

## استخدام طريقتي (2SLS) و (3SLS) في تقدير منظومة (\*) المعادلات الآتية للأسعار العالمية للحبوب للمدة (١٩٦١-٢٠٠٢)

محمود حمدون عبدالله  
مدرس مساعد  
هيئة التعليم التقني - المعهد التقني بالموصل  
قسم أنظمة الحاسبات

مزام محمد يحيى  
مدرس مساعد  
جامعة الموصل - كلية علوم الحاسبات والرياضيات  
قسم الإحصاء والمعلوماتية  
Muzahim\_1963@yahoo.com

### المستخلص

في هذا البحث تم استخدام طريقتي المربعات الصغرى ذات المرحلتين والثلاث مراحل في تقدير منظومة المعادلات الآتية للأسعار العالمية للحبوب (القمح، الذرة، الأرز، الشعير) للفترة (١٩٦١-٢٠٠٢)، وذلك لغرض دراسة المتغيرات ذات الأثر المباشر على الأسعار العالمية للحبوب (الإنتاج، الصادرات، الاستيرادات، التغير في المخزون، الاحتياطات الأجنبية، عدد سكان العالم، التقدم التكنولوجي)، كما تم إعادة تقدير المنظومة بالطرائق نفسها المذكورة آنفاً بعد إضافة متغيرات الأزمات الدولية (الحروب، الجفاف، الأزمات المالية والنقدية، الصدمات النفطية) لبيان تأثير هذه المتغيرات أيضاً على الأسعار العالمية للحبوب، وتم استخدام البرنامج الإحصائي الجاهز (SAS. 9) في الحصول على النتائج.

(\*) تم اعتماد بيانات البحث من أطروحة الدكتوراه للسيد عبدالله عبد الواحد الخولاني والمقدمة إلى قسم الاقتصاد في كلية الإدارة والاقتصاد في جامعة الموصل عام ٢٠٠٥ .

تأريخ قبول النشر ٢٠٠٨/٣/٢

تأريخ استلام البحث ٢٠٠٧/١٠/٢٤

## The Use of (2SLS) and (3SLS) Methods to Estimate the Simultaneous Equations System of the World Prices of the Grains for the Period (1961-2002)

**Mozahim M. Yehya**

Assistant Lecturer

Department of Statistics and Informatics  
University of Mosul

**Mahmood H. Abdullah**

Assistant Lecturer

Department of Statistics and Informatics  
University of Mosul

### Abstract

In this paper, (2SLS) & (3SLS) is used to estimate the simultaneous equation of grains (wheat, maize, rice, barley) for the period (1961-2002). The variables have been considered as direct effects on the world prices of the grains (production, export, import, exchange in the stock, foreigners reserves, the number of the world population, advancement technological). The simultaneous equations have been estimated by the same methods after adding the economic crises to the system (wars, drought, financial and monetary crises and oil shocks) to view the effects also on the world prices of the grains. The (SAS. 9) package is used to obtain the results.

### ١. المقدمة

إن بناء النماذج عملية أساسية لمعظم العلوم، سواء كانت طبيعية أو اجتماعية، لأن العلاقات تكون عادةً في واقعها الفعلي معقدة إلى درجة يتعذر معها دراستها إلا من خلال تمثيلها بشكل مبسط باستخدام النماذج التي تكون على نوعين: الأول يعرف بنماذج المعادلات المنفردة، فيما يعرف الثاني بنماذج المعادلات المتعددة (منظومة من المعادلات). وتشكل النظرية الاقتصادية مجموعة من المعادلات التي هي عبارة عن منظومة من العلاقات النظرية التي يتم تمثيلها رياضياً لتعبر عن المكونات الأساسية لظاهرة اقتصادية معينة، ومن ثم التعرف بصورة كمية على طبيعتها وأهميتها من الناحية الاقتصادية وانسجامها مع نتائج الاختبار الإحصائي، ويتمثل هذا بصورة رئيسة باختيار الأسلوب الإحصائي المناسب لقياس معالم النموذج.

إن اختيار الأسلوب الإحصائي المناسب يتوقف على طبيعة النموذج وعدد العلاقات التي يتكون منها، فضلاً عن الخصائص الإحصائية للتقديرات التي يمكن الحصول عليها، وعموماً يمكن القول إن الطريقة الأنسب في قياس أنموذج المعادلة المنفردة هي طريقة المربعات الصغرى الاعتيادية (Ordinary Least Square) (OLS) في ظل توافر الشروط المعروفة لتطبيق هذه الطريقة. أما في حالة كون الظاهرة محل البحث هي مجموعة من المعادلات (منظومة من المعادلات)، فإن اختيار الطريقة المناسبة من بين الطرائق المتعددة في تقدير المنظومة يتوقف على طبيعة العلاقة بين المتغيرات التوضيحية المكونة للمنظومة، فإذا كانت هذه العلاقة تبادلية، أي أن المتغيرات التوضيحية تؤثر وتتأثر ببعضها البعض، وهو ما يسمى بمنظومة المعادلات الأنيية، فإن اختيار الطريقة المناسبة للتقدير يتحدد وفقاً لحالة

التشخيص (Identification) لكل معادلة من معادلات المنظومة، علماً أن هناك طرائق لتقدير المعادلة المنفردة في منظومة المعادلات الآنية، والتي من أهمها طريقة المربعات الصغرى ذات المرحلتين (Two Stage Least Square) (2SLS)، فضلاً عن طرائق تقدير المنظومة دفعة واحدة ولجميع المعادلات، والتي إحداها طريقة المربعات الصغرى ذات المراحل الثلاث (Three Stage Least Square) (3SLS). وإذا لم تكن العلاقة تبادلية بين المتغيرات التوضيحية في منظومة المعادلات فيتم اختبار البواقي للمعادلات المختلفة في المنظومة، فإذا كان هناك ارتباط بينها فيتم استخدام طريقة الانحدار غير المرتبط ظاهرياً (Seemingly Unrelated Regression)، وبخلافه يتم استخدام طرائق حل المعادلة المنفردة.

## ٢. هدف البحث

إن الهدف الأساسي للبحث هو استخدام طرائق تقدير منظومة المعادلات الآنية، ممثلة بطريقة (2SLS) بوصفها من أهم طرائق تقدير المعادلة المنفردة في منظومة المعادلات الآنية، فضلاً عن استخدام طريقة (3SLS) بوصفها من طرائق التقدير ذات المعلومات الكاملة لبيان: هل أن العلاقة التي تحكم الأسعار العالمية للحبوب تخضع لسيطرة احتكار القلة؟ أي أن الأسعار تتحدد بناءً على توافقات المصدرين الرئيسيين للحبوب، أم أنها تخضع لقوى السوق والعوامل المؤثرة فيها، فضلاً عن دراسة مدى مساهمة متغيرات الأزمات الدولية في ارتفاع الأسعار العالمية للحبوب.

