



AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ 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 testleri: 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 Tezsiz Yüksek Lisans (İÖ) Programı)

1	İktisat tezsiz yüksek lisans mezunları özellikle kamu ve özel bankalarda, eğitim ve araştırma kurumlarında istihdam edilebilmektedirler.
2	Bu programdan mezun olanlar Türkiye'nin iktisat politikalarını inceleyerek hangi politikaların hangi durumda etkin olduğunu belirlemede başarılı olurlar.
3	Bu programdan mezun olanlar Türkiye'deki finansal piyasalar ve uluslararası finansal piyasalar konusunda kendilerini yetiştirebilirler.
4	Bu programdan mezun olmakla birlikte iktisadi düşünce sistemlerinin günümüz ekonomi politikalarını nasıl etkilediğinin incelenmesi konusunda başarılı olunur.
5	Ekonomi uzmanı olarak piyasaya giren bu program mezunları ekonomide yeni değişim dinamikleri ve devletin yeni rolünün irdelenmesi konusunda yetkindirler.

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

