



Ders Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U Saat	AKTS	Z / S
Finansal Teknikler	BFİ5509		3 + 0	7,5	Seçmeli
Birim Bölüm	Bankacılık ve Finans - YL İÖ - Lisansüstü (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 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 Kırılmalı Birim Kök Testleri
7	Yapısal Kırılmalı 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

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