

# Zaman Serileri Verisiyle Regresyon Analizi

Zaman Serileri Analizi

Ekonometrik Modelleme ve Zaman Serileri Analizi

Dr. Ömer Kara<sup>1</sup>

<sup>1</sup>İktisat Bölümü  
Eskişehir Osmangazi Üniversitesi

7 Nisan 2021

# Taslak

## 1 Motivasyon

# Motivasyon

Bu bölümde sırasıyla aşağıdaki konular incelenecektir.

- Zaman serisi modellerinde sonlu örneklem varsayımları
- Zaman serisi modellerinde tahmin
- Zaman serisi modellerinde Gauss–Markow teoremi
- Zaman serisi modellerinde Gauss–Markow varsayımları altında Sıradan En Küçük Kareler (SEKK) parametre tahmincilerinin sonlu örneklem özellikleri
- Zaman serisi modellerinde klasik varsayımlar ve çıkarsama
- Zaman serisi modellerinde farklı fonksiyonel form ve kukla değişken kullanımı
- Zaman serisi modellerinde trend ve mevsimsellik kullanımı
- Not: Yukarıdaki konular sadece doğrusal modeller düşünülerek incelenecektir.

# Kaynaklar

Gujarati, D.N. (2009). *Basic Econometrics*. Tata McGraw-Hill Education.

Güriş, S. (2005). *Ekonometri: Temel Kavramlar*. Der Yayınevi.

Hyndman, R.J. ve G. Athanasopoulos (2018). *Forecasting: Principles and Practice*. OTexts.

Stock, J.H. ve M.W. Watson (2015). *Introduction to Econometrics*.

Wooldridge, J.M. (2016). *Introductory Econometrics: A Modern Approach*. Nelson Education.