الجمهورية الجزائرية الديمقراطية الشعبية
وزارة التعليم العالي والبحث العلمي
جامعة محمد بوضياف -المسيلة-

كلية : العلوم الاقتصادية والتجارية وعلوم التسيير
قسم: العلوم التجارية.
رقم:.....

ميدان: علوم اقتصادية تجارية وعلوم التسيير
فرع: العلوم التجارية
تخصص: مالية وتجارة دولية

العنوان:

أثر تغيرات أسعار البترول على التجارة الخارجية الجزائرية خلال الفترة (1990-2020)

مذكرة مقدمة ضمن متطلبات نيل شهادة ماستر (أكاديمي) في العلوم التجارية

تخصص: مالية وتجارة دولية

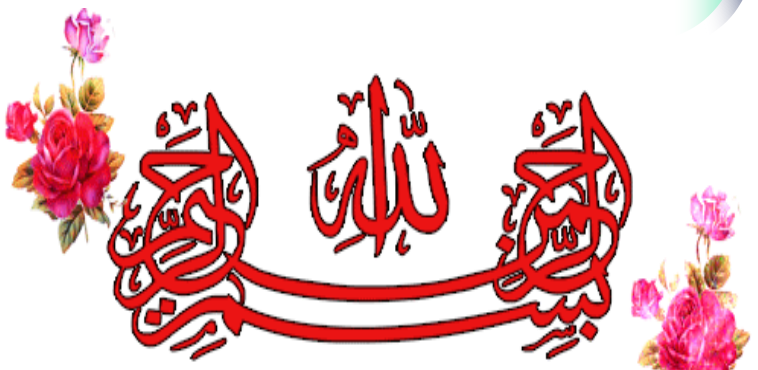
من إعداد الطلبة: بن الطيب أحلام

بن عزي ريمة

لجنة المناقشة:

أ.د. بدروني عيسى	أستاذ التعليم العالي	رئيسا
د. مخوخ رزيقة	أستاذ محاضر –أ–	مقررا ومشرفا
د.فيشوش حمزة	أستاذ محاضر –أ–	ممتحنا

السنة الجامعية: 2023/2022



شكر وعرفان:

بداية الشكر لله عز وجل الذي أعاننا وشد من عزمنا لإكمال هذا البحث، والذي وهبنا الصبر والمطاولة والتحدي لنجعل من هذا البحث علما ينتفع به.

نتقدم بأجمل عبارات الشكر والامتنان من قلوب فائضة بالاحترام والتقدير للمشرفة الدكتورة "مخوخ رزيقة"، ونقدم أزكى تحياتنا وأجملها وأثناها على كل التوجيهات والنصائح التي قدمتها لنا لإتمام هذا البحث فلك منا أسمى عبارات الثناء.

كما نتقدم بجزيل الشكر والعرفان "للأستاذ الدكتور: " مصطفى قريد" الذي لم يبخل علينا بتوجيهاته ونصائحه القيمة

كما نتوجه بالشكر إلى أعضاء لجنة المناقشة الكرام : الدكتور: فيشوش حمزة، والدكتور: بن حوحو محمد.

خالص الشكر والتقدير إلى كل فريق عمل قسم العلوم التجارية من أساتذة وعمال.

إهداء

الحمد لله وكفى والصلاة على الحبيب المصطفى وأهله ومن وفى، الحمد لله الذي وفقنا لتثمين هذه الخطوة في مسيرتنا الدراسية بمذكرتنا هذه ثمرة الجهد والنجاح بفضله تعالى مهداة :

إلى من لم يدخرا نفسا في تربيتي ومهدا لي سبيل النجاح إلى الوالدين الكريمين حفظهما الله وأدامهما نورا لدربي.

إلى قرة عيني زوجي الذي كان سندا لي في مشواري، إلى فلذات كبدي: أمير، أروى، مؤيدو بسملة حفظهم الله ورعاهم.

إلى إخوتي وأخواتي: زينب، هدى، حمزة وأحمد، والى كل عائلتي الثانية عائلة زوجي، وأخص بالذكر مروان، إلى زملاء الدراسة متمنية لهم التوفيق.

أحلام

إهداء

إلى التي بحنانها ارتويت و بدفئها احتميت، وبنورها اهتديت ولحقها ما وفيت.

إلى أمي حفظها الله

إلى درعي الذي به احتميت وفي الحياة به اقتديت،ركيزة عمري وصدر أماني وكبريائي

أبي حفظه الله

إلى زوجي سندي ومصدر قوتي وقرة عيني الذي رافقني وساندني طوال مشواري الدراسي حفظك الله وأدامك لي.

إلى فلذات كبدي دينا رنا أماني وعلي ريان الذين تعبو معي طيلة فترة دراستي .

إلى إخوتي وأخواتي: أمال نورة سليم لويزة وليد إيمان حفظهم الله ورعاهم

إلى عائلتي الثانية عائلة زوجي كل باسمه

إلى زميلتي أحلام التي ساعدتني وأعانتني في إنجاز هذه المذكرة

أهدي هذا العمل.

ريمة

ملخص

تهدف هذه الدراسة إلى تحديد أثر تغيرات أسعار البترول على التجارة الخارجية الجزائرية خلال الفترة(1990-2020)، باستخدام طريقة المربعات الصغرى العادية تبين وجود علاقة طردية بين أسعار البترول والصادرات، كما ظهر أن تغير أسعار البترول بنسبة 1% يؤدي إلى تغير في الصادرات في نفس الاتجاه بنسبة 1.018%، فضلا عن أن الواردات تبدي استجابة معنوية كبيرة للتغيرات في أسعار البترول، كما تبين أن تغير نسبته 1% في هذه الأخيرة يؤدي إلى تغير الواردات بنسبة 1.037%، أما الميزان التجاري فقد أبدى استجابة معنوية ضعيفة للتغيرات في أسعار البترول حيث انه إذا تغير سعر البترول بمقدار 1دولار سيتغير رصيد الميزان التجاري بحوالي 0.1807 مليار دولار.

الكلمات المفتاحية: أسعار البترول، التجارة الخارجية للجزائر، دراسة قياسية.

Abstract:

This study aims to determine the effect of changes in oil prices on Algerian foreign trade during the period (1990-2020). By using least squares method, it appears a direct correlation between oil and exports. Also, it shows that a change in oil prices of 1% leads to change in exports in the same direction, by 1.037% besides imports show a highly significant response to oil price changes. Furthermore, it was found that a change of 1% in oil prices leads to a change in imports by 1.807%. In fact the trade balance showed a weak response to changes in oil price has only changed by one dollar. Thus, the trade balance will change by about 0.1807 billion dollars.

Keywords : oil prices, Algerian foreign trade, Quantitative study.

فهرس المحتويات

العناوين	الصفحة
الإهداء.....	
شكر وعرفان.....	
ملخص الدراسة.....	
فهرس المحتويات.....	I
فهرس الجداول.....	VI
فهرس الأشكال.....	VII
فهرس الملاحق.....	VII
المقدمة.....	أ- هـ
الفصل الأول: الاطار النظري لأسعار البترول.....	06
تمهيد.....	07
المبحث الأول: عموميات حول البترول.....	08
المطلب الأول: مفهوم البترول وخصائصه ومميزاته.....	08
أولا: مفهوم البترول.....	08
ثانيا: خصائص البترول.....	08
ثالثا: مميزات البترول.....	09
المطلب الثاني: أنواع البترول.....	09
أولا: البترول الخفيف.....	10
ثانيا: البترول الثقيل.....	10
ثالثا: البترول المتوسط.....	10
المطلب الثالث: أهمية البترول.....	10
أولا: أهمية البترول على الصعيد الاقتصادي.....	10
ثانيا: أهمية البترول على الصعيد الاجتماعي.....	11
ثالثا: أهمية البترول على الصعيد السياسي.....	11
رابعا: أهمية البترول على الصعيد العسكري.....	11

المبحث الثاني: عموميات حول أسعار البترول.....	11
المطلب الأول: مفهوم سعر البترول.....	**11**
المطلب الثاني: أنواع أسعار البترول.....	**12**
المطلب الثالث: العوامل المحددة لأسعار البترول.....	13
أولا: العوامل الاقتصادية.....	**13**
ثانيا: التنظيمات الدولية.....	**15**
ثالثا: العوامل الجيوسياسية والأزمات البترولية.....	**16**
المبحث الثالث: السوق العالمية للبترول ومخاطر الطفرات البترولية.....	**18**
المطلب الأول: مفهوم وخصائص السوق البترولية.....	**18**
أولا: مفهوم السوق البترولية.....	**18**
ثانيا: خصائص السوق البترولية.....	**18**
المطلب الثاني: أنواع السوق البترولية وطرق التسعير.....	**19**
أولا: أنواع السوق البترولية.....	**19**
ثانيا: طرق التسعير.....	**20**
المطلب الثالث: مخاطر الطفرات البترولية.....	21
خلاصة الفصل.....	**24**
الفصل الثاني: الاطار النظري للتجارة الخارجية.....	**25**
تمهيد.....	**26**
المبحث الأول: عموميات حول التجارة الخارجية.....	**27**
المطلب الأول: مفهوم التجارة الخارجية وأسباب قيامها.....	**27**
أولا: مفهوم التجارة الخارجية.....	**27**
ثانيا: أسباب قيام التجارة الخارجية.....	**27**
المطلب الثاني: أهمية التجارة الخارجية.....	**28**
المطلب الثالث: سياسات التجارة الخارجية وأهدافها.....	**29**
أولا: ماهية السياسة التجارية.....	**29**
ثانيا: أهداف السياسة التجارية.....	**30**
المبحث الثاني: نظريات التجارة الخارجية.....	**30**
المطلب الأول: النظريات الكلاسيكية.....	**30**
أولا: نظرية الميزة المطلقة.....	**30**

ثانيا: نظرية المزايا النسبية.....	31
ثالثا: نظرية القيم الدولية.....	32
المطلب الثاني: النظريات النيوكلاسيكية.....	33
أولا: نظرية التكلفة البديلة.....	33
ثانيا: نظرية نسب عناصر الانتاج.....	34
ثالثا: الاختبار التجريبي لنظرية هكشر وأولين.....	35
المطلب الثالث: النظريات الحديثة	36
أولا: نظرية نسب عناصر الانتاج الجديدة.....	36
ثانيا: نظرية معدل التبادل التجاري والتجارة ما بين الصناعات.....	37
ثالثا: النظرية التكنولوجية.....	38
المبحث الثالث: مؤشرات التجارة الخارجية.....	40
المطلب الأول: هيكل الصادرات والواردات.....	40
أولا: هيكل الصادرات.....	40
ثانيا: هيكل الواردات.....	40
المطلب الثاني: رصيد الميزان التجاري.....	40
أولا: مفهوم الميزان التجاري.....	40
ثانيا: أقسام الميزان التجاري.....	41
ثالثا: وضعيات الميزان التجاري.....	41
المطلب الثالث: معدل التبادل التجاري والانفتاح الاقتصادي على العالم.....	41
أولا: مؤشر الانفتاح الاقتصادي على العالم.....	41
ثانيا: معدل التبادل التجاري.....	41
المطلب الرابع: مؤشرات أخرى.....	42
أولا: التركيز.....	42
ثانيا: التنويع.....	43
ثالثا: التخصص.....	43
رابعا: مؤشر تنويع المنتجات حسب المهارات وكثافة التكنولوجيا.....	43
خلاصة الفصل.....	44
الفصل الثالث: قياس اثر تغيرات أسعار النفط على متغيرات التجارة الخارجية.....	45
تمهيد.....	46

المبحث الأول: تعريف متغيرات الدراسة وتحليل اتجاهاتها.....	42
المطلب الأول: تعريف متغيرات الدراسة.....	47
المطلب الثاني: الدراسة الإحصائية والاقتصادية لمتغيرات الدراسة.....	47
أولا: تطور أسعار البترول خلال الفترة (1990-2020).....	47
ثانيا: التحليل الإحصائي والاقتصادي لسلسلة الصادرات.....	48
ثالثا: التحليل الإحصائي والاقتصادي لسلسلة الواردات.....	50
رابعا: التحليل الإحصائي والاقتصادي للميزان التجاري.....	53
المبحث الثاني: الأدوات المستعملة في الدراسة.....	54
المطلب الأول: الطريقة المعتمدة في الدراسة.....	54
المطلب الثاني: التقييم وفقا لمعيار النظرية الاقتصادية.....	55
المطلب الثالث: التقييم الإحصائي.....	56
أولا: اختبار ستودنت.....	56
ثانيا: اختبار إحصائية فيشر.....	57
المطلب الرابع: التقييم من الناحية القياسية.....	57
أولا: انعدام ارتباط بين عناصر الخطأ من مشاهدة لأخرى.....	58
ثانيا: حالة عدم تجانس التباين.....	59
ثالثا: اختبار وايت.....	59
رابعا: اختبار ARCH-LM.....	59
خامسا: اختبار التوزيع الطبيعي للبواقي.....	60
المبحث الثالث: نتائج الدراسة ومناقشتها.....	60
المطلب الأول: قياس اثر أسعار البترول على الصادرات(نموذج الصادرات).....	60
أولا: التقييم الاقتصادي لنموذج الصادرات.....	61
ثانيا: التقييم من الناحية الإحصائية لنموذج الصادرات.....	62
ثالثا: التقييم من الناحية القياسية لنموذج الصادرات.....	62
المطلب الثاني: قياس اثر أسعار البترول على الواردات(نموذج الواردات).....	64
أولا: التقييم الاقتصادي لنموذج الواردات.....	65
ثانيا: التقييم من الناحية الإحصائية لنموذج الواردات.....	65
ثالثا: التقييم من الناحية القياسية لنموذج الواردات.....	65
المطلب الرابع: قياس أثر أسعار البترول على الميزان التجاري(نموذج الميزان	68

التجاري).....	
أولا: التقييم الاقتصادي لنموذج الميزان التجاري.....	68
ثانيا: التقييم من الناحية الإحصائية لنموذج الميزان التجاري.....	68
ثالثا: التقييم من الناحية القياسية لنموذج الميزان التجاري.....	69
خلاصة الفصل.....	72
خاتمة.....	73
قائمة المراجع.....	77
الملاحق.....	81

فهرس الجداول :

الرقم	العنوان	الصفحة
01	نتائج تقدير معادلة الاتجاه العام لسعر البترول خلال الفترة (1990-2020)	48
02	تطور هيكل الصادرات الجزائرية خلال الفترة (1990-2020).....	49
03	نتائج تقدير معادلة الاتجاه العام للواردات الجزائرية خلال الفترة(1990-2020).....	51
04	نتائج تقدير نموذج الصادرات بدلالة سعر البترول خلال الفترة(1990-2020).....	61
05	نتائج اختبار وايت لتجانس تباين الخطأ لنموذج الصادرات.....	63
06	نتائج اختبار ARCH-LM لنموذج الصادرات.....	63
07	نتائج تقدير نموذج الواردات بدلالة سعر البترول خلال الفترة (1990-2020).....	65
08	نتائج اختبار وايت لتجانس تباين الخطأ لنموذج الواردات.....	66
09	نتائج اختبار ARCH-LM لنموذج الواردات.....	67
10	نتائج تقدير نموذج الميزان التجاري / سعر البترول خلال الفترة(1990-2020).....	68
11	نتائج اختبار وايت لتجانس تباين الخطأ لنموذج الميزان التجاري.....	69
12	نتائج اختبار ARCH-LM لنموذج الميزان التجاري.....	70

فهرس الأشكال :

الرقم	العنوان	الصفحة
01	**تطور أسعار البترول خلال الفترة(1990-2020).....**	48
02	**تطور هيكل الصادرات الجزائرية خلال الفترة (1990-2020).....**	50
03	**تطور قيمة الواردات الجزائرية خلال الفترة(1990-2020).....**	51
04	**تطور الميزان التجاري في الجزائر خلال الفترة (1990-2020).....**	53
05	**مجالات وقوع إحصائية DW.....**	58
06	**نتائج اختبار إحصائية جاك-بيرا لنموذج الصادرات.....**	64
07	**نتائج اختبار إحصائية جاك-بيرا لنموذج الواردات.....**	67
08	**نتائج اختبار إحصائية جاك-بيرا لنموذج الميزان التجاري.....**	70

فهرس الملاحق :

الرقم	العنوان	الصفحة
01	**السلاسل الزمنية لمتغيرات الدراسة خلال الفترة (1990-2020).....**	81
02	**تصريح شرفي بالالتزام بمعايير الأمانة والنزاهة العلمية في إعداد مذكرة الماستر للطالبة بن الطيب أحلام.....**	83
03	**تصريح شرفي بالالتزام بمعايير الأمانة والنزاهة العلمية في إعداد مذكرة الماستر للطالبة بن عزي ريمة .....**	84

مقدمة

مقدمة:

يؤدي البترول دور أساسي وبالغ الأهمية في الاقتصاد العالمي المعاصر، إذ أصبح يعد مصدر طاقوي أساسي للعديد من القطاعات الزراعية والصناعية وحتى الاجتماعية، هذه الأهمية البالغة جعلت تقلبات أسعاره ذات تأثير واسع على مختلف مناحي الحياة، الأمر الذي أثار جدلا كبيرا حيث أفسح مجالا واسعا أمام محاولة تفسير المسار غير الطبيعي لأسعار البترول والعوامل المؤثرة فيه بقوة، فالبعض صنفها من المنظور الاقتصادي: كقوى السوق والتغيرات المناخية، التغير في مستوى الانتاج، الاحتياطي للبترول وكمية طلب الدول المستوردة للبترول فضلا عن العامل التكنولوجي، والبعض الآخر صنفها من منظور اقتصادي سياسي: كالتنظيمات الدولية–منظمة أوبك، الوكالة الدولية للطاقة– وغيرها من الشركات المنتجة للبترول.

فقد تعاظمت أهمية البترول وأصبح يشكل حيزا في سوق المبادلات التجارية، هذا الحيز المعتبر الذي احتله جعل لتقلبات أسعاره تأثير مباشر وغير مباشر على اقتصاديات الدول المصدرة للبترول، هذا ما فسرته نظرية" **المرض الهولندي**"الذي تعاني منه الدول المصدرة للنفط، إذ تفسر وجود ضعف كبير في المجالات الاقتصادية خارج قطاع المحروقات، التي تؤثر سلبا على تجارتها الخارجية من خلال ارتباط صادراتها ارتباطا وطيدا بتغيرات أسعار البترول، والذي بدوره يزيد من حجم الواردات لتلبية الاحتياجات المحلية والذي ينعكس سلبا على قيمة العملة الوطنية وهروب رؤوس الأموال، وبالتالي ضعف الاستثمارات الأجنبية.

وتعتبر الجزائر من بين الدول التي تملك موارد طبيعية معتبرة وبالأخص البترول الذي يمثل المحرك الأساسي لاقتصادها، حيث تمتلك ثالث اكبر احتياطي بعد نيجيريا وليبيا، وتعتبر ثالث اكبر منتج للنفط في القارة الإفريقية، فضلا عن احتلالها المركز الثالث عالميا من حيث تصدير البترول بعد كل من روسيا والنرويج، كما تمثل صادرات المحروقات أكثر من 96% من إجمالي صادرات الدولة منذ الاستقلال وحتى يومنا هذا، وهي تسعى جاهدة لتفادي أعراض المرض الهولندي من خلال تطبيق مخططات التنمية والانتعاش الذي كان في أسعار البترول حتى سنة 2014، فهي إذا كمعظم الدول المنتجة للبترول كان لانهيار أسعار البترول تأثيرا على اقتصادها، والذي أدى إلى انخفاض حاد في عائدات المحروقات وبالتالي تدني في قيمة الصادرات وتفاقم حالة عجز الميزان التجاري خاصة في السنوات الأخيرة من فترة الدراسة.

انطلاقا من كون أسعار البترول لها تأثير كبير على الاقتصاد الجزائري يمكننا طرح التساؤل الرئيسي التالي:

ما مدى تأثير تقلبات أسعار البترول على التجارة الخارجية الجزائرية خلال الفترة (1990–2020)؟

وعليه يمكن طرح التساؤلات الفرعية الموالية:

1. ما مدى تأثير تقلبات أسعار البترول على الصادرات الجزائرية؟
2. ما مدى تأثير تقلبات أسعار البترول على الواردات الجزائرية؟
3. هل يبدي الميزان التجاري استجابة معنوية للتغيرات في أسعار البترول؟

فرضيات الدراسة: من خلال هذه الدراسة سنحاول الإجابة على الفرض الرئيسي الموالي:

تبدي التجارة الخارجية للجزائر استجابة كبيرة للتغيرات في سعر البترول خلال الفترة 1990-2020.

والذي تنبثق عنه الفرضيات الفرعية التالية:

أ. تبدي الصادرات استجابة طردية قوية للتغيرات في أسعار البترول.

ب. تبدي الواردات استجابة طردية قوية للتغيرات في أسعار البترول.

ج. يبدي الميزان التجاري استجابة معنوية كبيرة للتغيرات في أسعار البترول.

أهداف الدراسة:

الهدف الأساسي من هذه الدراسة يتمثل في تسليط الضوء على تأثير التغيرات المستمرة في أسعار البترول على التجارة الخارجية للجزائر خلال الفترة 1990-2020، وهذا من خلال قياس ورصد هذا التأثير بالاستناد إلى أدوات القياس الاقتصادي، وتتفرع عنه الأهداف الفرعية التالية:

1. التعرف على المفاهيم النظرية المتعلقة بالبترول والتجارة الخارجية.
2. الكشف عن أهم العوامل المتحكمة في أسعار البترول.
3. تشخيص واقع الصادرات والواردات والميزان التجاري خلال فترة (1990-2020).
4. الكشف عن فعالية سياسة التنويع الاقتصادي .
5. التعرف على مدى تأثير أسعار البترول على متغيرات التجارة الخارجية باستخدام منهج القياس الكمي خلال الفترة (1990-2020).

أهمية الدراسة:

أ. تنبع أهمية هذه الدراسة في الوقت الحالي لتقييم وضعية التجارة الخارجية الجزائرية.

ب. الاهتمام المتزايد والمفرط بالبترول من طرف كل دول العالم ومدى تأثيره في العلاقات الاقتصادية والسياسية بين الدول، والذي أصبح سلاحا في يد الدول المنتجة له.

ج. محاولة الدراسة تأكيد أن الجزائر عرضة للصدمات المفاجئة في أسعار البترول إذ أنها تعتمد على مورد مالي يخضع للسوق الخارجية في تحديد أسعاره.

أسباب اختيار الموضوع: إن تطرقنا لدراسة هذا الموضوع يكمن في الدوافع التالية:

1- الرغبة في تناول المواضيع ذات الطابع القياسي الكمي، فضلا على أن موضوع التجارة الخارجية ذا علاقة مباشرة بالتخصص المدروس.

2- أهمية قطاع المحروقات في الاقتصاد العالمي وفي الاقتصاد الجزائري بصفة خاصة.

3- تشكل إيرادات البترول نسبة معتبرة من الصادرات الجزائرية والتي بدورها تحدد وضعية الميزان التجاري إلى جانب الواردات، وكذا وضعية التجارة الخارجية، فالتغير في أسعاره من شأنه أن يؤثر على مسار التنمية الاقتصادية وجذب الاستثمارات الأجنبية.

الدراسات السابقة:

دراسة قام بها كل من: **قاوي عمر، بوشول السعيد وبغداد بنين**، بعنوان: أثر تغيرات أسعار النفط على متغيرات التجارة الخارجية في الجزائر: دراسة قياسية خلال الفترة (1980-2018) باستخدام VECM، وهي مقالة بمجلة: مخبر النمو والتنمية الاقتصادية-جامعة الوادي.

هدفت الدراسة للوصول إلى طبيعة استجابة متغيرات التجارة الخارجية لارتفاع أسعار النفط، ومعرفة النسب التفسيرية لذلك والتأكد من مدى مطابقة النموذج القياسي مع الواقع الاقتصادي المعاش، وذلك بالاعتماد على المنهج الوصفي في الجانب النظري والمنهج التجريبي لتطبيق نموذج تصحيح الخطأ.

وقد أثبتت الدراسة وجود علاقة توازنية طويلة الأجل بين متغيرات الدراسة، وان الارتفاع في سعر النفط يؤثر ايجابيا على متغيرات التجارة الخارجية، حيث بينت نتائج تحليل التباين أن سعر النفط يفسر الجانب الأكبر من التغيرات التي تحدث في الصادرات والواردات في المدى القصير والطويل، ويفسر نسبة ضعيفة جدا من التغيرات التي تحدث في سعر الصرف الحقيقي في الجزائر، ويفسر اختبار السببية وجود علاقة ثنائية الاتجاه بين الصادرات وسعر النفط وعلاقة سببية أحادية الاتجاه تتجه من سعر النفط وسعر الصرف إلى الواردات.

وفي دراسة قام بها كل من: **المؤمن عبد الكريم وعبد الرحمان عبد القادر**، بعنوان: تأثير تقلبات أسعار البترول على الميزان التجاري بالجزائر دراسة قياسية للفترة (1990-2016)، وهو عبارة عن مقال في مجلة: دراسات اقتصادية التي تصدر عن جامعة زيان عاشور بالجلفة.

حيث هدفت الدراسة إلى إيجاد طبيعة العلاقة بين تقلبات أسعار البترول ورصيد الميزان التجاري في الفترة (1990-2016) حيث تم استخدام منهج التكامل المشترك ونموذج تصحيح

الخطأ، إذ تم كذلك الاعتماد على تطبيق الفروق الأولى على السلاسل الزمنية بعدما أثبتت الدراسة عدم استقرارها.

ليتم الوصول من خلال الدراسة إلى وجود علاقة تكامل متزامن بين أسعار البترول ورصيد الميزان التجاري، ووجود علاقة سببية في اتجاه واحد بينهما وأنه يتم تصحيح الخطأ بين المتغيرين بمقدار 86% سنويا.

كما قام: **عبد الكريم دبار ورحيمة بوصبيع صالح**، بإجراء دراسة بعنوان: أثر تقلبات أسعار النفط على الميزان التجاري الجزائري خلال الفترة (1990-2020)، وهي عبارة عن مقال في مجلة: التنمية الاقتصادية التي تصدر عن مخبر النمو والتنمية الاقتصادية في الدول العربية

هدفت الدراسة إلى تحديد العلاقة بيت الميزان التجاري وأسعار النفط، حيث عمدت إلى نمذجة قياسية وتحليلية باستخدام نموذج ARDL، وتوصلت من خلال النموذج إلى وجود علاقة توازنية طويلة الأجل بين متغيرات الدراسة مع وجود علاقة قصيرة الأجل أيضا وهو ما أكدته معادلة نموذج تصحيح الخطأ *VECM*، حيث ظهرت إشارة معامل تصحيح الخطأ سالبة ومعنوية.

وفي دراسة قام بها: **بركان بسمة ودربوش محمد الطاهر**، بعنوان: واقع التجارة الخارجية في الجزائر في ظل تقلبات أسعار النفط خلال الفترة (2014-2020)، وهي عبارة عن مقالة في مجلة: الأصيل للبحوث الاقتصادية والإدارية التي تصدر عن جامعة عباس لغرور بخنشلة.

هدفت الدراسة إلى معرفة تأثير التجارة الخارجية الجزائرية بالتغيرات التي تشهدها أسعار النفط في الأسواق العالمية، حيث أظهرت النتائج أن إجمالي الصادرات الجزائرية مرتبط بشكل شبه كلي بالصادرات في قطاع المحروقات بنسبة تزيد عن 90%، وأن الميزان التجاري تراجع بصفة كبيرة ابتداءا من 2014 وذلك راجع للأزمة النفطية، ليواصل في التراجع حتى سنة 2020، حيث سجل عجزا طيلة هذه السنوات الأخيرة رغم بوادر الإصلاح ومحاولة النهوض بالتجارة الخارجية.

بالنسبة لدراستنا هذه فقد اختلفت عن الدراسات السابقة في عدة جوانب أهمها:

- اختلاف زمن الدراسة، بحيث شملت دراستنا احدث السنوات التي توفرت عنها الإحصائيات في المنشورات الرسمية، فضلا على أنها جاءت لتقيم سياسة كثر الحديث عنها مؤخرا ممثلة في سياسة تنويع الصادرات خارج المحروقات.
- اختلاف الأداة المستعملة في الدراسة، وهنا نقصد طريقة المربعات الصغرى العادية والتي تعتبر أفضل طرق التقدير، من حيث أنها تعطي مقدرات توصف بأنها أحسن مقدرات خطية غير متحيزة.

- النتائج المتوصل إليها في هذه الدراسة دقيقة من حيث كونها اعتمدت على القياس، وهذا يخالف الكثير من الدراسات السابقة خاصة تلك التي اعتمدت على مجرد الوصف والتحليل، بالإضافة لكون الدراسة الحالية تحاول تأكيد نتائج الدراسات السابقة خلال فترة مغايرة.

حدود الدراسة: تتمثل حدود الدراسة فيما يلي:

أ. **الحدود المكانية:** أجريت هذه الدراسة على الجزائر.

ب. **الحدود الزمانية:** اخترنا لهذه الدراسة الفترة (1990-2020)، لأنها تعتبر بداية الفترة الانتقالية للجزائر من الاقتصاد المخطط نحو اقتصاد السوق، حيث كانت الأسعار منخفضة قبل فترة الدراسة لترتفع بعدها وتستمر في الانتعاش حتى سنة 2014، لتعود بعدها للانخفاض إلى غاية نهاية فترة الدراسة.

منهج الدراسة:

من أجل الإجابة على التساؤل الرئيسي لهذا البحث واختبار صحة الفرضيات تم الاعتماد على المنهج الوصفي التاريخي، من خلال سرد وعرض البيانات المتعلقة بالمتغيرات المدروسة والمنهج التحليلي بغية تحليلها وتفسيرها.

أما في الجانب التطبيقي تم الاعتماد على المنهج القياسي الكمي، وذلك بجمع البيانات المتعلقة بالمتغيرات خلال الفترة 1990-2020، واستخراج المعادلات الرياضية بالاعتماد على البرنامج الإحصائي Eviews12 بهدف الحصول على نماذج مقبولة من الناحية الاقتصادية والإحصائية وكذلك القياسية.

تقسيم الدراسة:

بغية الإجابة على الإشكالية الرئيسية واختبار الفرضيات قمنا بتقسيم البحث إلى ثلاث فصول وذلك على النحو التالي:

- **الفصل الأول:** تحت عنوان الاطار النظري لأسعار البترول تطرقنا فيه للمفاهيم الأساسية للبترول وكذا أسعاره ومختلف العوامل المتحكمة في تحديدها، وتوضيح طبيعة الأسواق البترولية والأزمات السعرية التي تتعرض لها بالإضافة إلى مختلف الطفرات التي تحدث في الأسعار.
- **الفصل الثاني:** تحت عنوان الاطار النظري للتجارة الخارجية، تناولنا فيه المفاهيم الأساسية للتجارة الخارجية من خلال التطرق إلى عموميات حول التجارة الخارجية، وكذا عرض النظريات المفسرة لقيام التجارة الخارجية بالإضافة إلى توضيح مؤشرات التجارة الخارجية.

- **الفصل الثالث:** أفرد للإجابة عن الإشكالية الرئيسية، والذي تم فيه القيام بدراسة تحليلية لمتغير سعر البترول وتأثيره على التجارة الخارجية في الجزائر خلال الفترة (1990-2020)، وذلك انطلاقا من دراسة تطورات سعر البترول، الصادرات وكذلك الواردات والميزان التجاري، وكذا التعريف بالطريقة المستخدمة في القياس –طريقة المربعات الصغرى العادية–، ثم تم تقدير النموذج واختبار جودته وصلاحيته، وكذلك عرض ومناقشة وتحليل النتائج المتحصل عليها.

