AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ
DERS BİLGİ FORMU

Dersin Adı	Finansal Zaman Serileri								
Ders Kodu	UEK508		Ders Düzeyi	Yüksek Lisans					
AKTS Kredi	5	İş Yükü	126 *(Saat)*	Teori	3	Uygulama	0	Laboratuvar	0
Dersin Amacı									
Özet İçeriği									
Staj Durum	Yok								
Öğretim Yöntemleri	Anlatım (Takrir)								
Dersi Veren Öğretim Elemanı(ları)									

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

Ders Kitabı / Önerilen Kaynaklar	
1	Mustafa Sevüktekin, Ekonometriye Giriş, Dora Yayınları, 2013, Bursa.
2	Sevüktekin, M.ve M. Çınar, Ekonometrik Zaman Serileri Analizi: EViews Uygulamalı, Geliştirilmiş Dördüncü Baskı Bursa: Dora Yayın, 2014.
3	Enders, W., Applied Econometric Time Series, New York: John Wiley &Sons,Inc., 1995.

Hafta	**Haftalara Göre Ders Konuları**	
1	Teorik	Zaman Serisi Kalıpları Genel Tanıtımı
2	Teorik	Zaman Serisi Kalıplarının Grafiksel Analizleri
3	Teorik	Zaman Serisi Analizleri, Modelleri ve Bazı Temel Kavramlar
4	Teorik	Zaman Serilerinin Otokorelasyon Analizleri, Zaman Serilerinde Kısmî otokorelasyon Analizleri
5	Teorik	Zaman Serilerinde Portmanteau Testleri, Zaman Serilerinin Korelogramı ve Durağanlık Testleri
6	Teorik	Zaman Serisi Modelleri ve Fark Denklemi, Gecikme İşlemcisi ve Zaman Serisi Modellerine Uygulanması
7	Teorik	Durağan Olmayan Zaman Serilerinin Fark Alma Sürecine Göre Durağan Hale Getirilmesi
8	Teorik	Ders tekrarı ve Ara Sınav
9	Teorik	Korelogramlar ile Durağanlık Testleri
10	Teorik	Otoregresif (AR) Süreçler için İstatistiksel Modeller, Hareketli Ortalama (MA) Süreçleri için İstatistiksel Modeller, Otoregresif Hareketli Ortalama (ARMA) Süreçleri için İstatistiksel Modeller
11	Teorik	Durağan-dışılık ve Entegrasyon Süreçleri, Otoregresif Entegre Hareketli Ortalama (ARIMA) Süreçleri için İstatistiksel Modeller, Mevsimsel Box-Jenkins ARIMA Modelleri
12	Teorik	Tek değişkenli Süreçler için Birim Kökler
13	Teorik	Koentegrasyon ve Koentegrasyon Testleri
14	Teorik	Hata Düzeltme Modelleri, Mevsimsel Entegrasyon ve Koentegrasyon

Dersin Öğrenme, Öğretme ve Değerlendirme Etkinlikleri Çerçevesinde İş Yükü Hesabı (Ortalama Saat)				
Etkinlik	Adet	Ön Hazırlık	Etkinlik Süresi	Toplam İş Yükü
Kuramsal Ders	14	6	3	126
			Toplam İş Yükü (Saat)	126
			Yuvarla [Toplam İş Yükü (saat) / 25*] = **AKTS Kredisi**	5
**25 saatlik iş yükü 1 AKTS olarak kabul edilmektedir.*				

Dersin Öğrenme Çıktıları	
1	İktisadi teorileri, istatistiksel ve ekonometrik analizleri daha iyi kavrayabilme.
2	İktisadi olayları niteliksel ve niceliksel düzeyde analiz yapabilme.
3	Ekonometri Bölümünü ilgilendiren İktisat, İşletme, Maliye ve Hukuk gibi diğer disiplinlerle ilgili bilgi sahibi olma.

4	Ekonometri alanında toplumsal bilimsel, kültürel ve etik değerlere uygun hareket edebilme, kazandığı bilgi ve becerileri sorumluluk ilkelerine uygun olarak sosyal ve çalışma hayatında uygulayabilme.
5	Disiplinler arası ve disiplin içi çalışmalarda verimli sonuçlara ulaşabilmek için takımla çalışma becerilerine sahip olma.

Program Çıktıları *(Uygulamalı Ekonometri Disiplinlerarası Yüksek Lisans Programı)*	
1	Ekonomik ve toplumsal konular üzerine veri toplayabilecektir.
2	Ham veriyi istatistiksel ve ekonometrik analizlere uygun hale getirebilecektir.
3	Veriyi oluşturan mekanizmaları açıklayan ekonometrik modeller kurabilecektir.
4	Ekonometrik analizler aracılığıyla elde edilmiş olan sonuçları yorumlayabilecektir.
5	Bağımsız bir ampirik araştırmayı başlangıcından sonuna dek yürütebilecektir.

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

	ÖÇ1	ÖÇ2	ÖÇ3	ÖÇ4	ÖÇ5
PÇ1	5	4	3	1	2
PÇ2	4	3	2	2	1
PÇ3	3	2	2	3	2
PÇ4	2	5	3	4	2
PÇ5	3	2	5	3	4