Ders Bilgi Formu

Ders Adı	Kodu	Yerel Kredi	AKTS	Ders (saat/hafta)	Uygulama (saat/hafta)	Laboratuar (saat/hafta)
Zaman Serileri Analizi II	IKT6119	3	7.5	3	0	0

Önkoşullar	Yok

Yarıyıl	Güz, Bahar

Dersin Dili	İngilizce, Türkçe
Dersin Seviyesi	Doktora Seviyesi
Ders Kategorisi	Temel Meslek Dersleri
Dersin Veriliş Şekli	Yüz yüze

Dersi Sunan Akademik Birim	İktisat Bölümü
Dersin Koordinatörü	Hüseyin Taştan
Dersi Veren(ler)	Hüseyin Taştan
Asistan(lar)ı	

Dersin Amacı	Bu dersin amacı modern zaman serileri tekniklerinin iktisadi verilerin özellikleri dikkate alınarak öğretilmesidir. Bu derste çok değişkenli analiz yöntemleri ve modeller incelenecektir
Dersin İçeriği	VAR, ECM, Eşbütünleşme, Granger nedensellik testleri, Spektral analiz, Doğrusal olmayan zaman serileri
Opsiyonel Program Bileşenleri	Yok

Ders Öğrenim Çıktıları

1	Öğrenciler, iktisatta karşılaştığımız çok değişkenli (multivariate) veriler için uygun zaman serisi analiz yöntemlerini teorik olarak öğreneceklerdir.
2	Öğrenciler bu derste öğrendikleri yöntemleri kendi bağımsız çalışmalarında kullanabileceklerdir.
3	Öğrenciler zaman serileri analizinde kullanılan yazılımları kullanma becerisine sahip olurlar.
4	Öğrenciler, iktisatta karşılaştığımız çok değişkenli (multivariate) veriler için uygun zaman serisi analiz yöntemlerini uygulamalı olarak öğreneceklerdir.
5	Öğrenciler doğrusal olmayan zaman serileri analizinde giriş düzeyinde beceriye sahip olurlar.

Haftalık Konular ve İlgili Ön Hazırlık Çalışmaları

Hafta	Konular	Ön Hazırlık
1	Giriş, Zaman serilerinde temel kavramların gözden geçirilmesi	Ders notları.
2	Tahmin yöntemlerinin gözden geçirilmesi	Ders notları.
3	Vektör Otoregresyon (VAR) modelleri I	Ders notları.
4	Vektör Otoregresyon (VAR) modelleri II	Ders notları.
5	Vektör Hareketli Ortalamalar ve VARMA modelleri, Etki-tepki fonksiyonu, Varyans ayrıştırması	Ders notları.
6	Granger-nedensellik testleri, Geweke lineer bağımlılık ölçütü, Bağımlılık ve nedenselliğin spektral analizi	Ders notları.

7	1. arasınav	
8	Midterm 1 / Practice or Review	
9	Kurmaca regresyon, Eşbütünleşme ve Hata düzeltme modelleri, Engle-Granger ve Johansen eşbütünleşme testleri II	Ders notları.
10	Kurmaca regresyon, Eşbütünleşme ve Hata düzeltme modelleri, Engle-Granger ve Johansen eşbütünleşme testleri III	Ders notları.
11	State-Space modelleri, Kalman filtresi	Ders notları.
12	Markov geçişli VAR modelleri, Hamilton filtresi	Ders notları.
13	Doğrusal olmayan çok değişkenli zaman serileri modelleri	Ders notları.
14	Çok değişkenli volatilite modelleri, MGARCH	Ders notları.
15	Genel gözden geçirme ve öğrenci proje sunumları	Ders notları.
16	Final	

Değerlendirme Sistemi

Etkinlikler	Sayı	Katkı Payı
Devam/Katılım		
Laboratuar		
Uygulama		
Arazi Çalışması		
Derse Özgü Staj		
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği		
Ödev	5	20
Sunum/Jüri		
Projeler	1	20
Seminer/Workshop		
Ara Sınavlar	1	20
Final	1	40
Dönem İçi Çalışmaların Başarı Notuna Katkısı		60
Final Sınavının Başarı Notuna Katkısı		40
TOPLAM		100

AKTS İşyükü Tablosu

Etkinlikler	Sayı	Süresi (Saat)	Toplam İşyükü
Ders Saati	13	3	39
Laboratuar			
Uygulama			
Arazi Çalışması			
Sınıf Dışı Ders Çalışması	16	7	112
Derse Özgü Staj			
Ödev	5	10	50

Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği			
Projeler	1	20	20
Sunum / Seminer			
Ara Sınavlar (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	5	5
Final (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	5	5
		Toplam İşyükü	231
		Toplam İşyükü / 30(s)	7.70
		AKTS Kredisi	7.5

Diğer Notlar	Yok