



Ders Bilgi Formu

Ders Adı	Kodu	Yerel Kredi	AKTS	Ders (saat/hafta)	Uygulama (saat/hafta)	Laboratuvar (saat/hafta)
Uygulamalı Finansal Ekonometri	ISL6143	3	7.5	3	0	0

Önkoşullar	Yok
------------	-----

Yarıyıl	Bahar
---------	-------

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

Dersi Sunan Akademik Birim	İşletme Bölümü
Dersin Koordinatörü	Atanmamış
Dersi Veren(ler)	Güler Aras
Asistan(lar)ı	Özlem Kutlu Furtuna

Dersin Amacı	Bu dersin amacı, finans alanındaki ampirik konuların ve tekniklerin çalışılarak, modern ekonometrik tekniklerin finans teorisi çerçevesinde aktarılmasıdır.
Dersin İçeriği	Finansal Veri ve Ekonometriye İlişkin Temel Kavramlar, Klasik Doğrusal Regresyon Modelleri, Birim Kök Testleri, Riske Maruz Değer, Tek Değişkenli Zaman Serisi Modellemeleri ve Tahminleri, Çok Değişkenli Modeller, Volatilité ve Korelasyon Modelleri – GARCH Modeli, ARCH Modeli, Simülasyon Yöntemleri, Yapay Sinir Ağları
Opsiyonel Program Bileşenleri	Yok

Ders Öğrenim Çıktıları

1	Öğrenciler -Finansal ekonometri alanında temel kavram ve konuları açıklayabilecektir.
2	- Temel kavramları karar verme sürecinde uygulayabilecektir.
3	Metodolojik yöntemlerin kullanılması
4	Güncel finans konularının tartışılması

Haftalık Konular ve İlgili Ön Hazırlık Çalışmaları

Hafta	Konular	Ön Hazırlık
1	Finansal Ekonometriye Giriş	Wang2009; ss.1-15
2	Finansal Veri ve Ekonometriye İlişkin Temel Kavramlar	Wang2009; ss.15-30
3	Klasik Doğrusal Regresyon Modelleri	Wang2009; ss.15-30
4	Birim Kök Testleri	Wang2009; ss.45-58
5	Riske Maruz Değer	Wang2009; ss.131-151
6	Tek Değişkenli Zaman Serisi Modellemeleri	Wang2009; ss.168-180
7	Tek Değişkenli Zaman Serisi Tahminleri	Wang2009; ss.180-198
8	Ara Sınav 1	
9	Çok Değişkenli Modeller	Wang2009; ss.226-235

10	Volatilite ve Korelasyon Modelleri – GARCH Modeli	Wang2009; ss.66-78
11	Volatilite ve Korelasyon Modelleri – ARCH Modeli	Wang2009; ss.68-89
12	Simülasyon Yöntemleri	Wang2009; ss.113-131
13	Panel Data Analizi	Wang2009; ss.250-278
14	Örnek Finansal Olay Çalışmaları	İlgili kitap ve makaleler
15	Final	İlgili kitap ve makaleler

Değerlendirme Sistemi

Etkinlikler	Sayı	Katkı Payı
Devam/Katılım		
Laboratuvar		
Uygulama		
Arazi Çalışması		
Derse Özgü Staj		
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği		
Ödev	1	15
Sunum/Jüri	3	15
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	14	3	42
Laboratuvar			
Uygulama			
Arazi Çalışması			
Sınıf Dışı Ders Çalışması	14	6	84
Derse Özgü Staj			
Ödev	2	25	50
Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği			
Projeler	1	20	20
Sunum / Seminer	0	0	0
Ara Sınavlar (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)	1	14	14
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
--------------	-----