## Ekonometri II Ödev 1

## Teslim Tarihi 03 Nisan 2017 Sınav Saati

**Vadeli Mevduat (VADELİ):** Bağımlı değişkenimiz, bankalarda aylık vadelerle işlem gören mevduatların yıllık karşılığıdır.

**Vadesiz Mevduat (VADESİZ):** Bankalardaki vadesiz mevduatların yıllık karşılığıdır.

**Faiz Oranı (FAİZ):** 12 ay vadeli ağırlıklandırılmış mevduat faiz oranlarının yıllık karşılığıdır. *(TCMB notu: Mevduat faiz oranlarında, bankaların vadeler itibariyle ilgili ay içinde uygulayacağını bildirdiği azami faiz oranlarının mevduat tutarları ile gün sayısına göre ağırlıklandırılarak hesaplanmış ortalamaları alınmaktadır.)*

**Kişibaşı GSMH (GSMH):** Yıl içinde kişibaşına düşen gelir karşılığını ifade etmektedir. Toplam GSMH’nin yıl ortasındaki ortalama nüfus değerine bölünmesiyle elde edilir. *(TCMB notu: Yıl ortası nüfus değerleri; 1990-1996 yılları 1985-1990 nüfus projeksiyonu, 1997-1999 yılları 1997 yılı nüfus tespiti, 2000-2004 ise 2000 yılı genel nüfus sayımına göre verilmiştir.)*

**TEFE (TEFE):** Toptan eşya fiyatlarındaki yıllık yüzde değişimleri ifade etmektedir.

**Döviz Kuru (DÖVİZ):** Yıl içindeki ortalama dolar kurunun TL karşılığıdır.

Aşağıda verilen verileri kullanarak

LOG(VADELI) = **α0** + **α1** LOG(FAIZ) + **α2** LOG(GSMH) + **α3** LOG(DOVIZ)+e

modelini Evews programını kullanarak tahmin etmeniz beklenmektedir.

1) Modelde tahmin edilen parametre katsayılarının tek başına anlamlı olup olmadığına %5 anlamlılık düzeyinde bakınız.

2) Modelin parametre tahmincileri bir bütün olarak %5 anlamlılık düzeyinde anlamlı mıdır bakınız.

3) Parametre tahmincilerini yorumlayınız.

4)Yapısal kırılma olduğu düşünülen 1995 yılına göre modeli iki gruba ayırarak 1987-1994 ve 1995-2004 için Chow testini yapınız.

5)Modelin matematiksel formunun doğru olup olmadığını CV testi ile test ediniz.

6) Çoklu doğrusal bağlantı sorununu yan regresyonları oluşturarak test ediniz.

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Yıllar** | **Vadeli Mevduat** | **Vadesiz Mevduat** | **Faiz** | **GSMH** | **Yıl Ortası Nüfus** | **Kişibaşı GSMH** | **TEFE** | **Döviz Kuru** |
| (milyon tl) | | (milyon tl) | (%) | (milyon tl) | (milyon) | (tl) | (%) | (tl) |
| 1987 | 8,13 | 6,23 | 56,00 | 129,22 | 52,56 | 2,46 | 32,19 | 0,0009 |
| 1988 | 18,71 | 7,60 | 83,90 | 227,32 | 53,72 | 4,23 | 68,22 | 0,0014 |
| 1989 | 27,99 | 12,26 | 58,83 | 393,06 | 54,89 | 10,16 | 69,43 | 0,0021 |
| 1990 | 41,77 | 18,89 | 59,35 | 630,12 | 56,20 | 11,21 | 54,67 | 0,0026 |
| 1991 | 76,19 | 27,38 | 72,70 | 1093,37 | 57,31 | 22,08 | 58,16 | 0,0042 |
| 1992 | 126,64 | 46,13 | 74,24 | 1981,87 | 58,40 | 33,94 | 65,53 | 0,0069 |
| 1993 | 186,85 | 74,50 | 74,76 | 3868,43 | 59,49 | 65,03 | 64,02 | 0,0110 |
| 1994 | 441,29 | 127,01 | 95,56 | 7762,46 | 60,58 | 128,14 | 118,47 | 0,0298 |
| 1995 | 971,67 | 195,88 | 92,32 | 14772,11 | 61,64 | 239,64 | 88,01 | 0,0457 |
| 1996 | 2131,21 | 566,40 | 98,77 | 28835,88 | 62,70 | 459,92 | 78,66 | 0,0814 |
| 1997 | 4293,19 | 893,14 | 96,56 | 52224,95 | 62,48 | 835,87 | 80,75 | 0,1521 |
| 1998 | 6250,48 | 1402,46 | 95,50 | 77415,27 | 63,46 | 1219,93 | 70,14 | 0,2610 |
| 1999 | 7882,46 | 2822,66 | 46,73 | 124583,46 | 64,35 | 1936,18 | 52,79 | 0,4201 |
| 2000 | 14805,61 | 3209,97 | 45,64 | 178412,44 | 67,46 | 2644,68 | 50,65 | 0,6237 |
| 2001 | 26329,20 | 5376,65 | 65,50 | 277574,06 | 68,62 | 4045,21 | 66,16 | 1,2254 |
| 2002 | 46721,93 | 7914,97 | 48,19 | 359762,93 | 69,63 | 5167,08 | 51,32 | 1,5058 |
| 2003 | 61036,06 | 11418,45 | 28,59 | 430511,48 | 70,71 | 6088,24 | 23,84 | 1,4931 |
| 2004 | 80830,98 | 12338,41 | 22,06 | 353980,19 | 71,79 | 4930,84 | 12,21 | 1,4223 |