکه مدیریت کلان اقتصادی در مورد اقتصادهای نفتی، متفاوت است. اقتصادهای نفتی اکثراً نارسایی‌ها و ضعف‌های اقتصادی را علی‌الخصوص در مورد کاهش شکاف فنی با کشورهای

توسعه یافته، به واسطه ثروت‌های کلان نفتی از کانال واردات فناوری مرتفع می‌سازند، اما تا زمانی که با ایجاد تحول فنی به بومی‌سازی مؤلفه‌های دانش در کشورشان نپردازند، بستر رشد اقتصادی مستمر و باثبات فراهم نمی‌گردد. بنابراین منطقی است اقتصادهای نفتی از طریق مدیریت مؤلفه‌های جدید تولید در راستای تقویت ساختار اقتصاد دانش‌بنیان و کاهش شکاف فناوری با کشورهای توسعه یافته و تبدیل ثروت‌های تجدیدناپذیر به تجدیدپذیر گام بردارند.

جدول ۵- میانگین شاخص آزادی اقتصادی و حکمرانی خوب در گروه‌های منتخب منطقه منا

| گروه | شاخص کلی آزادی اقتصادی | حجم دولت | پول سالم | تجارت آزاد | مقررات | ساختار قانونی و حقوق مالکیت | حق اظهار نظر و پاسخگویی | ثبات سیاسی | اثر بخشی دولت |
|---------------------|------------------------|-------------|-------------|-------------|-------------|-----------------------------|-------------------------|--------------|---------------|
| الجزایر و ایران | 5.33 (5) | 5.25 (4) | 6.89 (5) | 4.92 (5) | 4.39 (5) | 4.74 (5) | -1.15 (5) | -1.19 (5) | -0.61 (5) |
| بحرین و مصر | 7.08 (3) | 6.40 (2) | 8.82 (1) | 7.16 (3) | 6.42 (3) | 5.73 (4) | -0.93 (3) | -0.30 (4) | 0.10 (3) |
| اردن، کویت و عمان | 7.39 (1) | 5.88 (3) | 8.61 (2) | 7.45 (2) | 6.80 (1) | 7.29 (1) | -0.58 (1) | 0.27 (2) | 0.20 (2) |
| مراکش، تونس و سوریه | 5.83 (4) | 5.24 (5) | 7.05 (4) | 5.45 (4) | 4.98 (4) | 6.19 (3) | -1.03 (4) | -0.14 (3) | -0.16 (4) |
| امارات متحده عربی | 7.35 (2) | 7.02 (1) | 8.02 (3) | 8.46 (1) | 6.56 (2) | 6.85 (2) | -0.71 (2) | 0.85 (1) | 0.77 (1) |
| کل | 6.60 | 5.79 | 7.86 | 6.48 | 5.77 | 6.20 | -0.88 | -0.16 | -0.01 |

*مأخذ: محاسبات تحقیق

یکی از روش‌های آماری برای تجزیه اطلاعات موجود در مجموعه داده‌ها، روش تجزیه عامل‌ها یا تحلیل عاملی است. این روش توسط (Pearson, 1901) و (Spearman, 1904) برای اولین بار برای تعیین تأثیرگذارترین متغیرها زمانی که تعداد متغیرها زیاد و روابط بین آن‌ها ناشناخته است، بکار گرفته شد. در این روش متغیرها در عامل‌هایی قرار می‌گیرند به طوری که از

عامل اول به عامل‌های بعدی درصد واریانس کاهش می‌یابد و از این رو متغیرهایی که در عامل اول قرار می‌گیرند تأثیرگذارترین هستند. به‌طور کلی هدف از تجزیه عامل‌ها به شرح زیر خلاصه می‌شود:

تحلیل عاملی بر دو نوع تحلیل عاملی تأییدی و تحلیل عاملی اکتشافی است. در تحلیل عاملی اکتشافی پژوهشگر درصدد کشف ساختار زیربنایی مجموعه نسبتاً بزرگی از متغیرهاست و پیش فرض اولیه آنکه هر متغیری ممکن است با هر عاملی ارتباط داشته باشد، به‌عبارت‌دیگر پژوهشگر در این روش هیچ نظریه اولیه‌ای ندارد. در تحلیل عاملی تأییدی پیش فرض اساسی آن است که هر عاملی با زیرمجموعه خاصی از متغیرها ارتباط دارد. حداقل شرط لازم برای تحلیل عاملی تأییدی این است که پژوهشگر در مورد تعداد عامل‌های مدل، قبل از انجام تحلیل پیش فرض معینی داشته باشد. ولی در عین حال پژوهشگر می‌تواند انتظارات خود مبنی بر روابط بین متغیرها و عامل‌ها را نیز در تحلیل وارد نماید.

