

| <b>DERS BİLGİLERİ FORMU</b>     |  |
|---------------------------------|--|
| Ders Açan Fakülte/ Enstitü      | İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi   |
| Ders Açan Bölüm/ Ana Bilim Dalı | İktisat  |
| Dersin Kodu                     | İKT 451  |
| Dersin Adı                      | Uygulamalı Ekonometri: Zaman Serisi Analizi  |
| Öğretim Dili                    | İngilizce  |
| Ders Alan Programlar            | İktisat  |
| Ders Türü                       | Seçmeli  |
| Dersin Seviyesi                 | 5  |
| AKTS Kredisi                    | 6  |
| Ön Koşullar                     | İKT 352  |
| Dersin İçeriği                  | Makroekonomik verileri tanımlayan Zaman Serisi konularını teorik ve uygulamalı düzeyde yapısal modellemeler dahilinde inceler.   |
| Dersin Amacı                    | Makroekonomi doğası gereği değişkenler arasında çift yönlü (endojen) ilişkilerin bulunduğu bir alanını ifade eder. Ders, öğrencileri makroekonomik veriler ile analiz yapmak, yapısal bir model oluşturup bu modelin parametrelerinin tahminini yapmak ve buradan politika analizleri üretmek alanlarında yetiştirmeyi amaçlamaktadır. |
| Dersin Kazanımları              | Ders hem yükske lisans öğrencilerini, hem de konuya ilgi duyan lisans öğrencilerini zaman serisi konusunda eğitebilmektedir.   |
| Ders Kitabı ve/veya Kaynaklar   | Applied Econometric Time Series (Walter Enders), Ekonometrik Zaman Serileri Analizi: EViews Uygulamalı (Sevüktekin ve Nargeleçkenler)  |
| Değerlendirme Ölçütleri         | Katkı payı   |
| Devam                           | 10%  |
| Laboratuvar                     | 0%   |
| Uygulama                        | 0%   |
| Alan Çalışması                  | 0%   |
| Ödev                            | 10%  |
| Sunum                           | 0%   |
| Projeler                        | 10%  |
| Seminer                         | 0%   |
| Ara Sınavlar                    | 35%  |
| Quiz                            | 0%   |
| Final                           | 35%  |
| Toplam                          | 100%   |
| Ders Planı                      | <b>Tartışılacak/ İşlenecek Konular</b>   |
| 1. Hafta                        | Fark Denklemleri   |
| 2. Hafta                        | Fark Denklemleri   |
| 3. Hafta                        | Durağan Zaman Serisi Modelleri   |
| 4. Hafta                        | Durağan Zaman Serisi Modelleri (ARMA Modellemesi)  |
| 5. Hafta                        | Durağan Olmayan Zaman Serisi Modelleri   |
| 6. Hafta                        | Durağan Olmayan Zaman Serisi Modelleri   |
| 7. Hafta                        | Birden Çok Denklemli Zaman Serisi Modelleri  |
| 8. Hafta                        | Birden Çok Denklemli Zaman Serisi Modelleri (VAR Modellemesi)  |
| 9. Hafta                        | Birden Çok Denklemli Zaman Serisi Modelleri (VAR Modellemesi)  |
| 10. Hafta                       | Birden Çok Denklemli Zaman Serisi Modelleri (VEC ve Kointegrasyon Modellemeleri)   |
| 11. Hafta                       | Yapısal Kırılmalar   |
| 12. Hafta                       | Yapısal Kırılmalar   |