الفصل الأول

الاطار النظري لأسعار البترول

تمهيد:

يعد البترول من أهم مصادر الطاقة العالمية ومورد رئيسي للثروة الاقتصادية في العالم المعاصر، مما أكسبه أهمية إستراتيجية وأعطاه قيمة عالية لدى كل دول العالم، حيث تأتت أهميته من خلال استعمالاته في كل المجالات الاقتصادية والاجتماعية، وهذا الأمر الذي جعله محل الاهتمام في تحديد أسعاره وطرق وضع هذه الأسعار، بالإضافة إلى مختلف العوامل المتحكمة في الأسعار، مما أدى إلى عدم استقرار السوق البترولية وثباتها، وظهور الأزمات البترولية على مر الأزمنة، ووفقا لما سبق ذكره تم تقسيم هذا الفصل كالتالي:

المبحث الأول: عموميات حول البترول.

المبحث الثاني: عموميات حول أسعار البترول.

المبحث الثالث، السوق العالمية للبترول ومخاطر الطفرات البترولية.

المبحث الأول: عموميات حول البترول.

بما أن الحضارة المعاصرة قائمة في مختلف جوانبها على البترول فإننا سنحاول عرض مفاهيم أساسية عن البترول وذلك من خلال التعريف بالبترول وذكر خصائصه ومميزاته وأنواعه المختلفة بالإضافة إلى أهميته في مختلف المجالات، وفق المطالب التالية.

المطلب الأول: مفهوم البترول وخصائصه ومميزاته

تميّز البترول بكونه سلعة استراتيجية حدّدت الخريطة العالمية المكونة من المنتجين والمستهلكين الذين تزايد اهتمامهم بتحديد أسعار هذه السلعة مع كثرة الأزمات البترولية وما خلفته من انعكاسات على مستوى الاقتصاد العالمي.

أولا: مفهوم البترول

اعتبر اكتشاف النفط كأحد أهم الاكتشافات التي توصل إليها الإنسان عبر الزمن، فهو مورد أساسي للطاقة، مورد اقتصادي وسلعة تجارية بامتياز، لهذا اختلفت الآراء حول تحديد مصطلح لهّ، وفيما يلي أهم التعاريفات له:

كلمة بترول هي " كلمة لاتينية تعني زيت الصخر، أي Petroleum، فكلمة Petr تعني صخر، في حين تشير Oleum إلى الزيت، وبجمع الشقين نتحصل على الكلمة المركبة والتي تعني زيت الصخر" (امينة، 2014، الصفحات 6-7)، فالبترول مادة كربونية من خصائصها الفيزيائية أنها مادة سائلة ذات طبيعة زيتية، كما أن للبترول رائحة خاصة وله ألوان تتراوح ما بين الأسود الفاتح إلى البني والأخضر، فضلا عن خاصية اللزوجة التي يتميز بها.

في نفس السياق يعرف البترول بأنه "ذلك السائل الكثيف الأخف من الماء، والذي يتركب من الفحم ويحرر عند احتراقه طاقة قابلة للاشتعال، يتراوح لونه بين البني الغامق والبني المخضر، ويوجد على أعماق مختلفة ضمن صخور مسامية(Alomar, 2019, p. 26) "

البترول خليط من المواد الهيدروكاربونية التي تتكون وتتجمع في باطن الأرض وتظل فيه إلى أن تخرج لسطح الأرض من تلقاء نفسها أي بفعل العوامل الطبيعية المختلفة (شقوق، كسور أرضية) أو بفعل الإنسان، وقد اختلف العلماء في أصل نشأة البترول، فمنهم من يرى أنه نشا نشأة أزلية أو طبيعية أي أنه نشأ بدون سبب يمكن أن يعرفه الإنسان كنتيجة للتفاعل الكيماوي الذي حدث في المواد غير العضوية التي يتكون منها (عبد المطلب، 2015، صفحة 15).

في هذا الإطار نستنتج أن البترول هو مادة سائلة لزجة، تتكون من مجموعة من المركبات الهيدروكاربونية، وله خصائص مختلفة وفريدة، فضلا عن تركيبات جزيئية متنوعة انعكست في تدرج ألوانه من البني الأخضر إلى الأسود الفاتح، كما انه مورد اقتصادي طبيعي فان، ذلك انه

يتمتع بمخزون أو احتياطي غير متجدد، ولا يترك بعد استعماله أي أمل في استخدامه مرة ثانية، وهذا ما يجعله مورد اقتصادي على قدر كبير من الأهمية.

ثانيا: خصائص البترول

يتميز البترول بالخصائص التالية (مديحة، 1998، الصفحات ص50-51):

1-تركيبه الكيميائي فريد، حيث أن الهيدروجين المدموج مع الكربون يعطيه خواص لا توجد في غيره من المواد، هذا الدمج تقدمه الطبيعة مجانا، وقد حاول الإنسان تقليد الطبيعة في هذا المجال لكن التكاليف الناتجة عن هذه المحاكاة كانت كبيرة جدا.

2-يؤدي ارتفاع نسبة الكبريت في الزيت الخام إلى تقليل جودة هذا الأخير وتخفيض سعره، لان احتراقه مع البنزين يؤدي إلى التلوث.

3-البترول مادة استراتيجية تتأثر بالعوامل الاقتصادية والسياسية، مما يضفي طبيعة دولية وأهمية خاصة على هذه السلعة.

4-يعتبر البترول ناميا ويتناقص بكثافة استعماله، كما ونشير في هذا الموضع بأن مشتقات البترول تبلغ حوالي 80.000 منتجا.

5-البترول هو المصدر الرئيسي للطاقة ويعتمد عليه معظم التطور التكنولوجي المعاصر، واغلب الفن الإنتاجي السائد.

6-يتوفر معظم البترول في الدول النامية، بينما يتوفر مصدر الطاقة البديل-الفحم- في الدول الصناعية المتقدمة.

7-يعتبر البترول احد الصناعات العملاقة التي تتضمن مخاطر عالية، ويحتاج إلى رؤوس أموال ضخمة، والتي تتميز بالضخامة في مختلف مراحلها.

ثالثا: مميزات البترول

إن خصائص السلعة البترولية يرتبط بطبيعتها وبكيفية استغلالها، مما يكسبها أهمية كبيرة تتمثل في تزايد منفعتها إلى جانب استمرارية تعاظم قدرتها التنافسية، وبصورة فاعلة ومؤثرة مع السلع البديلة، ومن ابرز مميزاتها (الدوري م.، 1983، صفحة 15):

1-الميزة التكنولوجية الفنية: ترتبط بمدى تطور أساليب ومعدات استغلال الثروة البترولية.

2-الميزة الإنتاجية: وهنا نقصد إنتاجية العمل العالية، حيث تتميز بارتفاع إنتاجيتها وتزايدها بصورة مستمرة وكبيرة مقارنة مع بقية السلع الأخرى، وخاصة السلع المنافسة والبديلة.

3-ميزة مرونة الحركة البترولية: حيث تتميز عن غيرها من السلع بمرونة حركتها وتنقلها من مراكز إنتاجها إلى مراكز ومناطق استعمالها واستهلاكها في أي منطقة من العالم.

4-ميزة الاستعمال الواسع وغير المحدود: حيث أن للبترول منافع متنوعة واستعمالات متزايدة، رغم سعة وتعدد تلك الاستعمالات.

المطلب الثاني: أنواع البترول:

نسجل الأنواع التالية من البترول(Chautard, 2008, p. 16) :

أولا-النفط الخفيف: يسجل كأحد أجود أنواع البترول، وهو النوع الذي تكون درجة كثافته النوعية عالية، تبدأ في الغالب من درجة 35^0 فما فوق مثل النفط الخام الجزائري، القطري وكذلك الليبي.

ثانيا-النفط الثقيل: يتميز بدرجة كثافة تفوق 28°، كما يتميز هذا النفط بتكاليف استخراجه المرتفعة، فضلا على أن المستخلصات منه-المشتقات-ثقيلة كالمازوت والإسفلت، من أمثلته النفط الخام المصري وكذلك السوري.

ثالثا-النفط المتوسط: درجة كثافته النوعية تتراوح بين 28° و35°، من أمثلته النفط الخام السعودي والكويتي، كما يمكن تقسيم هذا الأخير إلى حلو أو مر بحسب احتوائه على المادة الكبريتية. (زاير، 2004، الصفحات 12-13).

المطلب الثالث: أهمية البترول

أولا: أهمية البترول على الصعيد الاقتصادي

تكمن الأهمية الاقتصادية للبترول في ما يلي: (وحيد، 2013، صفحة 69):

1-النفط كمصدر رئيسي للطاقة: تشكل الطاقة بحسب رأي علماء الاقتصاد المستحدثين أمثال **ألدمان** و**فرانكل** عاملا جديدا من عوامل الإنتاج إلى جانب الأرض، العمل، رأس المال والتنظيم، فلا توجد فائدة من رأس المال دون عمل، وكذلك لا فائدة من الأول دون طاقة، بحيث تعتبر الطاقة البترولية الأوفر، كما أن تبعية المجتمع العصري حيال البترول أصبحت وثيقة واعتبر استهلاكه معيار للتقدم الاقتصادي، وذلك بسبب الارتباط شبه الكلي بين استهلاك البترول والتقدم التكنولوجي.

2-البترول مادة أساسية في الصناعة: حيث يعتبر هذا الأخير الوقود الأساسي لتشغيل الصناعة وتحريك الآلات في المصانع، لرصد هذه الأهمية في الوقت الراهن يكفي معرفة أن 80% من النفط في العالم يذهب لقطاع الصناعة، ومن هذا المنطلق يمكن القول أن العملية الصناعية لا تستطيع الاستمرار ر بشكل منتظم من دون نفط.

3-البترول مصدر للإيرادات المالية: تتجسد هذه الأهمية في اقتصاديات البلدان المنتجة وبالتالي المصدرة للبترول، والتي يعتمد اقتصادها بصفة رئيسية على البترول في الدخل الوطني والتراكم الرأسمالي، وفي تمويل برامج وخطط التنمية الاقتصادية وتحصيل الإيرادات المالية المختلفة، سواء كان بصورة مباشرة أو غير مباشرة، كالأرباح والضرائب أو الضرائب على الاستهلاك بالنسبة للدول المستهلكة.

4-البترول سلعة رئيسية للتبادل التجاري: حيث يعتبر هذا الأخير سلعة تجارية لها دور فعال في تنشيط وتطور عملية التبادل، سواء كان التبادل على نطاق دولي أو محلي، لان البترول ومشتقاته سلع يتم تداولها في كل دول العالم، حيث يكون السلعة الرئيسية في إيرادات الأقطار المنتجة والمصدر الأول في ميزان مدفوعاتها.

ثانيا: أهمية البترول على الصعيد الاجتماعي

يتمثل دور البترول على الصعيد الاجتماعي من خلال المظاهر الآتية:

1-دور البترول في قطاع المواصلات: يعتبر النفط بمثابة المحرك الرئيسي لعملية النقل الحديث، حيث استحوذ هذا الأخير على الحصة الأكبر في الاستهلاك العالمي للنفط في: السيارات، البواخر، والطائرات وغيرها من وسائل النقل تستعمل مشتقات النفط كطاقة ضرورية لعملها مثل: البنزين، المازوت، الديزل والكيروزين.

2-دور المشتقات البترولية في الحياة اليومية: تتنوع استعمالات المشتقات النفطية في الحياة اليومية مثل البلاستيك، المنظفات، المطاط الصناعي والأسمدة، وكما هو معلوم انه من غير الممكن الاستغناء على السلع السابقة، من حيث كونها تسهل الحياة اليومية (حمادي، 2009، الصفحات 8-9).

ثالثا: أهمية البترول على الصعيد السياسي

أصبح مادة إستراتيجية وسياسية، بقدر ما هو مادة اقتصادية تجارية، بهذا الصدد يمكننا الاستشهاد بقول الدكتور **محمد الرميحي** في كتابه النفط والعلاقات الدولية" مازال النفط كمادة خام حيوية للبشر يثير النقاش في الميادين السياسية أكثر مما يثيره في ميدان الاقتصاد، وتؤثر فيه العوامل السياسية بشكل اكبر وأوسع من العوامل الاقتصادية، فكمية الإنتاج النفطي وكذلك أسعاره هي قرارات سياسية بالدرجة الأولى، وليس لها علاقة بميكانيكية قواعد السوق الكلاسيكية المعروفة (وحيد، 2013، صفحة 75)".

رابعا: أهمية البترول على الصعيد العسكري

يعادل الطلب العالمي على النفط ذو الطبيعة العسكرية بحوالي 5% من الاستهلاك العالمي، ويزداد في حالة الحروب، ويضل الوقود النفاث مثل الكيروزيين أهم المشتقات النفطية التي يزداد عليها الطلب العسكري لاستعماله كمصدر لوقود مختلف آليات الحرب الميكانيكية،

كما أن من أبرز أسباب الحروب في العصر الحديث يتمثل في السيطرة على مناطق تواجد النفط (حمادي، 2009، صفحة 11).

المبحث الثاني: عموميات حول أسعار البترول.

يعتقد البعض أن تسعير النفط عملية سهلة بينما الأمر ليس كذلك، إذ أنها تخضع لعدد من المعايير والعمليات المعقدة بالإضافة للظروف الاقتصادية، فالسعر الذي يعلن يوميا في وسائل الإعلام هو للبيع الفوري في أسواق البيع ولا يعكس بالضرورة واقع البيع الفعلي للنفط المتعاقد عليه سلفا.

المطلب الأول: مفهوم سعر البترول

هناك عدة تعاريف لسعر البترول سنكتفي بالبعض منها فيما يلي:

السعر هو عبارة عن قيمة الشيء معبر عنه بالنقود، والسعر قد يكون اقل أو أكثر من الشيء المنتج أو قد يعادل قيمة الشيء المنتج، ومن خلال هذا التعريف للسعر فان السعر البترولي يعني قيمة المادة أو السلعة البترولية (عيسى، 2016).

سعر النفط يعني" قيمة المادة أو السلعة النفطية معبرا عنها بالنقود، حيث أن مقدار ومستوى أسعار النفط تخضع وتتأثر بصورة متباينة بالعوامل الاقتصادية والسياسية، أو طبيعة السوق السائدة سواء في عرضه أو طلبه أو الاثنين معا (مهدي، 2015، صفحة 8)".

سعر النفط الحقيقي أو ما يسمى بسعر النفط بالدولار ثابت القيمة، والذي يعبر عنه تطور السعر عبر فترة زمنية معينة بعد استبعاد ما طرأ عليه خلال تلك الفترة من عوامل التضخم النقدي أو التغير في معدل تبادل الدولار الذي يتخذ أساسا لتسعير النفط مع العملات الرئيسية الأخرى (بيطام، 2014-2015، صفحة 16).

وبالتالي نستنتج أن سعر البترول هو القيمة النقدية أو الصورة النقدية لوحدة واحدة من البترول الخام –البرميل– معبر عنه بالوحدة النقدية الأمريكية خلال فترة زمنية معينة[1].

المطلب الثاني: أنواع أسعار البترول.

لقد تعددت واختلفت أنواع أسعار النفط، سنقتصر على ذكر بعض أنواعها ذات العلاقة المباشرة بهذا البحث وهي:

1-السعر المعلن: أو كما تسمى "الأسعار المعلنة" وهي التي يقصد بها أسعار النفط المعلنة رسميا من قبل الشركات البترولية، حيث ظهر هذا السعر لأول مرة عام 1880 في الولايات المتحدة الأمريكية من قبل شركة **ستاندر أند وايل**[2]، أين تميزت الأسواق آنذاك بوجود عدد كبير

[1] البرميل وحدة قياسية أمريكية تستخدم في قياس حجم النفط الخام تبلغ كميتها 158.98 لترا أو 42 غالونا، هذا ويمكن لبرميل النفط متوسط النوعية أن ينتج: 51.6 %بنزين، 16.9%مازوت، 3.3%كيروزين، 3.3 وقود للسفن والمصانع ومحطات الكهرباء، 8.2%غازات مختلفة جافة وسائلة، 5%فحم كوك، 1.9%إسفلت، 0.9%زيوت تشحيم و1.4%منتجات أخرى.

[2] هي احد الشركات التي سميت " الشقيقات السبع" والتي أصبح اسمها مؤخرا اكسون.

من المنتجين، وهي الشركة الوحيدة التي سيطرت على عمليات إنتاج النفط (الدوري م.، محاضرات في الاقتصاد البترولي، 1983، صفحة 168).

2-السعر المتحقق: وهو عبارة عن السعر المتحقق لقاء تسهيلات أو حسومات متنوعة، ويتفق عليها الطرفان البائع والمشتري بنسبة مئوية كحسم من السعر المعلن أو تسهيلات في شروط الدفع، والسعر المتحقق هو فعلا عبارة عن السعر المعلن ناقص الحسومات والتسهيلات الممنوحة من طرف البائع للمشتري، وظهرت هذه الأسعار منذ أواخر الخمسينيات (قويدري ق.، انكاسات تقلب أسعار البترول على التوازنات الاقتصادية الكلية في الجزائر، 2009، صفحة 63).

3-سعر السوق الحقيقي: وهو سعر السوق الفعلي بالنسبة لكميات النفط الخام المباعة، والتي لا تدخل ضمن شبكة الكارتل الدولية، حيث يتم الاتفاق عليه بين طرفين يتمتعان باستقلال تام- عن الكارتل-ويقل هذا النوع من السعر عن السعر المعلن بنسبة تزداد كلما ازدادت المنافسة في عمليات البيع.

4-سعر الإشارة: هذا النوع من الأسعار ظهر في فترة الستينيات، واعتمد سعر الإشارة في احتساب سعر البترول بين بعض الدول البترولية المنتجة والشركات الأجنبية من اجل توزيع أو قسمة العوائد البترولية بين الطرفين. إن سعر الإشارة عبارة عن سعر البترول الخام والذي يقل عن السعر المعلن وكذلك يزيد عن السعر المتحقق، مع العلم أن هذا السعر أخذت به وطبقته العديد من الدول البترولية، مثل ما تم بين الجزائر وفرنسا عام 1965 (قويدري ق.، 2009، صفحة 63).

5-سعر الكلفة الضريبية: هو السعر المعادل لكلفة إنتاج البترول الخام مضافا إليه قيمة ضريبة الدخل والربح بصورة أساسية العائدة للدول البترولية المانحة لاتفاقيات استغلال الثروة البترولية، إذن فهذا السعر يعكس التكلفة الحقيقية التي تدفعها الشركات البترولية للحصول على برميل من البترول الخام، وهو في نفس الوقت يمثل الأساس الذي تتحرك فوقه الأسعار المتحققة في السوق، فالبيع بأقل من هذا السعر يعني البيع بالخسارة (الدوري م.، 1983، صفحة 198).

6-السعر الفوري أو الآني: هو سعر الوحدة البترولية المتبادلة آنيا في السوق البترولية الحرة، وهذا السعر يجسد قيمة السلعة البترولية نقدا في السوق الحرة للبترول المتبادل بين الأطراف المنتجة والمستهلكة وبصورة آنية.

المطلب الثالث: العوامل المحددة لأسعار البترول

يتأثر مستوى الأسعار المستخدمة في تجارة النفط بعدة عوامل تفصيلها كما يلي:

أولا: العوامل الاقتصادية

وهي عوامل ذات أثر مباشر وكبير، ويمكن تقسيمها لعوامل تؤثر على العرض النفطي وأخرى ذات اثر على الطلب منه، ومعروف أن أي تأثير على احد الجانبين السابقين يؤثر على السعر، واتجاه تأثيرها كما يلي:

1-العرض: يعتمد العرض لأنواع النفط الاعتيادية في العالم على الاحتياطات المثبتة وتطورها في الدول المنتجة المعروفة، واكتشاف المزيد من الاحتياطات النفطية في هذه الدول أو في مناطق أخرى من العالم، وكميات استخراج النفط من هذه الاحتياطات والطاقات الإنتاجية والتصديرية المتاحة وتطورها أيضا، وهناك عوامل لا تقل أهمية يأتي في مقدمتها:

1-المستوى الفني لأدوات الإنتاج: ومعروف أن هذا العامل يساعد على اكتشاف احتياطات نفطية جديدة تعمل على الرفع من المستوى العام للعرض البترولي، فضلا على أن المستوى التقني الذي تتميز به عوامل الإنتاج البترولي تزيد من مرونة العرض البترولي من حيث كونها تسهم في سرعة الكشف عن الحقول والمكامن البترولية.

2-السلع البديلة للنفط ومستوى أسعارها: جودة هذه الأخيرة وانخفاض أسعارها تساهم في توجيه جزء من الطلب العام على البترول نحوها، وهذا ما يدفع بسعر البترول نحو الانخفاض الناتج عن انخفاض الطلب، وبالتالي انخفاض العرض في محاولة المنتجين رفع السعر من جديد.

3-الحروب والأوضاع السياسية: كانت ولا تزال الأحداث السياسية احد العوامل المؤثرة في العرض البترولي العالمي، فخلال حروب وأزمات سياسية كبيرة خاصة في مناطق الإنتاج شهد العرض العالمي للنفط عدة اختلالات بالتزامن معها، فبدءا من سنة 1980 أصبح النفط سلاحا للهجوم بدل أن كان وسيلة للدفاع (شتيوي و شتيوي، 2016-2017، صفحة 51)، وخير دليل يؤكد وجهة النظر هذه هو أحداث غزو العراق وأفغانستان فضلا عن ملف إيران النووي وغيرها من القضايا.

2-الطلب: عموما يتحدد الطلب على البترول بعدة عوامل أهمها:

أ-النمو في الاقتصاد العالمي: تعتبر معدلات النمو الاقتصادي المحرك الرئيسي للطلب على البترول وبالتالي أهم عامل يؤثر على سعر هذه السلعة، في هذا الاطار يمكن أن نشير إلى العلاقة بين النمو الاقتصادي والطلب النفطي تكونت منذ سنة 1973، والتي كانت في حدود الواحد، أي لكل واحد بالمائة من النمو تتطلب كذلك واحد بالمائة من النمو في الاستهلاك (شباب، 2018-2019، صفحة 93).

ب-انخفاض سعر الدولار: من العوامل العديدة التي في كثير من الأحيان يكون لها أثر مباشر على ارتفاع أسعار النفط الانخفاض المستمر للدولار الأمريكي على مدى السنوات الخمس الماضية، ففي حين أن العلاقة بين أسعار النفط وقيمة الدولار معقدة ولا تخدم مصالح أطراف

السوق في معظم الأحيان، حيث نجد أن انخفاض قيمة الدولار ستؤدي إلى ارتفاع سعر النفط بالدولار والعكس بالعكس، فمنذ أن تم اعتماد تقويم النفط بالدولار الأمريكي يفترض أن انخفاض سعر الصرف الدولار سيخفض تسعير النفط في السوق ومن ثم سيزيد الطلب عليه، وفي حالة ترك السوق يتوازن وفقا للظروف الجديدة فان انخفاض الدولار مع ثبات العوامل الأخرى سيرفع سعر النفط بالدولار (بوفليح، 2011، صفحة 42).

ج-المضاربة في الأسواق الآجلة للنفط: لقد ساهمت الابتكارات المالية التي ظهرت في الآونة الأخيرة في أسواق السلع بالسماح للمستثمرين من الاستفادة من ارتفاع أسعار النفط دون الحاجة إلى الحيازة الفعلية للنفط على هيئة مخزون، وهو ما برز واضحا في كثافة نشاط المضاربة، والتي تعني شراء النفط بغرض إعادة بيعه بسعر أعلى بدل من استخدامه لأغراض تجارية في الأوراق الآجلة للنفط، وقد أصبح المتداول من العقود النفطية مما يعرف بالبراميل الورقية اكبر من المعروض من الشحنات النفطية الحقيقية، مما أدى إلى خلق **طلب وهمي** على البراميل الورقية للنفط وتزايدت حدة الهلع في الأسواق نتيجة الارتفاع المتواصل للأسعار، مما دفع مستخدمي النفط الفعليين من مستهلكين ومصافي التكرير إلى التحوط من الارتفاع المستمر للأسعار عن طريق دعم بناء مخزوناتهم النفطية، مما تسبب في زيادة متزامنة **للطلب** والمخزون للضغط على الأسعار صعودا.

د-نوعية الخام: يوجد نوعين من رئيسيين من زيت النفط يعرفان تجاريا بالزيت الخفيف **light oil** والزيت الثقيل **Heavy oil**، ويعتمد هذا التصنيف على كثافة النفط، وترجع خاصية اختلاف كثافة النفط إلى نسبة الهيدروكربونات الثقيلة فيه، فكلما زادت هذه النسبة زادت كثافة النفط، وفي الحقيقة أن النفط الخفيف أكثر طلبا في السوق وأعلى سعرا وذلك بسبب إمكانية الحصول منه على كميات كبيرة من المشتقات البترولية، وبالذات السولار والبنزين، وهما المشتقان البتروليان الأكثر طلبا في العالم، مع العلم انه يوجد تصنيف آخر للنفط يعتمد على نسبة الكبريت، فإذا كانت النسبة منخفضة يعرف باسم النفط الحلو **Sweet Oil**، أما إذا زادت نسبة الكبريت فيصنف النفط على انه حامض **Sour Oil**، وبالطبع فان الأول هو الأكثر طلبا في السوق (الخياط، اسعار النفط....الصعود والمؤشرات، 2008، صفحة 04).

هـ-التغيرات المناخية: تؤدي الكوارث الطبيعية مثل الأعاصير، الزلازل والبراكين إلى تعطيل البنية التحتية لإنتاج النفط وتكريره وحتى نقله (الخياط، 2009، صفحة 04)، وهذا ما يدفع بالمستهلكين العالميين إلى التحوط من هذه الأحداث من خلال زيادة طلبهم على البترول، كما يلاحظ أن الطلب العالمي على النفط ومشتقاته يزداد عندما تنخفض درجة الحرارة في الشتاء، حيث يزداد استخدام جميع مصادر الطاقة والنفط من أبرزها، وبالتالي فزيادة الطلب العالمي على النفط تؤدي إلى ارتفاع الأسعار، والعكس في حالة ارتفاع درجة الحرارة.

ثانيا: التنظيمات الدولية

منذ اكتشاف للنفط سنة 1859 أعطيت له أهمية كبيرة، وهذا على اعتبار أنه أجود أنواع الطاقة، وبالتزامن مع ذلك أسست مجموعة من المنظمات هدفها الحفاظ على البترول من الاستخدام غير العقلاني فضلا عن تنظيمه وتسويقه في السوق العالمية، من بين أهمها والتي لها تأثير في أسعار النفط نجد:

1-منظمة الدول المصدرة للنفط: والتي يشار لها اختصارا **بمنظمة أوبك**، انشات هذه الأخيرة نتيجة وجود بعض الشركات المتعددة الجنسيات والدول المنتجة على شكل تنظيم مشابه للكارتل التي تسيطر على أسعار النفط وتتحكم فيها، إذ كانت هي السبب الرئيسي في انخفاض الأسعار في معظم الأحيان، مما الحق ضررا بالغا باقتصاديات الدول المنتجة والمصدرة، وبناءا على مبادرة فنزويلا سنة 1960 عقد اجتماع في بغداد بين 10-14 من شهر ديسمبر ضم ممثلي: إيران، العراق، الكويت، المملكة العربية السعودية وفنزويلا، وتقرر من هذا الاجتماع التاريخي إنشاء **أوبك**، فالهدف الأول لهذه المنظمة كان الإبقاء على أسعار النفط الذي يستغله الكارتل الدولي خارج حدودها في مستوى مرتفع، وحماية مصالح الدول المنتجة من خلال ضمان دخل ثابت لها، فضلا عن تامين تصديرها إلى الدول المستهلكة بطريقة اقتصادية منتظمة، وكذلك ضمان فوائد مناسبة لرؤوس أموال الشركات المستثمرة في صناعة النفط، وتنسيق الجهود التي تبذلها البلدان المنتجة لانتزاع حصة اكبر من الأرباح الناتجة عن استغلال ثرواتها الخاصة.

2-الوكالة الدولية للطاقة: هي هيئة مستقلة تأسست في نوفمبر عام 1974، أما الظروف التي سبقت إنشاء الوكالة فكانت أزمنة السويس عام 1956 وكذلك الارتفاع الكبير الذي شهدته أسعار النفط بين عامي 1973و1974، أين وجه رئيس الولايات المتحدة الأمريكية **نيكسون** دعوة إلى حكومات الدول الصناعية الكبرى المستوردة للبترول لحضور اجتماع واشنطن، بهدف توحيد وتنسيق جهود هذه الأخيرة فيما تعلق باستيراد واستهلاك النفط، وكذلك لبذل جهود إضافية وتنسيقها فيما تعلق بالبحث وتنمية مصادر الطاقة البديلة في إطار منظمة التعاون والتنمية الاقتصادية (سيد احمد، 1982، صفحة 75).

ثالثا: العوامل الجيوسياسية والأزمات النفطية العالمية

لقد تعرض سعر النفط في السوق النفطية العالمية من بداية السبعينات إلى غاية يومنا هذا إلى مجموعة من الصدمات النفطية وذلك خلال السنوات 1973، 1979، 1986، 1990-1991، 1998، 2004-2008، 2014، 2020 كما يلي (بن بوزيان و لخديمي، 2013، الصفحات 201-202):

1-**الأزمة النفطية عام 1973:** لقد أطلق على هذه الأزمة اسم **تصحيح الأسعار البترولية**، أين تم تقييم البرميل بقيمته الحقيقية والتي كانت متدنية إلى مستويات قياسية، حيث في هذه السنة

قررت المنظمة زيادة أسعار النفط من جانب واحد لتقفز من 3 دولار الى12 دولار للبرميل الواحد، أي رفع الأسعار النفطية بنسبة 400%.

2- **الأزمة النفطية عام 1979:** عادت وارتفعت الأسعار ثانية وبشكل مفاجئ سنة 1979 ثلاث مرات على اثر الحرب العراقية الإيرانية (حرب الخليج الأولى) من 3دولار إلى 32 دولار للبرميل الواحد خلال أشهر قليلة مما أدى إلى انفجار أزمة نفطية ثانية.

3-**الأزمة النفطية عام 1986:** في الأسبوع الأخير من الشهر الثاني عام 1986 انخفض سعر النفط بشدة، إذ انخفض سعر نفط بحر الشمال إلى 17.70 دولار للبرميل وباقتراب فصل الربيع انطلقت حرب أسعار شاملة بعد أن توقفت فترة من الزمن، وانخفضت أسعار النفط إلى اقل من 13 دولار للبرميل.

4-الأزمة النفطية 1990-1991: تعرضت السوق النفطية العالمية في بداية التسعينيات لازمة حادة تمثلت في حرب الخليج الثانية، والتي ارتفعت على إثرها الأسعار في الأشهر الأولى للحرب حتى بلغت سقف 40 دولار للبرميل (بوشول، 2005، صفحة 5).

5-الأزمة النفطية عام 1998: في نهاية التسعينيات وبالضبط سنة 1998 تعرضت السوق النفطية العالمية لهزة ثانية أدت إلى اختلال كبير في العرض والطلب، فتدهورت أسعار النفط إلى أدنى مستوى لها بما يقل عن 10 دولار للبرميل في ديسمبر من نفس السنة.

