**DERS İZLENCESİ**

|  |  |
| --- | --- |
| **Dersin Adı** | Zaman Serisi Ekonometrisi-I |
| **Dersin Kredisi** | 3 |
| **Dersin AKTS'si** | 6 |
| **Dersin Yürütücüsü** | Dr. Öğr. Üyesi Levent KAYA |
| **Dersin Gün ve Saati** | Perşembe 09.00 – 12.00 |
| **Ders Görüşme Gün ve Saatleri** | Pazartesi 14.00 – 15.00 |
| **İletişim Bilgileri** | lekaya[@harran.edu.tr](mailto:.............@harran.edu.tr) 414.3183000-1823 |
| **Öğretim Yöntemi ve Ders Hazırlık** | Yüz yüze. Konu anlatım, Soru-yanıt, örnek çözümler, doküman incelemesi. Derse hazırlık aşamasında, öğrenciler ders kaynaklarından her haftanın konusunu derse gelmeden önce inceleyerek gelecekler. Haftalık ders konuları ile ilgili tarama yapılacak. |
| **Dersin Amacı** | Zaman serisi verilerinin ekonometrik analizini teorik ve uygulamalı olarak iyi öğrenmesini sağlamaktır. Özellikle öğrencilerin ekonomik verilerin tek değişkenli zaman serisi modelleri ile ilgili gerekli bilgiler ile donatılması amaçlanmaktadır. Ekonometrik paket programlarının kullanımı, bu dersin tamamlayıcısıdır ve uygulama makroekonomik ve finansal verilerle yapılmaktadır.   |  | | --- | |  | |
| **Dersin Öğrenme Çıktıları** | **Bu dersin sonunda öğrenci;**  1. Zaman serisine ait temel kavramlar hakkında yorumlama yapar.  2. Zaman serilerini analiz tekniklerini bilir ve uygular.  3.Ekonometrik yöntemler ile iktisat bilimi analizi ve politika önermeleri yapar.  4. Uygun bir ekonometrik paket programı üst düzeyde kullanır.  5. İktisadi olgular arasında neden sonuç ilişkisi kurabilir, probleme dair objektif çıkarsamada bulunabilir, ileri yönelik öngörüde bulunur.  6. Alanıyla ilgili zaman serisi içeren çalışmaları derinlemesine anlar.   |  | | --- | |  | |
| **Haftalık Ders Konuları** | **1. Hafta** Zaman serisine giriş, temel kavramlar  **2. Hafta** Zaman serisinin bileşenleri ve süreçler  **3.Hafta** Otorelasyon fonksiyonu, Kısmi Otokorelasyon Fonksiyonu  **4.Hafta** Eviews Programına giriş  **5.Hafta** Otoregresif süreçler(AR(p), MA(q), ARMA(p,q))  **6.Hafta** Box-Jenkins Modelleme Yaklaşımı (ARIMA)  **7.Hafta** Arasınav + Bilgisayar Uygulaması (Eviews)  **8.Hafta** Durağanlık kavramı ve Durağanlığın Tespiti (Grafik, Korelogram)  **9.Hafta** Bilgisayar Uygulaması (Eviews)  **10. Hafta** Birim Kök Testleri (ADF, Phillips-Perron, KPSS)  **11.Hafta** Bilgisayar Uygulaması (Eviews)  **12. Hafta** Yapısal Kırılmalı Birim Kök Testleri (Perron, Zivot-Andrews, Lee-Strazicich)  **13.Hafta** Bilgisayar Uygulaması (Eviews)  **14.Hafta** Genel Değerlendirme |
| **Ölçme-Değerlendirme** | Bu ders kapsamında 1(bir) Ara Sınav, Müfredat konularını kapsayan 1(bir) Kısa Sınav ve 1(bir) Yarıyıl Sonu Sınavı yapılacaktır. Her bir değerlendirme kriterinin başarı puanına etkisi yüzdelik olarak aşağıda verilmiştir.  **Kısa Sınav:** %10  **Ara Sınav**: %40  **Yarıyıl Sonu Sınavı:** %50  Ara Sınav Tarih ve Saati: Ara sınavlar 07-18 Kasım 2022 tarihleri arasında Birim Tarafından ilan edilecek tarih ve saatlerde yapılacaktır.  **Kısa Sınav Tarih ve Saati**: 19.10.2022 (Ders saatinde Yapılacaktır) |
| **Kaynaklar** | **Akgül, I. (2003).** Zaman Serilerinin Analizi ve ARIMA Modelleri. Der Yayınları.  **Enders, W. (2005).** Applied Econometric Time Series. John Wiley and Sons.  **Kutlar, A. (2000).** Ekonometrik Zaman Serileri: Teori ve Uygulama. Ankara: Gazi Kitabevi.   |  | | --- | |  | |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | **PROGRAM ÖĞRENME ÇIKTILARI İLE**  **DERS ÖĞRENİM KAZANIMLARI İLİŞKİSİ TABLOSU** | | | | | | | | | | | | | | | | | |
|  | **PÇ1** | **PÇ2** | **PÇ3** | **PÇ4** | **PÇ5** | **PÇ6** | | **PÇ7** | **PÇ8** | **PÇ9** | | **PÇ10** | **PÇ11** | **PÇ12** | | **PÇ13** | **PÇ14** | **PÇ15** |
| **ÖK1** | 5 | 5 | 5 | 3 | 5 | 5 | | 3 | 3 | 3 | | 3 | 3 | 2 | | 2 | 3 | 1 |
| **ÖK2** | 5 | 5 | 5 | 3 | 5 | 5 | | 3 | 3 | 3 | | 3 | 3 | 2 | | 2 | 3 | 1 |
| **ÖK3** | 5 | 5 | 5 | 3 | 5 | 5 | | 3 | 3 | 3 | | 3 | 3 | 2 | | 2 | 3 | 1 |
| **ÖK4** | 5 | 5 | 4 | 4 | 3 | 3 | | 3 | 3 | 3 | | 3 | 3 | 2 | | 2 | 3 | 1 |
| **ÖK5** | 5 | 5 | 4 | 4 | 3 | 3 | | 3 | 3 | 3 | | 3 | 3 | 2 | | 2 | 3 | 1 |
| **ÖK6** | 5 | 5 | 4 | 4 | 3 | 3 | | 3 | 3 | 3 | | 3 | 3 | 2 | | 2 | 3 | 1 |
| **ÖK: Öğrenme Kazanımları PÇ: Program Çıktıları** | | | | | | | | | | | | | | | | | | |
| **Katkı Düzeyi** | **1 Çok Düşük** | | | **2 Düşük** | | | **3 Orta** | | | | **4 Yüksek** | | | | **5 Çok Yüksek** | | | |

**Program Çıktıları ve İlgili Dersin İlişkisi**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **Dersin Adı** | **PÇ1** | **PÇ2** | **PÇ3** | **PÇ4** | **PÇ5** | **PÇ6** | **PÇ7** | **PÇ8** | **PÇ9** | **PÇ10** | **PÇ11** | **PÇ12** | **PÇ13** | **PÇ14** | **PÇ15** |
| **İstatistiğe Giriş I** | 5 | 5 | 5 | 4 | 4 | 4 | 3 | 3 | 3 | 3 | 3 | 2 | 2 | 3 | 1 |