|  |
| --- |
| Dersin Ayrıntıları |
| Dersin Kodu | **Akademik Yıl** | **Yarıyıl** |
| BE022 | 2021-2022 |  |
| Dersin Adı | **T** | **U** | **L** | **AKTS** |
| 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 |  |
| Dersin Türü | **Zorunlu** |  | **Seçmeli** | **X** |
| Dersin Amacı | Öğrenciler bu derste zaman serileri analizinde kullanılan yöntemler hakkında bilgi edinirler ve bunları uygularlar. |
| Dersin İçeriği | Zaman serileri hakkında genel bilgiler, zaman serilerinin bileşenlerine ayrılması, otoregresif modeller, hareketli ortalama modelleri, otoregresif hareketli ortalama modelleri,koşullu değişen varyans modelleri, dışsal değişkene sahip ARIMA modelleri, Granger nedensellik analizi, vektör otoregresif modeller, koentegrasyon analizi, panel veri analizi |
| Ön Koşulları |  |
| Dersin Koordinatörü |   |
| Dersi Verenler |  |
| Dersin Yardımcıları |  |
| Dersin Staj Durumu |  |
| Ders Kaynakları |
| Ders Notu | Orhunbilge, N., Zaman Serileri Analizi Tahmin ve Fiyat İndeksleri, İstanbul Üniversitesi Yayınları, 1999.Sevüktekin, M., Çınar, M., Ekonometrik Zaman Serileri Analizi EViews Uygulamalı, Dora Yayıncılık, 2014.Akgül, I., Zaman Serilerinin Analizi ve ARIMA modelleri, Der Yayınları, 2011. |
| Diğer Kaynaklar |  |
| Materyal Paylaşımı |
| Dokümanlar |  |
| Ödevler |  |
| Sınavlar |  |
| Dersin Yapısı |
| Sosyal Bilimler |  | %40 |
| Eğitim Bilimleri |  | % |
| Fen Bilimleri |  | % |
| Sağlık Bilimleri |  | % |
| Alan Bilgisi |  | %60 |
| Değerlendirme Sistemi |
|  | **Sayısı** | **Katkı Oranı (%)** |
| Ara Sınav | 1 | %40 |
| Kısa Sınav |  | % |
| Ödev |  | % |
| Devam |  | % |
| Uygulama |  | % |
| Proje |  | % |
| Yarıyıl Sonu Sınavı | 1 | %60 |
| Toplam | **100** |
| AKTS İş Yükü Dağılımı Tablosu |
|  | **Sayısı** | **Süresi** | **Toplam İş Yükü (Saat)** |
| Ders Süresi | 14 | 3 | 42 |
| Sınıf Dışı Ç. Süresi | 14 | 4 | 56 |
| Ödevler |  |  |  |
| Sunum/Seminer Hazırlama | 2 | 30 | 60 |
| Ara Sınavlar | 1 | 44 | 44 |
| Uygulama | 14 | 1 | 14 |
| Laboratuvar |  |  |  |
| Proje |  |  |  |
| Yarıyıl Sonu Sınavı | 1 | 64 | 64 |
| Toplam İş Yükü | **280** |
| AKTS Kredisi (Toplam İş Yükü / 28)  | **10** |
| Dersin Öğrenim Çıktıları |
| 1 | Zaman serileri analizinde kullanılan yöntemler hakkında bilgi sahibi olma |
| 2 | Zaman serilerinde kullanılan yöntemleri uygulayabilme |
| Ders Konuları |
| 1 | Zaman serileri hakkında genel bilgiler |
| 2 | Zaman serilerinin bileşenlerine ayrılması |
| 3 | Düzgünleştirme yöntemleri |
| 4 | Otoregresif modeller |
| 5 | Hareketli ortalama modelleri |
| 6 | Otoregresif hareketli ortalama modelleri |
| 7 | Koşullu değişen varyans modelleri  |
| 8 | Koşullu değişen varyans modelleri  |
| 9 | Ara sınav |
| 10 | Dışsal açıklayıcı değişkene sahip ARIMA modelleri |
| 11 | Granger nedensellik analizi |
| 12 | Vektör otoregresif modeller |
| 13 | Koentegrasyon analizi |
| 14 | Panel veri analizi |
| 15 | Panel veri analizi |
| Dersin Program Çıktılarına Katkısı (1-5) |
| DÖÇ | **P1** | **P2** | **P3** |
| 1 | 5 | 5 | 5 |
| 2 | 5 | 5 | 5 |
| Katkı Oranı: 1: Çok Düşük 2: Düşük 3: Orta 4: Yüksek 5: Çok Yüksek |
|  |
| Hazırlayan: | Dr. Öğr. Üyesi Mehmet Hakan Özdemir |
| Güncelleme Tarihi: | 16.05.2021 |