



| Ders Adı           | Kodu                                                                                                                                                                                                                                                               | Yarıyıl | T+U Saat | AKTS | Z / S   |
|--------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------|----------|------|---------|
| Finansal Teknikler | BFİ5509                                                                                                                                                                                                                                                            |         | 3 + 0    | 7,5  | Seçmeli |
| Birim Bölüm        | Bankacılık ve Finans - YL İÖ - Lisansüstü (Yüz yüze)                                                                                                                                                                                                               |         |          |      |         |
| Amaç               | İktisadi sorunların analizinin ekonometrik yöntemler ile nasıl yapıldığının ele alınması amaçlanmaktadır. Öğrencilerin bu ders ile beraber ekonometrik yöntemler ile iktisadi olguları kavrayabilme ve değerlendirebilme yetisine sahip olmaları hedeflenmektedir. |         |          |      |         |
| Ders İçeriği       | Ekonometrik altyapının kısa bir tekrarı ve finansal zaman serilerine giriş, ARCH/GARCH modelleri EViews yardımı ile incelenmektedir.                                                                                                                               |         |          |      |         |
| Ders Kaynakları    | 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 Kırılmalı Birim Kök Testleri                  |
| 7     | Yapısal Kırılmalı Birim Kök Testleri                  |
| 8     | Tek Değişkenli Zaman Serisi Modellemeleri             |
| 9     | Çok Değişkenli Zaman Serisi Modellemeleri             |
| 10    | Eşbütünleşme 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

- Farklı lisans programlarından mezun olanların finans alanıyla ilgili temel kavramlara, güncel ve teorik bilgilere sahip olmak
- Alanla ilgili edindiği bilgi ve becerileri finansal süreçleri çözmede kullanmak, analitik ve stratejik düşünerek uygulamaya geçirebilmek
- Alanla ilgili edindiği bilgiler çerçevesinde finansal piyasaları ve finansal kurumları değerlendirebilmek
- Alanla ilgili konularda ekip çalışmasının getireceği sorumluluklara açık olmak
- Alanla ilgili konularda bireysel anlamda sorumluluğa açık olmak
- Finansal olaylar arasında neden-sonuç ilişkisi kurabilmek ve yorumlayabilmek
- Finansal konularla ilgili bilgi ve becerileri yazılı ve sözlü olarak aktarabilmek, iletişim kurabilmek
- Finansal konularda gelişmeleri takip edebilecek ve iletişim kurabilecek düzeyde bir yabancı dili anlamak ve kullanmak
- Alanın gerektirdiği düzeyde bilgi, iletişim teknolojileri ve paket programları kullanabilmek
- Alanla ilgili konularda toplumsal refahı ön planda tutabilmek ve etik değerlere uygun değerlendirebilmek ve yorum yapabilmek
- Finansal piyasa ve kurumların iç ve dış çevresinde tüm paydaşlarını gözeterek şekilde ilişkilerini izleyebilmek
- Çevreye, sosyal sorumluluğa, kaliteye ve yenilikçiliğe her şart altında önem vermek, verileri ilgili doğrultuda toplayabilmek
- Bankacılık ve finans konularında edindiği bilgi ve becerileri sürekli geliştirerek ömür boyu öğrenmeye açık olmak
- Alanıyla ilgili konularda bilgi ve becerileri eleştirel bir bakış açısıyla değerlendirebilmek
- Genelde finans, özelde ise bankacılık konuları ile ilgili bilgi birikimine sahip olarak, ekonomide yaşanan süreçleri izleyebilmek

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

| Ders Öğrenme Çıktısı                                                 | PÇ 1 | PÇ 2 | PÇ 3 | PÇ 4 | PÇ 5 | PÇ 6 | PÇ 7 | PÇ 8 | PÇ 9 | PÇ 10 | PÇ 11 | PÇ 12 | PÇ 13 | PÇ 14 | PÇ 15 |
|----------------------------------------------------------------------|------|------|------|------|------|------|------|------|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| Finansal teorileri test edilebilmek                                  | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -     | -     | -     | -     | -     | -     |
| Metodolojik yöntemleri kullanabilmek                                 | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -     | -     | -     | -     | -     | -     |
| Finansal ekonometri alanında temel kavram ve konuları açıklayabilmek | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -    | -     | -     | -     | -     | -     | -     |