



Ders Bilgi Formu

Ders Adı	Kodu	Yerel Kredi	AKTS	Ders (saat/hafta)	Uygulama (saat/hafta)	Laboratuvar (saat/hafta)
Finansal Ekonometri	IKT5303	3	7.5	3	0	0

Önkoşullar	Yok
------------	-----

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

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

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

Ders Kategorisi	Temel Meslek Dersleri
-----------------	-----------------------

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

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

Dersin Koordinatörü	Hasan Ağan Karaduman
---------------------	----------------------

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

Asistan(lar)ı	
---------------	--

Dersin Amacı	Bu dersin temel amacı makroekonomi ve finans alanlarında kullanılan modern ekonometri ve zaman serileri tekniklerinin teori ve laboratuvar uygulamaları ile öğrenciye öğretilmesidir.
--------------	---

Dersin İçeriği	Klasik normal doğrusal regresyon modeli, Zaman serileri analizi; temel zaman serileri modelleme teknikleri, ARIMA modellemesi, durağanlık ve durağanlık testleri, eşbütünleşim ve hata düzeltme modelleri, vektör otoregresyon modelleri, Finansal piyasalarda volatilitenin modellemesi, ARCH ve GARCH modelleri, Stokastik volatilité, VaR.
----------------	---

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

Ders Öğrenim Çıktıları

1	Bu dersi başarıyla tamamlayan öğrenci, finansal zaman serilerinin ekonometrik analiz yöntemlerine ilişkin bilgi ve beceriye sahip olabilecektir,
2	Öğrenciler bu derste öğrendiği yöntemleri kendi araştırmalarında kullanabilme becerisini edinebilecektir.
3	Öğrenci, finansal zaman serileri analizinde kullanılan bilgisayar yazılımları hakkında işlevsel bilgi sahibi olabilecektir.
4	Öğrenciler finansal ve iktisadi veri kaynaklarına nasıl ulaşacaklarını ve onları nasıl kullanacaklarını öğreneceklerdir.
5	Öğrenciler finansal ekonometri üzerine olan literatüre bir bütün olarak anlam verebileceklerdir.

Haftalık Konular ve İlgili Ön Hazırlık Çalışmaları

Hafta	Konular	Ön Hazırlık
1	Giriş, finansal zaman serilerinin temel özellikleri, istatistik ve matematik kavramlarının gözden geçirilmesi	Ders notları
2	Basit regresyon analizi	Ders notları
3	Çoklu regresyon analizi, tahmin ve çıkarsama, Gauss-Markov teoremi, Varsayımlar	Ders notları

4	Değişen varyans ve otokorelasyon, Ekonometri paket programları	Ders notları
5	Tek değişkenli zaman serisi modelleri, Box-Jenkins yaklaşımı	Ders notları
6	Öngörü	Ders notları
7	Durağanlık ve birim kök testleri	Ders notları
8	1. arasınav	
9	Kurmaca regresyon, Koentegrasyon, VAR modelleri, ECM, Granger nedenselliği	Ders notları
10	Volatilite modelleri I: ARCH – GARCH modelleri	Ders notları
11	Volatilite modelleri II: diğer ARCH modelleri, EGARCH, TARCH, PARCH, etc.	Ders notları
12	Çok değişkenli volatilite modelleri MGARCH	Ders notları
13	2. arasınav ve uygulama çalışmaları	
14	Doğrusal olmayan finansal zaman serileri	Ders notları
15	Value-at-Risk (VaR) modellemesi, RiskMetrics	Ders notları

Değerlendirme Sistemi

Etkinlikler	Sayı	Katkı Payı
Devam/Katılım		
Laboratuvar		
Uygulama		
Arazi Çalışması		
Derse Özgü Staj		
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği		
Ödev	6	20
Sunum/Jüri		
Projeler		
Seminer/Workshop		
Ara Sınavlar	2	40
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
Laboratuvar			
Uygulama			
Arazi Çalışması			
Sınıf Dışı Ders Çalışması	14	6	84

Derse Özgü Staj			
Ödev	6	12	72
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği			
Projeler			
Sunum / Seminer			
Ara Sınavlar (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	2	10	20
Final (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	15	15
Toplam İşyükü			230
Toplam İşyükü / 30(s)			7.67
AKTS Kredisi			7.5

Diğer Notlar	Yok
--------------	-----