



Ders Bilgi Formu

Ders Adı	Kodu	Yerel Kredi	AKTS	Ders (saat/hafta)	Uygulama (saat/hafta)	Laboratuvar (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	Ali Hakan Büyüklü
---------------------	-------------------

Dersi Veren(ler)	Ali Hakan Büyüklü
------------------	-------------------

Asistan(lar)ı	
---------------	--

Dersin Amacı	Portföy 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 metodlarını kullanır,
2	Finans verileri ile çalışmaya yatkın olur,
3	Varlık değerlendirme 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 Başlık 3
4	Hisse senedi fiyat oynaklığı	Kitap 1 Başlık 6
5	Oynaklık ve GARCH modeli	Kitap 1 Başlık 8
6	Çeşitli GARCH modelleri	Kitap 1 Başlık 8
7	Doğrusal Olmayan Zaman Serileri, Karmaşık teorisi ve finans	Ders Notları
8	Ara Sınav 1	
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	Final	Kitap 4 Başlık 6

Değerlendirme Sistemi

Etkinlikler	Sayı	Katkı Payı
Devam/Katılım		
Laboratuvar		
Uygulama		
Arazi Çalışması		
Derse Özgü Staj		
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği		
Ödev		
Sunum/Jüri		
Projeler	1	20
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
Laboratuvar			
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
--------------	-----