



AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ DERS BİLGİ FORMU

Dersin Adı		Finansal Ekonometri							
Ders Kodu		FEK510		Ders Düzeyi		Yüksek Lisans			
AKTS Kredi	5	İş Yüğü	125 (Saat)	Teori	3	Uygulama	0	Laboratuvar	0
Dersin Amacı		Bu ders öğrenciye finansal ekonometride kullanılan kapsamlı bir dizi tekniğı ve bu tekniklerin pratik uygulamalarını tanıtır. Derse istatistik ve ekonometri üzerine ön bilgi ile başlamak çok faydalı olacaktır, fakat bu bir ön koşul değildir. Her öğrenci, derste öğrendiklerini finansal bir veri setine uygulayacağı bir proje teslim etmekle yükümlüdür. Buna uygun olarak, dersin amaçlarından bir tanesi de öğrenciye bağımsız araştırma projeleri yürütmek için gerekli olan yetenekleri verebilmek ve bilgilerini, ilgilerini çekebilecek ilave konulara fazla zorluk çekmeden uygulayabilmeleri için gerekli olan alt yapıyı vermektir.							
Özet İçeriğı		Ders ağırlıklı olarak Zaman Serisi metotları üzerine kurulacaktır. Ders, istatistik ve ekonometrinin temel metotlarının gözden geçirilmesiyle başlar; regresyon analizi, en küçük kareler yöntemi, ve bu yöntemlerin önemli uzantılarına giriş yapar. Daha sonra, ARMA ve ARIMA modellerinin tahmin ve öngörüler, şartlı değişken varyans modelleri (ARCH/GARCH), vektör otoregresyon modelleri ve birlikte durağanlık (kointegrasyon) konuları dahil olmak üzere çok sayıda zaman serisi metodu tartışılır. Her konu finans alanından bir uygulama eşliğinde, finansal verilerin kendilerine özgü özellikleri ve bu tür verilerle çalışmak için özellikle geliştirilmiş metotlar göz önünde bulundurularak işlenir.							
Staj Durum		Yok							
Öğretim Yöntemleri		Anlatım (Takrir), Gösterip Yaptırma, Proje Tabanlı Öğrenme							
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	Chris Brooks, Introductory Econometrics for Finance (Secon Edition), Cambridge University Press. Supplementary text: Svetlozar T. Rachev, Stefan Mitnik, Frank J. Fabozzi, Sergio M. Focardi, and Teo Jasic
2	Financial Econometrics: From Basics to Advanced Modeling Techniques (John Wiley & Sons, Inc.)

Hafta	Haftalara Göre Ders Konuları	
1	Teorik	Temeller: Olasılık ve İstatistiğın Gözden Geçirilmesi
2	Teorik	Regresyon Analizine Giriş
3	Teorik	Regresyon Analizinde Temel Konular
4	Teorik	Zaman Serisi Ekonometrisinin Temelleri
5	Teorik	ARMA Modellemesi
6	Teorik	ARMA Modellemesi
7	Ara Sınav (Vize)	Ara Sınav
8	Teorik	Durağan Olmama, Birim Kökler ve ARIMA Modelleri
9	Teorik	Zaman Serileriyle Tahminleme
10	Teorik	Otoregresif Kosullu Degisen Varyans: ARCH ve GARCH
11	Teorik	Otoregresif Kosullu Degisen Varyans: ARCH ve GARCH
12	Teorik	Duragan Vektör Modelleri: VAR
13	Uygulama	Durağan Vektör Modelleri
14	Teorik	Esbütünleşme ve Ortak Egilimler
15	Uygulama	Esbütünleşme ve Ortak Egilimler
16	Dönem Sonu Sınavı (Final)	Final Sınavı

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

Etkinlik	Adet	Ön Hazırlık	Etkinlik Süresi	Toplam İş Yüğü
Kuramsal Ders	14	2	3	70



Bireysel Çalışma	7	2	2	28
Ara Sınav	1	10	1	11
Dönem Sonu Sınavı	1	15	1	16
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	Lisans yeterliliklerine dayalı olarak finansal ekonometri alanında bilgilerini uzmanlık düzeyinde geliştirmek ve derinleştirmek.
2	Finansal ekonometri ile ilgili disiplinler arasındaki etkileşimi kavramak.
3	Finansal ekonometri ile ilgili sorunların saptanmasında analitik düşünebilmek, soru ve sorunların bilimsel analizi sonucunda ekonomi ve finans politikaları önerebilmek.
4	Finansal ekonometri alanında edindiği uzmanlık düzeyindeki kuramsal ve uygulamalı bilgileri kullanabilmek.
5	Finansal ekonometri alanındaki bilgileri farklı disiplinlerden gelen bilgilerle bütünleştirerek yeni bilgiler üretmek ve uzmanlık gerektiren sorunları bilimsel araştırma yöntemlerini kullanarak çözümleyebilmek.
6	Finansal ekonometri alanında geliştirilen modelleme, ampirik analiz ve politika seçenekleri oluşturma becerilerini disiplinler arası bağlamlarda kullanabilmek

Program Çıktıları (Ekonometri Yüksek Lisans 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	ÖÇ6
PÇ1	5	5	4	4	5	4
PÇ2	4	3	4	4	4	4
PÇ3	3	4	4	3	4	3
PÇ4	5	3	3	5	3	5
PÇ5	3	4	4	5	5	5
PÇ6	5	5	3	5	5	5
PÇ7	5	5	4	4	4	4
PÇ8	5	3	3	3	3	3
PÇ9	3	4	4	4	4	4

