

ZAMAN SERİLERİ ANALİZİ

1	Ders Adı:	ZAMAN SERİLERİ ANALİZİ
2	Ders Kodu:	EKO5101
3	Ders Türü:	Zorunlu
4	Ders Seviyesi	Yüksek Lisans
5	Dersin Verildiği Yıl:	1
6	Dersin Verildiği Yarıyıl	1
7	Dersin AKTS Kredisi:	7.00
8	Teorik Ders Saati (saat/Hafta)	3.00
9	Uygulama Ders Saati(saat/Hafta)	0.00
10	Laboratuvar Ders Saati (saat/hafta) :	0
11	Dersin Önkoşulu:	Yok
12	Dersin Dili:	Türkçe
13	Dersin Veriliş Şekli:	Yüz yüze
14	Dersin Koordinatörü:	Prof. Dr. ERKAN IŞIGIÇOK
15	Dersi Veren Diğer Öğretim Elemanları:	Prof. Dr. Erkan IŞIGIÇOK
16	Koordinatör İletişim Bilgileri:	E-posta : eris@uludag.edu.tr Telefon: 0 224 29 41101 Adres: Uludağ Üniversitesi, İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi, Ekonometri Bölümü,16059, Görükle/Bursa.
17	Dersin WEB adresi:	
18	Dersin Amacı:	Zaman serisi analizinin temel kavramlarının ve modellerinin öğretilmesidir.
19	Dersin Mesleki Gelişime Katkısı:	
20	Dersin Öğrenme Kazanımları:	
	1	Farklı yapıdaki zaman serisi grafiklerini analiz edebilme.
	2	Durağan ve durağan olmayan stokastik süreçleri analiz edebilme.
	3	Ekonometrik yaklaşım ile zaman serileri yaklaşımı arasındaki ilişkiyi bilebilme.
	4	Otoregresif ve hareketli ortalama süreçlerini tanımlayabilme.
	5	Box-Jenkins yaklaşımı kullanabilme.
	6	Granger Nedensellik analizini uygulayabilme ve bulguları yorumlayabilme.
	7	Birim kök testlerini uygulayabilme.
	8	Zaman serisi verilerine ARIMA modelleri ve Nedensel modelleri uygulayabilme.
	9	
	10	
21	Dersin İçeriği:	
Hafta	DERS İÇERİKLERİ	
	Teorik	Uygulama
1	Felsefi ve İstatistiksel Anlamda Nedensellik	

2	Ekonometrik Yaklaşım ve Zaman Serileri Analizi Yaklaşımı	
3	Zaman Serilerini Etkileyen Faktörler	
4	Zaman Serileri Analizinin Teorik Çerçevesi	
5	Nedensellik Testlerinin Teorik Çerçevesi	
6	Eviews Paket Programına Veri Girişi ve Komutların Özellikleri	
7	Değişkenler Arasındaki İlişkilerin Nedensellik Testleri ile Araştırılması ve Eviews Uygulamaları	
8	Zaman Serisi Kalıpları ve Eviews Uygulamaları	
9	Durağan ve Durağan Olmayan Stokastik Süreçler	
10	Korelogram ile Durağanlık Analizi ve Eviews Uygulamaları	
11	Birim Kök Testi ile Durağanlık Analizi ve Eviews Uygulamaları	
12	Box-Jenkins Yöntemi ile AR Modelinin Tahmini ve Eviews Uygulamaları	
13	Box-Jenkins Yöntemi ile MA Modelinin Tahmini ve Eviews Uygulamaları	
14	Box-Jenkins Yöntemi ile ARIMA Modelinin Tahmini ve Eviews Uygulamaları	
22	Ders Kitabı, Referanslar ve/veya Diğer Kaynaklar:	1. Erkan IŞIGIÇOK, Zaman Serilerinde Nedensellik Çözümlemesi, Uludağ Üniversitesi Basımevi, 1994. 2. Mustafa SEVÜKTEKİN ve Mehmet NARGELEÇEKENLER, Zaman Serileri Analizi, Nobel Yayın Dağıtım, 3. Baskı, 2010.
23	Değerlendirme	
YARIYIL İÇİ ÇALIŞMALAR		SAYISI
Ara Sınav		0
Kısa Sınav		0
Ödev		4
Yıl Sonu Sınavı		1
Toplam		5
Yıl içi çalışmalarının Başarıya Oranı		30.00
Finalin Başarıya Oranı		70.00
Toplam		100.00
Kullanılan Ölçme ve Değerlendirme Yaklaşımları		
24	AKTS / İŞ YÜKÜ TABLOSU	