## ٣. الجانب النظري

تعد نماذج الانحدار من أكثر العلاقات الرياضية تبسيطاً للواقع العملي (عواد، ١٩٩٨، ٤٧٦)، ذلك لأن هذه النماذج تفترض وجود اتجاهها وحيداً للسببية، بمعنى أن المتغير التوضيحي أو المتغيرات التوضيحية تؤثر في متغير الاستجابة ولا تتأثر به. إلا أنه في واقع الأمر تعتمد معظم العلاقات على تبادل التأثير بين المتغيرات المكونة للنموذج، أي أن هناك على الأقل عدداً من المتغيرات تتحدد آنياً، أي تؤثر وتتأثر ببعضها البعض. وفي هذه الحالة فإنه لا يمكن استخدام نموذج مكون من معادلة واحدة لوصف العلاقة بين المتغير التوضيحي أو المتغيرات التوضيحية ومتغير الاستجابة، لذلك فإنه لا بد من استخدام نموذج متعدد المعادلات، وإن أحد أهم هذه النماذج التي تتطوي على الاعتماد المتبادل بين المتغيرات هو منظومة المعادلات الآنية.

## ٣-١ منظومة المعادلات الآنية

يمكن تعريف منظومة المعادلات الآنية بأنها "مجموعة من المعادلات التي تمثل العلاقات بين متغيرات الاستجابة والمتغيرات التوضيحية، بحيث أن المتغيرات تؤثر وتتأثر ببعضها البعض في آن واحد" (عواد، ١٩٩٨، ٤٧٧).

## ٣-٢ طرائق تقدير منظومة المعادلات الآتية

إن تطبيق طريقة المربعات الصغرى الاعتيادية في تقدير معلمات منظومة المعادلات الآتية سينتج تقديرات متحيزة وغير متسقة، نظراً لمخالفة الفرض القائل بعدم ارتباط القيم المشاهدة للمتغير التوضيحي بالقيم المتتابة للخطأ العشوائي (كاظم، ٢٠٠٥، ٢٥٩)، (عواد، ١٩٩٨، ٤٧٨، ٤٨٠). مما يتطلب استخدام طرائق أخرى للتقدير وحسب حالة التشخيص لكل معادلة من معادلات المنظومة بحيث يكون من شأن هذه الطرائق إعطاء تقديرات تتمتع بخصائص التقدير الجيد لمعلمات منظومة المعادلات الآتية.

## ٣-٣ التشخيص (Identification)

يقصد بالتشخيص اختبار كل معادلة من معادلات المنظومة لمعرفة ما إذا كان بالإمكان الحصول على مقدرات وحيدة (Unique Estimator) للمعلمات الهيكلية تتصف بالاتساق وعدم التحيز، ومن خلال اختبار التشخيص يمكن معرفة ما إذا كانت كل معادلة في منظومة المعادلات الآتية غير مشخصة أو قابلة للتشخيص. وتكون المعادلة غير مشخصة عندما لا يكون هنالك من حل لتقدير معلماتها، إذ لا يمكن بلوغ قيم تقديرية للمعلمات الهيكلية، وتكون المعادلة مشخصة عندما تقبل الحل، إذ يمكن بلوغ قيم تقديرية للمعلمات الهيكلية. وهناك حالتان للمعادلات المشخصة، الحالة الأولى: وتعرف بالمعادلات المشخصة تماماً (Just or Exact Identified)، وفيها يمكن الحصول على قيم تقديرية وحيدة للمعلمات الهيكلية. أما الحالة الثانية: وتعرف بالمعادلات التي تحمل صفة فوق التشخيص (Over Identified)، وفيها يمكن الحصول على أكثر من قيمة تقديرية واحدة للمعلمات الهيكلية. ولمعرفة حالة التشخيص لابد من اجتياز شرطي الترتيب والرتبة (Rank and Order Conditions) (الهاشمي، ١٩٨٨، ٣٦).

## a. شرط الترتيب (Order Condition)

يعتبر هذا الشرط ضرورياً ولكنه غير كافٍ لتشخيص أي معادلة في منظومة المعادلات الآتية، ولتوضيح فكرة اختبار تحقق شرط الترتيب في معادلة ما في منظومة المعادلات الآتية، وعلى افتراض أن عدد المتغيرات الكلية في المنظومة (المتغيرات الداخلية أو الخارجية أو المتخالفة زمنياً) هو (T)، وأن عدد المعادلات الكلي في المنظومة هو (E)، وأن عدد المتغيرات في المعادلة محل الاختبار هو (V)، فإن (الجبري، ٢٠٠٠، ٤٧٢):

١. تعد المعادلة فوق التشخيص إذا كان  $T-V > E-1$ .
٢. تعد المعادلة مشخصة تماماً إذا كان  $T-V = E-1$ .
٣. تعد المعادلة تحت التشخيص فيما عدا ذلك.

### b. شرط الرتبة (Rank Condition)

يعد هذا الشرط تأكيداً لاختبار شرط الترتيب، إذ ترتب كافة المعلمات الهيكلية بدلالة كافة متغيرات المنظومة على شكل مصفوفة، ثم يتم حذف معلمات المعادلة موضع الاختبار، بعد ذلك يتم تجزئة المصفوفة الناتجة إلى كافة المصفوفات الجزئية ذات الدرجة (E-1)، فإذا كان محدد واحد على الأقل من المصفوفات الجزئية لا يساوي الصفر فإن المعادلة تكون مشخصة تماماً، أما إذا كانت جميع المصفوفات الجزئية ذات الدرجة (E-1) مساوية للصفر فإن المعادلة تكون تحت التشخيص (الجبوري، ٢٠٠٠، ٤٧٣).

### ٣-٤ طريقة المربعات الصغرى ذات المرحلتين

#### (Two Stage Least Squares) (2SLS)

تعد طريقة المربعات الصغرى ذات المرحلتين من الطرائق المهمة في تقدير معادلة هيكلية منفردة في منظومة المعادلات الأنية التي تحمل صفة فوق التشخيص والمشخصة تماماً (Intriligator, 1996, 360)، إذ تأخذ بنظر الاعتبار تأثير كل المتغيرات المحددة مسبقاً (Predetermined Variables) على المتغير المعتمد في المنظومة، كما أنها تعطي تقديرات متسقة (Consistent) وغير متحيزة (Unbiased)، فضلاً عن أنها طريقة بسيطة في حساباتها مما جعلها من أكثر الطرائق أهمية في القياس الاقتصادي (Gujarati, 1988, 605-606).

سميت هذه الطريقة بذات المرحلتين، وذلك لأنها تمر بمرحلتين، الأولى: هي في تحديد المتغير الداخلي في المعادلة المطلوب تقدير معالمها، ثم إيجاد الصيغة المختزلة (Reduced Form) لهذا المتغير ومن ثم استخدام طريقة (OLS) لإيجاد القيم التقديرية للشكل المختزل، أما المرحلة الثانية: فهي في إحلال القيم التقديرية محل القيم الحقيقية للمتغيرات الداخلية في المعادلات الهيكلية، ومن ثم استخدام طريقة (OLS) مرة أخرى لإيجاد المعلمات التقديرية للمعادلات الهيكلية لمنظومة المعادلات الأنية (Intriligator, 1996, 361).

كذلك يمكن الوصول إلى مقدرات طريقة (2SLS) باستخدام طريقة المربعات الصغرى العامة (Generalized Least Squares) (GLS)، ولتوضيح هذه الطريقة بالصيغة الرياضية، نفرض أنه لدينا (N) من المشاهدات، وأن المعادلة الهيكلية (Structural Equation) (i) المراد تقدير معالمها في منظومة المعادلات الأنية هي:

$$y_i = Y_i \gamma_i + X_i \beta_i + \varepsilon_i \quad \dots(1)$$

إذ إن:

$y_i$ : هو متجه عمودي لمشاهدات المتغير الداخلي والذي يمثل متغير الاستجابة في المعادلة الأولى.

