



Ders Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U Saat	AKTS	Z / S
Finansal Ekonometri	BSİ5010		3 + 0	7,5	Seçmeli
Birim Bölüm	Bankacılık ve Sigortacılık - YL - Lisansüstü (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 Veren	Doç. Dr. Melik KAMIŞLI				
Ders Kaynakları	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	Eşbütünlük 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 Metotları	Süresi (Saat)	Sayı
Dinleme ve anlamlandırma	Ders	6	14
Dinleme ve anlamlandırma, gözlem/durumları işleme, eleştirel düşünme, soru geliştirme	Tartışmalı Ders	2	14
Önceden planlanmış özel beceriler	Problem Çözme	5	14
Ara Sınav 1		1	1
Uygulama 1		1	1
Dönem Sonu Uygulaması		1	1
Ders İş Yükü:		185	
AKTS (Ders İş Yükü / 25.5):		7,25	

Program Çıktıları	
1	Finans alanıyla ilgili temel kavramlara, güncel ve teorik bilgilere sahip olmak
2	Alanla ilgili edindiği bilgi ve becerileri finansal süreçleri çözmeye kullanmak, analitik ve stratejik düşünerek uygulamaya geçirebilmek
3	Alanla ilgili edindiği bilgiler çerçevesinde finansal piyasaları ve finansal kurumları değerlendirebilmek
4	Alanla ilgili konularda ekip çalışmasının getireceği sorumluluklara açık olmak
5	Alanla ilgili konularda bireysel anlamda sorumluluğa açık olmak
6	Finansal olaylar arasında neden-sonuç ilişkisi kurabilmek ve yorumlayabilmek
7	Finansal konularla ilgili bilgi ve becerileri yazılı ve sözlü olarak aktarabilmek, iletişim kurabilmek
8	Finansal konularda gelişmeleri takip edebilecek ve iletişim kurabilecek düzeyde bir yabancı dili anlamak ve kullanmak
9	Alanın gerektirdiği düzeyde bilgi, iletişim teknolojileri ve paket programları kullanabilmek
10	Alanla ilgili konularda toplumsal refahı ön planda tutabilmek ve etik değerlere uygun değerlendirebilmek ve yorum yapabilmek
11	Finansal piyasa ve kurumların iç ve dış çevresinde tüm paydaşlarını gözetecek şekilde ilişkilerini izleyebilmek
12	Çevreye, sosyal sorumluluğa, kaliteye ve yenilikçiliğe her şart altında önem vermek, verileri ilgili doğrultuda toplayabilmek
13	Bankacılık ve finans konularında edindiği bilgi ve becerileri sürekli geliştirerek ömür boyu öğrenmeye açık olmak
14	Alanla ilgili konularda bilgi ve becerileri eleştirel bir bakış açısıyla değerlendirebilmek
15	Genelde finans, özelde ise bankacılık ve sigortacılık 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	1	1	3	3	3	3	3	3	3	3	5	5	5	5	-
Metodolojik yöntemleri kullanabilmek	1	1	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	-
Finansal ekonometri alanında temel kavram ve konuları açıklayabilmek	5	5	3	3	3	3	3	3	3	3	3	3	3	3	-
Ortalama Değer	2,33	2,33	3,67	3,67	3,67	3,67	3,67	3,67	3,67	3,67	4,33	4,33	4,33	4,33	-

<https://ebs.bilecik.edu.tr/pdf/dersbilgigetir/408620>