

# Panel Data

Sedat Alataş

ADU-İktisat

*sedat.alatas@adu.edu.tr*

Mayıs 2022

- Neden birim kök testi yapıyoruz? Sahte regresyon problemi?
- Fark alma
- Yapısal kırılmalar (Energy Efficiency: RALS-LM) ve Fourier
- Panel birim kök testleri: cross-sectional dependence?
  - Birinci-nesil vs. ikinci nesil
- Homojenlik testi?

- Fark alma: bilgi kaybı
- $I(1)$  süreç
- $I(1)$  ve  $I(0)$ : ARDL
- Panel eşbütünleşme test istatistikleri (Westerlund LM, ECM, Kao, Pedroni)

- Mean group estimators (MG, AMG, CCEMG)
- DOLSMG, DSUR, CUP-FM, BA-OLS
- Logit-probit: Club convergence
- Pooled OLS, FE, RE, DGMM, SGMM
- Örnek: Stata uygulama, JEM, data5.xlsx

# Son