

Zaman Serileri Verisiyle Regresyon Analizi

Ekonometrik Modelleme ve Zaman Serileri Analizi

Dr. Ömer Kara¹

¹İktisat 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