



Ders Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U Saat	AKTS	Z / S
Finansal Ekonometri	İKT5505		3 + 0	7,5	Seçmeli
Birim Bölüm	Para-Banka ve Dış Ticaret - YL İÖ - Lisansüstü (Sözlü Anlatım)				
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 Damodar, (1999) "Temel Ekonometri", Gujarati Damodar, (1999) "Temel Ekonometri", Financial Econometrics: From Basics to Advanced Modeling Techniques, Rachev, Mitnik,, Jabozzi, Focardi, Jašić, Financial Econometrics: From Basics to Advanced Modeling Techniques, Rachev, Mitnik,, Jabozzi, Focardi, Jašić				

Hafta	Konu
1	İstatistiğe Giriş
2	Ekonometrik Modelin Temel Kavramları
3	Finansal Seriler ve Özellikleri
4	Finansal Ekonometriye Giriş
5	Geleneksel Birim Kök Testleri
6	Yapısal Kısımlı Birim Kök Testleri
7	Tek ve Çok Değişkenli Zaman Serisi Modellemeleri
8	Volatilité ve Korelasyon Modelleri – ARCH Modeli
9	Volatilité ve Korelasyon Modelleri – GARCH Modeli
10	Oynaklık öngörüsü: ARCH/GARCH tipi modeller ile öngörü
11	Öngörü değerlendirme ölçütleri ve ARCH/GARCH tipi modellerin EViews ile tahmini
12	Çok Değişkenli Oynaklık Modelleri
13	Diagnostik kontrol ve en iyi modelin seçilmesi
14	Eşbütünlük Testleri

Ders İş Yükü	Çalışma Türü / Öğretim Metotları	Süresi (Saat)	Sayı
Dinleme ve anlamlandırma	Ders	3	14
Araştırma – yaşam boyu öğrenme, yazma, okuma, Bilişim	Sınıf Dışı Çalışma	3	14
Araştırma – yaşam boyu öğrenme, yazma, okuma, Bilişim, eleştirel düşünme, soru geliştirme, yönetsel beceriler, takım çalışması	Grup Çalışması	5	2
Araştırma – yaşam boyu öğrenme, durumları işleme, soru geliştirme, yorumlama, sunum	Sözlü	5	2
Dinleme ve anlamlandırma, gözlem/durumları işleme	Panel	5	2
Önceden planlanmış özel beceriler	Problem Çözme	3	14
Ara Sınav 1		5	1
Ödev 1		10	1
Dönem Sonu Uygulaması		15	1
<b>Ders İş Yükü:</b>		186	
<b>AKTS (Ders İş Yükü / 25.5):</b>		7,29	

Program Çıktıları	
1	Alanıyla ilgili teorik ve güncel bilgilere sahip olmak.
2	Alanında uzmanlaşmak ve analiz yapabilme becerisini kazanmak.
3	Alanı ve diğer disiplinler arasında bağlantı kurarak analiz yapma ve uygulama safhalarında bilgilerini disiplinler arası değerlendirebilme yetisini edinmek.
4	Proje ve çalışmalarında kullanılmak üzere yeterli düzeyde yazılım, bilgi ve iletişim teknolojilerine hakim olmak.
5	Uygulama çalışmalarında elde ettiği sonuçları akademik kurallar çerçevesinde projelendirme ve sözlü ve yazılı olarak sunabilme becerisini edinmek.
6	Alanında edindiği uzmanlık düzeyindeki bilgileri eleştirel bir yaklaşımla değerlendirerek, yaşam boyu öğrenme ve sorgulama bilincine sahip olmak.
7	Alanıyla ilgili politika ve çözüm önerilerini bilimsel veri ve yöntemlerle destekleyerek ilgili kişi ve kurumlara yazılı ve sözlü olarak sunabilmek.
8	Alanla ilgili çalışmalarda bilimsel, kültürel, toplumsal ve etik değerlere uygun hareket etme hassasiyetini kazanmak.
9	Alanıyla ilgili literatürü eleştirel bakış açısıyla değerlendirme becerisinin kazanmak.
10	Yaşadığı ülkenin sosyal ve iktisadi sorunlarını analiz edebilecek, çözüm ve politikalar üretebilecek düzeyde toplumu ve ilgili kurumları tanımak.
11	Alanıyla ilgili konularda bağımsız çalışabilme ve ekip çalışmalarının getireceği sorumluluklara da açık olmak.
12	Çalıştığı kurumun güçlü ve zayıf yanlarını tespit ederek, uygun stratejileri ortaya koyabilecek bilimsel donanımı edinmek
13	Alanıyla ilgili gelişmeleri takip edebilecek düzeyde yabancı dil bilmek.

**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 teorileri test edilebilmek	2	2	4	4	2	2	2	1	1	1	2	1	1
Metodolojik yöntemleri kullanabilmek	3	2	5	5	3	2	3	1	1	1	3	1	1
Finansal ekonometri alanında temel kavram ve konuları açıklayabilmek	5	4	3	2	3	3	3	3	3	3	2	1	2

<https://ebs.bilecik.edu.tr/pdf/dersbilgi/getir/410951>