الفصل التمهيدي

الإطار العام للدراسة

- **المقدمة**
- **مشكلة الدراسة**
- **فروض الدراسة**
- **أهداف الدراسة**
- **أهمية الدراسة**
- **منهجية الدراسة**
- **حدود الدراسة**
- **أسباب اختيار الموضوع**
- **الدراسات السابقة**

المقدمة :

الـنفط لـه مكانـه هامـة ومحوريـة ضـمن اقتصـاديات الطاقـة حيـث إنـه يمثـل سـلعة دوليـة فـي مـداها، وإسـتراتجية فـي أهميتهـا بالنسـبة لجميـع دول العـالم، وقـد أدت هـذه الأهميـة إلـى أن تكـون أسـعاره محـل اهتمـام وذي ميـزة خاصـة، وتعـد اقتصـاديات الـدول المصـدرة للـنفط أكثـر عرضـة للتقلبـات فـي الأسـعار ممـا يجعلهـا تتـأثر ايجابيـا أو سـلبياً علـى الوضـع الاقتصـادي لتلـك الـدول، فكـل مـن الإيـرادات العامـة والنفقـات العامـة تعـد مـن أهـم أدوات السياسـية الماليـة التـي تعتمـد عليهـا السـلطات الحكوميـة لتحقيـق أهـدافها الاقتصـادية والاجتماعيـة والتنمويـة، فـأي نمـو فـي الإيـرادات العامـة والنفقـات العامـة فـي أحيـان كثيـرة لا يـرتبط بكفـاءة السياسـة الماليـة وإنمـا مـرتبط بأسـعار الـنفط خصوصـا فـي البلـدان الريعيـة، وذلـك نتيجـة أن الإيـرادات النفطيـة هـي المكـون الأساسـي لإيـرادات الخزينـة العامـة، مـن جهـة وأن تمويـل نفقاتهـا يعتمـد أيضـا بنسـبة كبيـرة علـى الإيـرادات النفطيـة مـن جهـة أخـرى، بالتـالي فـان السياسـية الماليـة لـبعض الـدول ذات الهيكـل الاقتصـادي غيـر المتنـوع والتـي تعتمـد علـى العائـدات النفطيـة تتعـرض إلـى حالـة مـن عـدم الاستقرار لسياساتها المالية وذلك بسبب تقلبات السلبية لأسعار النفط.

وباعتبـار أن ليبيـا مـن إحـدى الـدول المصـدرة للـنفط، ويلعـب قطـاع الـنفط دورا محوريـا فـي اقتصـادها، حيـث تعتمـد بشـكل أساسـي علـى صـادراتها النفطيـة لتمويـل الميزانيـة العامـة للدولـة التـي يشـكل منهـا الإيـراد النفطـي تقريبـا95% (**المنظمـة الليبية،أغسـطس2016،ص8**) إلـى تـاريخ هـذه الدراسـة خـلال الفتـرة الممتـدة مـن اكتشـاف الـنفط، أي جـل الصـادرات الليبيـة فـي معظمهـا صـادرات للـنفط الخـام، وتسـتخدم عوائـده لتمويـل نفقـات الموازنـة العامـة، وبالتـالي فـإن السياسـية الماليـة فـي ليبيـا تتـأثر بشـكل كبيـر

بالأحداث والأزمات التي تمس الأسواق النفطية، ففي حالة ارتفاع أسعار النفط يزداد دخل الدولة (الإيراد العام) ومن ثم يزداد حجم الإنفاق العام والعكس في حالة الانخفاض.

لأهمية كل من النفط والسياسة المالية كون النفط يمول وينعش الاقتصاد العالمي بشكل عام واقتصاد الدولة محل الدراسة بشكل خاص، وكذلك أدوات السياسة المالية والمتمثلة في الإيرادات العامة والنفقات العامة فهي تعد الكيان الداخلي لدولة، فكل تغير في أسعار النفط له تأثير في أدوات السياسة المالية، وبالتالي تكون هناك صعوبة في تنفيذ أو تقدير أو التنبؤ بالسياسات المالية للدولة، ولتسليط الضوء على تلك الجدلية وإثرائها تبحث الدراسة في تقلبات أسعار النفط وأثرها على الإيرادات العامة والنفقات العامة في الاقتصاد الليبي باعتبار ليبيا من الدول المصدرة للنفط.