6-الأزمة النفطية ابتداء من 2004: عرف العالم صدمة بترولية أخرى بدأت منذ سنة 2004، حيث ارتفعت الأسعار ووصلت إلى 51 دولار للبرميل، وبقيت في ارتفاع مستمر حتى وصل السعر سنة 2008 إلى 92.7 دولار للبرميل خلال الربع الأول، ثم 113.5 دولار للبرميل خلال الربع الثالث، ليهوى السعر لحدود 52.5 دولار للبرميل الواحد خلال الربع الرابع، ولعل السبب الرئيسي في ذلك يعود إلى تفاقم الأزمة المالية العالمية والانهيارات المتلاحقة لأسواق المال والمؤسسات المصرفية (محفوظ، 2017، صفحة 4).

7-الصدمة النفطية 2014: كان للمخاوف بشأن تباطؤ وتيرة نمو الاقتصاد العالمي، ووفرة الإمدادات وتباطؤ نمو الطلب على النفط في الصين دورا رئيسيا في استمرار تراجع أسعار النفط، فشهدت أسعار سلة أوبك انخفاضا لأكثر من النصف منذ أواسط عام 2014 وحتى بداية 2015، فقد انخفض سعر البرميل الواحد من 105.4 دولار في جوان 2014 إلى 44.4 دولار في جانفي عام 2015، وهو يمثل أكبر انخفاض تشهده الأسعار منذ انهيارها عام 2008، وواصلت الأسعار انخفاضها نهاية سنة 2015، حيث وصل سعر النفط إلى 29 دولار في ديسمبر 2015، حيث كان لزيادة مخزونات النفط العام في الولايات المتحدة وارتفاع الدولار مدعوما بتوقعات تحسن الاقتصاد الأمريكي دورا في حدوث هذا التراجع (منظمة الاقطار العربية المصدرة للبترول، 2015).

8-الأزمة النفطية سنة 2020: في نهاية سنة 2019 وبالضبط في شهر نوفمبر انتشر وباء خطير عرف بكوفيد 19 في مدينة ووهان الصينية، وبسرعة تفشى ليصل إلى مناطق واسعة في الصين مما جعل الحكومة الصينية تباشر باتخاذ خطوات صارمة لاحتواء الوباء ومنع انتشاره، كإغلاق المدن والمنشات والمصانع ومنع حركة السير وغيرها من الإجراءات، ونتيجة لذلك توقع خبراء استهلاك النفط انخفاض بواقع 25%، لكن الأمر لم يتوقف عند هذا الحد، فقد تطور الأمر بسرعة ليصبح عالميا وذلك مع إعلان منظمة الصحة العالمية في 30 جانفي 2020 قرارها بأنه وباء خطير، مما جعل دول العالم تحذو حذو الصين في سياسات محاربة هذا الوباء الخطير، وهذا ما انعكس على الاقتصاديات العالمية من جهة، وعلى المحرك الرئيسي لها " النفط" من جهة أخرى، ليستيقظ العالم بعد هذا الإعلان على زلزال اقتصادي، حيث انهارت أسعار النفط بصورة لم يسبق تسجيلها من قبل مطلقا في تاريخنا الحديث، فقد تراجعت الأسعار خلال دقائق معدودة بأكثر من 30%، وذلك بعد عدة أيام من الخسائر المتواصلة التي أدت به إلى أن يهوي إلى مستويات لم نعرفها منذ سنوات، ما حدث في الأسواق يشكل انهيارا وليس هبوطا عاديا أو منطقيا وإنما انهيار بكل معنى الكلمة، إذ لا توجد سلعة تفقد ثلث قيمتها خلال دقائق معدودة (المركز العربي للابحاث ودراسة السياسات، افريل2020، الصفحات 2-3).

المبحث الثالث: السوق العالمية للبترول ومخاطر الطفرات النفطية

يجرى التعامل في اطر التجارة لمختلف السلع والخدمات في أماكن أو وفق طرق محددة، فلكل نوع من السلع والخدمات سوق يتم التعامل فيها بهذه السلع والخدمات، ومن بينها السوق البترولية التي ستكون محل دراستنا من خلال التطرق إلى تحديد: مفهومها وخصائصها، وأنواع السوق البترولية، وطرق التسعير في هذه الأسواق، وكذا مخاطر الطفرات البترولية، وذلك وفق المطالب التالية:

المطلب الأول: مفهوم السوق البترولية وخصائصها.

أولا: مفهوم السوق البترولية

تعرف السوق البترولية على أنها" السوق التي يتم فيها التعامل بمصدر مهم من مصادر الطاقة وهو البترول، يحرك هذه السوق العرض والطلب مع بعض التحفظات بالإضافة إلى العوامل الاقتصادية التي تحكم السوق، هناك عوامل أخرى كالعوامل السياسية والعسكرية والمناخية وتضارب المصالح بين المستهلكين والمنتجين والشركات البترولية" (قويدري ق.، 2008، صفحة 45).

كما تعرف الأسواق النفطية-البورصات-، وهو ما يعقد اتفاقيات ثنائية بين الدول المنتجة مع الدول الراغبة في الاستيراد، ويتم تحديد الأسعار وفقا لقوى العرض والطلب والزمن أو التاريخ

الذي ستنفذ فيه هذه التعاقدات، ومن المعروف أن كبرى أسواق النفط في العالم توجد في بريطانيا وتعرف ببورصة البترول العالمية (حمادي، 2008، صفحة 52).

أيضا يمكن تعريف السوق النفطية بأنها" المكان الوهمي مكانيا أو جغرافيا لحدوث عملية تبادل السلعة النفطية، خاصة الخام منها بين الأطراف المتبادلة" (الدوري م.، محاضرات في الاقتصاد البترولي، 1983، صفحة 142).

نستنتج أن السوق النفطية تشير إلى الفضاء أين يتم فيه التعامل بأهم مورد للطاقة ممثل في البترول الخام، طبعا طبقا لقواعد العرض والطلب.

ثانيا: خصائص السوق النفطية

تتميز السوق البترولية بثلاث خصائص هي (الموسوي، 2005، صفحة 29):

1-سوق احتكار القلة: يحتكر السوق البترولية عدد قليل من الشركات-منافسة القلة-، وهو نوع من الاحتكار الجزئي حيث تعمل هذه القلة من الشركات على التركيز على عدد قليل من المشروعات الضخمة تؤثر بصورة مباشرة على العرض الكلي.

2-الاتجاه نحو التكامل الرأسي: حيث أن منتجي القلة يتحكمون في إنتاج البترول ونقله تكريره وتسويقه، فان هذه العمليات يربطها نوع من التكامل الراسي من بداية استخراج البترول الخام إلى نهاية مظهره على شكل مشتقات مختلفة.

3-الاتجاه نحو التكتل: تدل حركة الشركات في السوق البترولية على الاتفاقات المسبقة فيما بينها على الخطوات التي تتبعها كل منها حتى وصول سلعة البترول ومشتقاتها إلى الأسواق، مما يجعلها تتجه نحو التكامل الكامل.

4-عدم مرونة الطلب في الأجل القصير: يتميز الطلب في الأجل القصير بعدم مرونته في الأجل القصير، فالصناعات المبنية على أساس استخدام النفط لا يمكنها التحول عنه لمصدر آخر بسبب ارتفاع أسعاره، ذلك لان هذه العملية تتطلب بعض الوقت للتحول إلى مصادر الطاقة البديلة.

5-تأثر السوق بالأسواق ذات الصلة الوثيقة: تتأثر السوق النفطية العالمية بصورة مباشرة بسوق الناقلات وتكاليف الشحن، والتي تتأثر بتقلبات الطلب العالمي على النفط (مخلفي، 2014، صفحة 55).

المطلب الثاني: أنواع الأسواق البترولية وطرق التسعير

أولا-أنواع الأسواق البترولية

يوجد نوعين مختلفين هما:

1- السوق الفورية: يطلق مصطلح السوق الفوري على مجمل الصفقات الفورية التي تمت في منطقة يتمركز فيها نشاط هام للتجارة على منتج أو عدة منتجات، تتمركز هذه الأسواق في مناطق جغرافية معينة تتميز هذه المناطق بمميزات معينة كقرب البائع من المشتري وتمتاز بتعامل بترولي مكثف، كما ينشط بها إضافة إلى المنتجين والمستهلكين نوعان من المتعاملين هما التجار والسماسرة، أما فيما يخص التعاملات فان المشتري الذي يريد شحنة من الخام متوفرة في شهر يتصل بمختلف منتجي المنطقة ويتفاوض معهم بواسطة الهاتف ثم يتم التأكد عن طريق الفاكس في إطار الاتفاقيات العامة ما بين المتعاملين، ويكون الدفع بعد شهر غالبا من عملية الشحن، بينما تقل الآجال بالنسبة للمنتجات البترولية وعليه فالسوق الفورية ليست بمكان مادي معين.

2- الأسواق المستقبلية: عرف عن هذا النوع من الأسواق في مجال السلع التي يخضع عرضها لتقلبات يصعب التنبؤ بها مثل المنتجات الزراعية التي تتأثر بعامل المناخ، مثلا فيحقق مثل هذا النوع من الأسواق لمن يشتري هذه السلعة يعقد أجال للتحوط ضد مخاطر تغير السعر في المستقبل، ومن هذا المنطق وضع المنظمون في حقل البترول سوق الأسعار الثابتة بتسليم مؤجل، وهو ما يعرف بالأسواق البترولية الآجلة، ويمكن أن نميز نوعين من الأسواق الآجلة هما:

ا-**الأسواق النفطية المادية الآجلة:** موازاة مع الأسواق الفورية التي تخص الشحنات متوفرة خلال فترة 15 يوم، تطورت المبيعات إلى تسليمات بعيدة الأمد تدعى بالأسواق البترولية الآجلة، تعمل بالتدقيق كالأسواق الفورية لكن بآجال أطول ومع بعض العمليات ذات النمط الموحد.

ب_السوق البترولية المالية الآجلة: وهي عبارة عن السوق المالية (البورصة)، وهذا معناه

أن المعاملات لا تتم فقط على بضاعة عينية ولكن أيضا بواسطة أوراق مالية، وهذا معناه انه في هذه السوق يتم بيع وشراء البترول الخام والمنتجات البترولية عن طريق التزامات وتعتبر هذه السوق مكملة للسوق المالية، واهم هذه الأسواق نجد:

*سوق نيويورك للتبادل التجاري.

*سوق المبادلات العالمية في انجلترا.

*سوق سنغافورة للتبادل النقدي العالمي.

ثانيا: طرق التسعير للبترول.

لقد شكلت سنة 1973 نقطة تحول في عملية تسعير النفط، بحيث نجد السنة السابقة تزامنت مع عملية التصحيح السعري للنفط، لهذا ارتأينا تناول عملية ممارسة تسعير البترول قبل عملية التصحيح السعري لسنة 1973 وبعده.

1- تسعير النفط قبل سنة 1973: إن الشركات البترولية العالمية الكبرى اعتبرت في هذه المرحلة محتكرة للصناعة النفطية، وهذا بسبب انفرادها بعملية التسعير، هذا السبب الأخير اعتبر أهم أسباب استمرارها ورخائها، هذه العملية التي يمكن تقسيمها إلى ثلاث مراحل فرعية (عفيفي ص.، 2003، صفحة 248):

***التسعير حسب نظام نقطة الأساس الوحيدة:** لان الولايات المتحدة الأمريكية في هذه المرحلة كانت تعتبر اكبر منتج للبترول في العالم، كانت أسعار النفط تتأثر بنواياها، لهذا كانت أسعار هذا الأخير تتحدد استنادا للأسعار المعمول بها في خليج المكسيك، فكانت أسعار الخليج السابق الأساس الوحيد المعتمد في تسعير النفط.

***التسعير حسب نظام نقطتي الأساس:** على اثر تنبه البحرية البريطانية خلال الحرب العالمية الثانية إلى الارتفاع غير المبرر في أسعار النفط المورد إليها، تدخلت حكومتها من خلال ممارسة ضغط منقطع النظير على الشركات البترولية، هذه الأخيرة لم تجد مفرا من الاعتراف بمنظمة الخليج العربي كنقطة أساس ثانية لتسعير النفط، وهذا ما أدى إلى سقوط نظام التسعير السابق وحل محله نظام نقطتي الأساس.

***التسعير وفق مشاركة الدول المنتجة في تحديد الأسعار:** كانت الاتجاهات الوطنية وتزايد الوعي البترولي بالدول المنتجة، فضلا عن ضغط الرأي العام بها على الحكومات أهم العوامل التي حسنت من شروط التعامل بالبترول وخاصة الأسعار، وكانت التخفيضات البترولية من جانب الشركات سنة 1959 و1960 من أهم الدوافع التي عززت موقف الحكومات المنتجة لاتخاذ موقف موحد نتج عنه إنشاء منظمة الدول المنتجة للبترول "**أوبك**".

2- تسعير البترول بعد سنة 1973: قبل السنة السابقة كانت سوق البترول تحتكرها قلة، وبالتالي لم تكن تخضع لعوامل الطلب والعرض، وفي ظل هذا الوضع كان سعر البترول يفتقد لمعناه الاقتصادي، فضلا أن أسعار البترول لم تعكس حقوق الدول التي تمتلك البترول، لكنها عكست سيطرة شركات البترول (يونس، 1986، صفحة 4).

المطلب الثالث: مخاطر الطفرات النفطية.

إن الارتفاع السريع والمبالغ فيه في أسعار النفط في الأسواق الدولية في فترة قصيرة ثم يعاود الرجوع إلى سعره الحقيقي يسمى **بالطفرة النفطية**، فهذه الطفرة تحقق مداخيل كبيرة ووفرة هائلة للسيولة للدول المصدرة للنفط، وفي حالة لم تحسن هذه الدول استغلال الفائض فان هذه النعمة تتحول إلى نقمة على اقتصاديات الدول المصدرة، وهنا سنتطرق إلى تأثيرها السلبي على النظام المالي والمصرفي، وتكمن سلبيات الارتفاع المفاجئ في أسعار النفط في:

أولا: المرض الهولندي

تعد نظرية المرض الهولندي من ابرز النظريات الاقتصادية في تفسير اقتصاديات الدول الغنية بالموارد الطبيعية، وهو مصطلح وضعه علماء اقتصاد هولندا عقب اكتشاف الغاز الطبيعي في بحر الشمال حيث واجهت هولندا ارتفاع سعر الصرف الحقيقي للعملة المحلية، مما أدى إلى انخفاض القدرة التنافسية للسلع المنتجة محليا، الأمر الذي أدى إلى تلاشي نشاط الإنتاج الصناعي في هولندا وهذا ما يعرف بظاهرة اللاتصنيع.

وتتجلى نظرية المرض الهولندي في أن طفرة الموارد الطبيعية تدفع حركة الموارد من القطاع التقليدي في الدولة إلى قطاعي الموارد الطبيعية الخام والخدمات، الشيء الذي يؤدي إلى تدهور القطاع الإنتاجي أي الحقيقي للدول التي تهدف إلى تحقيق التنمية في الأجل الطويل بالتدرج.

ثانيا: تتوفر لدى البنوك أو الاقتصاد المحلي للدول المصدرة وفرة كبيرة في السيولة

وهذا ما يجعل الأفراد أو المؤسسات في غنى عن الاقتراض من البنوك فيزيد الإيداع ويقل القرض وكنتيجة حتمية لقلة المقترضين والمنافسة الشديدة تقدم البنوك القروض لكل من يريد الحصول على الأموال وتخفيض معايير الإقراض، كما انه في ظل وفرة السيولة يصعب التمييز بين المقترض الجيد والمقترض السيئ، وعند الارتداد العكسي لأسعار النفط –انخفاض الأسعار وشح السيولة–يبدأ المودعين بسحب مدخراتهم من البنوك مما يفرض عليها تسييل أصولها، وهنا تجد البنوك نفسها عاجزة عن تسديد المودعين، وهذا ما يؤدي إلى إفلاس البنوك فينهار النظام المالي بأكمله.

ثالثا: تأثيرها على الأفراد

أما من ناحية الأفراد فان توفر السيولة في الاقتصاد يؤدي إلى توفر الدخل لدى الأفراد والعائلات بشكل معتبر مما يحسن من جدارتهم الائتمانية أمام المصارف، وهذا ما يؤهلهم الحصول على القروض سواء عقارية أو استهلاكية، وهو ما يعتبر خطأ استراتيجي فادح من وجهين: الوجه الأول أن انخفاض أسعار النفط يؤدي إلى انخفاض في الدخل بصفة عامة، الذي يؤدي إلى عجز المقترضين عن السداد، هذا في ظل نظام أجور وسوق عمل مرن، أما إذا كان سوق العمل ونظام الأجور يتميز بعدم المرونة، فان انخفاض الأسعار يؤدي إلى الضغط على الميزانية العامة للدول، والتي تلجأ بدورها إلى الرفع من نسبة الضرائب والرسوم، وكما هو معروف فان هذا الإجراء الأخير من شأنه إضعاف قدرة هذه الشريحة على السداد، مع العلم أن الأمر يزداد سوءا إذا كانت مدة الطفرة النفطية تقل عن مدة الطفرة السابقة.

رابعا: تأثيرها على السوق ما بين البنوك

في هذا الإطار نجد أن البنوك الناجحة والتي تتميز بالحجم الكبير بحاجة إلى سيولة كبيرة، هذه الأخيرة تتوفر في السوق فيما بين المصارف، ولان المصارف الصغيرة هي التي

تتوفر على السيولة السابقة والتي تمتنع عن منحها للبنوك المنافسة، فالنتيجة هي توقف القلب النابض للنظام المالي عن العمل، وبالتالي تنهار البنوك الكبرى وبالتبعية انهيار مختلف أنواع البنوك، وهذا ما يعرف **بمعضلة الانهيار الشامل**، وهنا يظهر دور البنك المركزي بضخ السيولة إلى البنوك المحتاجة بمختلف الطرق.

خامسا: انخفاض تقييم البنوك للقروض

فوفرة السيولة بسبب الثروة النفطية تجعل النظام المالي بأقسامه هشا ومتواكلا على الحكومة، وتظهر هذه الحالة بوضوح في حالة الاقتصاديات أين تكون البنوك مملوكة للدولة كحالة الجزائر، التي نجد البنوك بها في ظل غياب الحافز، وأيضا في حالة غياب الانضباط السوقي فضلا عن الرقابة والعقوبات، فان هذا كله يقود إلى التوسع غير الصحي في منح القروض، ذلك أن التقييم لديها لهذه الأخيرة وتحمل تكاليف الرقابة عليها يقل، على أساس أنها تعلم انه في حالة تعرضها لمشاكل مالية فان الحكومة ستكفل عملية رسملتها دوريا، وستمدها بالسيولة اللامشروطة على اعتبار أنها تمثل الكيان المالي للدولة، وبالتالي فان نتيجة هذا الوضع في حالة انخفاض أسعار النفط وشح السيولة نجد هذا النوع من الحكومات الذي يتوفر على نظام مالي هش غير قادر على تحمل الصدمات المالية وغير قادر على العمل الحر خارج عن تدعيم الحكومة، وهو ما يؤدي حتما إلى انهيار مالي.

سادسا: التعرض المفرط للتضخم المستورد

وهو النوع من أنواع التضخم الذي تعاني منه الاقتصاديات التي تعتمد بشكل شبه كلي في عملية تحقيق إيراداتها، مثل حالة الجزائر التي تعتمد على الخارج في سد مختلف حاجياتها سواء الاستهلاكية أو الاستثمارية، وهو ما يعني انه في حالة ارتفاع أسعار البترول فان معدلات التضخم في الدول المصدرة ترتفع بالتبعية، لهذا فان الدول المصدرة تصبح تصدر التضخم كما تصدر السلع، وهو ما يعني بالتبعية ارتفاع سلة التضخم المحلي.

سابعا: حرمان البنوك من استغلال أسعار الفائدة المحلية

يتم التعامل بالنفط في الأسواق الدولية بالدولار، وهذا ما يعني أن الدول المصدرة ستربط عملاتها هي الأخرى بالدولار، فنجد أن الولايات المتحدة الأمريكية عندما يبدأ اقتصادها بالتباطؤ يجعلها تعمل على تسهيل السياسة النقدية وبالتالي خفض أسعار الفائدة، وهو الإجراء نفسه الذي تنتهجه الدول المصدرة للنفط، يعني تخفض أسعار الفائدة لكن بنسبة اقل من نسبة التضخم التي كانت مرتفعة، الأمر الذي يشجع الطلب على الائتمان، وهذا ما يحقق خسارة لبنوك هذه الدول ذلك أن سعر الفائدة اكبر من معدل التضخم، وهذا ما يخلق نظام مصرفي غير متوازن، فالبنوك بين خيارين: التوقف عن الإقراض وهذا ليس من مصلحتها، أو الإقراض مرفوق بتحقيق خسائر، وكلا الخيارين لا يحققان مصالح البنوك (هوام، 2015-2016، الصفحات 23-25).

خلاصة الفصل:

من خلال ما تطرقنا إليه في هذا الفصل يمكننا القول بأن البترول سلعة استراتيجية، ذات خصائص فريدة تجعلها ذات قدرة تنافسية بصورة فاعلة، حيث يتم تحديد أسعارها بناءا على عوامل عديدة، فمنها العوامل الاقتصادية المتمثلة في: العرض والذي بدوره يتأثر بالمستوى الفني لأدوات الانتاج، جودة السلع البديلة للنفط ومستوى أسعارها، والحروب والأوضاع السياسية، بالإضافة إلى الطلب الذي يتحدد عموما من خلال النمو الاقتصادي، انخفاض سعر الدولار، المضاربة في الأسواق الآجلة للنفط، ونوعية الخام، وكذا التغيرات المناخية، كما تلعب التنظيمات الدولية المتمثلة في منظمة الأوبك والوكالة الدولية للطاقة دورا في تحديد أسعار البترول، وكل هذا يتم في فضاء خاص يدعى بالسوق البترولية على اختلاف نوعيها الفورية والمستقبلية، أين يتم تسعير البترول بطرق عديدة، فقد تتعرض هذه الأسعار إلى الارتفاع السريع والعودة إلى مستواها الحقيقي تحت اسم" الطفرة البترولية"، التي تحمل في طياتها مخاطر كثيرة في حالة عدم استغلال هذا الفائض لصالح الدولة المصدرة.

الاطار النظري للتجارة الخارجية

تمهيد:

في القديم كانت المجتمعات تعيش في ظل اقتصاد مغلق، حيث كانت تجارتها على شكل مقايضة داخل البلد الواحد، ومع التطور ازدادت الحاجات بتنوع سلوك السكان الاستهلاكي وتنوع رغباتهم، الأمر الذي أدى إلى ضرورة الانتقال من الوضع الحالي إلى اقتصاد مفتوح وذلك من خلال فتح الأسواق على العالم الخارجي، أي بداية ظهور التجارة الخارجية.

إن للتجارة الخارجية دور لا يستهان به في بناء العلاقات الدولية ولا يمكن لأي مجتمع تحقيق ذلك بدون تعاون دولي، لذلك نجد أن التجارة الخارجية تقوم على مبدأ المشاركة الذي هو بمثابة الركيزة الأساسية للسياسة الخارجية لأي دولة.

إن العلاقات الاقتصادية الدولية هي المحرك الأساسي والرئيسي كونها تحتل أهمية بالغة على مستوى كافة دول العالم، فبتلك العلاقات يتحدد مستوى القيمة الاقتصادية التي يظهر أثرها على الجوانب الاجتماعية، الثقافية والسياسية، بالتالي فالتجارة الدولية هي العمود الفقري للعلاقات الاقتصادية الدولية، فهي الشيء القيم والأكثر تطورا لهذه العلاقات، وكنتيجة لما سبق سنتناول في هذا الفصل الجانب النظري للتجارة الخارجية وفق المباحث الثلاثة التالية:

المبحث الأول: عموميات حول التجارة الخارجية.

المبحث الثاني: نظريات التجارة الخارجية.

المبحث الثالث: مؤشرات التجارة الخارجية.

المبحث الأول: عموميات حول التجارة الخارجية.

تعد التجارة الدولية من القطاعات الأساسية والحيوية لكل البلدان سواء النامية منها أو المتقدمة، حيث تمثل همزة وصل بين المجتمعات والدول، ويعد التبادل التجاري محور العلاقات الاقتصادية بين الدول والذي لا يمكن الاستغناء عنه، فلا يمكن لأي قطر من الأقطار أن يعيش بمعزل عن بقية العالم

المطلب الأول: مفهوم التجارة الخارجية.

لقد شهد مصطلح التجارة الخارجية عدة تعاريف نذكر منها:

المعاملات التجارية الدولية في صورها الثلاثة المتمثلة في انتقال السلع والأفراد ورؤوس الأموال، تنشا بين أفراد يقيمون في وحدات سياسية مختلفة أو بين حكومات ومنظمات اقتصادية تقطن وحدات سياسية مختلفة (رشاد و واخرون، 2000، صفحة 12).

عملية التبادل التجاري في السلع والخدمات وغيرها من عناصر الإنتاج المختلفة بين عدة دول، بهدف تحقيق منافع متبادلة لأطراف التبادل (حمدي، 1996، صفحة 8).

يعني اصطلاح التجارة الخارجية كل من الصادرات والواردات المنظورة وغير المنظورة، بينما أطلق مفهوم التجارة الدولية للدلالة على الخارجية بالمعنى الواسع (حاتم، 2005، صفحة 88).

هي ذلك النوع من التجارة الذي يشمل كافة الصادرات والواردات السلعية والخدمية المتداولة بين الدول المختلفة وفقا لقواعد محددة وبعملات قابلة للتحويل (قابل، 2010، صفحة 17).

وعليه نستنتج أن التجارة الدولية أو الخارجية هما وجهان لعملة واحدة، يشيران إلى عملية التبادل بالسلع فضلا عن الخدمات، هذه العملية تتم بين أفراد ينتمون لدول مختلفة، وهذا ما يميزها عن التجارة المحلية أو الداخلية التي تتم بين أفراد ينتمون لنفس التنظيمات السياسية، مع العلم أن عملية التبادل السابقة يشار لها بمصطلحين شائعين هما: الصادرات إذا كان اتجاه السلعة أو الخدمة من داخل البلد إلى خارجه، والواردات إذا كان التدفق السابق يتم من الخارج إلى داخل البلد، كذلك أطرافها نجدها تختلف بين: الدول، الأفراد والمنظمات أو خليط من ذلك.

تتميز عقود التجارة الدولية بطبيعة خاصة تميزها عن عقود التجارة الداخلية، فالأولى تخضع لمبدأ سلطان الإدارة، أما التجارة الداخلية فتخضع للقوانين والتشريعات الوطنية لكل الدول (الحموري، 2007، صفحة 3).

المطلب الثاني: أسباب قيام التجارة الدولية

يرجع قيام التجارة الخارجية إلى احد أو كل الأسباب التالية (بوكونة، 2012-2011، صفحة 74):

1- **اللا توازن في عملية توزيع عناصر الإنتاج وكذلك التكنولوجيا من دولة لأخرى:** وهذا ما فرض على كل دولة التخصص في إنتاج السلع التي تتميز فيها بنفقة نسبية أو مطلقة على البلدان الأخرى، حتى تعود عليها بالفائدة طالما معدل التبادل يختلف عن ذلك المعدل الذي كان سائدا قبل قيام التجارة، وهذا ما يعد سببا جوهريا ورئيسي لقيام التبادل، كما يمكن إن تكون التكنولوجيا سببا في تطوير المنتجات والتغيرات التي تطرأ على المنتجات حتى تتميز بالكفاءة العالية لاستغلال الموارد الاقتصادية، حيث التجارة تبنى على التغيرات التي تظهر على المنتجات داخل البلد وتطويرها.

2- **تفاوت التكاليف وأسعار عوامل الإنتاج و الأسعار المحلية لكل دولة:** تهدف كل دولة إلى تخفيض تكاليف الإنتاج لسلعة داخل الدولة مقارنة بارتفاع هذه التكاليف لنفس السلعة في دولة أخرى، وذلك من خلال تحقيق وفرات الحجم، حيث انه عند تساوي التكاليف النسبية لإنتاج سلعتين في كل من الدولتين لما قامت التجارة الدولية بينهما

3- **البحث عن زيادة الدخل القومي:** تريد كل دولة أن تعتمد على الدخل المحقق من التجارة الخارجية وذلك بهدف الرفع من مستوى المعيشة محليا وتحقيق الرفاهية الاقتصادية لجميع أفراد المجتمع.

4- **البحث عن زيادة الإنتاج المحلي:** كل فائض في الإنتاج المحلي يؤدي إلى البحث عن أسواق خارجية لتسويق الفائض من الإنتاج، بشرط توفر كافة الظروف الملائمة للطلب على الإنتاج عالميا.

5- **اختلاف الميولات والأذواق:** إن المستهلكين في كل دولة يسعون للحصول على السلعة ذات المواصفات الإنتاجية المتميزة والعالية الجودة لتحقيق أقصى منفعة ممكنة منها، حيث أن التغير في الأذواق يؤثر على منحنى الطلب التبادلي من خلال أثر التغير في الأذواق على خريطة السواء الخاصة بدولة ما.

6- **الأسباب السياسية والإستراتيجية:** كل دولة تتميز بالندرة النسبية للسلعة المنتجة تريد تحقيق النفوذ السياسي-المشاركة في صنع القرار في الدولة التي هي بحاجة للسلعة- والمتاجرة بهذه السلع عالميا (بوكونة، 2012-2011، صفحة 75).

المطلب الثالث: أهمية التجارة الخارجية.

من مميزات التجارة الخارجية أنها تمكن كل دولة من الاستفادة من مزايا الدول الأخرى، أي ما تتمتع به دولة ما تضعه التجارة الخارجية تحت تصرف الدول الأخرى، ويمكن معرفة أهمية التجارة الخارجية من خلال الآتي:

أ. تعطي التجارة الخارجية الفرصة لكل دولة في الحصول على بعض المنتجات والخدمات التي لا تتوفر لديها، إما لان ظروفها المناخية لا تسمح بذلك، أو لان إمكانياتها الطبيعية هي الأخرى لا تسمح بذلك، أو لان الدولة عند إنتاجها تتحمل تكاليف باهضة، والتي تكون أعلى من مصاريف شرائها (بوكرنة، 2012-2011، صفحة 75).

ب. تعتبر التجارة الخارجية عاملا هاما للدول النامية التي تسعى لتنمية اقتصادياتها، إذ أنها تعطي لهذه الدول فرصة الحصول على قروض من الدول الصناعية، واقتراض الدول ما هو إلا صورة من صور انتقال السلع والخدمات من دولة إلى أخرى.

ج. تقسيم العمل، أي أن تتخصص كل دولة في إنتاج بعض السلع وترك لبقية الدول الأخرى بقية السلع بالرغم من أنها تستطيع إنتاج بعض السلع أو كلها إذا رغبت في ذلك.

د. تعتبر التجارة الخارجية أداة تقرب المسافات وتجتاز الحدود بين الدول وخاصة في وجود تطور في سبل المواصلات والاتصالات السلكية واللاسلكية.

هـ. تعمل التجارة الخارجية على زيادة الرفاهية الاقتصادية، وذلك من خلال زيادة إشباع حاجات الأفراد من السلع والخدمات (بودية، 2011-2010، صفحة 08).

و. تعتبر التجارة الخارجية مؤشرا جوهريا على قدرة الدولة الإنتاجية والتنافسية في السوق الدولي، وذلك لارتباط هذا المؤشر بالإمكانيات الإنتاجية المتاحة وقدرة الدولة على التصدير ومستويات الدخول فيها، وقدرتها كذلك على الاستيراد، وانعكاس هذا كله على رصيد الدولة من عملات أجنبية، وما له من اثر على الميزان التجاري (مسعداوي، 2010، صفحة 15).

