



Ders Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U Saat	AKTS	Z / S
İktisadi Zaman Serileri Analizi	İKT5015		3 + 0	7,5	Seçmeli
Birim Bölüm	İktisat YL Tezli İÖ - Lisansüstü (Yüz Yüze)				
Amaç	Dersin amacı, fark denklemlerini çözmeye ve dinamik yapıyı ortaya çıkarmaya, ekonomik zaman serisi verilerini analiz etmek için AR, MA ve ARMA zaman serileri modellerini belirleme ve tahmin etme, zaman serileri modellerinin gecikme süresini belirleme, tek değişkenli zaman serileri modelleri ile öngörüm yapma, Birim kökler ve eşbütünlük için test yapma, hata düzeltme modellerinin belirlenmesi, kısa ve uzun dönem dengelerin analizi, ARDL modellerinin modellenmesi ve Hata Düzeltme modelleri ile ilişkilerinin analiz edilmesi gibi konuların kavranmasıdır.				
Ders İçeriği	Ders, modern zaman serileri analizine temel bir giriş yapmayı amaçlamaktadır. Kapsanan konular arasında, fark denklemleri ve çözümleri, Ardışık Bağlanım (AR), Hareketli Ortalama (MA) ve ARMA modelleri, öngörüm, birim kökler, durağanlık, durağan olmama, eşbütünlük, hata düzeltme, birim kök ve eşbütünlük testleri ve Ardışık Bağlanım Dağıtılmış Gecikme (ARDL) modelleri yer almaktadır.				
Ders Kaynakları	Walter Enders, Applied Econometric Time Series, John Wiley and Sons 2010, Mustafa SEVÜKTEKİN, Mehmet ÇINAR, Ekonometrik Zaman Serileri Analizi, 2017				

Hafta	Konu
1	İstatistiksel Kavramların Kısa Bir Tekrarı
2	Fark denklemleri
3	AR Modelleri: Temel özellikler ve dinamikler
4	MA Modelleri: Temel özellikler ve dinamikler
5	ARMA modeller: Temel özellikler
6	Durağanlık ve Birim Kökler: Test etme ve Sonuçları
7	Durağanlık ve Birim Kökler: Test etme ve Sonuçları Devam
8	Ara Sınav
9	Ardışık Bağlanımlı, Bütünlük, Hareketli Ortalama Modelleri (ARIMA)
10	Eşbütünlük: Test etme ve modelleme
11	Hata Düzeltme Modelleri (ECM)
12	ARDL modelleri and ECM
13	E-Views ile uygulamalar I
14	E-Views ile uygulamalar II
15	Dışadüşenler, zaman serisi analizinde mevsimsellik

Program Çıktıları

- Alanıyla ilgili edindiği teorik bilgileri nitel ve nicel yöntem ve araçları kullanarak uygulamaya dönüştürme becerisini kazanmak.
- Uygulama çalışmalarından elde edilen analiz sonuçlarını doğru bir şekilde yorumlayabilmek.
- Alanı ve diğer disiplinler arasında bağlantı kurarak analiz yapma ve uygulama safhalarında bilgilerini disiplinler arası değerlendirebilme yetisini edinmek.
- Alanıyla ilgili konularda bağımsız çalışabilme ve ekip çalışmalarının getireceği sorumluluklara da açık olmak.
- Uygulama çalışmalarından elde ettiği sonuçları akademik kurallar çerçevesinde rapor halinde yazılı ve sözlü olarak sunabilme becerisini edinmek.
- Alanında edindiği uzmanlık düzeyindeki bilgileri eleştirel bir yaklaşımla değerlendirerek, yaşam boyu öğrenme ve sorgulama bilincine sahip olmak.
- Alanıyla ilgili politika ve çözüm önerilerini bilimsel veri ve yöntemlerle destekleyerek ilgili kişi ve kurumlara yazılı ve sözlü olarak sunabilmek.
- Alanla ilgili çalışmalarda bilimsel, kültürel, toplumsal ve etik değerlere uygun hareket etme hassasiyetini kazanmak.
- Öğrenim deneyimlerini yansıtabilme ve bununla ilgili dönütlere uyum sağlayabilme becerisini edinmek.
- Yaşadığı ülkenin sosyal ve iktisadi sorunlarını analiz edebilecek, çözüm ve politikalar üretebilecek düzeyde toplumu ve ilgili kurumları tanımak.
- Çalıştığı kurumun güçlü ve zayıf yanlarını tespit ederek, uygun stratejileri ortaya koyabilecek bilimsel donanımı edinmek.
- Çalıştığı kurumun ilgili sektör içerisinde rekabet avantajı elde etmesi adına risk yönetimi ve finansal tahmin yapabilme becerisini kazanmak.
- Alanıyla ilgili gelişmeleri takip edebilecek düzeyde yabancı dil bilmek.
- Alanının gerektirdiği düzeyde bilgi ve iletişim teknolojilerini kullanabilme yeteneğine sahip olmak.

Ders Öğrenme Çıktısı - Program Çıktıları (1 -5 Puan Aralığı)

Ders Öğrenme Çıktısı	PÇ 1	PÇ 2	PÇ 3	PÇ 4	PÇ 5	PÇ 6	PÇ 7	PÇ 8	PÇ 9	PÇ 10	PÇ 11	PÇ 12	PÇ 13	PÇ 14
Fark denklemlerini çözebilir ve zımnı dinamik yapıyı ortaya çıkarabilir.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
AR, MA, ARMA ve ARIMA modellerini belirleyebilir ve tahmin edebilir ve bu modelleri önkestirim için kullanabilir,	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Durağanlık, durağan olmama, eşbütünleşme, hata düzeltme; stokastik trendler, kısa ve uzun dönem denge, Ardışık ilişki; Kısmi ardışık ilişki kavramlarını açıklayabilir ve tartışabilir,	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Model seçimi için Kısmi Ardışık İlişki Fonksiyonu (PACF), Lagrange Çarpan (LM) testi, AIC, SIC kriterlerini kullanabilir,	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Birim kök ve eşbütünleşme kavramlarını test edebilir	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Ortalama Değer	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

<https://ebs.bilecik.edu.tr/pdf/dersbilgiyetir/409812>