

GENEL TANIM / GENERAL DESCRIPTION

Ders Adı / Course Name	APPLIED ECONOMETRIC ANALYSIS / APPLIED ECONOMETRIC ANALYSIS	
Ders Kodu / Course Code	İKT626	
Ders Türü / Course Type		
Ders Seviyesi / Course Level	Master's Degree / Master's Degree	
Ders Akts Kredi / ECTS	5.00	
Haftalık Ders Saati (Kuramsal) / Course Hours For Week (Theoretical)	3.00	
Haftalık Uygulama Saati / Course Hours For Week (Objected)	0.00	
Haftalık Laboratuvar Saati / Course Hours For Week (Laboratory)	0.00	
Dersin Verildiği Yıl / Year	1	
Öğretim Sistemi / Teaching System	Formal Education / Formal Education	
Eğitim Dili / Education Language		
Ön Koşulu Olan Ders(ler) / Precondition Courses	Yok	
Amacı / Purpose	Bu ders Uygulamalı Ekonometri dersinin devamıdır ve onunla aynı amaçlara sahiptir.	
İçeriği / Content	Durağan zaman serisi modelleri: ARIMA modelleri, ARMA (p, q) modeli için durağanlık kısıtları, otokorelasyon fonksiyonu, kısmi otokorelasyon fonksiyonu, durağan serinin otokorelasyonlarının örnekleme dağılımı, Box-Jenkins model seçimi, öngörülerin özellikleri, mevsimsellikDeğişkenliğin modellenmesi: ARCH süreçleri, ARCH ve GARCH tahminleri, ARCH-M modeli, GARCH süreçlerinin özellikleri, GARCH modellerinin En Yüksek Olabilirlik Tahmini, diğer şartlı varyans modelleri Trendin modellenmesi: deterministik ve stokastik trend, trendin giderilmesi, birim kökler ve regresyon hata terimleri, Dickey-Fuller testleri, genişletilmiş Dickey-Fuller testleri, yapısal değişim, testin gücü ve deterministik regresörler, trendler ve ayrıştırma, panel birim kök testle	
Önerilen Diğer Hususlar / Recommended Other Considerations	Yok	
Staj Durumu / Internship Status	Yok	
Kitabı / Malzemesi / Önerilen Kaynaklar / Books / Materials / Recommended Reading	1- D.Nedim. 2012; Ekonometri, Temel Kavramlar ve Uygulamalar. Dora Yayınevi, Bursa, 2012 2-Yamak, R. ve Köseoğlu, M. 2006; Uygulamalı İstatistik ve Ekonometri, Aksakal Yayınları, Trabzon 3-Enders, W. 2004; Applied Econometric Time Series, John Wiley and Sons, Second Edition, USA 4-Bozkurt, H. 2007; Zaman Serileri Analizi, Ekin Kitabevi, Bursa	

Öğretim Üyesi (Üyeleri) / Faculty Member (Members)	Yrd.Doç.Dr.Nedim DİKMEN	
--	-------------------------	--

ÖĞRENME ÇIKTILARI / LEARNING OUTCOMES

1	ekonometrik araçların neler olduğunu öğrenecekler	
2	ekonometrik araçları nasıl kullanacaklarını öğrenecekler	
3	ekonometrik araçlar iktisadi olaylara nasıl uygulayacaklarını öğrenecekler	
4	ekonometrik analiz yöntemleri ile iktisadi olayları nasıl çözümleyeceklerini öğrenecekler	
5	iktisadi problemlere ekonometrik araçlar kullanılarak nasıl çözüm bulunacağını öğrenecekler	

HAFTALIK DERS İÇERİĞİ / DETAILED COURSE OUTLINE

Hafta / Week					
1	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Durağan zaman serisi modelleri				
2	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Otokorelasyon ve kısmi otokorelasyon fonksiyonları				
3	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	ARMA (p,q) ve ARIMA (p,i,q) modelleri				
4	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Box-Jenkins model seçimi				
5	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Mevsimsel değişkenliğin modellenmesi				

