



AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ DERS BİLGİ FORMU

Dersin Adı		Zaman Serisi Analizi							
Ders Kodu		FEK504		Ders Düzeyi		Yüksek Lisans			
AKTS Kredi	5	İş Yüğü	124 (Saat)	Teori	3	Uygulama	0	Laboratuvar	0
Dersin Amacı		Öğrencilere zaman serileriyle ilgili temel bilgileri kavratmak							
Özet İçeriğı		Zaman serisi analizi, durağanlık, Otokorelasyon, birim kök testi							
Staj Durum		Yok							
Öğretim Yöntemleri		Anlatım (Takrir), Gösterip Yaptırma							
Dersi Veren Öğretim Elemanı(ları)			Doç. Dr. Hatice AKDAĞ						

Ölçme ve Değerlendirme Araçları

Araç	Adet	Oran (%)
Ara Sınav (Vize)	1	40
Dönem Sonu Sınavı (Final)	1	60

Ders Kitabı / Önerilen Kaynaklar

1	Ekonometri, RecepTarı, Umuttepe Yayınları, 2012.
---	--

Hafta	Haftalara Göre Ders Konuları	
1	Teorik	Zaman serisi analizinde kullanılan temel kavramlar
2	Teorik	Trend, yığılım
3	Teorik	Bazı kullanışlı işlemciler
4	Teorik	Otokorelasyon
5	Teorik	Kısmi otokorelasyon fonksiyonu
6	Teorik	Durağanlık
7	Teorik	DurağanlıkTestleri
8	Ara Sınav (Vize)	Ara Sınav
9	Teorik	Durağan olan ve durağan olmayan seriler
10	Teorik	Gecikme uzunluğunun seçiminde kullanılan kriterler
11	Teorik	Artıkterimlerin otokorelasyon durumlarınınintestedilmesi
12	Teorik	Rassal yürüyüş süreci
13	Teorik	Perron yapısal kırılma testi
14	Teorik	Mevsimsel birim kök testi
15	Teorik	Bulguların Değerlendirilmesi
16	Dönem Sonu Sınavı (Final)	Final Sınavı

Dersin Öğrenme, Öğretme ve Değerlendirme Etkinlikleri Çerçevesinde İş Yüğü Hesabı (Ortalama Saat)

Etkinlik	Adet	Ön Hazırlık	Etkinlik Süresi	Toplam İş Yüğü
Kuramsal Ders	10	3	3	60
Uygulamalı Ders	4	6	3	36
Ara Sınav	1	10	1	11
Dönem Sonu Sınavı	1	15	2	17
Toplam İş Yüğü (Saat)				124
Yuvarla [Toplam İş Yüğü (saat) / 25*] = AKTS Kredisi				5

*25 saatlik iş yüğü 1 AKTS olarak kabul edilmektedir.

Dersin Öğrenme Çıktıları

1	Zaman serisi analizinde kullanılan temel kavramların tanınması
2	Trend ve yığılım kavramlarının anlaşılması
3	Fark alma işleminin öğrenilmesi



4	Otokorelasyon
5	Durağanlık analizlerini kavrama
6	Durağanlık testlerini uygulayabilmek
7	Zaman serisi analiz yapabilmek

Program Çıktıları (Ekonometri Yüksek Lisans Programı)

1	Ekonometrik kavramların öğrenilmesi
2	Ekonometrik model tahmin edebilme
3	Tahmin edilen ekonometrik modelin güvenilirliğini test edebilmek
4	Zaman serisi analizini öğrenme
5	Finansal varlıkların tanınması ve ekonomik birimlerin kararlarını ölçen analizlerin yapılması
6	Finansal verilerin analizleri için özellikle geliştirilmiş ekonometrik yöntemleri kullanabilme
7	Finans ve ekonomi alanlarının gerektirdiği düzeyde bilgisayar programları ile birlikte bilişim ve iletişim teknolojilerini ileri düzeyde kullanmak.
8	Para teorisi, uluslararası ticaret ve finans teorileri üzerine yapılabilecek ekonometrik uygulamalara temel olacak bilgilerin öğretilmesi
9	Bilimsel bir alanda detaylı literatür araştırması yapabilme, topladığı bilgileri sentezleyebilme, analiz edebilme, yorumlayabilme ve bulguları rapor haline getirebilme

Program ve Öğrenme Çıktıları İlişkisi 1:Çok Düşük, 2:Düşük, 3:Orta, 4:Yüksek, 5:Çok Yüksek

	ÖÇ1	ÖÇ2	ÖÇ3	ÖÇ4	ÖÇ5	ÖÇ6	ÖÇ7
PÇ1	1	2	2	2	2	2	2
PÇ2	2	2	5	1	1	3	1
PÇ3	2	1	1	4	3	1	4
PÇ4	1	2	2	1	1	4	2
PÇ5	4	3	3	3	3	1	2
PÇ6	5	5	4	4	4	2	3
PÇ7	5	3	3	3	3	3	5
PÇ8	3	4	3	4	5	2	3
PÇ9	3	4	3	3	4	1	3

