



AYDIN ADNAN MENDERES ÜNİVERSİTESİ
SOSYAL BİLİMLER ENSTİTÜSÜ
UYGULAMALI EKONOMETRİ (DİSİPLİNLERARASI) ANABİLİM DALI
UYGULAMALI EKONOMETRİ (DİSİPLİNLERARASI) PROGRAMI
UYGULAMALI EKONOMETRİ DİSİPLİNLERARASI YÜKSEK LİSANS PROGRAMI
DERS BİLGİ FORMU

Dersin Adı	Finansal Modelleme I								
Ders Kodu	UEK505			Ders Düzeyi		Yüksek Lisans			
AKTS Kredi	5	İş Yüğü	126 (Saat)	Teori	3	Uygulama	0	Laboratuvar	0
Dersin Amacı	pabilir duruma gelmesi sağlanacaktır. Finansal model kurma yeteneęi oluşturulacaktır. Bu kapsamda Bilimsel Araştırma Tekniklerinin öğrenilmesine yer verilecek ve öğrencinin bilimsel çalışma ya								
Özet İçerięi	pabilir duruma gelmesi sağlanacaktır. Finansal model kurma yeteneęi oluşturulacaktır. Bu kapsamda Bilimsel Araştırma Tekniklerinin öğrenilmesine yer verilecek ve öğrencinin bilimsel çalışma ya								
Staj Durum	Yok								
Öğretim Yöntemleri	Anlatım (Takrir)								
Dersi Veren Öğretim Elemanı(ları)	Prof. Dr. Sezgin DEMİR								

Ölçme ve Deęerlendirme Araçları

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

Ders Kitabı / Önerilen Kaynaklar

1	Mustafa Sevüktekin, Ekonometriye Giriş, Dora Yayınları, 2013, Bursa.
---	--

Hafta	Haftalara Göre Ders Konuları	
1	Teorik	Olasılık ve İstatistik Temellerinin Gözden Geçirilmesi
2	Teorik	Ekonometrik Regresyon Modelleri ve Zaman Serileri Metodolojisinin Finansta Kullanımı: Temel Kavramlar
3	Teorik	Tek Deęişenli Zaman Serilerinin Modellemesi ve Öngörü
4	Teorik	Çok Deęişenli Zaman Serilerinin Modellenmesi: Vektör Otoregresif Modeller (VAR)
5	Teorik	Finansta Uzun Dönem İlişkilerinin Modellenmesi: Eşümleşme ve Hata Düzeltme Modelleri
6	Teorik	Volatilite Model Tahmini: ARCH ve GARCH
7	Teorik	Uzun Hafıza Zaman Serisi Modellemesi I: ARFIMA
8	Teorik	Uzun Hafıza Zaman Serisi Modellemesi II: ARFIMA
9	Teorik	Etkin Piyasa Kavramı ve Piyasa Etkinliğinin Sınanması
10	Teorik	Risk-Getiri Modelleri, Portföy Risk ve Getirisi Hesaplanması
11	Teorik	Portföy Etkinliğinin Testi, Piyasa Mikro Yapısının Modellenmesi
12	Teorik	Sermaye Aktif Fiyatlama Modelleri (CAPM)
13	Teorik	Çok Faktörlü Fiyatlama Modelleri
14	Teorik	Finansal Ekonometri Uygulamaları

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

Etkinlik	Adet	Ön Hazırlık	Etkinlik Süresi	Toplam İş Yüğü
Kuramsal Ders	14	6	3	126
Toplam İş Yüğü (Saat)				126
Yuvarla [Toplam İş Yüğü (saat) / 25*] = AKTS Kredisi				5

*25 saatlik iş yüğü 1 AKTS olarak kabul edilmektedir.

Dersin Öğrenme Çıktıları

1	Finansal verilerin ayırt edici özelliklerini tanımlayabilme.
2	Finansal verilerin analizleri için özellikle geliştirilmiş ekonometrik yöntemleri kullanabilme.
3	Ekonometrik ve istatistiksel analizler ile iktisadi olaylar arasında karşılaştırma yapabilme.
4	İktisadi olaylara ilişkin ekonometrik ve istatistiksel çözümlerden planlama ve program yapabilme.



5	Ulusal finans piyasalarının yapısının tahmin edilen parametreler yardımıyla gerek ekonomik ilişkiler yumağı gerekse etki-tepki analizlerini yapabilme
---	---

Program Çıktıları (Uygulamalı Ekonometri Disiplinlerarası Yüksek Lisans Programı)

1	Ekonomik ve toplumsal konular üzerine veri toplayabilecektir.
2	Ham veriyi istatistiksel ve ekonometrik analizlere uygun hale getirebilecektir.
3	Veriyi oluşturan mekanizmaları açıklayan ekonometrik modeller kurabilecektir.
4	Ekonometrik analizler aracılığıyla elde edilmiş olan sonuçları yorumlayabilecektir.
5	Bağımsız bir ampirik araştırmayı başlangıcından sonuna dek yürütebilecektir.

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

	ÖÇ1	ÖÇ2	ÖÇ3	ÖÇ4	ÖÇ5
PÇ1	2	3	3	3	1
PÇ2	3	2	2	2	2
PÇ3	2	5	1	1	3
PÇ4	1	2	2	3	2
PÇ5	3	3	3	2	5

