



Ders Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U Saat	AKTS	Z / S
Finansal Ekonometri	MUF429	7	3 + 0	3,0	Seçmeli
Birim Bölüm	Muhasebe ve Finans Yönetimi - Lisans (Yüz yüze)				
Amaç	Finansal ilişkileri matematiksel modellerle ifade ederek ekonometrik modeller oluşturabilmek ve bu modeller sayesinde özellikle finans piyasalarına ait ilişkileri yorumlayabilmek.				
Ders İçeriği	Ekonomik veriler temelinde ekonomik ilişkilerin nasıl modelleneceği, bu ilişkilerin nasıl parametrik olarak ortaya konacağı, bu parametrelerin neleri ifade ettiği ve bunlardan hareketle ekonominin finans yönünü anlayabilecek mikro ekonomik yapının matematiksel modeller ve veri setleri yardımıyla ekonometrik modellenmesi hedeflenmektedir.				
Ders Kaynakları	Gujarati, D. N., Porter, D. C., Şenesen, Ü., & Günlük-Şenesen, G. (2012). Temel ekonometri. Literatür Yayıncılık. , Financial Econometrics: From Basics to Advanced Modeling Techniques, Rachev, Mitnik., Jabozzi, Focardi, Jašić, Gujarati, D. N., Porter, D. C., Şenesen, Ü., & Günlük-Şenesen, G. (2012). Temel ekonometri. Literatür Yayıncılık.				

Hafta	Konu
1	Finansal Ekonometriye Giriş
2	Finansal Veri ve Ekonometriye İlişkin Temel Kavramlar
3	Finansal Veri ve Ekonometriye İlişkin Temel Kavramlar
4	Klasik Doğrusal Regresyon Modelleri
5	Geleneksel Birim Kök Testleri
6	Yapısal Kırımlı Birim Kök Testleri
7	Yapısal Kırımlı Birim Kök Testleri
8	Tek Değişkenli Zaman Serisi Modelleri
9	Çok Değişkenli Zaman Serisi Modelleri
10	Eşbütünlük Testleri
11	Volatilité ve Korelasyon Modelleri – ARCH Modeli
12	Volatilité ve Korelasyon Modelleri – GARCH Modeli
13	Çok Değişkenli Oynaklık Modelleri
14	Finansal Piyasalarda Asimetri

Program Çıktıları

- Muhasebe ve finansın temellerini oluşturan kavram ve kuramları bilir.
- Muhasebe ve denetim süreçleri ile ilgili bilgi ve becerilere sahiptir.
- Finansal yönetim süreçleri ile ilgili bilgi ve becerilere sahiptir.
- Muhasebe ve finans uygulamalarına ait bilgisayar programlarını kullanır.
- Bilişim teknolojilerindeki gelişmeler ve dijital uygulamalar hakkında temel bilgiye sahiptir.
- İş yaşamında iletişim kurabilme, sorumluluk alabilme ve problem çözme yeteneğine sahiptir
- Alanı ile ilgili bilimsel ve teknolojik bilgileri takip ederek, öğrenme ihtiyaçlarını belirler ve bilgi, beceri ve yetkinliklerini geliştirir.
- Toplumsal sosyal sorumluluk bilinci ile sürdürülebilirlik konularında bilgiye sahiptir.
- İş hayatında evrensel, toplumsal, bilimsel ve mesleki etik değerlere sahiptir.
- Muhasebe ve finans alanlarında karar alma ve süreçleri bağımsız olarak yürütme bilgi ve becerisine sahiptir.
- Bir yabancı dili kullanarak alanı ile ilgili gelişmeleri takip eder ve meslektaşları ile iletişim kurar.
- Takım çalışmasına yatkın, inovatif, analitik ve eleştirel düşünme becerisine sahiptir.
- Alanı ile ilgili edindiği bilgileri etkili iletişim yeteneği ile sözlü, yazılı ve görsel olarak ifade eder.
- İşletme faaliyetlerine liderlik ve yönetsel becerilerle katkı sağlar.

Ders Öğrenme Çıktısı - Program Çıktıları (1 -5 Puan Aralığı)

Ders Öğrenme Çıktısı	PÇ1	PÇ2	PÇ3	PÇ4	PÇ5	PÇ6	PÇ7	PÇ8	PÇ9	PÇ10	PÇ11	PÇ12	PÇ13	PÇ14
Finansal teorileri test edilebilmek	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Metodolojik yöntemleri kullanabilmek	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Finansal ekonometri alanında temel kavram ve konuları açıklayabilmek	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Finansal teorileri test edilebilmek	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Metodolojik yöntemleri kullanabilmek	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Finansal ekonometri alanında temel kavram ve konuları açıklayabilmek	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Ortalama Değer	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-