ز. العمل على تحريك وتنمية الأموال وزيادة رؤوس الأموال التي تنتج من خلال العمل التجاري الخارجي.

المطلب الرابع: سياسات التجارة الخارجية وأهدافها.

أولا: ماهية السياسة التجارية

- السياسة التجارية هي مجموعة الوسائل التي تلجأ إليها الدولة في تجارتها الخارجية لتحقيق أهداف معينة، حيث تختلف هذه السياسات باختلاف النظم الاقتصادية (ناشز و شهاب، 2010، صفحة 197).

-السياسة التجارية هي السياسة الاقتصادية التي تطبق في مجال التجارة الخارجية، فهي مجموعة الإجراءات التي تطبقها السلطات ذات السيادة، تشمل هذه الإجراءات الواردات والصادرات مثل الحصص والرسوم الجمركية والإعانات (حشيش و محمود، 2003، صفحة 229) .

-كما تعرف كذلك بأنها حزمة من القوانين والإجراءات والتشريعات التي تتخذها الدولة من أجل تنظيم العلاقة بينها وبين دول العالم الأخرى (المرزوق، صفحة 98).

وعليه يمكن تعريف السياسة التجارية بأنها مجموعة من القوانين والاجراءت والتشريعات التي تطبقها الدولة في مجال التجارة الخارجية بهدف تنظيم علاقاتها مع باقي دول العالم.

ثانيا: أهداف السياسة التجارية: يمكن أن نوجز أهداف السياسة التجارية في:

1-الأهداف الاقتصادية:

- تحقيق التوازن في ميزان المدفوعات عن طريق تعظيم عائدات الصادرات والموارد من العملة الصعبة.
- تشجيع الاستثمار من اجل التصدير وزيادة العمالة ومستوى التشغيل في الاقتصاد الوطني محليا.
- حماية الاقتصاد الوطني من خطر الإغراق، فضلا عن حماية الصناعة الناشئة حديثة العهد من خطر المنافسة.
- تعتبر مصدرا هاما من مصادر الإيرادات العامة للدولة لتمويل الإنفاق العام بأنواعه المختلفة (قابل، 2010، صفحة 313).

2-الأهداف الاجتماعية: والتي تتمثل في:

- حماية مصالح بعض المنتجين، يعني العمل لصالح المنتجين الزراعيين لسلع معينة تعتبر ضرورية للدولة.
- إعادة توزيع الدخل القومي بين الفئات والطبقات المختلفة.

3-الأهداف الاستراتيجية: وتتمثل في:

- المحافظة على امن الدولة من الناحية الاقتصادية والغذائية والعسكرية.
- العمل على توفير الحد الأدنى من الإنتاج من مصادر الطاقة كالبترول مثلا.

المبحث الثاني: نظريات التجارة الخارجية

تطورت هذه النظريات المفسرة للتجارة الخارجية عبر الزمن ونظرا للأهمية البالغة لها ارتأينا تناولها حسب تسلسلها الزمني.

المطلب الأول: النظريات الكلاسيكية في التجارة الخارجية.

حيث ظهرت هذه النظريات في أواخر القرن الثامن عشر وأوائل القرن التاسع عشر منافية لأفكار المدرسة التجارية التي ظهرت في القرن السابع عشر من قبل مجموعة من الباحثين أطلق عليهم التجاريين، والتي كانت تهدف إلى جمع المعادن النفيسة متمثلة في الذهب والفضة، والتي اعتبرت حسب أرائهم أساس ثروة الأمم وعظمتها، وهي التي يمكن الحصول عليها من مصدرين: أولهما مناجم الذهب والفضة وهي موجودة في بلدان محددة وثانيهما التجارة الخارجية، وانطلاق من ذلك اقترحوا أن تتدخل الدولة في الشؤون الاقتصادية، فضلا عن أن المدرسة التجارية افترضت أن عنصر العمل هو أهم عناصر الإنتاج.

أولا: نظرية الميزة المطلقة لآدم سميث

رغم القليل الذي كتبه سميث في ما يتعلق بالتجارة الخارجية، فقد كان لكتابه المشهور" ثروة الأمم" سنة 1676 تأثير اكبر مما كان لأي كتاب آخر في القضاء على قيود التجارة الخارجية، ومباشرة حرية التجارة في أوروبا الغربية في القرن التاسع عشر، حيث بدأ بتعريف ثروة الأمة على أنها انعكاس لقدرتها الإنتاجية وليس لقدرتها على تراكم الأرصدة الدولية والمعادن النفيسة (رزق، 2010، صفحة 17).

تعد نظرية الميزة المطلقة **لآدم سميث** أول نظرية فسرت قيام التجارة الدولية بين الأمم، حيث ركزت على جانب العرض في تفسير أسباب الفوارق السعرية بين الدول، وتعتبر النظرية أن وظيفة التجارة الخارجية هي التغلب على ضيق السوق المحلي (داوود واخرون، 2002، صفحة 33)، فتتلخص الفكرة العامة لنظرية الميزة المطلقة أو كما تسمى نظرية " التكاليف المطلقة" في أن ثروة الدولة تقاس بما تنتجه من السلع والخدمات، بحيث تنتج منها أكثر مما تحتاجه لإشباع حاجاتها الداخلية وتقوم بمبادلة الفائض مع العالم الخارجي مقابل استيراد السلع التي يكون إنتاجها غير ملائم لها، أو التي لا تستطيع إنتاجها أبدا، أي تقوم على أن الدولة التي تتمتع بالنفقة المطلقة الأقل عن بقية العالم في إنتاج سلعة معينة، فإذا تخصصت في إنتاج هذه السلعة سيكون مربحا لها من ناحية منافسة الأسعار، كما تدعو نظرية النفقات المطلقة إلى وجوب ترك التجارة الخارجية بين البلدان المختلفة حرة غير خاضعة لأية قيود وذلك من اجل تحقيق المكاسب من التبادل الدولي والمشاركة فيه، ورغبة في زيادة ثروة الأمم، ويفترض ادم سميث أن تقييد الدولة للواردات من الدول الأجنبية فرضه الأساسي حماية الصناعات الناشئة (يسري واخرون، 2006، صفحة 23).

رغم اعتبار نظرية **ادم سميث** محاولة جادة في تفسير أسباب قيام التجارة الدولية بين الدول إلا أنها تعرضت لنقد حاد يتقدمه اعتبار النظرية أفرطت في التبسيط، فهي حصرت التبادل بين قطرين فقط في حين أن الأمر أكثر تشعبا وتعقيدا، فضلا عن أنها تعرضت لنقد من شكل آخر تمثل في وجود الكثير من الدول لا تمتلك أي تفوق في إنتاج أي سلعة، وهذا ما يعني حسب النظرية أن تجارتها الدولية تؤول إلى الصفر، في حين الواقع يثبت العكس، كذلك اعتبرت النظرية امتداد لنظرية نفس العالم في التجارة الداخلية، في حين هناك فوارق بينهما واختلافات جوهرية، وهذا ما يجعلها عاجزة عن تفسير مجمل التجارة الدولية بين الأقطار، إلا انه يمكن قبولها في تفسير أجزاء من تجارة العالم كتلك التي تتم بين الدول المتطورة والأخرى المتخلفة، وهذا ما حفز عالم آخر يدعى دفيد ريكاردو على تقديم نظرية أخرى سميت نظرية المزايا النسبية، والتي تقوم على فكرة التفوق النسبي وليس المطلق في إنتاج السلع.

ثانيا: نظرية المزايا النسبية لدفيد ريكاردو

في القرن التاسع عشر قام الاقتصادي الانجليزي "**دفيد ريكاردو** "**(1772-1823)** بالرد على نظرية الميزة المطلقة **لآدم سميث،** وذلك في كتابه المشهور عن التجارة الخارجية 1817"الاقتصاد السياسي والضرائب". في الفصل السابع منه عن قانون الميزة النسبية، وطبقا لهذه النظرية فان ريكاردو يؤكد بأنه ليس باستطاعة كل الدول أن تكون لديها ميزة مطلقة في الإنتاج، ففي كثير من الدول وخاصة الدول النامية منها قد لا يتوفر لديها ميزة مطلقة في أي من سلعها، وفي هذه الحال لا يمكن استخدام نظرية الميزة المطلقة لتفسير قيام التبادل التجاري، ويعتبر **ريكاردو** أن السبب الرئيسي في قيام التجارة الخارجية هو اختلاف المزايا النسبية لإنتاج السلع من دولة لأخرى(Naji, 2005, p. 21) .

من أجل تصحيح الخلل القائم في نظرية التكاليف المطلقة ارتأى **ريكاردو** ضرورة إدراج ما يسمى بالتكاليف النسبية في عملية التبادل، فنظرية التكاليف النسبية تؤكد على ضرورة تخصص دولة ما في إنتاج السلعة أو السلع التي تتمتع في إنتاجها بميزة نسبية أي "**اقل تكلفة ممكنة**" (زبون، 2003، الصفحات 87-86).

ثالثا: نظرية القيم الدولية لجون ستيوارت ميل

لقد كان **لجون ستيوارت ميل** (1806-1878) من خلال كتابه "**مبادئ الاقتصاد السياسي** " مع بعض تطبيقات الفلسفة الاجتماعية (1848) في بابه السابع عشر الخاص بالتجارة الدولية، والثامن عشر الخاص بالقيم الدولية دور كبير في تحليل قانون النفقات النسبية في علاقته بنسبة التبادل الدولي، والتي يتعرض لها ريكاردو في تحليله، ووفقا لهذه النظرية فقد بين جون ستيوارت ميل أن القيمة الدولية للسلعة لا تتحدد على أساس نفقة إنتاجها، وأن سعر التبادل حسب ميل يتحدد وفقا لقانون العرض والطلب، وذلك على المستوى الذي يجعل صادرات كل بلد تغطي حجم إراداته (المتبادل)، حيث أوضح أن نسب التبادل الدولية بين سلعتين لا تعتمد فقط على تكاليف الإنتاج ونسب التبادل الدولية،بل وعلى نمط الطلب ومرونته السعرية لكل سلعة من السلعتين في الدولتين التي يجري التبادل بينهما، حيث يتوقف تحديد معدل التبادل الدولي عند ميل على طلب الدولة على ناتج الدولة الأخرى ومرونة هذا الطلب، ولكن كيف يتحدد معدل التبادل هذا (دياب، 2010، صفحة 105).

يوضح ميل أن التجارة بين البلدين تقوم إذا كان معدل التبادل التجاري يقع بين المعدلين الداخليين السائدين فيهما، ويحقق كل من البلدين مكسبا مقداره الفرق بين معدل التبادل التجاري المتفق عليه بين الدولتين ومعدل التبادل الداخلي في كل دولة، وكذلك بين أن معدل التبادل الفعلي بين الدولتين يتحدد على أساسين هما:

-شدة طلب كل من الدولتين على السلعة التي تنتجها الدولة الأخرى.

–مرونة الطلب، أي تحديد معدل التبادل الفعلي يتم على أساس الطلب المتبادل (ابو شرار، 2015، صفحة 40).

لم تتمكن النظرية من الاقتراب من الواقع عند افتراضها لتكافؤ أطراف التبادل، ففي حالة تبادل دولي بين دول غير متكافئة من الممكن ألا يكون للطلب المتبادل دور في تحديد نسبة التبادل الدولي، أي بإمكان الدول الكبرى أن تملي شروطها، بالإضافة إلى ذلك فان الفكرة المتعلقة التي مفادها أن التبادل غير المتكافئ بين الدول سيأتي بالنفع على الدول الصغيرة فيمكن أن يكون غير محقق، حيث يمكن أن يؤدي التبادل إلى عدم مرونة الطلب للبلد الصغير بسبب إشباع السوق الناتج عن ضيق سوقه الداخلي، أما الحالة المعاكسة فإنها صالحة بالنسبة للبلدان ذات طلب داخلي واسع، وهذا التفسير غير صالح لكون أن إتباعه من المفروض أن يؤدي إلى عدم وجود دولة متطورة .

من خلال ما سبق وحسب النظريات الكلاسيكية فان قيام التجارة الخارجية يؤدي إلى زيادة الدخل والرفاهية نتيجة التخصص والتقسيم في العمل، وذلك من خلال تخفيض الأسعار وإعادة توزيع الموارد لصالح القطاعات الأعلى كفاءة، كما أن فوائد التجارة الخارجية توزع بالتساوي بين دول التبادل التجاري، إلا أن النموذج الكلاسيكي تعرض لعدة انتقادات جعلته لا يتوافق مع الواقع العملي.

المطلب الثاني: النظريات النيوكلاسيكية للتجارة الخارجية

لقد أوضحت النظريات الكلاسيكية أن قيام التبادل التجاري بين الدول يقوم على أساس اختلاف النفقات النسبية للإنتاج بينها، إلا أنها لم تتطرق لأسباب الاختلاف في هذه النفقات حيث حددت متى تقوم التجارة الدولية بين الدول ولكن لم تفسر لنا لماذا تقوم هذه التجارة، هذا ما أدى إلى ظهور النظريات النيوكلاسيكية التالية الذكر.

أولا: نظرية التكلفة البديلة

من غير المقبول أن يكون العمل هو عنصر الإنتاج الوحيد، كما أنه لا يتكون من وحدات متجانسة، وهو معيار تعرض لكثير من النقد من قبل الاقتصادي الألماني **غ.هبرلر** الذي أعطى مفهوم جديد للنفقات النسبية يعتمد على فرضيات نظرية تكلفة الفرصة البديلة، شرح **هابرلر** في كتابه سنة1933 قانون الميزة النسبية، من خلال تقديمه لنظرية تكلفة الفرصة البديلة ومنحنى إمكانيات الإنتاج كبديل للنظريات السابقة (فوزي، 2016، صفحة 39)، ويسمح لنا مفهوم تكلفة الفرصة البديلة بتطوير نظرية عامة تتعلق بالميزة النسبية تشمل جميع عناصر الإنتاج، وفي هذا الصدد تعتبر تكلفة الفرصة البديلة هي كمية السلعة التي يتعين التخلي عنها لتوفير موارد كافية لإنتاج سلع أخرى (سوير و سبرينكل، 2015، صفحة 40).

يعتبر **هاربلر** أثمان السلع تتناسب مع نفقات التكلفة النسبية، فالدول الأكثر كسبا هي التي تتمتع بميزة نسبية في إنتاج السلع، وأن اختلاف الأثمان النسبية هو الدافع لقيام التبادل، إذ أن معدل التبادل يتحدد بواسطة تلاقي قوى العرض والطلب للدولتين. وبعبارة أخرى تتلخص الفكرة العامة لنظرية تكلفة الفرصة البديلة، في أنه إذا استطاعت دولة معينة إنتاج السلعة (س) أو السلعة (ع)، فان تكلفة الفرصة البديلة للسلعة (س) هي عبارة عن كمية السلعة (ع) التي يجب التنازل عنها أو التضحية بها للحصول على وحدة إضافية من السلعة (س) (فوزي، 2016، الصفحات 39-40).

رغم ما تقدمه النظرية من تفسير لأسباب قيام التجارة الخارجية غير أنها لم تسلم من الانتقادات أهمها: عجز النظرية على تفسير أسباب اختلاف المزايا النسبية بين الدول، وكذلك تأثير التجارة الخارجية المستخدمة في الدول صاحبة التبادل.

ثانيا: نظرية نسب عناصر الإنتاج هكشر وأولين

تعد نظرية **هكشر-أولين** امتدادا لنظرية النفقات النسبية- ذلك لأن نظرية النفقات النسبية فسرت سبب قيام التجارة الدولية وأرجعت ذلك إلى اختلاف النفقات النسبية لإنتاج السلع، أما هكشر -أولين فإنها توضح أسباب اختلاف النفقات النسبية للسلع المختلفة، وهذا يعني أن هذه النظرية بدأت من حيث انتهت نظرية النفقات النسبية، ولذلك تعتبر مكملة لها وليست بديلة (السريتي ا.، 2009، صفحة 75).

وقد جاءت نظرية **هكشر -أولين** على مرحلتين هما:

1-**مساهمة هكشر**: فقد أرجع **هكشر** أسباب اختلاف النفقات النسبية لإنتاج السلعة من دولة إلى أخرى إلى ما يلي:

*اختلاف درجة الوفرة أو الندرة النسبية لعناصر الإنتاج بين الدول المختلفة، نظرا لان عناصر الإنتاج لا تتوافر بنفس الدرجة في جميع الدول مما يسبب اختلاف أسعار هذه العناصر وبالتالي اختلاف تكاليف الإنتاج النسبية، وقد اقترح العالم هكشر المعادلة الموالية لقياس درجة الندرة النسبية أو الوفرة لعنصر إنتاجي معين:

الوفرة أو الندرة النسبية لعنصر الإنتاج=عرض هذا العنصر/عرض عناصر الإنتاج الأخرى.

*اختلاف طرق إنتاج السلع المختلفة: وهو ما يعني بالتبعية إن إنتاج السلع المختلفة يحتاج إلى كميات مختلفة من عناصر الإنتاج، لذلك استنتج هكشر معيارا لتقسيم السلع يعتمد على كثافة استخدام العنصر في السلعة، وبناءا على استخدام هذا المعيار أمكنه ملاحظة ما يلي:

-السلع التي يحتاج إنتاجها إلى كميات كبيرة من العمل وكميات اقل من رأس المال تسمى السلع كثيفة العمل مثل المنسوجات.

-السلع التي يحتاج إنتاجها إلى كميات كبيرة من رأس المال وكميات اقل من العمل، تسمى سلع كثيفة رأس المال مثل الآلات .

-بعض السلع والتي يحتاج إنتاجها إلى كميات كبيرة من عنصر الأرض مقارنة بكميات العناصر الإنتاجية الأخرى تصنف تحت مسمى السلع كثيفة الأرض مثل السلع الزراعية كالقمح على سبيل المثال.

وعليه قرر **هكشر** ما يلي:

*إن الدولة التي تتمتع بوفرة نسبية في (عنصر العمل، رأس المال، الأرض) نظرا لوجود انخفاض نسبي لديها في(الأجور، معدلات الفائدة، الريع)، ستتمكن من إنتاج سلع كثيفة (العمل، رأس المال، الأرض) على الترتيب.

*تتكون صادرات كل دولة من السلع التي يحتاج إنتاجها إلى عناصر الإنتاج المتوافرة فيها، أين تكون أسعار هذه العناصر منخفضة نسبيا في هذه الدولة، ومن ثم تستطيع إنتاج هذه السلع بتكلفة نسبية اقل.

*تتكون واردات كل دولة من السلع التي يحتاج إنتاجها إلى عناصر إنتاج متوافرة لديها أو تعاني فيها من ندرة نسبية بالمقارنة بغيرها من الدول.

2-مساهمة أولين: استند أولين لرأي مخالف للنظريات السابقة لتفسير أسباب قيام التجارة الدولية بين الأقطار، فبدل تفسيرها بسبب الاختلاف في النفقات النسبية، استند إلى الأسعار النسبية، ذلك أن الأسعار تعكس ظروف الطلب في حين تعكس النفقات ظروف الطلب، وتتمثل مساهمته في:

أ-رأى **أولين** أن اختلاف طرق الإنتاج بين السلع أمر طبيعي جدا، وإنما يتطلب الأمر النص على ضرورة تماثل دالة إنتاج السلعة الواحدة في جميع الدول-التقنية الأحسن بمرور الوقت يمكن تقليدها-، ثم إن هذا الشرط هام إذا ما أردنا أن نفسر سبب الاختلاف في النفقات النسبية استنادا لدرجة توفر عناصر الإنتاج في دولة من دول العالم كما فعل هكشر.

ب-ضرورة الأخذ في الاعتبار ظروف الطلب، ذلك أن الأسعار النسبية لا تتحدد فقط بظروف العرض-**هكشر**- وإنما أيضا بظروف الطلب مثل أذواق المستهلكين، دخول المستهلكين...الخ، وهذا ما قاد العالم أولين إلى تقديم طرح على قدر كبير من المنطقية الاقتصادية، فحسبه لو افترضنا أن بلد ما يتمتع بوفرة نسبية في عنصر رأس المال على سبيل المثال، فان هذا البلد سيقوم بإنتاج السلع كثيفة رأس المال بتكلفة منخفضة نسبيا طبقا لتقدير هكشر، ولكن إذا افترضنا أن أذواق المستهلكين في هذا البلد تميل نحو تفضيل هذا النوع من السلع، فسوف يزداد الطلب عليها ومن ثم سيرتفع سعرها نسبيا، وبالتالي فأذواق المستهلكين قد تقلل وربما تلغي الميزة النسبية المترتبة على الوفرة النسبية لعنصر إنتاجي ما، فالوفرة النسبية لعنصر العمل مثلا تعني انخفاض

سعر العمل النسبي ولكن زيادة الطلب على هذا العنصر يؤدي إلى ارتفاع سعره النسبي، ويتحدد الطلب في جزء منه بأذواق المستهلكين.

ثالثا: الاختبار التجريبي لنظرية هكشر وأولين

كما تسمى في قاموس المصطلحات الاقتصادية بلغز **ليونتيف**، استنادا للعالم الأمريكي الذي طبقها على الاقتصاد الأمريكي سنة 1947، حيث أن أهم نتيجة لهذه الدراسة تمثلت في كون أمريكا تقوم بتصدير سلع كثيفة العمل وفي نفس الوقت تستورد سلع كثيفة رأس المال، وعرف هذا التناقض المسجل بين الأدب النظري وتطبيقاته على ارض الواقع "بلغز ليونتيف"، فالدولة محل الدراسة–التجربة–تصدر سلعا يغيب في إنتاجها عنصر رأس المال بالرغم من أنها غنية به لأسباب لا علاقة لها بنسب عوامل الإنتاج، وفسر ذلك بان إنتاجية العامل الأمريكي تعادل ثلاث أضعاف العامل الأجنبي، وهذا هو ما يتناقض مع نظرية **هكشر–أولين**، ويعزى السبب كذلك لكون المواطن الأمريكي يستهلك عنصر رأس المال بكثافة–هيكل الحماية، رأس المال البشري، اثر البحوث والتطوير.– .

النتيجة التي توصل إليها ليونتيف تعتبر هدم لنظرية **هكشر وأولين**، لهذا السبب ظهرت تفسيرات متعددة تحاول فهم الأمر تتمثل في (عبد القادر ا.، 2011، الصفحات 50–52):

–فضلا على انه تبين أن إنتاجية العامل الأمريكي هي أكثر من العامل الأجنبي–بمقدار ثلاثة أضعاف–، كذلك تبين أن المواطن الأمريكي يستهلك أكثر سلعا كثيفة رأس المال، يعني إذا كانت الو م ا الغنية برأس المال تفضل استهلاك المزيد من السلع الكثيفة لرأس المال فانه لن يبقى فائض ليتم تصديره، فإنها تصدر سلع كثيفة العمل بدل سلع الميزة، وهذا ما يسمى في قاموس المصطلحات الاقتصادية انعكاس أو تحيز الطلب.

–قد تتحول السلعة من سلعة كثيفة العمل إلى سلعة كثيفة رأس المال مثلما حدث في الو م أ، وهو ما يعرف بأثر انعكاس كثافة عوامل الإنتاج، مع العلم أن هذا الأثر يتوقف على درجة أو سهولة إحلال عنصر إنتاجي محل عنصر إنتاجي آخر في الإنتاج.

–**تريفيز Travis** سنة 1971 حاول تفسير الأمر من خلال هيكل الحماية، والذي يقصد به مجموعة التدابير الجمركية وغير الجمركية التي يتم استخدامها للتأثير على حجم ونمط التجارة الخارجية لقطر من الأقطار، هذه الأخيرة والتي لوحظ تشددها في مواجهة الواردات الأمريكية كثيفة العمل، الأمر الذي يكون قد اثر سلبا على تدفق الواردات كثيفة العمل نحو الدولة.

–اثر البحوث والتطوير، وهنا يتم الربط بين الإنفاق على أنشطة البحوث والتطوير وكفاءة أداء الصادرات، مثلما أشارت له الكثير من الدراسات–**جروبر وكسينج**– إلى وجود سلع رأس المال والمعرفة تنتج عن البحث والتطوير، ويؤدي ذلك إلى زيادة في قيمة الإنتاج المشتق من

حجم معين من الموارد البشرية والمواد الأولية، ولذلك نلاحظ دور رأس المال المعرفة ورأس المال البشري في تحديد نمط التجارة الأمريكية، وهو الأمر الذي لم يأخذه ليونتيف بعين الاعتبار.

المطلب الثالث: النظريات الحديثة للتجارة الخارجية

يبدو أن محاولة ليونتيف قد فتحت الباب على مصراعيه أمام العديد من الدراسات، والتي أسفرت في معظمها عن عدم تأييد نظرية هكشر وأولين، ليس من حيث صحتها النظرية ولكن من حيث انطباقها مع الواقع، من بينها نجد:

أولا: نظرية نسب عناصر الإنتاج الجديدة

تعتبر من بين النظريات التي حاولت صياغة فرضيات نظرية **هكشر وأولين** بما يتلاءم والاقتصاد الأمريكي، وقد تبناها كل من:

1-ليمار: والذي قام سنة 1987 باختبار إمكانية التنبؤ في نموذج **هيكشر وأولين** لقاعدة معطيات مجموعة من القطاعات واحتساب نسبة رأس المال مؤشر العامل البشري وهذا وفق جدول، حيث توصل إلى أن هناك أسباب جوهرية جعلت نموذج **هيكشر وأولين** يتلاشى، وهي (سي محمد، مدخل للاقتصاد الدولي، 2015، صفحة 36):

-التبادل التي حاولت نظرية **هيكشر وأولين** تفسيره هو تبادل تجاري يقوم على أساس وجود اختلاف بين الدول فيما تملكه من ثروة في عناصر الإنتاج، يعني انه تبادل تجاري يعجز على تفسير التبادل بين الأقطار والدول المتشابهة في إنتاجها.

-تغيير نسبي لسعر السلعة يؤدي إلى توسع التجارة وإدارة توزيع الدخل، وهذه الأسباب لم تعمر طويلا أمام إفرازات النظريات الحديثة، ومن ابرز هذه الوقائع هو تفاوت التبادل التجاري في العالم المتقدم، وان عناصر الإنتاج في الدول متشابهة على عكس الدول المتخلفة التي تواصل أو تكتفي بتجارة المواد الأولية، أما التغير النسبي في سعر السلعة بعد قيام التجارة الخارجية فيؤدي إلى زيادة الطلب على سلعة ما، وهذا لا يؤدي بالضرورة إلى إعادة توزيع الدخل حسب نظرية **ستوبلر-ساموبلسون**.

2-نظرية نسب عناصر الإنتاج الجديدة: تعتبر هذه الأخيرة أن عنصر العمل غير متجانس ويعزى السبب في هذا لاختلاف درجات المهارة، وعند اخذ هذه الأخيرة بعين الاعتبار يتضح التفسير وراء لغز ليونتيف، والذي يرجع بحسب النظرية إلى ما تتمتع به الو م أ من وفرة نسبية في رأس المال البشري، ومن ثم يصبح هذا الأخير محددا على قدر كبير من الأهمية للميزة النسبية(Stephen & Michel, 2007, p. 133) .

يرى **جونز** سنة 1987 إمكانية الاعتماد على عنصر رأس المال البشري في تفسير أنماط التجارة الخارجية، وذلك يخص المنتجات التي تعتمد على العمالة الماهرة، كما أن حركات رؤوس الأموال تلعب دورا لا باس به في تفسير أسباب التجارة الخارجية، نظرا لأنه إذا أمكن للدولة

استيراد السلع الوسيطة الداخلة في إنتاج سلعة ما بأسعار اقل من مثيلاتها في السوق الداخلي فالنتيجة هي زيادة القدرة التنافسية لهذه الدولة في إنتاج السلعة (عفيفي س.، 2003، صفحة 169)، كما واهتم النموذج بدراسة اثر التغير التكنولوجي على نمط التجارة الخارجية، وتوصل إلى أن أي تغير تكنولوجي سيؤدي إلى تغير أسعار عناصر الإنتاج، وبالتالي تغير المخرجات، وعليه تحسين في جودة المنتج وهذا ما سيقابله تغير في الطلب ممثلا في أذواق المستهلكين (عبيدلي، 2016، صفحة 9).

ثانيا: نظرية معدل التبادل الدولي لليندر والتجارة ما بين الصناعات

قبل التطرق إلى التجارة ما بين الصناعات سوف نلم بنظرية التبادل الدولي **لشافين ليندر** سنة1961 وذلك وفق العناصر التالية الذكر:

1-نظرية معدل التبادل لليندر: حيث يرى **ليندر** أن التجارة ترتبط بالمزايا النسبية، ولكن منشأ هذه المزايا لا يوجد في الاختلاف بين الهبات المبدئية لعوامل الإنتاج، ولا يعني هذا أن اختلاف نسب عوامل الإنتاج لا قيمة له في تفسير التبادل التجاري، ولكنه يعني أن قيمته محدودة،ولذا فان الأمر يتطلب البحث عن موارد أخرى، وفي تفسيره للتبادل الدولي فقد فرق بين تجارة المنتجات الصناعية ومنتجات المواد الأولية.

فبالنسبة للمنتجات الأولية، فيرى أن التبادل فيها يتم طبقا للميزة النسبية والتي تتحدد بنسب عناصر الإنتاج، أما المنتجات الصناعية فهناك عدة محددات لعمليات التصدير والاستيراد، ومن بينها حجم الطلب المحلي وهو شرط ضروري لتحقيق الميزة النسبية .نتيجة لذلك تكون التجارة الخارجية أكثر كثافة بين الدول التي تتشابه هياكل الطلب فيها، فإذا كان الدخل الفردي هو المحدد الأساسي للطلب، فان التجارة الخارجية تكون أكثر كثافة بين الدول التي يتفاوت مستوى الدخل فيها (يونس، 2015، الصفحات 84-82).

2- التجارة ما بين الصناعة: يذهب مفهوم هذا النوع من التجارة الدولية إلى تبادل الدول المتقدمة فيما بينها سلعا صناعية متمايزة (سي محمد، 2015، الصفحات 49-51)، وتتسم السلع المتمايزة بسيمات خاصة تجعلها تبدو مختلفة عن السلع المتنافسة في نفس الوقت أو الصناعة وقد تكون في شكل:

-سلع متباينة أفقيا والتي تختلف فيما بينها بصورة طفيفة بالرغم من تشابه أسعارها كالحلويات.

-سلع متباينة رأسيا والتي لديها شكل خارجي مختلف تماما وأسعار مختلفة كالسيارات...

وقيام هذا النوع من التجارة يدعمها تشابه الدول الصناعية فيما بينها مما تملكه من تكنولوجيا ورأس المال وعمالة ماهرة وتقارب في موارد الإنتاج ومن هنا تظهر الميزة النسبية لهذه الدول.حيث قام **جربل وليود** من وضع مؤشر يقيس معدل التبادل بين الصناعات في الدول

المتقدمة، أما فيما يخص معدل التبادل بين الدول السائرة في طريق النمو فقد قام **قيفن وهارفيشا** بحساب معدل التبادل بين الصناعات بين هذه الدول.