$Y_i$ : هي مصفوفة ذات رتبة  $(N \times m_i)$  لمتغيرات الاستجابة التوضيحية (Explanatory Dependent Variables) (وهي متغيرات الاستجابة التي تظهر مع المتغيرات التوضيحية في الجهة اليمنى من المعادلات).  
 $X_i$ : هي مصفوفة ذات رتبة  $(N \times L_i)$  للمتغيرات التوضيحية المحددة مسبقاً (Explanatory Predetermined Variables).  
 $b_i$  و  $g_i$  هما متجهان لمعاملات المتغيرات الداخلية والمتغيرات المحددة مسبقاً التوضيحية على الترتيب.  
 $e_i$ : هو متجه عمودي لـ  $(N)$  من الأخطاء العشوائية الهيكلية (الإزعاجات) (الاضطرابات) الهيكلية.  
يمكن إعادة كتابة المعادلة ١ بالصيغة الآتية:

$$y_i = Z_i \delta_i + \varepsilon_i \quad \dots(2)$$

إذ إن:

$$Z_i = [Y_i \quad X_i] \quad ; \quad \delta = \begin{bmatrix} \gamma_i \\ \beta_i \end{bmatrix}$$

بالضرب المسبق للمعادلة ٢ بالمصفوفة  $(X')$  نحصل على:

$$X' y_i = X' Z_i \delta_i + X' \varepsilon_i \quad \dots(3)$$

المعادلة ٣ هي منظومة من  $(M)$  من المعادلات، متضمنة  $(n_i)$  من المعلمات  $(\delta_i)$ . وعلى افتراض أن كل المتغيرات المحددة التوضيحية مسبقاً هي متغيرات ثابتة (Fixed Variables)، فإن مصفوفة التغيرات لمتجه الإزعاجات  $(X' \varepsilon_i)$  هي:

$$V(X' \varepsilon_i) = E(X' \varepsilon_i \varepsilon_i' X) = \sigma_{ii} (X' X) \quad \dots(4)$$

إذ إن  $(\sigma_{ii})$  هو الانحراف المعياري لـ  $(N)$  من الإزعاجات للمعادلة الهيكلية (i). الآن وبتطبيق طريقة (GLS) على المعادلة (3) نحصل على:

$$Z_i' X (\sigma_{ii} X' X)^{-1} X' y_i = Z_i' X (\sigma_{ii} X' X)^{-1} X' Z_i \delta_i \quad \dots(5)$$

والتي منها نشق مقدر طريقة (2SLS) وكالاتي (الجبوري، ٢٠٠٠، ٥١٨):

$$\hat{\delta} = [Z_i'X(\sigma_{ii}X'X)^{-1}X'Z_i]^{-1}Z_i'X(\sigma_{ii}X'X)^{-1}X'y_i \quad \dots(6)$$

إن مصفوفة التباين لـ  $(\hat{\delta})$  هي:

$$V(\hat{\delta}) = \sigma_{ii}[Z_i'X(X'X)^{-1}X'Z_i]^{-1} \quad \dots(7)$$

إن مقدرات طريقة (2SLS) تكون متحيزة (Biased) في العينات الصغيرة، ويميل هذا التحيز إلى التلاشي مع زيادة حجم العينة (بمعنى اللاتحيز بالغاية)، كما أن مقدرات هذه الطريقة تتصف بكونها متسقة (Consistent) (Intriligator,1996,PP. (363-368).

### ٣-٥ طريقة المربعات الصغرى ذات المراحل الثلاث

#### (Three Stage Least Squares Method) (3SLS)

يمكن عد طريقة (3SLS) امتداداً لطريقة (2SLS)، ذلك لأن المرحلتين الأوليتين من هذه الطريقة هي في تقدير (2SLS). في المرحلة الأولى: يتم إيجاد مقدرات معلمات الشكل المختزل باستخدام طريقة المربعات الصغرى الاعتيادية، في حين في المرحلة الثانية يتم إيجاد مقدرات معلمات كل معادلة من معادلات الشكل الهيكلي على انفراد باستخدام طريقة (2SLS)، أما المرحلة الثالثة فتستخدم طريقة المربعات الصغرى العامة (GLS) في إيجاد معلمات معادلات الشكل الهيكلي دفعة واحدة وللمنظومة كاملة بالاستفادة من مصفوفة التباين لحدود الإزعاجات للشكل الهيكلي المقدر من بواقي المرحلة الثانية (Intriligator,1996, 375).

تتصف مقدرات طريقتي (2SLS) و (3SLS) بأنها مقدرات متسقة (Consistent)، ولكن طريقة (3SLS) أكثر كفاءة من طريقة (2SLS). ولتوضيح هذه الطريقة، بافتراض وجود منظومة تحتوي على  $M$  من المعادلات الهيكلية التصادفية الخطية (Linear Stochastic Structural Equations) بـ  $(M)$  من المتغيرات المعتمدة المشتركة (Jointly Dependent Variables) و  $(R)$  من المتغيرات التوضيحية المحددة مسبقاً (Explanatory Predetermined Variables) وبافتراض أن الإزعاجات للمعادلات الهيكلية (The Structural Disturbances) لها وسط مقداره الصفر، وأنها مستقلة بعضها عن بعض ومتجانسة، كما يفترض بأن محدد مصفوفة التباين المتزامنة (Contemporaneous Covariance) لا يساوي الصفر. وعليه ولغرض الحصول على مقدرات طريقة المربعات الصغرى ذات المراحل الثلاث يتم إضافة مرحلة جديدة إلى طريقة المربعات الصغرى ذات المرحلتين لتقدير معلمات كل المعادلات الهيكلية أنياً وبالشكل الآتي: يمكن كتابة المعادلة ٣ لكل المعادلات مجتمعة بالصيغة الآتية:

$$\begin{bmatrix} X'y_1 \\ X'y_2 \\ \cdot \\ \cdot \\ \cdot \\ X'y_M \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} X'Z_1 & & & \\ & X'Z_2 & 0 & \\ & & \cdot & \\ & & & 0 \\ & & & & X'Z_M \end{bmatrix} \begin{bmatrix} \delta_1 \\ \delta_2 \\ \cdot \\ \cdot \\ \cdot \\ \delta_M \end{bmatrix} + \begin{bmatrix} X'\varepsilon_1 \\ X'\varepsilon_2 \\ \cdot \\ \cdot \\ \cdot \\ X'\varepsilon_M \end{bmatrix} \quad \dots(8)$$

ولغرض تطبيق طريقة المربعات الصغرى العامة (GLS) للصيغة المذكورة انفا، نحتاج إلى إيجاد مصفوفة التغاير لمتجه البواقي للمعادلة ٨ وبالشكل الآتي:

$$\text{COV} \begin{bmatrix} X'\varepsilon_1 \\ X'\varepsilon_2 \\ \cdot \\ \cdot \\ \cdot \\ X'\varepsilon_M \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \sigma_{11}(X'X) & \sigma_{12}(X'X) & \dots & \sigma_{1M}(X'X) \\ \sigma_{21}(X'X) & \sigma_{22}(X'X) & \dots & \sigma_{2M}(X'X) \\ \cdot & \cdot & \cdot & \cdot \\ \cdot & \cdot & \cdot & \cdot \\ \cdot & \cdot & \cdot & \cdot \\ \sigma_{M1}(X'X) & \sigma_{M2}(X'X) & \dots & \sigma_{MM}(X'X) \end{bmatrix} \quad \dots(9)$$

