



Ders Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U Saat	AKTS	Z / S
Finansal Ekonometri	BAF312	6	3 + 0	5,0	Zorunlu
Birim Bölüm	Finans ve Bankacılık - Lisans (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 Veren	Doç. Dr. Melik KAMIŞLI				
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 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

Ders İş Yükü	Çalışma Türü / Öğretim Metotlar	Süresi (Saat)	Sayısı
Dinleme ve anlamlandırma	Ders	3	14
Önceden planlanmış özel beceriler	Problem Çözme	5	14
Ara Sınav 1		1	1
Ara Sınav 2		1	1
Ders İş Yükü:		114	
AKTS (Ders İş Yükü / 25.5):		4,47	

Program Çıktıları	
1	Paranın zaman değeri, risk-getiri dengesi gibi finans alanıyla ilgili temel kavramlar, teoriler ve uygulamalar hakkında güncel ve teorik bilgilere sahip olur.
2	Bankacılık sektörüyle ilgili temel bilgi, ilke ve uygulamaları bilir ve edindiği bilgi ve becerileri finansal süreçleri çözmeye kullanır, analitik ve stratejik düşünerek bankacılıkla ilgili verileri analiz edebilir.
3	Alanla ilgili edindiği bilgiler çerçevesinde, banka, yatırım şirketi, borsa vb. finansal kurumları, finansal piyasaları öğrenir ve bu piyasalarda işlem gören hisse senetleri, tahviller vb. finansal ürünleri analiz ederek, değerlendirebilir.
4	Alanla ilgili konularda ekip çalışmasının getireceği sorumluluklara açık olur.
5	Alanla ilgili konularda bireysel anlamda sorumluluğa açık olur.
6	Ulusal veya uluslararası finansal sistemlerin işleyişini anlayabilir, iflas, kriz vb. finansal olaylar arasında neden-sonuç ilişkisi kurar ve yorumlama becerisine sahip olur.
7	Finans ve bankacılık sektörüyle ilgili bilgi ve becerileri yazılı ve sözlü olarak aktarır ve iletişim kurar.
8	Finansal konularda gelişmeleri takip edebilecek ve iletişim kurabilecek düzeyde bir yabancı dili anlayabilir ve kullanabilir.
9	Yatırım analizi ve portföy yönetimi başta olmak üzere finans ve bankacılık sektörünün gerektirdiği düzeyde bilgi, iletişim teknolojileri ve paket programları kullanabilir.
10	Alanla ilgili konularda toplumsal refahı ön planda tutar ve etik değerlere uygun değerlendirerek yorum yapar.
11	Bankacılık sektörünün iç ve dış çevresinde tüm paydaşlarını gözeterek şekilde ilişkileri izleyebilir, sorunları tanımlar ve çözüm önerileri geliştirme yetkinliğine sahip olur.
12	Çevreye, sosyal sorumluluğa, kaliteye ve yenilikçiliğe her şart altında önem verir ve finansal verileri bu doğrultuda toplayıp değerlendirir.
13	Finans ve bankacılık konularında edindiği bilgi ve becerileri sürekli geliştirerek ömür boyu öğrenmeye açık ve bankacılık sektörüyle ilgili güncel gereksinimleri karşılamak becerisine sahiptir.
14	Finans ve bankacılık sektörüyle ilgili bilgileri eleştirel bir bakış açısıyla değerlendirebilir.
15	Finans ve bankacılık sektörü ile edindiği bilgi birikimi ile, küresel ekonomide ve uluslararası bankacılıkta yaşanan süreçleri izleyebilir.

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	1	1	3	3	3	3	4	5	5	5	5	5	5	5	5
Metodolojik yöntemleri kullanabilmek	1	3	3	3	4	4	4	5	5	5	5	5	5	5	5
Finansal ekonometri alanında temel kavram ve konuları açıklayabilmek	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5
Ortalama Değer	2,33	3	3,67	3,67	4	4	4,33	5	5	5	5	5	5	5	5

<https://ebs.bilecik.edu.tr/pdf/dersbilgigetir/341168>