



جامعة آل البيت

كلية الاقتصاد والعلوم الإدارية

قسم اقتصاد المال والاعمال

أثر تقلبات أسعار النفط على الناتج المحلي الإجمالي في العراق

Impact of Fluctuations in Oil Price on the Gross Domestic Product in IRAQ

إعداد الطالب

جهاد بدو حمد

الرقم الجامعي

(1620507005)

إشراف

الأستاذ الدكتور إبراهيم محمد البطانية

قدمت هذه الرسالة استكمالاً لمتطلبات الحصول على درجة الماجستير في اقتصاد المال والأعمال

عمادة الدراسات العليا

جامعة آل البيت

الفصل الصيفي ٢٠١٧/٢٠١٨

التفويض

أنا **جهاد بدو حمد**... أفوض جامعة آل البيت بتزويد نسخ من رسالتي للمكتبات أو المؤسسات أو الهيئات أو الأشخاص عند طلبها.

التوقيع:  التاريخ: 2018/7/31 م

١.

١.

إقرار والتزام بقوانين جامعة آل البيت وأنظمتها وتعليماتها

الرقم الجامعي: 1620507005

أنا الطالب : جهاد بدو حمد

الكلية : الاقتصاد والعلوم الإدارية

التخصص : اقتصاد المال والأعمال

أعلن بانني قد التزمت بقوانين جامعة آل البيت، وأنظمتها وتعليماتها وقراراتها السارية المفعول المتعلقة بإعداد رسائل الماجستير والدكتوراه عندما قمت شخصيا بإعداد رسالتي بعنوان :

"أثر تقلبات أسعار النفط على الناتج المحلي الإجمالي في العراق"

وذلك بما ينسجم مع الأمانة العلمية المتعارف عليها في كتابة الرسائل والأطاريح العلمية. كما أعلن بأن رسالتي غير منقولة أو مستلة من رسائل أو أطاريح أو كتب أو أبحاث أو أي منشورات علمية تم نشرها أو تخزينها في أي وسيلة إعلامية، وتأسيساً على ما تقدم فإنني أتحمل المسؤولية بأنواعها كافة فيما لو تبين غير ذلك بما فيه حق مجلس العمداء في جامعة آل البيت بإلغاء قرار منحي الدرجة العلمية التي حصلت عليها وسحب شهادة التخرج مني بعد صدورها دون أن يكون لي أي حق في التظلم أو الاعتراض أو الطعن بأي صورة كانت في القرار الصادر عن مجلس العمداء بهذا الصدد.

توقيع الطالب.....

التاريخ / / ٢٠١٨م

قرار لجنة المناقشة

نوقشت هذه الرسالة:

أثر تقلبات أسعار النفط على الناتج المحلي الإجمالي في العراق
Impact Of Fluctuations in Oil prices on the Gross Domestic product in Iraq

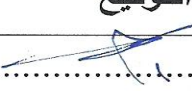



وأجيزت بتاريخ 31/7/2018م

إعداد الطالب

جهاد بدو حمد

إشراف

الأستاذ الدكتور إبراهيم محمد البطاينة

التوقيع	أعضاء لجنة المناقشة
	الأستاذ الدكتور إبراهيم البطاينة مشرفاً ورئيساً
	الأستاذ الدكتور حسين الزيود عضواً
	الدكتور تركي الفوز عضواً
	الدكتور عمر خضيرات عضواً خارجياً

د

د

الإهداء

إلى من أحمل اسمه بكل افتخار...

إلى اجمل الاقدار في الحياة...

ستبقى كلماتك نجوم اهتدي بها اليوم وغداً وإلى الابد...

والدي العزيز

إلى ملاكي في الحياة...

إلى معنى الحب والحنان والتفاني...

إلى من كان دعائها سر نجاحي وحنانها بلسم جراحي إلى اغلى الحبايب...

أمي الحبيبة

إلى كل من علمني حرفاً وانا طريقي للعلم والخير...

أساتذتي الكرام

إلى الاب الروحي وقدوتي كنت خير سند...

عمي العزيز

إلى من خففوا عناء السفر و وحشة الطريق

أصدقائي

الشكر والتقدير

الحمد لله رب العالمين والصلاة والسلام على أفضل الخلق سيدنا محمد وعلى آله وصحبه أجمعين، وبعد
الشكر كل الشكر الى المملكة الأردنية الهاشمية، ملكاً وارضاً وشعباً لإتاحة فرصة الدراسة في هذه الجامعة
المباركة جامعة آل البيت، أسمى آيات الشكر والامتنان والتقدير والمحبة إلى الذين حملوا اقدس رسالة في
الحياة إلى الذين مهدوا لنا طريق العلم والمعرفة، إلى جميع اساتذتنا الافاضل، الذين ساعدوني في الحصول
على المعلومات، وأخص بالشكر والتقدير عمادة كلية الإدارة والاقتصاد وعلى رأسها الأستاذ الدكتور (
حسين علي الزيود) لما قدمه من علم وتسهيل عمل من اجل التقدم وزيادة الحركة العلمية في الجامعة
المباركة، كما أتقدم بالشكر والعرفان إلى أستاذي الدكتور الفاضل إبراهيم احمد البطاينة، اعترافاً بجميله
أولاً على قبوله الإشراف على الدراسة، وعلى توجيهاته ونصائحه ثانياً.
وأتقدم بالشكر إلى كل من ساعد وساهم في توجيهي التوجيه الصحيح، والى كل من بادر في تقديم
المعلومات، والمراجع العلمية في سبيل انجاز هذه الرسالة.

قائمة المحتويات

هـ.....	الإهداء
و.....	الشكر والتقدير
ز.....	قائمة المحتويات
ط.....	قائمة الجداول
ي.....	قائمة الملاحق
ك.....	الملخص باللغة العربية
ل.....	ABSTRACT
١.....	الفصل الأول : الإطار العام للدراسة
١.....	المقدمة:
٢.....	أهمية الدراسة :
٢.....	مشكلة الدراسة :
٢.....	أهداف الدراسة:
٢.....	منهجية الدراسة :
٣.....	الفصل الثاني : الإطار النظري والدراسات السابقة
٣.....	أ) الإطار النظري للدراسة:
٣.....	مقدمة :
٣.....	أولاً: سوق النفط :
٣.....	مفهوم السوق النفطية:
٣.....	أنواع أسواق النفط :
٤.....	خصائص السوق النفطية :
٤.....	إنتاج النفط :
٦.....	ثانياً: أسعار النفط العالمي :
٦.....	التطور التاريخي لأسعار النفط :
٦.....	تحديد سعر النفط :
٦.....	أنواع أسعار النفط:

٨.....	ثالثاً: الناتج القومي :
٨.....	مفهوم الناتج القومي الإجمالي :
٩.....	الفرق بين الناتج القومي الإجمالي والناتج المحلي الإجمالي :
١٠.....	رابعاً: النفط في العراق :
١٠.....	١. النفط في العراق :
١١.....	٢. مواقف العراق في منظمة اوبك :
١١.....	٣. الموارد النفطية العراقية :
١٢.....	٤. دور النفط في الناتج المحلي العراقي :
١٣.....	ب) الدراسات السابقة.....
١٦.....	ما يميز الدراسة الحالية عن الدراسات السابقة:
١٧.....	الفصل الثالث: منهجية الدراسة.....
١٧.....	المقدمة:
١٧.....	أسلوب الدراسة :
١٧.....	متغيرات الدراسة :
١٧.....	الأساليب الإحصائية :
٢١.....	الفصل الرابع : تحليل البيانات واختبار الفرضيات.....
٢١.....	المقدمة :
٢١.....	اختبار سكون السلاسل الزمنية:
٢٦.....	أثر صدمة في كل من سعر النفط والنمو الاقتصادي:
٢٧.....	النتائج.....
٢٩.....	التوصيات.....
٣٠.....	قائمة المراجع.....
٣٠.....	أولاً- المراجع العربية:
٣٢.....	ثانياً- المراجع الأجنبية:
٣٣.....	الملاحق.....

قائمة الجداول

الصفحة	الموضوع	رقم
٩	الترتيب حسب كمية الإنتاج والتصدير	
١٩	مؤشرات الأداء الرئيسية - الحجم والطاقة الإنتاجية) لا نتاج النفط وطاقته التصديرية للأعوام من (٢٠١٥ - ٢٠٣٠)	
٤٠	نتائج اختبار سكون السلاسل الزمنية	
٤١	نتائج اختبار سكون البواقي	
٤٣	اختبار التكامل المشترك	

قائمة الملاحق

الصفحة	الموضوع	رقم
٥٦	نتائج اختبار فترات التباطؤ	٤
٥٧	اختبار نتائج نموذج الانحدار الذاتي	٥
٥٧	نتائج اختبار السببية	٦
٥٨	نتائج اختبار تحليل التباين	٨
٥٩	نتائج اختبار نموذج تصحيح الخطأ	٩

أثر تقلبات أسعار النفط على الناتج المحلي الإجمالي في العراق

إعداد الطالب

جهاد بدو حمد

إشراف

الأستاذ الدكتور إبراهيم محمد البطانية

الملخص باللغة العربية

هدفت هذه الدراسة إلى تأثير التقلبات في أسعار النفط على الناتج المحلي الإجمالي في العراق من الفترة ٢٠١٥-٢٠٠٠. اعتمدت هذه الدراسة على البيانات الأولية لمعدل هذه الدراسة بناءً على معرفة تأثير تقلبات أسعار النفط على الناتج المحلي الإجمالي للعراق (٢٠١٥-٢٠٠٠). تعتمد هذه النتائج على الخطوات الأساسية التي تدرس هذه النتائج وتستخدم طريقة التحليل القياسية. ووجدت أن هناك علاقة سببية بين التقلبات في أسعار النفط والنمو الاقتصادي ، وأن صدمة إيجابية في تقلبات الأسعار سيكون لها تأثير كبير على هيكل النمو الاقتصادي.

Impact of Fluctuations in Oil Price on the Gross Domestic Product in IRAQ

Prepared by

Jihad Bado Hamad

Supervision

Prof. Dr. Ibrahim M. Al-Batayneh

ABSTRACT

This study aimed to the Impact of Fluctuations in Oil Price on the Gross Domestic Product in IRAQ

from the period 2000-2015. This study relied on the primary data to The rate of this study is based on knowledge of the effect of oil price fluctuations on Iraq's GDP (2000-2015). These results are based on the basic steps that examine these results and use .the standard analysis method

And found that there is a causal relationship between fluctuations in oil prices and economic growth, and that a positive shock in price fluctuations will have a significant impact on the structure of economic growth.

الفصل الأول : الإطار العام للدراسة

المقدمة:

يمثل النفط المحرك الرئيسي للاقتصاد العراقي حيث يعتبر النفط سلعة استراتيجية عالمية ومادة أولية حيوية للطاقة والتصنيع والحركة، ومشتقاته تستخدم في عدد كبير من الصناعات والحرف الأساسية المختلفة في العالم، كما أنه يشكل نسبة مهمة وفعالة في التجارة الدولية ويؤثر في كافة أوجه النشاط الاقتصادي، ويستخدم في الصناعات البتروكيمياوية. هذه الخواص دفعت به ليكون المحرك الرئيسي للاقتصاد العالمي مبرونة طلب منخفضة، فمحدودية وندرة مصادره جعلته يخرج عن قوانين السوق التي تتم نتيجة للأحكام والقرارات التي يتخذها كل من المنتجين والمستهلكين، وإنتاجه ونقله وتسويقه على النطاق العالمي له تأثير هائل سواء على الدول التي تعتمد عليه كمصدر للعملة الصعبة والدخل، أو تلك التي يعتمد عليه نشاطها الصناعي، فقد تكفي أزمة نفطية واحدة لتعرقل اقتصاديات قائمة أو تنشأ حركة فاعلة في الاقتصاد بأثر التقلبات في أسعاره، لذا فقد رسمت معالم الخريطة الاقتصادية العالمية من الصراع المستمر بين الدول والشركات النفطية الكبرى للسيطرة على سوق، ومن بين جميع مصادر الطاقة الأخرى يعتبر النفط أكثر السلع الاستراتيجية تداولاً على مستوى العالم. كما تسهم الصناعات النفطية بشكل كبير في إجمالي الناتج المحلي، وفي إيرادات الدولة، وميزان المدفوعات، والصادرات الخارجية. يتسم سعر النفط بالتذبذبات صعوداً ونزولاً بين الحين والآخر، والسبب يعود إلى ربط سعر برميل النفط بقوى العرض والطلب وآلية السوق الحرة. فمن جانب العرض يتحدد سعر النفط بالسياسات النفطية للدول المنتجة والمصدرة ومنظمة أوبك ومنظمة أوابك، أما من ناحية الطلب، فهناك دور كبير لمعدلات النمو الاقتصادي والكثافة السكانية والعوامل الأخرى المؤثرة على سعر النفط وأهمها التقلبات الاقتصادية. حيث يمكن تعريف التقلبات الاقتصادية بانها حركة التذبذب التي تحدث في النشاط الاقتصادي والناتج القومي من رواج، وكساد، وانتعاش، وتضخم وأزمات مالية والحروب التي تؤثر على الأداء الاقتصادي، وهي نقطة تحول إلى الأفضل أو إلى الأسوأ فهي لحظة حرجة وحاسمة يمكن أن تؤدي إلى نتائج سلبية سيئة.

والعراق يعتمد على اقتصاد ريعي أحادي الجانب وعلى النفط كمصدر رئيسي لإيرادات الدولة والتي تستخدم في تعزيز جهوده التنموية ودفع عجلة النمو الاقتصادي إلى الأمام، ويعود ذلك بشكل أساسي لربحيته العالية وعائداته السريعة، خاصة خلال حقبة السبعينات وبداية الثمانينات من القرن العشرين، إلا أن ما تعرضت له السوق النفطية العالمية من أزمات متتالية بداية من سنة ١٩٨٦ حتى سنة ٢٠١٠، وهي نتيجة لعدة عوامل انعكست في النهاية على تقلبات وتغيرات حادة في أسعار النفط انخفاضاً وارتفاعاً والتي أدت إلى حالة من عدم الاستقرار، ونجم عنها آثاراً اقتصادية تختلف باختلاف سلوك تلك الأسعار في السوق النفطية العالمية، خاصة في الفترة الأخيرة التي عرفت فيها انخفاضاً غير مسبوق.

وحيث يعتمد الاقتصاد العراقي اعتماداً كلياً على القطاع النفطي ويشكل ما يقارب ٩٥% من إجمالي دخل العراق من العملة الصعبة، وبالتالي فإن تقلبات الأسعار تؤثر بصورة مباشرة على الناتج المحلي الإجمالي، ويختلف حجم هذا التأثير حسب التقلبات في أسعار النفط وفتراتها لذا فقد جاءت هذه الدراسة لاختبار اثر تقلبات أسعار النفط على النمو الاقتصادي في العراق للفترة ٢٠١٥-٢٠٠٠.

أهمية الدراسة :

تكمن أهمية الدراسة في كونها توضح إن أهمية النفط بصفة خاصة ومصادر الطاقة الأخرى بصفة عامة، كون النفط يعد من القضايا الرئيسية التي شغلت الدول النفطية وما له من مزايا في الاقتصاد العالمي ، وعلى اعتبار أن القطاع النفطي في العراق هو العمود الفقري للاقتصاد العراقي، وهو اقتصاد ريعي، فقد أصبح من الضروري تسليط الضوء على هذا الموضوع لعدة أسباب نذكر منها:

أ. أنه بواسطة الاعتماد على أسعار النفط يقوم واضعي السياسة الاقتصادية في العراق ببناء توجهاتهم وتوقعاتهم المستقبلية نظراً لما يمثله قطاع النفط في هيكل اقتصادها.