ثالثا: النظرية التكنولوجية في التجارة الخارجية

تتكون النظرية التكنولوجية في التجارة الخارجية من ثلاث نماذج رئيسية:

1- نموذج اقتصاديات الحجم: يمكن القول أن نظرية اقتصاديات الحجم تسعى إلى تفسير نمط التجارة الخارجية بين الدول الصناعية المتقدمة وبين الدول الصناعية ذات السوق الداخلية الصغيرة، فالدول الصناعية صغيرة الحجم تتجه إلى الحصول على مزايا نسبية مكتسبة مصدرها اقتصاديات الحجم في السلع نصف المصنعة أو الوسيطية لعدم قدرتها على التأثير على أذواق المستهلكين، أما الدول الصناعية كبيرة الحجم تتجه إلى السلع تامة الصنع والسلع الاستهلاكية بسبب قدرتها على التأثير في الأذواق والتفضيلات للمستهلكين في الدول الأخرى (حاتم، 1999، الصفحات 198-199).

2-نموذج الفجوة التكنولوجية: فقد عرف **بوستر** "الفجوة التكنولوجية" بأنها المدة التي تكون فيها الدولة تتمتع بالميزة النسبية في التفوق التكنولوجي وتكون الوحيدة في إنتاج وتصدير السلعة ذات الكثافة التكنولوجية، حيث تتمتع باحتكار مؤقت إلى أن يزول هذا الاحتكار بزوال التفوق التكنولوجي(Guillchon & Kewecky, 2003, p. 62) .

3-نموذج دورة حياة المنتج: هذا النموذج هو الأوسع من نموذج الفجوة التكنولوجية والذي طوره الاقتصادي **ريموند فرنون** عام1966،ويوضح في نموذجه الذي أسماه "**دورة المنتج**" سلسلة المراحل التي يمر بها المنتج الجديد في مسيرة تطوره، حيث افترض أن هذه النظرية تعمل على تحليل الأسباب التي تؤدي إلى الابتكارات والكيفية التي تنتشر بها بالاعتماد على دورة حياة المنتوج ودورها في قيام التجارة الدولية وافترض أن التطور التكنولوجي ينطلق بشكل مستمر في الولايات المتحدة الأمريكية مما يعطيها دورا رياديا في تطوير المنتجات الجديدة عبر مراحل دورة حياة المنتوج وذلك كالتالي:

- **المرحلة الأولى:(مرحلة المنتج الجديد):** تنتج السلعة بكميات قليلة وتكون تكاليف إنتاجها مرتفعة، وتكون الكفاءات العلمية والهندسية هي العوامل الأكثر أهمية ويحتاج الأمر يد عاملة عالية المهارة، وتكون أسعار المنتج الجديد عالية لذا يكون الطلب عليها غير كبير كما أن تصدير السلعة يكون محدود.
- **المرحلة الثانية(مرحلة النمو أو التوسع):** يرتفع الطلب على السلعة التي تلقى قبولا متزايدا ويجري إنتاجها بصورة متزايدة، وبالتالي أسعارها وكذا الطلب عليها محليا وخارجيا، ويتم تلبية الطلبات المحلية ثم يبدأ إنتاجها خارجيا عن طريق الشركة الأم أو شركات أخرى.

- **المرحلة الثالثة (مرحلة النضج):** في هذه المرحلة يصبح المنتج نمطيا، إذ تتزايد المنافسة عن طريق الأسعار بحيث يرتكز الإنتاج في الدول ذات الأجور المنخفضة من أجل خفض التكاليف، وتبدأ الدول المقلدة بإنتاج المنتج وبيعه في أسواقها الداخلية.
- **المرحلة الرابعة(مرحلة الزوال والهبوط):** تصبح السلعة قديمة بسبب ظهور سلع جديدة أكثر حداثة وتطورا تلبي الحاجات نفسها،فعلى الرغم من انخفاض الأسعار فان الطلب على السلعة ينخفض وإنتاجها يتراجع.

وبالتالي نستخلص أن التقدم التكنولوجي له دور هام في تحديد الميزة النسبية للسلع الصناعية.

المبحث الثالث: مؤشرات التجارة الخارجية

تتعرف الدول على الاتجاهات الصحية لتجارتها الخارجية عن طريق تقييم مؤشرات التجارة الخارجية والتي تمكن من تحديد انفتاح اقتصادها ومسايرته للاقتصاد العالمي، وفيما يلي عرض لبعض هذه المؤشرات:

المطلب الأول: مؤشر هيكل الصادرات والواردات

كما يسمى مؤشر عدد المنتجات المصدرة والمستوردة حيث يمثل هذا المؤشر عدد المنتجات التي تصدرها الدول أو تستوردها وهذا وفقا للتصنيف الموحد للتجارة الخارجية الصادر عن الأمم المتحدة بأخذ ثلاث أرقام.

أولا: هيكل الصادرات

يشتمل على جانبين هما (حربي و عريقات، 2009، صفحة 402):

1-التركيب السلعي: وهو طبيعة التركيب الهيكلي للاقتصاد، فكلما تنوعت مكوناته السلعية توزعت على أكبر حجم لواردات السلع المصدرة، ويدل ذلك على تطور الهيكل الإنتاجي ونقل المخاطر التي تواجه الصادرات في الحصول على العوائد الأجنبية، ويحدث العكس إذا انخفضت المكونات السلعية للصادرات وارتفعت درجة تركيزها، وذلك يدل على تخلف الهيكل الإنتاجي.

2-التوزيع الجغرافي للصادرات: ويقصد به توجه الصادرات نحو الأسواق الخارجية، فكلما كانت الصادرات ترتكز على أسواق محددة، فهذا يعني أن الاقتصاد في حالة تبعية، ومن المحتمل أن تتعرض هذه الصادرات لمخاطر التقلبات في العلاقات السياسية.

ثانيا: هيكل الواردات

زيادة على أهمية تحليل الهيكل السلعي والتوزيع الجغرافي للواردات لتحديد طبيعة تطور الاقتصاد ودرجة تبعيته للخارج، فانه يعبر أيضا عن توجه السياسة لمحاربة هذه التبعية (حربي و عريقات، 2009، صفحة 402).

المطلب الثاني: رصيد الميزان التجاري

أولا: مفهوم الميزان التجاري

من خلال الميزان التجاري نستطيع معرفة نتيجة حركة كل من الصادرات والواردات من السلع والخدمات، وهناك عدة تعاريف للميزان التجاري نسرد أهمها في ما يلي:

1- الميزان التجاري عبارة عن رصيد العمليات التجارية، أي المشتريات والمبيعات من السلع والخدمات، وهو المعنى الأوسع والمألوف استخدامه حاليا.

2-الميزان التجاري هو فرع من ميزان المدفوعات للبلد يبين العلاقة بين إجمالي الصادرات والواردات الإجمالية، وعادة ما يضم الميزان التجاري مكونات منها: المرئية كالسلع، وغير المرئية كالخدمات (السريتي م.، 2009، صفحة 231).

من خلال التعاريف السابقة يمكن تعريف الميزان التجاري بأنه الفرع الأول من ميزان المدفوعات لبلد ما حيث يمثل رصيد العمليات التجارية السلعية والخدمية.

ثانيا: أقسام الميزان التجاري

حسب التعاريف السابقة يمكن تقسيم الميزان التجاري إلى قسمين هما (عوض الله، 2005، صفحة 66):

1-الميزان التجاري السلعي: ويطلق عليه أيضا ميزان التجارة المنظورة، ويتضمن كافة البنود المتعلقة بالصادرات والواردات من السلع المادية التي تمر بحدود الدولة الجمركية.

2-الميزان التجاري الخدمي: ويطلق عليه أيضا ميزان التجارة غير المنظورة، ويشمل كافة الخدمات المتبادلة بين الدولة والخارج مثل: خدمات النقل والتامين، السياحة، الخدمات الحكومية إلى جانب الخدمات المتنوعة، هذا فضلا عن بند دخل الاستثمارات، الذي يشمل في حقيقته إما خدمات أو رأس المال المحلي أو خدمات المال الأجنبي للداخل.

ثالثا: وضعيات الميزان التجاري

يشكل الميزان التجاري أهم بنود ميزان المدفوعات، حيث يعبر رصيد الميزان التجاري عن الفرق بين الصادرات والواردات ويتم حسابه وفق الصيغة التالي:CBS=X-M، ويمكن أن نستخلص منه بعض الموازين الفرعية، بحسب طبيعة التدفقات، فنجد ميزان السلع المنظورة وميزان السلع غير المنظورة ويتمثل رصيده في وضعين رئيسيين هما (محب حلة، 2014، الصفحات 396-398):

- **الفائض التجاري:** ويكون الرصيد فيها موجب أي أن حجم الصادرات أكبر من حجم الواردات.
- **العجز التجاري:** ويكون فيها الرصيد سالب أي أن حجم الصادرات أقل من حجم الواردات.

المطلب الثالث: معدل التبادل التجاري ودرجة الانفتاح الاقتصادي على الخارج.

أولا: مؤشر الانفتاح الاقتصادي: هو سياسة تقضي بتحرير المبادلات المالية والتجارية مع الخارج وذلك بإزالة العراقيل في مستوى الواردات والصادرات، فتحرير التجارة الخارجية يساهم في نقل وتبادل الخبرات والتكنولوجيا الحديثة بين الدول المتقدمة والدول النامية عبر المنتجات المصدرة والمستوردة، ما يتيح للمستهلكين الحصول على منتجات تحقق الرفاهية أكبر، وحصول المنتجين على منتجات وسيطية ذات إنتاجية عالية، كما تستفيد الاقتصاديات المصدرة من دخول أسواق جديدة بتحقيق اقتصاديات الحجم، ويكن حساب درجة الانفتاح الاقتصادي بالصيغة التالية: **(X+M)/PIB**.

درجة الانفتاح الاقتصادي= (مجمل التجارة الخارجية (الصادرات +الواردات)/(الناتج المحلي الإجمالي أو الدخل))*100.

فارتفاع هذه النسبة يعني زيادة في الانفتاح الاقتصادي.

ثانيا: مؤشر معدل التبادل التجاري: وهو يعبر عن النسبة بين مؤشر قيمة الوحدة من الصادرات إلى مؤشر قيمة الوحدة من الواردات، وتعبر قيمة الوحدة (الصادرات أو الواردات) عن السعر الوسطي المرجح وهو يعتبر دليل عن مستوى الرفاهية التي يمكن أن يحض بها اقتصاد ما، ويمكن كتابة صيغته كالتالي:

معدل التبادل التجاري=(الرقم القياسي لكمية الصادرات /الرقم القياسي لكمية الواردات)*100.

إذا كانت النسبة أكبر من 100% تدل على تحسن التبادل التجاري للدولة، والعكس في حالة النسبة اقل من 100% .

-**الرقم القياسي للصادرات:** وهو مؤشر لقياس التغير في القيمة الكلية للصادرات في سنة معينة بالمقارنة بالقيمة المقابلة لها في سنة الأساس.

-**الرقم القياسي للواردات:** وهو مؤشر لقياس التغير في القيمة الكلية للواردات في سنة معينة بالمقارنة بالقيمة المناظرة لها في نفس سنة الأساس، مع العلم أن:

***سنة الأساس:** هي السنة أو الفترة التي تحسب أسعار سنة المقارنة بأسعارها[3].

***سنة المقارنة:** وهي السنة أو الفترة التي تنسب أسعارها لأسعار سنة الأساس بهدف قياس التغير في الأسعار.

[3] يراعى أن تكون سنة الأساس فترة عادية، أي تتميز بالاستقرار وان تكون قريبة نسبيا من فترة المقارنة.

2-الرقم القياسي بطريقة لاسبير: وهو الذي يحسب باستعمال العبارة الرياضية الموالية:

مجموع سعر سنة المقارنة*كمية سنة الأساس/(سعر سنة الأساس*كمية سنة الأساس)*100

المطلب الرابع: مؤشرات أخرى.

بالإضافة إلى المؤشرات السابقة الذكر، هناك أخرى أهمها (العابد و دهان، 2016، الصفحات 192-194):

أولا: مؤشر التركيز: ويعرف بHarfindahl-Hirschmann Index حيث يقيس درجة تركز المنتجات المصدرة والمستورة وفقا للعلاقة التالية:

$$H_{jk} = \frac{\sqrt{\sum_{i=1}^{n}\left(\frac{x_{ijk}}{X_{jk}}\right)^2} - \sqrt{1/n}}{1-\sqrt{1/n}}$$

حيث يمثل:

- x_{ijk} قيمة صادرات /واردات البلد j من المنتج i نحو الشريك k (العالم، بلد أو إقليم..).
- $X_{jk} = \sum_{i=1}^{n} x_{jk}$ مجموع صادرات /واردات البلد j نحو الشريك k.
- n عدد المنتجات وفق تصنيف الأمم المتحدة المستوى الثالث.
- يأخذ هذا المؤشر القيم من 0-1، واقترابه من الواحد يعني زيادة مستوى تركيز المبادلات الدولية للدولة على عدد محدود من المنتجات.

ثانيا: مؤشر التنويع: يحسب هذا المؤشر وفقا للعلاقة التالية:

$$S_i = \frac{\sum_i \left|h_{ij} - h_i\right|}{2}$$

حيث:

- h_{ij} حصة المنتج i من مجموع صادرات أو واردات البلد j .
- h_i حصة المنتج i من مجموع صادرات أو واردات العالم.
- تتراوح قيمة المؤشر بين0-1، واقترابها من الواحد يعني تقارب من الهيكل العالمي.

ثالثا: مؤشر التخصص

يحسب هذا المؤشر من خلال الفرق بين تدفقات الصادرات والواردات من المنتج i في البلدj نسبة إلى مجموع الصادرات والواردات، وتتراوح قيم هذا المؤشر بين1و+1،عبر عنه بالعلاقة التالية:

$$TSI_{ji} = \frac{X_j^i - M_j^i}{X_i^i + M_i^i}$$

القيم الموجبة لهذا المؤشر تعني بأن البلد يصدر أكثر مما يستورد، والقيم السالبة تعني بأنه بلد استهلاكي ولا يحقق اكتفاءه الذاتي من المنتج المعني.

رابعا: مؤشر تنويع المنتجات حسب المهارات وكثافة التكنولوجيا

يمكن القول بأن هذا المؤشر هو الذي نستخلص منه درجة اعتماد الدولة في تجارتها الخارجية على التكنولوجيا المتطورة والمهارة العالية، حيث ارتفاع قيمة صادرات الدولة من هذه المنتجات يعني امتلاكها لتنافسية خارج السعر وكلما تراجعت هذه القيمة يعني تراجعت التنافسية خارج السعر للدولة.

خلاصة الفصل:

تعد التجارة الخارجية أداة أساسية في الاقتصاد العالمي، حيث تعتبر من القطاعات الحيوية لدى كل البلدان، لما لها من أهمية كبيرة في تحقيق التنمية والرفاهية الاقتصادية، حيث تعمل على تقسيم العمل الدولي وتقريب المسافات بين الدول وغيرها، فقد كان السبب الرئيسي لقيام التجارة الخارجية هو مشكلة الندرة النسبية، الأمر الذي أدى إلى ظهور مجموعة من النظريات الاقتصادية المتمثلة في: النظريات الكلاسيكية، النظريات النيوكلاسيكية والنظريات الحديثة، التي سعت إلى الكشف عن أسس التبادل التجاري بين الدول انطلاقا من فرض حرية التجارة، فقيام التجارة بين الدول لابد أن يكون وفق سياسة تجارية معينة تختلف من دولة لأخرى باختلاف النظم الاقتصادية والتي تهدف من خلالها إلى تحقيق التوازن في اقتصادها والمحافظة على أمنه إلى غير ذلك من الأهداف المذكورة سلفا، ويعتمد تحليل التجارة الخارجية لأي دولة على مؤشرات ألا وهي: الميزان التجاري، هيكل الصادرات وهيكل الواردات، والتي على أساسها يمكن معرفة درجة الانفتاح الاقتصادي وكذا معدل التبادل التجاري.

الجانب التطبيقي

قياس أثر تغيرات أسعار البترول على متغيرات التجارة الخارجية

تمهيد

سنحاول في هذا الفصل تقديم تحليل يتماشى مع واقع النظرية الاقتصادية والواقع الاقتصادي الجزائري من أجل تأكيد أو نفي ما سنستخلصه من دراستنا التحليلية لمتغير سعر البترول وتأثيره على التجارة الخارجية في الجزائر خلال الفترة (1990- 2020)، وذلك انطلاقا من دراسة تطورات سعر البترول، الصادرات وكذلك الواردات والميزان التجاري، وكذا التعريف بالطريقة المستخدمة في القياس، وتقدير النموذج واختبار جودته وصلاحيته، وكذلك عرض ومناقشة وتحليل النتائج المتحصل عليها، وهذا وفق المباحث التالية:

المبحث الأول: تعريف متغيرات الدراسة وتحليل اتجاهاتها.

المبحث الثاني: الأدوات المستعملة في الدراسة.

المبحث الثالث: نتائج الدراسة ومناقشتها.

المبحث الأول: تعريف متغيرات الدراسة وتحليل اتجاهاتها.

من أجل دراسة اثر تغيرات أسعار البترول على متغيرات التجارة الخارجية لابد من التطرق إلى تعريفها ومعرفة اتجاه تغيرها، وكذلك محاولة ربط هذه التغيرات بالواقع كما سيتم ذكره.

المطلب الأول: تعريف متغيرات الدراسة.

تعد مرحلة صياغة النموذج القياسي من أهم مراحل بناء هذا الأخير وأصعبها، حيث يتم خلالها تحديد المتغيرات المستقلة والتي يمكن أن تؤثر على المتغير التابع، بالنسبة لهذه الدراسة التي تغطي الفترة من 1990-2020 اشرنا بالرمز:

(PO): للمتغير المستقل ممثل في سعر البترول مقيم بالدولار لكل برميل.

(EX): للمتغير التابع الأول ممثل في قيمة الصادرات، وهو مقيم بالمليار دولار.

(IM): للمتغير التابع الثاني ممثل في قيمة الواردات، وهو الآخر مقيم بالمليار دولار.

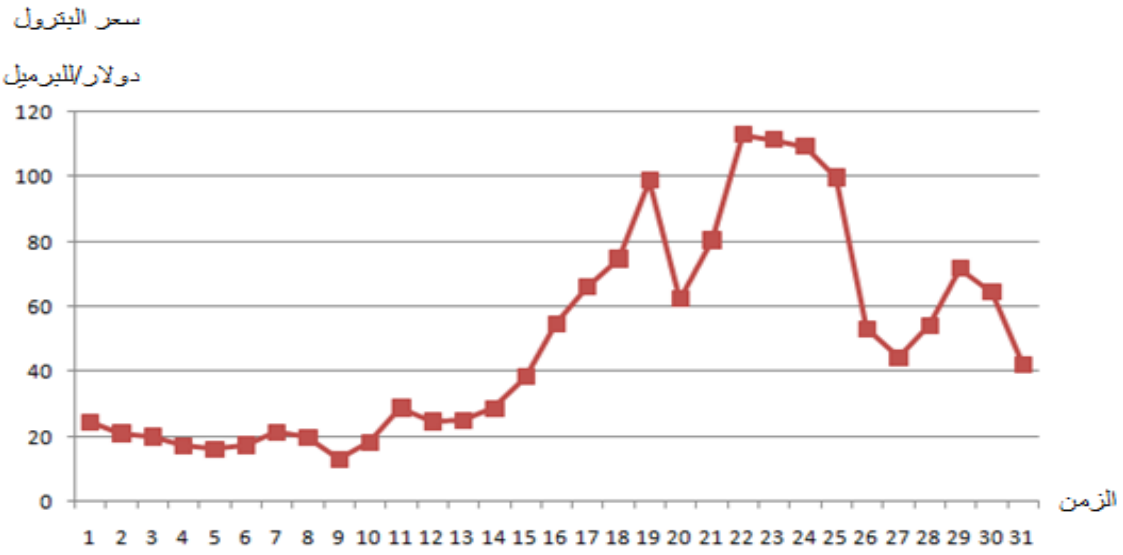
(BC): وهو يعكس المتغير التابع الثالث ممثل في رصيد الميزان التجاري مقيم بالمليار دولار.

وقد تم الاعتماد على أربعة سلاسل زمنية تعكس تطور الظواهر الأربعة السابقة، وتغطي الفترة من 1990-2020، أي تتوفر كل سلسلة على 31 مشاهدة.

المطلب الثاني: الدراسة الإحصائية والاقتصادية لمتغيرات الدراسة.

أولا: تطور أسعار البترول خلال الفترة (1990-2020): كما يظهر في الشكل رقم (01) فقد بلغ متوسط سعر البترول خلال فترة الدراسة الممتدة من سنة 1990 إلى سنة 2020 حوالي 49.48 دولار/للبرميل، في حين بلغ أعلى سعر لهذا الأخير سنتي 2011 و2012 بأكثر من 112 دولار/برميل و 111 دولار/برميل على التوالي خلال نفس الفترة السابقة، تحت تأثير: الأداء الضعيف للدولار مقابل اليورو، أحداث الربيع العربي الذي شهدته المنطقة العربية، والتي أقلقت العالم من احتمال انتشارها لدول أخرى منتجة للنفط داخل المنطقة العربية، والتي تدعمت كذلك بالمضاربات المفرطة في سوق النفط، والحضر على تصدير البترول الإيراني الذي فرضته الولايات المتحدة الأمريكية والاتحاد الأوروبي سنة 2012، والذي تسبب في انكماش العرض البترولي بنحو مليون برميل يوميا من السوق.

الشكل (01): تطور أسعار البترول خلال الفترة 1990-2020.



المصدر: من إعداد الطالبتين اعتمادا على معطيات الملحق(01).

رغم الاتجاه العام التصاعدي الذي تعرفه أسعار البترول والمقدرة بحوالي2.45 دولار لكل سنة ابتداءا من بداية فترة الدراسة، والتي يظهرها الجدول الموالي أين تبين أن معلمة الاتجاه العام معنوية($t = 5.19 \geq 2$)، فأسعار البترول عرفت انتكاسات حادة كتلك التي حدثت سنة 1998 أين بلغ السعر أدنى مستوى له خلال فترة الدراسة والمقدر بأقل من 14 دولار/للبرميل بسبب الأزمة المالية الأسيوية مما دفع بمنظمة أوبك في 29 نوفمبر 1997 إلى رفع سقف إنتاجها بحوالي 10%، ومع تزامن الركود الذي أصاب دول جنوب شرق آسيا، مما خلق فائض في السوق العالمية، مع العلم أن سوء الوضع السابق بالنسبة للأسعار تدعم أكثر بعودة دولة العراق إلى السوق.

الجدول(01): نتائج تقدير معادلة الاتجاه العام لسعر البترول خلال الفترة 1990-2020.

Dependent Variable: P
Method: Least Squares
Date: 05/04/23 Time: 21:20
Sample: 1990 2020
Included observations: 31

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
T	2.455714	0.472512	5.197142	0.0000
C	10.19310	8.661295	1.176856	0.2488

R-squared	0.482238	Mean dependent var	49.48452
Adjusted R-squared	0.464384	S.D. dependent var	32.15232
S.E. of regression	23.53093	Akaike info criterion	9.216849
Sum squared resid	16057.43	Schwarz criterion	9.309364
Log likelihood	-140.8612	Hannan-Quinn criter.	9.247007
F-statistic	27.01028	Durbin-Watson stat	0.469641
Prob(F-statistic)	0.000015		

المصدر: من إعداد الطالبتين اعتمادا على برنامج Eviews 12.

ثانيا: التحليل الإحصائي والاقتصادي لسلسلة الصادرات: وضعت مختلف الحكومات المتعاقبة في الجزائر هدف ترقية الصادرات خارج قطاع المحروقات صوب عينيها وهذا منذ بداية السنوات

الأولى للاستقلال، أين حاولت هذه الأخيرة بناء اقتصاد متنوع لا يعتمد على مورد البترول، وهذا من خلال تعديل القوانين الخاصة بالاستثمار سواء الأجنبي منه أو المحلي وإبرام اتفاقيات تعاون اقتصادي وشراكة مع عديد الدول، وكذلك تشجيع الاستثمار خاصة الأجنبي منه، فضلا عن التوسع في الاستثمارات العامة، ولكن كل هذه المحاولات باءت بالفشل في بعض الأحيان، وفي أحيان أخرى أعطت نتائج غير مرضية، ولعل الإحصائيات الواردة في الجدول الموالي خير برهان على ما سبق، حيث يظهر لنا تطور هيكل الصادرات في الجزائر خلال الفترة 1990-2020.

الجدول(02): تطور هيكل الصادرات الجزائرية خلال الفترة 1990-2020.

الوحدة: نسبة مئوية من الصادرات الكلية.

السنوات		1990	1991	1992	1993	1994	1995	1996
الصادرات	محروقات	95.91	96.22	95.39	94.90	96.85	94.83	95.68
	خ محروقات	4.09	3.78	4.61	5.10	3.15	5.17	4.32
السنوات		1997	1998	1999	2000	2001	2002	2003
الصادرات	محروقات	95.36	96.35	96.67	97.27	97.06	96.79	98.07
	خ محروقات	4.64	3.65	3.33	2.73	2.94	3.21	1.93
السنوات		2004	2005	2006	2007	2008	2009	2010
الصادرات	محروقات	97.92	98.4	97.93	98.38	98.21	98.29	98.3
	خ محروقات	2.08	1.60	2.07	1.62	1.79	1.71	1.70
السنوات		2011	2012	2013	2014	2015	2016	2017
الصادرات	محروقات	98.32	98.39	98.37	97.22	95.70	95.25	96.04
	خ محروقات	1.68	1.61	1.63	2.78	4.3	4.75	3.96
السنوات		2018	2019	2020	**2020-1990**			
الصادرات	محروقات	94.60	94.14	91.29	**96.58**			
	خ محروقات	5.40	5.86	8.71	**3.41**			

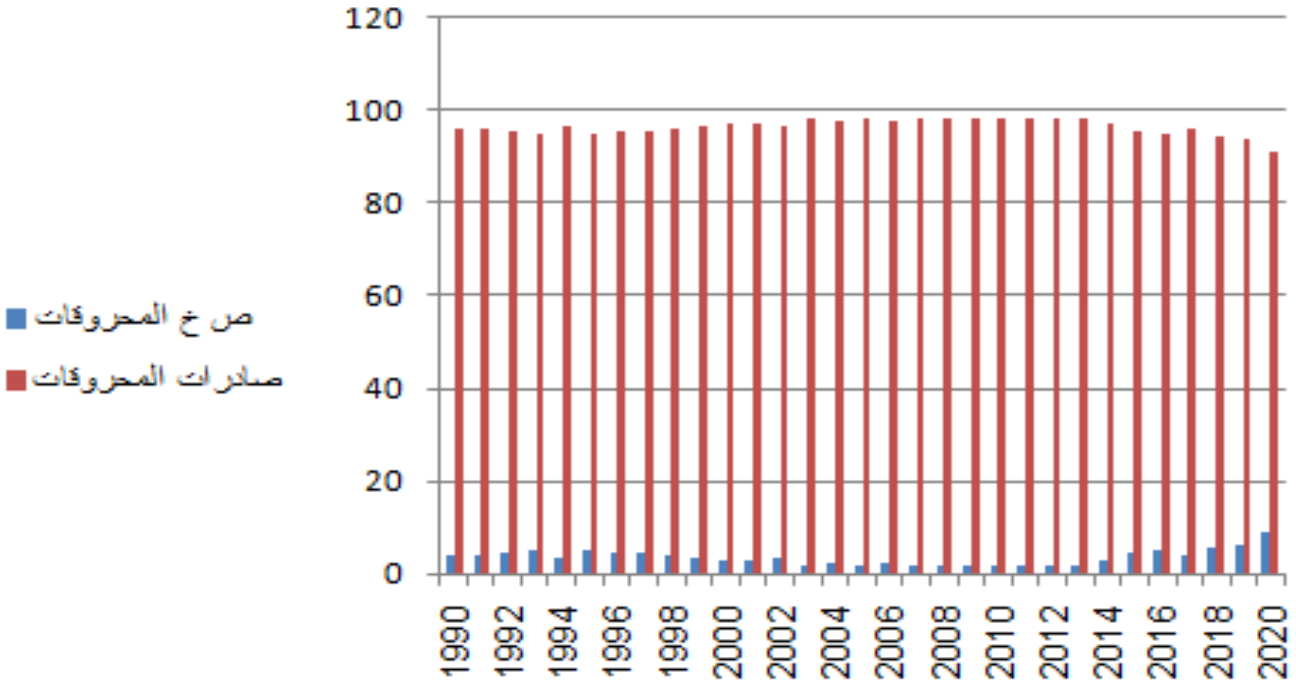
المصدر: من إعداد الطالبتين اعتمادا على إحصائيات بنك الجزائر.

من خلال الجدول السابق يظهر لنا تطور صادرات المحروقات كنسبة من الصادرات الكلية خلال الفترة 1990-2020، وكذلك نظيرتها الصادرات خارج قطاع المحروقات خلال نفس الفترة، حيث يظهر الاعتماد الكلي للصادرات الجزائرية على مورد البترول وبعض مشتقاته، فقد قدرت نسبتها من الصادرات الكلية 96.58% كمتوسط لفترة الدراسة، مع تأرجحها ارتفاعا وانخفاضا بين أعلى قيمة والمقدرة بحوالي 98% سنة 2005، 2011 و2012 بسبب الارتفاع الحاد لسعر البترول في الأسواق العالمية أين بلغ عتبة 112 دولار/للبرميل و111 دولار/للبرميل

خلال السنتين السابقتين على التوالي كما يوضحه الشكل الموالي رقم(02)، واقل قيمة سنة 1995 بحوالي 94.83% وهو ما اثر على مداخيل الدولة من النقد الأجنبي وتسبب في بروز أداء ضعيف جدا للميزان التجاري، أين سجل حالة من بين أسوء حالاته خلال نفس السنة.

الشكل(02): تطور هيكل الصادرات الجزائرية خلال الفترة 1990-2020.

الوحدة: نسبة مئوية من الصادرات الكلية.



المصدر: من إعداد الطالبتين اعتمادا على معطيات الملحق(01).

إدراك الحكومة الجزائرية بضرورة الخروج من التبعية للبترول جعلها سنة 2018 تقوم بخطوات جادة لحل هذا الإشكال، تمثلت في المجهودات التي قامت بها وزارة التجارة لترقية الصادرات خارج المحروقات، خاصة بعد التراجع الكبير الذي عرفته صادرات المحروقات سنة 2016 أين مثلت نسبة 95.25% من الصادرات الكلية، وهو ما تجسد في الاتجاه العام النازل لنسبة صادرات المحروقات كنسبة من الصادرات الكلية كما هو ظاهر في الشكل السابق، حيث تحسن هذا المؤشر من 96.04% سنة 2017 إلى حوالي 91% سنة 2020، إلا أن كل الجهود السابقة لم ترقى إلى التطلعات المطلوب، أي لم يكن لها اثر كبير في الرفع من قيمة الصادرات خارج المحروقات بالمقدار الكبير والمطلوب، حيث بقيت تحت سقف 03 مليار دولار.

ثالثا: التحليل الإحصائي والاقتصادي لسلسلة الواردات: بلغ متوسط قيمة الواردات خلال فترة الدراسة حوالي 30 مليون دولار، وهي تعرف اتجاه عام تصاعدي ابتداءا من سنة 1990 أين كانت تقدر بحوالي 8.77 حتى سنة 2020 حين بلغت 35.42 مليار دولار، وهذا ما يؤكده الجدول الموالي، الذي يظهر معنوية معلمة انحدار الواردات على عنصر الزمن، حيث قدرت

قيمة t المحسوبة بحوالي $t_{cal}=10.89$ وهي اكبر من القيمة اثنان $2 \prec t_{cal}=10.89$، وهذا ما يعني أن قيمة الواردات الجزائرية تسلك اتجاها عاما تصاعديا خلال الفترة الممتدة من1990-2020 والذي بلغ حوالي 1.82 مليار دولار لكل سنة، مع العلم أن معامل الارتباط بين الواردات والزمن بلغ 0.803، وأن 79.67% من التغيرات الحاصلة في الواردات تفسر باستعمال عامل الزمن.

