

FİNANSAL EKONOMETRİ

1	Ders Adı:	FİNANSAL EKONOMETRİ
2	Ders Kodu:	EKO4117
3	Ders Türü:	Seçmeli
4	Ders Seviyesi	Lisans
5	Dersin Verildiği Yıl:	4
6	Dersin Verildiği Yarıyıl	7
7	Dersin AKTS Kredisi:	5.00
8	Teorik Ders Saati (saat/Hafta)	3.00
9	Uygulama Ders Saati(saat/Hafta)	0.00
10	Laboratuvar Ders Saati (saat/hafta) :	0
11	Dersin Önkoşulu:	
12	Dersin Dili:	Türkçe
13	Dersin Veriliş Şekli:	Yüz yüze
14	Dersin Koordinatörü:	Prof. Dr. Kadir Yasin Eryiğit
15	Dersi Veren Diğer Öğretim Elemanları:	
16	Koordinatör İletişim Bilgileri:	mcinar@uludag.edu.tr Uludağ Üniversitesi İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi Görükle Kampüsü 16059 Nilüfer / Bursa
17	Dersin WEB adresi:	
18	Dersin Amacı:	Bu ders öğrenciye finansal ekonometride kullanılan ileri düzeyde birçok yöntemi tanıtmaktadır. Derse istatistik ve ekonometri üzerine ön bilgi ile başlamak çok faydalı olacaktır, fakat bu bir önkoşul değildir. Finansal ilişkileri matematiksel modellerle ifade ederek ekonometrik modeller oluşturmak. Bu ekonometrik modeller sayesinde özellikle finans piyasalarına ait ilişkileri parametrik olarak yorumlayabilmek ve böylece finans piyasalarındaki sayısal gelişmeler hakkında bilgi sahibi olabilmek
19	Dersin Mesleki Gelişime Katkısı:	
20	Dersin Öğrenme Kazanımları:	
	1	Finansal verilerin ayırt edici özelliklerini tanımlayabilme
	2	Finansal verilerin analizleri için özellikle geliştirilmiş ileri ekonometrik yöntemleri kullanabilme
	3	Ekonometrik ve istatistiksel analizler aracılığıyla finansal olaylar arasında karşılaştırma yapabilme
	4	Finansal olaylara ilişkin ekonometrik ve istatistiksel çözümlemelerden planlama ve program yapabilme
	5	Ekonometrik modellerin finans piyasalarında öngörü ve gelecek tahmininde kullanımını öğrenebilme
	6	Dünya ve Türkiye’de finansal olayların özellikle zaman periyodu içerisinde gelişim sürecini daha kolay takip edebilme
	7	Ulusal finans piyasalarının yapısının tahmin edilen parametreler yardımıyla gerek ekonomik ilişkiler yumağı gerekse etki-tepki analizlerini yapabilme
	8	Finansal piyasalardaki oynaklığın yapısını ekonometrik ve istatistiksel analizlerle yorumlayabilme
	9	

		10	
21	Dersin İçeriği:		
Hafta	DERS İÇERİKLERİ		
	Teorik	Uygulama	
1	Olasılık ve İstatistik Temellerinin Gözden Geçirilmesi		
2	Ekonometrik Regresyon Modelleri ve Zaman Serileri Metodolojisinin Finanstaki Kullanımı: Temel Kavramlar		
3	Tek Değişkenli Zaman Serilerinin Modellemesi ve Öngörü		
4	Çok Değişkenli Zaman Serilerinin Modellenmesi: Vektör Otoregresif Modeller (VAR)		
5	Finanstaki Uzun Dönem İlişkilerinin Modellenmesi: Eştleşme ve Hata Düzeltme Modelleri		
6	Volatilite Model Tahmini: ARCH ve GARCH		
7	Uzun Hafıza Zaman Serisi Modellemesi I: ARFIMA		
8	Uzun Hafıza Zaman Serisi Modellemesi II: ARFIMA		
9	Etkin Piyasa Kavramı ve Piyasa Etkinliğinin Sınanması		
10	Risk-Getiri Modelleri, Portföy Risk ve Getirisi Hesaplanması		
11	Portföy Etkinliğinin Testi, Piyasa Mikro Yapısının Modellenmesi		
12	Sermaye Aktif Fiyatlandırma Modelleri (CAPM)		
13	Çok Faktörlü Fiyatlandırma Modelleri		
14	Finansal Ekonometri Uygulamaları		
22	Ders Kitabı, Referanslar ve/veya Diğer Kaynaklar:	1. Sevüktekin, M.ve M. Çınar, Ekonometrik Zaman Serileri Analizi: EViews Uygulamalı, Geliştirilmiş Dördüncü Baskı Bursa: Dora Yayın, 2014. 2. Gourieroux, C., and J. Jasiak, 2001. Financial Econometrics. Princeton University Press. 3. Campbell, Lo and MacKinlay,(1997), "The Econometrics of Financial Markets", Princeton University Press. 4. Tsay R. S. (2002), Analysis of Financial Time Series, New York: John Wiley. 5. Mills T. C. (1999), The Econometric Modeling of Financial Time Series, Cambridge: Cambridge University Press	
23	Değerlendirme		
YARIYIL İÇİ ÇALIŞMALAR		SAYISI	KATKI YÜZDESİ
Ara Sınav		1	40.00
Kısa Sınav		0	0.00
Ödev		0	0.00
Yıl Sonu Sınavı		1	60.00
Toplam		2	100.00
Yıl içi çalışmalarının Başarıya Oranı		40.00	
Finalin Başarıya Oranı		60.00	

Toplam		100.00		
Kullanılan Ölçme ve Değerlendirme Yaklaşımları				
24	AKTS / İŞ YÜKÜ TABLOSU			
ETKİNLİK		SAYISI	Süresi (Saat)	Toplam İş Yüğü (Saat)
Teorik Dersler		14	3.00	42.00
Uygulamalı Dersler		0	0.00	0.00
Sınıf Dışı Ders Çalışma Süresi (Ön çalışma, pekiştirme)		0	0.00	0.00
Ödevler		1	30.00	30.00
Projeler		1	40.00	40.00
Arazi Çalışmaları		0	0.00	0.00
Arasınnavlar		1	0.00	0.00
Diğer		0	0.00	0.00
Yarıyıl Sonu Sınavı		1	40.00	40.00
Toplam İş Yüğü				152.00
Toplam İş Yüğü / 30 saat				5.07
Dersin AKTS Kredisi				5.00

25	PROGRAM YETERLİLİKLERİ İLE DERS ÖĞRETİM KAZANIMLARI İLİŞKİSİ TABLOSU															
	PY1	PY2	PY3	PY4	PY5	PY6	PY7	PY8	PY9	PY10	PY11	PY12	PY13	PY14	PY15	PY16
ÖK1	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
ÖK2	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
ÖK3	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
ÖK4	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
ÖK5	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
ÖK6	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
ÖK7	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
ÖK8	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
ÖK: Öğrenme kazanımlar PY: Program yeterlilikleri																
Katkı Düzeyi:	1 çok düşük			2 Düşük			3 Orta			4 Yüksek			5 Çok Yüksek			