در تحلیل عاملی نمره فرد i در متغیر z را می‌توان به‌عنوان مجموعه ضرایب نمره‌ها در تعداد کمتری از متغیرهای حاصل که عوامل نامیده می‌شوند، تعریف نمود. هر عامل، ترکیب خطی متغیرهاست و بر پایه رابطه زیر برآورد می‌گردد:

$$Z_{ji} = a_{j1}F_{i1} + \dots + a_{jm}F_{im} + d_j U_{ji}$$

Z_{ji} نمره معیار فرد i ام در متغیر z ام است. F_{i1} نمره معیار فرد i در اولین عامل مشترک و F_{im} نمره معیار وی در m امین عامل مشترک است. عبارت U_{ji} نمره معیار فرد i در چیزی است که عامل اختصاصی نامیده می‌شود. یعنی عاملی که تنها در یک متغیر واحد موجود است که در این مورد متغیر z است. ضرایب a_{jm} بارهای عاملی هستند. این‌ها ضرایبی هستند که به نمره‌های عامل مشترک نسبت داده می‌شوند. ضریب d_j وزنی است که به نمره‌های عامل اختصاصی تعلق می‌یابد. معادله ۱ به شکل نمره معیار است. بنابراین نمره‌های Z_{ji} و نمره‌های عاملی F_i میانگین صفر و واریانس واحد دارند. با مجذور نمودن هر دو طرف معادله ۱، و سپس جمع آن‌ها برای N مورد و تقسیم آن بر N و این فرض که نمره‌های عاملی ناهمبسته هستند، می‌توان نوشت:

$$S2_j = 1 = a2_{j1} + a2_{j2} + \dots + a2_{jm} + d2_j$$

این معادله نشان می‌دهد واریانس کل را می‌توان به دو بخش جمع‌پذیر واریانس مشترک و واریانس منفرد تقسیم کرد. میزان اشتراک یک متغیر که اغلب با علامت $H2_j$ نشان داده می‌شود،

برابر است با مجموع مجذورات بارهای عاملی مشترک.

$$H2_j = 1 = a2_{j1} + a2_{j2} + \dots + a2_{jm}$$

میزان اشتراک بخشی از واریانس است که می توان آن را به عوامل مشترک نسبت داد. بخشی از واریانس که باقی می ماند و نمی توان آن را به عوامل مشترک نسبت داد واریانس منفرد است که با علامت $d2_j$ نشان داده می شود. واریانس منفرد را گاهی به دو مؤلفه اختصاصی $b2_j$ و واریانس خطا $e2_j$ تقسیم می کنند. واریانس اختصاصی بخشی از واریانس کل است که به عواملی که به متغیر معینی اختصاص دارد و به خطای اندازه گیری ربطی ندارد، مربوط می شود. از آنجا که تمام اندازه گیری ها تا اندازه ای شامل خطا هستند، در تحلیل عاملی بخشی از واریانس منفرد ناشی از خطای اندازه گیری خواهد بود.

یکی از روش های انتخاب متغیرهای مناسب برای تحلیل عاملی استفاده از ماتریس همبستگی است. از آنجا که روش تحلیل عاملی بر همبستگی بین متغیرها اما از نوع غیر علی استوار است، بنابراین در استفاده از این روش باید ماتریس همبستگی بین متغیرها نیز محاسبه شود. به طور معمول این گونه ماتریس های همبستگی وجود رابطه بین برخی متغیرها و عدم ارتباط آن با برخی دیگر را نشان می دهند. این الگو در تحلیل عاملی موجب شکل گیری خوشه هایی می شود که متغیرهای درون خوشه با یکدیگر همبستگی و با متغیرهای خوشه های دیگر همبستگی نداشته باشند.

ذکر این نکته ضروری است که در تحلیل عاملی سه واریانس وجود دارد، واریانس مشترک، به نسبتی از واریانس گفته می شود که به وسیله عامل های مشترک تبیین می گردد. واریانس خاص، به یک متغیر خاص مربوط می شود و واریانس خطا که ناشی از بی اعتباری و ناپایایی داده های جمع آوری شده است.