ب. التغيرات غير المتوقعة في أسعار النفط في السوق النفطية العالمية وتزايد الاهتمام بهذا الموضوع في الآونة الأخيرة.

مشكلة الدراسة :

تعد التغيرات في أسعار النفط من المشاكل الأساسية التي وقفت حاجزا بوجه النمو الاقتصادي في أكثر المجتمعات وتجاوبها أكثر دول العالم المختلفة باختلاف مستويات تطورها وتقدمها على المستوى الاقتصادي والاجتماعي والسياسي، وعليه فأن مشكلة الدراسة تتلخص باختبار تأثير تقلبات أسعار النفط على النمو الاقتصادي في العراق للفترة (٢٠١٥ - ٢٠٠٠)

وما لهذه الظاهرة من آثار عديدة سواءً من الناحية الاقتصادية أو الاجتماعية أو السياسية وتأثر الاقتصاد العراقي الذي يعتمد بنسبة ٩٥% على النفط وخاصة خلال فترة التغيرات الأخيرة التي حدثت في العراق.

أهداف الدراسة:

تهدف الدراسة إلى:

تهدف هذه الدراسة إلى قياس أثر تقلبات أسعار النفط على الناتج المحلي الإجمالي العراقي (GDP).

فرضية الدراسة: تختبر هذه الدراسة الفرضيتين التاليتين:

H0: لا يوجد تأثير ذو دلالة إحصائية لتقلبات أسعار النفط على النمو الاقتصادي في العراق.

H1: يوجد تأثير ذو دلالة إحصائية لتقلبات أسعار النفط على النمو الاقتصادي في العراق.

منهجية الدراسة :

استخدمت هذه الدراسة منهج التحليل القياسي لاختبار فرضيات الدراسة وذلك من خلال استخدام نموذج (VAR)، ودالة استجابة الصدمات (Impulse Response Function) وتحليل التباين Variance (Decomposition).

الفصل الثاني : الإطار النظري والدراسات السابقة

أ) الإطار النظري للدراسة:

مقدمة :

يتناول هذا الجزء من الدراسة الحديث عن سوق النفط العالمي من حيث التعريف والخصائص والأنواع كما يتناول أسعار النفط وتطورها التاريخي وما شهدته من تقلبات بين ارتفاع وانخفاض كما يتحدث عن طريقة تحديد أسعار النفط وأهم العوامل التي تتدخل في هذه العملية إضافة إلى أهم أنواع هذه الأسعار عالمياً وربطها بالنتائج القومي للعراق.

أولاً: سوق النفط :

مفهوم السوق النفطية:

أصبح النفط منذ منتصف القرن العشرين ذو دورٍ رئيسي في اقتصاديات الدول منتجةً كانت أو مستهلكة؛ فبواسطته تدور عجلة الإنتاج في المصانع ومختلف القطاعات الأساسية لها، كما يُعد النفط من أهم القطاعات التي تعتمد عليها الدول المنتجة له في رفق خزينتها بالإيرادات اللازمة لتحسين مستوى الدخل والنتائج القومي، ويتأثر هذا القطاع في كل الأوضاع السياسية والاقتصادية التي يعيشها العالم فكما هو معروف أن للأزمات السياسية أثرٌ كبير في إنعاش الاقتصاد العالمي أو ركوده وهو ما نعيشه في منطقة الشرق الأوسط؛ إذ أدت كل الأوضاع القائمة إلى خفض أسعار النفط بعد ما عاشته من ارتفاع وازدهار في بداية القرن الحالي، هذا ما يُؤكد على قوة العلاقة التي تربط بين مستويات الناتج القومي في الدول المنتجة للنفط وأسعاره في الأسواق العالمية، ويمكننا تعريف سوق النفط بأنه ذلك السوق العالمي الذي يتم فيه التعامل مع إحدى أهم مصادر الطاقة في العالم من خلال الاتفاقيات التجارية المُبرمة والتي يحكمها قانون العرض والطلب إضافة إلى بعض العوامل الاقتصادية والسياسية والعسكرية وتضارب المصالح بين المستهلكين والمنتجين والشركات العاملة في هذا القطاع (زرواط، ٢٠١٤).

أنواع أسواق النفط :

أدى الطابع الذي غلب على تعاملات الشركات النفطية والدول المصدرة فيما بينها إلى ظهور تطورات في طرق تسويق النفط الخام وظهور نوعين من الأسواق هما (الموسوي، ٢٠٠٥؛ Noreng, 2006):

الأسواق الفورية التي تشمل مجمل الصفقات الفورية في المناطق التي يبرز فيها نشاط تجاري على منتجات معينة والتي تتميز بقرب طريقي عملية الشراء فتكون بشكل فوري، ويتصف هذا النوع بالتعامل النفطي المُكثَّف ووجود التُّجار والسمايرة. ويرتبط التوازن العام لأسعار الخام والمنتجات النفطية في هذه السوق بالوضع المحلي للعرض والطلب، إلا أنه يمكن لمنتوج معين أن يتجاوز فيه فارق السعر بين سوقين في تكلفة النقل من سوق إلى آخر وفي هذه الحالة فإن مجموعة من التنظيمات سوف تستفيد من هذا الفارق؛ وذلك بإعادة البيع في السوق المربحة.

الأسواق الآجلة وتم اللجوء إلى هذا النوع بهدف التخفيض من مخاطر التقلبات الكبيرة في سعر النفط إذ قام المنظمون النفطيون بوضع سوق الأسعار الثابتة بتسليم مؤجل، ولهذا السوق شكلان هما السوق النفطية المادية الآجلة والسوق النفطية المالية الآجلة، وتتحدد وظائف هذا النوع فيما يلي:
توفير الوقاية من مخاطر تذبذب أسعار النفط.

التسيير الحسن للمخزون النفطي.

ضمان إمكانية تصريف المنتجات بالأسعار المتعامل بها.

خصائص السوق النفطية :

تتلخص أهم الخصائص الذي تميز السوق النفطية بما يلي (خيرالدين، ٢٠٠٨):

تأثر سوق النفط بالأسواق ذات العلاقة المباشرة بها كسوق الناقلات والشحن حيث تعكس كلفة ناقلات النفط تقلبات الطلب على النفط الخام بشكل مباشر ما يؤدي إلى اعتبار الأسعار الفورية للناقلات على أنها أسعار نموذج المنافسة الكاملة.

تتكامل ممارسات الشركات العالمية والوطنية العاملة في قطاع صناعة النفط في مختلف مراحل إنتاجه بشكل رأسي وأفقي.

عدم مرونة النفط في الاتفاقيات ذات الأجل القصير؛ وذلك لصعوبة تحول الصناعات المعتمدة على النفط كمصدر للطاقة إلى استخدام مصادر أخرى بديلة إذ تتطلب عملية الاستبدال بعض من الوقت بمعنى آخر أن نسبة الآلات التي تعتمد على البترول في رصيد أي مجتمع إلى رأس المال المستخدم للطاقة يتوقف على الأسعار النسبية للمصادر المختلفة للطاقة فإذا اعتمد رصيد مجتمع على هذه المعدات فإنه سيتحمل ارتفاعاً كبيراً في الأسعار بدلاً من الاستغناء عن تلك المعدات.

تتوجه الشركات النفطية العالمية إلى عقد اتفاقيات تُحدد الخطوات المتبّعة من قبلها إلى أن يصل النفط ومشتقاته للأسواق العالمية، كما قامت الدول المصدرة للنفط بتأسيس تكتلات ومنظمات دولية كالأوبك بغرض المحافظة على استقرار السوق النفطي بما يخدم مصلحة الدول الأعضاء ما يمكن وصفه بالتكامل والتكتلات في العمل.

إنتاج النفط :

إن للاستقلال السياسي وتأثيراته في العالم دور رئيس وحاسم في إنجاح جهود زيادة القدرة الإنتاجية لمنظمة أوبك ما يبين أهمية النفط ودوره في النظام العالمي إذ أدت السياسة النفطية إلى نشوب عدة حروب وظهور مفاهيم حديثة في صياغة السياسة الخارجية، وقد ازدادت الأهمية الاستراتيجية التي يتمتع بها النفط ابتداءً من الحرب العالمية الثانية تلازماً مع استخدامه في القطاعات العسكرية وامتدت أهميته خلال فترة الحرب الباردة وبالتالي بروز أثره الكبير في التنمية الاقتصادية للدول، ومع تنامي الطلب على النفط في دول شرق آسيا ظهرت تحديات أخرى لدول أوبك فمن المؤكد أن الصين والهند سيتعاظم طلبها على هذه السلعة وهو ما يبرر ما تتخذه الدول الغربية من سياسات وتدخلات في المناطق المنتجة للنفط (المزيني، ٢٠١٣).

ويوضح الجدول التالي الترتيب حسب كمية الإنتاج والتصدير.

جدول (١) الترتيب حسب كمية الإنتاج والتصدير

الترتيب على حسب كمية الإنتاج والتصدير (٢٠٠٧) الف / ب / ي							
ت	الدولة	الإنتاج	التصدير	ت	الدولة	الإنتاج	التصدير
١	السعودية*	٢٤٨,١٠	٨,٠٣٨	١٠	فنزويلا*	٢,٦٧٠	١,٩٦٠
٢	روسيا	٨٧٤,٩	٧,٠٥٤	١١	الكويت*	٢,٦١٦	٢,٢٩١
٣	الولايات المتحدة	٨,٤٥٧	----	١٢	النرويج	٢,٥٦٥	٢,٣٤٠
٤	ايران*	٤,٠٣٤	٢,٣٢٦	١٣	نيجيريا*	٢,٣٥٣	٢,٠٨٢
٥	الصين	٣,٩١٢	----	١٤	البرازيل	٢,٢٧٧	----
٦	المكسيك	٣,٥٠٠	١,٣٨١	١٥	الجزائر*	٢,١٧٤	١,٩٠٧
٧	كندا	٣,٤٢٢	١,٠٥٥	١٦	انغولا*	---	١,٧١١
٩	العراق*	٢,٦٩٧	٢,٠٥٥	١٨	كازاخستان	---	١,٢١٣

المصدر: OPEC (2013)

يشير الجدول رقم ١ إلى ان العراق احتلت المرتبة التاسعة في إنتاج وتصدير النفط حيث كان مستوى الإنتاج ٢,٦٩٧ برميل وكان حجم التصدير ٢,٠٥٥.

وتتوقع دراسة حديثة (٢٠١٥-جريدة الشرق الأوسط) لوكالة الطاقة الدولية أن يحافظ النفط على احتكاره للنصيب الأكبر بين مصادر الطاقة الأساسية خلال الأعوام المقبلة لتبلغ حصته من إجمالي الاستهلاك العالمي للطاقة في الفترة من (١٩٩٩ إلى ٢٠٢٠) نحو أربعين بالمئة وتتكهن الدراسة بارتفاع الاستهلاك العالمي من النفط خلال العقدين الجاري والمقبل بمعدل ٢,٢% سنوياً ومن المتوقع أن تتقلص في الفترة المقبلة الفجوة في مستوى استهلاك النفط بين الدول الصناعية والنامية حيث كانت الدول النامية تستهلك ٨,٥% من إجمالي النفط الذي تستهلكه الدول الصناعية المتقدمة لكن من المنتظر أن ترتفع هذه النسبة لتبلغ ٩٠% بحلول العام ٢٠٢٠ رغم أن استهلاك الدول المتقدمة من النفط يتركز في قطاع النقل والمواصلات الذي يطرح في اليوم أكثر من بديل في منتجات النفط أما استخدامات الدول النامية فتغطي كل القطاعات تقريباً.

أما بالنسبة للدول العربية فقد قدرت الطاقة الإنتاجية للنفط فيها لعام ٢٠٠١ بحوالي ٢٦,٤ ألف برميل يومياً بمعدلات استغلال عالية، كما أنه من المتوقع أن تؤمن الدول العربية النفطية نصف كمية الطلب الإضافي عليه خلال الفترة القادمة، وتماشياً مع هذه التوقعات سعت الدول العربية إلى زيادة طاقتها الإنتاجية للمحافظة على حصصها في الأسواق العالمية وضمان واستقرار أسعار النفط وبقائه المصدر الرئيسي للطاقة في المدى البعيد؛ حيث بدأت الدول العربية الغنية بالاحتياطيات في زيادة طاقتها الإنتاجية؛ إذ متوقع أن ترفعها لأكثر من ١٢% خلال الفترة القادمة بمعدل طاقة إضافية قدرها ٣,١ مليون برميل (صارم، ٢٠٠٣).

ثانياً: أسعار النفط العالمي :

التطور التاريخي لأسعار النفط :

مرت أسعار النفط في تاريخه الذي يتجاوز مئة وثلاثين عام في عدة محطات أدت إلى تأرجحها، فقد تراوحت أسعاره في الفترة من عام (١٩٤٨) إلى الستينات القرن الماضي بين إثنان وثلاث دولارات، وبعد حظر بعض الدول العربية المنتجة للنفط تصديره للولايات المتحدة في السبعينات تضاعفت أسعاره لتتخطى ١٢ دولار للبرميل لتستقر بعدها أسعاره على هذا المعدل، وبانطلاق الثورة الإيرانية وما تلاها من حرب بين العراق وإيران شهد سوق النفط العالمي ارتفاعاً ضخماً؛ إذ ارتفعت أسعاره إلى الضعف فقد فاق سعر البرميل ٣٥ دولار ليعود وينخفض بعد ذلك مرة أخرى، وقد حاولت أوبك تحديد الحصص الإنتاجية من النفط للدول الأعضاء بهدف تحقيق نوع من الاستقرار على أسعاره، إلا أنها لم تُفلح في ذلك؛ لقيام بعض تلك الدول بإنتاج كميات أكبر من الحصص الموضوعة، وعادت هذه الأسعار لترتفع في مطلع التسعينات نتيجة الآثار المترتبة من غزو العراق للكويت، واستمرت هذه الأسعار بين ارتفاع وانخفاض حتى بداية القرن الحالي لتتجه بعدها نحو الصعود المستمر نتيجة انخفاض سعر الدولار وهو اقتصاد الدول الآسيوية ذات الاستهلاك النفطي الكبير، كما أدت الكوارث الطبيعية والأزمات الجيوسياسية في نيجيريا وفانزويلا والعراق إلى ارتفاع قياسي في سعر برميل النفط الخام ليلاصق ٩٠ دولار بين عامي ٢٠٠٧ و ٢٠٠٨ ويتخطاه أحياناً (الموسوي، ٢٠٠٥).

تحديد سعر النفط :

يخضع تحديد سعر النفط إلى عدة معايير وعمليات وإلى الظروف الاقتصادية والأوضاع السياسية في العالم؛ فالسعر المُعلن في الإعلام لا يعكس بالضرورة البيع أسعار النفط المتعاقد عليها سلفاً، وتوجد ثلاثة أسواق عالمية لبيع النفط يتم على ضوءها تحديد أسعاره بمختلف أنواعه وهي ناميكس ووست تكساس للولايات المتحدة الأمريكية وبرنت لدول أوروبا وعمان وديي لمنطقة شرق آسيا إذ تُغيّر الأسعار وفق العقود وظروف سوق النفط، وعلى سبيل المثال يُسعر العربي الثقيل في السوق الأمريكية بأقل من سبعة إلى عشر دولارات للبرميل عن سعر ناميكس ووست تكساس وبأقل من خمسة إلى سبع دولارات عن سعر برنت، كما يُسعر الزيت العربي الخفيف بأكثر من سعر ناميكس أو وست تكساس بدولارين تقريباً وبدولارين إلى أربعة عن برنت، وعلى هذا المنوال تختلف أسعار بقية أنواع النفط في تلك الأسواق (فاروق، ٢٠٠٦؛ Thompson, 2017).