الجدول(03):نتائج تقدير معادلة الاتجاه العام للواردات الجزائرية خلال الفترة 1990-2020.

Dependent Variable: I
Method: Least Squares
Date: 05/06/23 Time: 16:27
Sample: 1990 2020
Included observations: 31

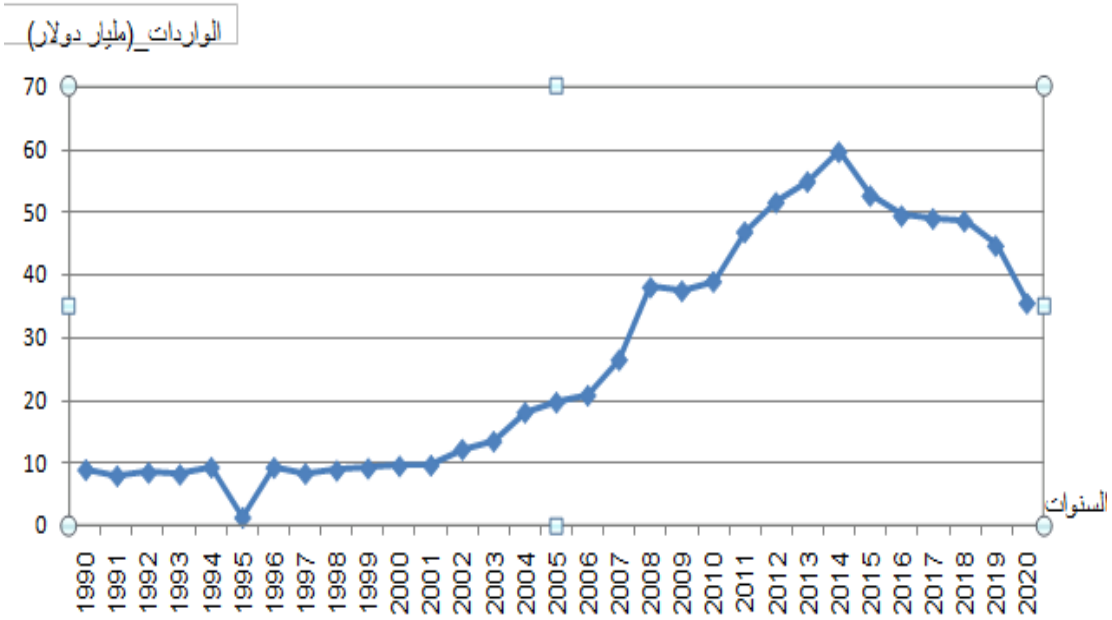
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
T	1.824799	0.167552	10.89095	0.0000
C	-2.669168	3.071276	-0.869075	0.3919

R-squared	0.803540	Mean dependent var	26.52761
Adjusted R-squared	0.796766	S.D. dependent var	18.50872
S.E. of regression	8.344014	Akaike info criterion	7.143307
Sum squared resid	2019.055	Schwarz criterion	7.235822
Log likelihood	-108.7213	Hannan-Quinn criter.	7.173464
F-statistic	118.6128	Durbin-Watson stat	0.243683
Prob(F-statistic)	0.000000		

المصدر: من إعداد الطالبتين اعتمادا على برنامج Eviews 12.

ويمكن إظهار تطور الواردات الجزائرية خلال الفترة (1990-2020) في الشكل الموالي:

الشكل(03): تطور قيمة الواردات الجزائرية خلال الفترة 1990-2020.



المصدر: من إعداد الطالبتين اعتمادا على معطيات الملحق(01).

هناك عدة تطورات مرت بها الواردات الجزائرية والتي كانت في فترات منفصلة كما سنوضحه فيما يلي:

خلال الفترة (1990-1993): شكل قانون المالية التكميلي لسنة 1990 نقطة انعطاف في القوانين التي تحكم سير التجارة الخارجية في الجزائر، من سيطرة الدولة على عمليات التجارة الخارجية إلى التحرير الجزئي لعمليات التجارة الخارجية، لذلك يمكن تسمية هذه المرحلة بمرحلة التحرير التدريجي أو التحرير المقيد، إلا أن تزامنها مع الانهيار الحاد في أسعار النفط في تلك السنوات جعل تأثير الإجراء الهيكلي السابق يكاد يكون معدوم، وهذا ما يوضحه الشكل أعلاه والملحق رقم (01)، بحيث نجد قيمة الواردات تطورت بالاتجاه السالب من 8.77 مليار دولار سنة 1990 إلى 7.99 مليار دولار عام 1994.

خلال الفترة (1994-1998): مرة أخرى حملت سنة 1994 حزمة من القوانين التي تشجع حرية التجارة الخارجية، بالنسبة للواردات تمثلت في إلغاء كل القيود المتعلقة بالاستيراد في افريل من نفس السنة وذلك على مراحل، ويتعلق الأمر بتمويل المواد الاستهلاكية المستوردة بالعملة الصعبة، وكذلك القيود المتعلقة باستيراد المعدات الصناعية، فضلا عن إزالة الحدود المفروضة على آجال سداد ائتمانات المستوردين ومنه السماح لاستيراد السلع ماعدا المحضورة منها، وفي إطار الانفتاح الاقتصادي والاندماج الجهوي تم تخفيف الحماية الجمركية، حيث تم تخفيض الحد الأقصى للرسوم الجمركية من 60% إلى 50% سنة 1996، وفي أول جانفي تم تخفيضه إلى 45%، كما تم حصر قائمة المواد الممنوعة إلى ثلاث مواد فقط.

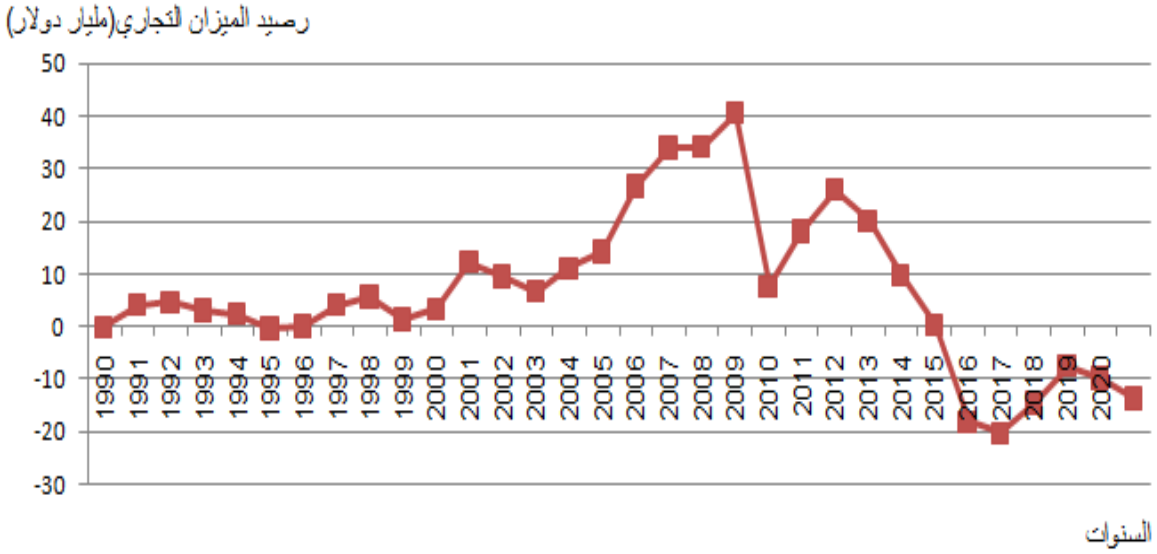
بالنسبة للواردات وكأنها غير معنية بهذه الإجراءات، وهذا بسبب تزامن هذه الأخيرة مع الانخفاض الحاد في أسعار البترول وكذلك تفاقم حجم الدين الخارجي، فقد بقيت قيمة الواردات ثابتة في حدود 09 مليار دولار، أي من 9.15 مليار دولار سنة 1994 إلى حوالي 8.96مليار دولار سنة 1999.

خلال الفترة (2000-2014): يبدو أن إجراءات الفترة السابقة الهادفة إلى تشجيع الانفتاح الاقتصادي كانت جد مؤثرة في جانب الواردات خلال هذه الفترة، والتي تميزت بالارتفاع المستمر لأسعار البترول من 28.77 دولار/للبرميل سنة 2000 إلى أكثر من 112 دولار للبرميل سنة 2011، والتي بالتوازي معها قفزت الواردات من 9.35 مليار دولار إلى حوالي 46.82 مليار دولار خلال نفس السنتين السابقتين، أي بارتفاع نسبته تقدر بحوالي 400%، وقد عرفت خلال السنوات الباقية حتى 2014 اتجاه تصاعدي من 51.56 مليار دولار سنة 2012 إلى أكثر من 59 مليار دولار سنة 2014، وهذا على الرغم من التراجع الذي عرفته أسعار البترول من 111.49 دولار/للبرميل سنة 2012 إلى اقل من 100 دولار/للبرميل سنة 2014.

خلال الفترة (2015-2020): هناك أحداث عالمية كثيرة حدثت خلال هذه الفترة، والتي ألقت بظلالها على كل من أسعار البترول وقيمة الواردات، يأتي في مقدمتها تباطؤ وتيرة النمو في الاقتصاد العالمي عام 2014، والذي أدى إلى تباطؤ الطلب على النفط في الصين، تدعم الحدث السابق بزيادة مخزونات النفط العام في الولايات المتحدة الأمريكية وارتفاع الدولار مدعوما بتوقعات تحسن الاقتصاد الأمريكي، وانتهى سيناريو التدعيم سنة 2019 بزلزال اقتصادي تمثل في انتشار وباء كورونا، مع العلم أن كل الأحداث السابقة مجتمعة ساهمت في انخفاض قيمة الواردات من حوالي 52 مليار دولار سنة 2015 إلى حوالي 35 مليار دولار سنة 2020.

رابعا: التحليل الإحصائي والاقتصادي للميزان التجاري: عرف الميزان التجاري في الجزائر خلال فترة الدراسة الممتدة من 1990-2020 نفس أعراض الاختلالات المزمنة التي شهدها قبل فترة الدراسة والمتمثلة في التذبذب من جهة، فضلا عن ارتباط رصيده بأسعار البترول من جهة أخرى كما يظهر في الشكل الموالي رقم(04).

الشكل(04): تطور الميزان التجاري في الجزائر خلال الفترة 1990-2020.



المصدر: من إعداد الطالبتين اعتمادا على معطيات الملحق(01).

فكما يظهر في الشكل أعلاه يمكن تقسيم تطورات الميزان التجاري إلى ثلاثة مراحل هي:

خلال الفترة(1990-2000): تميز رصيده خلال هذه الفترة بالضعف الشديد سواء في الاتجاه الموجب أو نظيره السالب، فأحسن النتائج الذي حققها هذا الأخير كانت في نهاية هذه الفترة (2000) بما قيمته 12.3 مليار دولار، مع العلم أن النتائج الطيبة للميزان التجاري بدأت منذ سنة 1995، قبل أن سجل في السنة السابقة لها رصيد سالب قيمته -0.26 مليار دولار، والسبب في هذا يرجعه اغلب المختصين في الشأن الاقتصادي لجملة من العوامل يتقدمها دخول الجزائر في مفاوضات مع صندوق النقد الدولي لإعادة الجدولة سنة 1994، وكذلك عجز

المؤسسات الوطنية عن الاستيراد وامتناع البنوك عن تقديم القروض اللازمة لعمليات الاستيراد، فضلا عن استفادة الجزائر في نهاية الفترة من قرض من طرف صندوق النقد الدولي قيمته 119928 مليون دولار وحدة حقوق سحب خاصة وهو ما ساهم في إنعاش الميزان التجاري، زيادة على ذلك شهدت هذه الفترة ارتفاع لأسعار البترول وتحسن قيمة الدولار وبالتالي زيادة عائدات الجزائر من صادرات المحروقات.

خلال الفترة (2000-2014): يمكن تسميتها بالعصر الذهبي في وضعية الميزان التجاري، فقد سجل خلالها رصيد موجب كبير كتلك النتيجة المسجلة سنة 2008 والبالغة حوالي 40.6 مليار دولار، ليعرف في السنة الموالية انخفاض حاد حتى 7.78 مليار دولار أي بما نسبته 80.83-% عن السنة السابقة، وهي أسوا نتيجة يحققها رصيده خلال هذه الفترة بسبب تداعيات الأزمة المالية العالمية وانخفاض الطلب على البترول، وعليه نستنتج انه منذ سنة 2000 بداية تطبيق سياسة الإنعاش الاقتصادي والتي تزامنت وضعف الهيكل الإنتاجي في البلاد أين يجب تغطية ذلك باللجوء إلى الأسواق الأجنبية، إلا أن الميزان التجاري عرف أحسن حالاته خلال هذه الفترة، والسبب الكامن وراء هذا يعزى إلى الاستقرار شبه الكلي والتحسن المستمر في أسعار البترول بالإضافة إلى نتائج هذه السياسة في حد ذاتها.

خلال الفترة(2015-2020): سجلت هذه الفترة عجز متتالي في الميزان التجاري من بدايتها سنة 2015 قدره 18.383- مليار دولار، إلى غاية سنة 2020 بعجز قدره 13.50- مليار دولار، حيث عرفت سنة 2016 أعلى قيمة للعجز بحوالي20.128- مليار دولار وذلك بسبب انخفاض أسعار النفط مما أدى إلى انخفاض قيمة الصادرات، في حين بلغت أدنى قيمة للعجز في الميزان التجاري 7.458- وذلك سنة 2018 لتعود للارتفاع في السنتين التاليتين وذلك راجع لتفشي جائحة كورونا التي اجتاحت العالم سنة 2019 وتأثيرها على أسعار النفط.

المبحث الثاني: الأدوات المستعملة في الدراسة.

الباحث في مجال القياس الاقتصادي في الغالب يواجه إشكاليتين: تتعلق الأولى باختلاف وحدات قياس المتغيرات المدرجة في النموذج-التابع والمستقل-، وتتصرف الثانية إلى شكل النموذج في حد ذاته فيما إذا كان خطي أو أسي أو غيرها.

المطلب الأول: الطريقة المعتمدة في الدراسة.

لان اغلب الاقتصاديين درج على ادخل اللوغاريتم الطبيعي على طرفي النموذج لحل الإشكاليتين المشار إليهما سابقا فضلا عن إشكالية القيم الشاذة، وبالتالي فهم يفترضون ضمنا أن النموذج من الناحية الرياضية يأخذ الشكل الموالي:

$$Y_i = A * X_i^B * e^{U_i}$$

حيث أن:

(Y_i): يشير إلى المتغير التابع، والذي في حالة دراستنا يشير للصادرات (EX)، أو الواردات (IM)أو الميزان التجاري (BC).

(X_i): يشير إلى المتغير المستقل، والذي هو في حالة دراستنا سعر النفط (PO).

(U_I): متغير عشوائي يشير إلى عنصر الخطأ.

(e): أساس اللوغاريتم وقيمته 2.71.

إدخال اللوغاريتم على طرفي المعادلة السابقة يجعلها تأخذ الصيغة الخطية الموالية:

$$LnY_i = LnA + BLnX_i + U_i \Leftrightarrow y_i = \beta_1 x_i + \beta_0 + e_i$$

من المعادلة السابقة يتضح أن النموذج الذي سيعتمد في الدراسة أصبح خطي، وهذا ما يعني أننا سنعتمد على طريقة المربعات الصغرى العادية للحصول على مقدرات هذا النموذج، وقد فضلنا استخدام هذه الطريقة على طرق القياس الأخرى ممثلة في: طريقة الإمكان الأعظم ML، طريقة المربعات الصغرى الموزونة WLS، طريقة المربعات الصغرى المقيدة RLS وطريقة بيز MB بسبب كون الأولى تعطي خصائص مثلى في حالة تحقق الافتراضات التي تقوم عليها، مع العلم أن النموذج كي يعتمد يجب أن يستجيب:

المطلب الثاني: التقييم وفقا لمعيار النظرية الاقتصادية.

يستند في هذا النوع من التقييم على الخلفية النظرية للنموذج المختار، ذلك أن هذا الأساس الذي يحدد جملة المتغيرات الأساسية الواجب إدخالها كمتغيرات مؤثرة على الظاهرة محل البحث، في هذا الصياغ نجد أن سعر البترول في الجزائر كبلد ريعي هو المتغير الأساسي والمؤثر على التجارة الخارجية، من خلال تأثيره على الصادرات وكذا الواردات باعتبارها كمؤشرات للتجارة الخارجية، هذا ما جعلنا نختار دالة كوب –دوغلاس كشكل للنموذج المدروس، والتي من أهم خصائصها إمكانية التعميم لأكثر من متغيرين، ولهذا نستخلص أن معايير التقييم من الناحية الاقتصادية هي في الحقيقة سابقة لعملية القياس .

إذا كان الأساس النظري للنموذج المختار يذهب لتحديد المتغيرات المفسرة لظاهرة ما، فانه كذلك ينصرف مسبقا للإشارة إلى افتراضات محددة عن إشارات المعالم المراد تقديرها (Piganid, 1978, p. 53)، أي تحديد **إشارات وقيم المعلمات**، والتي تستخدم للحكم على مدى سلامة التقديرات من الناحية الاقتصادية، لهذا تعتبر المعايير من النظرية الاقتصادية أول المعايير التي يجب أن نستخدمها لتقييم النتائج المتوصل لها من عملية القياس.

تكون إشارة المعالم في دالة كوب –دوغلاس كالتالي:

-**إشارة الجزء الثابت:** الجزء الثابت في أي نموذج قياسي أو اقتصادي هو عبارة عن كمية المتغير التابع عندما يكون هذا الأخير غير مفسر من طرف المتغيرات الخارجية، بالنسبة لدالة الانتاج يدعى معامل الفعالية أو أثر الانتاج، وقد أقرت المدرسة الحدية للإنتاج ضرورة أن يكون هذا الحد موجبا، وإذا كان سالبا يرفض النموذج المقدر، مع العلم انه في حالة نموذجنا يقبل حتى وان كانت المعلمة المقدرة التي تشير إليه سالبة، بسبب كوننا سنعتمد في عملية التقدير على القيم المحولة-بعد إدخال اللوغاريتم على القيم الأصلية-، وبذلك سيكون الجزء المعني بالكلام هنا هو e^A، وهذا الجزء موجب مهما كانت قيمة الثابت A $\left(e^A \succ 0 \forall A \in R\right)$، وهذا ما يتوافق تماما مع النظرية الاقتصادية التي تشير إلى أن الصادرات أو الواردات تأخذ قيمة موجبة حتى وان كانت قيمة المتغير المستقل صفر.

-**إشارة المرونات:** تشير المرونات في دالة كوب- دوغلاس إلى أسس المتغيرات المدرجة في النموذج، وهي تعبر عن نسبة تغير المتغير التابع إذا تغير أحد المتغيرات المستقلة بنسبة 1% (Guy, 1997, p. 20)، وأن قيمتها يجب أن تكون على الأقل أكبر من الصفر، وعليه يجب أن تكون موجبة دائما (فرحي، 2012، صفحة 247).

المطلب الثالث: التقييم الإحصائي.

تسمى هذه العملية أيضا باختبارات الدرجة الأولى، أو الاختبارات الإحصائية لمعالم النموذج القياسي، وهي تهدف إلى اختبار مدى الثقة الإحصائية في التقديرات الخاصة بمعلمات النموذج المحصل، وهي نوعان، إحداهما يختبر المعالم الواحدة تلوى الأخرى، والنوع الآخر يختبرها جملة واحدة.

أولا: اختبار ستودنت: يستعمل هذا الاختبار التوزيع الإحصائي لستودنت، ويختبر المعنوية الإحصائية لمعالم النموذج المقدر كل على حدا، وذلك بفرض تساوي احد المعالم للصفر واختبار مدى صحة هذا الفرض، وبالتالي ستكون الفرضية الصفرية والبديلة لهذا الاختبار كالتالي:

$H_0 : B_1 = 0$ تعني عدم وجود علاقة بين المتغيرين

$H_1 : B_1 = 0$ تعني وجود علاقة بين المتغيرين

قبول الفرضية الصفرية يعني أننا لم نوفق في اختيار المتغير المفسر، وعلى العكس من هذا نجد أن قبول الفرضية البديلة يعني أن المتغير المفسر المعني يؤثر في المتغير التابع، ولأجل الفصل بين الفرضين نلجأ إلى حساب إحصائية ستودنت، والتي تعطى بالعبارة التالية (تومي، 1999، صفحة 57):

$$t_{(n-k,\alpha)} = \frac{\hat{B}_1 - B_1}{SE\left[\hat{B}_1\right]}$$

(α):يعبر عن الخطأ المقبول في الاختبار أو مستوى المعنوية، وبالتالي $(1-\alpha)$ هو مستوى الاحتمال المقبول به.

$(n-k)$: تعبر عن درجات الحرية.

$SE\left[\hat{B}_1\right]$: يعبر عن الانحراف المعياري للمقدر $\left[\hat{B}_1\right]$.

نقارن بين الإحصائية المحسوبة t_{cal} والإحصائية الجدولية t_{tab} فإذا كانت $t_{tab} \succ t_{cal}$ فان الفرضية الصفرية صحيحة، أما إذا كان العكس فالفرضية البديلة هي الصحيحة، مع العلم أن هذا الاختبار يجرى لجميع معالم النموذج، بما فيها الجزء الثابت، والذي تحسب إحصائيته كالتالي:

$$t_{(n-k,\alpha)} = \frac{\hat{\beta}_0}{\sqrt{\left[\sum e_i^2 /(\hat{n}-2)\right] / \sum\left(X_i - \bar{X}\right)^2}}$$

ثانيا: اختبار إحصائية فيشر: يستخدم إحصائية فيشر لاختبار معالم النموذج دفعة واحدة، وهذا باستخدام إحصائية فيشر التي تبين نسبة التباين المفسر إلى التباين غير المفسر، والتي تحسب وفق الصيغة التالية (سلفادور، 1982، صفحة 168):

$$F_{(K-1,n-K,\alpha)} = \frac{\sum \hat{Y}_i^{\,2}/(K-1)}{\sum e_i^2/(n-k)} = \frac{R^2/(K-1)}{(1-R^2)/(n-K)}$$

(R^2):معامل التحديد المضاعف، (n):عدد المشاهدات، (K):عدد المعالم المقدرة، أما (α) فتعني مستوى المعنوية، في حين يشير $(\sum e_i^2)$: لمجموع مربعات البواقي.

يبنى اختبار فيشر على أساس فرضية العدم التي تنفي وجود ارتباط المتغير التابع والمتغيرات المستقلة، مقابل الفرضية البديلة التي تؤكد على الأقل معنوية واحد من المعالم المقدرة –معنوية المعالم مقبولة– وهذا ما يمكن التعبير عنه كالتالي:

$H_0 : C = B_1 = B_2 = B_3 = ...B_K = 0$ عدم معنوية معالم النموذج

$H_1 : \exists B_j \neq 0 \forall j \leq K$ معنوية على الأقل واحد من معلمات النموذج

إذا كان $F_{tab} \succ F_{cal}$ بمستوى معنوية (α) ودرجة حرية $(K-1)$و $(n-K)$ للبسط والمقام على الترتيب، فان فرضية العدم هي الصحيحة، وفي الحالة العكسية تكون الفرضية البديلة هي

الصحيحة، وهنا يمكن أن نستنتج أن إحصائية فيشر تمكننا من قبول النموذج ككل أو رفضه، على عكس الاختبار السابق إلي يمكننا من قبول أو رفض متغير واحد فقط.

المطلب الرابع: التقييم من الناحية القياسية.

تسمى كذلك اختبارات الدرجة الثانية، يضاف لذلك أن تحقق المشاكل التي تكشف عنها لا يعني رفض النموذج، بقدر ما يذهب إلى كون النموذج مرفوض فقط بصورته الأصلية، ويمكن أن يصبح مقبول بإجراء بعض التعديلات عليه، تتمثل هذه الاختبارات في:

أولا: انعدام ارتباط بين عناصر الخطأ من مشاهدة لأخرى: وهذا ما نعبر عنه رياضيا كما يلي:

$$E(U_S, U_T) = 0 .....S \neq T$$

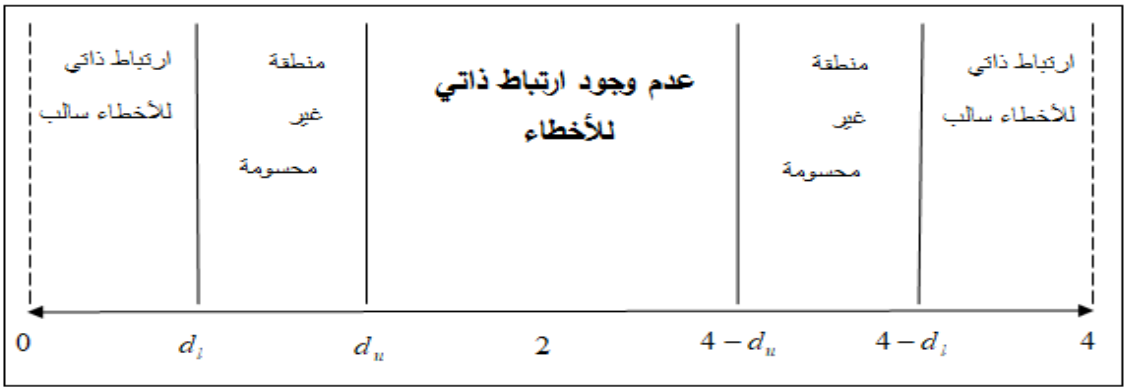
العبارة الرياضية السابقة تعني انه ليس هناك ارتباط بين عناصر الخطأ من مشاهدة لأخرى، غير أن هذه الفرضية يصعب تحقيقها دائما، خاصة إذا ما تعلق الأمر ببيانات على شكل سلاسل زمنية، وبالتالي يجب معالجة هذا الخلل حتى يصبح النموذج أكثر دقة.

لاكتشاف هذا الخلل نعتمد على إحصائية داربين–واتسون DW، نسبة للباحثين في علم الإحصاء: **Durbin** و**Watson**، إلا انه لا بد من الإشارة إلى أن عيب هذا المؤشر هو انه يفترض وجود ارتباط ذاتي للأخطاء من الدرجة الأولي فقط، والذي نعبر عنه رياضيا كالتالي:

$$U_t = \rho U_{t-1} + \varepsilon_t$$

إحصائية داربين–واتسون تنحصر في المجال من صفر حتى أربعة $DW \in [0,4]$، إلا أن الجداول الإحصائية الخاصة بمؤشر DW تأخذ بعين الاعتبار عدد المتغيرات المفسرة في النموذج وكذا عدد المشاهدات، كما تضع حد أدنى (Lower Limit,d_L) وحد أعلى (Upper Limit,d_u) بالنسبة لهذا المؤشر بحيث يصبح المجال الحقيقي كما يلي:

الشكل(05): مجالات وقوع إحصائية DW.



المصدر: من إعداد الطالبتين بالاعتماد على: (السيفو و مشعل، 2003، صفحة 322).

الشكل أعلاه يشير إلى انه كلما اقتربت DW المحسوبة من الصفر دل ذلك على وجود ارتباط ذاتي موجب، في حين كلما اقتربت هذه القيمة من العدد أربعة دل ذلك على وجود ارتباط ذاتي سالب، أما القيمة الوسطى لها فتعني انعدام الارتباط الذاتي، ولغرض إجراء الاختبار يستوجب إيجاد القيمة العليا d_u والقيمة الدنيا d_l لمعامل DW والموجودة في جداول خاصة محسوبة على أساس درجات الحرية n وعدد المتغيرات k ولمستوى دلالة معين α، وعليه فقرار وجود أو عدم وجود ارتباط ذاتي للأخطاء يعتمد على الشكل السابق.

ثانيا: حالة عدم تجانس التباين: من بين أهم الفرضيات التي تم وضعها عند استعمال طريقة المربعات الصغرى العادية في الحصول على مقدرات النموذج سواء البسيط منه أو العام، فرضية ثبات التباين من مشاهدة إلى أخرى، غير أن هذه الفرضية قد لا تتحقق في الواقع خاصة لما يتعلق الأمر بالبيانات المقطعية، وبالتالي فان عدم القيام بتصحيح هذا الخلل قد يقلل من دقة النموذج، أي أن استخدام (OLS) على بيانات تعاني من مشكلة عدم تجانس التباين يفقد الطريقة خاصة الكفاءة (Blue)، أي يعطي مقدرات لا تتمتع بخاصية أفضل مقدرات خطية غير متحيزة، في حين خاصية الخطية وعدم التحيز تبقى محققة (دومينيك، 1982، صفحة 216).

بالنسبة للنموذج البسيط يمكن التعبير على الخاصية السابقة رياضيا بالطريقة التالية:

$$E\left(U_i^2\right)=\sigma_{Ui}^2 \wedge E\left(U_iU_j\right)=0\forall i\neq j$$

هناك طرائق مختلفة تستعمل للكشف عن تجانس التباين، منها التي تعتمد على الرسم البياني الشامل لقيم بواقي المشاهدات، أو الرسم البياني لقيم البواقي وعلاقتها بالزمن، في نفس الوقت هناك الطرق الرياضية والتي تعتبر أكثر حسما في اختبار وجود مشكلة عدم تجانس التباين، يعتبر أهمها اختبار وايت وكذلك اختبار ARCH-LM.

ثالثا: اختبار وايت: تتمثل خطوات إجراء هذا الاختبار في (عبد القادر عطية، 2014، صفحة 448):

1-تقدير انحدار مساعد بين مربع الأخطاء $\left(\varepsilon_t^2\right)$ من ناحية، والمتغير أو المتغيرات $\left(X_{1t},X_{2t},X_{3t},.....X_{nt}\right)$ وكذلك المتغير أو المتغيرات $\left(X_{1t}^2,X_{2t}^2,X_{3t}^2,.....X_{nt}^2\right)$ من ناحية أخرى، أي تقدير الصيغة الرياضية التالية:

$$\varepsilon_t^2=\alpha_1+\alpha_2X_{2t}+\alpha_3X_{3t}+.....\alpha_kX_{tk}+\beta_1X_{2t}^2+\beta_2X_{3t}^2+.....\beta_kX_{tk}^2+U_t$$

2-حساب معامل التحديد R^2.

3-نختبر الفرض الصفري التالي:$\left(H_0:\alpha_1=\alpha_2=\alpha_3=.....\alpha_k=\beta_1=\beta_2=.....=\beta_k=0\right)$

وهذا بمقارنة القيمة $LM = nR^2$ مع (x^2) عند مستوى معنوية مرغوب ودرجات حرية تساوي عدد المعلمات الانحدارية في صيغة الانحدار المساعد، فإذا كان $nR^2 \succ x^2_{(k,0.05)}$ نرفض فرض العدم، وعليه توجد مشكلة عدم تجانس التباين، وهذا ما يعني أن: $\delta_t^2 = \alpha_1$.

