



## Ders Bilgi Formu

Ders Adı	Kodu	Yerel Kredi	AKTS	Ders (saat/hafta)	Uygulama (saat/hafta)	Laboratuvar (saat/hafta)
Finansal Ekonometriye Giriş	IKT3830	3	5	3	0	0

Önkoşullar	Yok
------------	-----

Yarıyıl	Güz, Bahar
---------	------------

Dersin Dili	İngilizce, Türkçe
-------------	-------------------

Dersin Seviyesi	Lisans Seviyesi
-----------------	-----------------

Ders Kategorisi	Uzmanlık/Alan Dersleri
-----------------	------------------------

Dersin Veriliş Şekli	Yüz yüze
----------------------	----------

Dersi Sunan Akademik Birim	İktisat Bölümü
----------------------------	----------------

Dersin Koordinatörü	Hüseyin Taştan
---------------------	----------------

Dersi Veren(ler)	Hüseyin Taştan, Hasan Ağan Karaduman
------------------	--------------------------------------

Asistan(lar)ı	Alican Yıldırım
---------------	-----------------

Dersin Amacı	Bu dersin amacı finans alanında kullanılan modern ekonometri ve zaman serileri tekniklerinin teorik ve uygulamalı biçimde öğrenciye öğretilmesidir.
--------------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

Dersin İçeriği	Finansal zaman serilerine giriş, temel zaman serileri modelleme teknikleri, ARIMA ve Box-Jenkins, durağanlık ve durağanlık testleri, eşbütünleşme ve hata düzeltme modelleri, Finansal piyasalarda volatilitenin modellenmesi: ARCH ve GARCH modelleri, Doğrusal olmayan zaman serisi analizi.
----------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

Opsiyonel Program Bileşenleri	Yok
-------------------------------	-----

### Ders Öğrenim Çıktıları

1	Bu dersi başarıyla tamamlayan öğrenci finansal zaman serilerinin ekonometrik analiz yöntemlerine ilişkin bilgi ve beceriye sahip olacaktır.
2	Bu derste öğrendiği yöntemleri kendi araştırmalarında kullanabilme becerisini edinecektir.
3	Finansal zaman serileri analizinde kullanılan en az bir bilgisayar yazılımı hakkında işlevsel bilgi sahibi olacaktır.
4	Öğrenciler ekonometrik modellerden hareketle finansal kararlar verebilir.
5	Öğrenciler finanstaki ekonometrik yöntemlere dair literatürü anlamlandıracak duruma gelir.

### Haftalık Konular ve İlgili Ön Hazırlık Çalışmaları

Hafta	Konular	Ön Hazırlık
1	Finansal zaman serilerinin temel özellikleri	Brooks Ch1
2	İstatistik ve matematik kavramlarının gözden geçirilmesi	Brooks Ch2
3	Ekonometrik Tahmin Yöntemlerinin gözden geçirilmesi	Brooks Ch3, Ch4
4	Ekonometrik Tahmin Yöntemlerinin gözden geçirilmesi_devam	Brooks Ch5
5	Box-Jenkins yaklaşımı ve Öngörü	Brooks Ch6
6	Durağanlık ve Birim Kök Testleri	Brooks Ch8
7	Volatilité modelleri: ARCH – GARCH modelleri	Brooks Ch9

8	Ara Sınav 1	
9	Volatilite modelleri devam- diğer ARCH modelleri, EGARCH, TARCH, PARCH.	Brooks Ch9
10	Eşbütünleşme Kavramı ve Hata Düzeltme Modelleri	Brooks Ch8
11	Uygulama Çalışması	Brooks Ch 5-6-8-9
12	Vektör Otoregresif Model	Brooks Ch7
13	Çok değişkenli volatilité modelleri MGARCH	Brooks Ch9
14	Doğrusal-Olmayan Finansal Zaman Serisi Modelleri	Brooks Ch10
15	Final	

## Değerlendirme Sistemi

Etkinlikler	Sayı	Katkı Payı
Devam/Katılım		
Laboratuvar		
Uygulama		
Arazi Çalışması		
Derse Özgü Staj		
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği		
Ödev	5	20
Sunum/Jüri		
Projeler		
Seminer/Workshop		
Ara Sınavlar	1	40
Final	1	40
<b>Dönem İçi Çalışmaların Başarı Notuna Katkısı</b>		60
<b>Final Sınavının Başarı Notuna Katkısı</b>		40
<b>TOPLAM</b>		100

## AKTS İşyükü Tablosu

Etkinlikler	Sayı	Süresi (Saat)	Toplam İşyükü
Ders Saati	13	3	39
Laboratuvar			
Uygulama			
Arazi Çalışması			
Sınıf Dışı Ders Çalışması	14	4	56
Derse Özgü Staj			
Ödev	5	4	20
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği			
Projeler			
Sunum / Seminer			

Ara Sınavlar (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	10	10
Final (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	10	10
<b>Toplam İşyükü</b>			135
<b>Toplam İşyükü / 30(s)</b>			4.50
<b>AKTS Kredisi</b>			5
Diğer Notlar	Yok		