أنواع أسعار النفط:

مع تنامي أهمية النفط عالمياً بالنسبة للدول المنتجة والمستهلكة احتل النفط مكان الصدارة في المؤتمرات والمحافل الدولية لا سيما بعد مؤتمر طهران عام ١٩٧١ كانت أسعار النفط العربي الخام لا تتجانس مع قيمته الحقيقية كمصدر مهم للطاقة ذو استعمالات متعددة تختلف عن المصادر البديلة له المتوفرة كالفحم الحجري وعندما كانت أسعاره تشكل أهم مواضيع الساعة كان من الضروري توضيح أنواع أسعار النفط الخام خلال هذه الفترة (السعيد، ٢٠١٣؛ الدوري، ٢٠٠٣؛ Bentley, 2016).

الأسعار المعلنة: كانت شركة Standard oil أول من أعلن هذه الأسعار حينما كانت تتميز السوق النفطية بوجود العديد من المنتجين الأمريكيين، وكانت هذه الشركة تفرض سيطرتها على عمليتي نقل وتكرير النفط الخام واستمر العمل بهذه الأسعار حتى عندما دخلت سوق النفط الأمريكية شركات جديدة عقب حل الحكومة احتكار هذه الشركة وظهور المنافسة بين الشركات في تحديد الأسعار المعلنة لشراء النفط الأمريكي الخام وتحول سوق النفط الأمريكية إلى سوق تنافسية، وبعد اكتشاف النفط في مناطق مختلفة في العالم توحدت شركات النفط الكبرى في تنظيم واحد متكامل لكافة جوانب الصناعة النفطية حيث كان من بين ما قامت به تحديد الأسعار المعلنة في مواقع التصدير المنتشرة في البلدان النفطية في العالم خاصة منطقة الخليج العربي وخليج المكسيك، واكتسب هذا النوع من الأسعار أهمية كبيرة بعد عام ١٩٤٨ بعد تعديل الامتيازات الممنوحة للشركات النفطية العاملة في فانزويلا بسبب منافسة أقطار الشرق الأوسط لها حينما ظهر فيها نظام مناصفة الأرباح، واستمرت الشركات باتباعها هذا النوع من الأسعار حتى إقرار منظمة أوبك أسعار النفط الخام خلال مؤتمرها في الكويت عام ١٩٧٣، وفي الواقع يمكن القول بأن الأسعار المعلنة أسعار نظرية لا تعادل في حقيقتها قيمة النفط كمصدر حيوي للطاقة.

الأسعار المتحققة: تعود بدايتها إلى ظهور شركات نفطية مستقلة في منطقة الشرق الأوسط وذلك بعد منحها خصومات على الأسعار المعلنة تراوحت بين (١٠ إلى ٣٥) سنت على البرميل الخام بغرض منافسة الشركات النفطية الكبرى في سعر نفطها المعلن، وتعتبر هذه الأسعار أسعار فعلية في السوق النفطية ويدخل في تحديدها عدة عوامل من أهمها أنماط الاستهلاك وطبيعة المنافسة والموقع الجغرافي والمحتوى الكبريتي للنفط وكثافة النوعية، وتشمل هذه الأسعار كميات النفط الخام التي تبيعها الشركات النفطية الكبرى أو الشركات المستقلة، أو حتى الكميات التي تكون من حصة الأقطار المنتجة علماً بأن هذا النوع يكون دائماً أقل من الأسعار المعلنة، وقد ازدادت أهمية هذه الأسعار للأقطار العربية النفطية التي تقوم بتسويق نفطها من قبل الشركات الوطنية التي تملكها لا سيما العراق بعد تأمين ثروته النفطية.

أسعار الكلفة الضريبية: تمثل الكلفة الحقيقية التي تدفعها الشركات النفطية الكبرى من أجل الحصول على برميل النفط الخام من النفط المنتج بموجب الاتفاقيات المعقودة مع أقطار الحكومات المنتجة للنفط، وتعتبر هذه الأسعار القاعدة التي تركز عليها الأسعار المتحققة في السوق النفطية إذ أن بيع النفط الخام بأقل من هذه الأسعار يعني لها الخسارة، وقد اتفقت الأساليب التي تحتسب بموجبها هذه الأسعار بين الطرفين حكومات الأقطار المنتجة والشركات الكبرى العاملة في أراضيها، وقد أصبحت هذه الأسعار تساوي في المتوسط كلفة الإنتاج مضاف إليه عوائد الحكومة الذي يساوي الربح زائد الضريبة (Lun, 2013).

الأسعار الآنية الفورية: برزت في السوق العالمية مع أواخر عام ١٩٧٨ بعد توقف صادرات النفط الإيرانية عن البلدان المتعاقدة معها مما اضطرها للبحث عن نفوط بديلة لزيادة الطلب العالمي مقابل ما هو معروض، فقد اتجهت الشركات الكبرى والمستقلة ببيع كميات من النفط الخام والذي تحصل عليه بطريقة أو أخرى وفق حسمات معينة في السوق الآنية للنفط وبذلك تقوم السوق الآنية بإعادة توزيع الإمدادات النفطية على البلدان المستهلكة للنفط بكميات قليلة تراوحت بين (٥% إلى ١٠%) من مجمل صادرات النفط العالمية ثم زادت النسب لتصل إلى ٢٠% من مجمل الصادرات النفطية العالمية. وتعتبر سوق روتردام أفضل مثال على السوق الآنية للنفط، فالأسعار الآنية تمثل أسعار الصفقات الفورية للنفط والتي ينتهي مفعولها بانتهاء عمليتي البيع والشراء لذلك فهي تتأثر بأوضاع الطلب والعرض في السوق وقت إجرائها.

ثالثاً: الناتج القومي :

يُعد الناتج القومي لأي دولة من أهم المرتكزات التي يستند عليها اقتصاد المجتمع بالإضافة إلى الناتج المحلي، وحال الناتج القومي كحال المحلي يتأثر بالأسعار وتقلباتها في مختلف المنتجات ولبيان مستوى تأثير الناتج القومي للعراق بتقلبات أسعار النفط كان من الضروري توضيح ما المقصود بالناتج القومي للدولة

مفهوم الناتج القومي الإجمالي :

يقصد بالناتج القومي الإجمالي للدول تقدير القيمة الإجمالية لكل المنتجات والخدمات لسكان الدولة خلال فترة زمنية محددة، ويحسب إجمالي الناتج القومي عن طريق أخذ إجمالي الإنفاق الفردي والاستثمار المحلي الخاص والإنفاق الحكومي وصافي الصادرات والدخل الذي يحصل عليه المقيمون من الاستثمارات الأجنبية مطروح منه الدخل الذي يحصل عليه المقيمون الأجانب في الاقتصاد المحلي. (Thomas, 2009) وفيما يلي توضيحاً لكل عنصر من هذه العناصر (زين، ٢٠٠٦):

إجمالي الإنفاق الفردي: القيمة المالية الكلية لحجم إنفاق الأفراد علي السلع الاستهلاكية والخدمات خلال فترة زمنية محددة عادةً ما تكون ستة أشهر أو سنة، وتعد قيمة إجمالي الإنفاق للأفراد مؤشراً ذو دلالات كثيرة. أولاً في حالة زيادة هذه القيمة من عام إلى عام نستطيع أن نستنتج الآتي، أما أن الأحوال الاقتصادية في ازدهار أو أن معدل التضخم في الأسعار ينمو باستمرار. في الحالة الأولى نعتبر إن الاقتصاد في حالة ازدهار في حالة أن هذه الزيادة في الإنفاق تعكس نمو معدل الدخل للفرد وفي نفس الوقت تعكس نمو في حجم السلع والخدمات المقدمة للأفراد ويعد هذا النمو نمو صحي للاقتصاد ولقيمة إجمالي إنفاق الفرد. في الحالة الثانية نستطيع أن نستنتج أن الزيادة في إجمالي الإنفاق للأفراد تعكس فقط الزيادة في معدل التضخم بدون الإسهام بمساهمة حقيقية للازدهار الاقتصادي بل إن ضررها أكثر من نفعها؛ لذا قد تعتبر الزيادة في قيمة إجمالي الإنفاق لدى الأفراد زيادة صحية فقط في حالة تخطيها الزيادة في معدل التضخم.

الإنفاق الحكومي: وهو بند من بنود الحساب الجاري في ميزان المدفوعات للدولة؛ لذا أي تغيير في قيمة هذا الإنفاق تترجم بالسالب أو بالموجب على ميزان المدفوعات ككل، وهو عامل مؤثر جداً في الآليات الاقتصادية لأي دولة نتيجة لكبر حجمه وتأثيره على تحسين مستوى المعيشة للفرد، وعادةً نجد أن الزيادة في معدل الإنفاق الحكومي تعكس زيادة في المرتبات والعلاوات للموظفين أو الزيادة في الخدمات العامة (مثل بناء مدارس جديدة أو مستشفيات).

أما بالنسبة لزيادة العجز العام في الميزانية، فنجد أن هذه الزيادة تفرض علي الحكومة الاقتراض أما من الخارج أو من القطاع الخاص لتغطية عجزها. وفي كلتا الحالتين يجب علي الدولة تحمل عبء تسديد هذه القروض. في المجمل نجد أن الزيادة في الإنفاق الحكومي لها تأثير سيء علي الاقتصاد وعادةً ما تلجأ الحكومة لهذا الحل في أوقات الركود الاقتصادي لتقليل معدل البطالة وحث القطاع الخاص علي الاستثمار.

الاستثمارات المحلية: هي إجمالي إنفاق الشركات سواء الحكومية أو الخاصة علي شراء الأصول والمعدات والأدوات لهدف زيادة الإنتاج. من هذا المنطلق نجد أن الاستثمارات، بعكس الإنفاق الحكومي، تمثل زيادة في النفقات من أجل تحقيق عائد تجاري واقتصادي. لذا يجوز القول أن الزيادة في الاستثمارات تعد ظاهرة صحية وإيجابية. والسبب في ذلك يكمن في أن زيادة الاستثمارات تؤدي إلى زيادة في الناتج القومي وأيضاً تؤدي إلي زيادة في نسبة العمالة وبالتالي إلي زيادة في الدخل للأفراد.

لذلك ليس من الصعب أن نستشف أن زيادة الاستثمارات تعد العنصر الأساسي في نمو الاقتصاد القومي في أي دولة. من ناحية أخرى نستطيع أن نجزم بأن انخفاض في حجم الاستثمارات يؤدي إلي الانكماش الاقتصادي وتأثيره يعد تأثير سلبي.

صافي الصادرات: وهو المصطلح لتعريف الفارق ما بين قيمة الصادرات والواردات. والعلاقة ما بين قيمة صافي الصادرات والأداء الاقتصادي لأي دولة تعد علاقة واضحة ومباشرة. ببساطة شديدة إذا عرفنا الصادرات بأنها زيادة في الدخل القومي من العملات الأجنبية نتيجة لترويج السلع والخدمات المحلية في الخارج سنستطيع أن نستنتج بسهولة أنه كلما زادت الصادرات كلما تحسن الأداء الاقتصادي لأي دولة. أما الواردات فهي الإنفاق المباشر للعملات الصعبة الشراء والسلع والخدمات من الخارج، لذا من الواضح أيضاً أن ارتفاع قيمة الواردات يعد في غير مصلحة الدولة. لذا في حالة ارتفاع قيمة الواردات علي نظيرتها من الصادرات نجد أن هناك عجز في الميزان التجاري مما يترجم فورياً إلي زيادة في عجز ميزان المدفوعات أو علي أحسن تقدير تقليص قيمة الفائض. والنتيجة المترتبة علي هذا العجز هي زيادة الطلب علي العملات الأجنبية لشراء السلع والخدمات المستوردة. ونتيجة لهذه الزيادة في الطلب عادةً ما تكون النتيجة هي انخفاض قيمة العملة المحلية مما يعطي مؤشراً سيئاً للأداء الاقتصادي لأي دولة.

ويرتبط الناتج القومي بمقياس اقتصادي آخر يعرف بالناتج المحلي الإجمالي الذي يشمل كل الإنتاج المحلي داخل حدود الدولة، ويقاس الناتج القومي القيمة النقدية الإجمالية لما ينتجه سكان الدولة مع استبعاد إنتاج المقيمين الأجانب من هذه العملية في حين يتم حساب إنتاج المواطنين خارج حدود الدولة

الفرق بين الناتج القومي الإجمالي والناتج المحلي الإجمالي :

إن الناتج القومي الإجمالي والناتج المحلي الإجمالي مفهومان وثيقا الصلة، وتأتي الاختلافات الرئيسية بينهما من حقيقة أنه قد تكون هناك شركات مملوكة من قبل المقيمين الأجانب تنتج السلع في البلاد والشركات المملوكة من قبل السكان المحليين تنتج المنتجات خارج حدود الدولة (ناصر، ٢٠٠٧).

وفي حين أن الناتج المحلي الإجمالي هو مقياس النشاط الاقتصادي للبلاد على نطاق واسع، فإن الناتج القومي الإجمالي لا يزال يستحق النظر إليه لأن الاختلافات الكبيرة بين الناتج القومي الإجمالي والناتج المحلي الإجمالي قد تشير إلى أن البلد يزداد مشاركة في التجارة الدولية أو الإنتاج أو العمليات المالية، وأخيراً، قد يكون الناتج القومي الإجمالي الحقيقي مقياساً أكثر فائدة، لأنه يحدد أي تغييرات في الدخل القومي بسبب التضخم، والناتج القومي الإجمالي الحقيقي يأخذ الناتج القومي الإجمالي الاسمي المقاس بالأسعار الجارية ويعدل لأي تغييرات في مستوى الأسعار للسلع والخدمات المدرجة في حساب الناتج القومي الإجمالي

ولتحديد الناتج القومي الإجمالي يتم اتباع المعادلة التالية:

معادلة الناتج القومي الإجمالي (World Bank, 2009) :

الناتج القومي الإجمالي = الاستهلاك + النفقات الحكومية + الاستثمارات + الصادرات + الإنتاج الأجنبي من قبل الشركات المحلية للدولة - الإنتاج المحلي من قبل الشركات الأجنبية

في الاقتصاد، الناتج القومي الإجمالي (GNP) هو مقياس لحجم الإنتاج الاقتصادي من السلع والخدمات من موارد مملوكة من قبل سكان منطقة معينة في فترة زمنية ما حتى وإن كان هذا الإنتاج الاقتصادي يتم خارج هذه المنطقة.

معادلة الناتج المحلي الإجمالي :

الناتج المحلي الإجمالي = الاستهلاك الخاص + إجمالي الاستثمار + الإنفاق الحكومي + (الصادرات-الواردات)
أو اختصاراً: $GDP = C + I + G + (X - M)$

عادة يتم قياس الناتج المحلي الإجمالي إما فصلي أو سنوي ويشير إلى نصيب الفرد في الدولة وأيضاً يستخدم مقياس شائع لقياس جودة الحياة.

