## 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  |