إذ إن  $(\sigma_{ii})$  هو التغاير المتزامنة لإزاعات الشكل الهيكلية للمعادلات  $i$  و  $i$ . كما أن معكوس الصيغة أعلاه هو:

$$\text{COV}^{-1} \begin{bmatrix} X'\varepsilon_1 \\ X'\varepsilon_2 \\ \cdot \\ \cdot \\ \cdot \\ X'\varepsilon_M \end{bmatrix} = \begin{bmatrix} \sigma^{11}(X'X)^{-1} & \sigma^{12}(X'X)^{-1} & \dots & \sigma^{1M}(X'X)^{-1} \\ \sigma^{21}(X'X)^{-1} & \sigma^{22}(X'X)^{-1} & \dots & \sigma^{2M}(X'X)^{-1} \\ \cdot & \cdot & \cdot & \cdot \\ \cdot & \cdot & \cdot & \cdot \\ \cdot & \cdot & \cdot & \cdot \\ \sigma^{M1}(X'X)^{-1} & \sigma^{M2}(X'X)^{-1} & \dots & \sigma^{MM}(X'X)^{-1} \end{bmatrix} \quad \dots(10)$$

إذ إن  $(\sigma^{ii'})$  هو معكوس مصفوفة التباين المتزامنة للأخطاء العشوائية للشكل الهيكلي، وهذا يعني أن  $([\sigma^{ii'}] = [\sigma_{ii'}]^{-1})$ . إن التطبيق المباشر لطريقة (GLS) سوف يعطي النتائج الآتية: باستبدال المتجه العمودي على يسار المعادلة ٥، أي استبدال المقدار  $(Z_i'X(\sigma_{ii}X'X)^{-1}X'y_i)$  بالمقدار الآتي:

$$\begin{bmatrix} \sigma^{11}Z_1'X(X'X)^{-1}X'y_1 + \dots & \sigma^{1M}Z_1'X(X'X)^{-1}X'y_M \\ \sigma^{21}Z_2'X(X'X)^{-1}X'y_1 + \dots & \sigma^{2M}Z_2'X(X'X)^{-1}X'y_M \\ \cdot & \cdot \\ \cdot & \cdot \\ \sigma^{M1}Z_M'X(X'X)^{-1}X'y_1 + \dots & \sigma^{MM}Z_M'X(X'X)^{-1}X'y_M \end{bmatrix} \quad \dots(11)$$

واستبدال المصفوفة  $(n_i * n_i)$  على يمين المعادلة ٥، أي استبدال المقدار  $(Z_i'X(X'X)^{-1}X'Z_i)$  بالمقدار الآتي:

$$\begin{bmatrix} \sigma^{11}Z_1'X(X'X)^{-1}X'Z_1 & \dots & \sigma^{1M}Z_1'X(X'X)^{-1}X'Z_M \\ \sigma^{21}Z_2'X(X'X)^{-1}X'Z_1 & \dots & \sigma^{2M}Z_2'X(X'X)^{-1}X'Z_M \\ \cdot & \cdot & \cdot \\ \cdot & \cdot & \cdot \\ \sigma^{M1}Z_M'X(X'X)^{-1}X'Z_1 & \dots & \sigma^{MM}Z_M'X(X'X)^{-1}X'Z_M \end{bmatrix} \quad \dots(12)$$

يلاحظ أن الصيغتين (١١) و (١٢) قد تضمنتا  $(\sigma's)$  والتي هي غالباً غير معلومة، لذا فإنه يستعاض عنها بمقدراتها من طريقة (2SLS)، ويرمز لها بـ  $(S_{ij}')$ ، وعليه ستكون مقدرات طريقة (3SLS)  $(\hat{\delta}^*)$  على النحو الآتي:

$$\delta^* = \begin{bmatrix} s^{11}z_1'x(x'x)^{-1}x'z_1 & \dots & s^{1M}z_1'x(x'x)^{-1}x'z_M \\ s^{21}z_2'x(x'x)^{-1}x'z_1 & \dots & s^{2M}z_2'x(x'x)^{-1}x'z_M \\ \vdots & & \vdots \\ s^{M1}z_M'x(x'x)^{-1}x'z_1 & \dots & s^{MM}z_M'x(x'x)^{-1}x'z_M \end{bmatrix}^{-1} \begin{bmatrix} \sum s^{1i}z_1'x(x'x)^{-1}x'y_i \\ \sum s^{2i}z_2'x(x'x)^{-1}x'y_i \\ \vdots \\ \sum s^{Mi}z_M'x(x'x)^{-1}x'y_i \end{bmatrix} \dots(13)$$

إذ إن مصفوفة التغيرات للمقدرات ( $\delta^*$ ) هي:

$$V(\delta^*) = \begin{bmatrix} s^{11}z_1'x(x'x)^{-1}x'z_1 & \dots & s^{1M}z_1'x(x'x)^{-1}x'z_M \\ s^{21}z_2'x(x'x)^{-1}x'z_1 & \dots & s^{2M}z_2'x(x'x)^{-1}x'z_M \\ \vdots & & \vdots \\ s^{M1}z_M'x(x'x)^{-1}x'z_1 & \dots & s^{MM}z_M'x(x'x)^{-1}x'z_M \end{bmatrix} \dots(14)$$

تتصف طريقة (3SLS) بأنها متحيزة ولكنها متسقة، كما أنها أكثر كفاءة من طريقة (2SLS) (الجبوري، ٢٠٠٠، ٥٢٩).

#### ٤. الجانب العملي

تضمن الجانب العملي من هذا البحث توصيف وتقدير منظومة المعادلات الآتية للأسعار العالمية للحبوب للفترة (١٩٦١-٢٠٠٢)، والمعادلات الأربع، فضلاً عن البيانات المأخوذة من المصدر (الخولاني، ٢٠٠٥):

$$Y_1 = a_0 + a_1 Y_2 + a_2 Y_3 + a_3 Y_4 + a_4 X_1 + a_5 X_2 + a_6 X_3 + a_7 X_4 + a_8 X_{17} + a_9 X_{18} + a_{10} X_{19} + a_{11} X_{20} + a_{12} X_{21} + a_{13} X_{22} + a_{14} X_{23} \dots(15)$$

$$Y_2 = b_0 + b_1 Y_1 + b_2 Y_3 + b_3 Y_4 + b_4 X_5 + b_5 X_6 + b_6 X_7 + b_7 X_8 + b_8 X_{17} + b_9 X_{18} + b_{10} X_{19} + b_{11} X_{20} + b_{12} X_{21} + b_{13} X_{22} + b_{14} X_{23} \dots(16)$$

$$Y_3 = c_0 + c_1 Y_1 + c_2 Y_2 + c_3 Y_4 + c_4 X_9 + c_5 X_{10} + c_6 X_{11} + c_7 X_{12} + c_8 X_{17} + c_9 X_{18} + c_{10} X_{19} + c_{11} X_{20} + c_{12} X_{21} + c_{13} X_{22} + c_{14} X_{23} \dots(17)$$

$$Y_4 = d_0 + d_1 Y_1 + d_2 Y_2 + d_3 Y_3 + d_4 X_{13} + d_5 X_{14} + d_6 X_{15} + d_7 X_{16} + d_8 X_{17} + d_9 X_{18} + d_{10} X_{19} + d_{11} X_{20} + d_{12} X_{21} + d_{13} X_{22} + d_{14} X_{23} \dots(18)$$