6	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	ARCH ve GARCH süreçleri				
7	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	IGARCH, TGARCH ve ARCH-M modelleri				
8	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Arasınava				
9	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	GARCH modellerinin en yüksek olasılık tahminleri				
10	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Diğer şartlı varyans modelleri				
11	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Kısa sınav				

12	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Trendin modellenmesi; deterministic ve stokastik trend				
13	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Birim kökler ve regresyon hata terimleri				
14	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	DF ve ADF testleri				
15	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Panel birim-kök testleri				
16	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Dönem sonu sınavı				

DEĞERLENDİRME / EVALUATION

	Sayı / Number	Katkı Yüzdesi / Percentage of Contribution (%)
Ara Sınav / Midterm Examination	1	100
Toplam / Total:	1	100
Başarı Notuna Katkı Yüzdesi / Contribution to Success Grade(%):		40

	Sayı / Number	Katkı Yüzdesi / Percentage of Contribution (%)
Final Sınavı / Final Examination	1	100
Toplam / Total:	1	100
Başarı Notuna Katkı Yüzdesi / Contribution to Success Grade(%):		60

Etkinliklerinin Başarı Notuna Katkı Yüzdesi(%) Toplamı / Total Percentage of Contribution (%) to Success Grade:	100
Değerlendirme Tipi / Evaluation Type:	

İŞ YÜKÜ / WORKLOADS

Etkinlikler / Workloads	Sayı / Number	Süresi (Saat) / Duration (Hours)	Toplam İş Yüğü (Saat) / Total Work Load (Hour)
Ara Sınav / Midterm Examination	1	1.00	1.00
Final Sınavı / Final Examination	1	1.00	1.00
Derse Katılım / Attending Lectures	14	3.00	42.00
Problem Çözümü / Problem Solving	14	1.00	14.00
Alan Çalışması / Field Work	3	5.00	15.00
Makale Yazma / Writing Paper	1	16.00	16.00
Makale Kritik Etme / Criticising Paper	3	10.00	30.00
Ara Sınav İçin Bireysel Çalışma / Individual Study for Mid term Examination	1	14.00	14.00
Final Sınavı İçin Bireysel Çalışma / Individual Study for Final Examination	1	14.00	14.00
Toplam / Total:	39	65.00	147.00
Dersin AKTS Kredisi = Toplam İş Yüğü (Saat) / 30.00 (Saat/AKTS) = 147.00/30.00 = 4.90 ~ / Course ECTS Credit = Total Workload (Hour) / 30.00 (Hour / ECTS) = 147.00 / 30.00 = 4.90 ~			

PROGRAM VE ÖĞRENME ÇIKTISI / PROGRAM LEARNING OUTCOMES

Öğrenme Çıktıları / Learning Outcomes	Program Çıktıları / Program Outcomes													
	1.1.1	1.1.2	1.1.3	2.1.1	2.1.2	2.1.3	3.1.1	3.1.2	3.1.3	3.2.1	3.2.2	3.3.1	3.4.1	3.4.2
1.ekonometrik araçların neler olduğunu öğrenecekler /	4	4	4	5	5	5	4	4	4	4	4	5	5	5
2.ekonometrik araçları nasıl kullanacaklarını öğrenecekler /	4	4	4	5	5	5	4	4	4	4	4	5	5	5
3.ekonometrik araçlar iktisadi olaylara nasıl uygulayacaklarını öğrenecekler /	4	4	4	5	5	5	4	4	4	4	4	5	5	5
4.ekonometrik analiz yöntemleri ile iktisadi olayları nasıl çözümleyeceklerini öğrenecekler /	4	4	4	5	5	5	4	4	4	4	4	5	5	5
5.iktisadi problemlere ekonometrik araçlar kullanılarak nasıl çözüm bulunacağını öğrenecekler /	4	4	4	4	5	5	4	4	4	4	4	5	5	5

Katkı Düzeyi / Contribution Level : 1-Çok Düşük / Very low, 2-Düşük / Low, 3-Orta / Moderate, 4-Yüksek / High, 5-Çok Yüksek / Very high