رابعاً: النفط في العراق :

١. النفط في العراق :

يتمتع العراق بوفرة موارده الطبيعية إلا أن اقتصاده يعتمد بشكل رئيس على موارده من الثروة النفطية التي تقوم برفد خزينته بالنسبة الأكبر من الإيرادات، وقد بدأت مسيرة العراق النفطية منذ اكتشاف أول بئر نفط في مدينة كركوك عام ١٩٢٧ ليتم منح امتياز له لشركة نفط العراق، وتلاه اكتشاف حقل عين زالة في الموصل بواسطة شركة نفط الموصل ثم قامت شركة نفط البصرة باكتشاف حقل الزبير في مدينة البصرة، ووفقاً للامتيازات التي منحها الحكومة العراقي لتلك الشركات سيطرت شركة نفط العراق على منطقة شمال بغداد وشرق دجلة أما غرب دجلة وشمال بغداد فقد سيطرت عليه شركة نفط الموصل وسيطرت شركة نفط البصرة على جنوب العراق، ويحظى القطاع النفطي في الاقتصاد العراقي بأهمية كبيرة لما يؤديه من دور كبير في التنمية الاقتصادية والاجتماعية؛ إذ تعتمد الأنشطة الاقتصادية على عوائده المادية الناتجة من عملية التصدير والتوريد، كما تكمن أهميته الاستراتيجية كونه عنصر أساسي في بناء قاعدة صناعية متطورة إضافة إلى كونه أهم مصدر للطاقة والمواد الأولية الضرورية للاستهلاك (البصام، ٢٠١٣).

جدول (٢) مؤشرات الأداء الرئيسية - الحجم والطاقة الإنتاجية) لا نتاج النفط وطاقته التصديرية للأعوام من (٢٠١٥ - ٢٠٣٠)

مؤشرات الأداء الرئيسية	٢٠١٥	٢٠٢٠	٢٠٢٥	٢٠٢٥
إنتاج النفط (مليون ب/ي)	٤٠٥*	٩٠٣	٩٠٣	٩٠٣
طاقة تصدير النفط (مليون ب/ي)	٨٠٤	١٠,٦	١٠,٦	١٠,٦
من الجنوب	٦٠٨	٦٠٨	٦٠٨	٦٠٨
من الشمال	١٠٦	٣٠٨	٣٠٨	٣٠٨٣
الخط الاستراتيجي بين الشمال والجنوب	٠,٩	٣	٣	٣

المصدر: (2013) OPEC.

يلاحظ من خلال الجدول أعلاه ان نسبة إنتاج النفط سوف ترتفع من ٤٠٥ مليون برميل في ٢٠١٥ إلى ٩٠٣ مليون برميل في ٢٠٢٥. ونلاحظ أن أيضاً أن الكمية المصدرة من النفط العراقي سوف ترتفع إلى ١٠,٦ مليون برميل يوميا في سنة ٢٠٢٥.

٢. مواقف العراق في منظمة اوبك :

عقد العراق أول امتياز عربي للتنقيب عن النفط واستخراجه عام ١٩٢٥ مع عدد من الشركات النفطية الكبرى إلا أنه كان يحصل على عوائد منخفضة جداً مقارنة بالعوائد التي كانت تحصل عليها الشركات الأجنبية والحكومات التي تملكها، كما رافق هذا الامتياز تدخل مباشر في شؤون العراق الداخلية وخاصة السياسية كما بهدف إبقاء القطاع النفطي في معزلٍ عن الاقتصاد الوطني له، وكان لتأميم النفط الإيراني وتأسيس منظمة اوبك تأثير كبير على سياسات الشركات النفطية في منطقة الشرق الأوسط من جهة وعلى السياسات النفطية في العراق بعد عام ١٩٥٨ في مواجهة الحكومات المالكة لتلك الشركات من جهة أخرى التي انتهت بتأميم ثروته النفطية والتعاون مع دول الخليج العربي للسيطرة على أسعار النفط الخام أعقاب حرب تشرين عام ١٩٧٣ وإعلان الأسعار من جانب واحد كخطوة أولى في طريق السيطرة الكاملة على ثرواتهم النفطية، وفيما يلي استعراض لأهم مواقف العراق في منظمة اوبك في مجال تسعير نفطها الخام ابتداءً من اتفاقية طهران عام ١٩٧١ حتى الآن (جنديل، ٢٠١٧):

أ. ضرورة تثبيت سعر برميل النفط العربي الخام.

ب. ربط سعر البرميل بأسعار المنتجات النفطية التي يُكرَّرُ معظمها خارج منطقة دول اوبك وبأسعار المصادر البديلة للنفط.

ج. ضرورة تخطيط الإنتاج النفطي ضمن نطاق الاوبك في الوقت نفسه.

د. البحث عن بديل للدولار بهدف المحافظة على القوة الشرائية للعوائد النفطية.

هـ. الدعوة لتطبيق طريقة تسعير مرنة حيث أن العلاوات الإضافية فوق مستوى الحد الأدنى للأسعار قد عوضت بعض الشيء عن الفروقات النسبية.

و. دعوته لإقامة مؤتمر منظمة اوبك عام ١٩٨٠.

٣. الموارد النفطية العراقية :

يصل احتياطي النفط في العراق إلى حوالي (١١٥) مليار برميل وهذا الرقم يشكل ١٥% من إجمالي الاحتياطي العالمي، وإن الاحتياطي المحتمل غير المؤكد ٢٠٠ مليار برميل. يوجد النفط العراقي بكميات هائلة ولم يتم كشفه بشكل كلي مبكراً بسبب الوضع الذي عاشه العراق من الحروب في بداية الثمانينات واستمرت لغاية ١٩٨٨ ولحقتها في عام ١٩٩١ حرب جديدة مع الكويت وما تبعها من حصار اقتصادي جعل الفرصة غير مواتية للنهوض بالقطاع النفطي وبسبب الأخطاء السياسية وهجرة المهندسين والكوادر الفنية إلى خارج العراق وتوقف العمليات الإنتاجية للنفط العراقي لمدة خمس سنوات بسبب الحصار الاقتصادي تأثر النفط العراقي في السياسات المحلية والإقليمية والعالمية، ومع أحداث عام ٢٠٠٣ توقف النفط العراقي عن التصدير من البلاد بسبب الحرب ومن ثم استأنف التصدير في النصف الثاني من العام نفسه واستمر في الإنتاج ولكن ليس بمستوى الطموح ولكن اقل من الحصة المقررة في منظمة الاوبك وقد اقتصر تصدير النفط على ثلاث أسواق هي (السوق الأمريكية والأوروبية وسوق الشرق) (الراوي، ٢٠١١؛ Dicker, 2011).

وتركز دراسة النفط في الاقتصاد الوطني على تحليل الأجواء المختلفة التي يمكن أن يساهم النفط من خلالها في إحداث تغييرات هامة في طبيعة وبنية الاقتصاد العراقي وما يرافق ذلك من تغييرات في العناصر المكونة للبيئة الجغرافية بأكملها (اليوسف، ٢٠١٥).

ونظراً لكثرة ما كُتِبَ في هذا الموضوع ارتأى الباحث التركيز والإيجاز في دراسة هذا المبحث على النحو التالي
اتسم الاقتصاد العراقي قبل بدء تصدير النفط بكونه اقتصاداً معاشياً قائماً على الزراعة بدرجة كبيرة والتجارة بشكلها البسيط بدرجة اقل ولم تكن إيرادات الدولة تزيد عن أربعة ملايين دينار إلا قليلاً فقد بلغت عام ١٩٢٢/٢١ نحو ٣.٩ مليون دينار ارتفعت عام ١٩٢٦/٢٥ إلى نحو ٤.٣ مليون دينار وظلت حتى عام ١٩٣٤ وهي السنة الأولى للتصدير.

يعتبر النفط العمود الفقري للدخل القومي في العراق لا ينافسه بذلك أي قطاع آخر وقد تميز بنمو مطرد باستثناء سنوات ١٩٦٧/٦١/٥٧/٥٦ لأسباب تتعلق ببعض الأزمات والحوادث التي تخلف خلالها تصدير النفط، وتبلغ نسبة مساهمة النفط في الدخل القومي حالياً نحو ثلث إجمالي مقابل ٤٠.٣% عام ١٩٦٩
للنفط دور هام في تكوين راس المال فالصناعة النفطية تمول القدر الأكبر من عملية تراكم راس المال سواء عن طريق الاستثمارات التي كانت تقوم بها الشركات العاملة في النفط قبل تأمينها أو بشكل غير مباشر باستخدام الدولة للموارد النفطية.

تعتمد تجارة العراق الخارجية على صادرات النفط الخام فهو المسؤول عن تحديد وضعية ميزان التجارة والمدفوعات فالنفط يعتبر المحرك الأساسي لتجارة العراق الخارجية فهو المسؤول عن حجمها ومن هنا تتضح مدى سيطرة القطاع النفطي على جملة الاقتصاد العراقي وهذا يشير إلى ان صادرات العراق من صادراته النفطية ليس الا وان اقتصاده هو اقتصاد تصدير أحادي السلعة.

تحتل العوائد النفطية مركزاً هاماً في ميزانية الدولة الاعتيادية التي تقوم بمختلف أوجه العرض على الواردات والدوائر التابعة لها.

٤. دور النفط في الناتج المحلي العراقي :

يمثل الناتج المحلي الإجمالي أحد أهم المؤشرات الاقتصادية في التحليل الاقتصادي، ويعرف الناتج المحلي الإجمالي بأنه هو القيمة الإجمالية لجميع البضائع والخدمات التي ينتجها اقتصاد بلد ما. إن قطاع النفط يعتبر من أهم مصادر الطاقة التي تعتبر حجر أساس في الاقتصاد العراقي، وتمثل صادرات النفط ٩٥% من عائدات الحكومة العراقية وتساوي أكثر من ٧٠% من إجمالي الناتج المحلي (GDP) في عام ٢٠١١ وتعتمد الحكومة العراقية بشكل كبير على قطاع النفط في تأهيل وبناء العراق وذلك من خلال زيادة إنتاج النفط وزيادة الصادرات من المنتجات النفطية وأيضاً مدى كفاءة إدارة العائدات، ويزيد إنتاج العراق من النفط الان على (ثلاثة ملايين) ب/ي وهو ثالث أكبر مصدر للنفط في العالم. إن ارتفاع نسبة مساهمة القطاع النفطي في تكوين الناتج المحلي الإجمالي تعكس السمة الأحادية للاقتصاد العراقي ومدى اعتماده على عوائد النفط وعلى الصناعة النفطية التي جعلت إجمالي الناتج المحلي وتكوين رأس المال المحلي وبالتالي فإن أي تقلبات في العوائد سوف تنعكس حركتها على مجمل النشاط الاقتصادي في البلد (زين، 2006).

إن مرور العراق بأربع حروب ساهم ذلك في تدني مستوى المعيشة بشكل كبير وادى انحدار مستوى المعيشة إلى انخفاض الناتج المحلي الإجمالي للفرد إلى أكثر من الخمس للقيمة الحقيقية. ان الانخفاض الكبير في إنتاج النفط وانخفاض صادرات النفط العراقي اثر بشكل كبير على الناتج المحلي الإجمالي حيث بلغ نصيب الفرد من الناتج المحلي الإجمالي في عام ٢٠٠٥ ما يقارب من ١٠٦٣ دولار. وأيضاً يساهم انخفاض إنتاج وتصدير النفط على نمو وبناء الدولة العراقية التي تعتمد بشكل أساس على إنتاج النفط في إعمار وتطوير العراق

ب) الدراسات السابقة

أولاً: الدراسات العربية :

الجنابي (٢٠١٥)، الموسومة (تداعيات انهيار أسعار النفط على الموازنة المالية العامة في العراق (دراسة تحليلية لموازنة ٢٠١٥)، هدفت الدراسة إلى تسليط الضوء على مخاطر وإشكاليات انخفاض أسعار النفط العالمية وأثارها في إعداد الموازنات المالية العامة في العراق واعتبار الموازنة المالية العامة للعام ٢٠١٥ في العراق نموذجاً لهذه الدراسة وضرورات تفعيل مصادر أخرى للإيرادات غير النفطية في تمويل موارد الميزانية العامة،

انطلقت هذه الدراسة من فرضية مفادها (ان ظاهرة انخفاض أسعار النفط مخاطر وإشكاليات عديدة تعيق صياغة وإعداد الموازنة العامة في العراق، مما يتطلب تفعيل مصادر بديلة لتوليد الدخل غير النفط وبالتالي تحصيل الإيرادات المالية اللازمة بما يضمن تجنب مخاطر وإشكاليات تقلبات أسعار النفط وتأثيرها السلبي في الموازنة المالية العامة للدولة.

وتوصلت الدراسة إلى العديد من الاستنتاجات كان من أهمها ان تقلبات أسعار النفط خلال المدة من (٢٠٠٨-٢٠١٥) أربكت كثيراً الموازنات المالية العامة في العراق، وأفرزت تداعيات خطيرة شكلت تحديات حقيقية أمام الموازنة تمثلت بشكل عجز بالموازنة، وضرورة تفعيل مصادر الدخل غير النفطية في تمويل موارد الميزانية العامة، منها تطوير القطاعات الإنتاجية والخدمية وكذلك اعتماد سياسة ضريبي حامية من شأنها زيادة إيرادات الدولة.

رقية ونور اليقين (٢٠١٣)، (مدى تأثير تقلبات أسعار البترول على الاقتصاد الجزائري)، تناولت هذه الدراسة أهمية النفط باعتباره المحرك الرئيسي للاقتصاد كونه سلعة استراتيجية لبناء اقتصاد الدولة وضعف النمو في القطاعات الاقتصادية الأخرى، بالإضافة إلى الإشارة إلى دور الصناعة النفطية وما لها من آثار خطيرة بسبب ما تتطلبه من أموال هائلة لعمليات الاستكشاف، وأكدت على ان السعر هو العامل الأساسي المؤثر في قوى العرض والطلب، ومن الاستنتاجات التي توصلت إليها هذه الدراسة، ان النفط مادة ذو أهمية كبيرة على مستوى العالم لما يحتويه من مشتقات عديدة، واعدت الصناعة النفطية مهمة لأنها تعمل على تحويل الثروة النفطية الخام إلى منتجات صالحة للاستعمال، وبينت الدراسة أيضاً ان قطاع المحروقات له أهمية كبيرة في خدمات الدولة، إضافة إلى تأثير الأزمات النفطية في السبعينات على الاقتصاد الجزائري حيث خفضت من إنتاجها مما أدى إلى ارتفاع أسعار النفط من جهة أخرى مما أكسب قطاع المحروقات أهمية كبيرة في تنويع إستراتيجية التنمية، إضافة إلى ان النفط الجزائري من أفضل أنواع النفوط لأنه خفيف ومشتقاته متعددة.

إبراهيم (٢٠٠٩)، قياس تأثير إيرادات النفط في نمو اقتصاد العراق للمدة (١٩٧٠-٢٠٠٥)، تهدف هذه الدراسة إلى توضيح طبيعة العلاقة بين إيرادات الصادرات النفطية ودورها في تحقيق عملية النمو الاقتصادي في العراق للمدة (١٩٧٠-٢٠٠٥) معتمدين في ذلك على عدد من المؤشرات التحليلية التي تعبر عن مضمون نمو الاقتصاد العراقي كالناتج المحلي الإجمالي وإجمالي تكوين رأس المال الثابت والإنفاق الاستهلاكي الحكومي والخاص وتقدير وتحليل العلاقة باستخدام نماذج الإبطاء أو التخلف الزمني توصلت الدراسة إلى أن الصناعة القائدة (الصناعة النفطية في العراق) قد استقطبت بعضاً من الصناعات - استناداً إلى نظرية أقطاب النمو - تمثلت بارتفاع معامل الارتباط مع الناتج المحلي الإجمالي على المستويين الإجمالي مع تفاوت بسيط على المستوى القطاعي لكون هذه القطاعات تعتمد على إيرادات متوقعة غير متحققة.

