



**AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ**  
**SOSYAL BİLİMLER ENSTİTÜSÜ**  
**EKONOMETRİ ANABİLİM DALI**  
**EKONOMETRİ PROGRAMI**  
**EKONOMETRİ YÜKSEK LİSANS PROGRAMI**  
**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 öngörülleri, 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 Mittnik, 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 Yükü Hesabı (Ortalama Saat)**

| Etkinlik   | Adet | Ön Hazırlık | Etkinlik Süresi | Toplam İş Yükü |
|--|------|-------------|-----------------|----------------|
| 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 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 | Lisans yeterliliklerine dayalı olarak finansal ekonometri alanında bilgilerini uzmanlık düzeyinde geliştirmek ve derinleştirmek.   |
| 2 | Finansal ekonometri ile ilgili disiplinler arasındaki etkilesimi 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 çözümlenebilmek. |
| 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 edebilme  |
| 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 yapabileme, 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   |

