



| 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 | 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

| | |
|----|---|
| 1 | Muhasebe ve finans alanında güncel kuramsal ve uygulamalı bilgilere sahip olur. |
| 2 | Muhasebe bilgilerini stratejik, taktik ve operasyonel boyutlarda kullanabilir ve bu bilgileri örgütsel düzeyde analiz edebilir ve tasarlayabilir. |
| 3 | Kamu ve özel sektör iş yaşamının gerektirdiği, hem teorik hem de uygulama bazındaki muhasebe ve finans konularıyla iş yaşamına kolayca adaptasyon sağlar. |
| 4 | Bilişim teknolojileri başta olmak üzere, muhasebe ve finans alanındaki çağdaş yöntem ve teknolojilerdeki güncel gelişmeleri izler, bunları etkili bir şekilde kullanabilir ve kendini sürekli yenileme becerisi kazanır |
| 5 | Kamu ve özel sektör kuruluşlarındaki alanı ile ilgili süreçleri yerinde inceleyerek uygulama becerisi kazanır |
| 6 | Çevreye, sosyal sorumluluğa, kaliteye, yenilikçiliğe her şart altında önem verir ve verileri ilgili doğrultuda toplayabilir. |
| 7 | Bireysel ve ekip üyesi olarak sorumluluk alır, açık fikirli, eleştiriye açık, yapıcı ve özgüven sahibi olur, etkin ve verimli çalışır. |
| 8 | İş etiğinin değerlerine uymanın gereğini özümser, muhasebe ve finans alanı ile ilgili verilerin toplanması, yorumlanması, duyurulması ve uygulanması aşamalarında her şart altında toplumsal, bilimsel ve etik değerlere sahip olur ve uygular. |
| 9 | Liderlik vasıflarını kazanmak ve başarı ile uygulamak |
| 10 | Bir yabancı dili kullanarak muhasebe ve finans alanı ile ilgili bilgileri izler ve meslektaşları ile iletişim kurar |
| 11 | Yerel, ulusal, uluslararası ve küresel boyutlarda muhasebe ve finans alanındaki hem teorik hem de pratik değişim ve gelişimi izleme becerisi kazanır. |
| 12 | Takım çalışmasına uyumlu, inisiyatif sahibi, analitik düşünebilen, yenilik ve değişime açık, girişimci, yaşam boyu öğrenme davranışı kazanır. |
| 13 | Alanı ile ilgili ileri düzeydeki bir çalışmayı bağımsız olarak yürütebilir. |
| 14 | Toplumsal Sosyal sorumluluk bilinci ile yaşadığı sosyal çevre için projeler ve etkinlikler düzenleyebilir. |

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 |
|--|------|------|------|------|------|------|------|------|------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 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 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |