قـال تعالى:

مَّا أَفَاء اللَّهُ عَلَى رَسُولِهِ مِنْ أَهْلِ الْقُرَى فَلِلَّهِ وَلِلرَّسُولِ وَلِذِي الْقُرْبَى وَالْيَتَامَى وَالْمَسَاكِينِ وَابْنِ السَّبِيلِ كَيْ لَا يَكُونَ دُولَةً بَيْنَ الْأَغْنِيَاءِ مِنكُمْ وَمَا آتَاكُمُ الرَّسُولُ فَخُذُوهُ وَمَا نَهَاكُمْ عَنْهُ فَانتَهُوا وَاتَّقُوا اللَّهَ إِنَّ اللَّهَ شَدِيدُ الْعِقَابِ)

صدق الله العظيم - سورة الحشر – آية(7)

الإهداء

إلى والدّي .....

((وقل ّرب أرحمهما كما ربياني صغيرا))

إلى إخواني وأخواتي

الذين كانوا سنداً لي أثناء دراستي

إلى رسل العلم الناشدين الإبداع والتطور

في وطني الكبير

هادية

الشكر والعرفان

الشكر أولا لله سبحانه وتعالي الذي وفقني لإتمام هذا البحث ، وأتقدم بوافر الشكر والتقدير للدكتور / بسام يونس بكر الذي وجدت منه كل ترحيب وتعاون وكان خير معين لي صبورا ومتواضعا وما بخل علي لحظة بعلمه الغزير ولا بزمنه الغالي ...

واخص بالشكر كل من أسرة مكتبة جامعة السودان وأسرة مكتبة جامعة امدرمان الإسلامية وأسرة مكتبة بنك السودان وأسرة مكتبة الجهاز المركزي للإحصاء، وأسرة المكتبة الالكترونية بجامعة السودان.

والشكر أيضا لزملائي في كلية الدراسات العليا الذين وجدت منهم تعاونا صادقا والي كل من ساعدني في كتابة البحث اعترافا بفضلهم وتقديرا لجهدهم.

ملخص البحث

اجري هذا البحث لدراسة وتحليل بيانات التضخم في السودان للفترة (1970-2005م) بهدف معرفة الاتجاه العام للتضخم في السودان واكتشاف التغيرات التي تطرأ علي السلسلة محل الدراسة ومن ثم التوصل الي نموذج يمكن من خلاله التنبؤ بالتضخم في السودان في المستقبل .

ومن اجل تحقيق هذه الأهداف سعت الدراسة الي اختبار فرضيه رئيسيه مفادها وجود علاقة طويلة الأجل بين التضخم في السنة الحالية Y_t والتضخم في السنة السابقة Y_{t-1} وفق نموذج AR(1) والذي يأخذ الصورة التالية :

$$Y_t = \mu + \phi_1 Y_{t-1} + e_t$$

ولقد تم الحصول علي البيانات من مصادرها الثانوية(الجهاز المركزي للإحصاء)

ومن ثم إتباع المنهج الوصفي وذلك من خلال وصف بيانات الدراسة كما استخدمت الدارسة حزم NCSS, Minitab في التحليل الإحصائي لبيان الظاهرة موضع الدراسة واتجاهها . وقد قسمت الدراسة الي خمسة فصول ، حيث شمل الفصل الأول الإطار العام للدراسة ،والفصل الثاني تناول الجانب النظري للتضخم ،وخصص الفصل الثالث ليتناول تحليل السلاسل الزمنية ، والفصل الرابع فقد تم فيه تحليل التضخم باستخدام نماذج بوكس - جنكنز والفصل الخامس احتوي علي النتائج والتوصيات .

وتوصلت الدراسة الي النتائج التالية :-

1. السلسلة الزمنية لظاهرة التضخم في السودان للفترة (1970- 2005 م) غير ساكنة مع وجود قيم شاذة للتضخم في بعض السنوات .
2. ARIMA (1, 1, 0)هو أفضل نموذج يلائم ظاهرة التضخم في السودان لفترة الدراسة.
3. تساهم قيمة التضخم في السنة السابقة بنسبة 63% تقريباً في التغيرات التي تحصل في قيمة التضخم في السنة الحالية .

وتوصي الدارسة بالاتي :-

1. استخدام نماذج الانحدار الذاتي والمتوسطات المتحركة المتكاملة في دراسة وتحليل متغيرات الاقتصاد القومي لسنوات طويلة ومنها التضخم .
2. انتهاج إصلاحات ضريبية وسياسة اقتصادية تعمل علي تخفيض التضخم وذلك من خلال :

أ- بذل الجهود لتعزيز المناخ الاستثماري وجذب المزيد من رؤوس الاموال.

ب-تحديث عوامل الإنتاج عن طريق تطوير وتوطين التقنيات الحديثة وربط البحث العلمي بمواقع الإنتاج والخدمات .

Abstract

This study was conducted to study the analysis of the inflation data in Sudan for the period from (1970 – 2006) in order to know the general trend of the inflation in Sudan, and to discover the changes that appeared on the seris under study, and then reach a model which inflation in Sudan can be interpreted.