رابعا: اختبار ARCH-LM: الغرض منه هو معرفة إذا كان هناك ارتباط بين مربعات البواقي، وهو يعتمد على إحصائية مضاعف لاغرانج وإحصائية (x^2)، تتمثل خطواته في (عبد القادر م.، 2005، صفحة 447):

1-تقدير النموذج العام بطريقة المربعات الصغرى العادية، ثم حساب $\left(\hat{\varepsilon}^2_{t-p}, \ldots\ldots, \hat{\varepsilon}^2_{t-1}, \hat{\varepsilon}^2_t\right)$.

2-نقوم بانحدار $\left(\hat{\varepsilon}^2_{t-p}, \ldots\ldots, \hat{\varepsilon}^2_{t-1}, \hat{\varepsilon}^2_t\right)$ كما يلي:

$$\hat{\varepsilon}^2_t = \beta_0 + \beta_1 \hat{\varepsilon}^2_{t-1} + \ldots\ldots\ldots\ldots + \beta_p \hat{\varepsilon}^2_{t-p} + U_t$$

3- نقوم بحساب معامل التحديد R^2.

4-نقوم باختبار الفرض العدمي التالي: $H_0: \beta_0 = \beta_1 = \ldots\ldots\ldots\ldots = \beta_P = 0$، وهذا بمقارنة القيمة $LM = nR^2$ مع (x^2) عند مستوى معنوية معين، ودرجة حرية تساوي عدد المعلمات الانحدارية في صيغة الانحدار السابق، فإذا كان $nR^2 \succ x^2_{(k,0.05)}$ نرفض فرض العدم، وبالتالي فالتباين للأخطاء غير متجانس.

خامسا: اختبار التوزيع الطبيعي للبواقي: وعليه فان فرض العدم يقوم على أساس أن البواقي تتبع التوزيع الطبيعي، مقابل الفرض البديل المعاكس، يستخدم اختبار شهير في هذا يتمثل في اختبار **جاك-بيرا**، ويعتمد القرار فيه على قيمة إحصائية **جاك-بيرا**، والتي تحسب بموجب الصيغة التالية:

$$S = \frac{n}{6}\beta_1 + \frac{n}{24}(\beta_2 - 3)^2 \rightarrow x^2_{(2,0.05)}$$

نقوم بمقارنة الإحصائية السابقة لجاك-بيرا مع إحصائية كاي مربع، بدرجات حرية مساوية لعدد المعالم المقدرة في الإحصائية السابقة (2)، ومستوى معنوية معين (في الغالب 5%)، فإذا تحقق $S \prec x^2_{(2,0.05)}$ فإننا نقبل فرضية العدم المشيرة للتوزيع الطبيعي للبواقي، والعكس صحيح (Regis, 2005, p. 230).

المبحث الثالث: نتائج الدراسة ومناقشتها.

من خلال هذا المبحث سيتم قياس أثر أسعار البترول على كل من الصادرات والواردات والميزان التجاري وذلك بتقدير النماذج الثلاثة وتقييمها اقتصاديا وإحصائيا وقياسيا،وتحديد درجة تأثر كل من المتغيرات بتغير سعر البترول وفق المطالب التالية

المطلب الأول: قياس اثر أسعار النفط على الصادرات(نموذج الصادرات): إدخال البيانات الواردة في الملحق الأول الخاصة بالصادرات مقومة بالمليار دولار، وكذلك سعر البترول مقوم بالدولار/للبرميل، ومن ثم تحويل بيانات هذه المتغيرات إلى الشكل اللوغاريتمي[4] لإمكانية تقديرها معلمات النموذج بطريقة المربعات الصغرى العادية، أعطى النتائج الملخصة في الجدول الموالي:

الجدول(04): نتائج تقدير نموذج الصادرات بدلالة سعر البترول خلال الفترة1990-2020.

Dependent Variable: EXX
Method: Least Squares
Date: 05/24/23 Time: 11:39
Sample: 1990 2020
Included observations: 31

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
POO	1.018143	0.041213	24.70414	0.0000
C	-0.467997	0.154416	-3.030762	0.0051

R-squared	0.954637	Mean dependent var	3.285688
Adjusted R-squared	0.953073	S.D. dependent var	0.707045
S.E. of regression	0.153164	Akaike info criterion	-0.852272
Sum squared resid	0.680318	Schwarz criterion	-0.759757
Log likelihood	15.21022	Hannan-Quinn criter.	-0.822115
F-statistic	610.2945	Durbin-Watson stat	2.238320
Prob(F-statistic)	0.000000		

المصدر: من إعداد الطالبتين اعتمادا على البرنامج الإحصائي Eviews12.

أولا: التقييم الاقتصادي للنموذج: النموذج من الناحية الاقتصادية مقبول، ذلك أن معلمة أسعار البترول موجبة والتي تمثل المرونة، مما يعني أن أسعار البترول تؤثر بشكل طردي على قيمة الصادرات، وهذا أمر مقبول بالنظر لكون الجزائر بلد ريعي يعتمد على البترول، وهذا يعني أن تغير أسعار البترول بنسبة 1% يؤدي إلى تغير في نفس الاتجاه للصادرات نسبته 1.018%، وهي مرونة كبيرة تفوق الواحد الصحيح وتثبت الأثر الكبير لأسعار البترول على الصادرات، وهذا ما يتوافق مع واقع كون الصادرات الكلية للجزائر اغلبها إن لم نقل كلها هي صادرات نفطية، ما يدعم هذه الحقيقة قيمة معامل التحديد المضاعف الذي بلغ 0.9546، وهذا ما يعني أن التغيرات في سعر البترول تفسر حوالي 95.46% من التغيرات الحاصلة في قيمة

[4] رغم أننا ندخل في البرنامج الإحصائي Log عند تحويل البيانات إلى الشكل اللوغاريتمي إلا انه يعتبرها Ln، أي اللوغاريتم الذي أساسه e=2.71.

الصادرات، أما النسبة الباقية 4.54% من التغيرات الحاصلة في قيمة هذه الأخيرة فترجع إلى عوامل أخرى غير مدرجة في النموذج، إذن هناك علاقة طردية قوية بين المتغير المستقل ونظيره التابع وهذا ما يثبته معامل الارتباط الذي بلغت قيمته 0.953، أي يقترب من الارتباط شبه التام –يقترب من الواحد الصحيح–.

ثانيا: التقييم من الناحية الإحصائية: عند النظر إلى معلمة أسعار البترول β_1 وكذلك معلمة الحد الثابت β_0 نلاحظ أن إحصائية t المحسوبة اكبر من اثنين $2 \prec 3.03 = \left|t_{\beta 0}\right|, 2 \prec 24.7 = \left|t_{\beta 1}\right|$، وهذا ما يشير لضرورة قبول الفرض البديل لهاتين المعلمتين، أي هي مقبولة عند مستوى المعنوية 5%.

كما أن إحصائية فيشر المحسوبة بلغت $F_{CAL} = 610.29$، وهي اكبر من الإحصائية الجدولية عند درجات حرية $df = n - 1 = 2 - 1 = 1$ للبسط و $df = n - K = 31 - 2 = 29$ للمقام والبالغة $F_{(1,29,0.05)} = 4.18$، وعليه نستنتج انه توجد على الأقل معلمة من معلمات النموذج مقبولة إحصائيا عند مستوى المعنوية 5%، وكل هذا يشير لقبول النموذج من الناحية الإحصائية.

ثالثا: التقييم من الناحية القياسية:

1- اختبار إحصائية داربين–واتسون: بلغت قيمة إحصائية داربين–واتسون $DW = 2.23$، وهي تقع بين $d_U = 1.57 \prec DW = 2.23 \prec 4 - d_U = 2.43$، على أساس أن $d_L = 1.297, d_U = 1.57$ عند $K = 2$، و $n = 31$ ومستوى معنوية 5%، وعند النظر إلى الشكل السابق رقم(10) نجد أن هذا يعني أن النموذج المقدر لا يعاني من مشكلة الارتباط الذاتي بين عناصر الخطأ العشوائي.

2–اختبار وايت لتجانس تباين الخطأ: بعد حساب قيمة مضاعف لاغرانج تبين أن هذه الأخيرة تساوي:

$$LM = nR^2 = 31 * 0.103 = 3.193$$

أما قيمة كاي مربع عند مستوى معنوية 5% ودرجات حرية يساوي عدد المعلمات المقدرة، والتي تبين أنها معلمتين كما يظهر في الجدول الموالي فإنها تساوي $x^2_{(2,0.05)} = 5.99$، وعند المقارنة تبين أن إحصائية مضاعف لاغرانج اقل من إحصائية كاي مربع، وهذا ما يتركنا نقبل فرض العدم، مما يشير لكون النموذج المقدر لا يعاني من مشكلة عدم تجانس تباين الخطأ.

الجدول(05): نتائج اختبار وايت لتجانس تباين الخطأ لنموذج الصادرات.

Heteroskedasticity Test: White
Null hypothesis: Homoskedasticity

F-statistic	1.622161	Prob. F(2,28)	0.2155
Obs*R-squared	3.218953	Prob. Chi-Square(2)	0.2000
Scaled explained SS	1.091923	Prob. Chi-Square(2)	0.5793

Test Equation:
Dependent Variable: RESID^2
Method: Least Squares
Date: 05/24/23 Time: 12:08
Sample: 1990 2020
Included observations: 31

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-0.210936	0.132095	-1.596854	0.1215
POO^2	-0.017681	0.009834	-1.798003	0.0830
POO	0.130489	0.073067	1.785876	0.0850

R-squared	0.103837	Mean dependent var	0.021946
Adjusted R-squared	0.039826	S.D. dependent var	0.019642
S.E. of regression	0.019247	Akaike info criterion	-4.971157
Sum squared resid	0.010373	Schwarz criterion	-4.832384
Log likelihood	80.05293	Hannan-Quinn criter.	-4.925920
F-statistic	1.622161	Durbin-Watson stat	1.115895
Prob(F-statistic)	0.215485		

المصدر: من إعداد الطالبتين اعتمادا على البرنامج الإحصائي Eviews12.

3-نتائج ARCH-LM: يعتمد هذا الأخير على قيمة إحصائية مضاعف لاغرانج وإحصائية كاي مربع، وعند النظر للجدول الموالي الذي يساعد في حساب الأولى والجداول الإحصائية التي تساعد على استنتاج الثانية، تبين أن:

$$LM = nR^2 = 30 * 0.113 = 3.39$$

$$x^2_{(1,0.05)} = 3.84$$

هذا يعني أن $LM = 3.39 \prec x^2_{(1,0.05)} = 3.84$، وهذا ما يتركنا نرفض الفرض البديل لصالح الفرض العدم، مما يعني مرة أخرى أن التباين الشرطي للأخطاء ثابت.

الجدول(06): نتائج اختبار ARCH-LM لنموذج الصادرات.

Heteroskedasticity Test: ARCH

F-statistic	12.77196	Prob. F(1,28)	0.0013
Obs*R-squared	9.397606	Prob. Chi-Square(1)	0.0022

Test Equation:
Dependent Variable: RESID^2
Method: Least Squares
Date: 05/24/23 Time: 12:25
Sample (adjusted): 1991 2020
Included observations: 30 after adjustments

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.008939	0.004514	1.980478	0.0576
RESID^2(-1)	0.589843	0.165047	3.573788	0.0013

R-squared	0.113253	Mean dependent var	0.021061
Adjusted R-squared	0.288727	S.D. dependent var	0.019340
S.E. of regression	0.016311	Akaike info criterion	-5.329638
Sum squared resid	0.007449	Schwarz criterion	-5.236224
Log likelihood	81.94456	Hannan-Quinn criter.	-5.299754
F-statistic	12.77196	Durbin-Watson stat	1.730110
Prob(F-statistic)	0.001301		

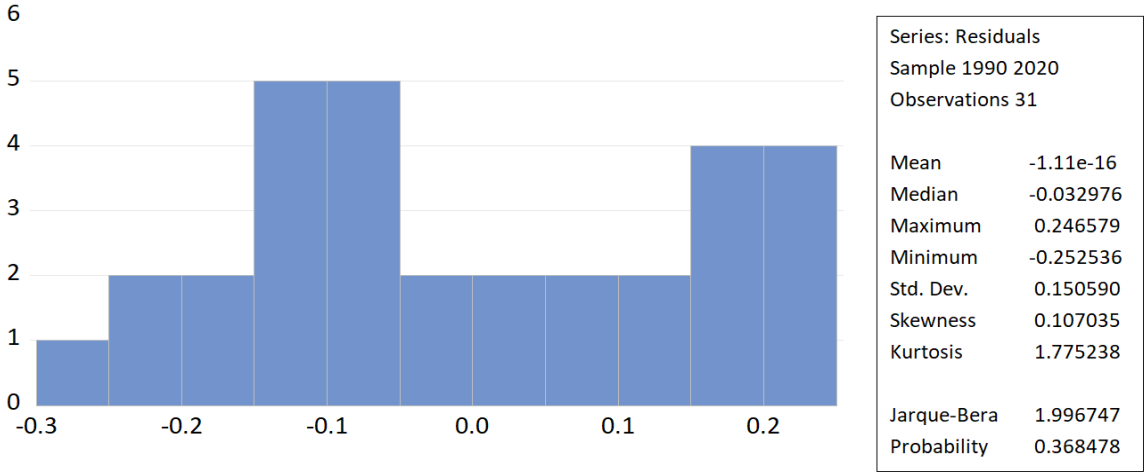
المصدر: من إعداد الطالبتين اعتمادا على البرنامج الإحصائي Eviews12.

4-اختبار جاك-بيرا لتوزيع البواقي: كما سبق التطرق له فان هذا الاختبار يستعمل لتأكيد أو نفي التوزيع الطبيعي لسلسلة البواقي، من خلال مقارنة إحصائية جاك-بيرا S مع إحصائية كاي-تربيع، بحيث من الجدول اللاحق نجد أن:

$$S = 1.996$$

من الجداول الإحصائية نجد أن إحصائية كاي مربع عند مستوى معنوية 5% ودرجات حرية 2 (درجات الحرية يساوي عدد المعلمات المقدرة في الصيغة الإحصائية لمعلمة جاك-بيرا والبالغ 2) يساوي $x^2_{(2,0.05)} = 5.99$، وهي أكبر من إحصائية جاك-بيرا المحسوبة $S = 1.996 \prec x^2_{(2,0.05)} = 5.99$، وعليه نجد أن سلسلة البواقي تتوزع توزيعا طبيعيا.

الشكل(06): نتائج اختبار إحصائية جاك-بيرا لنموذج الصادرات.



المصدر: من إعداد الطالبتين اعتمادا على البرنامج الإحصائي Eviews12.

مما سبق نستنتج أن العلاقة الدالية التي تربط قيمة الصادرات كمتغير تابع وسعر البترول كمتغير مستقل خلال الفترة 1990-2020 تأخذ الصيغة الدالية التالية:

$$EXX = 1.018POO - 0.467 + U_i$$
$$EX = e^{-0.467} * PO^{1.018} * e^{U_i}$$

المطلب الثاني: قياس اثر أسعار البترول على الواردات: وذلك بالقيام بنفس الإجراء الخاص بالصادرات على الواردات، أي إدخال المعطيات الخاصة بهذه الأخيرة وكذلك الخاصة بسعر البترول، ومن ثم إدخال اللوغاريتم عليها والقيام بعملية التقدير أعطى النتائج التي يلخصها الجدول الموالي:

الجدول(07): نتائج تقدير نموذج الواردات بدلالة سعر البترول خلال الفترة (1990-2020)

Dependent Variable: IMM
Method: Least Squares
Date: 05/18/23 Time: 18:30
Sample: 1990 2020
Included observations: 31

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
POO	1.037742	0.089719	11.56664	0.0000
C	-0.821953	0.336151	-2.445189	0.0208

R-squared	0.821853	Mean dependent var	3.003987
Adjusted R-squared	0.815710	S.D. dependent var	0.776693
S.E. of regression	0.333426	Akaike info criterion	0.703551
Sum squared resid	3.224021	Schwarz criterion	0.796067
Log likelihood	-8.905047	Hannan-Quinn criter.	0.733709
F-statistic	133.7871	Durbin-Watson stat	1.531310
Prob(F-statistic)	0.000000		

المصدر: من إعداد الطالبتين اعتمادا على البرنامج الإحصائي Eviews12.

أولا: التقييم الاقتصادي للنموذج: من الجدول السابق نستنتج أن النموذج يكتب وفق المعادلة التالية:

$IMM = 1.037POO - 0.821 + U_i$ أو بشكله الأصلي التالي: $IM = e^{-0.821} * PO^{1.037} * e^{U_i}$، وهذا ما يعني أن العلاقة بين قيمة الواردات وأسعار البترول علاقة طردية، بمعنى عند تغير سعر البترول بنسبة 1% يؤدي إلى تغير في نفس الاتجاه لقيمة الواردات نسبته 1.037%، وهذا ما يثبته معامل الارتباط الذي كانت قيمته 0.8157، الذي يؤكد أن العلاقة بين المتغيرين هي علاقة طردية قوية، وهذا ما يتوافق مع رأي النظرية الاقتصادية، كما أن معامل التحديد المضاعف هو كذلك كانت قيمته كبيرة 0.8218، ليدل هذا على أن 82.18% من التغيرات

الحاصلة في الواردات تفسر بالتغيرات الحاصلة في أسعار البترول، في حين تعزى النسبة الباقية 17.82% لعوامل أخرى غير مدرجة في النموذج.

ثانيا: التقييم الإحصائي للنموذج: نلاحظ أن قيمة $t_{\beta 1}=11.56, t_{\beta 0}=-2.44$ لمعلمة الجزء الثابت وأسعار البترول على الترتيب اكبر من 2 بالقيمة المطلقة، وهذا ما يعني أن كلا المعلمتين ذات معنوية إحصائية، أي النموذج مقبول عند النظر إلى المعلمات الواحدة تلوى الأخرى، كما أن إحصائية فيشر المحسوبة بلغت $F_{CAL}=133.78$ ، اكبر من الإحصائية الجدولية عند درجات حرية $df=n-1=1$ للبسط و $df=n-K=31-2=29$ للمقام والبالغة $F_{(1,29,0.05)}=4.18$ ، وعليه نستنتج انه توجد على الأقل معلمة من معلمات النموذج مقبولة إحصائيا عند مستوى المعنوية 5%، وكل هذا يشير لقبول النموذج من الناحية الإحصائية.

ثالثا: التقييم القياسي للنموذج.

1-اختبار إحصائية داربين-واتسون: بلغت قيمة إحصائية داربين-واتسون $DW=1.53$ ، وهي تقع بين $d_L=1.297, d_U=1.57$ ، على أساس أن $d_U=1.57 \prec DW=1.53 \prec 4-d_U=2.47$ عند $K=2$ ، و $n=31$ ومستوى معنوية 5%، وعند النظر إلى الشكل السابق رقم(10) نجد أن هذا يعني أن النموذج المقدر لا يعاني من مشكلة الارتباط الذاتي بين عناصر الخطأ العشوائي.

2-اختبار وايت لتجانس تباين الخطأ: قيمة إحصائية مضاعف لاغرانج استنادا للجدول الموالي تبلغ: $LM=nR^2=31*0.046=1.426$ ، في حين النظر إلى الجداول الإحصائية نجد أن إحصائية كاي مربع عند درجات حرية $df=2$ ومستوى معنوية 5% تساوي $x^2_{(2,0.05)}=5.99$ ، وهذا ما يتركنا نستنتج أن $LM=1.426 \prec x^2_{(2,0.05)}=5.99$ ، أي النموذج المقدر لا يعاني من مشكلة عدم تجانس تباين الخطأ.

الجدول(08): نتائج اختبار وايت لتجانس تباين الخطأ لنموذج الواردات.

Heteroskedasticity Test: White
Null hypothesis: Homoskedasticity

F-statistic	4.570905	Prob. F(2,28)	0.0191
Obs*R-squared	7.630110	Prob. Chi-Square(2)	0.0220
Scaled explained SS	6.107804	Prob. Chi-Square(2)	0.0472

Test Equation:
Dependent Variable: RESID^2
Method: Least Squares
Date: 05/18/23 Time: 18:36
Sample: 1990 2020
Included observations: 31

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-2.529015	0.881989	-2.867399	0.0078
POO^2	-0.189528	0.065658	-2.886580	0.0074
POO	1.435830	0.487865	2.943091	0.0065

R-squared	0.046132	Mean dependent var	0.104001
Adjusted R-squared	0.192285	S.D. dependent var	0.142992
S.E. of regression	0.128511	Akaike info criterion	-1.173834
Sum squared resid	0.462424	Schwarz criterion	-1.035061
Log likelihood	21.19443	Hannan-Quinn criter.	-1.128598
F-statistic	4.570905	Durbin-Watson stat	1.093415
Prob(F-statistic)	0.019148		

المصدر: من إعداد الطالبتين اعتمادا على البرنامج الإحصائي Eviews12.

3-اختبار ARCH-LM: أكد هذا الاختبار النتيجة المتوصل إليها باستخدام اختبار وايت، بحيث نجد أن إحصائية مضاعف لاغرانج استنادا لهذا الاختبار تساوي: $LM = nR^2 = 30 * 0.027 = 0.81$ ، وهي تقل عن إحصائية كاي مربع عند درجات حرية يساوي عدد المعلمات في الانحدار المساعد $K = 1$ ومستوى معنوية 5%، والبالغة $x^2_{(1,0.05)} = 3.84$ بالنظر إلى الجدول الإحصائي الخاص بكاي تربيع، وهذا ما يؤكد مرة أخرى أن النموذج لا يعاني من مشكلة عدم ثبات التباين الشرطي للأخطاء.

الجدول(09): نتائج اختبار ARCH-LM لنموذج الواردات.

Heteroskedasticity Test: ARCH

F-statistic	13.61154	Prob. F(1,28)	0.0010
Obs*R-squared	9.813291	Prob. Chi-Square(1)	0.0017

Test Equation:
Dependent Variable: RESID^2
Method: Least Squares
Date: 05/18/23 Time: 18:49
Sample (adjusted): 1991 2020
Included observations: 30 after adjustments

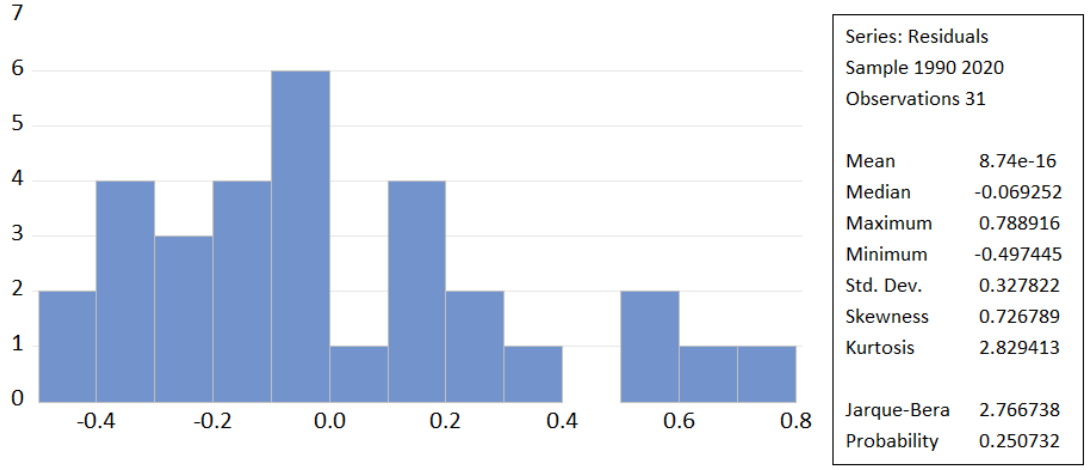
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	0.046357	0.027130	1.708676	0.0986
RESID^2(-1)	0.583647	0.158197	3.689382	0.0010

R-squared	0.027109	Mean dependent var	0.104069
Adjusted R-squared	0.303078	S.D. dependent var	0.145436
S.E. of regression	0.121413	Akaike info criterion	-1.314901
Sum squared resid	0.412750	Schwarz criterion	-1.221487
Log likelihood	21.72351	Hannan-Quinn criter.	-1.285017
F-statistic	13.61154	Durbin-Watson stat	1.432140
Prob(F-statistic)	0.000960		

المصدر: من إعداد الطالبتين اعتمادا على البرنامج الإحصائي Eviews12.

4-اختبار التوزيع الطبيعي لسلسلة البواقي: عدد المعلمات الانحدارية في صيغة حساب جاك-بيرا والبالغ معلمتين هو نفسه عدد درجات الحرية للإحصائية الجدولية لتوزيع كاي مربع، والتي نجدها عند مستوى معنوية 5% هو تساوي $x^2_{(2,0.05)} = 5.99$ ، أما الشكل الموالي فيؤكد أن قيمة إحصائية جاك-بيرا بلغت $S = 2.766$ ، مما يعني أن هذه الأخيرة اقل من إحصائية كاي مربع، ومنه نستنتج أن بواقي النموذج تتوزع توزيعا طبيعيا.

الشكل(07): نتائج اختبار إحصائية جاك-بيرا لنموذج الواردات.



المصدر: من إعداد الطالبتين اعتمادا على البرنامج الإحصائي Eviews12.

مما سبق نستنتج أن العلاقة الدالية التي تربط قيمة الواردات كمتغير تابع وسعر البترول كمتغير مستقل خلال الفترة 1990-2020 تأخذ الصيغة الدالية التالية:

$$IMM = 1.037POO - 0.821 + U_i$$
$$IM = e^{-0.821} * PO^{1.037} * e^{U_i}$$

المطلب الثالث: قياس اثر أسعار البترول على الميزان التجاري: عدم قدرتنا على إدخال اللوغاريتم على السلسلة الخاصة برصيد الميزان التجاري بسبب القيم السالبة لهذا الأخير في بعض السنوات، اضطررنا لترك القيم كما هي دون تحويل، وتقدير النموذج بطريقة المربعات الصغرى العادية أعطى النتيجة الموضحة في الجدول الموالي:

الجدول(10):نتائج تقدير نموذج الميزان التجاري / سعر البترول خلال الفترة1990-2020.

Dependent Variable: BC
Method: Least Squares
Date: 05/18/23 Time: 21:08
Sample: 1990 2020
Included observations: 31

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
PO	0.180780	0.079770	2.266267	0.0311
C	-1.909400	4.684827	-0.407571	0.6866

R-squared	0.150456	Mean dependent var	7.036387
Adjusted R-squared	0.121162	S.D. dependent var	14.98499
S.E. of regression	14.04789	Akaike info criterion	8.185162
Sum squared resid	5722.949	Schwarz criterion	8.277677
Log likelihood	-124.8700	Hannan-Quinn criter.	8.215319
F-statistic	5.135968	Durbin-Watson stat	1.726564
Prob(F-statistic)	0.031073		

المصدر: من إعداد الطالبتين اعتمادا على البرنامج الإحصائي Eviews12.

أولا: تقييم النموذج من الناحية الاقتصادية: يمكن كتابة النموذج الذي يعبر عن العلاقة بين رصيد الميزان التجاري وأسعار البترول بطريقة مبسطة كالتالي: $BC = 0.1807PO - 1.909$، وهذا ما يعني أن العلاقة بين المتغير التابع ممثل في رصيد الميزان التجاري والمتغير المستقل

ممثل في أسعار البترول علاقة طردية، وهذا ما يتفق مع واقع النظرية الاقتصادية التي تقر بذلك خاصة بالنسبة للدول الريعية كالجزائر، كما أن قيمة معامل الارتباط والمقدرة بحوالي 0.121 تقر بوجود علاقة ارتباطيه طردية بين المتغيرين السابقين لكنها ضعيفة، فضلا على أن معامل التحديد المضاعف لهذا النموذج كان مساو للقيمة 0.1504، وهذا ما يعني أن 15.04% من التغيرات الحاصلة في رصيد الميزان التجاري تعزى للتغيرات الحاصلة في أسعار البترول، والنسبة الباقية أي 84.96% ترجع لعوامل أخرى غير مدرجة في النموذج.

ثانيا: التقييم من الناحية الإحصائية: النظر إلى معلمات النموذج الواحدة تلوى الأخرى يبين أن قيمة هذه الأخيرة اكبر من اثنين $t_{B1} = 2.26 \succ 2$، وهذا ما يعني قبول الفرض البديل لهذه المعلمة، بمعنى جميع معالم النموذج مقبولة عند مستوى معنوية 5%، أما دراسة المعنوية الإحصائية للنموذج ككل، فبينت أن إحصائية فيشر المحسوبة قد بلغت $F_{cal} = 5.13$ وهي اكبر من القيمة الجدولية عند درجات حرية $df = 1$ للبسط و $df = 29$ والبالغة $F_{(1,29,0.05)} = 4.18$، وعليه نستنتج انه توجد على الأقل معلمة من معلمات النموذج مقبولة إحصائيا عند مستوى المعنوية 5%، وكل هذا يشير لقبول النموذج من الناحية الإحصائية.

ثالثا: التقييم من الناحية القياسية.

1-اختبار إحصائية داربين-واتسون: بلغت قيمة إحصائية داربين-واتسون $DW = 1.76$، وهي تقع في المجال $d_U \prec DW = 1.76 \prec 4 - d_U$، على أساس أن $d_U = 1.57$ و $d_L = 1.297$ عندما يكون عدد المعلمات المقدرة $K = 2$ و $n = 31$ ومستوى معنوية 5%، وبالتالي النموذج لا يعاني من مشكلة الارتباط الذاتي.

2-اختبار وايت لتجانس تباين الخطأ: قيمة إحصائية مضاعف لاغرانج استنادا للجدول الموالي تبلغ: $LM = nR^2 = 31 * 0.029 = 0.899$، في حين النظر إلى الجداول الإحصائية نجد أن إحصائية كاي مربع عند درجات حرية $df = 2$ ومستوى معنوية 5% تساوي $x^2_{(2,0.05)} = 5.99$، وهذا ما يتركنا نستنتج أن $LM = 0.899 \prec x^2_{(2,0.05)} = 5.99$، أي النموذج المقدر لا يعاني من مشكلة عدم تجانس تباين الخطأ.

الجدول(11): نتائج اختبار وايت لتجانس تباين الخطأ لنموذج الميزان التجاري.

Heteroskedasticity Test: White
Null hypothesis: Homoskedasticity

F-statistic	15.75138	Prob. F(2,28)	0.2610
Obs*R-squared	16.41244	Prob. Chi-Square(2)	0.0003
Scaled explained SS	11.35922	Prob. Chi-Square(2)	0.0034

Test Equation:
Dependent Variable: RESID^2
Method: Least Squares
Date: 05/18/23 Time: 21:18
Sample: 1990 2020
Included observations: 31

Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	-380.8534	105.1627	-3.621564	0.0011
PO^2	-0.173188	0.035245	-4.913874	0.0000
PO	23.49854	4.361888	5.387242	0.0000

R-squared	0.029433	Mean dependent var	184.6113
Adjusted R-squared	0.495822	S.D. dependent var	236.0178
S.E. of regression	167.5856	Akaike info criterion	13.17263
Sum squared resid	786378.2	Schwarz criterion	13.31140
Log likelihood	-201.1758	Hannan-Quinn criter.	13.21787
F-statistic	15.75138	Durbin-Watson stat	1.384293
Prob(F-statistic)	0.261000		

المصدر: من إعداد الطالبتين اعتمادا على البرنامج الإحصائي Eviews12.

3-اختبار ARCH-LM: هو الآخر يؤكد اختبار وايت، بحيث نجد أن إحصائية مضاعف لاغرانج استنادا لهذا الاختبار تساوي: $LM = nR^2 = 30 * 0.079 = 2.37$، وهي تقل عن إحصائية كاي مربع عند درجات حرية يساوي عدد المعلمات في الانحدار المساعد $K = 1$ ومستوى معنوية 5%، والبالغة $x^2_{(1,0.05)} = 3.84$ بالنظر إلى الجدول الإحصائي الخاص بكاي تربيع، وهذا ما يؤكد مرة أخرى أن التباين الشرطي للأخطاء ثابت.

