Ders İzlencesi

Ders Kodu - Ders Adı	**FİN552 - Finansal Ekonometri**
Ders Türü	II.Yarıyıl
Teori + Uygulama	3+0
AKTS	**6.0**
Ders Dili	Türkçe
Ders Türü	Seçmeli Dersler
Öğretim Elemanları	DR. ÖĞR. ÜYESİ YUSUF ÜNSAL

Dersin Veriliş Biçimi	Uzaktan öğretim teknikleri
Önkoşullar	Yoktur.
Önerilen Dersler	Yoktur.
Önerilen Kaynaklar	• Brooks Chris, (2008) . Introductory Econometrics for Finance 2nd.edn., Cambridge University Press.• Kuznetsov A. (2007). The Complete Guide to Capital Markets for Quantitative Professionals, McGraw-Hill.• Heij C., P. De Boer, Philip Hans Franses, Teun Kloek and Herman van Dijk (2004). Econometric Methods with Applications in Business and Economics, Oxford.• C. Davino, M. Furno, D. Vistocco, (2013). Quantile Regression: Theory and Applications, Wiley.• Svetlozar T. Rachev, Stefan Mittnik, Frank J. Fabozzi, Sergio M. Focardi, and Teo Jasic, (2007) Financial Econometrics: From Basics to Advanced Modeling Techniques, Wiley.
Staj & Uygulama	Yoktur.

Ders İzlencesi

Haftalar	Öğrenme Çıktıları	Konular	Öğretim Yöntemleri
1. hafta		Temel istatistik ve Ekonometrik Kavramlar	
2. hafta		Regresyon Analizine Giriş	
3. hafta		Regresyon Analizinde Temel Konular	
4. hafta		Zaman Serisi Ekonometrisinin Temelleri	
5. hafta		Tek ve Çok Değişkenli Zaman Serileri	
6. hafta		Box Jenkins Yaklaşımı ve ARIMA Modelleri	
7. hafta		Ara Sınav	
8. hafta		Rassal Yürüyüş, Durağanlık ve Birim Kök Testleri	
9. hafta		Oynaklığın Modellenmesi : ARCH Modelleri	
10. hafta		Oynaklığın Modellenmesi : GARCH Modelleri	
11. hafta		Durağan Vektör Modelleri: VAR Modeli	
12. hafta		Eşbütünleşme ve Ortak Eğilimler	
13. hafta		Finansal Zaman Serilerini Modelleme ve Öngörü	
14. hafta		Dönem Sonu Sınavı	

Öğrenme Çıktıları

#	Öğrenme Çıktıları
1	Finansal ilişkileri uygun modellerle tahmin ederek ekonomik ve finansal verilere ilişkin öngörüde bulunabilecek
2	Finansal ekonomideki sorunlara istatistik ve ekonometrik teknikleri uygulayabilecek
3	Finansal piyasaları değerlendirmede, yatırım stratejilerini belirlemede, farklı alanlarda risk analizi yapmada değişik araç ve teknikleri kullanabilecek
4	Uluslararası finansal piyasalarda yaşanan gelişmeler ve yenilikler hakkında bilgi sahibi olarak yeni finansal ürünleri tasarlama ve üretme konusunda uzmanlık kazanabilecek
5	Bağımsız bir ampirik arastırmayı başlangıcından sonuna dek, veri toplama, ekonometrik kestirim ve alınan sonuçların yorumlanması adımlarının tamamı da dâhil olacak şekilde yürütebilecektir.

Sürdürülebilir Kalkınma Amaçları

İçerik girilmemiştir.

Dersin Teması

İçerik girilmemiştir.

AKTS İş Yükü

Etkinlik	Süre (Saat)	Sayı	İş Yükü
Teorik Derse Katılım	0	0	0
Sınıf Dışı Çalışma (Ön Hazırlık & Pekiştirme Amaçlı)	0	0	0
Ödevler	0	0	0
Proje - Rapor - Sunum Hazırlama	0	0	0
Ara Sınav Hazırlığı (sınav süresi dahil)	0	0	0
Final Sınavı Hazırlığı (sınav süresi dahil)	0	0	0
Uygulama (Laboratuvar, Müzik/Enstrüman Uygulaması, Atölye/Saha Çalışması vb.)	0	0	0
Staj Uygulaması	0	0	0
		Hesaplanan AKTS	**0**

Ölçme ve Değerlendirme

İçerik girilmemiştir.