إذ إن:

- $Y_1$  : السعر العالمي للقمح.  
 $Y_2$  : السعر العالمي للذرة.  
 $Y_3$  : السعر العالمي للأرز.  
 $Y_4$  : السعر العالمي للشعير.  
 $X_1$  : الإنتاج العالمي من القمح.  
 $X_2$  : الصادرات العالمية من القمح.  
 $X_3$  : الاستيرادات العالمية من القمح.  
 $X_4$  : التغير في المخزون العالمي من القمح.  
 $X_5$  : الإنتاج العالمي من الذرة.  
 $X_6$  : الصادرات العالمية من الذرة.  
 $X_7$  : الاستيرادات العالمية من الذرة.  
 $X_8$  : التغير في المخزون العالمي من الذرة.  
 $X_9$  : الإنتاج العالمي من الأرز.  
 $X_{10}$  : الصادرات العالمية من الأرز.  
 $X_{11}$  : الاستيرادات العالمية من الأرز.  
 $X_{12}$  : التغير في المخزون العالمي من الأرز.  
 $X_{13}$  : الإنتاج العالمي من الشعير.  
 $X_{14}$  : الصادرات العالمية من الشعير.  
 $X_{15}$  : الاستيرادات العالمية من الشعير.  
 $X_{16}$  : التغير في المخزون العالمي من الشعير.  
 $X_{17}$  : الاحتياطات الأجنبية.  
 $X_{18}$  : عدد سكان العالم.  
 $X_{19}$  : متغير الزمن المعبر عن مستوى التكنولوجيا.  
 $X_{20}$  : متغير الحروب.  
 $X_{21}$  : متغير الجفاف.  
 $X_{22}$  : متغير الأزمات المالية والنقدية.  
 $X_{23}$  : متغير الصدمات النفطية.

يلاحظ من المعادلات (١٥) إلى (١٨) وجود متغيرات داخلية ( $Y_1, Y_2, Y_3, Y_4$ ) في الجهة اليمنى من المعادلات، وهذه المتغيرات مرتبطة مع بعضها البعض ارتباطاً تبادلياً، فهي تظهر بوصفها متغيرات داخلية تارة وبوصفها متغيرات خارجية تارة أخرى، أي أن هناك اتجاهاً ثنائياً للسببية، وهذا مخالف لفرضية نموذج الانحدار الخطي المكون من معادلة واحدة والذي يفترض اتجاهاً وحيداً للسببية، وعليه فإن ذلك سيؤدي إلى تأثير حد الخطأ العشوائي بالمتغيرات الداخلية، وفي هذا مخالفة واضحة للفرض القائل باستقلالية القيم المتتالية للخطأ العشوائي عن القيم المشاهدة للمتغيرات التوضيحية.

يتضح مما سبق أنه لا مجال لاستخدام طريقة المربعات الصغرى الاعتيادية في تقدير المنظومة أعلاه بشكل سليم، وعليه لا بد من استخدام طرائق حل منظومة المعادلات الآتية وحسب حالة التشخيص لكل معادلة.

لقد تم إجراء اختبار التشخيص على معادلات المنظومة من خلال المتغيرات ذات الأثر المباشر على الأسعار العالمية للحبوب، فضلاً عن إضافة متغيرات الأزمات الدولية، وقد لوحظ أن المعادلات تحمل صفة فوق التشخيص، ولما كان

البحث يؤكد أهمية تحقيق أفضل تعبير قياسي للعلاقة الاقتصادية قيد الدرس بحيث تحقق المعلمات المقدره انسجام نتائج الاختبارات الإحصائية والقياسية مع منطوق النظرية الاقتصادية، فقد تم استخدام طريقة (2SLS) بوصفها من أهم طرائق تقدير المعادلة المنفردة لمنظومة المعادلات التي تحمل صفة فوق التشخيص، كما تم استخدام طريقة (3SLS) بوصفها إحدى طرائق تقدير المنظومة ذات المعلومات الكاملة.

#### ٤- ١ مناقشة النتائج

بشكل عام ومن ملاحظة الجدول ١ والخاص بتقدير المعلمات اعتماداً على الطريقتين (2SLS) و (3SLS) في تقدير الأسعار العالمية للحبوب من خلال دراسة المتغيرات ذات الأثر المباشر على الأسعار العالمية للحبوب، والجدول ٢ والخاص بتقدير الأسعار العالمية للحبوب في ظل وجود الأزمات الاقتصادية، يمكن ملاحظة أن المعلمات المقدره بطريقة (3SLS) أفضل من المعلمات المقدره بطريقة (2SLS)، لأن الانحرافات المعيارية للمعلمات المقدره لجميع المتغيرات للمعادلات الأربع بطريقة (3SLS) أقل من الانحرافات المعيارية للمعلمات المقدره بطريقة (2SLS)، كما تشير نتائج قيمة الاحصاء (t) المحتسبة إلى المعنوية العالية للمعلمات المقدره للمتغيرات التوضيحية عند مستوى المعنوية (5%)، وعليه سيتم اعتماد نتائج طريقة (3SLS) في التحليل.

وفيما يأتي خلاصة لنتائج (3SLS) التي انبثقت عن كل معادلة من معادلات الشكل الهيكلي لمنظومة الأسعار العالمية للحبوب للفترة (١٩٦١-٢٠٠٢) والتي تم الحصول عليها باستخدام البرنامج الإحصائي الجاهز SAS الإصدار (9.0).

#### a. السعر العالمي للقمح

يلاحظ من الجدول ١ أن السعر العالمي للقمح ( $Y_1$ ) يتأثر بالمتغيرات ( $Y_2, Y_3, X_3$ )، كما يلاحظ أن المعلمات المقدره لمعادلة السعر العالمي للقمح تتفق مع النظرية الاقتصادية، إذ بلغت قيمة معامل التقاطع (22.341-)، أما بالنسبة للمعلمتين المقدرتين للسعر العالمي للذرة والأرز فكانت موجبة وبلغت قيمتهما (1.052445, 0.093441) على الترتيب، وهي تشير إلى العلاقة التنافسية بين السعر العالمي للقمح وكل من السعر العالمي للذرة والأرز، وهذا يعني أن زيادة في السعر العالمي للذرة بوحدة واحدة يؤدي إلى زيادة في السعر العالمي للقمح بمقدار (1.052445) وحدة، وأن زيادة السعر العالمي للأرز بمقدار وحدة واحدة يؤدي إلى زيادة في السعر العالمي للقمح بمقدار (0.093441) وحدة، وهنا يمكن ملاحظة أن تأثر الأسعار العالمية للقمح بارتفاع أسعار الذرة يكون أكبر مما هو عليه بالنسبة لارتفاع أسعار الأرز، كذلك يلاحظ بأن السعر العالمي للقمح يتأثر بالزيادة في كميات الاستيرادات، حيث يرتفع السعر العالمي للقمح بمقدار (0.231420) وحدة إذا ارتفعت الاستيرادات بمقدار وحدة واحدة.

