

# İÇİNDEKİLER

<b>Kapak</b>	<b>i</b>
<b>Önsöz</b>	<b>v</b>
<b>İçindekiler</b>	<b>vii</b>
<b>Bölüm 1. Çok Değişkenli Zaman Serileri Yöntemlerine Giriş</b>	<b>1</b>
1.1. Uygulama	8
<b>Bölüm 2. Birim Kök Testleri</b>	<b>15</b>
2.1. Dickey-Fuller Testi	18
2.2. Geliştirilmiş Dickey-Fuller Testi	20
2.3. Phillips-Perron Testi	21
2.4. Molinas ve Schwert Testi	23
2.5. Hall Testi	24
2.6. Sargan-Bhargava Testi	26
2.7. Phillips ve Ouliaris Testi	27
2.8. Sims Testi	28
2.9. Birim Kök Testi ile ilgili Bazı Uygulamalar	29
2.10 Uygulama	32
<b>Bölüm 3. Vektör Otoregresyon Modellerinin Belirlenmesi</b>	<b>40</b>
3.1. Vektör Otoregresyon Modellerinin İncelenmesi	45
3.2. Gecikme Sayısının Tespiti	51
3.2.1. Nedensellik Analizinde Gecikme Sayısının Tespiti	52
3.2.2. Vektör Otoregresyon Modelinde Gecikme Sayısının Tespiti	56
3.3. Mevsimsel Vektör Otoregresyon Modeli	65
3.4. Uygulama	67
3.5. Benzetim Çalışması	70
3.6. Sonuç	81

<b>Bölüm 4. Vektör Otoregresyon Modelinin Verilere Uygulanma Yöntemi</b>	<b>83</b>
4.1. Etki Tepki Fonksiyonu ve Varyans Ayırıştırması	88
4.2. Uygulama	100
4.2.1. Vektör Otoregresyon Modeli	104
4.2.2. Etki Tepki Fonksiyonu	105
4.2.3. Varyans Ayırıştırması	110
<b>Bölüm 5. Eşbütünleşme Analizi</b>	<b>112</b>
5.1. Eşbütünleşme Testleri	120
5.1.1. Eşbütünleşme Regresyonu Durbin-Watson Testi	121
5.1.2. Dickey-Fuller Eşbütünleşme Testi	122
5.1.3. Geliştirilmiş Dickey-Fuller Eşbütünleşme Testi	122
5.1.4. Kısıtlı Vektör Otoregresyon Testi	122
5.1.5. Geliştirilmiş Kısıtlı Vektör Otoregresyon Testi	123
5.1.6. Kısıtsız Vektör Otoregresyon Testi	124
5.1.7. Geliştirilmiş Kısıtsız Vektör Otoregresyon Testi	124
5.2. Eşbütünleşme Tahmin Yöntemi	125
5.3. Çok Değişkenli Eşbütünleşme Testi	127
5.4. Çok Değişkenli Eşbütünleşme Tahmin Yöntemi	131
5.5. Sonuç	137
5.6. Eşbütünleşme Analizi ile ilgili Bazı Uygulamalar	139
5.7. Uygulama	144
<b>Kaynaklar</b>	<b>150</b>
<b>Ekler</b>	<b>163</b>
Ek 1 Uygulama Verileri	165
Ek 2 İstatistik Tabloları	176
<b>Dizin</b>	<b>180</b>