أولاً مشكلة الدراسة:

نظرا لاعتماد الاقتصاد الليبي على النفط كمصدر أساسي لتمويل الموازنة العامة والذي يؤثر على القطاعات الاقتصادية المختلفة على تنفيذ الخطط التنموية، وبما أن أدوات السياسة المالية وفقا للفكر الاقتصادي تحتل مكانه هامه بين السياسات الأخرى لأنها تستطيع أن تقوم بالدور الأعظم في تحقيق الأهداف المتعددة التي ينشدها الاقتصاد الوطني وذلك بفضل أدواتها المتعددة المتمثلة في الإنفاق العام والضرائب وغيرها، وللأثر البارز للتقلبات في أسعار النفط العالمية التي أدت إلى تقلبات في حجم النفقات العامة والإيرادات العامة في الاقتصاد الليبي وبالتالي يمكن صياغة المشكلة في السؤال التالي:

ماهو التأثير الذي سيحدث للتغيرات والتذبذب لأسعار النفط العالمية على السياسة المالية في ليبيا ؟

ثانياً: فرضيات الدراسة:

1- يوجد أثر ذو دلاله إحصائية للتقلبات في أسعار النفط على النفقات العامة.

2- يوجد أثر ذو دلاله إحصائية للتقلبات في أسعار النفط على الإيرادات العامة.

3- يوجد أثر ذو دلاله إحصائية للتقلبات في أسعار النفط على معدل نمو الناتج المحلي الإجمالي.

ثالثاً: أهداف الدراسة:

تهدف الدراسة إلى :

1- التعريف بالسياسة المالية وأهدافها.

2- بيان العلاقة بين أسعار النفط والسياسة المالية.

رابعاً: أهمية الدراسة:

يعد البحث في موضوع الدراسة من أهم القضايا التي تسعى الدولة المعاصرة خصوصا الريعية منها إلي تحقيقها من خلال محاولة التنبؤ بالتغيرات المستقبلية في أسعار النفط وربطها بكفاءة أدوات السياسة المالية كون الاقتصاد الليبي اقتصاداً ريعيا، وأن قطاع النفط يكتسي أهمية كبيرة في معظم الدول النفطية في حد ذاته كسلعه لم يعد مصدراً للطاقة فقط بل أحد مصادر الدخل المهمة، ونظرا لارتباط السياسة المالية في ليبيا بالإيرادات النفطية مما جعلها عرضة لمخاطر التقلبات التي تحدث في أسعار

الـنفط، كمـا تسـتمد الدراسـة أهميتهـا مـن أنهـا يمكـن أن تسـهل علـى واضـعي السياسـة الاقتصـادية فـي ليبيـا بنـاء توقعـاتهم المسـتقبلية والتنبـؤ بـالتغيرات فـي أداء أدوات السياسـة المالية.

خامسا: منهجية الدراسة:

بعـد اطـلاع علـى بعـض الدراسـات التـي لهـا علاقـة بدراسـة الموضـوع والاسـتفادة منهـا، فـإن الباحثـة سـوف تقـوم بدراسـة الموضـوع مـن جوانـب أخـرى ولفتـرات زمنيـة حديثـة، حيـث تعتمـد الدراسـة علـى المـنهج الوصـفي التحليلـي، بالإضـافة إلـى المـنهج التحليلـي الكمـي وذلـك مـن خـلال إيجـاد وتفسـير العلاقـة بـين المتغيـرات فـي ضـوء النظريـة الاقتصـادية وفـق المـنهج القياسـي مـن خـلال بنـاء نمـوذج قياسـي مسـتخدما البرنـامج الإحصـائي **Eviews** لاختبـار فرضـيات الدراسـة، وباسـتخدام أسـاليب قياسـية سـتكون نتائجها أدق، مما قد يستفاد منها في إتخاذ القرارات المناسبة.

سادساً: حدود الدراسة:

وفقـا لأهـداف البحـث فـأن حـدود موضـوع الدراسـة يتعلـق بالتقلبـات فـي أسـعار الـنفط العالميـة، وأثرهـا علـي السياسـة الماليـة فـي ليبيـا، حيـث تخـتص الدراسـة بالاقتصـاد الليبـي فـي ظـل التغيـرات التـي تحـدث فـي أسـعار الـنفط العالميـة خـلال الفتـرة الزمنية(1990 . 2017).

سابعاً: الدراسات السابقة:

توجد العديد من الدراسات الاقتصادية التي تناولت الموضوع من زوايا مختلفة فبعضها تناول متغير من متغيرات الدراسة كظاهرة مستقلة، وتناولت الدراسات الأخرى العلاقة بين متغيرين أو أكثر من متغيرات الدراسة، وفيما يأتي عرض موجز لما توصلت إليه بعض الدراسات ذات العلاقة بموضوع البحث:

أولاً :الدراسات المحلية:

1- **دراسة (عون، 2010)، بعنوان (أثر تقلبات أسعار النفط على تخطيط الموازنة العامة في ليبيا1990-2009، رسالة ماجستير، جامعة الفاتح)**