در روش تجزیه مؤلفه های اصلی، عامل ها، واریانس هر متغیر از جمله واریانس مشترک با سایر متغیرهای مجموعه و نیز واریانس خاص متغیر را توجیه می کنند، پس تعداد عامل ها در این روش از نظر تئوری باید با تعداد متغیرها برابر باشد، زیرا واریانس هر متغیر باید توسط عامل ها تبیین شود. به عبارت دیگر در تجزیه مؤلفه های اصلی به تعداد متغیرها، مؤلفه وجود دارد، ولی عامل هایی استخراج می شوند که بیشترین مقدار واریانس را تبیین کنند. هر عامل شامل یک یا چند متغیر است. مجذورات بارهای یک عامل نشان دهنده درصدی از واریانس ماتریس همبستگی است که به وسیله آن عامل تبیین می شود، این مقدار را مقدار ویژه نامند. برای محاسبه آن کافی است

ضریب همبستگی متغیرها را با یک عامل به توان برسانیم و با هم جمع کنیم تا مقدار ویژه آن عامل به دست آید. هر چه مقدار ویژه یک عامل بیشتر باشد، آن عامل واریانس بیشتری را تبیین می‌نماید. بر این اساس تعداد عامل‌ها با توجه به مقدار ویژه هر عامل مشخص می‌شود و عامل‌هایی که مقدار ویژه آن‌ها بیشتر از یک باشد، به عنوان عامل‌های معنی‌دار در نظر گرفته می‌شود. در ماتریس عاملی هر ستون معرف یک عامل است. مقادیر هر ستون نشان‌دهنده بارهای عاملی هر متغیر با یک عامل هستند، در خروجی نرم‌افزار، عامل‌ها از چپ به راست قرار می‌گیرند و متغیرها در ستون اول قرار می‌گیرند، برای تفسیر، مقادیر متغیرها به ترتیب در عامل‌های مختلف بررسی می‌شوند.

تحلیل عاملی اکتشافی

همان‌گونه که قبلاً نیز توضیح داده شد، هدف از تجزیه و تحلیل عاملی اکتشافی آن است که مجموعه بزرگی از متغیرها را به محدوده کوچک‌تری از عوامل کاهش دهیم که این عوامل بر مفاهیم پایه‌ای مشترک دلالت دارند. جدول ۶ نتیجه تحلیل عاملی را نمایش می‌دهد. هر ردیف در جدول ذیل، یک عامل را نشان می‌دهد. عامل‌ها بیانگر یک مفهوم پایه‌ای منحصر به فردی است که شاخص‌های مورد مطالعه نشان می‌دهند. ستون اول در جدول ذیل، واریانس هر عامل (واریانس همه موارد مربوط به آن عامل) را نشان می‌دهد. ستون دوم در جدول ذیل، نسبت واریانس عامل را به کل واریانس محاسبه نموده است. ستون سوم جدول نیز واریانس تجمعی عامل‌ها را نشان می‌دهد. همانطور که مشخص است واریانس تجمعی عامل‌ها بیش از ۱۰۰ درصد است، این امر بدین معنی است که عوامل دیگری با واریانس‌های منفی وجود دارند که قابل مشاهده نیستند و یا گزارش نشده‌اند (مجموع واریانس‌های تجمعی عامل‌ها بایستی برابر ۱۰۰ درصد باشد، ولی در اینجا بیشتر از ۱۰۰ درصد است؛ بنابراین عوامل پنهانی دیگری با واریانس‌های منفی وجود دارند که در نهایت با احتساب آن‌ها، مجموع واریانس‌ها ۱۰۰ درصد می‌شود). اصطلاحاً به این مدل‌ها، مدل با داده‌های بیش از حد متناسب می‌گویند. قابل توجه است عامل‌ها به شیوه‌ای استخراج می‌شوند که محورهای عاملی در حالت ۹۰ درجه قرار گیرند و این بدین معناست که هر عامل، مستقل از سایر عامل‌هاست؛ بنابراین همبستگی بین عامل‌ها به طور قراردادی صفر تعیین می‌گردد. با بررسی ماتریس چرخش نیافته، محقق می‌تواند به جستجوی روش‌های تلخیص داده‌ها و تعیین

تعداد عامل‌های استخراجی پردازد. اما تعیین نهایی تعداد عامل‌ها پس از دستیابی به ماتریس عاملی چرخش یافته امکان‌پذیر است. یکی از مفاهیم مهم در تحلیل عاملی، چرخش عامل‌هاست. بسیاری از آماردانان و محققان معتقدند در بسیاری از موارد، عامل‌های چرخش نیافته کافی نیستند، زیرا چرخش عامل‌ها از ورود برخی از متغیرها در عامل‌های مختلف جلوگیری می‌کند و ساختار عاملی مناسب و با قابلیت تفسیر بیشتر ارائه می‌دهد. بنابراین دلیل اصلی چرخش عامل‌ها دستیابی به ماتریس عاملی ساده و از نظر تئوری معنادار و قابل تفسیرتر است. عامل‌ها به دور مبدأ، چرخش داده می‌شوند تا موقعیت جدیدی کسب نمایند.