من الجدول ٢ يمكن ملاحظة أنه في حالة وجود الأزمات الدولية، فإن السعر العالمي للقمح ( $Y_1$ ) يتأثر بالمتغيرات ( $Y_4, X_{17}, X_{18}, X_{23}$ )، إذ يلاحظ أن المتغيرات المؤثرة قد اختلفت عما كانت عليه في حالة عدم وجود الأزمات الدولية، وظهر هنا تأثير كل من الأسعار العالمية للشعير وعدد سكان العالم وبتغير الأزمات النفطية بوصفها متغيرات مساهمة في ارتفاع الأسعار العالمية للقمح، وهذه المتغيرات جميعها منقحة مع النظرية الاقتصادية، إذ يلاحظ أن لمتغير الأزمات النفطية الدور الأول والفاعل في ارتفاع الأسعار بنسبة كبيرة تصل إلى (8.639572)، كما أن ارتفاع أسعار الشعير بمقدار وحدة واحدة يؤدي إلى ارتفاع أسعار القمح بمقدار (2.023)، كما أن لمتغير عدد السكان دوراً في ارتفاع السعر العالمي للقمح بمقدار (0.065464)، أما الاحتياطات الأجنبية فكان لها أثر في انخفاض الأسعار، وهذا مخالف للنظرية الاقتصادية، إلا أنه يمكن عدها واقعية بسبب وجود متغير الأزمات النفطية إذ تسعى الدول المتقدمة والتي تمتلك احتياطات كبيرة من رؤوس الأموال إلى استثمارها في مجالات أخرى وربما إلى استثمارها في سوق المضاربة على النفط، كما أن هذه الدول تعد في طليعة الدول المصدرة للحبوب فهي لا تستخدم الزيادات في احتياطاتها الأجنبية في زيادة مشترياتها من الحبوب.

#### b. السعر العالمي للذرة

يلاحظ من الجدول ١ أن السعر العالمي للذرة ( $Y_2$ ) يتأثر بالمتغيرات ( $Y_3, Y_4, X_7$ )، كما يلاحظ أن المعلمات المقدرة منسجمة مع منطوق النظرية الاقتصادية، فزيادة وحدة واحدة في السعر العالمي لكل من الأرز والشعير تؤدي إلى زيادة في السعر العالمي للذرة بمقدار (0.194737, 0.355468) على الترتيب، كذلك يلاحظ بأن السعر العالمي للذرة يتأثر إيجاباً بكمية الاستيرادات، إذ إن زيادة وحدة واحدة من الاستيرادات تؤدي إلى زيادة في السعر العالمي للذرة بمقدار (0.465007).

أما في حالة وجود الأزمات الدولية فمن الجدول ٢ يمكن ملاحظة أن السعر العالمي للذرة ( $Y_2$ ) يتأثر بالمتغيرات ( $Y_1, Y_4, X_{17}, X_{18}$ )، ويلاحظ أيضاً أن المتغيرات قد اختلفت عما كانت عليه في حالة عدم وجود الأزمات الدولية، وظهر هنا أيضاً كما هو الحال في المعادلة الأولى متغيري عدد السكان والاحتياطات الأجنبية، وظهر الأخير أيضاً مخالفاً للنظرية الاقتصادية وله المبرر السابق نفسه، وذلك بسبب وجود الأزمات الدولية وخصوصاً بتغير الأزمات النفطية، إذ ظهر تأثيره على المنظومة من خلال استخدام طريقتي (2SLS) و (3SLS) التي تأخذ بنظر الاعتبار التداخلات بين المتغيرات ليس على مستوى المعادلة وإنما على صعيد المنظومة. أما فيما يتعلق بالمتغيرين ( $Y_1, Y_4$ ) فقد ظهر تأثيرهما متفقاً مع النظرية الاقتصادية، كما يمكن ملاحظة أن تأثيرهم على السعر العالمي للذرة متقارب.

**c. السعر العالمي للأرز**

يلاحظ من الجدول ١ أن السعر العالمي للأرز ( $Y_3$ ) يتأثر بالمتغيرات التوضيحية ( $Y_4, X_{10}, X_{18}$ )، كما يلاحظ العلاقة التنافسية بين السعر العالمي للشعير والسعر العالمي للأرز، إذ إن زيادة وحدة واحدة في السعر العالمي للشعير تؤدي إلى زيادة في السعر العالمي للأرز بمقدار (4.118932)، كما يلاحظ أن الزيادة في الصادرات العالمية للأرز بمقدار وحدة واحدة تؤدي إلى انخفاض ملحوظ في السعر العالمي للأرز بمقدار (-16.3561)، كما أن زيادة عدد السكان بمقدار وحدة واحدة يؤدي إلى زيادة في السعر العالمي للأرز بمقدار (0.075748).

من الجدول ٢ نلاحظ أنه عند إدخال متغيرات الأزمات الدولية لبيان مدى أثرها على الأسعار العالمية للأرز، ظهر أن المتغيرات المؤثرة على السعر العالمي للأرز هي ( $Y_4, X_{11}, X_{17}, X_{18}, X_{23}$ )، وظهر أيضاً أن الإشارة الجبرية لمتغير الاحتياطات الأجنبية ( $X_{17}$ ) مخالفة للنظرية الاقتصادية وله المبرر السابق نفسه، بينما ظهرت بقية المتغيرات متفقة مع النظرية الاقتصادية، كما ظهر أن لمتغير الأزمات النفطية دوراً كبيراً ومؤثراً في ارتفاع الأسعار العالمية للأرز، إذ بلغت معلمة متغير الأزمات النفطية (71.18821)، كما يلاحظ أن الزيادة في الاستيرادات في ظل الأزمات الدولية بوحدة واحدة تؤدي إلى ارتفاع الأسعار بمقدار (9.765659)، وأن الزيادة في عدد السكان بمقدار وحدة واحدة تؤدي إلى ارتفاع الأسعار بمقدار (0.119606) وحدة، كما أن زيادة وحدة واحدة في السعر العالمي للشعير يؤدي إلى ارتفاع الأسعار العالمية للأرز بمقدار (3.148021).

**d. السعر العالمي للشعير**

يلاحظ من الجدول ١ أن السعر العالمي للشعير ( $Y_4$ ) يتأثر بالمتغيرات التوضيحية ( $Y_2, X_{17}, X_{18}, X_{19}$ )، وكانت النتائج متفقة مع النظرية الاقتصادية، فزيادة وحدة واحدة في كل من السعر العالمي للذرة والاحتياطات الأجنبية وعدد السكان يؤدي إلى زيادة في السعر العالمي للشعير بمقدار (0.657225, 0.037434, 0.146398) على الترتيب، كما يلاحظ أن للتقدم التكنولوجي أثراً كبيراً في خفض السعر العالمي للشعير، إذ إن زيادة وحدة واحدة في التقدم التكنولوجي تؤدي إلى انخفاض كبير في السعر العالمي للشعير بمقدار (-12.8957).

ومن الجدول ٢ نلاحظ أنه عند إدخال متغيرات الأزمات الدولية لبيان مدى أثرها على الأسعار العالمية للشعير، ظهر أن المتغيرات المؤثرة على السعر العالمي للشعير هي ( $Y_1, Y_4, X_{17}, X_{19}$ )، وكانت النتائج متفقة مع النظرية الاقتصادية، مع ملاحظة انخفاض تأثير الأسعار العالمية للشعير بعامل الزمن المعبر عنه بالتقدم التكنولوجي، إذ ظهرت المعلمة المقدرة للتقدم التكنولوجي بمقدار (-2.22667)، وذلك بسبب إدخال متغيرات الأزمات الدولية، والتي تؤدي إلى إضعاف المتغيرات ذات الأثر المباشر في الأسعار العالمية للحبوب.

