



Ders Bilgi Formu

Ders Adı	Kodu	Yerel Kredi	AKTS	Ders (saat/hafta)	Uygulama (saat/hafta)	Laboratuvar (saat/hafta)
Finansta Ekonometrik Yöntemler	IKT5207	3	7.5	3	0	0

Önkoşullar	Yok
------------	-----

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

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

Dersin Seviyesi	Yüksek 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	
---------------	--

Dersin Amacı	Bu dersin amacı finans alanında kullanılan modern ekonometrik yöntemleri orta/ileri düzeyde öğretilmesidir.
--------------	---

Dersin İçeriği	Finansal Zaman Serileri ve Getiri, Doğrusal ve Doğrusal Olmayan Zaman Serisi Modelleri, Koşullu Değişen Varyans Modelleri, Çok Değişkenli Finansal Zaman Serisi Analizi, Riske Maruz Değer, Temel Bileşen Analizi ve Faktör Modelleri, Sürekli-zaman Modelleri, State Space Modelleri ve Kalman Filtresi, Markov Zinciri Mone Carlo Metodu.
----------------	---

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

Ders Öğrenim Çıktıları

1	Öğrenciler finans uygulamalarında sıklıkla kullanılan tahmin ve test yöntemleri hakkında işlevsel bilgi sahibi olacaktır.
2	Öğrenciler ekonometrik modelleme, tahmin ve çıkarsama yöntemlerini kullanarak finans alanında uygulamalı bağımsız araştırma yürütebilme bilgi ve becerisi kazanacaktır.
3	Öğrenciler birden fazla ekonometri programını amaçlarına uygun olarak kullanabilecektir.
4	Öğrenciler finansal karar alma süreçlerinde ekonometrik yöntemleri kullanabilecektir.
5	Öğrenciler finansal ekonometrik yöntemlere dair güncel literatüre hakim olacaktır.

Haftalık Konular ve İlgili Ön Hazırlık Çalışmaları

Hafta	Konular	Ön Hazırlık
1	Finansal Zaman Serileri ve Getiri	FY Ch1, BU Ch1, Tsay Ch1
2	Doğrusal Zaman Serisi Modelleri	FY Ch2, BU Ch2, Tsay Ch2
3	Koşullu Heteroskedastik Modeller	FY Ch 3, BU Ch3, Tsay Ch3
4	Doğrusal Olmayan Modeller	Tsay Ch4
5	Yüksek Frekanslı Veri Analizi	Tsay Ch5
6	Sürekli Zaman Modelleri	FY Ch9, Tsay Ch6

7	Ekstrem Değerler ve VaR	BU Ch5-6, Tsay Ch7
8	Midterm 1	
9	Çok Değişkenli Zaman Serisi Modelleri	FY Ch 4, Tsay Ch8
10	Temel Bileşen Analizi ve Faktör Modelleri	FY Ch 6, Tsay Ch9
11	Çokdeğişkenli Oynaklık Modelleri	BU Ch4, Tsay Ch10
12	State Space Modelleri	Tsay Ch11
13	Kalman Filtresi	Tsay Ch11
14	Markov Zinciri Monte Carlo Metodu	Tsay Ch12
15	Final	

Değerlendirme Sistemi

Etkinlikler	Sayı	Katkı Payı
Devam/Katılım		
Laboratuar		
Uygulama		
Arazi Çalışması		
Derse Özgü Staj		
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği		
Ödev	8	30
Sunum/Jüri		
Projeler		
Seminer/Workshop		
Ara Sınavlar	1	30
Final	1	40
Dönem İçi Çalışmaların Başarı Notuna Katkısı		60
Final Sınavının Başarı Notuna Katkısı		40
TOPLAM		100

AKTS İşyükü Tablosu

Etkinlikler	Sayı	Süresi (Saat)	Toplam İşyükü
Ders Saati	13	3	39
Laboratuar			
Uygulama			
Arazi Çalışması			
Sınıf Dışı Ders Çalışması	14	6	84
Derse Özgü Staj			
Ödev	8	9	72
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği			
Projeler			
Sunum / Seminer			

Ara Sınavlar (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	15	15
Final (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	15	15
Toplam İşyükü			225
Toplam İşyükü / 30(s)			7.50
AKTS Kredisi			7.5

Diğer Notlar	Yok
--------------	-----