جدول ۷ نیز دوران عامل‌ها را نشان می‌دهد که کمک می‌کند تفاوت بین عامل‌ها را واضح‌تر مشخص نماییم.

جدول ۶- تجزیه و تحلیل عاملی شاخص‌های آزادی اقتصادی و حکمرانی خوب

کشورهای منتخب مناطی دوره (۲۰۱۰-۱۹۹۶)

| Factor | Variance | Proportion | Cumulative |
|----------|----------|------------|------------|
| Factor 1 | 3.65 | 0.90 | 0.90 |
| Factor 2 | 0.41 | 0.12 | 1.03 |
| Factor 3 | 0.09 | 0.03 | 1.06 |

جدول ۷- دوران عامل‌های حاصل از جدول ۶

| Variable | Factor 1 | Factor 2 | Factor 3 | Uniqueness |
|-----------------------------|----------|----------|----------|------------|
| EFW Size of Government | 0.49 | 0.14 | 0.25 | 0.68 |
| EFW Regulation | 0.87 | 0.16 | 0.03 | 0.20 |
| EFW Sound Money | 0.58 | 0.46 | 0.01- | 0.44 |
| EFW Free Trade | 0.82 | 0.26 | -0.18 | 0.21 |
| EFW Legal Structure | 0.75 | -0.29 | 0.03 | 0.34 |
| GI Voice & Accountability | 0.54 | -0.18 | 0.16 | 0.64 |
| GI Political Stability | 0.77 | -0.31 | -0.19 | 0.27 |
| GI Government Effectiveness | 0.86 | -0.16 | 0.05 | 0.22 |

ستون آخر جدول ۷، واریانس منحصر به فرد هر متغیر را نشان می‌دهد، این واریانس با دیگر متغیرها به اشتراک گذاشته نمی‌شود. حجم دولت بیشترین واریانس منفرد و یا منحصر به فرد را دارد. در اینجا دو عامل جهت تفسیر اکثریت واریانس مشاهده شده بین شاخص آزادی اقتصادی و حکمرانی خوب موجود است. عامل اول همبستگی مثبتی با شاخص آزادی اقتصادی و حکمرانی خوب داراست که می‌تواند پیشنهادی برای آزادسازی اقتصادی و حکمرانی خوب به‌طور همزمان

تلقی گردد. به نظر می‌رسد عامل اول به‌طور گسترده‌تری توسط شاخص حکمرانی و شاخص ساختار قانونی و حقوق مالکیت، تجارت آزاد و تنظیم مقررات توضیح داده می‌شود.

مطابق جدول ۶، عامل دوم که ۱۲ درصد از واریانس داده‌ها را توضیح می‌دهد، بیشتر با شاخص آزادی اقتصادی در رابطه است و ارتباط اندکی با شاخص ساختار قانونی و حقوق مالکیت نشان می‌دهد. این عامل را می‌توان به‌عنوان پیشنهادی برای ارتقای آزادی اقتصادی بدون توجه به حکمرانی در نظر گرفت.

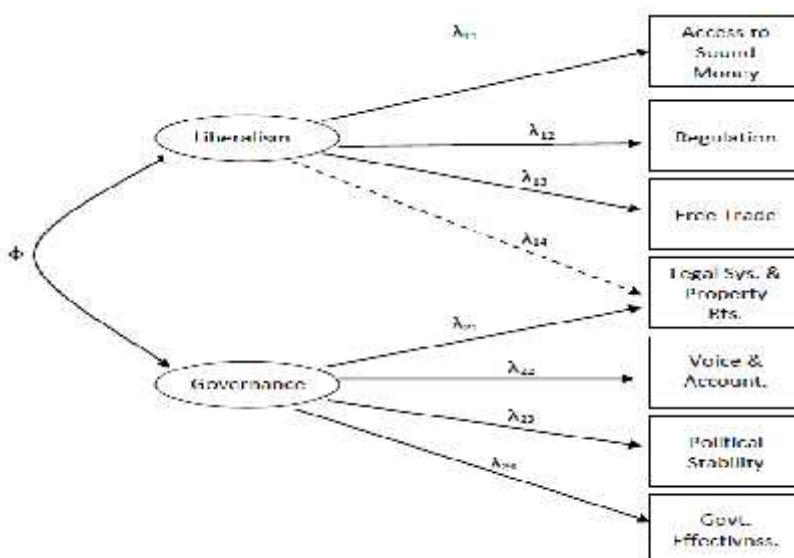
در بین پنج شاخص اصلی آزادی اقتصادی، چهار مورد اول شامل اندازه دولت، آزادی تجارت، تنظیم مقررات بازارها و دسترسی به پول سالم، از لحاظ مفهومی در ارتباط مستقیم با شاخص آزادی اقتصادی هستند. در مورد شاخص پنجم که شاخص ساختار قانونی و حقوق مالکیت است، می‌توان بیان نمود عموماً این شاخص شرایط ساختاری و قانونی که برای عملکرد خوب بازار مورد نیاز است، را نشان می‌دهد. لذا از این لحاظ این مؤلفه دارای مفهومی متمایز از دیگر مؤلفه‌ها است و به نظر می‌رسد بیشتر در ارتباط با شاخص‌های اجرایی است (Cohen, 2011). بنابراین از لحاظ مفهومی، ساختار قانونی و حمایت از حقوق مالکیت، ارتباط نزدیک‌تری با حکمرانی داراست. بدین ترتیب مطابق با نتایج تحلیل عاملی اکتشافی، شاخص ساختار قانونی و حقوق مالکیت بسیار زیاد شبیه به شاخص حکمرانی رفتار می‌نماید. بنابراین نتایج تحلیل عاملی اکتشافی نشان می‌دهد ساختار قانونی و حقوق مالکیت قوی، هم در کشورهایی همراه با آزادی اقتصادی بالاتر و هم در کشورهایی با حکمرانی خوب قابل مشاهده است، اما شاخص ساختار قانونی و حقوق مالکیت ارتباط بیشتری با شاخص حکمرانی خوب داراست.

