

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

الآية

قال تعالى :
(وَقَالَ رَبِّ أَوْزِعْنِي أَنْ أَشْكُرَ نِعْمَتَكَ الَّتِي
أَنْعَمْتَ عَلَيَّ وَعَلَىٰ وَالِدَيَّ ، وَأَنْ أَعْمَلَ صَالِحًا
تَرْضَاهُ وَأَدْخِلْنِي بِرَحْمَتِكَ فِي عِبَادِكَ
الصَّالِحِينَ)

**سورة النمل
الآية (19)**

الاهداء

الى روح أمى

أسأل الله أن يجعل قبرها روضة من
رياض الجنة ويسكنها الفردوس الأعلى

الى أبى

متعته الله بالصحة والعافية

الى أم أحمد (نون)

الدوحة جزاها الله بقدر ما صبرت وصابرت

الى أحمد ومحمد وأبوبكر

وعمر

قرت عيني وفلذات كبدي

أهدى هذا البحث

شكر وتقدير

الشكر والحمد ابتداءً وانتهاءً لله رب العالمين ثم لجامعة السودان للعلوم والتكنولوجيا لماتقدمه لطلاب العلم من فرص وخدمات جلية و لكل الذين لا أستطيع أن أجد معروفهم في تعاونهم ومساعدتهم لى في هذا البحث في مقدمتهم أستاذى الفاضل د. طارق الرشيد الذى ما آل جهدا من توجيهات كان لها عظيم الأثر في إخراج هذا البحث ، كما أوجه شكرى للدكتور خالد البيلي والدكتورة هويدا الميع و لأساتذتى الاجلاء ببرنامج الماجستير ، وأسجل شكرى وتقديرى للأخ المهمل عبد القادر والاخت أبتسام بلة بديوان الزكاة وللأخوة في إدارة التدريب بالامانة العامة لديوان الزكاة والى اخوتى وزملائي بديوان الزكاة بولاية الجزيرة .

وللعاملين بمكتبة جامعة أم درمان الاسلامية ومكتبة جامعة السودان للعلوم والتكنولوجيا الذين ما بخلوا علي بنفائيس مكتباتهم .

وأسجل شكرى لإخوتى وزملاء الدفعة والاخ محمد عمار أحمد والاخ آدم الفيل ولكل الذين ساهموا في اخراج هذا البحث .

مستخلص البحث

تقوم الدراسات القياسية على فروض متعلقة بالمتغيرات المستقلة والتابعة وحد الخطا فاز انتفى اى فرض من الفروض يؤدى ذلك الى مشكلة من مشاكل الاقتصاد القياسى ومشكلة اختلاف التباين التى تناولها الباحث بالدراسة قائمة على انتفاء احد الفروض المتعلقة بحد الخطا وعلاقته بالمتغيرات

المستقلة وطبقت الدراسة على نموذج الناتج المحلى الاجمالى فى السودان للفترة (1975-2006) والذي يتوقع ان يعانى من مشكلة اختلاف التباين لاحتوائه على دوال غير مستقرة بالاضافة لاشتماله على بيانات سلاسل زمنية وبيانات عرضية وينتج عن وجود مشكلة اختلاف التباين فقدان خاصية الكفاءة فى المقدرات وعدم الثقة فى اختبارات المعنوية ولايمكن الاعتماد على حدود الثقة وتصبح طريقة المربعات الصغرى العادية غير مناسبة لتقدير المعلمات قامت الدراسة على دعوى وجود عدم ثبات التباين فى كل دوال النموذج ودعوى وجود علاقة سببية بين المتغيرات المستقلة والتابعة فى أى دالة من دوال النموذج والمنهج المتبع فى هذه الدراسة هو منهج البحث فى الإقتصاد القياسى والذي يحتوى على تعيين وتقدير وتقييم معلمات النموذج المقدره وإختبار مشكلة إختلاف التباين وعلاجها وتناول البحث الموضوع فى أربعة فصول ومقدمة فى الفصل الأول تناول الإطار النظرى ومشكلة إختلاف التباين وفى الفصل الثانى تناول الناتج المحلى الإجمالى وفى الفصل الثالث تشخيص النموذج وطريقة التقدير المتبعة فى الدراسة وفى الفصل الرابع تقدير النموذج والكشف عن مشكلة إختلاف التباين وعلاجها وقد توصل الباحث الى نتائج من أهمها :تحقق فرضية أن النموذج يعانى من مشكلة إختلاف التباين فى كل دواله السلوكية وأن طريقة المربعات الصغرى مكنت الباحث من تقدير النموذج وإجراء اختبار الكشف على إختلاف التباين ومن أهم النتائج أيضا تحقيق أهداف البحث ومن أهم توصيات الباحث إجراء دراسة قياسية على نموذج الناتج المحلى الإجمالى تشمل كافة مشاكل القياس والعلاقة بينها وطرق معالجتها وضرورة مراعات الدقة فى البيانات الإحصائية المستخدمة فى الدراسات الإقتصادية القياسية