أظهرت نتائج التطبيق بمعادلات (GDP) المتباطئ زمنياً كانت موجبة ومعنوية إحصائياً تؤكد وجود الآثار الطافحة للقطاع القائد، بعد استخدام إيرادات الصادرات النفطية الفعلية لتأكيد ذلك الدور مع وجود بعض من الاختناقات التي تعيق وصول (GDP) إلى مستواه الأمثل في الاستجابة للتغيرات في إيرادات الصادرات النفطية، وأوصت الدراسة إلى أن سياسة نمو الأجل الطويل ينبغي أن تطبق وبقوة عن طريق الاهتمام بفكرة التداخل المعرفي في حصول ظاهرة النمو الاقتصادي والتي تتفاعل تلقائياً وبصورة عفوية لتؤدي دوراً فاعلاً في تفاعلها مع نمو إيرادات الصادرات النفطية في نمو الاقتصاد العراقي وكذلك ضرورة الاهتمام بالروابط الأمامية والخلفية للقطاعات المكونة للاقتصاد وقطاع النفط مع التقليل من الاعتماد على إيرادات النفط المتوقعة لسنة قادمة في مقابل التأكيد على متوسط هذه الإيرادات بسبب التذبذبات الشديدة التي تشهدها بين حين وآخر (من أجل تجاوز صدمات الطلب).

بوجمعة (٢٠٠٩)، (انعكاسات تقلبات أسعار النفط على التوازنات الاقتصادية الكلية في الجزائر)، والتي تطرقت إلى توضيح مراكز الاحتياطي والإنتاج والاستهلاك العالمي، وتناولت هذه الدراسة أهم الإبعاد الاقتصادية والفنية لصناعة النفط، ثم عمل على استعراض أهم التطورات الحادثة في أسعار النفط والعوامل المحددة لها، ليختتم بدراسة تأثير تقلبات أسعار البترول على التوازنات الكلية في الجزائر كل من الميزان التجاري، الناتج الداخلي الإجمالي والميزانية العامة للدولة.

خير الدين (٢٠٠٨)، (تأثير تذبذبات أسعار النفط على التضخم والميزان التجاري في الأردن)، هذه الدراسة تناولت موضوع تأثير تغيرات أسعار النفط على التوازنات الكلية في الأردن، وهدفت الدراسة إلى تحديد تأثير تذبذب أسعار استيراد النفط الخام ومعرفة طريقة انتقال هذه التأثيرات إلى مستوى الأسعار والعجز في الميزان التجاري في الأردن بصورة مباشرة عن طريق المستورد من النفط وبصورة غير مباشرة عن طريق ارتفاع أسعار الاستيرادات الأخرى، ويتم ذلك عن طريق التحليل الوصفي والكمي للمتغيرات ذات العلاقة بطريقة السلاسل الزمنية، وتوصلت الدراسة إلى تقدير العلاقة بين معدل التضخم وأسعار النفط باستخدام أسلوب التحليل القياسي (VAR)، وقياس مرونة عجز الميزان التجاري الأردني للتغيرات في أسعار النفط باستخدام أسلوب تحليل المربعات الصغرى للوغاريتمات الداخلة في النموذج.

العمرى (٢٠٠٨)، (دراسة تأثير تطورات أسعار النفط الخام على النمو الاقتصادي دراسة حالة الجزائر ١٩٧٠ - ٢٠٠٦)، هدفت هذه الدراسة إلى معرفة العلاقة الحقيقية التي تربط سعر النفط الخام بالنمو الاقتصادي، لأنه بالرغم من الإجراءات التي اتخذتها الدولة لفصل الاقتصاد الوطني عن التقلبات الكبيرة التي تحدث في أسعار النفط إلا أن التأثير ظل مستمراً على الاقتصاد الوطني إضافة إلى أن الجزائر بلد منتج وليس مستهلك

وتوصلت الدراسة عدة نتائج، إذ تميزت أسعار النفط بنوع من التغيرات قبل ظهور الأوبك نتيجة الاحتكار المفروض من قبل الشركات الكبرى التي كانت تحدد الأسعار حسب ما يخدم مصالحها سعياً منها لزيادة أرباحها، وكذلك بعد ظهور الأوبك تميزت الأسعار بالمرونة نتيجة المنافسة التي فرضتها الشركات المنتجة للنفط سعياً منها لاستعادة ثروتها عن طريق التأمينات، إضافة إلى أن الأزمة النفطية في السبعينات حيث ارتفعت الأسعار حيث كان لها آثار كانت إيجابية للدول المنتجة وسلبية للدول المستهلكة، وبعد عام ١٩٨٣ انخفضت الأسعار حتى وصلت إلى ١٠ دولار للبرميل في عام ١٩٨٦ مما نتج عنه انعكاس المعادلة بشكل سلبي للدول المنتجة وإيجابي للدول المستهلكة، وبينت الدراسة بعد هذه الأزمات إلى استقرار الأسعار نتيجة التعاون بين الدول المنتجة داخل منظمة الأوبك وخارجها، أما نتائج الدراسة القياسية هنالك علاقة طردية بين الجباية النفطية وأسعار النفط إذ أن الأسعار تؤثر بصورة غير مباشرة على الناتج الداخلي الخام.

ثانياً: الدراسات الأجنبية :

١. دراسة (٢٠١٤) BjrnI and Thorsrud :

(The effect of an oil price decrease on the Norwegian economy)

أثر انخفاض سعر النفط على الاقتصاد النرويجي

هدفت هذه الدراسة إلى معرفة تأثير انخفاض أسعار النفط على أحد مشتقات النفط في النرويج ودراسة الصدمات التي تعرضت لها أسعار النفط، حيث كانت الصدمة الأولى صدمة الطلب العالمي على النفط والثانية صدمة العرض العالمي من السلع الأساسية، وتوصلت الدراسة إلى أن انخفاض أسعار النفط بنسبة ٢٥% بسبب تراجع النشاط العالمي يؤدي إلى تأثير الاقتصاد النرويجي بصورة كبيرة حيث يتراجع الطلب العالمي على النفط، وينخفض الطلب العالمي على السلع والخدمات، إضافة إلى انخفاض الناتج المحلي الإجمالي في النرويج بنسبة (٢ إلى ٢.٥%)، وهذا الانخفاض سببه زيادة المعروض من النفط في السوق العالمية.

٢. دراسة (٢٠١٣) YusmaBt, Yusoff, and Abdueltif :

قياس تأثير التغير العالمي في أسعار النفط على النمو الاقتصادي والطلب على الطاقة في ماليزيا

وهدفت هذه الدراسة إلى معرفة تأثير تغير أسعار النفط العالمي على النمو الاقتصادي والطلب على الطاقة في ماليزيا، وتوصلت الدراسة إلى وجود تغيرات في أسعار النفط العالمية إلى الناتج المحلي الإجمالي في ماليزيا في المدى القصير، واستنتجت الدراسة أن سعر النفط غير مرن بصورة مستمرة في الأجلين القصير والطويل، إضافة إلى وجود سببية ثنائية الاتجاه بين الطلب على الطاقة والناتج المحلي الإجمالي مما سيكون له آثار هامة بالنسبة لسياسة الطاقة، حيث يمكن تنفيذ سياسة الطاقة دون أن تنقل آثاراً ضارة على كل من قطاع الطاقة والاقتصاد.

٣. دراسة Hakan Berument (٢٠١٠) الموسومة:

countries The impact of oil price shocks on the economic growth of selected MENA

تأثير صدمات أسعار النفط على النمو الاقتصادي في دول مختارة من مجموعة دول الشرق الأوسط وشمال أفريقيا

هدفت هذه الدراسة إلى معرفة كيف تؤثر صدمات أسعار النفط على معدل النمو الاقتصادي الحقيقي في بلدان مختارة في منطقة الشرق الأوسط وشمال أفريقيا

وتوصلت الدراسة إلى أن الأداء الاقتصادي للبلد الواحد لا يؤثر على أسعار النفط العالمية يتم فرضه على وضع الانحدار الذاتي للنواقل كقيد محدد ، وتشير التقديرات إلى أن الزيادات في أسعار النفط لها تأثير إحصائي هام وإيجابي على نواتج الجزائر وإيران والعراق والكويت وليبيا وعمان وقطر وسوريا والإمارات العربية المتحدة. ومع ذلك يبدو أن صدمات أسعار النفط لها تأثير هام إحصائياً على مخرجات البحرين وجيبوتي ومصر وإسرائيل والأردن.

٤. دراسة (2007) Lutz Kilian :

The Impact of Oil Price Shocks on the U.S.A Stock Market.

تأثير صدمات أسعار النفط في سوق الأسهم الأمريكية.

هدفت الدراسة إلى معرفة تأثير صدمات أسعار النفط على سوق الأسهم الأمريكية، وتوصلت الدراسة إلى ان استجابة عائدات الأسهم الحقيقية في الولايات المتحدة الأمريكية تختلف اختلافا كبيرا اعتمادا على ما إذا كانت الزيادة في أسعار النفط الخام مقترنة بصدمات العرض أو الطلب في السوق العالمية للنفط الخام، وان نتائج الدراسة بينت ان ارتفاع أسعار النفط ضررها اقل على سوق الأسهم الأمريكية، إضافة إلى ان أسعار الأسهم لا تنطبق ألا على صدمات الطلب الخاصة بسوق النفط الخام كالزيادة في الطلب التحوطي على النفط الذي يعكس المخاوف بسبب نقص المعروض النفطي مستقبلا، وان الصدمات الإيجابية للطلب العالمي على السلع الصناعية تؤدي إلى ارتفاع أسعار النفط الحقيقية وارتفاع أسعار الأسهم مما يساعد على تفسير مرونة سوق الأسهم الأمريكية في الارتفاع الأخير في أسعار النفط وهذه الصدمات لا تؤثر بشكل كبير على العائدات النفطية.

ما يميز الدراسة الحالية عن الدراسات السابقة:

هدفت هذه الدراسة إلى دراسة تأثير تقلبات أسعار النفط على الناتج المحلي الإجمالي في الاقتصاد العراقي وتوصلت إلى أن هناك علاقة سببية بين تقلبات أسعار النفط إلى النمو الاقتصادي، وان حدوث تقلبات أسعار النفط يؤدي الى حدوث صدمه إيجابية في هيكل الاقتصاد وسيكون له اثر معنوي على هيكل الاقتصاد ، ومن معادلة سعر النفط فإنه يتبين وجود اثر إيجابي ومعنوي لسعر النفط في الفترة السابقة على سعر النفط في الفترة الحالية وكذلك وجود اثر إيجابي ومعنوي للنمو الاقتصادي في الفترة السابقة على النمو الاقتصادي في الفترة الحالية، وكذلك وجود اثر سلبي ومعنوي لسعر النفط على النمو الاقتصادي.

الفصل الثالث: منهجية الدراسة

المقدمة:

قام الباحث من خلال هذا الفصل التطرق إلى التعريف بالمنهج الأمثل الذي سيخدم الدراسة، بالإضافة إلى التعريف بالمتغيرات الاقتصادية التي يتم اختيارها وسبب اختيارها مع الإشارة إلى مصادرها، وتوضيح الاختبارات الإحصائية التي تخدم متطلبات الدراسة والتي تم أدراجها وأخيراً بيان النتائج المتحصل عليها والاستنتاجات لتستخلص في الأخير مجموعة من التوصيات.

أسلوب الدراسة :

من خلال الاطلاع على الدراسات السابقة واستناداً إلى دراسة كل من (Khuranet et.al.(2015), Yutakan (2015) ظهر جلياً أن المنهج المناسب للدراسة هو المنهج الوصفي والتحليلي بهدف الإحاطة بمختلف الجوانب النظرية والعملية للموضوع اعتماداً على المصادر والمراجع المختلفة كالكتب، المقالات والمجلات العلمية وغيرها.

متغيرات الدراسة :

من أجل تقدير اثر تقلبات أسعار النفط على النمو الاقتصادي في العراق وبالأستناد إلى دراسة Khuranet et.al.(2015), Yutakan (2015) قام الباحث بالاعتماد على نموذج تصحيح الخطأ.

وقد غطت الدراسة الفترة الممتدة بين (1990-2016)، وقد اعتمد الباحث في تحليلها على البيانات السنوية المتحصل عليها من البنك الدولي WB، ومنظمة الدول المصدرة للنفط OPEC.

الأساليب الإحصائية :

بعد الحصول على البيانات اللازمة واعتماداً على الدراسات السابقة تم استخدام الاختبارات الإحصائية المناسبة بالاعتماد على برمجية EVIEWS، بهدف الإجابة عن أسئلة الدراسة واختبار فرضياتها ومن ثم صياغة النتائج والتوصيات ويمكن توضيحها فيما يلي:

اختبار جذر الوحدة: (Unit Root) :-

قام الباحث باختبار الاستقرار (Stationary) للسلاسل الزمنية لاختبار مدى استقرار السلاسل الزمنية أو عدم احتوائها على جذر الوحدة.

اختبار استقرار بيانات السلسلة الزمنية(جذر الوحدة):

يوجد على المستوى التطبيقي عدة اختبارات يمكن استخدامها لاختبار صفة الاستقرار في السلسلة، وسيتم التركيز على اختبارات جذر الوحدة (Unit Root Test) لأنها من أكثر الاختبارات استخداماً في التطبيقات العملية، وحيث إن جذور الوحدة ترتكز على وجود ارتباط ذاتي بين المتغيرات فأن اختبارات جذور الوحدة ترتكز على فرضية إن حدود الخطأ ليست مترابطة بشكل جوهري وإسقاط هذا الفرض يؤدي إلى حدوث مشكلة الارتباط الذاتي.

أولاً: اختبار ديكي فوللر المركب (Augmented Dickey-Fuller , 1981).

ثانياً: بيرون فيليبس (Phillips and Perron , 1988) .:

اختبار ديكي فوللر المركب:-

ويعتبر اختبار ديكي فوللر من أكثر الاختبارات استخداماً في التطبيقات العملية، ومضمون هذا الاختبار، إذا كان معامل الانحدار للصيغة القياسية المقترحة يساوي الواحد فإن هذا يؤدي إلى وجود مشكلة جذر الوحدة الذي يعنى عدم استقرار بيانات السلسلة الزمنية ($p=1$)، يقوم اختبار ديكي فوللر المركب على إدراج عدد من الفروق ذات الفجوة الزمنية حتى تختفي مشكلة الارتباط الذاتي الخاصة باختبار ديكي فوللر البسيط، وعليه تصبح الصيغة القياسية المقترحة متضمنة متغيرات بفترات إبطاء كمتغيرات تفسيرية للتخلص من إمكانية وجود ارتباط ذاتي لعنصر الخطأ (الرشيد، ٢٠١٠).

اختبار فيليبس بيرون (Phillips and Perron , 1988)

يقوم هذا الاختبار على إدخال تصحيح للارتباط الذاتي باستخدام طريقة غير معلمية، وما يميز هذا الاختبار انه يأخذ في الاعتبار التغيرات الهيكلية للسلسلة الزمنية، فهو ذو قوة اختباريه أكبر من اختبار ADF، حيث انه يختلف عن DF و ADF في انه يحتوى على قيم متباطئة للفروق، والذي يأخذ في الاعتبار الفروق الأولى للسلسلة الزمنية باستخدام التصحيح غير المعاملي (Correlated Non Parametric) ويسمح بوجود متوسط يساوي صفر واتجاه خطى للزمن أي أنه لا يستند إلى توزيع معامل لحد الخطأ.