تحلیل صورت پذیرفته صرفاً یک تحلیل اکتشافی و پیشنهادی است و تجزیه و تحلیل عاملی تأییدی این امکان را فراهم می‌آورد که به‌طور مستقیم این دسته‌بندی انجام شده را مورد آزمون قرار دهیم.

تجزیه و تحلیل عاملی تأییدی

نمودار ۲ تصویری از مدلی را که قرار است مورد آزمون قرار دهیم، نمایش می‌دهد. شایان توجه است این نمودار بر مبنای تحلیل عاملی اکتشافی انجام شده در قسمت قبل ترسیم شده است. به‌طوری‌که شاخص ساختار قانونی و حمایت از حقوق مالکیت را هم در ارتباط با شاخص آزادی

اقتصادی و هم در ارتباط با شاخص حکمرانی خوب در نظر می‌گیریم.



نمودار ۲- مدل تحلیل عاملی تأییدی

**منبع: محاسبات تحقیق

در نمودار بالا، $\{$ نشان‌دهنده رابطه بین متغیرهای مشهود (اجزای شاخص آزادی اقتصادی و حکمرانی خوب) با متغیرهای پنهان (شاخص کلی آزادی اقتصادی و شاخص کلی حکمرانی خوب) است. هم بیانگر رابطه بین شاخص حکمرانی خوب و شاخص آزادی اقتصادی است. جهت ساده‌تر شدن نمودار، اجزای خطا (Error terms) را در نمودار نمایش نداده‌ایم. شایان توجه است در این قسمت دو مدل را آزمون خواهیم نمود، در مدل ۱، شاخص ساختار قانونی و حقوق مالکیت هم به‌عنوان یکی از اجزای شاخص آزادی اقتصادی و هم به‌عنوان یکی از اجزای شاخص حکمرانی خوب در نظر گرفته می‌شود و در مدل ۲، شاخص ساختار قانونی و حقوق مالکیت فقط یکی از اجزای شاخص حکمرانی خوب به حساب می‌آید. جدول ۸، نتایج حاصل از تحلیل عاملی تأییدی را نمایش می‌دهد. در مدل ۱، بارهای عاملی برای کلیه اجزای شاخص حکمرانی و آزادی اقتصادی به جز شاخص سیستم قانونی و حقوق مالکیت که مربوط به شاخص آزادی اقتصادی است (۰/۲۲-)، مثبت و معنادار هستند؛ یعنی شاخص ساختار قانونی و حقوق مالکیت که به‌عنوان

یکی از شاخص‌های اصلی آزادی اقتصادی شناخته شده است، در این مدل ارتباط بیشتری با شاخص حکمرانی خوب نشان می‌دهد. به عبارت دیگر، در این مدل، شاخص ساختار قانونی و حقوق مالکیت کاملاً توسط شاخص حکمرانی خوب تعیین می‌گردد. همچنین مطابق با استانداردهای (Hu and Bentler, 1999)، تناسب مدل ۱ مورد تأیید قرار می‌گیرد، به طوری که ریشه استاندارد میانگین مربع باقیمانده‌ها (Standardized root mean square residual (SRMR))، زیر ۰/۰۹ و شاخص تناسب نسبی بنتلر (Comparative fit index (CFI))، ۰/۹ یا بالاتر است.

