Ders Bilgi Formu

Ders Adı	Kodu	Yerel Kredi	AKTS	Ders (saat/hafta)	Uygulama (saat/hafta)	Laboratuar (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 modellemesi: 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	Volatilite modelleri: ARCH – GARCH modelleri	Brooks Ch9

8	Midterm 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 volatilite modelleri MGARCH	Brooks Ch9
14	Doğrusal-Olmayan Finansal Zaman Serisi Modelleri	Brooks Ch10
15	Final	

Değerlendirme Sistemi

Etkinlikler	Sayı	Katkı Payı
Devam/Katılım		
Laboratuar		
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
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	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
		Toplam İşyükü	135
		Toplam İşyükü / 30(s)	4.50
		AKTS Kredisi	5

Diğer Notlar	Yok