

İŞLETME VE EKONOMİ DOKTORA PROGRAMI
DERS BİLGİ FORMU

Dersin Ayrıntıları				
Dersin Kodu	Akademik Yıl			Yarıyıl
BE032	2021-2022			
Dersin Adı	T	U	L	AKTS
İleri Ekonometri ve Zaman Serileri Analizi	3	1	0	10
Dersin Dili	İngilizce			
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans		Doktora	X
Anabilim Dalı/Programı	İşletme ve Ekonomi Doktora Programı			
Eğitim Türü	Yüz Yüze			
Dersin Türü	Zorunlu		Seçmeli	X
Dersin Amacı	Ders, örnekleme dağılımları, asimptotik teori, tahmin, klasik regresyon modeli, genelleştirilmiş regresyon; doğrusal olmayan regresyon; eşzamanlı denklemler, özdeşleşme, araçsal değişkenler. Uzantılar ve uygulamalar Maximum Likelihood, GMM, VAR, GARCH, panel data analizi. Ders ayrıca, makroekonomik ve / veya mikroekonomik teorilerin deneysel uygulamaları ve testlerindeki ileri konular hakkında kapsamlı bilgi sağlayacaktır. Dersten sonra öğrenciler ekonometrik modelleri standart işletme veya ekonomi ile ilgili problemlere uygulayabileceklerdir. Kursun ikinci bölümü şu konuları kapsayacaktır: Durağan olmayan zaman serilerinin tahmini ve çıkarımı, ARMA Modelleme, Box-Jenkins yöntemi, birim kökleri ve ARIMA Modelleri, Durağan vektör modelleri, Eşbütünleşme, Zaman serileriyle tahmin, Spektral Teori ve Filtreleme, Çok Değişkenli Zaman Serileri, doğrusal olmayan ve Gauss olmayan zaman serileri.			
Dersin İçeriği	Standart varsayımlardan sapmalar: spesifikasyon testleri; zaman serilerine ilk bakış; genelleştirilmiş regresyon; doğrusal olmayan regresyon; eşzamanlı denklemler, özdeşleşme, araçsal değişkenler. Uzantılar ve uygulamalar: ML, GMM, VAR, GARCH, panel verileri.			
Ön Koşulları				
Dersin Koordinatörü				
Dersi Verenler				
Dersin Yardımcıları				
Dersin Staj Durumu				
Ders Kaynakları				
Ders Notu	Economic Theory and Methods (Russel Davidson and James MacKinnon, OUP, 2009)			
Diğer Kaynaklar	Ders Notları			
Materyal Paylaşımı				
Dokümanlar	Ders Notları ve Kitaplar			
Ödevler	Ödevler			
Sınavlar	Vize ve Final			
Dersin Yapısı				

**İŞLETME VE EKONOMİ DOKTORA PROGRAMI
DERS BİLGİ FORMU**

Sosyal Bilimler		%100
Eğitim Bilimleri		%
Fen Bilimleri		%
Sağlık Bilimleri		%
Alan Bilgisi		%

Değerlendirme Sistemi

	Sayısı	Katkı Oranı (%)
Ara Sınav		30
Kısa Sınav		
Ödev		30
Devam		
Uygulama		
Proje		
Yarıyıl Sonu Sınavı		40
	Toplam	100

AKTS İş Yüğü Dağılımı Tablosu

	Sayısı	Süresi	Toplam İş Yüğü (Saat)
Ders Süresi	14	3	42
Sınıf Dışı Ç. Süresi	14	2	28
Ödevler	12	5	60
Sunum/Seminer Hazırlama			
Ara Sınavlar	1	60	60
Uygulama			
Laboratuvar			
Proje			
Yarıyıl Sonu Sınavı	1	90	90
		Toplam İş Yüğü	280
		AKTS Kredisi (Toplam İş Yüğü / 28)	10

Dersin Öğrenim Çıktıları

1	Klasik regresyon modelinin varsayımlarını ihlal etmenin sonuçlarını ayırt etme
2	Farklı varyansın doğasını ve sonuçlarını açıklama
3	Model spesifikasyon hatalarını açıklama
4	Zaman serisi ekonometrisindeki temel kavramları tanımlama
5	Durağanlık için Dickey-Fuller ve artırılmış Dickey-Fuller testleri gerçekleştirme

Ders Konuları

**İŞLETME VE EKONOMİ DOKTORA PROGRAMI
DERS BİLGİ FORMU**

1	Ön Bilgiler ve Genelleştirilmiş En Küçük Kareler (GLS)
2	GLS ve Panel Data
3	GLS ve Panel Data
4	IV
5	IV
6	GMM
7	GMM
8	Linear Olmayan GMM
9	Vize
10	MLE
11	MLE
12	Çok Değişkenli Modeller
13	Zaman Serisi ve Sabit Data
14	Zaman Serisi ve Sabit Data
15	Genel Tekrar

Dersin Program Çıktılarına Katkısı (1-5)

DÖÇ	P1	P2	P3
1	4	3	5
2	4	5	5
3	3	3	4
4	5	4	4
5	3	4	4

Katkı Oranı: 1: Çok Düşük 2: Düşük 3: Orta 4: Yüksek 5: Çok Yüksek

Hazırlayan:

Güncelleme Tarihi: