

ZAMAN SERİLERİ ANALİZİ

1	Ders Adı:	ZAMAN SERİLERİ ANALİZİ
2	Ders Kodu:	EKO4111
3	Ders Türü:	Seçmeli
4	Ders Seviyesi	Lisans
5	Dersin Verildiği Yıl:	4
6	Dersin Verildiği Yarıyıl	7
7	Dersin AKTS Kredisi:	5.00
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:	Doç. Dr. Mehmet Çınar
15	Dersi Veren Diğer Öğretim Elemanları:	
16	Koordinatör İletişim Bilgileri:	mcinar@uludag.edu.tr Uludağ Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Görükle Kampüsü 16059 Nilüfer / Bursa
17	Dersin WEB adresi:	
18	Dersin Amacı:	Zaman Serisi Modelleri dersinin temel amacı, Ekonometri Bölümü öğrencilerinin ekonometriye giriş, ekonometrik modeller, istatistik teorisi ve iktisat derslerinde edindikleri temel bilgileri gerçek iktisadi ilişki örneklerini dikkate alarak analiz yapabilme, kullanabilme ve yorumlayabilme yeteneklerinin sağlanmasıdır.
19	Dersin Mesleki Gelişime Katkısı:	
20	Dersin Öğrenme Kazanımları:	
	1	İktisadi teorileri, istatistiksel ve ekonometrik analizleri daha iyi kavrayabilme
	2	İktisadi olayları niteliksel ve niceliksel düzeyde analiz yapabilme.
	3	Ekonometrik ve istatistiksel analizler ile iktisadi olaylar arasında karşılaştırma yapabilme
	4	İktisadi olaylara ilişkin ekonometrik ve istatistiksel çözümlemelerden planlama ve program yapabilme
	5	Dünya ve Türkiye’de iktisadi olayların özellikle zaman periyodu içerisinde gelişim sürecini daha kolay takip edebilme
	6	Gerçek hayat ilişkilerini baz alarak kısa dönemli analizleri yorumlayabilme
	7	Uzun dönemde iktisadi ilişkilerin varlığını araştırarak çıkarsamalarda bulunabilme
	8	Öğrenilen teknikleri kullanarak iktisadi serilerin kullanıldığı uygulamalı alanlarda çalışabilme
	9	
	10	
21	Dersin İçeriği:	

Hafta	DERS İÇERİKLERİ	
	Teorik	Uygulama
1	Zaman Serisi Kalıpları Genel Tanıtımı	
2	Zaman Serisi Kalıplarının Grafikselsel Analizleri	
3	Zaman Serisi Analizleri, Modelleri ve Bazı Temel Kavramlar	
4	Zaman Serilerinin Otokorelasyon Analizleri, Zaman Serilerinde Kısmî otokorelasyon Analizleri	
5	Zaman Serilerinde Portmanteau Testleri, Zaman Serilerinin Korelogramı ve Durağanlık Testleri	
6	Zaman Serisi Modelleri ve Fark Denklemi, Gecikme İşlemcisi ve Zaman Serisi Modellerine Uygulanması	
7	Durağan Olmayan Zaman Serilerinin Fark Alma Sürecine Göre Durağan Hale Getirilmesi	
8	Ders tekrarı ve Ara Sınav	
9	Korelogramlar ile Durağanlık Testleri	
10	Otoregresif (AR) Süreçler için İstatistiksel Modeller, Hareketli Ortalama (MA) Süreçleri için İstatistiksel Modeller, Otoregresif Hareketli Ortalama (ARMA) Süreçleri için İstatistiksel Modeller	
11	Durağan-dışılık ve Entegrasyon Süreçleri, Otoregresif Entegre Hareketli Ortalama (ARIMA) Süreçleri için İstatistiksel Modeller, Mevsimsel Box-Jenkins ARIMA Modelleri	
12	Tek değişkenli Süreçler için Birim Kökler	
13	Koentegrasyon ve Koentegrasyon Testleri	
14	Hata Düzeltme Modelleri, Mevsimsel Entegrasyon ve Koentegrasyon	
22	Ders Kitabı, Referanslar ve/veya Diğer Kaynaklar:	1. Sevüktekin, M.ve M. Çınar, Ekonometrik Zaman Serileri Analizi: EViews Uygulamalı, Geliştirilmiş Dördüncü Baskı Bursa: Dora Yayın, 2014. 2. Enders, W., Applied Econometric Time Series, New York: John Wiley & Sons, Inc., 1995. 3. Hamilton, J. D., Time Series Analysis, Princeton, New Jersey: Princeton University Pres, 1994. 4. Patterson, K., An Introduction to Applied Econometrics: A Time Series Approach, New York: Macmillan Pres., 2000.
23	Değerlendirme	
YARIYIL İÇİ ÇALIŞMALARI		SAYISI KATKI YÜZDESİ
Ara Sınav		1 40.00
Kısa Sınav		0 0.00
Ödev		0 0.00
Yıl Sonu Sınavı		1 60.00
Toplam		2 100.00
Yıl içi çalışmalarının Başarıya Oranı		40.00
Finalin Başarıya Oranı		60.00
Toplam		100.00

Kullanılan Ölçme ve Değerlendirme Yaklaşımları			
24	AKTS / İŞ YÜKÜ TABLOSU		
ETKİNLİK	SAYISI	Süresi (Saat)	Toplam İş Yüğü (Saat)
Teorik Dersler	14	3.00	42.00
Uygulamalı Dersler	0	0.00	0.00
Sınıf Dışı Ders Çalışma Süresi (Ön çalışma, pekiştirme)	10	4.00	40.00
Ödevler	0	0.00	0.00
Projeler	1	15.00	15.00
Arazi Çalışmaları	0	0.00	0.00
Arasınavlار	1	20.00	20.00
Diğer	0	0.00	0.00
Yarıyıl Sonu Sınavı	1	30.00	30.00
Toplam İş Yüğü			147.00
Toplam İş Yüğü / 30 saat			4.90
Dersin AKTS Kredisi			5.00