

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

﴿إِقْرَأْ بِاسْمِ رَبِّكَ الَّذِي خَلَقَ﴾ 1 خَلَقَ الْإِنْسَانَ مِنْ عَلَقٍ 2

إِقْرَأْ وَرَبُّكَ الْأَكْرَمُ 3 الَّذِي عَلَّمَ بِالْقَلَمِ 4 عَلَّمَ الْإِنْسَانَ مَا لَمْ

يَعْلَمُ ﴿﴾ 5

سورة العلق

إلى من أشبهنا

إلى من أنبلجت رسالته بقول (اقرأ) ذلك النبي المعلم

إلى من نزعنا ملاءات الحزن من حياتنا ووسدتنا حرير حزننا وحنانها . . .

أمي

إلى أشبه من وجدت خلقاً بخير خلق الله وأحب خلق الله إلي . . .

أبي

إلى عضدي وسندي وذكر عاطريهتف به لساني . . .

أخوتي

إلى من نسجنا معهم خيوط الصداقة والمحبة والتآخي . . .

زملائي

إلى كل من أثار حياتنا علماً ونصحاً من لدن رعشات القلم الأولى وإلى رعشات الفرحه

هذه . . .

أساتذتي

شكر وتقدير

الشكر لله أولاً و آخراً ان يسر لنا اتمام هذه الدراسة ونسأله سبحانه في عملنا هذا التوفيق والنجاح. ثم للدكتور الفاضل:

احمد محمد عبد الله حمدي

المشرف على هذه الدراسة اعطانا ووجهنا وسألناه فأرشدنا نسأل الله له التوفيق والسداد وعمل صالح يلقاه يوم المعاد وللدكتورة الفاضلة:

عفرء هاشم عبد اللطيف

كما لا انسى ان اتقدم بالشكر الجزيل لكل من مد يد العون لنا من اخوة واخوات سواء كان ذلك بكلمة او دعوة او توجيه او ضيحة فشكراً لكم ونسأل الله بمنه وكرمه ان لا يجرمكم من خيري الدنيا والآخرة.

ذهب الله بالكمال وابقى كل نقص لذلك الانسان

مستخلص.

هدفت هذه الدراسة الى تقدير وتحليل العوامل المؤثرة على الناتج المحلي الاجمالي السوداني (الانفاق الحكومي، الانفاق الخاص، الاستثمار، الصادر والوارد) واتبع الباحث المنهج الوصفي التحليلي بالتطبيق على عينة من بيانات الناتج المحلي الاجمالي السوداني من الجهاز المركزي للاحصاء السوداني في الفترة من (1996م-2009م)، بواسطة طريقة المربعات الصغرى العادية تم تقدير نموذج الناتج المحلي الاجمالي وبالكشف عن مشكلات الاقتصاد القياسية الارتباط الذاتي، عدم ثبات التباين والتعدد الخطي بواسطة اختبارات بريش - كودفري، ثبات التباين الشرطي (آرش) ومصفوفة الارتباط بين المتغيرات المستقلة على الترتيب خلصت النتائج الى ان النموذج يعاني من مشكلات الاقتصاد القياسية ، عند التخلص من مشكلة الارتباط الذاتي كانت طريقة ابطاء المتغير التابع (بعد اجراء ابطاءين) افضل من طريقة الفرق العام وطريقة الفرق الاول، بينما كانت طريقة التحويلات اللوغريتمية لمعالجة عدم ثبات التباين للمتغير العشوائي افضل من المعالجة بطريقتي قسمة متغيرات النموذج على القيمة المطلقة للجذر التربيعي للبواقي وقسمة متغيرات النموذج على الجذر التربيعي لمتغير الانفاق الحكومي على الترتيب، وبعد اضافة متغيري (الصادر والوارد) الى معادلة الناتج المحلي الاجمالي السوداني تم التخلص من مشكلة التعدد الخطي حيث كانت هذه الطريقة افضل من سابقتها المبنية على حذف متغير الانفاق الحكومي، وقد اوصت الدراسة باستخدام النماذج التي تم التوصل اليها في هذه الدراسة بعد التخلص من مشكلات الاقتصاد القياسية .

Abstract.