In order to achieve these objectives, the study tended to test the existence of major hypothesis that in the long-term there is a relation between the inflation in the current year (Y_t) and that of the previous year (Y_{t-1}) according to the model AR(1) which takes the following formula:

$$Y_t = \mu + \phi_1 Y_{t-1} + e_t$$

The data has been obtained from its secondary sources (Department of Central Statistics), and then using the descriptive approach according to category of data. The study also used the NCSS and Minitab for the statistical analysis to illustrate the phenomenon under study and its directions.

The study was divided into five chapters; the first chapter was assigned for general framework of the study, the second chapter deals with theoretical side of the inflation, the third chapter involves the analyses the time series, and the fourth chapter was concerned with analyzing the statistic inflation by using box - Jenkins model, and the fifth chapter includes conclusions and recommendations.

The study concludes to:

1. Time series for inflation phenomenon was non-stationary with some extreme values in some years in Sudan.

2. ARIMA (1, 1, 0) Model was found to be the best model that suits inflame phenomenon in Sudan for the study period.

3. The value of inflation in the last year contributed 63% of the inflation to the present year.

RECOMMENDATIONS:

1- The autoregressive integrated moving average models are recommended for the analysis for economy naira variables in Sudan including the inflation.

2- Adoption of tax reform and economic policies that reduces inflation through :

(A) Intensification of investment induces conditions and attraction of investment capitals.

(B) Renewal of production tarots through the development and adoption of new technologies.

(C) Linking scientific research with production areas.

فهرس المحتويات

الموضوع	رقم الصفحة
آية	أ
الإهداء	ب
الشكر والعرفان	ج
ملخص البحث باللغة العربية	د
ملخص البحث اللغة الإنجليزية	هـ
فهرس المحتويات	و
فهرس الجداول	ز
فهرس الأشكال البيانية	ح
الفصل الأول : مقدمه	1
1-1 تمهيد	2
1-2 اهمية البحث	3
1-3 مشكلة البحث	3
1-4 أهداف البحث	3
1-5 فرضيات البحث	4
1-6 منهج البحث	4
1-7 بيانات البحث	4
1-8 خطة البحث	5
1-9 الدراسات ألسابقه	6
الفصل الثاني :التضخم	7
2-1 تمهيد	8
2-2 مفهوم التضخم	8
2-3: أنواع التضخم	9
2-4: اسباب التضخم	10
2-5 آثار التضخم	11-12

2-6 نظريات التضخم	13
2-6-1 النظرية الكمية للنقود	14-16
2-6-2 النظرية الكنزية	17-23
2-6-3 مدرسة التوقعات الرشيدة	23-25
2-6-4 النظرية الكمية الحديثة	25-31
الفصل الثالث : تحليل السلاسل الزمنية	32
3-1 تمهيد	33
3-2 أهداف السلاسل الزمنية	34
3-4 مكونات السلسلة الزمنية	35-37
3-5 نماذج السلاسل الزمنية	37-39
2-5-3 نماذج الانحدار الذاتي	39-42
2-5-3 نماذج المتوسطات المتحركة	42-44
3-5-4 نماذج الانحدار الذاتي والمتوسطات المتحركة	45-47
6-5-3 نماذج الانحدار الذاتي والمتوسطات المتحركة التكاملية	48
6-5-3 تصميم وبناء نظام إحصائي تنبؤي(بوكس جنكيز)	50-53
الفصل الرابع: تحليل التضخم باستخدام نماذج بوكس. جنكنز	54
4-1 تمهيد	55
4-2 وصف الظاهرة المدروسة	56
4-3 تحديد النموذج	57
4-4 تطبيق النموذج	59
4-5 فحص التشخيص	59
4-6 التنبؤ بالنموذج	60
الفصل الخامس النتائج والنتائج	61
قائمة المراجع	62-63

فهرس الجداول

رقم الجدول	اسم الجدول	رقم الصفحة
(4-1)	معدل التضخم العام للفترة(1970-2005م)	56
(4-2)	قيم معيار اكاكي للمعلومات نماذج بوكس – جنكنز المختلفة.	59
(4-3)	نتائج نماذج ARIMA (1،1،0) للتضخم في السودان خلال فترة الدراسة .	60
(4-4)	قيم التضخم المتنبأ به للفترة (2006-2010م)	61

فهرس الأشكال البيانية

رقم الجدول	اسم الجدول	رقم الصفحة
(4-1)	التضخم في السودان للفترة (1970-2005م).	55
(4-1)	معاملات الارتباط الذاتي وحدود الثقة للتضخم بالسودان للفترة (1970-2005م)	57
(4-3)	معاملات الارتباط الذاتي الجزئي وحدود الثقة للتضخم بالسودان للفترة (1970-2005م).	58
(4-4)	معاملات الارتباط الذاتي وحدود الثقة للتضخم بالسودان بعد اخذ الفرق الأول	58
(4-5)	معاملات الارتباط الذاتي الجزئي وحدود الثقة للتضخم بالسودان بعد اخذ الفرق الأول	59
(4-6)	القيم الحقيقية والمتنبأ بها للتضخم في السودان للفترة (1970-2005م).	60