

Türkiye’de Otomotiv Üretiminin Oynaklığının Otoregresif Koşullu Değişen Varyans ve Genelleştirilmiş Otoregresif Koşullu Değişen Varyans Modelleri Yardımıyla Analizi

Rahmi YAMAK¹
Zeynep KARAÇOR²
Volkan ALPTEKİN³
Burcu GÜVENEK⁴

Özet

Bu çalışmada öncelikle doğrusal olmayan ARCH ve GARCH Modellerinin teorik yapısına değinilmiş, ardından Türkiye otomotiv sektörünün 1980’den günümüze geçirdiği gelişim istatistikler ve grafiklerle incelenmiştir. Sonrasında ise ARCH ve GARCH Modelleri yardımıyla otomotiv sanayi üretiminin 2002–2008 yılları arasında oynaklığı ölçülmeye çalışılmış ve 2009 yılı Ocak - Haziran aylarına ilişkin öngöründe bulunulmuştur.

Anahtar Kelimeler: *Otomotiv Sanayi, ARCH, GARCH, Öngörü*

Analysis of the Volatility of the Turkish Automotive Production under the ARCH and GARCH Models

Abstract

Initially in this study nonlinear ARCH and GARCH models having been dealt with their theoretic structure, then has been analysed the development of the Turkish automotive industry since 1980 to present with statistics and graphics. After this, by the helping of the ARCH and GARCH models has been trying to be measured the volatility of the automotive industrial production between the period of 2002 – 2008 and has been projected about the January to June of 2009.

Keywords: *Automotive Industry, ARCH, GARCH, Forecast*

¹ Prof. Dr., Karadeniz Teknik Üniversitesi, İ.İ.B.F., Ekonometri Bölümü, yamak@ktu.edu.tr

² Doç. Dr., Selçuk Üniversitesi, İ.İ.B.F., İktisat Bölümü, Konya, zkaracor@selcuk.edu.tr

³ Arş.Gör.Dr., Selçuk Üniversitesi, İ.İ.B.F., İktisat Bölümü, Konya, valptekin@selcuk.edu.tr

⁴ Arş.Gör.Dr., Selçuk Üniversitesi, İ.İ.B.F., İktisat Bölümü, Konya, burcuguvenek@selcuk.edu.tr