در مدل دوم، رابطه بین شاخص ساختار قانونی و حمایت از حقوق مالکیت را زیرمجموعه‌ای از آزادی اقتصادی نمی‌دانیم، بلکه این شاخص را تنها به عنوان زیرمجموعه‌ای از حکمرانی خوب در نظر می‌گیریم. با توجه به ضرایب به دست آمده در مدل دوم، مشاهده می‌گردد در بارهای عاملی سایر شاخص‌ها (بقیه اجزای شاخص آزادی اقتصادی و حکمرانی خوب)، تفاوت اندکی به وجود آمده است، همچنان شاخص ساختار قانونی و حمایت از حقوق مالکیت با ضریب ۰/۹۲ نیز ارتباط قوی با شاخص حکمرانی خوب دارد و همچنین آماره‌های SRMR و CFI نیز در حد استاندارد باقی مانده‌اند.

همچنین از آنجایی که هر چه آماره تناسب (Bayesian Information Criterion) BIC کوچک‌تر باشد حاکی از تناسب بهتر داده‌هاست، لذا با توجه به جدول ۸، آماره تناسب (BIC) نیز نشان‌دهنده آن است که تناسب داده‌ها در مدل دوم بهتر است، این امر بدین معناست زمانی که شاخص ساختار قانونی و حقوق مالکیت یکی از زیرمجموعه‌های شاخص حکمرانی خوب در نظر گرفته می‌شود (مدل دوم)، تناسب بهتری در داده‌ها حاصل گردیده است. بنابراین این نتیجه انعکاس می‌گردد که شاخص حکمرانی خوب بر شاخص آزادی اقتصادی بسیار تأثیرگذار است، تا جایی که یکی از شاخص‌های آزادی اقتصادی تحت عنوان شاخص ساختار قانونی و حقوق مالکیت در حد گسترده‌ای توسط شاخص‌های حکمرانی خوب تعیین می‌گردد.

قابل توجه است در هر دو مدل ارتباط متقابل قوی بین شاخص آزادی اقتصادی و شاخص حکمرانی خوب ملاحظه می‌گردد. به عبارت دیگر شاخص آزادی اقتصادی و شاخص حکمرانی خوب از یکدیگر تأثیر می‌پذیرند و بخشی از عوامل تعیین‌کننده یکدیگر محسوب می‌گردند. بنابراین شاخص آزادی اقتصادی و شاخص حکمرانی را به طور منطقی می‌توان دو جنبه اساسی از

فرایند توسعه تفسیر نمود.

جدول ۸- تحلیل عاملی تأییدی (شاخص آزادی اقتصادی و شاخص حکمرانی خوب)

| | | مدل ۱ | | | مدل ۲ | | |
|-------------------|---------------------------|---------------|---------|---------|---------------|---------|---------|
| | | Estimate | Std Err | Z-Value | Estimate | Std Err | Z-Value |
| } ₁₁ | freedom Sound Money | 0.65 | 0.05 | 13.00 | 0.65 | 0.05 | 12.89 |
| } ₁₂ | Freedom Free Trade | 0.88 | 0.03 | 29.86 | 0.87 | 0.03 | 29.86 |
| } ₁₃ | Freedom Regulation | 0.91 | 0.03 | 34.70 | 0.92 | 0.24 | 37.57 |
| } ₁₄ | Freedom Legal System | -0.22 | 0.17 | -1.25 | --- | --- | --- |
| } ₂₁ | Governance Legal System | 0.98 | 0.16 | 5.88 | 0.77 | 0.04 | 20.30 |
| } ₂₂ | Governance Voice | 0.57 | 0.06 | 10.16 | 0.58 | 0.06 | 10.26 |
| } ₂₃ | Governance Pol. Stability | 0.82 | 0.03 | 26.44 | 0.82 | 0.03 | 25.19 |
| } ₂₄ | Governance Govt. Eff | 0.89 | 0.03 | 32.87 | 0.89 | -0.03 | 36.02 |
| e1 | Sound Money | 7.2 | 0.40 | 17.83 | 7.2 | 0.40 | 17.83 |
| e2 | Free Trade | 4.32 | 0.25 | 17.26 | 4.32 | 0.25 | 17.26 |
| e3 | Regulation | 4.46 | 0.26 | 17.32 | 4.46 | 0.26 | 17.32 |
| e4 | Legal System | 4.79 | 0.27 | 17.42 | 4.79 | 0.27 | 17.42 |
| e5 | Voice | -2.32 | 0.15 | -15.52 | -2.33 | 0.15 | -15.52 |
| e6 | Pol. Stability | -0.22 | 0.08 | -2.82 | -0.22 | 0.08 | -2.82 |
| e7 | Govt. Eff | -0.02 | 0.08 | -0.26 | -0.02 | 0.08 | -0.26 |
| | Governance Liberalism | 0.86 | 0.03 | 25.39 | 0.85 | 0.03 | 25.58 |
| Model Chi-Sq (df) | | 76.87 (12) | | | 76.60 (13) | | |
| SRMR | | 0.05 | | | 0.05 | | |
| CFI | | 0.91 | | | 0.91 | | |
| BIC | | 2385.9 | | | 2382.5 | | |

