



BİLECİK ŞEYH EDEBALI ÜNİVERSİTESİ
İKTİSADİ VE İDARİ BİLİMLER FAKÜLTESİ

MALİYE

(2022 - 2023) Ders Bilgi Formu



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

Birim Bölüm	Maliye - 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 - ARIMA Modelleri AR, MA ve ARIMA 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	Maliye alanında güncel, teorik ve uygulamalı bilgilere sahip olmak
2	Kamu ve özel sektörde görev alacak / alan elemanlarda aranan düzeyde hukuk, muhasebe, işletme alanlarıyla ilgili bilgilere sahip olmak
3	Kamu ekonomisi, maliye teorisi, kamu kesiminin mali yönetimi ve denetimi ile bütçe teorisi ve uygulamalarına ilişkin teorik bilgilere ve bu konuda analiz yeteneğine sahip olmak
4	Ekip çalışmasına yatkın olma, sorumluluk alabilme, liderlik edebilmek, kurum ve çalışma arkadaşlarını yenilikçi fikirlere yönlendirebilme.
5	Maliye alanında edindiği bilgi ve becerileri sürekli geliştirmek ve alanında yenilik ve gelişmeleri takip ederek ömür boyu öğrenmeye açık olmak.
6	Gerek kamunun gerekse de özel kesimin gereksinim duyduğu yüksek becerili elemanlarda olması gereken; yeterli düzeyde maliye, hukuk, iktisat, işletme, muhasebe bilgisine sahip olmak ve alanla ilgili kurumlara faydalı hedefler belirlemek, bu bilgileri kullanabilmek.
7	Sayısal ve istatistiksel araştırma becerisine ve düşünme yeteneğine sahip, alınacak kararların sonuçlarını öngörebilen ve doğru tahminlerde bulunabilen, sebep-sonuç ilişkilerini göz önünde bulundurabilme yeteneğine sahip olmak
8	Liderlik özelliklerine sahip ve diğer alanlardaki uzmanlarla iletişim kurabilme kabiliyetine sahip olmak.
9	Toplumsal, bilimsel ve mesleki etik değerlerin bilincinde olmak
10	Maliye ve ekonomi alanında kullanılan bilgi sistemleri konusunda bilgi sahibi olma ve gerekli yazılımları kullanabilme becerisine sahip olmak.
11	Türkçe yazılı ve sözlü iletişim yeterliliğine sahip olmak, bilgilerini ve düşüncelerini başkalarına iletebilme, ikna gücü yüksek, eleştirel düşünebilme, alternatif çözümler üretebilme, ve bilgileri analiz etme becerisine sahip, inisiyatif kullanabilme becerisine sahip olmak.
12	Sosyal hakların evrenselliği, sosyal adalet, kalite ve kültürel değerler ile çevre koruma, iş sağlığı ve güvenliği konularında yeterli bilince sahip olmak.
13	Bir yabancı dili maliye alanında bilgi sahibi olacak şekilde anlayabilme ve kullanabilme yeteneğine sahip olmak.
14	Alanının gerektirdiği düzeyde bilgi ve iletişim teknolojilerini kullanabilme yeteneğine sahip olmak

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
Alan ile ilgili teorik ve güncel bilgilere sahip olmak.	4	4	5	5	4	5	5	4	3	4	5	4	1	4
Ortalama Değer	4	4	5	5	4	5	5	4	3	4	5	4	1	4