اختبار التكامل المشترك: (Cointegration Test)

تحليل التكامل المشترك يقدم دعماً للنظرية الاقتصادية من خلال رصد العلاقات بين المتغيرات الاقتصادية في إطار إحصائي، فمن منظور اقتصادي فإن بعض المتغيرات تتحرك بانتظام بمرور الوقت على الرغم من أنها تتسم بشكل منفرد بالتذبذب العشوائي، لذا فإن تحليل التكامل المشترك يعد أحد الأدوات المهمة عند دراسة العلاقات بين المتغيرات الاقتصادية على المدى الطويل، إضافة على ذلك فإنه يساعد على تحديد مستوى التوازن بين البيانات غير المستقرة وتلك التي تتسم بالثبات.

إذن فإن التكامل المشترك تصاحب (Association) بين سلسلتين زمنيتين (X_1Y_1) أو أكثر بحيث تؤدي التقلبات في إحداها لإلغاء التقلبات في الأخرى بطريقة تجعل النسبة بين قيمتها ثابتة عبر الزمن، حيث إن العلاقات الطويلة الأجل بين مجموعة المتغيرات تعتبر مفيدة في التنبؤ بتقييم المتغير التابع بدلالة مجموعة من المتغيرات المستقلة، وتتطلب حدوثه ان تكون السلسلتين متكاملتين من الرتبة الأولى كل على حدة، والبواقي الناجمة عن تقديم العلاقة بينهما متكاملة من الرتبة صفر.

ومما سبق نجد أن التكامل المشترك هو التعبير الإحصائي لعلاقة التوازن طويلة الأجل. فلو أن هناك متغيرين يتصفان بخاصية التكامل المشترك فإن العلاقة بينهما تكون متجهة لوضع التوازن في الأجل الطويل، بالرغم من إمكانية وجود انحرافات عن هذا الاتجاه في الأجل القصير. ولإجراء هذا الاختبار يجب أن تكون السلاسل الزمنية لمتغيرات الدراسة جميعها متكاملة من نفس الرتبة. ويعتمد اختبار التكامل المشترك على الفرض الصفري القائل بوجود أو اقل من متجهات التكامل المشترك.

وقد طور جوهانسن اختبارين إحصائيين لفحص التكامل المشترك بين مجموعة من المتغيرات، وهما كالتالي:

Trace Test:

$$\lambda_{\text{Trace}}(r) = -T \sum_{r+1}^P \ln(1 - \lambda_i)$$

Maximal Eigen Value Test:

$$\lambda_{\text{max}}^{(r, r+1)} = -T \ln(1 - \lambda_{r+1})$$

حيث:

T: عدد المشاهدات.

P: عدد المتغيرات.

λ : القيم المقدره لخصائص الجذور (قيم إيجن المحسوبة).

R: عدد متجهات التكامل المشترك.

نموذج متجه الانحدار الذاتي: Vector Auto Regressions (VAR).

من أجل تقدير نموذج الانحدار الذاتي غير المقيد (VAR) (vector Auto Regression) والذي يأخذ الشكل ذو أبعاد $p \times p$ (Bendini, 2000) على النحو:

$$X_t = \delta_1 X_{t-1} + \dots + \delta_p X_{t-k} + \mu_0 + \varepsilon_t$$

حيث X_t مصفوفة المتغيرات وإبعادها $P \times P$ و ε تشير إلى الخطأ وتعديل هذه المعادلة إلى الشكل المصحح التوازني التالي (Johansen, 2000):

$$\Delta X_t = \delta_1 X_{t-1} + \Gamma_1 X_{t-1} + \dots + \Gamma_{k-1} \Delta X_{t-k+1} + \mu_0 + \varepsilon_t$$

حيث ε خطأ عشوائي موزع توزيع طبيعي ووسطه صفر وتباينه معلوم ($\varepsilon_t \sim N(0, \Omega)$)

وبالاستناد إلى هذا النموذج من الممكن التعرف على مدى تأثير الصدمة وتقسيمها إلى جزئين وهما الجزء المتوقع وغير المتوقع وبالتالي فإن نموذج VAR يعطي طريقة عملية لقياس إي صدمة والتي تتمثل بالجزء ΔX_t (Green, 2003)؛ حيث إن الجزء المتوقع يمكن وصفه من خلال المعادلة التالية:

$$E_{t-1}(\Delta X_t / \sigma_{t-1}) = \pi_1 X_{t-1} + \Gamma_1 \Delta X_{t-1} + \dots + \Gamma_{k-1} \Delta X_{t-k+1}$$

وتقيس هذه الصيغة الجزء المتوقع أما ε فتقيس الجزء غير المتوقع مع العلم إن التباين معروف مسبقا ويساوي σ_{t-1} وبالتالي فإن الجزء المتوقع مع توفير بيانات عن المتغيرات في الفترة السابقة (t-1) يعطي تنبؤ عن الفترة القادمة وذلك على أساس أن التباين في الفترة السابقة σ_{t-1} ، ومن هنا فإن الجزء الغير المتوقع ε ذو خطأ عشوائي (Ω وسطه صفر وتباينه معلوم) يصبح التنبؤ التوقع متاح ومتسق مع السلوك الرشيد (Green, 2003).

نموذج تصحيح الخطأ: (VECM) Vector Error Correction Model.

الذي يأخذ الشكل المشابه في دراسة جوهانسن (Johansen,1991) كالتالي:

$$\Delta\pi_t = \mu + \sum_{i=1}^k \bar{\gamma}_i \Delta\pi + \sigma\pi + \gamma$$

ويمكن للمعاملات μ و $\Gamma_1, \dots, \Gamma_k$ ان تتغير بدون وضع أي قيود عليها. يمثل k طول المبطا في نموذج تصحيح الخطأ بينما γ اتجاهات الصدمات الطبيعية التوزيع مع متوسط قيمته صفر. يمكن معرفة وجود التكامل المشترك في المدى القصير من خلال تحديد رتبة المعلمة σ .

تحليل مكونات التباين :

تم استخدام اختبار تحليل مكونات التباين وذلك للتعرف على مقدار التباين في التنبؤ لكل متغير الذي يعزى إلى خطأ التنبؤ في المتغير نفسه والمقدار الذي يعزى إلى خطأ التنبؤ في المتغيرات التوضيحية الأخرى في نموذج الدراسة، ويتم عادة تحليل مكونات التباين لكل متغير من متغيرات النموذج وتبرز أهمية تحليل مكونات التباين في إظهار الأهمية النسبية لأثر أي تغير مفاجئ في كل متغير من متغيرات النموذج على جميع المتغيرات في النموذج ولتلافي مشكلة وجود التأثير المتزامن للأخطاء في المتغيرات المختلفة في النموذج، يتم اللجوء إلى توزيع تشولاسكي.

اختبار اقتران ردة الفعل: Impulse–response functions :

قام الباحث باختبار استجابة ردة الفعل لتتبع المسار الزمني لمختلف الصدمات المفاجئة (shocks) التي تتعرض لها المتغيرات المختلفة المتضمنة في نموذج (VAR)، حيث عكست كيفية استجابة كل متغير من متغيرات الدراسة لأي صدمة مفاجئة في أي متغير في النموذج مع مرور الزمن وتعكس كيفية استجابة كل متغير من هذه المتغيرات لأي هزة أو صدمة مفاجئة في أي متغير في النموذج مع مرور الزمن. ومما يجدر ذكره أن كلا من تحليل مكونات التباين ودالة الاستجابة لردة الفعل لهما أهمية كبيرة في عملية التنبؤ.

الفصل الرابع : تحليل البيانات واختبار الفرضيات

المقدمة :

بعد الحصول على البيانات اللازمة، واعتماداً على الدراسات السابقة قام الباحث باستخدام الاختبارات الإحصائية المناسبة بالاعتماد على برمجية EViews، بهدف الإجابة عن أسئلة الدراسة واختبار فرضياتها ومن ثم صياغة النتائج والتوصيات، ويمكن توضيحها من خلال المراحل التالية:

اختبار سكون السلاسل الزمنية:

أثبتت العديد من الدراسات القياسية (Stock and Watson, 1988)، (Plosser & Nelson, 1982)، (Yule, 1926)، أن السلاسل الزمنية المتعلقة بالمتغيرات الاقتصادية الكلية تنسم بعدم الاستقرار ناتجا عنها مشكلة الانحدار الزائف (Spurious Régression) ويظهر ذلك من خلال النتائج المضللة التي يتحصل عليها حيث تكون قيم R^2 مرتفعة حتى في ظل عدم وجود علاقة حقيقية بين المتغيرات، وعليه لابد من التأكد من استقرار متغيرات الدراسة بالاعتماد على اختبار جذر الوحدة (Unit Root Test) عن طريق استخدام اختبار Augmented Dickey Fuller (ADF) لاختبار مدى استقرار السلاسل الزمنية أو عدم احتوائها على جذر الوحدة بحيث تكون الفرضية الصفرية هي احتواء السلسلة الزمنية للمتغير على جذر الوحدة أي أنه غير مستقر ويتم الحكم على هذه الفرضية بالقبول أو بالرفض بملاحظة قيمة الاحتمالية "Probability"، فإذا كانت أقل من (0.05) فهذا يعني أن القيمة المحسوبة لإحصائية (ADF) أكبر من القيمة الجدولية لها، مما يعني رفض فرض الأساس بوجود جذر الوحدة والحكم باستقرار السلسلة الزمنية للمتغير محل الدراسة.

واستناداً لدراسة Mamta (2004) الذي يرى أن اختبار (ADF) غير قادر على التمييز الجيد لسكون السلاسل الزمنية، لذا سيتم إجراء اختبار (PP) Phillips Perron والذي يتميز بقدرته على إعطاء تقديرات قوية في حالة السلاسل التي لها ارتباط متسلسل وتباين غير ثابت.

جدول (3) نتائج اختبار سكون السلاسل الزمنية

الاختبار				المتغيرات
PP		ADF		
المستوى	الفرق الأول	المستوى	الفرق الأول	
-0.145	-5.84	-0.349	-5.67	OIP
(-2.98)	(-2.98)	(-2.98)	(-2.98)	
-4.72	-10.33	3.49	2.10	GDP
(-2.98)	(-2.98)	(-3.02)	(-3.02)	

المصدر: من إعداد الباحث بالاعتماد على مخرجات EViews.

من خلال النتائج المتحصل عليها والموضحة في الجدول (٣) تبين أن بعض المتغيرات الاقتصادية لا تتسم بالسكون عند إجراء اختبار (ADF) و (PP) فقد كانت القيم المطلقة للإحصائية المقدرة تقل عن تلك الحرجة لكل مستويات المعنوية الإحصائية مما يستوجب قبول الفرضية الصفرية والدالة على وجود جذور الوحدة، وبعد أخذ الفرق الأول أصبحت كل المتغيرات تتسم بالاستقرار عند مستوى معنوية ٥%، وعليه فإن النتيجة لا تنفي إمكانية أن تكون السلاسل الزمنية لكل المتغيرات متكاملة من الدرجة الأولى (١) عند مستوى معنوية ٥%.

وللتأكد ما إذا كانت المتغيرات متكاملة من الدرجة الأولى أو لا قام الباحث باختبار درجة تكامل البواقي ويتضح ذلك من خلال الجدول التالي:

جدول (٤) نتائج اختبار سكون البواقي

المستوى			المتغيرات
PP	ADF	التباطؤ	
***.٠.٠٠٠٠	***.٠.٠٠٠٠	1	Z=resid

***، **، *، تشير إلى سكون المتغيرات عند مستوى معنوية ١%، ٥% و ١٠% على التوالي.

المصدر: من إعداد الباحث بالاعتماد على مخرجات EViews.

من خلال النتائج المتحصل عليها والموضحة في الجدول (٤) تبين أن البواقي تتسم بالسكون عند إجراء اختبار (ADF) و (PP) عند المستوى، فقد كانت القيم المطلقة للإحصائية المقدرة تفوق تلك الحرجة لكل مستويات المعنوية الإحصائية مما يستوجب رفض الفرضية الصفرية والدالة على وجود جذور الوحدة، وعليه فإن البواقي متكاملة من الدرجة الصفرية (٠) عند مستوى معنوية ١%. ونظرا للنتائج المتحصل عليها وباعتبار أن البواقي تتسم بالسكون عند الدرجة الصفرية (٠)، لا يمكن رفض الفرضية الصفرية القائلة أن المتغيرات ليست متكاملة (السواعي، ٢٠١١، ١٩٩).

اختبار التكامل المشترك Cointegration Test:

يستلزم إجراء اختبار التكامل المشترك متعدد المتغيرات أن تكون السلاسل الزمنية لهذه المتغيرات جميعها متكاملة من نفس الرتبة، وبعد معرفة هذه الرتبة تتمثل الخطوة التالية في التأكد من وجود علاقة توازنه طويلة الأجل بين المتغيرات محل الدراسة بواسطة اختبار التكامل المشترك متعدد المتغيرات. من أهم اختبارات التكامل المشترك متعدد المتغيرات اختبار Juselius and Johansen الذي يستخدم طريقة الإمكان الأعظم ذات المعلومات الكاملة (FIML) Full Information Maximum Likelihood التي تعالج كل المتغيرات في النموذج كمتغيرات داخلية.

ويمكن توضيح ذلك من خلال المعادلة التالية:

$$\Delta y_t = \alpha_o + \alpha_1 t + \sum_{i=1}^{p-1} \Gamma_i \Delta y_{t-i} + \Pi y_{t-p} + u_t$$

تشير (Π) إلى مصفوفة المعاملات التي تمثل أثر المتغيرات في الأجل الطويل، ويشار لرتبة هذه المصفوفة بالرمز r . حيث تحدد r عدد متجهات التكامل المشترك وفي حالة $0 < r < 1$ فإن هذه المصفوفة تتكون من مصفوفتي (α, β') ، أي $\Pi = \alpha \beta'$ تمثل مصفوفة متجهات التكامل المشترك وهي تقيس العلاقة بين متغيرات المتجه في الأجل الطويل، التي يفترض أنها متكاملة من الرتبة الأولى ولهذا يتم استخدام قيم الفروق الأول لهذه المتغيرات في نموذج VAR بينما β' تمثل مبدلة المصفوفة β في حين α تمثل مصفوفة معاملات حد تصحيح الخطأ وهي تقيس علاقة التكيف من الأجل القصير إلى الأجل الطويل. ويتم اختبار فرضية عدم القائلة بعدم وجود تكامل مشترك بين المتغيرات بواسطة مقارنة قيم إحصائيات الاختبار المحسوبة بقيم إحصائيات الاختبار الجدولية المناظرة الواردة في Johansen and Juselius عند مستوى معنوية معين فإذا كانت قيمة إحصائيات الاختبار المحسوبة أكبر من قيمة إحصائيات الاختبار الجدولية، يتم رفض فرضية عدم وقبول الفرضية البديلة القائلة بأن هناك تكامل مشترك بين متغيرات الدراسة بمعنى أن هناك علاقة توازنه طويلة الأجل بين هذه المتغيرات مع معرفة عدد متجهات هذا التكامل. ويتضح ذلك من خلال الجدول التالي:

جدول رقم (5) اختبار التكامل المشترك

Date: 07/14/18 Time: 15:54				
Sample (adjusted): 1992 2016				
Included observations: 25 after adjustments				
Trend assumption: Linear deterministic trend				
Series: OIP GDP				
0.05		Trace	Hypothesized	
Prob.**	Critical Value	Statistic	Eigenvalue	No. of CE(s)
0.0555	15.49471	15.19254	0.454383	None
0.8291	3.841466	0.046581	0.001862	At most 1
Trace test indicates no cointegration at the 0.05 level				
* denotes rejection of the hypothesis at the 0.05 level				
**MacKinnon-Haug-Michelis (1999) p-values				

Unrestricted Cointegration Rank Test (Maximum Eigenvalue)				
	0.05	Max-Eigen		Hypothesized
Prob.**	Critical Value	Statistic	Eigenvalue	No. of CE(s)
0.0362	14.26460	15.14596	0.454383	None *
0.8291	3.841466	0.046581	0.001862	At most 1
Max-eigenvalue test indicates 1 cointegrating eqn(s) at the 0.05 level				
* denotes rejection of the hypothesis at the 0.05 level				

المصدر: من إعداد الباحث بالاعتماد على مخرجات EViews.

