

Dersin Adı	Kodu	Yarıyılı	T+U	Kredisi	AKTS
Zaman Serisi Ekonometrisi-I	1002702	VII	3+0	3	6
Ön koşul Dersler					
Dersin Dili	Türkçe				
Dersin Türü	Zorunlu				
Dersin Koordinatörü					
Dersi Veren					
Dersin Yardımcıları					
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	<p><b>Bu dersin sonunda öğrenci;</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. Zaman serisine ait temel kavramlar hakkında yorumlama yapar.</li> <li>2. Zaman serilerini analiz tekniklerini bilir ve uygular.</li> <li>3. Ekonometrik yöntemler ile iktisat bilimi analizi ve politika önermeleri 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 çıkarsamada bulunabilir, ileri yönelik öngörude bulunur.</li> <li>6. Alanıyla ilgili zaman serisi içeren çalışmaları derinlemesine anlar.</li> </ol>				
Dersin İçeriği	Zaman serisine giriş, temel kavramlar, grafik analizleri, zaman serisinin bileşenleri(trend ve mevsimsellik), otokorelasyon fonksiyonu (korelogram) ve testleri (Bartlett, Box-Pierce Q, Ljung-Box Q* testleri), saf hata süreci, rastsal gidiş süreci ve modeli, durağanlık, durağan olmama, Stokastik trend, Deterministik trend, Dickey ve Fuller(1981) testi, Dickey ve Fuller (1979) DF ve ADF birim kök testleri, Eşbütünleşme kavramı ve analizi, Engle ve Granger Eşbütünleşme yaklaşımı, Eşbütünleşme testi, Hata Düzeltme Modeli, nedensellik analizi ve Granger nedensellik testi, yapısal kırılma ve Perron (1989) yapısal kırılma testi.				
<b>Haftalar</b>	<b>Konular</b>				
1	Zaman serisine giriş, temel kavramlar, grafik analizleri				
2	Zaman serisinin bileşenleri(trend ve mevsimsellik)				
3	Okorelasyon fonksiyonu (korelogram) ve testleri (Bartlett, Box-Pierce Q, Ljung-Box Q* testleri)				
4	Saf hata süreci, rastsal gidiş süreci ve modeli,				
5	Durağanlık, durağan olmama,				
6	Stokastik trend, Deterministik trend				
7	Ara Sınav				
8	Dickey ve Fuller(1981) testi, Dickey ve Fuller (1979) DF ve ADF birim kök testleri				
9	Nedensellik analizi				
10	Granger nedensellik testi				
11	Eşbütünleşme				
12	Eşbütünleşme ve ECM analizi				
13	Yapısal kırılma ve Perron (1989) yapısal kırılma testi				
14	Yapısal kırılma ve Perron (1989) yapısal kırılma testi- devam				
<b>Genel Yeterlilikler</b>					
1.Zaman serisi verileri ile çalışır ve zaman serisi ekonometrisinin temel yöntemlerini uygulanmalarda kullanır.					
2.İktisadi olgular arasında ilişki kurarken konuya uygun model seçimi yapar.					
3. Zaman serisi verileri için yorumlar ve öngörüler yapabilme yetkinliğine sahip olur.					
<b>Kaynaklar</b>					
Akgül, I. (2003). <i>Zaman Serilerinin Analizi ve ARIMA Modelleri</i> . DerYayımları.					
Enders, W. (2005). <i>Applied Econometric Time Series</i> . John Wiley and Sons.					
Hamilton, J.D. (1994). <i>Time Series Analysis</i> . Princeton University Press					
Harris, R. & Sollis, R. (2003). <i>Applied Time Series Modelling and Forecasting</i> . John Wiley and Sons					
Harvey, A.C. (1993). <i>Time Series Models</i> . 2nd Ed. Harvester Wheatshaef					
Kutlar, A. (2000). <i>Ekonometrik Zaman Serileri: Teori ve Uygulama</i> . Ankara: Gazi Kitabevi.					
Maddala, G.S. & In-Moo Kim (1998). <i>Unit Roots, Cointegration and Structural Changes</i> . Cambridge University.					
<b>Değerlendirme Sistemi</b>					
<b>Ara Sınav: % 40</b>					
<b>Final: % 60</b>					
<b>Bütünleme:</b>					

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	5	5	4	5	5	5	5	3	4	3	3	3
ÖK2	5	5	5	5	5	4	5	5	5	5	3	4	3	3	3
ÖK3	5	5	5	5	5	4	5	5	5	5	3	4	3	3	3
ÖK4	5	5	5	5	5	4	5	5	5	5	3	4	3	3	3
ÖK5	5	5	5	5	5	4	5	5	5	5	3	4	3	3	3
ÖK6	5	5	5	5	5	4	5	5	5	5	3	4	3	3	3
<b>ÖK: Öğrenme Kazanımları PÇ: Program Çıktıları</b>															
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
Zaman Serisi Ekonometrisi-I	5	5	5	5	5	4	5	5	5	5	3	4	3	3	3