



AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ DERS BİLGİ FORMU

Dersin Adı		Finansal Ekonometri							
Ders Kodu		EK302		Ders Düzeyi		Lisans			
AKTS Kredi	5	İş Yüğü	125 (Saat)	Teori	3	Uygulama	0	Laboratuvar	0
Dersin Amacı		Dersin genel amacı, finansal zaman serilerini analiz etme, modelize etme ve öğürüsü 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 İçeriğı		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 değeri (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 değeri (VaR), Sermaye Varlık Fiyatlama Modeli (CAPM).
16	Dönem Sonu Sınavı (Final)	Final

Dersin Öğrenme, Öğretme ve Değerlendirme Etkinlikleri Çerçevesinde İş Yüğü Hesabı (Ortalama Saat)

Etkinlik	Adet	Ön Hazırlık	Etkinlik Süresi	Toplam İş Yüğü
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 Yüğü (Saat)				125
Yuvarla [Toplam İş Yüğü (saat) / 25*] = AKTS Kredisi				5
*25 saatlik iş yüğü 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 (Ekonometri Programı)

1	Ekonometrik kavramların öğrenilmesi
2	Ekonometrik model tahmin edebilme
3	Tahmin edilen ekonometrik modelin güvenilirliğini test edebilmek
4	Zaman serisi analizini öğrenme
5	Finansal varlıkların tanınması ve ekonomik birimlerin kararlarını ölçen analizlerin yapılması
6	Finansal verilerin analizleri için özellikle geliştirilmiş ekonometrik yöntemleri kullanabilme
7	Finans ve ekonomi alanlarının gerektirdiği düzeyde bilgisayar programları ile birlikte bilişim ve iletişim teknolojilerini ileri düzeyde kullanmak.
8	Para teorisi, uluslararası ticaret ve finans teorileri üzerine yapılabilecek ekonometrik uygulamalara temel olacak bilgilerin öğretilmesi
9	Bilimsel bir alanda detaylı literatür araştırması yapabilme, topladığı bilgileri sentezleyebilme, analiz edebilme, yorumlayabilme ve bulguları rapor haline getirebilme

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

	ÖÇ1	ÖÇ2	ÖÇ3	ÖÇ4	ÖÇ5
PÇ1	4	3	3	3	4
PÇ2	3	3	3	3	2
PÇ3	3	2	3	3	5
PÇ4	3	5	3	4	2
PÇ5	3	2	3	4	2
PÇ6	4	4	3	2	3
PÇ7	4	4	3	2	3
PÇ8	4	4	3	2	3
PÇ9	4	4	3	2	3