استخدم الباحث في الدراسة المنهج الاستقرائي التحليلي، بإضافة إلى الدراسة الميدانية والتي تم فيها تحليل العلاقة بين السببية وتقديرات الموازنة العامة في ليبيا والتغيرات الحاصلة في أسعار النفط، وكانت أهم نتائج هذه الدراسة تأثر الإيرادات والنفقات العامة في الاقتصاد الليبي وفقا لتقلبات أسعار النفط وحجم الإيرادات النفطية، تأثر السياسات الاقتصادية لتقلبات أسعار النفط وحجم العوائد النفطية في الموازنة العامة، وإن تمويل العجز في الموازنة العامة يعتمد بشكل أساسي على حجم الإيرادات النفطية، وكذلك ضعف الأهمية النسبية للإيرادات غير النفطية وذلك لعدم تنوع القاعدة الإنتاجية حيث مازال الاقتصاد الليبي يعتمد على قطاع النفط.

2- **دراسة (الطروق وأخرون،2012)، بعنوان (قياس أثر تقلبات أسعار النفط في أداء الاقتصاد الليبي للسنوات 1970-2009، معهد التخطيط طرابل)**

تناولت هذه الدراسة قياس أثر تقلبات أسعار النفط في أداء الاقتصاد الليبي وذلك من خلال معرفة مدى تأثر الناتج المحلي الإجمالي غير النفطي بالصادرات الليبية، ومعرفة تأثر الناتج المحلي الإجمالي بالتقلبات الحاصلة في أسعار النفط، وكانت أهم نتائج هذه الدراسة أن الاقتصاد الليبي خلال فترة الدراسة كان عرضة لتقلبات أسعار النفط الخام، حيث إنه هناك علاقة طويلة الأجل بين إجمالي الصادرات الليبية والناتج المحلي الإجمالي، كذلك ارتباط السياسة المالية بالإيرادات النفطية يجعل اقتصادها عرضه لتقلبات في أسعار النفط، وعلى الرغم من استثمار مبالغ مالية كبيرة لغرض تنويع هيكل الاقتصاد الوطني وتنويع مصادر الدخل، إلا أن الاقتصاد الليبي لازال يعتمد على الإيرادات النفطية في تمويل الميزانية العامة، بسبب ضعف القطاع الصناعي وعدم القدرة على تنويع هيكل الإنتاجي.

3- دراسة (أبو عزوم، 2016)، بعنوان (تقلبات أسعار النفط وأثرها على النمو الاقتصادي دراسة قياسية للاقتصاد الليبي خلال الفترة 1990-2010، مجلة البحوث الاكاديمية جامعة سبها).

تم التركيز في هذه الدراسة على معرفة تقلبات أسعار النفط وأثرها على النمو الاقتصادي خلال الفترة(1990-2010)، حيث تم استخدام المنهج الوصفي التحليلي والمنهج الكمي لقياس العلاقة بين المتغيرات موضوع الدراسة باستخدام برنامج R للتحقق من صحة فرضية الدراسة من عدمها، وكانت أهم النتائج التي توصلت إليها هذه الدراسة وجود علاقة طردية وقوية بين أسعار النفط ونمو وتطور الناتج المحلي

الإجمالي، حيث بلغت قدرة التفسير للتغير في أسعار النفط في تغير الناتج المحلي الإجمالي حوالي 98%، نتيجة لذلك فإن الاقتصاد الليبي لا يزال معتمداً اعتماداً كاملاً على الإيرادات النفطية ومن ثم فهو عُرضةً للتأثر الكبير بالتقلبات التي تشهدها أسعار النفط العالمية، حيث إن التذبذبات في إيرادات الدولة ناتج عن تذبذبات في أسعار النفط، وإن تراجعاً في قيمة الناتج وصادرات قطاع الإنتاج السلعي في أوقات ازدهار أسعار النفط، ونمو قطاع الخدمات في الوقت الذي يفترض فيه زيادة التوسع في الإنتاج السلعي والتصدير.

ثانيا: الدراسات العربية.

1- دراسة (حسناوي) بعنوان (أثر تقلبات أسعار النفط على السياسة المالية في الجزائر خلال الفترة 1986 -2014، رسالة ماجستير جامعة العربي التبسي، الجزائر).