This study aimed to estimating and analyzing the factors affecting the Sudanese Gross Domestic Product GDP (Government Spending, Private Spending, Investment, Export and Import), the researcher followed the descriptive analytic method application on Sample of GDP from Sudanese Central Bureau of Statistics in the period (1996-2009),the GDP model was estimated by the ordinary least square method (OLS) and detection of the econometric problems autocorrelation, heteroscedasticity and multicollinearity using the tests Breusch-Godfrey Serial Correlation LM, ARCH-LM and Correlations Matrix between independing variables, respectively results concluded that the model suffers from econometric problems, after getting rid of the autocorrelation problem, the method of lag of the dependent variable (two lags) was better than the generalized difference method and the first difference method, also the logarithmic method was better than the method dividing the model variables by the absluote value of the square root of residuals and the method dividing the model variables by the square root of the government expenditure variable when we got rid the problem of heteroscedasticity, when adding exports and imports variables to the sudan GDP model, the problem of multicollinearity was eliminated and this method was better than the method of deleting the government expenditure variable, the study recommended using models that have been reached after the disposal of the econometrics problems and adoption of the forecasts for the development of future economic and social development plans.

قائمة المحتويات

رقم الصفحة	الموضوع
أ	الآية.....
ب	الاهداء.....
ج	شكر وتقدير.....
د	مستخلص عربي.....
هـ	مستخلص انجليزي (Abstract).....
و	قائمة المحتويات.....
ط	قائمة الجداول.....
ل	قائمة الاشكال.....

الفصل الاول: المقدمة

1	1-1: تمهيد.....
2	2-1: مشكلة الدراسة.....
3	3-1: اهمية الدراسة.....
3	4-1: اهداف الدراسة.....
3	5-1: فرضيات الدراسة.....
4	6-1: منهجية واجراءات الدراسة.....
5	7-1: عينة الدراسة.....
5	8-1: حدود الدراسة.....
5	9-1: الدراسات السابقة.....
10	10-1: المقارنة بين الدراسة الحالية والدراسات السابقة.....
10	11-1: هيكل الدراسة.....

الفصل الثاني : نموذج الانحدار الخطي المتعدد

12	1-2: الانحدار ومفهومه.....
12	2-2: تصنيفات نماذج الانحدار
14	3-2: الاقتصاد القياسي وتحليل الانحدار
15	4-2: أقسام علم الإقتصاد القياسي.....
16	5-2: مراحل بناء نموذج إقتصاد قياسي.....
24	6-2: نموذج الانحدار الخطي المتعدد.....
24	7-2: الصيغة الرياضية لنموذج الانحدار الخطي المتعدد.....
25	8-2: اسباب ادخال المتغير العشوائي μ
26	9-2: الفرضيات الاساسية للنموذج.....
27	10-2: تقدير معالم النموذج بطريقة المربعات الصغرى.....
31	11-2: خصائص مقدرات المربعات الصغرى.....
32	12-2: جودة توفيق النموذج الخطي العام.....
37	13-2: المشكلات القياسية في نموذج الانحدار الخطي.....
38	14-2: مشكلة الارتباط الذاتي.....
43	15-2: مشكلة عدم تجانس تباين الاخطاء.....
51	16-2: مشكلة التعدد الخطي.....
53	17-2: اساليب معالجة مشكلات النموذج الخطي.....

الفصل الثالث : الناتج المحلي الاجمالي

59	1-3: الناتج المحلي الاجمالي واهميته.....
62	2-3: الجهاز المركزي للإحصاء السوداني.....

الفصل الرابع : الجانب التطبيقي

64	1-4: عينة الدراسة.....
	2-4: تفسير ومناقشة نتائج النموذج المقدر حسب طريقة المربعات الصغرى العادية.....
66
67	3-4: الكشف عن مشكلة الارتباط الذاتي بين الاخطاء العشوائية.....
68	4-4: معالجة مشكلة الارتباط الذاتي بين الاخطاء العشوائية.....
74	5-4: تفسير ومناقشة النتائج المتعلقة بالارتباط الذاتي
75	6-4: الكشف عن مشكلة عدم ثبات التباين بين الاخطاء العشوائية.....
76	7-4: معالجة مشكلة عدم ثبات التباين بين الاخطاء العشوائية.....
80	8-4: تفسير ومناقشة النتائج المتعلقة بثبات التباين.....
80	9-4: الكشف عن مشكلة التعدد الخطي.....
81	10-4: معالجة مشكلة التعدد الخطي.....
84	11-4: تفسير ومناقشة النتائج المتعلقة بالتعدد الخطي.....

الفصل الخامس : النتائج والتوصيات

86	1-5: النتائج.....
87	2-5: التوصيات.....
88	المراجع.....