Abstract

Econometric studies are based upon hypothesis related to dependent and independent variables, in addition to the error term. Not fulfillment of a hypothesis leads to one of the problems in Econometrics. The problem of Heteroskedasticity that was studied by the researcher was based upon non-fulfillment of a hypothesis related to the error term and its relation to dependent variables. The model was expected to suffer from

Heteroskedasticity as it consists of unstable functions together with time series and sector data. It is known that Heteroskedasticity leads to insufficiency of estimated parameters and low level confidence in probability tests and hence we cannot depend upon the limit of confidence. The ordinary least-square method is inappropriate for these parameters estimation.

The hypothesis of the study was that "there exists a Heteroskedasticity in all the model functions and the causal relation between dependent and independent variables". The methodology employed was econometric methods that include identifying, estimating and evaluating the model parameters then testing the problem of Heteroskedasticity and find suitable solutions.

In this work the researcher has studied the problem of Heteroskedasticity and applied it to the General Domestic Production data for the years 1975 – 2006 as a model. His thesis consists of an introduction containing the research plan and four other chapters. In chapter one the researcher discussed the theoretical framework for Heteroskedasticity where he stated the concept, causes and its consequences together with identification and methods to eliminate it. The theoretical framework for the constituents of the General Domestic Production was explained in chapter two. In the third chapter, he specified and described the model and the appropriate methods for its measurement. In chapter four the model was studied using the Two-stage Least Square method. The model was then subjected to the statistical and theoretical standards and the White Heteroskedasticity Test was employed to test all the equations of the model. The study revealed that the model suffers from Heteroskedasticity in all of its equations. This problem was resolved by taking the logarithm after omitting all non-effective parameters. The results obtained for the estimated parameters agreed well with the hypotheses set by the researcher. The researcher recommended that further studies that include all the problems related to Econometrics and their interrelation should be carried out on General Domestic Production. Such studies should be based on accurate statistical data

المحتوى

الترتيب	المحتوى
أ - ب	الآية
ج	الإهداء
د	الشكر
هـ	مستخلص البحث
و	فهرس المحتويات
ط	فهرس الأشكال البيانية
ك	فهرس الجداول
1	المقدمة

9	الفصل الأول اختلاف التباين
9	1 - 1 مفهوم اختلاف التباين
13	1 - 2 أسباب اختلاف التباين
14	1 - 3 آثار وتاريخ وجود مشكلة عدم ثبات التباين
16	1 - 4 طرق إكتشاف اختلاف التباين
27	1 - 5 طرق معالجة اختلاف التباين
32	الفصل الثاني
32	1 - 2 الناتج المحلي الإجمالي
32	1 - 1 - 2 مفهوم الناتج المحلي الإجمالي
33	1 - 3 - 2 قياس الناتج المحلي الإجمالي
35	1 - 2 - 5 محددات الناتج المحلي الإجمالي
40	2 - 2 الإستهلاك
40	1 - 2 - 2 مفهوم الإستهلاك
40	2 - 2 - 2 دالة الإستهلاك
43	6 - 2 - 2 نظريات تفسير الإستهلاك
47	5 - 6 - 2 العوامل الأخرى المؤثرة على الاستهلاك
48	3 - 2 الاستثمار
48	1 - 3 - 2 مفهوم الاستثمار
49	2 - 3 - 2 أنواع الاستثمار
50	3 - 3 - 2 العلاقة بين الاستثمار والدخل
52	4 - 3 - 2 العوامل المحددة للانفاق الاستثماري
54	5 - 3 - 2 نظريات الاستثمار
58	6 - 3 - 2 الاستثمار والمستوى التوازني للدخل
59	4 - 2 الانفاق الحكومي
59	1 - 4 - 2 مفهوم الانفاق الحكومي
60	2 - 4 - 2 أسباب وجود الانفاق الحكومي
60	3 - 4 - 2 أنواع الانفاق الحكومي
61	4 - 4 - 2 تزايد الانفاق الحكومي
63	5 - 4 - 2 الآثار الاقتصادية للانفاق الحكومي
71	5 - 2 التجارة الخارجية
71	1 - 5 - 2 أهمية التجارة الخارجية
71	2 - 5 - 2 مزايا التجارة الخارجية
71	3 - 5 - 2 مشاكل التجارة الخارجية
72	4 - 5 - 2 استراتيجيات التجارة الخارجية
78	5 - 5 - 2 التجارة الخارجية ونموذج الناتج المحلي الإجمالي
79	6 - 5 - 2 تمويل العجز وميزات المدفوعات
84	الفصل الثالث : تشخيص النموذج / طريقة تقدير النموذج
84	1 - 3 تشخيص النموذج
97	2 - 3 طريقة تقدير النموذج
100	الفصل الرابع : توصيف وتقدير النموذج ومعالجة

