



AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ
SOSYAL BİLİMLER ENSTİTÜSÜ
İKTİSAT ANABİLİM DALI
İKTİSAT PROGRAMI
İKTİSAT YÜKSEK LİSANS PROGRAMI
DERS BİLGİ FORMU

Dersin Adı	Finansal Ekonometri								
Ders Kodu	EKO539		Ders Düzeyi		Yüksek Lisans				
AKTS Kredi	5	İş Yüğü	124 (Saat)	Teori	3	Uygulama	0	Laboratuvar	0
Dersin Amacı	Finans ile ilgili konularda kullanılan ekonometrik yöntem ve teknikleri öğretmek								
Özet İçeriğı	Basit ve Çoklu Doğrusal Regresyon Modelleri, Uzun Hafıza Modelleri, Birim Kök Testleri, Volatilite Tahmin Modelleri, Nedensellik ve Eşbütünleşme Testleri, Logit ve Probit Modeller ve Markov Regime-Switching Modeli								
Staj Durum	Yok								
Öğretim Yöntemleri	Anlatım (Takrir)								
Dersi Veren Öğretim Elemanı(ları)									

Ölçme ve Değerlendirme Araçları

Araç	Adet	Oran (%)
Ara Sınav (Vize)	1	40
Dönem Sonu Sınavı (Final)	1	60

Ders Kitabı / Önerilen Kaynaklar

1	Finansal Ekonometri, Nilgün Çil Yavuz, Der Yayınları
---	--

Hafta	Haftalara Göre Ders Konuları	
1	Teorik	Ekonometriye Giriş
2	Teorik	Otokorelasyon ve Nedenleri
3	Teorik	Otokorelasyon tesleri: DW-d, Durbin-h, Durbin Alternatif Testi
4	Teorik	Otokorelasyon Testleri: LM Testi, Berenblut Webb Testi, Von-Neuman Testi
5	Teorik	Otokoresyonun ortadan kaldırılması: İki aşamalı Durbin Yöntemi, Hildrett-Lui Yöntemi
6	Teorik	Çoklu Doğrusal Bağlantı ve Nedenleri
7	Teorik	Çoklu Doğrusal Bağlantının Belirlenmesi: VIF, Koşullu Endeks
8	Ara Sınav (Vize)	Vize
9	Teorik	Çoklu Doğrusal Bağlantının Ortadan Kaldırılması
10	Teorik	Değişen Varyans ve Nedenleri
11	Teorik	Değişen Varyans Testleri: Goldfeld ve Quant Testi
12	Teorik	Değişen Varyans Testleri: White Testi, Glejser Testi
13	Teorik	ARCH Testi
14	Teorik	Değişen Varyansın Ortadan Kaldırılması
15	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	15	3	3	90
Ara Sınav	1	10	2	12
Dönem Sonu Sınavı	1	20	2	22
Toplam İş Yüğü (Saat)				124
Yuvarla [Toplam İş Yüğü (saat) / 25*] = AKTS Kredisi				5

*25 saatlik iş yüğü 1 AKTS olarak kabul edilmektedir.

Dersin Öğrenme Çıktıları

1	Finansal ekonometrik yöntemleri öğrenir
2	Finansal olgulara ekonometrik modeller uygulayabilir



3	Konular hakkında açıklama yapabilir, kavramları tanımlayabilir
4	Konular hakkında disiplinler arası bağlantı kurabilir
5	Konular hakkında analiz yapabilir ve ekonomiyi yorumlayabilir

Program Çıktıları (İktisat Yüksek Lisans Programı)

1	İktisat yüksek lisans tezli programından mezun olan bir öğrenci ekonominin bir alanında tez yazarak uzmanlaşmış ve o alanda yetkin bir bilgi donanımına sahip olarak yetişmiştir.
2	İktisat yüksek lisans mezunları özellikle kamu ve özel bankalarda, eğitim ve araştırma kurumlarında istihdam edilebilmektedirler.
3	İktisatta yüksek lisans tamamlayanlar makro ve mikroekonomi konularında analiz yeteneğine sahip olurlar.
4	Bu programdan mezun olanlar Türkiye'nin iktisat politikalarını inceleyerek hangi politikaların hangi durumda etkin olduğunu belirlemede başarılı olurlar.
5	Bu programda yüksek lisans derecesine sahip olanlar Türkiye'deki finansal piyasalar ve uluslararası finansal piyasalar konusunda kendilerini yetiştirebilirler.
6	Bu programdan mezun olmakla birlikte iktisadi düşünce sistemlerinin günümüz ekonomi politikalarını nasıl etkilediğinin incelenmesi konusunda başarılı olunur.
7	Bu programda yüksek lisans mezunu olarak öğrenciler Türkiye-Avrupa Birliği ekonomi ilişkileri konusunda bilgi sahibidirler ve bu konuda değerlendirme yapma şansına sahip olurlar
8	Yüksek lisansın tamamlanmasıyla birlikte öğrenciler Türkiye'de bölgeler arası gelişme farklılığını sosyal ve ekonomik açıdan ele alma konusunda başarılı olurlar
9	Ekonomi uzmanı olarak piyasaya giren bu program mezunları ekonomide yeni değişim dinamikleri ve devletin yeni rolünün irdelenmesi konusunda yetkindirler.
10	Bu program mezunları Türkiye'de bilgi ve teknoloji gelişimini artırıcı eylemleri irdeleyerek ekonomiye yansımaları konusunda bilgi sahibi olurlar.
11	İktisat programında yüksek lisans tamamlamış bir öğrenci Türkiye'de meydana gelen finansal krizlerin değerlendirilmesi konusunda bilgi sahibi olurlar.
12	Bu program mezunları Türkiye'nin iktisat tarihini gözleme konusunda bilgi sahibi olurlar.
13	Bu program mezunları Türkiye'nin işgücü yapısı, işsizlik gibi verilere ulaşarak bu verilerle analizler yapılması konusunda uzman olarak yetişecektir.

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

	ÖÇ1	ÖÇ2	ÖÇ3	ÖÇ4	ÖÇ5
PÇ1	4	4	4	4	4
PÇ2	4	4	4	4	4
PÇ3	4	4	4	4	4
PÇ4	4	4	4	4	4
PÇ5	4	4	4	4	4
PÇ6	4	4	4	4	4
PÇ7	4	4	4	4	4
PÇ8	4	4	4	4	4
PÇ9	4	4	4	4	4
PÇ10	4	4	4	4	4
PÇ11	4	4	4	4	4
PÇ12	4	4	4	4	4
PÇ13	4	4	4	4	4

