AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ
DERS BİLGİ FORMU

Dersin Adı	Finansal Ekonometri								
Ders Kodu	EK302		Ders Düzeyi	Lisans					
AKTS Kredi	5	İş Yükü	125 *(Saat)*	Teori	3	Uygulama	0	Laboratuvar	0
Dersin Amacı	Dersin genel amacı, finansal zaman serilerini analiz etme, modelize etme ve ögörüsü için ekonometrik teknikler ile ilgili ileri bilgi vermektedir. Bunun yanı sıra, bu ders, öğrencilerin uygulamalı olarak finansal problemlerin analizi için finansal ekonometrinin araçlarını ve tekniklerini pratik olarak kullanımını sağlamayı amaçlamaktadır. Bu bağlamda bilgisayar programlarının kullanılması ve finansal verilere uygulama yapılması bu dersin tamamlayıcısıdır. Bu dersin sonunda öğrenci, kümeleme ve diğer karakteristikleri sergileyen finansal zaman seriler için ARCH tipi modellerini kolayca uygulamayı öğrenmiş olacaktır.								
Özet İçeriği	Finansal zaman serileri ve karakteristiklerine genel bakış, rastsal yürüyüş hipotezinin testi; koşullu farklı varyans modelleri; finansal getirilerde koşullu ortalama ve koşullu varyansı modelleme, otoregresif koşullu farklı varyans modelleri ve uzantıları, asimetri kavramı, asimetrik GARCH modelleri, riske maruz değer (VaR), Varlık Fiyatlama Modellerinin tahmini ve testi, Sermaye Varlık Fiyatlama Modeli (CAPM).								
Staj Durum	Yok								
Öğretim Yöntemleri	Anlatım (Takrir), Tartışma, Bireysel Çalışma								
Dersi Veren Öğretim Elemanı(ları)	Doç. Dr. Tuğba AKIN								

Ölçme ve Değerlendirme Araçları		
Araç	Adet	Oran (%)
Ara Sınav (Vize)	1	30
Dönem Sonu Sınavı (Final)	1	50
Uygulama	1	20

Ders Kitabı / Önerilen Kaynaklar	
1	Introductory Econometrics for Finance, Brooks, C. 2nd ed., Cambridge Univ. Press, 2008.
2	Applied Econometric Time Series, Enders, W., John Wiley and Sons,Inc., 2005.
3	The Econometrics of Financial Markets, Campbell, Lo ve MacKinlay, Princeton Univ. Press, 2005.

Hafta	Haftalara Göre Ders Konuları	
1	Teorik	finansal zaman serileri ve karakteristiklerine genel bakış
2	Teorik	rastsal yürüyüş, etkin piyasa hipotezi: teorisi ve test edilmesi
3	Teorik	koşullu farklı varyans modelleri: giriş
4	Teorik	finansal getirilerde koşullu ortalama ve koşullu varyansı modelleme: AR, MA, ARMA (genel bir tekrar) ve ARCH modelleri
5	Teorik	ARCH modelleri-devam
6	Teorik	Uygulama
7	Teorik	Genelleştirilmiş otoregresif koşullu farklı varyans modeli: GARCH modeli
8	Ara Sınav (Vize)	Ara sınav
9	Teorik	GARCH modelleri-devam
10	Uygulama	Uygulama
11	Teorik	asimetri kavramı, asimetrik GARCH modelleri: genel bilgi
12	Teorik	EGARCH, GJR modelleri
13	Teorik	APARCH, TARCH, modelleri
14	Teorik	Uygulama
15	Teorik	riske maruz değer (VaR), Sermaye Varlık Fiyatlama Modeli (CAPM).
16	Dönem Sonu Sınavı (Final)	Final

Dersin Öğrenme, Öğretme ve Değerlendirme Etkinlikleri Çerçevesinde İş Yükü Hesabı (Ortalama Saat)				
Etkinlik	Adet	Ön Hazırlık	Etkinlik Süresi	Toplam İş Yükü
Kuramsal Ders	14	3	3	84

Bireysel Çalışma	3	4	1	15
Ara Sınav	1	12	1	13
Dönem Sonu Sınavı	1	12	1	13
			Toplam İş Yükü (Saat)	125
			Yuvarla [Toplam İş Yükü (saat) / 25*] = **AKTS Kredisi**	5
**25 saatlik iş yükü 1 AKTS olarak kabul edilmektedir.*				

Dersin Öğrenme Çıktıları	
1	Finans alanında uygulanan ekonometrik yöntemleri bilir ve günlük, haftalık...vs. finansal veriler ile ekonometrik analiz yapabilir.
2	Finansal veri kaynaklarından veri elde edebilir ve bu verileri ekonometrik çalışmalarda kullanılabilecek şekilde düzenleyebilir.
3	Yeterli temel ekonometri bilgisine sahiptir.
4	Para ve sermaye piyasası ile ilgili tüm bilgilere sahiptir.
5	Finansal piyasaların iktisadi yapısını bilir.

Program Çıktıları *(Ekonomi ve Finans Programı)*	
1	Finans ve ekonomi konuları ile ilgili temel ilke ve kavramları tanımlayabilme
2	Küresel ekonomi ve uluslararası ekonomi konularını yorumlayabilme
3	Ekonomik ve finansal beklentilere uygun raporlama teknikleri geliştirebilme
4	Mesleki konularda sahip olduğu bilgi birikimini kullanabilme
5	Yaşam boyu öğrenme felsefesini benimseyebilme
6	Makro ve mikro ekonomik gelişmeleri analiz edebilme
7	İstatistiksel bilgileri, ekonomi ve finans alanındaki çalışmalarında uygulayabilme
8	Alanı ile ilgili konularda inisiyatif kullanabilme
9	Mesleki çalışmalarında zamanı etkili bir şekilde kullanabilme

Program ve Öğrenme Çıktıları İlişkisi *1:Çok Düşük, 2:Düşük, 3:Orta, 4:Yüksek, 5:Çok Yüksek*

	ÖÇ1	ÖÇ2	ÖÇ3	ÖÇ4	ÖÇ5
PÇ1	3	3	3	3	3
PÇ2	3	3	3	3	3
PÇ3	4	3	3	3	3
PÇ4	5	3	3	3	3
PÇ5	4	4	3	3	3
PÇ6	4	4	3	3	3
PÇ7	3	4	3	3	3
PÇ8	3	3	3	3	3
PÇ9	3	3	3	3	4