تشير نتائج الجدول (5) إلى وجود علاقة تكامل مشترك بين متغيرات الدراسة ومعنوية (5%)، وذلك حسب (Trace Test), (Max Eigen Value Test) ولذلك نرفض الفرضية العدمية (H₀) وتقبل الفرضية البديلة (H₁) والدالة على وجود تكامل مشترك حيث إن عدد متجهات التكامل المشترك هو (r=1) عند مستوى معنوية (0.05) وبالتالي فإن نتائج استقرار البيانات واختبار التكامل المشترك تشير إلى وجود علاقة توازنية طويلة الأجل بين متغيرات الدراسة أي أنها تظهر سلوكاً متشابهاً في المدى الطويل.

تحديد فترات الإبطاء المثلى: VAR Lag Order Selection Criteria :

من خلال هذا الاختبار تم تحديد فترات الإبطاء المناسبة في نموذج (VAR) والتي تعطي أقل قيمة للمؤشرين SC, AIC, ومتغيرات الدراسة، وقد كانت نتائج الاختبار كما هو مبين في الجدول (4) في الملحق، لقد تم اختبار عدد فترات التباطؤ الضرورية لإلغاء الارتباط الذاتي لحد الخطأ، وقد أظهرت النتائج أن عدد فترات التباطؤ المثلى 1.

نموذج متجه الانحدار الذاتي (VAR) :

تعمل النماذج النظرية على الربط بين المتغيرات الداخلية والخارجية، إلا أن المتغيرات الاقتصادية تتأثر بالحالة الاقتصادية الكلية نتيجة الترابط بين المتغيرات مما يعني أن جميع المتغيرات ممكن أن تصبح متغيرات داخلية (Endogenous).

إن متجه الانحدار الذاتي يقوم بتفسير المتغير التابع بالقيم السابقة له والقيم السابقة للمتغيرات الأخرى المستخدمة في النموذج حيث يعتبر جميع المتغيرات المستخدمة متغيرات داخلية. والذي يمكن التعبير عنه من خلال الصيغة القياسية المثلى من خلال نموذج (VAR) والذي يأخذ الشكل الأولي غير المقيد ذو أبعاد PXP على النحو التالي:

$$X_t = \sum_{i=1}^m A_i X_{t-i} + U_t$$

حيث أن X_t مصفوفة متجه المتغيرات الداخلية وتمثل الجزء المتوقع.

بينما U_t خطأ أبيض موزع توزيع طبيعي وسطه صفر وتباينه معلوم (0,Ω) أي متجه البواقي القانونية غير المرتبطة ذاتيا ممثلة الجزء الغير متوقع.

إن نموذج (VAR) يقوم بفحص كل معادلة على حدة باستخدام (OLS)، وبسبب إدخال المتغيرات باستخدام القيم السابقة لها وبتباطؤ زمني فإنها لن تكون معنوية إحصائياً كما يصعب تفسيرها وعليه يتم الاعتماد على اختبار F للمعادلة ككل لتحديد قبول النتائج، كما يصعب تفسير وتحليل معاملات المتغيرات المستخدمة مما يوجب استخدام اختبار السببية Granger Causality، واختبار دالة الاستجابة الفورية Impulse-response functions واختبار تحليل مكونات التباين Variance Decomposition، لتوضيح العلاقة طويلة الأجل بين المتغيرات المدروسة. اثر تقلبات أسعار النفط على النمو الاقتصادي في العراق

نموذج تصحيح الخطأ: Vector Error Correction Model (VECM):

لتحديد العلاقة بين تقلبات أسعار النفط وهو الاقتصادي تم استخدام نموذج تصحيح الخطأ (Vector Error Correction Model). الذي يأخذ الشكل المشابه في دراسة جوهانسن (Johansen, 1991) كالتالي:

$$\Delta\pi_t = \mu + \sum_{i=1}^k \Gamma_i \Delta\pi + \sigma\pi + \gamma$$

ويمكن للمعاملات μ و Γ_1, Γ_k أني تتغير بدون وضع أي قيود عليها. يمثل k طول المبطا في نموذج تصحيح الخطأ بينما γ اتجاهات الصدمات الطبيعية التوزيع مع متوسط قيمته صفر. يمكن معرفة وجود التكامل المشترك في المدى القصير من خلال تحديد رتبة المعلمة σ .

ولكن قبل ذلك يجب التأكد من تحقق استقرار النتائج باعتبار أن عدم الاستقرار سيجعل من استخدام دالة الاستجابة الفورية وتحليل مكونات التباين غير صحيح وللتأكد من ذلك يجب تطبيق اختبار استقرارية نتائج الانحدار الذاتي (Polynomial roots of characteristics): يشترط هذا الاختبار أن لا تتجاوز الجذور المشتقة من النموذج واحد صحيح (Johansen, 2000)، قام الباحث بإجراء الاختبار، وكما هي موضحة في الجدول (٦) في الملحق، أظهرت نتائج الاختبار أن نتائج نموذج الانحدار الذاتي (VAR) مستقرة حيث إن الجذور المشتقة لم تتجاوز واحد صحيح.

كما تم إجراء اختبار العلاقة السببية بين المتغيرات (VAR Granger Causality) والتي تتضح نتائجها في الجدول (٦) في الملحق، بالاعتماد على النتائج الموضحة في الجدول (6) في الملحق، وانطلاقاً من قيمة الاحتمالية التي كانت أصغر من مستوى معنوية 5%، يتم رفض الفرضية الصفرية والقائلة بعدم وجود علاقة سببية بين المتغيرات وقبول الفرضية البديلة والدالة على وجود علاقة سببية بين متغيرات الدراسة ويمكن تلخيص اتجاه العلاقة السببية بين المتغيرات كما يلي:

وجود علاقة سببية من تقلبات سعر النفط إلى النمو الاقتصادي، حيث بلغت قيمة المعنوية (0.0426) وهي اقل من 5% وبالتالي يتم رفض الفرضية العدمية التي تنص على إن تقلبات سعر النفط لا يسبب النمو الاقتصادي وقبول الفرضية البديلة التي تنص على إن تقلبات سعر النفط يسبب النمو الاقتصادي.

عدم وجود علاقة سببية من النمو الاقتصادي إلى تقلبات سعر النفط، حيث بلغت قيمة المعنوية (0.947) وهي أكبر من 5% وبالتالي يتم قبول الفرضية العدمية التي تنص على إن النمو الاقتصادي لا يسبب تقلبات سعر النفط ورفض الفرضية البديلة التي تنص على إن النمو الاقتصادي يسبب تقلبات سعر النفط.

اختبار استجابة ردة الفعل: Impulse-Response Functions (IRF):

يتم اعتماد دالة الاستجابة الفورية (Impulse-response functions) لتتبع المسار الزمني لمختلف الصدمات المفاجئة (Shocks) التي تتعرض لها المتغيرات المختلفة المتضمنة في النموذج، وأين تكمن الصعوبة في تفسير المعامل الواحد بشكل فوري، وعليه فإن (IRF) تبين ردود أفعال المتغير التابع نتيجة حدوث تغير مفاجئ في حد الخطأ The Error Term بمقدار وحدة معيارية واحدة One Standard Deviation مما يتسبب في تغير المتغير المعتمد في الوقت الحالي وفي المستقبل، والذي سينعكس على المتغيرات الأخرى المتضمنة في النموذج أيضاً في الوقت الحالي والمستقبلي وتعكس كيفية استجابة كل متغير من هذه المتغيرات لأي صدمة مفاجئة في أي متغير في النموذج مع مرور الزمن، وقد تم إجراء اختبار استجابة ردة الفعل لكل من المتغيرات الاقتصادية المدرجة في الدراسة في شكل (١) في الملحق وقد تم الحصول على النتائج التالية:

أثر صدمة في كل من سعر النفط والنمو الاقتصادي:

يتبين من خلال الشكل (١) استجابة كل من سعر النفط والنمو الاقتصادي لانحراف معياري واحد وذلك لمدة ١٠ فترات زمنية^(١).

حسب تقديرات دوال الاستجابة الدفعية الممتدة على ١٠ سنوات والمبينة في الشكل (١) في الملحق، فإن حدوث صدمة هيكلية إيجابية واحدة في النمو الاقتصادي مقدرة بـ ١ % سيكون لها أثر معنوي إيجابي على أسعار النفط يمتد إلى الفترة الثانية على طول فترة الاستجابة، ثم تؤثر هذه الصدمة سلباً كحد أقصى في الفترة السادسة، ويعود أثر الصدمة ليصبح إيجابي حتى نهاية الفترة.

من جهة أخرى، ستولد صدمة في أسعار النفط مقدرة بـ ١ % سيكون لها أثر معنوي إيجابي على النمو الاقتصادي يمتد إلى الفترة الثالثة على طول فترة الاستجابة، ثم تؤثر هذه الصدمة سلباً حتى نهاية الفترة.

تحليل مكونات التباين :

للتعرف على مقدار التباين لكل متغير والذي يعزى إلى خطأ التنبؤ في المتغير نفسه والمقدار الذي يعزى إلى خطأ التنبؤ في المتغيرات التوضيحية الأخرى، يتم عادة تحليل مكونات التباين لكل متغير من متغيرات النموذج، كما تبرز أهمية تحليل مكونات التباين في أنه يعطي الأهمية النسبية لأثر أي تغير مفاجئ في كل متغير من متغيرات النموذج على جميع متغيرات النموذج، ولتفادي مشكلة وجود التأثير المتزامن للأخطاء في المتغيرات المختلفة في النموذج، يتم اللجوء إلى توزيع (Cholaski) والذي يتأثر بشكل كبير بترتيب المتغيرات في النموذج المراد اختباره، وعليه سيتم التأكد من النتائج من خلال تغيير ترتيب المتغيرات المستخدمة في نموذج الدراسة.

قام الباحث بإجراء اختبار تحليل مكونات التباين على متغيرات الدراسة.

ومن خلال النتائج المدرجة في الجدول (٨) في الملحق يتضح أنه عند إجراء اختبار تحليل مكونات تباين الأخطاء يتبين أن التقلبات الظرفية للمتغيرات في المدى القصير تتعلق بصدمات المتغيرات الأخرى بنسبة كبيرة جداً.

١. الأرقام المتحصل عليها من الجدول في الملحق (٧) بالاعتماد على مخرجات EViews.

كما تبين من الجدول انه عند تحليل مكونات التباين لسعر النفط إن حوالي ١٠٠% من خطأ التنبؤ في تباين سعر النفط يعزى إلى متغيرات الدراسة الأخرى في الفترة الأولى تنخفض هذه النسبة إلى ٤٣.٤٢ في الفترة العاشرة. بينما ١٠٠% من خطأ التنبؤ في النمو الاقتصادي يعزى إلى متغير نفسه تنخفض هذه النسبة لتصل إلى حوالي ٤٠.٧٣ % في الفترة العاشرة.

نموذج تصحيح الخطأ (VECM) :

تم تطبيق نموذج تصحيح الخطأ لتقدير العلاقات الاقتصادية بين المتغيرات الاقتصادية قيد الدراسة، بعد إن بينت نتائج اختبار فترات التباطؤ وجود فترة تباطؤ واحدة في كل من معادلات النموذج، وعلية كانت نتائج تقدير المعادلات كما يلي :

$$GGDP = 0.0007 + 0.93GGDP_{-1} - 0.09 OILP_{-1}$$

$$\text{Prob. (0.75) (0.001) (0.02) } R^2 = 0.52$$

$$OILP = 12.3 - 27.48 GGDP_{-1} + 0.93 OILP_{-1}$$

$$\text{Prob. (0.12) (0.3) (0.00) } R^2 = 0.54$$

يتبين من نتائج نموذج تصحيح الخطأ (VECM) لمعادلة النمو الاقتصادي، وجود اثر إيجابي ومعنوي للنمو الاقتصادي في الفترة السابقة على النمو الاقتصادي في الفترة الحالية، كذلك وجود اثر سلبي ومعنوي لسعر النفط على النمو الاقتصادي.

أما معادلة سعر النفط، فيتبين من النتائج وجود اثر إيجابي ومعنوي لسعر النفط في الفترة السابقة على سعر النفط في الفترة الحالية.

أما باقي الخصائص القياسية فهي مقبولة بالرغم من تدني قيمة معامل التحديد، والتي عادة ما تكون متدنية نسبياً في اقتصاديات الدول الصغيرة التي لا تتوفر فيها سلاسل زمنية طويلة للمتغيرات الاقتصادية وخاصة عند اخذ الفرق الأول بدلا من المتغيرات الأصلية.

النتائج

يتبين من النتائج ما يلي:

وجود علاقة تكامل مشترك بين متغيرات الدراسة ومعنوية (5%)، وذلك حسب (Max Eigen Value Test)، وذلك نرفض الفرضية العدمية (H_0) وتقبل الفرضية البديلة (H_1) والدالة على وجود تكامل مشترك حيث إن عدد متجهات التكامل المشترك هو ($r=1$) عند مستوى معنوية (0.05) وبالتالي فإن نتائج استقرار البيانات واختبار التكامل المشترك تشير إلى وجود علاقة توازنية طويلة الأجل بين متغيرات الدراسة أي أنها تظهر سلوكاً متشابهاً في المدى الطويل.

وجود علاقة سببية من تقلبات سعر النفط إلى النمو الاقتصادي، حيث بلغت قيمة المعنوية (0.0426) وهي اقل من 5% وبالتالي يتم رفض الفرضية العدمية التي تنص على إن تقلبات سعر النفط لا يسبب النمو الاقتصادي وقبول الفرضية البديلة التي تنص على إن تقلبات سعر النفط يسبب النمو الاقتصادي.

عدم وجود علاقة سببية من النمو الاقتصادي إلى تقلبات سعر النفط، حيث بلغت قيمة المعنوية (0.947) وهي أكبر من 5% وبالتالي يتم قبول الفرضية العدمية التي تنص على أن النمو الاقتصادي لا يسبب تقلبات سعر النفط ورفض الفرضية البديلة التي تنص على أن النمو الاقتصادي يسبب تقلبات سعر النفط.

حسب تقديرات دوال الاستجابة الدفعية الممتدة على 10 سنوات، فإن حدوث صدمة هيكلية إيجابية واحدة في النمو الاقتصادي مقدرة بـ 1% سيكون لها أثر معنوي إيجابي على أسعار النفط يمتد إلى الفترة الثانية على طول فترة الاستجابة، ثم تؤثر هذه الصدمة سلباً كحد أقصى في الفترة السادسة، ويعود أثر الصدمة ليصبح إيجابي حتى نهاية الفترة.

من جهة أخرى، ستولد صدمة في أسعار النفط مقدرة بـ 1% سيكون لها أثر معنوي إيجابي على النمو الاقتصادي يمتد إلى الفترة الثالثة على طول فترة الاستجابة، ثم تؤثر هذه الصدمة سلباً حتى نهاية الفترة.