نتیجه گیری و پیشنهادها

شاخص آزادی اقتصادی از جمله شاخص های تعیین کننده رشد و توسعه اقتصادی است و از طرفی از بسیاری از شاخص های کلان اقتصادی نیز تأثیر می پذیرد. اما حداکثر سازی مطلق شاخص آزادی اقتصادی نیز همواره گزینه مطلوب نیست، بلکه تعیین درجه آزادی اقتصادی هر کشور بستگی به ظرفیت ها و شرایط حاکم بر اقتصاد دارد. ضمن توجه به شکاف فناوری بین کشورهای

در حال توسعه با کشورهای توسعه یافته، با قطعیت نمی‌توان اظهار داشت توسعه تجارت بین‌الملل در راستای ارتقای شاخص آزادی اقتصادی، مطلوب همه کشورهای در حال توسعه است. لذا ملل در حال توسعه ابتدا بایستی از طریق شناسایی دقیق ظرفیت‌ها و مزیت‌ها، برتری نسبی در جامعه بین‌الملل برای خود ایجاد نمایند، سپس با رویکرد برد - برد به تجارت بین‌الملل بپردازند و منافع مضاعف کسب نمایند. همچنین با توجه به اینکه شاهد شکاف شاخص‌های توسعه‌ای کشورهای در حال توسعه با کشورهای توسعه یافته هستیم و از طرفی نمی‌توان جهت دستیابی به توسعه همه چیز را به دست نامرئی آدام اسمیت سپرد و در راستای توسعه مستمر، حمایت و هدایت الزاماتی گریزناپذیر هستند، لذا نگاه به تعامل بخش خصوصی و دولتی شدیداً نیازمند بهبود شاخص‌های حکمرانی خوب است تا دولت نقشی مکمل برای بخش خصوصی ایفا نماید. بنابراین به نظر می‌رسد شاخص حکمرانی خوب تأثیر بسزایی در تعیین شاخص آزادی اقتصادی دارد. لذا جهت دستیابی به رشد اقتصادی مستمر و باثبات و افزایش قدرت رقابت‌پذیری باید شرایط حکمرانی حاکم بر اقتصاد اصلاح گردد، سپس از طریق بهبود شاخص حکمرانی در راستای بهبود شاخص‌های اجرایی نظیر شاخص آزادی اقتصادی گام برداشت. در صورت وجود حکمرانی خوب، شاکله اصلی و اولیه جهت بهبود متغیرهای کلان اقتصادی، اصلاح ساختار اقتصادی و نیل به سوی توسعه اقتصادی میسر می‌گردد. نکته بسیار حائز اهمیت آن است که حکمرانی خوب بیشتر به دنبال ترکیب دولت و بخش خصوصی با نگرش مکمل بودن است و در پی ایجاد بستری جهت آماده‌سازی شرایطی مناسب برای بهبود شاخص‌های اقتصادی است.

حکمرانی و آزادی اقتصادی نقش مکملی در راستای نیل به سوی اهداف کلان اقتصادی دارا هستند، لذا رفع مغایرت‌ها و یک‌سو نمودن آن‌ها بخصوص در کشورهای در حال توسعه به منظور تعیین اولویت‌های سیاست‌گذاری اقتصاد کلان قابل تأمل است. یک سیستم قانونی قوی و منصف برای عملکرد خوب بازارها یک نیاز ساختاری مهم است، ولیکن آزادی اقتصادی یک اقتصاد در غیاب آن صحیح نیست. لذا درمی‌یابیم آزادی اقتصادی و حکمرانی خوب به شدت با یکدیگر در رابطه هستند. بدین معنی که هموارسازی مسیر بهبود شاخص آزادی اقتصادی توسط شاخص حکمرانی خوب صورت می‌پذیرد. چراکه برخی جنبه‌های آزادی اقتصادی مانند ساختار قانونی و حقوق مالکیت ارتباط نزدیک‌تری با مفهوم حکمرانی خوب دارند و این دو مهم باید در کنار یکدیگر بررسی گردند. لذا به سیاست‌گذاران اقتصادی می‌توان این توصیه سیاستی را نمود که

برای بهبود وضعیت خروجی‌های اقتصاد، ضروری است شاخص‌های نهادی را در ارتباط با یکدیگر در نظر گرفت و شاخص حکمرانی خوب را به‌عنوان پیش‌نیازی برای بهبود سایر شاخص‌های کلان اقتصادی مورد توجه قرار داد؛ به‌عبارت‌دیگر شاخص‌های اقتصادی نباید به‌صورت جزیره‌ای مورد تجزیه و تحلیل قرار گیرند.

