

1. Aşağıdaki denklemin hata terimlerinin ikinci mertebe otokorelasyon durumunu inceleyiniz.

“32 aylık gözlem kullanılmıştır.”

$$\hat{Y}_t = 0.154206103 - 0.0006 X_t$$

$$(0,87) \quad (-0,26)$$

$$e_t = 0,0009 - 0,0000002X_t - 0,018e_{t-1} - 0,04e_{t-2}$$

$$R^2 = 0,01$$

$$Dw-d = 1,93$$

$$\Sigma e_t^2 = 264,69$$

-
2. Onikinci mertebe basit otoregresif süreç [SAR(12)] test edilmek istenseydi hangi test istatistiği kullanılırdı kısaca anlatınız. *hipotez, ismi ve formül*

-
3. Yıllık verilerle tahmin edilen aşağıdaki regresyon denkleminde, üretim fiyat endeksi değişkeni, faiz oranı ve bir dönem gecikmeli fiyat endeksi değişkeni ile açıklanmaya çalışılmıştır. *otokorelasyon bulun...*

Regresyon aralığı : 1980 - 2002

$$\dot{U}FE_t = -0,09 + 0,06FO_t + 0,9\dot{U}FE_{t-1}$$

$$s.h. \quad (0,05) \quad (0,009) \quad (0,0009)$$

$$DW-d : 1,56$$

$$F_{hes} : 1117894$$