

FİNANSAL EKONOMETRİ

1	Ders Adı:	FİNANSAL EKONOMETRİ
2	Ders Kodu:	EKO4104
3	Ders Türü:	Zorunlu
4	Ders Seviyesi	Lisans
5	Dersin Verildiği Yıl:	4
6	Dersin Verildiği Yarıyıl	8
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:	yok
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:	kyeryigit@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:	İleri düzeyde kuramsal ve uygulamalı bilgilere sahip olmak ve bir işletmeyi farklı açılardan değerlendirebilmek. Uygulamada karşılaşılan sorunları çözebilmek için ekip üyesi olarak sorumluluk alabilmek. Ekonomide iş fırsatlarını görebilmek, doğru şekilde uygulayabilmek. Bilgi ve iletişim teknolojilerin etkin kullanabilmek.
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: Eşitlik ve Hata Düzeltme Modelleri	
6	Volatilité 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 Fiyatlama Modelleri (CAPM)	
13	Çok Faktörlü Fiyatlama 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. Gouriéroux, 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 ÇALIŞMALARI		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		klasik sınav
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	3	4	4	4	2	4	4	1	4	2	4	4	0	0	0	0
ÖK2	4	4	2	4	1	4	2	4	2	3	3	3	0	0	0	0
ÖK3	3	3	4	3	4	3	3	4	3	3	4	4	0	0	0	0
ÖK4	3	2	3	4	2	2	3	3	3	3	4	3	0	0	0	0
ÖK5	3	3	3	3	3	3	4	2	2	3	3	4	0	0	0	0
ÖK6	2	3	4	4	4	2	4	3	4	3	4	2	0	0	0	0
ÖK7	4	3	4	3	2	4	2	3	5	4	5	3	0	0	0	0
ÖK8	4	4	2	4	2	4	3	3	4	3	4	3	0	0	0	0
ÖK: Öğrenme kazanımlar PY: Program yeterlilikleri																
Katkı Düzeyi:	1 çok düşük			2 Düşük			3 Orta			4 Yüksek			5 Çok Yüksek			