Ders Bilgi Formu

Ders Adı	Kodu	Yerel Kredi	AKTS	Ders (saat/hafta)	Uygulama (saat/hafta)	Laboratuar (saat/hafta)
Finansta İstatistik Yöntemler	IST6104	3	7.5	3	0	0

Önkoşullar	Yok

Yarıyıl	Güz, Bahar

Dersin Dili	Türkçe
Dersin Seviyesi	Doktora Seviyesi
Ders Kategorisi	Temel Meslek Dersleri
Dersin Veriliş Şekli	Yüz yüze

Dersi Sunan Akademik Birim	İstatistik Bölümü
Dersin Koordinatörü	Coşkun Parim
Dersi Veren(ler)	Coşkun Parim
Asistan(lar)ı	

Dersin Amacı	Porföy üzerine yatırım yapmak risk ve getiriyi dengelemeyi gerekli kılar. Varlıkların doğru yatırımlara yönlendirilmesi istatistiksel metod ve verilerle daha uygun bir şekilde yapılacağını öğrencilere göstermek
Dersin İçeriği	Finansal zaman serileri Riske maruz değer Oynaklığın tahmini ve modellenmesi Temel bileşenler analizi ve çok değişkenli analiz
Opsiyonel Program Bileşenleri	Yok

Ders Öğrenim Çıktıları

1	Portföy yönetiminde istatistik metotlarını kullanır,
2	Finans verileri ile çalışmaya yatkın olur,
3	Varlık değerleme modelleri için regresyon analizi ve uygulamalarını yapabilir,
4	Çokfaktörlü fiyatlama modelleri için regresyon uygulamalarını bilir,
5	Yatırımların getirilerinde iyileştirilme sağlar.

Haftalık Konular ve İlgili Ön Hazırlık Çalışmaları

Hafta	Konular	Ön Hazırlık
1	İstatistik Tekniklerin gözden geçirilmesi	Ders Notları
2	Varlık Fiyatlama	Ders Notları
3	Faiz oranı yapısı	Kitap 1 Başilık 3
4	Hisse senedi fiyat oynaklığı	Kitap 1 Başilık 6
5	Oynaklık ve GARCH modeli	Kitap 1 Başilık 8
6	Çeşitli GARCH modelleri	Kitap 1 Başilık 8
7	Doğrusal Olmayan Zaman Serileri, Karmaşık teorisi ve finans	Ders Notları
8	Midterm 1 / Practice or Review	
9	Riske Maruz Değer	Kitap 4 Başlık 5

10	Finans verileri ve Sayılabilir veri modelleri	Ders notları
11	Kararlı dağılımlarla finans uygulamaları	Kitap 2 Başlık 2
12	Finans modellerinde bootstrapa dayalı testler	Kitap 5
13	Temel Bileşenler Analizi	Kitap 4 Başlık 8
14	Yapay sinir ağlarının finans uygulamaları	Kitap 5
15	Portföy etkinliğinin testi için istatistiksel metodlar	Kitap 4 Başlık 6
16	Final	

Değerlendirme Sistemi

Etkinlikler	Sayı	Katkı Payı
Devam/Katılım		
Laboratuar		
Uygulama		
Arazi Çalışması		
Derse Özgü Staj		
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği		
Ödev		
Sunum/Jüri		
Projeler	1	30
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	13	8	104
Derse Özgü Staj			
Ödev			
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği			
Projeler	1	20	20
Sunum / Seminer			
Ara Sınavlar (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	30	30
Final (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	30	30

Toplam İşyükü	223
Toplam İşyükü / 30(s)	7.43
AKTS Kredisi	7.5

Diğer Notlar	Yok