



F. Ders Tanıtım Formu					
Dersin Adı	Zaman Serisi Analizi				
Öğretim Dili	Türkçe				
Dersin Verildiği Düzey	Ön Lisans ()	Lisans (x)	Yüksek Lisans()	Doktora()	
Eğitim Öğretim Sistemi					
Örgün Öğretim (X)		İkinci Örgün Öğretim (X)		Uzaktan Öğretim()	
Dersin Türü		Dersin Alan Kodu		Ders Kodu	
Zorunlu ()	Seçmeli (x)			0401420	
Kuramsal Saat	Uygulama Saat	Toplam Saat	Yarıyılı	Ulusal Kredi	AKTS Kredi
3	--	3	Bahar	3	
Dersin Amacı	Bu dersin amacı zaman serilerinin temel özelliklerinin anlatılması ve zaman serisi yöntemleri ile ilgili teori ve uygulama bilgilerinin öğrenciye aktarılmasıdır.				
Dersin Özet İçeriği	Otokovaryans Ve Otokorelasyon, Durağan Ve Durağan Olmayan Zaman Serileri, Box-Jenkins Metodolojisi - ARMA Ve ARIMA Modelleri, Model Belirleme, Parametre Tahmini, Uygunluk Testi				
Ön Koşul Dersler	Matematik 1 -2, Ekonometri 1-2, İstatistik 1-2 derslerinin alınmış olması				
Önerilen Seçmeli Dersler					
Dersin Öğrenme Çıktıları	<ol style="list-style-type: none">1. Zaman serisi verilerinin ayırd edici özelliklerini tanımlar.2. Zaman serilerinin davranışlarını açıklayabilecek modeller kurar.3. Öğrencilerin zaman serisi yöntemlerinden faydalanarak iktisadi hipotezleri, makro ekonomik ve finansal değişkenlerin özelliklerini test edebilme yeterliliğine sahip olur.4. Herhangi bir zaman serisini (özellikle iktisadi bir seriyi) modelleyip, istatistik paket programlarını kullanarak öngörüler yapar.5. Zaman serisi modelleme tekniklerini öğrenir.				
Dersin Koordinatörü					
Dersin Öğretim Elemanı	1. Yrd. Doç. Dr. Ünal TÖNGÜR				
Dersin Yardımcı Öğretim Elemanı					
Öğretim Yöntemleri					
(x) Sözel Anlatım	() Örnek Olay	(x) Bilgisayar Destekli			
(x) Tartışma	() Drama	() Laboratuvar			
(x) Problem Çözme	() Buluş Yoluyla	()			
() Deney	() Proje	()			
Ders Kitabı / Önerilen Kaynaklar	<ol style="list-style-type: none">1. Akdi, Yılmaz (2003), Zaman Serileri Analizi, Bıçaklar Kitapevi, Ankara2. Sevüktekin M., Nargeleçekenler, M. Zaman Serisi Analizi3. Walter Enders, Applied Econometric Time Series (İkinci Baskı), Wiley.4. Brockwell and Davis, Introduction to Time Series and Forecasting				
Başarı Notunu Değerlendirme Sistemi					
() Doğrudan Dönüşüm Sistemi	(x) Bağlı Değerlendirme				
Araçlar		Sayı	Oran		
Derse Devam ve Katılım		15			
Kısa Sınav(lar)					
Ara Sınav(lar)		1	%30		



Akdeniz Üniversitesi



Ölçme ve Değerlendirme	Ödev(ler) / Seminer(ler)	10	
	Dönem Ödevi / Proje	1	
	Uygulama (Lab., Atölye, Arazi, PDÖ Raporları)		
	Diğer (.....)		
	Yarıyıl Sınavı	1	%70
	Toplam		% 100



Akdeniz Üniversitesi



Haftalara Göre Ders Konuları

Hafta	Konular	Ön Hazırlık
1	Zaman serileri kalıpları ve özellikleri	Konuyla ilgili okumalar
2	Otokorelasyon (ACF) ve Kısmi otokorelasyon (PACF) fonksiyonları	Konuyla ilgili okumalar
3	Otoregresif Süreçler (AR)	Konuyla ilgili okumalar
4	Otoregresif Süreçlerin (AR) İstatistiksel Özellikleri	Konuyla ilgili okumalar
5	Hareketli Ortalama Süreçleri (MA)	Konuyla ilgili okumalar
6	Hareketli Ortalama Süreçlerinin (MA) İstatistiksel Özellikleri	Konuyla ilgili okumalar
7	Otoregresif Hareketli Ortalama Süreçleri (ARMA)	Konuyla ilgili okumalar
8	Otoregresif Bütünleşik Hareketli Ortalama Süreçleri (ARIMA)	Konuyla ilgili okumalar
9	Box Jenkins Metodolojisi	Konuyla ilgili okumalar
10	Modelin Belirlenmesi	Konuyla ilgili okumalar
11	Parametre Tahmini	Konuyla ilgili okumalar
12	Modelin Uygunluğunun araştırılması Model seçim kriterleri	Konuyla ilgili okumalar
13	Öngörü	Konuyla ilgili okumalar
14	Durağanlık ve Birim Kök Kavramları	Konuyla ilgili okumalar
15	Dickey Fuller Birim Kök Testi	Konuyla ilgili okumalar

Dersin Öğrenme Çıktıları

Program Yeterlilikleri	01	02	03	04	05	06	07	08	09	10	Toplam
PY 01					1						1
PY 02	1	1	1	1	1						5
PY 03											
PY 04											
PY 05											
PY 06	5	5	5	5	5						25
PY 07											
PY 08			1	1							2
PY 09											
PY 10			1	1							2
PY 11			1	1							2
PY 12				1							1
PY 13											
PY 14											
PY 15											
PY 16											
PY 17											
PY 18											

Dersin, Program Yeterliliklerine Katkısı

1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18
1	5				25		2		2	2	1						



Akdeniz Üniversitesi



Dersin Öğrenme, öğretme ve değerlendirme etkinlikleri çerçevesinde iş yükü hesabı (Ortalama Saat)				
Etkinlikler	Sayısı	Ön Hazırlık	Etkinlik Süresi	Toplam İş Yüğü
Kuramsal Ders	14	1	3	56
Uygulamalı Ders				
Ödev(ler) / Seminer(ler)	10	1		10
Dönem Ödevi / Proje	1	20		20
Uygulama (Lab., Atölye, Arazi, PDÖ)				
Diğer bilgi edinme çalışmaları				
Kısa Sınav(lar)				
Ara Sınav(lar)	1	20	1	21
Yarıyıl Sınavı	1	30	1	31
Toplam İş Yüğü (Saat)				148
Yuvarla [Toplam İş Yüğü (saat) / Haftalık İş Yüğü (30)] = Dersin AKTS Kredisi				5