ومن خلال النتائج يتضح أنه عند إجراء اختبار تحليل مكونات تباين الأخطاء يتبين أن التقلبات الظرفية للمتغيرات في المدى القصير تتعلق بصدمات المتغيرات الأخرى بنسبة كبيرة جداً.

كما تبين أنه عند تحليل مكونات التباين لسعر النفط إن حوالي 100% من خطأ التنبؤ في تباين سعر النفط يعزى إلى متغيرات الدراسة الأخرى في الفترة الأولى تنخفض هذه النسبة إلى 43.42 في الفترة العاشرة. بينما 100% من خطأ التنبؤ في النمو الاقتصادي يعزى إلى متغير نفسه تنخفض هذه النسبة لتصل إلى حوالي 40.73% في الفترة العاشرة.

أما باقي الخصائص القياسية فهي مقبولة بالرغم من تدني قيمة معامل التحديد، والتي عادة ما تكون متدنية نسبياً في اقتصاديات الدول الصغيرة التي لا تتوفر فيها سلاسل زمنية طويلة للمتغيرات الاقتصادية وخاصة عند اخذ الفرق الأول بدلا من المتغيرات الأصلية.

أما معادلة سعر النفط، فيتبين من النتائج وجود أثر إيجابي ومعنوي لسعر النفط في الفترة السابقة على سعر النفط في الفترة الحالية.

يتبين من نتائج نموذج تصحيح الخطأ (VECM) لمعادلة النمو الاقتصادي، وجود أثر إيجابي ومعنوي للنمو الاقتصادي في الفترة السابقة على النمو الاقتصادي في الفترة الحالية، كذلك وجود أثر سلبي ومعنوي لسعر النفط على النمو الاقتصادي.

التوصيات

توصي الدراسة المنظمات النفطية بالنظر في أهمية إيجاد سياسات نفطية والاقتصادية تحد من تأثير التقلبات الاقتصادية على أسعار النفط.

على أصحاب القرار في الحكومة العراقية اخذ موضوع خطر تقلبات أسعار النفط بنظر الاعتبار عند اعداد الموازنة مع وضع سياسات بديلة للمواجهه أزمات تقلب الأسعار والتي من شأنها معالجة اختلالات الميزانية (العجز والفائض).

ضرورة العمل على تنويع مصادر الدخل في الاقتصاد بالشكل الذي يضمن امتصاص اثر الصدمات باقل قد من الخسارة من خلال استخدام حزمة من الإجراءات الهيكلية.

توصي الدراسة إلى الاستفادة من الفوائض المالية الإيرادات النفطية لدعم وتطوير وتنمية القطاعات الأخرى.

توصي الدراسة إلى ضرورة الاهتمام بالبنية التحتية للقطاع النفطي وإقامة مشاريع وصناعات تعتمد على النفط الخام ومشتقاته.

ضرورة إعطاء دور أكبر لقطاع الخاص في تحقيق النمو الاقتصادي.

قائمة المراجع

أولاً- المراجع العربية:

- البصام، سهام حسين (٢٠١٣). مخاطر وإشكاليات انخفاض أسعار النفط في إعداد الموازنة العامة للعراق، وضرورات تفعيل مصادر الدخل الغير نفطية: دراسة تحليلية. مجلة كلية بغداد للعلوم الاقتصادية، (٣٦).
- جنديل، جعفر طالب أحمد وعبد الحسين، علياء (٢٠١٧). السياسات الاقتصادية العالمية في تسعير النفط وانعكاساتها على التنمية في العراق. مجلة الكوت للعلوم الاقتصادية والإدارية، (٢٦)، ٧٢-٥١.
- خير الدين، المعتصم محمد (٢٠٠٨). تأثير تذبذبات أسعار النفط على التضخم والميزان التجاري في الأردن. رسالة ماجستير غير منشورة، كلية الدراسات العليا، الجامعة الأردنية، عمان، الأردن.
- داود، تغريد داود سلمان (٢٠١٦). أثر الإيرادات النفطية في تنمية الاقتصاد العراقي. مجلة جامعة بابل، ٢٤(٤)، ١٠٣٤-١٠٦٣.
- الدوري، محمد أحمد (٢٠٠٣). مبادئ اقتصاد النفط، الجزائر: دار شموع الثقافة.
- راضي، محمد السيد (٢٠١٧) الاقتصاد الكلي : (الطريقة الاقتصادية في التفكير-مقدمة في التحليل الاقتصادي الكلي-التدفق الدائري للدخل والإنتاج-قياس الدخل والناتج القومي-العوامل المحددة لحجم الإنفاق المخطط-نظرية المضاعف وتحديد الدخل القومي-...)، مصر، الإسكندرية: دار التعليم الجامعي للطباعة والنشر والتوزيع.
- الراوي، عبد الخالق مطلق (٢٠١١). محاسبة النفط والغاز، عمان، الأردن: دار اليازوري العلمية للنشر والتوزيع.
- زين، محمد علي (٢٠٠٦). الاقتصاد العراقي : الواقع الحالي وتحديات المستقبل، أبو ظبي. مركز الإمارات للبحوث والدراسات الاستراتيجية.
- سعد، الطاهر منصور علي(٢٠١٠). منظمة الأوبك في إطار العلاقة بين الدول المنتجة والدول المستهلكة للنفط الحاضر والمستقبل، جامعة عين شمس، القاهرة.
- السماك، محمد أزهرى سعيد (٢٠١٠). جغرافية النفط، عمان، الكويت: دار حنين.
- السواعي، خالد محمد (٢٠١١). أساسيات القياس الاقتصادي باستخدام EVIEWS، إربد، الأردن: دار الكتاب الثقافي.
- صارم، سمير (٢٠٠٣). الأبعاد النفطية في الحرب الأمريكية على العراق، دمشق: دار الفكر.
- الصعيدي، عماد حسنين سليم (٢٠١٥). أثر تقلبات أسعار النفط العالمية على عجز الموازنة العامة في الأردن. المؤتمر العلمي الدولي الأول، منظمات الأعمال، جامعة البلقاء التطبيقية، الأردن.

المجلوني، سماح أنور موسى (٢٠١٧). تذبذب أسعار النفط وأثره على الناتج المحلي الإجمالي والتضخم والميزان التجاري: الأردن كحالة دراسية، جامعة اليرموك، إربد، الأردن.

فاروق، عبد الخالق (٢٠٠٦). احتلال العراق ومستقبل الطاقة والنفط، القاهرة، مصر: العربي للنشر والتوزيع.

المزيني، ع (٢٠١٣). العوامل التي أثرت على تقلبات أسعار النفط العالمية. مجلة جامعة الأزهر، ١٥(١)، ٣١٩-٣٤٦.

الموسوي، ضياء مجيد (٢٠٠٥). ثورة أسعار النفط ٢٠٠٤، الجزائر: ديوان المطبوعات الجامعية.

ناصر، إيمان عطية (٢٠٠٧). مبادئ الاقتصاد الكلي، الإسكندرية، مصر: دار الجامعة الجديدة.

اليوسف، يوسف خليفة (٢٠١٥). الاقتصاد السياسي للنفط : رؤية عربية لتطورات، مركز دراسات الوحدة العربية، بيروت، لبنان.

Bentley, R.W. (2016). Introduction to Peak Oil, Springer International Publishing : Imprint: Springer, Cham.

Dicky and Fuller (1979). Distribution of the estimators for Autoregressive time series with unit root. Journal of American statistical Association , 74, 427-431.

Dicky and Fuller (1981). Likelihood ratio statistics for Autoregressive time series with unit root. Econometrica , 49(4), 1057.

Green, W.H. (2003). Econometric Analysis, 5th Edition, Upper Saddle River, New Jersey: Prentice Hall.

Johansen (1995). Likelihood-Based Inference in Cointegrated Vector Autoregressive Models, New York: Oxford University Press.

Khuran, S., Liu, H., & Rehana, N. (2015). Economic adjustment of United Kingdom and exchange rates. International Journal of Information, Business and Management, 7(2), 116–122.

Lun, Y.H. Venus (2013). Oil Transport Management. London: Springer.

Mamta, Chowdhury (2004). Currency Crisis and Stock Prices in East Asian Countries: An application of Cointegrating Granger Causality. School of Economics and Finance, Working paper series, N°2004/01.

Nelson, C. and Plosser, C. (1982). Trends and Random Walks in Macroeconomic Time Series: Some Evidence and Implications. Journal of Money Economics, 10.

Noreng, Øystein.(2006). Crude power : politics and the oil market, I. B. Tauris, London.

OPEC (2013). World Oil Outlook, November.

Phillips, P.C. and Perron, P. (1988). Testing for a Unit Root in Time Series Regression. Biometrika, 75, 335-346.

Stock, J. H. and Watson, M. W. (1988). Testing for Common Trends. Journal of American Statistical Association, 83.

Thomas, Alun H.(2009). Today versus tomorrow the sensitivity of the non-oil current account balance to permanent and current income. International Monetary Fund, Strategy, Policy and Review Dept., [Washington, D.C.].

Thompson, Helen (2017). Oil and the Western Economic Crisis, Springer International Publishing : Imprint: Palgrave Macmillan, Cham.

World Bank, Statistical Manual (2009). National Accounts, GDP–final output.

Yule, G.U. (1926). Why Do We Some Times Get Nonsense-Correlations Between Time-Series? A Study in Sampling and the Nature of Time-Series. Journal of the Royal Statistical Society, 89.

الملاحق

جدول (٤) نتائج اختبار فترات التباطؤ

VAR Lag Order Selection Criteria						
Endogenous variables: GROWTHGDP OILPRICE						
Exogenous variables: C						
Date: 07/14/18 Time: 15:54						
Sample (adjusted): 1992 2016						
Included observations: 25 after adjustments						
Lag	LogL	LR	FPE	AIC	SC	HQ
0	-49.55397	NA	0.594408	5.155397	5.254970	5.174835
1	-24.04038	43.37310*	0.069450*	3.004038	3.302758*	3.062351
2	-22.23158	2.713208	0.087954	3.223158	3.721024	3.320346
3	-20.51037	2.237563	0.114986	3.451037	4.148050	3.587102
4	-17.71839	3.071184	0.140140	3.571839	4.467998	3.746778
5	-12.41739	4.770902	0.140789	3.441739	4.537044	3.655554
6	-6.765018	3.956658	0.149859	3.276502	4.570954	3.529192
7	-1.258697	2.753160	0.190507	3.125870	4.619468	3.417436
8	10.89786	3.646966	0.175357	2.310214*	4.002959	2.640656*
* indicates lag order selected by the criterion						
LR: sequential modified LR test statistic (each test at 5% level)						
FPE: Final prediction error						
AIC: Akaike information criterion						
HQ: Hannan-Quinn information criterion						

المصدر: من إعداد الباحث بالاعتماد على مخرجات EViews.

جدول (٥) اختبار نتائج نموذج الانحدار الذاتي.

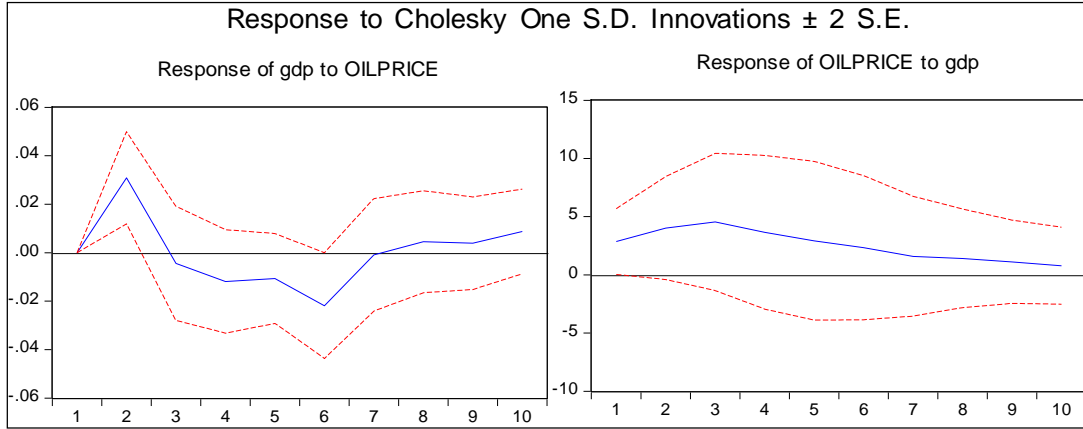
Modulus	Root
0.874845	0.871719 - 0.07701i
0.884845	0.881719 + 0.078801i
0.878101	-0.061432 - 0.765157i
0.868101	-0.071432 + 0.865157i
0.634604	0.612155 - 0.170217i
0.734604	0.812155 + 0.180217i
0.725878	0.426297 - 0.668251i
0.625878	0.426297 + 0.458251i
0.725015	0.625015-0.612356i
-0.106810	-0.606810+0.543265i
0.402011	-0.188318 - 0.461178i
0.402011	0.461178i + 0.178318
0.260729	-0.349428 - 0.077402i
0.260729	-0.329428 + 0.077402i
0.157083	0.080729 - 0.140303i
0.157083	0.080729 + 0.140303i

المصدر: من إعداد الباحث بالاعتماد على مخرجات EViews.

جدول (٦) نتائج اختبار السببية

Pairwise Granger Causality Tests			
Date: 07/14/18 Time: 16:00			
Sample: 1990 2016			
Lags: 2			
Prob.	F-Statistic	Obs	Null Hypothesis:
0.0426	3.71149	25	OIP does not Granger Cause GDP
0.9470	0.05461		GDP does not Granger Cause OIP

المصدر: من إعداد الباحث بالاعتماد على مخرجات .EViews



شكل (١) اختبار استجابة دالة ردة الفعل

المصدر: من إعداد الباحث بالاعتماد على مخرجات .EViews

جدول (٨) نتائج اختبار تحليل التباين

Period	S.E.	GDP	OILPRICE
1	0.026159	100.0000	0.000000
2	0.042285	40.21285	53.46417
3	0.050947	46.71930	37.58750
4	0.053253	43.58890	39.39532
5	0.056987	47.05152	37.91864
6	0.061569	40.82784	45.13547
7	0.063142	41.64934	42.93541
8	0.063397	41.38158	43.09470
9	0.063959	41.80673	42.70714
10	0.064797	40.73527	43.42571

المصدر: من إعداد الباحث بالاعتماد على مخرجات .EViews

جدول (٩) نتائج اختبار نموذج تصحيح الخطأ

Vector Error Correction Estimates		
Date: 07/14/18 Time: 15:54		
Sample (adjusted): 1992 2016		
Cointegrating Eq:	CointEq1	
GROWTHGDP(-1)	1.000000	
OILPRICE(-1)	0.000271	
	(0.00060)	
	[0.44996]	
Error Correction:	D(GROWTHGDP)	D(OILPRICE)
CointEq1	-0.936136	-17.20601
	(0.22722)	(27.2002)
	[-4.12001]	[-0.63257]
D(GROWTHGDP(-1))	0.092218	10.83794
	(0.19800)	(23.7023)
	[0.46575]	[0.45725]
D(GROWTHGDP(-2))	0.038006	19.72321
	(0.18766)	(22.4644)
	[0.20253]	[0.87798]
D(OILPRICE(-1))	0.003589	0.579890
	(0.00231)	(0.27640)
	[1.55452]	[2.09802]
D(OILPRICE(-2))	-0.000934	-0.109641
	(0.00271)	(0.32412)

	[-0.34492]	[-0.33828]
C	-0.011556	1.686702
	(0.01445)	(1.72991)
	[-0.79966]	[0.97502]
R-squared	0.677855	0.420328
Adj. R-squared	0.472854	0.051446

المصدر: من إعداد الباحث بالاعتماد على مخرجات EViews.