

Dersin Adı	Kodu	Yarıyılı	T+U	Kredisi	AKTS
Zaman Serisi Analizi	1003844	VIII	3+0	3	6
Ön koşul Dersler					
Dersin Dili	Türkçe				
Dersin Türü	Seçmeli				
Dersin Koordinatörü					
Dersi Veren					
Dersin Yardımcıları					
Dersin Amacı	Modern ekonometrik zaman serisi tekniklerini ileri düzeyde öğretilmesi ve bir ekonometrik paket programı kullanarak uygulamalı olarak zaman serilerini analiz edebilme imkanının oluşturulmasıdır.				
Dersin Öğrenme Çıktıları	<b>Bu dersin sonunda öğrenci;</b> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Zaman serisi kavramını bilir.</li> <li>2. Zaman serilerini analiz tekniklerinin bilir ve uygular.</li> <li>3. Ekonometrik yöntemler ile iktisat biliminin analizini ve politika önermelerini yapar.</li> <li>4. Uygun bir ekonometrik paket programı üst düzeyde kullanır.</li> <li>5. İktisadi olgular arasında neden sonuç ilişkisi kurabilir, probleme dair objektif çıkarımlarda bulunur, ileri yönelik öngörülebilir bulunur.</li> <li>6. Alanıyla ilgili zaman serisi içeren çalışmalarını derinlemesine anlar.</li> </ol>				
Dersin İçeriği	AR, MA, ARMA, ARIMA, gibi tek değişkenli ekonometrik teknikler yanında, VAR, ECM, farklı eşbütünlük teknikleri ile ARCH ve GARCH uygulamaları işlenecektir. Ekonometrik uygulamalar gerçek veri setleri kullanılarak, ekonometrik paket program ile bilgisayar laboratuvarında yapılması teşvik edilecektir.				
<b>Haftalar</b>	<b>Konular</b>				
1	Basit Ve Çoklu Regresyon Tekniklerinin Gözden Geçirilmesi				
2	Basit Ve Çoklu Regresyon Tekniklerinin Gözden Geçirilmesi –Sahte Regresyon Sorunu				
3	ARIMA Modellerine Giriş				
4	Arıma Modelleri				
5	ARIMA Modelleri-Devam				
6	Durağanlık Analizi				
7	<b>Ara Sınav</b>				
8	Birim Kök Analizi				
9	Var Modellemesi				
10	Nedensellik Analizi				
11	Eşbütünlük Ve ECM Analizi				
12	Eşbütünlük Ve ECM Analizi-Devam				
13	ARCH Ve GARCH Modellemeleri				
14	ARCH Ve GARCH Modellemeleri-Devam				
<b>Genel Yeterlilikler</b>					
Zaman serisi veriler ile çalışır. Zaman serisi ekonometrisinin temel yöntemlerini uygulamalarda kullanır. İktisadi olgular arasında ilişki kurarken konuya uygun model seçimi yapar. Zaman serisi verileri için yorumlar ve öngörüler yapabilme yetkinliğine sahip olur.					
<b>Kaynaklar</b>					
Hamilton, J.D. (1994). <i>Time Series Analysis</i> . Princeton University Press Harvey, A.C. (1993). <i>Time Series Models</i> . 2nd Ed. Harvester Wheatsheaf Kutlar, A. (2000). <i>Ekonometrik Zaman Serileri: Teori ve Uygulama</i> . Gazi Kitabevi. Maddala, G.S. & In-Moo Kim (1998). <i>Unit Roots, Cointegration and Structural Changes</i> . Cambridge University Press					
<b>Değerlendirme Sistemi</b>					
Ara Sınav % 40 Final % 60					

**PROGRAM ÖĞRENME ÇIKTILARI İLE  
DERS ÖĞRENİM KAZANIMLARI İLİŞKİSİ TABLOSU**

	PÇ 1	PÇ 2	PÇ 3	PÇ 4	PÇ 5	PÇ 6	PÇ 7	PÇ 8	PÇ 9	PÇ 10	PÇ 11	PÇ 12	PÇ 13	PÇ 14	PÇ 15	PÇ 16	PÇ 17	PÇ 18
ÖK1	5	3	4	3	5	5	3	3	2	5	2	1	3	2	5	2	5	2
ÖK2	5	3	4	3	5	5	3	3	2	5	2	1	3	2	5	2	5	2
ÖK3	5	3	4	3	5	5	3	3	2	5	2	1	3	2	5	2	5	2
ÖK4	5	3	4	3	5	5	3	3	2	5	2	1	3	2	5	2	5	2
ÖK5	5	3	4	3	5	5	3	3	2	5	2	1	3	2	5	2	5	2
ÖK6	5	3	4	3	5	5	3	3	2	5	2	1	3	2	5	2	5	2
<b>ÖK: Öğrenme Kazanımları PÇ: Program Çıktıları</b>																		
<b>Katkı Düzeyi</b>	<b>1 Çok Düşük</b>			<b>2 Düşük</b>			<b>3 Orta</b>			<b>4 Yüksek</b>			<b>5 Çok Yüksek</b>					

**Program Çıktıları ve İlgili Dersin İlişkisi**

Dersin Adı	PÇ 1	PÇ 2	PÇ 3	PÇ 4	PÇ 5	PÇ 6	PÇ 7	PÇ 8	PÇ 9	PÇ 10	PÇ 11	PÇ 12	PÇ 13	PÇ 14	PÇ 15	PÇ 16	PÇ 17	PÇ 18
Zaman Serisi Analizi	5	3	4	3	5	5	3	3	2	5	2	1	3	2	5	2	5	2