

Dersin Adı	Kodu	Yarıyılı	T+U	Kredisi	AKTS
Zaman Serisi Ekonometrisi-II	1002802	VIII	3+0	3	5
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. Ekonomik verilerin çok değişkenli zaman serisi modelleri ile ilgili gerekli bilgiler ile donatılması amaçlanmaktadır..				
Dersin Öğrenme Çıktıları	Bu dersin sonunda öğrenci; <ol style="list-style-type: none"> 1. Zaman serisi kavramını derinlemesine bilir. 2. Zaman serilerine ait ileri analiz tekniklerini bilir ve uygular. 3. Ekonometrik yöntemler ile iktisat biliminin analizini ve politika önermelerini yapar. 4. Uygun ekonometrik paket programlarını üst düzeyde kullanır. 5. İktisadi olgular arasında neden sonuç ilişkisi kurabilir, probleme dair objektif çıkarımlarda bulunur, ileri yönelik öngörülebilir bulunur. 6. Alanıyla ilgili zaman serisi içeren çalışmaları derinlemesine anlar. 				
Dersin İçeriği	Vektör otoregresif modeller, gecikme uzunluğunun belirlenmesi, etki-tepki analizi, varyans ayrıştırma, çoklu eştümleşme testi (Johansen testi), Vektör hata düzeltme modelleri, Stokastik mevsimsellik ve mevsimsel birim kök, mevsimsel birim kök testleri (HEGY), mevsimsel eştümleşme, mevsimsel hata düzeltme modeli.				
Haftalar	Konular				
1	VAR modelleri				
2	VAR modelleri, gecikme uzunluğunun seçilmesi (matris ve denklem gösterimleri)				
3	Etki-tepki fonksiyonları				
4	Varyans ayrıştırma analizi.				
5	Uygulama				
6	Uygulama				
7	Ara Sınav				
8	Çokdeğişkenli Johansen eşbütünleşme testi				
9	Vektör hata düzeltme modelleri				
10	Uygulama				
11	Mevsimsellik, mevsimsel birim kök				
12	Mevsimsel birim kök testleri (HEGY)				
13	Mevsimsel eşbütünleşme ve hata düzeltme modeli				
14	Uygulama				
Genel Yeterlilikler					
1.Zaman serisi veriler ile çalışır. 2.Zaman serisi ekonometrisinin ileri yöntemlerini uygulanmalarda kullanır. 3.Makro düzeyde analizler yapar, öngörülebilir bulunur, politika geliştirir.					
Kaynaklar					
Akgül, I. (2003). <i>Zaman Serilerinin Analizi ve ARIMA Modelleri</i> . Der Yayın. 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 Wheatsheaf Kutlar, A. (2000). <i>Ekonometrik Zaman Serileri: Teori ve Uygulama</i> . Gazi Kitabevi. Lütkepohl, H. (2005). <i>New Introduction to Multiple Time Series Analysis</i> . Springer-Verlag. Maddala, G.S. & In-Moo Kim (1998). <i>Unit Roots, Cointegration and Structural Changes</i> . Cambridge University Press					
Değerlendirme Sistemi					
Ara Sınav: % 40					
Final: % 60					
Bütünleme:					

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
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
Zaman Serisi Ekonometrisi-II	5	5	5	5	5	4	5	5	5	5	3	4	3	3	3