İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
ECK 563	Zaman Serisi Analizi	2	3	0	0	3	8

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Seçmeli
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	Yüksek Lisans öğrencisinde, dinamik sistemler mefhumunu oluşturmak. Dinamik sistemlerin karşılaşılan durumlara göre farklı modellemeleri olduğunu gösteremk
İçerik	Dinamik sistemlerin sosyal bilim problemlerine ve gözlemlerine adapte edilmesi, bunun gerektirdiği şekilde stokastik süreçlerin ve özel olarak autoregressive süreçlerin öğretilmesi ve dinamik özelliklerinin test edilmesi. Bu testlerin, ekonomi teorisi ve finans teorisinin belli başlı varsayımlarının geçerliliğini araştırmakta kullanılması, geçerliliğini yitiren teorem ve hipotezlerin tartışılarak, güncel gelişmelere uygun modelleme yapılabilmesi için öğrencide gerekli alt yapının temin edilmes.
Kaynaklar	J.D. Hamilton Time Series Analysis Hayashi Econometrics, Mishkin Money, Banking and Financial systems Banarjee et al. Co-integration Malkiel non-random walk Aumann agreeing to disagree Ozkaya, Karanfil estimation of unrecorded economy

Teori Konu Başlıkları

Hafta	Konu Başlıkları
1	Dinamik sistemler - Kalman
2	Kalman filter - arz ve talep sınaması
3	Fama - Malkiel EMH
4	Aumann Agreeing to disagree
5	Geonokoplos-Polermarchakis
6	EUT - von Neumann , J. Nash, SEUT - Savage, Gilboa
7	AR(p), MA(q) Hamilton 3. - 4. Chapter
8	ARIMA (p,d,q) Hamilton 17.CHAPTER
9	ADF, PP, KPSS Stokastik süreçler
10	Ozkaya, Karanfil Estimation of unrecorded economy
11	CB volatility analysis and GARCH örneği
12	FOREX, uygulama
13	Gold ounce, Oil prices uygulama
14	Lineer - olmayan stokastik süreç örneği