

GENEL TANIM / GENERAL DESCRIPTION

| | | |
|--|--|--|
| Ders Adı / Course Name | ECONOMETRICS II / ECONOMETRICS II | |
| Ders Kodu / Course Code | 1301003062017 | |
| Ders Türü / Course Type | | |
| Ders Seviyesi / Course Level | First Cycle / First Cycle | |
| Ders Akts Kredi / ECTS | 4.00 | |
| 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 | 3 | |
| Öğretim Sistemi / Teaching System | Face to Face / Face to Face | |
| Eğitim Dili / Education Language | English / English | |
| Ön Koşulu Olan Ders(ler) / Precondition Courses | Yok | none |
| Amacı / Purpose | Bu dersin temel amacı öğrencilere temel ekonometrik yöntemlerin öğretilmesidir. Öğrencilerin temel düzeyde matris cebiri, ileri matematik ve istatistik bilmeleri gerekmektedir. Klasik doğrusal regresyon modelinin varyasyonlarının geçersiz olmasının sonuçları tartışılacaktır. Bu çerçevede ekonometrik problemlerle tanışılacak ve temel düzeyde eşanlı denklem sistemlerine yer verilecektir. | The objective of this course is to introduce basic econometric techniques to the students. The students are required to be familiar with matrix algebra, calculus and statistic at the elementary level. The consequences of the relaxing the assumptions of the classical regression model will be discussed. Tu this aim, diagnostic tests related to econometric problems and simultaneous equation models are introduced . |
| İçeriği / Content | Hata terimlerinin normal olmaması, çoklu doğrusallık, değişen varyans, içsel bağıntı, içsel bağıntının tespit edilmesi, model kurma hataları ve model kurma hatalarının test edilmesi, otoregresif dağıtılmış gecikmeli modeller, kısmi uyumlanma modelleri, eşanlı denklem sistemleri. | Nonnormality of Errors, Multicollinearity, Heteroscedasticity, Autocorrelation, Detection of Autocorrelation, Testing for Model Specification, Specification Error, Autoregressive and Distributive Lag Models Partial Adjustment Models Simultaneous Equation Models. |
| Önerilen Diğer Hususlar / Recommended Other Considerations | Öğrencinin, istatistik I ve İstatistik II derslerini almış ve başarılı olmuş olması beklenmektedir. | It is expected that students are successful in Statistics I and II courses. |
| Staj Durumu / Internship Status | Yok | none |

| | | |
|---|---|---|
| Kitabı / Malzemesi / Önerilen Kaynaklar / Books / Materials / Recommended Reading | Gujarati, D. N. and Porter, D. C. (2009), Basic Econometrics, 5th International Edition, McGraw-Hill. Tari, R. (2010), Ekonometri, 6. Basım, Umut Yayınları. Wooldridge, J. M. (2005), Introductory Econometrics: A Modern Approach, 3th Edition, South-Western College Publishing. Chatterjee, S., and Hadi, A.S., (2006), Regression Analysis by Example, 4th Edition, Wiley-Interscience. Studenmund, A.H. (2005), Using Econometrics: A Practical Guide, 5th Edition, Addison-Wesley Series in Economics. Nlandu Mamingi (2005), Theoretical and Empirical Exercises in Econometrics, University of the West Indies Press. Heij, C., Boer, P., Franses, P. H., Kloek, T., and Van Dijk, H. K (2004), Econometric Methods with Applications in Business and Economics, Oxford University Press. Ramanathan R. (2002), Introductory Econometrics with Applications, 5th Edition, Harcourt College Publishers. Maddala, G. S., (2001), Introduction to Econometrics, 3rd Edition, Wiley. | Gujarati, D. N. and Porter, D. C. (2009), Basic Econometrics, 5th International Edition, McGraw-Hill. Tari, R. (2010), Ekonometri, 6. Basım, Umut Yayınları. Wooldridge, J. M. (2005), Introductory Econometrics: A Modern Approach, 3th Edition, South-Western College Publishing. Chatterjee, S., and Hadi, A.S., (2006), Regression Analysis by Example, 4th Edition, Wiley-Interscience. Studenmund, A.H. (2005), Using Econometrics: A Practical Guide, 5th Edition, Addison-Wesley Series in Economics. Nlandu Mamingi (2005), Theoretical and Empirical Exercises in Econometrics, University of the West Indies Press. Heij, C., Boer, P., Franses, P. H., Kloek, T., and Van Dijk, H. K (2004), Econometric Methods with Applications in Business and Economics, Oxford University Press. Ramanathan R. (2002), Introductory Econometrics with Applications, 5th Edition, Harcourt College Publishers. Maddala, G. S., (2001), Introduction to Econometrics, 3rd Edition, Wiley. |
| Öğretim Üyesi (Üyeleri) / Faculty Member (Members) | Prof. Dr. A. Özlem Önder Prof. Dr. Abdurrahman Nazif Çatık | |

ÖĞRENME ÇIKTILARI / LEARNING OUTCOMES

| | | |
|---|---|---|
| 0 | Ekonometrik problemleri çözebilme, | 1. Being able to solve econometric problems |
| 1 | Ekonometrik tahmin yöntemlerini karşılaştırabilme | 2. Being able to compare the econometric methods of estimation |
| 2 | İktisadi olayları ekonometrik olarak formüle edebilme, | 3. Being able to formulate economic events in an econometric manner |
| 3 | Farklı ekonometrik modelleri (logit/probit, zaman serisi, panel veri analizleri gibi) kullanarak analizler yapabilme, | 4. Being able to carry out an econometric analysis by using the different types the econometric models (logit/probit models, time series models, panel data models) |
| 4 | Farklı ekonometrik paket programları kullanabilme, | 5. Being able to use the different types of econometric software |
| 5 | Ampirik bir proje tasarlayabilme ve sonuçlandırabilme, | 6. Being able to design and complete an empirical research project |