الجدول ١

استخدام طريقة (2SLS) و (3SLS) في تقدير الأسعار العالمية للحبوب من خلال دراسة المتغيرات ذات الأثر المباشر على الأسعار العالمية للحبوب للفترة (١٩٦١-٢٠٠٢)

Methods	Dependent Variable	Variables	Parameter Estimate	Standard Error	t Value	Pr >  t
Two-Stage Least Squares Estimation	Y <sub>1</sub>	Intercept	-19.666	6.092242	-3.23	0.0026
		Y <sub>2</sub>	0.093838	0.039121	2.4	0.0215
		Y <sub>3</sub>	0.0989689	0.15141	6.54	<.0001
		X <sub>3</sub>	0.265396	0.08632	3.07	0.0039
	Y <sub>2</sub>	Intercept	-0.35701	10.1276	-0.04	0.9721
		Y <sub>3</sub>	0.157138	0.032654	4.81	<.0001
		Y <sub>4</sub>	0.332044	0.182517	1.82	0.0768
		X <sub>7</sub>	0.531599	0.146284	3.63	0.0008
	Y <sub>3</sub>	Intercept	-128.14	93.3611	-1.37	0.1779
		Y <sub>4</sub>	3.559216	1.101307	3.23	0.0025
		X <sub>1</sub>	-13.4113	4.34768	-3.08	0.0038
		X <sub>18</sub>	0.066772	0.029561	2.26	0.0297
	Y <sub>4</sub>	Intercept	-466.321	167.6739	-2.78	0.0085
		Y <sub>2</sub>	0.634888	0.069696	9.11	<.0001
		X <sub>17</sub>	0.042771	0.007863	5.44	<.0001
		X <sub>18</sub>	0.167124	0.056299	2.97	0.0052
X <sub>19</sub>		-14.6876	4.297371	-3.42	0.0015	
Three-Stage Least Squares Estimation	Y <sub>1</sub>	Intercept	-22.341	6.033264	-3.7	0.0007
		Y <sub>2</sub>	1.052445	0.036732	2.54	0.0152
		Y <sub>3</sub>	0.093441	0.143684	7.32	<.0001
		X <sub>3</sub>	0.23142	0.083811	2.76	0.0088
	Y <sub>2</sub>	Intercept	-7.75254	9.902218	-0.78	0.4385
		Y <sub>3</sub>	0.194737	0.029621	6.57	<.0001
		Y <sub>4</sub>	0.355468	0.174372	2.04	0.0485
		X <sub>7</sub>	0.465007	0.139414	3.34	0.0019
	Y <sub>3</sub>	Intercept	-178.821	88.65678	-2.02	0.0508
		Y <sub>4</sub>	4.239811	1.073581	3.95	0.0003
		X <sub>1</sub>	-16.3561	3.963733	-4.13	0.0002
		X <sub>18</sub>	0.075748	0.027609	2.74	0.0092
	Y <sub>4</sub>	Intercept	-408.514	144.3473	-2.83	0.0075
		Y <sub>2</sub>	0.657225	0.065843	9.98	<.0001
		X <sub>17</sub>	0.037434	0.006834	5.48	<.0001
		X <sub>18</sub>	0.146398	0.048446	3.02	0.0045
X <sub>19</sub>		-12.8957	3.724014	-3.46	0.0014	

الجدول ٢  
استخدام طريقة (2SLS) و (3SLS) في تقدير الأسعار العالمية للحبوب بوجود الأزمات  
الاقتصادية للفترة (١٩٦١-٢٠٠٢)

Methods	Dependent Variable	Variables	Parameter Estimate	Standard Error	t Value	Pr >  t
Two-Stage Least Squares Estimation	Y <sub>1</sub>	Intercept	-250.11	24.27664	-10.3	<.0001
		Y <sub>4</sub>	1.7101	0.22308	7.67	<.0001
		X <sub>17</sub>	-0.12114	0.011986	-10.11	<.0001
		X <sub>18</sub>	0.066952	0.006057	11.05	<.0001
		X <sub>23</sub>	19.48987	5.043993	3.86	0.0004
	Y <sub>2</sub>	Intercept	-39.2162	31.46747	-1.25	0.2205
		Y <sub>1</sub>	0.52414	0.109935	4.77	<.0001
		Y <sub>4</sub>	0.324176	0.255378	1.27	0.2122
		X <sub>17</sub>	-0.028	0.01525	-1.84	0.0744
		X <sub>18</sub>	0.013297	0.007926	1.68	0.1018
	Y <sub>3</sub>	Intercept	-454.246	93.02677	-4.88	<.0001
		Y <sub>4</sub>	2.725352	0.840928	3.24	0.0026
		X <sub>11</sub>	11.33161	5.312034	2.13	0.0398
		X <sub>17</sub>	-0.39283	0.067945	-5.78	<.0001
		X <sub>18</sub>	0.120564	0.022919	5.26	<.0001
	Y <sub>4</sub>	X <sub>23</sub>	85.50465	19.02014	4.5	<.0001
		Intercept	33.53921	4.15113	8.08	<.0001
		Y <sub>1</sub>	0.216198	0.127076	1.7	0.0973
		Y <sub>2</sub>	0.270879	0.185114	1.46	0.1518
		X <sub>17</sub>	0.053263	0.006862	7.76	<.0001
Three-Stage Least Squares Estimation	Y <sub>1</sub>	X <sub>18</sub>	-1.98027	0.34033	-5.82	<.0001
		Intercept	-260.093	23.74933	-10.95	<.0001
		Y <sub>4</sub>	2.023494	0.185703	10.9	<.0001
		X <sub>17</sub>	-0.12511	0.011811	-10.59	<.0001
		X <sub>18</sub>	0.065464	0.006034	10.85	<.0001
	Y <sub>2</sub>	X <sub>23</sub>	8.639572	3.353022	2.58	0.0141
		Intercept	-57.936	29.76101	-1.95	0.0592
		Y <sub>1</sub>	0.458098	0.103982	4.41	<.0001
		Y <sub>4</sub>	0.491884	0.237621	2.07	0.0455
		X <sub>17</sub>	-0.03689	0.01446	-2.55	0.015
	Y <sub>3</sub>	X <sub>18</sub>	0.01754	0.007592	2.31	0.0265
		Intercept	-461.193	92.45403	-4.99	<.0001
		Y <sub>4</sub>	3.148021	0.825511	3.81	0.0005
		X <sub>11</sub>	9.765659	4.802893	2.03	0.0498
		X <sub>17</sub>	-0.38284	0.064564	-5.93	<.0001
X <sub>18</sub>		0.119606	0.022874	5.23	<.0001	
X <sub>23</sub>	71.18821	18.41522	3.87	0.0004		

Methods	Dependent Variable	Variables	Parameter Estimate	Standard Error	t Value	Pr >  t
	Y <sub>4</sub>	Intercept	30.60842	3.684919	8.31	<.0001
		Y <sub>1</sub>	0.23568	0.07841	3.01	0.0047
		Y <sub>4</sub>	0.311841	0.109445	2.85	0.0071
		X <sub>17</sub>	0.057009	0.006585	8.66	<.0001
		X <sub>19</sub>	-2.22667	0.325564	-6.84	<.0001

