



| 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. ,<br>Financial Econometrics: From Basics to Advanced Modeling Techniques, Rachev, Mitnik., Jabozzi, Focardi, Jašić,<br>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 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

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