	مشكلة اختلاف التباين
100	1-4 توصيف النموذج
104	2 - 4 تقدير النموذج ومعالجة مشكلة اختلاف التباين
109	النتائج
121	التوصيات
122	المراجع

فهرس الاشكال البيانية

رقم الصفحة	عنوان الشكل	رقم الشكل
10	اختلاف التباين المتزايد	(1)
11	ثبات التباين	(2)
11	اختلاف التباين المتناقص والمتزايد	(3)
17	العلاقة بين البواقي والمتغير المستقل	(4)
17	العلاقة الخطية بين البواقي والمتغير المستقل	(5)
18	العلاقة النسبية التربيعية بين البواقي والمتغير المستقل	(6)
18	العلاقة غير الخطية بين البواقي والمتغير المستقل	(7)
18	العلاقة التربيعية بين البواقي والمتغير المستقل	(8)
36	العلاقة بين الدخل والاستهلاك والاستثمار	(9)
37	العلاقة بين الدخل والاستثمار	(10)
38	العلاقة بين الدخل والانفاق الحكومي	(11)
39	العلاقة بين الصادرات والواردات والمستوى التوازني	(12)
41	دالة الاستهلاك في الاجل القصير	(13)
42	دالة الاستهلاك في الاجل القصير والطويل	(14)
57	المستوى التوازني في سوق الناتج	(15)
63	الانفاق الحكومي على السلع الرأسمالية	(16)
64	الانفاق الحكومي على السلع الاستهلاكية	(17)
67	الدعم الحكومي الانتاج السلع في سوق	(18)

	المنافسة	
68	الدعم الحكومي لانتاج السلع في السوق الاحتكارية	(19)
68	الدعم الحكومي لحماية دخول بعض المنتجين في سوق المنافسة	(20)
69	الدعم الحكومي لدخول بعض المنتجين في سوق الاحتكار	(21)
70	الدعم الحكومي لانتاج سلع المنافع العامة	(22)
73	هيكل الحماية	(23)
75	سعر الصرف وأثره على الصادرات والواردات	(24)
78	الصادرات والواردات والمستوى التوازني للدخل	(25)
80	المستوى التوازني بين الدخل واسعار الفائدة	(26)
80	توازن اسواق المنتجات والنقود وميزان المدفوعات في ظل القيود المفروضة على عرض النقود	(27)
82	توازن اسواق المنتجات والنقود وميزان المدفوعات في حالة عدم وجود قيود مفروضة على عرض النقود	(28)
85	دالة العرض المميزة	(29)
86	دالة الطلب المميزة	(30)
88	دالتي الطلب والعرض المميزتين	(31)

فهرس الجداول

رقم الصفحة	عنوان الجدول	رقم
104	نتائج تقدير دالة الاستهلاك	(1-4)
105	نتائج اختبار وايت لدالة الاستهلاك	(2-4)
106	نتائج تقدير دالة الاستهلاك بعد معالجة مشكلة اختلاف التباين	(3-4)
106	نتائج اختبار وايت لدالة الاستهلاك بعد معالجة مشكلة اختلاف التباين	(4-4)
107	نتائج تقدير دالة الاستثمار	(5-4)
108	نتائج اختبار وايت لدالة الاستثمار	(6-4)
109	نتائج تقدير دالة الاستثمار بعد معالجة مشكلة اختلاف التباين	(7-4)
109	نتائج اختبار وايت لدالة الاستثمار بعد معالجة مشكلة اختلاف التباين	(8-4)
110	نتائج تقدير دالة الانفاق الحكومي	(9-4)
111	نتائج اختبار وايت لدالة الانفاق الحكومي	(10-4)
112	نتائج تقدير دالة الانفاق الحكومي بعد معالجة مشكلة اختلاف التباين	(11-4)
112	نتائج اختبار وايت لدالة الانفاق الحكومي بعد معالجة مشكلة اختلاف التباين	(12-4)
113	نتائج تقدير دالة الصادرات	(13-4)
114	نتائج اختبار وايت لدالة الصادرات	(14-4)
115	نتائج تقدير دالة الصادرات بعد معالجة مشكلة اختلاف التباين	(15-4)
115	نتائج اختبار وايت لدالة الصادرات بعد معالجة مشكلة اختلاف التباين	(16-4)
116	نتائج تقدير دالة الواردات	(17-4)
117	نتائج اختبار وايت لدالة الواردات	(18-4)
118	نتائج تقدير دالة الواردات بعد معالجة مشكلة اختلاف التباين	(19-4)
118	نتائج اختبار لدالة الواردات بعد معالجة مشكلة اختلاف التباين	(20-4)