References

- Ayal, E. B. and Karras, G. (1998). Components of economic freedom and growth: An empirical study. *Journal of Developing Areas*, 32(3); 327-338.
- Berggren, N. (2003). The benefits of economic freedom: A survey. *The Independent Review*, 8(2); 193-211.
- Berggren, N. and Jordahl, H. (2005). Does free trade really reduce growth? Further testing using the economic freedom index. *Public Choice*, 122(1); 99-114.
- Carlsson, F. and Lundström, S. (2002). Economic freedom and growth: decomposing the effects. *Public Choice*, 112(3-4); 335-344.
- Chirot, D. and Hall, Th. D. (1982). World-system theory. *Annual Review of Sociology*, 8(1); 81-106.
- Cohen, J. N. (2011). Is economic freedom strictly free market capitalism? A decompositional analysis of the economic freedom of the world index. Munich Personal RePEc Archive, Available at mpra.ub.uni-muenchen.de/33676/
- Easterly, W. R. (2001). *The elusive quest for growth: Economists' adventures and misadventures in the tropics*. Cambridge, MA, MIT Press.
- Economic freedom report at the world. 2012. Available at www.freetheworld.com.
- Gwartney, J. and Lawson, R. (2002). *Economic freedom of the world: 2002 Annual Report*. Vancouver, Economic Freedom Network.
- Gwartney, J. and Lawson, R. (2008). *Economic freedom of the world: 2008 Annual Report*. Vancouver, Economic Freedom Network.
- Gwartney, J. and Lawson, R. (2010). *Economic freedom of the world: 2010 Annual Report*. Vancouver, Economic Freedom Network.
- Hettne, B. (1995). *Development theory and the three worlds: Towards an international political economy of development*. New York, John Wiley.
- Hu, L. and Bentler, P. M. (1999). Cutoff criteria for fit indexes in covariance structure analysis: Conventional criteria versus new alternatives. *Structural Equation Modeling*, 6(1); 1- 55.
- J. Samimi, A. and Azarmand, H. (2005). The relationship between economic liberalization and macroeconomic performance in World (1980-2001). *Iranian Journal of Trade Studies*, 37(10); 41-62. (In persian)
- Jasbi, J. and Nafari, M. (2009). Designing a model of good governance based on the theory of open systems. *Journal of Management Sciences in Iran*, 4(16); 85-117. (In persian)

Justesen, M. K. (2008). The effect of economic freedom on growth revisited: New evidence on causality from a panel of countries 1970 - 1999. *European Journal of Political Economy*, 24(3); 642-680.

Kaufmann, D., Kraay, A. and Mastruzzi, M. (2007). Governance matters IV: Governance indicators for 1996– 2006. World Bank Policy Research Working Paper 3630, June 2005. Washington, DC.

Komijani, A. and Salatin, P. (2008). Impact of good governance on economic growth in selected countries, OPEC and OECD. *Journal of Economic Modeling*, 2(6); 1-24. (In persian)

Landman, T. (2003). Map-making and analysis of the main international initiatives on developing indicators on democracy and good governance. University of Essex: Human Rights Center.

Lateef, K. S. (1992). Comment on governance and development. by Beetninger, Proceedings of the World Bank Annual Conference on Development Economics, Washington D.C, p. 295. World Bank,

<http://www.worldbank.org/wbi/governance/about.htm#approach>

Sabagh Kermani, M. and Baskha, M. (2009). The role of good governance in improving the functioning of government expenditure, Case study: health and education sectors in Islamic Countries. *Journal of Economic Research*, 86(44); 109-130. (In persian)

Shirazi, F., Gholami, R. and Anˆo´n Higo´n, D. (2009). The impact of information and communication technology (ICT), education and regulation on economic freedom in Islamic Middle Eastern countries. *Information & Management*, 46(8); 426–433.

WDI, (2011). World Development Indicators. Available at: <http://www.worldbank.org>

WGI, (2011). Governance Matters, Worldwide Governance Indicators.