استخدم البحث المنهج الوصفي التاريخي، والمنهج التحليلي الكمي من خلال الاختبارات الإحصائية وبناء النماذج القياسية بين المتغيرات محل الدراسة والمتمثلة في أسعار النفط، والمديونية الخارجية، ورصيد الميزانية، وكانت أبرز وأهم نتائج هذه الدراسة إن الدول المصدرة للنفط من أكثر الدول عرضه لمثل هذه التقلبات في أسعار النفط، إن أهمية قطاع النفط في الجزائر تتجلى في تدخله في جميع القطاعات سواء منها الصناعية أم الاجتماعية، وإن الإيرادات والنفقات العامة في الجزائر ذات ارتباط شديد مع أسعار النفط، ولقد ساهم ارتفاع أسعار النفط في زيادة اعتماد الاقتصاد الجزائري أكثر على القطاع النفطي وبالتالي تستمد السياسة

المالية أهدافها مما تفرضه البيئة الاقتصادية من انعطافات تستدعي اتحاد القرارات والإجراءات المالية لمواجهة الصدمات التي تعوق الاستقرار الاقتصادي.

2- دراسة (سعد الله) بعنوان (أثر التقلبات أسعار النفط على السياسة المالية في الجزائر خلال الفترة 2000-2010 رسالة الماجستير جامعة الجزائر).

استخدم المنهج الوصفي والتاريخي من أجل سرد التطور التاريخي لصناعة النفط في ظل تقلبات أسعار النفط، والمنهج التحليلي من خلال وضع نموذج لتوقعات لمستويات الأسعار، وقياس الآثار المترتبة عن تلك التقلبات على أداء السياسة المالية مستخدما نموذج (VAR) لمجموعة من المتغيرات والمتمثلة في الإيرادات والنفقات العمومية، ومعدل النمو، ومعدل التضخم، وسعر الفائدة، حيث قام بدراسة مدى استجابة كل هذه التغيرات الكلية لصدمة في الإيرادات والنفقات الحكومية، وكانت أبرز نتائج الدراسة ضرورة إعادة توجيه الإنفاق العام، من خلال الاهتمام بالمجالات التي تشجع نمو الإنتاجية وتمكن من تحسين الطاقة الإنتاجية الموجودة، وذلك بمحاولة استغلال الوفرة المالية التي يترجمها ارتفاع احتياطي الصرف في توجيه السياسة المالية إلى تنشيط وتحفيز العرض الكلي، بالإضافة إلى تعزيز دور الوساطة المالية لتسهيل نمو القطاع الحقيقي وهذا بالإسراع في تطبيق الإصلاحات المالية.

ثالثا :الدراسات الأجنبية.

1- دراسة(Tan JuatHong ،2010) بعنوان (أثر صدمات أسعار النفط خلال الفترة 1970-2008).

استخدم البحث نموذج (VAR) لدراسة الأثر قصير وطويل الأجل، من خلال المتغيرات الاقتصادية التالية أسعار النفط والنفقات الحكومية و الإيرادات الحكومية، وكانت أبرز النتائج وجود علاقة متبادلة بين كل من تقلبات أسعار النفط والسياسة الموازنة، حدوث صدمة ايجابية في أسعار النفط ستكون لها أثر كبير على النفقات الحكومية وبالتالي الإيرادات، بينما حدوث صدمة بترولية سلبية سيكون لها أثر سلبي على الإيرادات الحكومية وبالتالي النفقات الحكومية.

2- **Qwader, Amjad (2018)**," Impact of Oil Price Changed on Certain Budget Variables, Government and Tax Revenues, External Grants, and Government Expenditures in Jordan", *International Journal of Economics and Finance*, Vol.

ثامناً: أسباب اختيار الموضوع:

1- كون ليبيا من الدول المصدرة للنفط، موضوع الدراسة مقدما لإيجاد البدائل لهذا المورد الناضب.

2- الدور الذي يلعبه النفط في الاقتصاد الليبي من خلال عوائده.

تاسعاً: تقسيمات الدراسة:

تنقسم الدراسة إلى أربعة فصول وهي الفصل التمهيدي الذي يشمل المقدمة والمشكلة وفرضيات الدراسة وأهداف الدراسة وأهمية الدراسة ومنهجية الدراسة وحدود الدراسة والدراسات السابقة، أما الفصل الأول وهو الاقتصاد النفطي وينقسم إلى ثلاث مباحث وهي المبحث الأول المتمثل في النفط مفهومه وأهميته والمبحث الثاني أسباب تقلبات

أسعار النفط العالمية، أما المبحث الثالث يشمل على الاقتصاد الليبي،بالنسبة للفصل الثاني المتمثل في السياسة المالية والتجارب الدولية وينقسم كذلك إلى ثلاث مباحث وهي المبحث الأول المتمثل في مفهوم وأدوات السياسة المالية، والمبحث الثاني يشمل واقع السياسة المالية في ليبيا للفترة (1990–2017)، والمبحث الثالث المتمثل في التجارب الدولية،والفصل الثالث يتمثل في النموذج القياسي لقياس وتحديد أثر تقلبات أسعار النفط العالمية على السياسة المالية في ليبيا.