### الاستنتاجات

من أهم الاستنتاجات التي تم التوصل إليها:

١. الحصول على تقديرات تتفق مع النظرية الاقتصادية ومع الواقع الفعلي، معززة بالنظرية الإحصائية.
٢. تبين أن العلاقة التي تحكم الأسعار العالمية للحبوب تخضع لقوى السوق والعوامل المؤثرة فيها، وهذه النتيجة تختلف عما توصل إليه (الخولاني، ٢٠٠٥) من أن العلاقة التي تحكم الأسعار العالمية للحبوب تخضع لسيطرة احتكار القلة، أي أن الأسعار تتحدد بناءً على توافقات المصدرين الرئيسيين للحبوب. وتأتي هذه النتيجة بسبب أن طرائق حل المنظومة تأخذ بنظر الاعتبار العلاقات التبادلية بين المتغيرات المختلفة في المنظومة، على خلاف طريقة (OLS) التي تعد الطريقة الأنسب في قياس أنموذج المعادلة المنفردة وليس منظومة من المعادلات.
٣. بالنسبة لمنظومة المعادلات الآتية المتعلقة بدراسة أثر المتغيرات ذات الأثر المباشر على الأسعار العالمية للحبوب أتضح الآتي:
  - أ. فيما يتعلق بالعلاقة التبادلية التنافسية بين الأسعار العالمية للمحاصيل الأربعة، فقد ظهر أن السعر العالمي للقمح يتأثر بالأسعار العالمية لكل من الذرة والأرز، في حين يتأثر السعر العالمي للذرة بسعر الأرز والشعير، في حين يؤثر السعر العالمي للشعير بالسعر العالمي للأرز، ويؤثر السعر العالمي للذرة بالسعر العالمي للشعير.
  - ب. عند دراسة المتغيرات ذات الأثر المباشر على الأسعار العالمية للحبوب (من دون إضافة متغيرات الأزمات الدولية)، ظهر أن المتغيرات التوضيحية كانت متفقة تماماً مع النظرية الاقتصادية، وهذه المتغيرات هي الاستيرادات والصادرات وعدد سكان العالم والاحتياطيات الأجنبية، فضلاً عن عامل الزمن المعبر عنه بالتقدم التكنولوجي، ويمكن الاستنتاج من ذلك بأن الأسعار العالمية تتأثر بجانب العرض والطلب على حدٍ سواء. كما يمكن ملاحظة غياب كل من متغيري المخزون والإنتاج العالمي من جميع معادلات المنظومة، ويعزى السبب في ذلك إلى ضالة المخزون العالمي من الحبوب، مما يعني عدم مقدرته على إحداث تغييرات في الأسعار العالمية للحبوب، أما

معدل الإنتاج العالمي من الحبوب فهو في تناقص مستمر، ذلك لأن التطور التكنولوجي في الدول المتقدمة قد وصل إلى مستويات عالية، في حين مازالت الدول النامية تعتمد على اليد العاملة الزراعية في الإنتاج، فضلاً عن أنها عاجزة عن تطبيق أساليب الإنتاج الحديثة بسبب التكاليف العالية لهذه التكنولوجيات وتدني قدرة المزارعين في الدول النامية على استيعاب الأساليب الحديثة في الإنتاج.

٤. بالنسبة لمنظومة المعادلات الأنية المتعلقة بدراسة المتغيرات ذات الأثر المباشر فضلاً عن متغيرات الأزمات الدولية على الأسعار العالمية للحبوب اتضح الآتي:

أ. فيما يتعلق بالعلاقة التبادلية التنافسية بين الأسعار العالمية للمحاصيل الأربعة في ظل الأزمات الدولية، ظهر أن السعر العالمي للقمح يتأثر بالسعر العالمي للشعير، في حين يتأثر السعر العالمي للذرة بسعري القمح والشعير، ويؤثر السعر العالمي للشعير بالسعر العالمي للأرز، وتؤثر الأسعار العالمية لكل من القمح والذرة بالسعر العالمي للشعير.

ب. ظهر أن المتغير المعبر عن الأزمات النفطية هو المتغير الوحيد من بين متغيرات الأزمات الدولية الذي بقي في التحليل، إذ ظهر أن له تأثيراً كبيراً في ارتفاع الأسعار العالمية للحبوب، وبالأخص منها القمح والأرز. وتعد هذه النتيجة منطقية، ذلك لأن الأزمات النفطية هي أزمات لها تأثير عالمي في ارتفاع الأسعار بخلاف بقية متغيرات الأزمات الدولية التي يمكن أن يكون لها تأثير على مستوى دولة أو مجموعة من الدول ولكن ليس على المستوى العالمي.

ت. إن المتغيرات التوضيحية التي كانت متفقة مع النظرية الاقتصادية ومع الواقع الفعلي، هي الاستيرادات وعدد سكان العالم، وإن المتغيرين الآخرين قد تكررا في كل معادلات المنظومة، وإن الاحتياطات الأجنبية كانت مخالفة للنظرية الاقتصادية في معادلات الأسعار العالمية للقمح والذرة والأرز، ولكنها متفقة مع الواقع في ظل الأزمات النفطية، إذ تلجأ الدول المتقدمة والتي تمتلك الجزء الأكبر من الاحتياطات الأجنبية إلى استثمارها في سوق المضاربة على النفط، كما أنها لا تستخدم احتياطاتها الأجنبية في شراء الحبوب، لأنها من الدول الرئيسة المصدرة للحبوب، في حين ظهرت (الاحتياطات الأجنبية) متفقة مع النظرية الاقتصادية بمعادلة السعر العالمي للشعير، بسبب أن محصول الشعير يستخدم مادة أولية في الصناعات الغذائية والعلفية، كما أنه يدخل في صناعة المشروبات الروحية، مما يجعل الطلب عليه كبيراً ولاسيما في الدول المتقدمة نظراً لارتفاع المستوى المعاشي ودخل الفرد فيها.

## المراجع

### أولاً- المراجع باللغة العربية

١. الجبوري، شلال حبيب وعبد، صلاح حمزة، ٢٠٠٠: "تحليل متعدد المتغيرات"، دار الكتب للطباعة والنشر، بغداد، العراق .
٢. الخولاني، عبدالله الواحد، ٢٠٠٥: "الآثار الاقتصادية للازمات في الأسعار العالمية للحبوب للمدة (١٩٦١-٢٠٠٢)" أطروحة دكتوراه (غير منشورة)، كلية الإدارة والاقتصاد، جامعة الموصل، العراق.
٣. عواد، علاء الدين حسن، ١٩٩٨: "القياس الاقتصادي"، الطبعة الأولى، مطابع دار الشرق، الدوحة، قطر.
٤. كاظم، أموري هادي، ٢٠٠٥: "مقدمة في القياس الاقتصادي"، الطبعة الأولى، مطبعة جامعة الموصل، العراق.
٥. الهاشمي، مزاحم محمد يحيى، ١٩٨٨: "بناء نموذج قياسي للقطاع الزراعي في العراق"، رسالة ماجستير، كلية الإدارة والاقتصاد، جامعة بغداد، العراق.

### ثانياً- المراجع باللغة الاجنبية

1. Gujarati,D. N. 1988; "Basic Econometrics" , McGraw - Hill Book Company, New York.
2. Intrilligator,M. D. &Bodkin,R. G. &Hsiao,C. 1996;"Econometr-ics Models, Techniques and Applications", Prentice Hall.