HAFTALIK DERS İÇERİĞİ / DETAILED COURSE OUTLINE

| Hafta / Week | | | | | |
|--------------|-----------------------------------|----------|-----|--|---------------------------|
| | Teorik Dersler / Theoretical | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
| 1 | Hata terimlerinin normal olmaması | | | | |
| | Nonnormality of Errors | | | | |
| 2 | Çoklu doğrusallık | | | | |
| | Multicollinearity | | | | |
| 3 | Çoklu doğrusallık testleri | | | | |
| | Testing of multicollinearity | | | | |
| 4 | Değişen varyans | | | | |
| | Heteroscedasticity | | | | |
| 5 | Değişen varyans testleri | | | | |
| | Heteroscedasticity tests | | | | |

| | Teorik Dersler / Theoretical | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|----|---------------------------------------|----------|-----|--|---------------------------|
| 6 | İçsel bağıntı | | | | |
| | Autocorrelation | | | | |
| | | | | | |
| 7 | Teorik Dersler / Theoretical | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
| | İçsel bağıntı testleri | | | | |
| | Autocorrelation tests | | | | |
| 8 | Teorik Dersler / Theoretical | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
| | Ara Sınav | | | | |
| | Mid-Term Exam | | | | |
| 9 | Teorik Dersler / Theoretical | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
| | Model kurma hataları | | | | |
| | Model Specification Errors | | | | |
| 10 | Teorik Dersler / Theoretical | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
| | Model kurma hatalarının test edilmesi | | | | |
| | Model specification error tests | | | | |
| 11 | Teorik Dersler / Theoretical | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
| | Dinamik ekonometrik modeller | | | | |
| | Dynamic econometric models | | | | |

| | Teorik Dersler / Theoretical | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
|----|---|----------|-----|--|---------------------------|
| 12 | Gecikmesi dağıtılmış ve otoregresif modeller | | | | |
| | Gecikmesi dağıtılmış ve otoregresif modeller | | | | |
| 13 | Teorik Dersler / Theoretical | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
| | Dağıtılmış gecikmeli modellere Koyck ve Almon yaklaşımı | | | | |
| | Koyck and Almon approaches to distributed lag models | | | | |
| 14 | Teorik Dersler / Theoretical | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
| | Eşanlı denklem sistemleri | | | | |
| | Simultaneous-Equation Systems | | | | |
| 15 | Teorik Dersler / Theoretical | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
| | Eşanlı denklem sistemlerinin tahmin edilmesi | | | | |
| | Estimation of simultaneous-Equation Systems | | | | |
| 16 | Teorik Dersler / Theoretical | Uygulama | Lab | Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques | Ön Hazırlık / Preliminary |
| | Final Sınavı | | | | |
| | Final Exam | | | | |

DEĞERLENDİRME / EVALUATION

| Yarıyıl (Yıl) İçi Etkinlikleri / Term (or Year) Learning Activities | 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 |

| Yarıyıl (Yıl) Sonu Etkinlikleri / End Of Term (or Year) Learning Activities | 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 İçin Bireysel Çalışma / Individual Study for Mid term Examination | 1 | 10.00 | 10.00 |
| Bireysel Çalışma / Self Study | 16 | 3.00 | 48.00 |
| Final Sınavı için Bireysel Çalışma / Individual Study for Final Examination | 1 | 25.00 | 25.00 |
| Derse Katılım / Attending Lectures | 16 | 3.00 | 48.00 |
| Final Sınavı / Final Examination | 1 | 1.00 | 1.00 |
| Ara Sınav / Midterm Examination | 1 | 1.00 | 1.00 |
| Toplam / Total: | 36 | 43.00 | 133.00 |

Dersin AKTS Kredisi = Toplam İş Yüğü (Saat) / 30.00 (Saat/AKTS) = 133.00/30.00 = 4.43 ~ / Course ECTS Credit = Total Workload (Hour) / 30.00 (Hour / ECTS) = 133.00 / 30.00 = 4.43 ~

PROGRAM VE ÖĞRENME ÇIKTISI / PROGRAM LEARNING OUTCOMES

| Öğrenme Çıktıları / Learning Outcomes | Program Çıktıları / Program Outcomes | | | | | | | | | | | | |
|--|--------------------------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|--------|--------|
| | 1.1.1 | 1.1.2 | 1.1.3 | 1.1.4 | 1.1.5 | 1.1.6 | 1.1.7 | 1.1.8 | 1.1.9 | 1.1.10 | 1.1.11 | 1.1.12 | 1.1.13 |
| 0.Ekonometrik problemleri çözebilme, / 1.Being able to solve econometric problems | 3 | | 5 | | | | | | | | | | |
| 1.Ekonometrik tahmin yöntemlerini karşılaştırabilme / 2.Being able to compare the econometric methods of estimation | | | 5 | | | | | | | | | | |
| 2.İktisadi olayları ekonometrik olarak formüle edebilme, / 3. Being able to formulate economic events in an econometric manner | | | 5 | | | | | | | | | | |
| 3.Farklı ekonometrik modelleri (logit/probit, zaman serisi, panel veri analizleri gibi) kullanarak analizler yapabilme, / 4.Being able to carry out an econometric analysis by using the different types the econometric models (logit/probit models, time series models, panel data models) | | | 5 | | | | | | | | | | |
| 4.Farklı ekonometrik paket programları kullanabilme, / 5. Being able to use the different types of econometric software | | | 5 | | | | | | | | | | |
| 5.Ampirik bir proje tasarlayabilme ve sonuçlandırabilme, / 6.Being able to design and complete an empirical research project | | | 5 | | | | 4 | | | | | | |

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