

# ZAMAN SERİSİ VE PANEL VERİ ANALİZİNDE GÜNCEL TEKNİKLER

Doç. Dr. Veli YILANCI

*Sakarya Üniversitesi Siyasal Bilgiler Fakültesi Ekonometri Bölümü*

Eğitim tarihi:

Eğitim saatleri:

Bu çalışmanın amacı zaman serisi ve panel verisi analizinde literatüre kazandırılan yeni teknikler hakkında uygulamalı olarak bilgi vermektir.

- Fourier Fonksiyonlarına Dayanan Birim Kök Testleri
  - Fourier KPSS Durağanlık testi
  - Fourier ADF Birim Kök Testi (Enders ve Lee (2012))
  - Doğrusal Modellere Dayalı Fourier Birim Kök Testi; Fourier ADF (Christopoulos ve León-Ledesma (2010))
  - Doğrusal Olmayan Modellere Dayalı Fourier Birim Kök Testi; Fourier KSS (Christopoulos ve León-Ledesma (2010))
  - Kesirli Frekanslı Fourier Birim Kök Testi
  - Kırılmalı – Fourier Panel Durağanlık Testi
- Fourier Fonksiyonlarına Dayanan Eşbütünleşme ve Nedensellik Testleri
  - Fourier Shin Eşbütünleşme Testi
  - Fourier ADL Eşbütünleşme Testi
  - Fourier EG Eşbütünleşme Testi (Yilanci(2017))
- Kalıntılarla Genişletilmiş Birim Kök Testleri
  - RALS ADF Birim Kök Testi
  - RALS LM Birim Kök Testi
- Kalıntılarla Genişletilmiş Eşbütünleşme Testleri
  - RALS ADL Eşbütünleşme Testi
  - RALS EG Eşbütünleşme Testi
- Asimetrik Parçalara Dayanan Eşbütünleşme Testleri
  - Granger & Yoon Saklı Eşbütünleşme Testi
  - Hatemi-J & Irandoust Saklı Eşbütünleşme Testi
  - Yilanci (2018) Saklı Eşbütünleşme Testi
  - Hatemi-J Panel Saklı Eşbütünleşme Testi

- Asimetrik Parçalara Dayanan Nedensellik Testleri
  - Hatemi-J Asimetrik Nedensellik Testi
  - Dumitrescu-Hurlin Panel Nedensellik Testi & Panel Asimetrik Nedensellik Testi
- Asimetrik etki tepki fonksiyonları
- Harvey vd.(2008) Doğrusallık Testi
- Zamanla Değişen Formda Nedensellik ve Eşbütünleşme Testleri
  - Zamanla Değişen Simetrik Nedensellik Testi
  - Zamanla Değişen Asimetrik Nedensellik Testi
  - Zamanla Değişen Panel Nedensellik Testi

Eğitim programının süresi 3 gün (21 saat) olup; katılımcıların dizüstü bilgisayarı ile katılımları gerekmektedir. Eğitim seminerinde kullanılacak programların (Gauss, Eviews, Winrats) katılımcılar tarafından edinilmesi beklenmektedir.