الجدول(12): نتائج اختبار ARCH-LM لنموذج الميزان التجاري.

Heteroskedasticity Test: ARCH

F-statistic	38.59459	Prob. F(1,28)	0.1028
Obs*R-squared	17.38636	Prob. Chi-Square(1)	0.0000

Test Equation:
Dependent Variable: RESID^2
Method: Least Squares
Date: 05/18/23 Time: 21:27
Sample (adjusted): 1991 2020
Included observations: 30 after adjustments

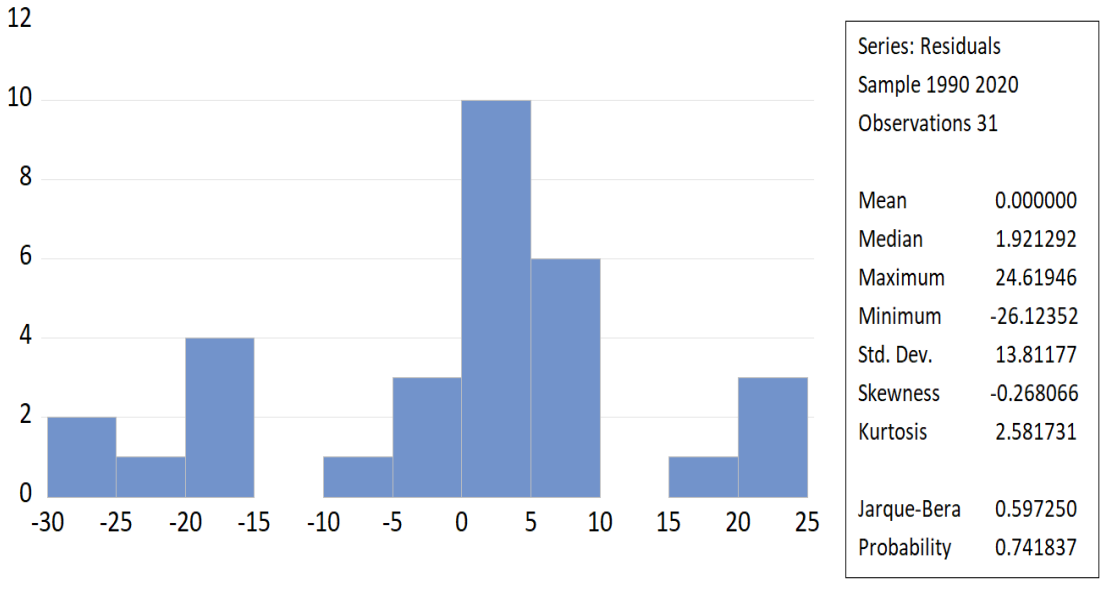
Variable	Coefficient	Std. Error	t-Statistic	Prob.
C	54.76533	36.02705	1.520117	0.1397
RESID^2(-1)	0.761496	0.122576	6.212455	0.0000

R-squared	0.079545	Mean dependent var	190.6699
Adjusted R-squared	0.564529	S.D. dependent var	237.5880
S.E. of regression	156.7849	Akaike info criterion	13.01197
Sum squared resid	688281.7	Schwarz criterion	13.10538
Log likelihood	-193.1795	Hannan-Quinn criter.	13.04185
F-statistic	38.59459	Durbin-Watson stat	1.623206
Prob(F-statistic)	00.10289		

المصدر: من إعداد الطالبتين اعتمادا على البرنامج الإحصائي Eviews12.

4-اختبار التوزيع الطبيعي: عند اخذ عدد المعلمات الانحدارية في صيغة حساب جاك-بيرا والبالغ معلمتين كما تم ذكره سابقا هو نفسه عدد درجات الحرية للإحصائية الجدولية لتوزيع كاي مربع، نجد أن قيمة هذه الأخيرة عند مستوى معنوية 5% هو $x^2_{(2,0.05)} = 5.99$، أما الشكل الموالي فيؤكد أن قيمة إحصائية جاك-بيرا بلغت $S = 0.597$، مما يعني أن هذه الأخيرة اقل من إحصائية كاي مربع، ومنه نستنتج أن البواقي تتوزع توزيعا طبيعيا.

الشكل(08): نتائج اختبار إحصائية جاك-بيرا لنموذج الميزان التجاري.



المصدر: من إعداد الطالبتين اعتمادا على البرنامج الإحصائي Eviews12.

مما سبق نستنتج أن النموذج الذي يعبر عن رصيد الميزان التجاري كمتغير تابع وسعر البترول كمتغير مستقل خلال الفترة 1990-2020 تأخذ الصيغة الموالية:

$$BC = 0.18PO - 1.909 + U_i$$

خلاصة الفصل:

من خلال هذا الفصل حاولنا قياس أثر تغيرات أسعار البترول على مؤشرات التجارة الخارجية خلال الفترة 1990-2020، وذلك انطلاقا من تقديم وتحليل المتغيرات والتعريف بالأدوات المستعملة في الدراسة، فالدراسة التحليلية للصادرات والواردات والميزان التجاري وتحليل أثر تقلبات أسعار البترول عليها تبين أن التجارة الخارجية للجزائر تعتمد اعتمادا شبه كلي على الإرادات المتأتية من قطاع المحروقات.

ومن أجل الدراسة القياسية استخدمنا طريقة المربعات الصغرى العادية، وذلك بتقدير ثلاث نماذج : نموذج الصادرات، نموذج الواردات ونموذج الميزان التجاري، حيث استخلصنا النتائج التالية:

1-وجود علاقة طرية قوية بين الصادرات وأسعار البترول، إذ أن ارتفاع أسعار البترول بنسبة1% يؤدي إلى ارتفاع الصادرات بنسبة1.018%.

2-وجود علاقة طردية قوية بين الواردات وأسعار البترول، فارتفاع البترول بنسبة1% يؤدي إلى ارتفاع الواردات بنسبة1.037%.

3-وجود علاقة طردية ضعيفة بين الميزان التجاري وأسعار البترول، إذ أن ارتفاع البترول بمقدار01 دولار يؤدي إلى ارتفاع الميزان التجاري بمقدار0.1807 مليار دولار.

الخاتمة

الخاتمة:

يعتبر قطاع المحروقات عصب الاقتصاد الجزائري باعتباره مصدرا للتمويل بالعملة الصعبة، ومورد طاقوي أساسي في الصناعة والتجارة والزراعة لا يمكن الاستهانة به، وذلك لما يوفره من عوائد ضخمة تساعد صناع القرار على تنفيذ مخططاتهم التنموية وتحقيق النمو والتقدم، فضلا على أنه في كثير من المرات ساعد الجزائر على تخطي الأزمات المتكررة عبر السنوات السابقة، إلا أنه جعل اقتصادها غير منتج بسبب الاعتماد المفرط على الصادرات البترولية واستعمالها في استراد المواد الاستهلاكية ومواد التجهيز، الشيء الذي تسبب في عدم تنمية الجانب الأهم للدولة وهو الجانب الإنتاجي وإهمال تطوير المؤسسات الإنتاجية وتنويعها لزيادة فعاليتها في تحقيق التنمية المستدامة في كافة المجالات الاقتصادية والاجتماعية، وهذا ما أظهر لنا المفارقات المتعلقة بهذا المورد، ما دعم هذا التوجه هو تعرضه لتقلبات حادة على مستوى السوق العالمي للبترول، وهذا ما أبقى التجارة الخارجية الجزائرية حبيسة التغيرات في أسعار البترول سواء بالإيجاب أو بالسلب، وهذا على الرغم من سعي الدولة إلى وضع برامج إصلاحية لإعادة الهيكلة والتنويع في الاقتصاد منذ الاستقلال إلى يومنا هذا.

من خلال تشخيصنا لوضعية التجارة الخارجية وعلاقتها بأسعار البترول، وهذا من خلال قراءتنا لمختلف البيانات الإحصائية المتعددة المصادر خلال الفترة 1990-2020، واستخدام الأساليب الإحصائية والقياسية في التحليل والاستنباط، تجمعت لدينا مجموعة من النتائج يمكن تلخيصها في:

1-أثبتت الدراسة لنموذج الصادرات أن معلمة أسعار البترول كانت موجبة بمعنى أن النموذج مقبول من الناحية الاقتصادية، وهذا ما يعني التأثير الطردي للأول على قيمة الصادرات، وهو ما يتوافق مع النظرية الاقتصادية، حيث أن تغير سعر البترول بنسبة 1% يؤدي إلى التغير في نفس الاتجاه للصادرات بنسبة 1.018%.

2-الارتباط القوي بين أسعار البترول وقيمة الصادرات، إن دل على شيء فإنما يدل على أن الجهود المبذولة لتنويع الصادرات لم ترقى للتطلعات المطلوبة، وبالتالي عدم كفاية الجهود الهادفة لفك الارتباط بين البترول وهذه الأخيرة، وهذا ما أكده مؤشر الصادرات خارج قطاع المحروقات الذي لم يتعدى في المتوسط خلال فترة الدراسة 1990-2020 عتبة **04%** من الصادرات الكلية.

3-حسب معامل التحديد المضاعف ترجع ما نسبته 95.46% من التغيرات الحاصلة في قيمة الصادرات إلى التغيرات في أسعار البترول وهذا ما أكده معامل الارتباط الذي قدر بحوالي 0.953، ليشير لوجود ارتباط طردي قوي بين أسعار البترول وقيمة الصادرات وهذا **ما يثبت صحة الفرضية الفرعية الأولى.**

4-أما فيما يخص الواردات، فالدراسة أثبتت أن نموذج الواردات مقبول من الناحية الاقتصادية، بحيث ظهرت إشارة معلمة أسعار البترول موجبة في نفس الفترة وهذا ما يفسر الأثر الطردي لأسعار البترول على قيمة الواردات، حيث تتغير قيمة هذه الأخيرة بنسبة 1.037% عند تغير أسعار البترول بنسبة 1%.

5-حسب معامل التحديد المضاعف في نموذج الواردات يظهر أن 82.18% من التغيرات الحاصلة في قيمة الواردات ترجع إلى التغيرات في أسعار البترول، حيث يقدر معامل الارتباط بحوالي0.8157، وهذا ما يثبت الارتباط الطردي القوي بين الواردات وأسعار البترول، بمعنى أن **الفرضية الفرعية الثانية محققة.**

6-من خلال نموذج الميزان التجاري تبين أن هناك علاقة طردية موجبة بين رصيد الميزان التجاري وأسعار البترول، حيث أن التغير في أسعار البترول بمقدار 1دولار يصحبه تغير في قيمة الميزان التجاري بمقدار0.1807مليار دولار.

7-تقدر قيمة معامل الارتباط بين سعر البترول ورصيد الميزان التجاري بحوالي0.121، حيث تقر بوجود ارتباط طردي ضعيف بين المتغيرين، فضلا عن أن معامل التحديد المضاعف المساوي 0.1504 أكد ذلك، بمعنى 15.04% من التغيرات الحاصلة في الميزان التجاري تعود إلى التغيرات في أسعار البترول، أما النسبة الباقية فترجع لعوامل أخرى غير مدرجة في النموذج، وهذا ما **ينافى الفرضية الفرعية الثالثة.**

ثانيا: اقتراحات الدراسة: على ضوء النتائج المتوصل إليها، يمكننا أن نقترح مجموعة من التوصيات، بحسب تقديرنا هي مهمة لفك الارتباط بين أسعار البترول والتجارة الخارجية، وبالتالي تفعيل سياسة التنويع الاقتصادي، من بينها:

1-على الدولة الجزائرية تنويع صادراتها خارج البترول للتقليل من التأثير السلبي لتقلبات أسعار البترول على اقتصادها.

2-التقليل من فاتورة الواردات وذلك بتشجيع الانتاج المحلي بغية استهلاكه داخليا وتصديره من أجل إخراج الميزان التجاري من حالة العجز.

3-انتهاج سياسات مغايرة في الاقتصاد تهدف إلى استغلال العائدات البترولية بفاعلية أكثر في المشاريع الاستثمارية التي تعطي قيمة مضافة.

4-دعم القطاع الزراعي لسد الاحتياجات الداخلية والتخفيف من الاستيراد وتنمية الصادرات خارج قطاع المحروقات.

5-تشجيع الصناعة البتر وكيماوية، من خلال تحفيز المستثمرين الأجانب والاستفادة من خبراتهم.

آفاق الدراسة: هناك عدة جوانب لم تفسح لنا الفرصة لدراستها والتي نرجو أن نتطرق إليها في المستقبل، أو أن تكون عناوين لدراسات مستقبلية لكل من يهمه هذا الحقل العلمي، ومن أبرز المواضيع:

1- تحديات الصادرات الجزائرية خارج المحروقات.

2- دراسة قياسية لأثر سعر البترول على النمو الاقتصادي والبطالة في الجزائر مقارنة بالدول العربية.

3-دراسة مقارنة لأثر سعر البترول على التجارة الخارجية بالنسبة للدول المنتجة للنفط.

4-آليات الخروج من الاقتصاد النفطي بالنسبة للاقتصاد الجزائري.

5-آفاق المشاريع الزراعية في الجزائر كبديل كإستراتيجية لتنويع الصادرات خارج المحروقات.

6-الصناعة البيتروكماوية كأسلوب للاستثمار الأجنبي وجلب العملة الصعبة.

المراجع:

أولا: المراجع باللغة العربية:

1-الكتب:

أحمد حشيش، ومجدي شهاب محمود. (2003). *أساسيات الاقتصاد الدولي*. بيروت، لبنان: منشورات الحلبي الحقوقية.

احمد رشيد مهدي. (2015). *جغرافيا النفط* (المجلد 1). عمان، الاردن: الجنادرية للنشر والتوزيع.

اسماعيل زاير. (2004). *أفضل أنواع النفط في العالم*. بغداد، بغداد، العراق: جامعة بغداد.

السيد متولي عبد القادر. (2011). *الاقتصاد الدولي-النظريات والسياسات-*. عمان: دار الفكر ناشرون وموزعون.

السيد محمد احمد السريتي. (2009). *اقتصاديات التجارة الخارجية*. الاسكندرية: مؤسسة رؤية للطباعة والنشر والتوزيع.

العطار رشاد، وواخرون. (2000). *التجارة الخارجية*. عمان: دار المسيرة للنشر والتوزيع والطباعة.

المركز العربي للابحاث ودراسة السياسات. (افريل2020). *كيف عصفت جائحة كورونا بأسعار النفط*. قطر: وحدة للدراسات السياسية.

أمينة مخلفي. (2014). *محاضرات حول مدخل الى الاقتصاد البترولي*. ورقلة: جامعة قاصدي مرباح.

توفيق محب حلة. (2014). *المفاهيم الاقتصادية المحورية والمستقرة*. مصر: دار الفكر الجامعي للنشر والتوزيع.

حسام علي داوود واخرون. (2002). *اقتصاديات التجارة الخارجية*. عمان-الاردن-: دار المسيرة للنشر والتوزيع والطباعة.

حسن الدغيري مديحة. (1998). *اقتصاديات الطاقة في العالم وموقف البترول العربي منها*. بيروت: دار الجيل.

خالد المرزوق. (بلا تاريخ). مذكرة السياسات الخارجية. بابل، العراق: جامعة بابل.

دبليو تشارلز سوير، وريتشارد ل سبرينكل. (2015). *الاقتصاد الدولي*. بيروت: مؤسسة صائغ عالمية ناشرون.

دومينيك سلفادور. (1982). *نظريات ومسائل في الاحصاء والاقتصاد القياسي*. (سعدية حافظ منتصر، وعبد العظيم أنيس، المترجمون) القاهرة: دار ماكجروهيل للنشر.

زينب حسين عوض الله. (2005). *الاقتصاد الدولي*. مصر: دار الجامعة الجديدة.

سامي عفيفي حاتم. (2003). *اقتصاديات التجارة الدولية*. عمان: مطبعة اسراء.

سامي عفيفي حاتم. (2005). *الاتجاهات الحديثة في الاقتصاد الدولي والتجارة الدولية-مبادئ اقتصاديات التجارة الدولية-*. القاهرة: الدار المصرية اللبنانية.

سامي عفيفي حاتم. (1999). *التجارة الخارجية بين التنظيم والتنظير*. القاهرة: الدار المصرية اللبنانية.

سوزي عدلي ناشز، ومجدي محمود شهاب. (2010). *أسس العلاقات الاقتصادية الدولية*. بيروت،لبنان: منشورات الحلبي الحقوقية.

صالح تومي. (1999). *مدخل لنظرية القياس الاقتصادي*. الجزائر : ديوان المطبوعات الجامعية.

صديقي محمد عفيفي. (2003). *تسويق بترولي*. الاسكندرية: مكتبة عين شمس.

ضياء مجيد الموسوي. (2005). *ثورة اسعار النفط*. الجزائر: ديوان المطبوعات الجامعية.

طارق الحموري. (2007). *صياغة وابرام العقود الدولية*. شرم الشيخ-القاهرة-: جامعة الدول العربية.

عبد الرحمان يسري واخرون. (2006). *الاقتصاد الدولي*. الاسكندرية: الدار الجامعية.

عبد الرزاق فوزي. (2016). *استراتيجيات التجارة الخارجية*. عمان: زمزم ناشرون وموزعون.

عبد القادر سيد احمد. (1982). *الأوبك ماضيها حاضرها ودورها وافاق تطورها*. الجزائر: ديوان المطبوعات الجامعية.

عبد القادر عبيدلي. (2016). *التجارة الدولية*. مصر: دار جرير للنشر والتوزيع.

عبد المجيد عبد المطلب. (2015). *اقتصاديات البترول والسياسة السعرية للبترول* (الطبعة الأولى). الاسكندرية: الدار الجامعية.

عبد المنعم حمدي. (1996). *اقتصاديات التجارة الدولية*. دمشق: مكتبة زهراء الشرق.

عطا الله علي زبون. (2003). *التجارة الخارجية*. عمان-الاردن-: دار اليازوري للنشر والتوزيع.

علي عبد الفتاح ابو شرار. (2015). *الاقتصاد الدولي نظريات وسياسات*. عمان: دار المسيرة للنشر والتوزيع والطباعة.

كمال سي محمد. (2015). *مدخل للاقتصاد الدولي*. الجزائر: دار الخلدونية للنشر والتوزيع.

محمد أحمد الدوري. (1983). *محاضرات في الاقتصاد البترولي*. الجزائر: ديوان المطبوعات الجامعية.

محمد احمد السريتي. (2009). *اقتصاديات التجارة الخارجية*. مصر: مؤسسة رؤية للطباعة والنشر والتوزيع.

محمد حربي، وموسى عريقات. (2009). *مبادئ الاقتصاد-التحليل الكلي-*. عمان: دار وائل للنشر والتوزيع والطباعة.

محمد دياب. (2010). *التجارة الدولية في عصر العولمة*. بيروت-لبنان-: دار المنهل اللبناني.

محمد صفوت قابل. (2010). *نظريات وسياسات التجارة الدولية*. القاهرة: الدار المصرية اللبنانية.

محمد عبد القادر عطية عبد القادر. (2005). *الحديث في الاقتصاد القياسي بين النظرية والتطبيق* (المجلد ط2). الاسكندرية: الدار الجامعية للنشر والتوزيع.

محمد فرحي. (2012). *الاقتصادالجزئي* (المجلد ط1). الجزائر: الأصالة للنشر والتوزيع.

محمود يونس. (2015). *التجارة الدولية والتكتلات الاقتصادية*. الاسكندرية: دار التعليم الجامعي.

محمود يونس. (1986). *العوامل المحددة لمستقبل اسعار البترول الخام*. بيروت: الدار الجامعية.

مخلفي امينة. (2014). *محاضرات حول مدخل الى الاقتصاد البترولي*. ورقلة: جامعة ورقلة.

منظمة الاقطار العربية المصدرة للبترول. (2015). *تقرير شهري حول التطورات النفطية في الاسواق العالمية والدول الاعضاء*. الكويت: منظمة الاقطار العربية المصدرة للبترول.

ميرندا زغلول رزق. (2010). *التجارة الدولية*. مصر: مركز التعليم المفتوح-جامعة بنها-.

وليد اسماعيل السيفو، وأحمد محمد مشعل. (2003). *الاقتصاد القياسي التحليلي*. عمان-الاردن-: دار مجدولاب للنشر والتوزيع.

يوسف مسعداوي. (2010). *دراسات في التجارة الدولية*. الجزائر: دار هومة.

2-الأطروحات والرسائل:

خير الدين وحيد. (2013). *أهمية الثروة النفطية في الاقتصاد الدولي والاستراتيجيات البديلة في قطاع المحروقات. مإكرة ماجستير. كلية العلوم الاقتصادية وعلوم التسيير*. بسكرة: جامعة محمد خيضر.

ريمة بيطام. (2014-2015). *أسعار النفط وانعكاساتها على الميزانية العامة للدولة -دراسة حالة الجزائر-*. مذكرة ماستر: كلية العلوم الاقتصادية والتجارية وعلوم التسيير. بسكرة: جامعة محمد خيضر.

سهام شباب. (2018-2019). *تاثير تقلبات أسعار النفط على الموازنة العامة للدولة-دراسة قياسية للموازنة العامة في الجزائر للفترة 1980-2016-*. أطروحة دكتوراه: كلية العلوم الاقتصادية والتجارية وعلوم التسيير. تلمسان: جامعة ابي بكر بلقايد-تلمسان-.

عبد الرزاق عيسى. (2016). *أثر تقلبات أسعارالنفط على الواردات الجزائرية دراسة حالة(1970-2014)*. مذكرة ماجستير: كلية العلوم الاقتصادية والتجارية وعلوم التسيير. ورقلة: جامعة قاصدي مرباح.

فاطمة بودية. (2010-2011). *تطبيق نموذج الجاذبية في التجارة الخارجية حالة الجزائر*. مذكرة ماجستير في العلوم الاقتصادية: كلية العلوم الاقتصادية والتجارية وعلوم التسيير. الشلف: جامعة حسيبة بن بوعلي.

قوشيح بوجمعة قويدري. (2008). *انعكاسات تقلبات أسعار البترول على التوازنات الاقتصادية الكلية في الجزائر. مذكرة ماجستير: كلية العلوم الاقتصادية*. الشلف: جامعة حسيبة بن بوعلي.

مروة شتيوي، وشبيلة شتيوي. (2016-2017). *أثر تقلبات أسعار البترول على تمويل الاستثمار في الجزائر 2000-2016*. مذكرة ماستر: كلية العلوم الاقتصادية وعلوم التسيير. قالمة: جامعة 08 ماي 1945.

منصف هوام. (2015-2016). *اثر تغيرات أسعار النفط على السياسة النقدية في الجزائر. مذكرة ماستر: كلية العلوم الاقتصادية والتجارية وعلوم التسيير*. تبسة: جامعة العربي التبسي.

نبيل بوفليح. (2011). *دور صناديق الثروة السيادية في تمويل اقتصاديات الدول النفطية -الواقع والافاق-مع الاشارة لحالة الجزائر . اطروحة دكتوراه:كلية العلوم الاقتصادية وعلوم التسيير*. سطيف: جامعة فرحات عباس سطيف.

نعيمة حمادي. (2009). *تقلبات أسعار النفط وانعكاساتها على تمويل التنمية في الدول العربية خلال الفترة 1986-2008. مذكرة ماجستير: كلية العلوم الاقتصادية والتجارية*. الشلف: جامعة حسيبة بن بوعلي.

نورة بوكرنة. (2011-2012). *تمويل التجارة الخارجية في الجزائر. مذكرة ماجستير: كلية العلوم الاقتصادية وعلوم التسيير*. الجزائر: جامعة الجزائر03.

3-المجلات:

لزهر العابد، ومحمد دهان. (جوان, 2016). تحليل واقع التنافسية الخارجية لاقتصاديات الدول. (جامعة 20 اوت 1955 سكيكدة، المحرر) *مجلة البحوث والدراسات الانسانية* ، الصفحات 181-207.

ماجن محمد محفوظ. (01 افريل, 2017). الصدمات النفطية الاسباب الانعكاسات وسبل العلاج. *مجلة المعيار* ، الصفحات 01-17.

محمد بن بوزيان، وعبد الحميد لخديمي. (جوان, 2013). تغيرات سعر النفط والاستقرار النقدي في الجزائر-دراسة تحليلية وقياسية-. *مجلة اداء المؤسسات الجزائرية* ، الصفحات 198-217.

محمد مصطفى الخياط. (10 افريل, 2008). اسعار النفط....الصعود والمؤشرات. *مجلة الكهرباء والغاز* ، الصفحات 01-18.

محمد مصطفى الخياط. (10 افريل, 2009). الاثار المتوقعة للازمة المالية على قطاع النفط. *مجلة التكنولوجيا والصناعة* ، الصفحات 01-16.

4-المداخلات العلمية والندوات:

السعيد بوشول. (2005). انعكاسات الصدمة النفطية 2014 على اداء اسواق الأوراق المالية الخليجية. *انعكاسات انهيار أسعار النفط على الاقتصاديات المصدرة له-المخاطر والحلول-*. المدية-الجزائر-: جامعة المدية.

ثانيا: المراجع باللغة الأجنبية:

1-الكتب:

Chautard, S. (2008). *Le petrole de Boeck.* France: groupe vocatif .

Guillchon, B., & Kewecky, A. (2003). *Economie internationale-commerce et macroeconomie.* Paris: Dunod.

Guy, T. (1997). *Micro-économie approfondie.* France: Armand colin/Maisson.

Naji, J. (2005). *Commerce international.Theories Techniques et applications.* Quebec canada: edition du renouveau pedagogique.

Piganid, B. (1978). *statistique et economique.* 2 édition.

Regis, B. (2005). *Econométrie* (Vol. 5 Edition). Paris.

Stephen, H., & Michel, M. (2007). *InternationalEconomic.* New York: Addition Wesley.

المجلات:

Alomar, B. (2019, JUNE 02). Word economic crowth and its offe ou Economic of Energy during1990-2005. *MPRA* , pp. 20-38.

قائمة الملاحق:

الملحق رقم(01): السلاسل الزمنية لمتغيرات الدراسة خلال الفترة (1990-2020).

السنة	سعر البترول(دولار)	قيمة الصادرات (مليار دولار)	قيمة الواردات (مليار دولار)	الميزان التجاري (مليار دولار)
1990	24.34	12.96	08.77	04.18
1991	21.04	12.44	07.77	04.67
1992	20.03	11.51	08.30	03.21
1993	17.05	10.41	07.99	02.42
1994	**16.19**	**08.89**	**09.15**	**-00.26**
1995	17.40	10.26	10.10	00.16
1996	21.33	13.22	09.09	04.13
1997	19.62	13.82	08.13	05.69
1998	13.02	10.14	08.63	01.51
1999	18.12	12.32	08.96	03.36
2000	28.77	21.65	09.35	12.30
2001	24.74	19.09	09.48	09.61
2002	24.91	18.71	12.01	06.70
2003	28.73	24.47	13.32	11.14
2004	38.35	32.22	17.95	14.27
2005	54.64	46.38	19.57	26.81
2006	66.05	54.74	20.68	34.06
2007	74.66	60.59	26.35	34.24
2008	98.96	78.59	37.99	40.60
2009	62.35	45.18	37.46	07.78
2010	80.35	57.09	38.89	18.20
2011	112.92	72.88	46.82	25.96
2012	111.49	71.73	51.56	20.16
2013	109.38	64.86	54.98	09.88
2014	**99.68**	**60.12**	**59.67**	**00.45**

2015	**53.07**	**34.56**	**52.64**	**-18.08**
2016	**44.28**	**29.30**	**49.43**	**-20.12**
2017	**54.12**	**34.56**	**48.98**	**-14.41**
2018	**71.82**	**41.11**	**48.57**	**-07.45**
2019	**64.49**	**34.99**	**44.63**	**-09.63**
2020	**42.12**	**21.93**	**35.42**	**-13.50**
المتوسط	**49.48**	**33.55**	**26.53**	-

المصدر: من إعداد الطالبتين بالاعتماد على:

1-التقارير السنوية لبنك الجزائر.

2-النشرات الإحصائية السنوية لبنك الجزائر.

3-التقارير السنوية لمنظمة الدول المنتجة للبترول Opec .

الملحق(02): تصريح شرفي بالالتزام بمعايير الأمانة والنزاهة العلمية في إعداد مذكرة الماستر للطالبة بن الطيب أحلام.

محمد بوضياف بالمسيلة
علوم الاقتصادية والتجارية و علوم التسيير

وزارة التعليم العالي والبحث العلمي

Université Mohamed Boudiaf de M'sila
culté des Sciences Economiques, Commerciales et
Sciences de Gestion

تصريح شرفي

بالالتزام بمعايير الأمانة و النزاهة العلمية في إعداد مذكرة الماستر

أنا الممضي اسفله:

الطالب (ة) بن الطيب أحلام المولود(ة) بتاريخ: 27/01/1989 بـ برج بوعريريج

الحامل لبطاقة التعريف الوطنية (أو ر.س) رقم: 208966980 الصادرة بتاريخ: 26/10/2018 عن الداخلية المسيلة

المسجل بالسنة الثانية ماستر شعبة: العلوم الاقتصادية تخصص: مالية بنوك تجارة دولية خلال السنة الجامعية 2020/2021

والمعد لمذكرة الماستر التي تحمل عنوان: أهمية تقنيات أخطار التوريد على التجارة الخارجية الجزائرية خلال الفترة 1990 2016

أصرح بشرفي أني إلتزمت بمراعاة معايير الأمانة والنزاهة العلمية المطلوبة في إنجاز مذكرة الماستر المذكور أعلاه.

حرر بتاريخ: 09/05/2021

التوقيع و البصمة

الملحق(03): تصريح شرفي بالالتزام بمعايير الأمانة والنزاهة العلمية في إعداد مذكرة الماستر للطالبة بن عزي ريمة.

الجمهورية الجزائرية الديمقراطية الشعبية
وزارة التعليم العالي والبحث العلمي

Université Mohamed Boudiaf a M'sila
Faculté des Sciences Economiques, Commerciales et des Sciences de Gestion
Département: Science Commerciale

جامعة محمد بوضياف بالمسيلة
كلية العلوم الاقتصادية والتجارية وعلوم التسيير
قسم: العلوم التجارية

تصريح شرفي

بالالتزام بمعايير الأمانة و النزاهة العلمية في إعداد مذكرة الماستر

أنا الممضي اسفله:

الطالب (ة): بن عزي ريمة المولود(ة) بتاريخ: 21/07/1987

العامل ببطاقة التعريف الوطنية (أو رس) رقم: 134/04/01 الصادرة بتاريخ: 04/5/23 عن:

المسجل بالسنة الثانية ماستر شعبة: علوم تجارية تخصص: مالية وتجارة دولية خلال السنة الجامعية: 2023

والمعد لمذكرة الماستر التي تحمل عنوان: أثر تغيرات أسعار البترول على التجارة الخارجية الجزائرية خلال الفترة 1990 - 2020

أصرح بشرفي أني إلتزمت بمراعاة معايير الأمانة والنزاهة العلمية المطلوبة في إنجاز مذكرة الماستر المذكور أعلاه.

حرر بتاريخ: 03/06/2023

2023 جوان 05

التوقيع و البصمة

*يحرر كل طالب (ة) تصريحا فرديا في حالة إعداد المذكرة من طرف أكثر من طالب(ة) واحد.

الحمد لله رب العالمين