



BİLECİK ŞEYH EDEBALI ÜNİVERSİTESİ
İKTİSADİ VE İDARİ BİLİMLER FAKÜLTESİ
İKTİSAT
(2025 - 2026) Ders Bilgi Formu



Ders Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U Saat	AKTS	Z / S
Finansal Ekonometri	MLİ357	5	3 + 0	5,0	Seçmeli

Birim Bölüm	İktisat - Lisans (Yüz yüze)
Amaç	Öğrencilere finansla ilgili yapacakları çalışmalarda kullanacakları temel ekonometrik modellerin ve çözüm yöntemlerinin öğretilmesi
Ders İçeriği	Ekonometriye giriş, çoklu doğrusal bağlantı, otokorelasyon, ARMA, ARİMA, ARCH, GARCH, zaman serileri analizi
Ders Kaynakları	Ekonometrik Çözümleme, Metodoloji Açısından Sosyal Bilimlere Giriş

Hafta	Konu
1	1. Hafta: Giriş ve Temel Kavramlar Finansal ekonometrinin tanımı ve kapsamı Temel finansal piyasalar ve finansal veriler Ekonometrik analiz süreçleri
2	2. Hafta: Finansal Verilerin Özellikleri Finansal zaman serilerinin özellikleri Durağanlık kavramı Fiyatlar, getiriler ve volatilité
3	3. Hafta: Regresyon Analizine Giriş Basit ve çoklu regresyon modelleri OLS yöntemi ve temel varsayımlar Finansal verilerde uygulama örnekleri
4	4. Hafta: Regresyon Modellerinde Problemler Otokorelasyon ve etkileri Değişen varyans (heteroskedastisite) Çoklu doğrusal bağlantı ve çözüm yolları
5	5. Hafta: Finansal Zaman Serileri - ARİMA Modelleri AR, MA ve ARİMA modellerine giriş Durağanlık testleri (ADF ve KPSS) Model seçimi ve tahmin
6	6. Hafta: Volatilité Modelleri - ARCH ve GARCH Finansal piyasalarda volatilitenin önemi ARCH ve GARCH modellerinin tanıtımı Modelleme ve tahmin uygulamaları
7	7. Hafta: Volatilité Modellerinde Gelişmiş Yaklaşımlar GARCH türevleri: EGARCH, TGARCH Asimetrik volatilité modelleri Finansal piyasalar için uygulamalar
8	8. Hafta: Panel Veri Modelleri Panel veri yapısı ve özellikleri Sabit ve rastgele etkiler modelleri Finansal uygulamalarda panel veri
9	9. Hafta: Vektör Otoregresyon (VAR) Modelleri VAR modellerine giriş Nedensellik analizi (Granger Nedensellik Testi) Şok tepki analizi
10	10. Hafta: Eşbütünleşme ve Hata Düzeltme Modelleri Eşbütünleşme kavramı Johansen eşbütünleşme testi Hata düzeltme modelleri ve uzun dönem ilişkiler
11	11. Hafta: Finansal Risk Modelleme Risk ölçüm yöntemleri: VaR (Value at Risk) Finansal risk modelleme teknikleri Monte Carlo simülasyonları
12	12. Hafta: Yüksek Frekanslı Veri Analizi Yüksek frekanslı verilerin özellikleri Likidite ve mikro yapı analizi
13	13. Hafta: Finansal Ekonometride Makine Öğrenmesi Makine öğrenmesi tekniklerinin finansal uygulamaları Regresyon ve sınıflandırma algoritmaları Portföy optimizasyonu ve tahmin modelleri
14	14. Hafta: Dönem Projeleri ve Genel Değerlendirme Öğrenci projelerinin sunumu Finansal ekonometrinin gelecekteki uygulama alanları Dersin genel değerlendirilmesi

Program Çıktıları

1	İktisat teorisi, kavramları ve yöntemleri hakkında kapsamlı bilgiye sahip olur.
2	Farklı disiplinlerden edindiği bilgi ve yöntemleri birleştirerek karşılaştığı konu ve sorunların çözümünde bütüncül bir anlayışa sahip olur.
3	İktisadi bakış açısını geliştirmek için farklı disiplinlerden faydalanır.
4	Ulusal ve uluslararası gelişmelere iktisat perspektifinden yaklaşarak, eleştirel düşünme ve analiz yapabilme becerisi kazanır.
5	Toplumsal ve çevresel sorunlara duyarlılık geliştirerek, eleştirel düşünme ve yenilikçi çözüm yaklaşımlarıyla bilimsel öneriler sunma becerisi kazanır.
6	Yaşam boyu öğrenme bilinci ile iktisat alanındaki yenilikleri takip eder ve bu yenilikleri kendi çalışmalarına entegre eder.
7	Alanındaki gelişmeleri takip edebilecek düzeyde Türkçe ve yabancı dil bilgisine sahip olarak yazılı-sözlü iletişim kurma becerisi kazanır.
8	Bağımsız çalışabilme ve ekip içinde etkin bir şekilde iş birliği yapabilme becerisi geliştirir.
9	Çeşitli bilgi ve verileri toplama, analiz etme ve bu verileri yorumlayarak iktisadi olguları anlama ve karar alma süreçlerinde kullanabilme becerisi kazanır.
10	İktisat teorisinin ve ekonomik kurumların tarihsel gelişimini anlar ve bu bağlamda ekonomik politikaları değerlendirme becerisi kazanır.
11	İktisadi politikaları sonuçlarıyla beraber analiz eder ve sorunların çözümüne yönelik sürdürülebilir öneriler geliştirir.
12	İktisadın özelleşmiş alt alanlarında da bilgi sahibi olur ve bu alanlara yönelik analitik düşünme becerileri geliştirir.
13	İktisadi analizlerde matematik ve istatistik bilimleri ile ekonometrik yöntemleri etkin bir şekilde kullanır.

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
Finansal zaman serisi verilerinin (getiri, volatilité, faiz oranları vb.) temel istatistiksel özelliklerini (volatilité kümelenmesi, kalın kuyruklar, vb.) tanımlar ve bu verilerin klasik ekonometrik varsayımlardan neden saptığını açıklar.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Finansal serilerde gözlemlenen volatilitéyi modellemek için ARCH ve GARCH ailesi modellerini (EGARCH, GJR-GARCH vb.) kullanır ve model sonuçlarını finansal risk ve belirsizlik bağlamında değerlendirir.	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
Ortalama Değer	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-