قائمة المراجع

رقم الصفحة	عنوان الجدول	رقم الجدول
22	الإختبارات الاحصائية حسب معايير الإقتصاد القياسي (إختبارات الدرجة الثانية).....	(1-2)
37	تحليل التباين.....	(2-2)
42	المقارنة بين قيمتي ديرن واتسن المحسوبة والجدولية.....	(3-2)
64	الناتج المحلي الاجمالي السوداني بملايين الجنيهات بطريقة الانفاق في الفترة 1996م- 2009م.....	(1-4)
66	تقدير النموذج حسب طريقة المربعات الصغرى العادية (OLS).....	(2-4)
67	الكشف عن مشكلة الارتباط الذاتي حسب اختبار بريش - كودفري.....	(3-4)
68	تقدير الانحدار بعد اجراء الفرق العام الاول حسب طريقة المربعات الصغرى العادية (OLS).....	(4-4)
69	الكشف عن مشكلة الارتباط الذاتي بعد اجراء الفرق العام الاول حسب اختبار بريش - كودفري.....	(5-4)
69	تقدير الانحدار بعد اجراء الفرق العام الثاني حسب طريقة المربعات الصغرى العادية (OLS).....	(6-4)
70	الكشف عن مشكلة الارتباط الذاتي بعد اجراء الفرق العام الثاني حسب اختبار بريش - كودفري.....	(7-4)
70	تقدير الانحدار بعد اجراء الفرق الاول حسب طريقة المربعات الصغرى العادية (OLS).....	(8-4)

رقم الصفحة	عنوان الجدول	رقم الجدول
71	الكشف عن مشكلة الارتباط الذاتي بعد اجراء الفرق الاول حسب اختبار بريش - كودفري.....	(9-4)
71	تقدير الانحدار بعد اجراء الفرق الثاني حسب طريقة المربعات الصغرى العادية (OLS).....	(10-4)
72	الكشف عن مشكلة الارتباط الذاتي بعد اجراء الفرق الثاني حسب اختبار بريش - كودفري.....	(11-4)
72	تقدير الانحدار بعد اجراء ابطاء للمتغير التابع حسب طريقة المربعات الصغرى العادية (OLS).....	(12-4)
73	الكشف عن مشكلة الارتباط الذاتي بعد اجراء ابطاء للمتغير التابع حسب اختبار بريش - كودفري.....	(13-4)
73	تقدير الانحدار بعد اجراء ابطاء للمتغير التابع حسب طريقة المربعات الصغرى العادية (OLS).....	(14-4)
74	الكشف عن مشكلة الارتباط الذاتي بعد اجراء ابطاء للمتغير التابع حسب اختبار بريش - كودفري.....	(15-4)
76	الكشف عن مشكلة عدم ثبات التباين بواسطة إختبار ARCH.....	(16-4)
76	تقدير الانحدار بعد اجراء التحويلات اللوغريتمية.....	(17-4)
77	الكشف عن مشكلة عدم ثبات التباين بواسطة إختبار ARCH بعد اجراء التحويلات اللوغريتمية.....	(18-4)
77	تقدير الانحدار بعد قسمة متغيرات الدراسة على القيمة المطلقة للجذر التربيعي للبواقي.....	(19-4)

رقم الصفحة	عنوان الجدول	رقم الجدول
78	الكشف عن مشكلة عدم ثبات التباين بواسطة إختبار ARCH بعد بقسمة جميع المتغيرات على القيمة المطلقة للجذر التربيعي للبقايا.....	(20-4)
79	تقدير الانحدار بعد قسمة متغيرات الدراسة على الجذر التربيعي لمتغير الانفاق الحكومي.....	(21-4)
79	الكشف عن مشكلة عدم ثبات التباين بواسطة إختبار ARCH بعد بقسمة جميع المتغيرات على الجذر التربيعي لمتغير الانفاق الحكومي.....	(22-4)
81	مصفوفة الارتباطات بين المتغيرات المستقلة.....	(23-4)
82	تقدير نموذج الناتج المحلي بعد حذف متغير الانفاق الحكومي.....	(24-4)
83	تقدير الانحدار بعد اضافة متغيري الصادر والوارد.....	(25-4)
83	الكشف عن مشكلة الارتباط الذاتي بعد اضافة متغيري (الصادر والوارد) بواسطة اختبار بريش - كودفري.....	(26-4)
84	الكشف عن مشكلة عدم ثبات التباين بعد اضافة متغيري (الصادر والوارد) بواسطة اختبار ARCH.....	(27-4)

قائمة الأشكال

رقم الصفحة	عنوان الشكل	رقم الشكل
28	شكل الانتشار وخط الانحدار المقدر.....	(1-2)
	اتجاه وطبيعة الارتباط الذاتي لحدود الخطا	(2-2)
40	العشوائي.....	
44	اتجاه تباين الخطأ العشوائي.....	(3-2)
	خاصية الخطية لمتغيرات الناتج المحلي الاجمالي	(1-4)
65	السوداني.....	