



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

Dersin Adı	Finansta Stokastik Süreçler								
Ders Kodu	UEK513		Ders Düzeyi		Yüksek Lisans				
AKTS Kredi	5	İş Yüğü	126 (Saat)	Teori	3	Uygulama	0	Laboratuvar	0
Dersin Amacı									
Özet İçeriğı									
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	Mustafa Sevüktekin, Ekonometriye Giriş, Dora Yayınları, 2013, Bursa.
---	--

Hafta	Haftalara Göre Ders Konuları	
1	Teorik	Giriş
2	Teorik	Finansta temel kavramları
3	Teorik	Stokastik süreçlere giriş
4	Teorik	Kesikli ve sürekli stokastik süreçler
5	Teorik	Martingales
6	Teorik	Martingales
7	Teorik	Tek dönem finans modelleri
8	Teorik	Ara sınav
9	Teorik	Çoklu dönem finans modelleri
10	Teorik	Brownian süreci
11	Teorik	Brownian süreci
12	Teorik	Stokastik kalkülüs
13	Teorik	Stokastik kalkülüs
14	Teorik	Opsiyon fiyat modelleri

Dersin Öğrenme, Öğretme ve Değerlendirme 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	Lisans yeterliliklerine dayalı olarak finans ekonomisi alanında bilgilerini uzmanlık düzeyinde geliştirmek ve derinleştirmek.
2	Finans ekonomisi ile ilgili disiplinler arasındaki etkileşimi kavramak.
3	Finans ekonomisi alanında edindiğı uzmanlık düzeyindeki kuramsal ve uygulamalı bilgileri kullanabilmek.
4	Finans ekonomisi alanındaki bilgileri farklı disiplinlerden gelen bilgilerle bütünleştirerek yeni bilgiler üretmek ve uzmanlık gerektiren sorunları bilimsel araştırma yöntemlerini kullanarak çözümlenebilmek.
5	Finans ekonomisiyle ilgili bilgileri eleştirel bir gözle değerlendirebilmek, öğrenmeyi yönlendirebilmek ve ileri düzey çalışmalarını bağımsız düzeyde yürütebilmek.



Program Çıktıları (Uygulamalı Ekonometri Tezsiz Yüksek Lisans (İÖ) 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	2	2	3	5
PÇ2	1	1	3	3	1
PÇ3	2	5	3	3	2
PÇ4	2	2	3	2	2
PÇ5	3	3	2	3	3

