



## Ders Bilgi Formu

| Ders Adı                       | Kodu    | Yerel Kredi | AKTS | Ders (saat/hafta) | Uygulama (saat/hafta) | Laboratuvar (saat/hafta) |
|--------------------------------|---------|-------------|------|-------------------|-----------------------|--------------------------|
| Finansta Ekonometrik Yöntemler | IKT5207 | 3           | 7.5  | 3                 | 0                     | 0                        |

|            |     |
|------------|-----|
| Önkoşullar | Yok |
|------------|-----|

|         |            |
|---------|------------|
| Yarıyıl | Güz, Bahar |
|---------|------------|

|             |                   |
|-------------|-------------------|
| Dersin Dili | İngilizce, Türkçe |
|-------------|-------------------|

|                 |                        |
|-----------------|------------------------|
| Dersin Seviyesi | Yüksek Lisans Seviyesi |
|-----------------|------------------------|

|                 |                        |
|-----------------|------------------------|
| Ders Kategorisi | Uzmanlık/Alan Dersleri |
|-----------------|------------------------|

|                      |          |
|----------------------|----------|
| Dersin Veriliş Şekli | Yüz yüze |
|----------------------|----------|

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| Dersi Sunan Akademik Birim | İktisat Bölümü |
|----------------------------|----------------|

|                     |                |
|---------------------|----------------|
| Dersin Koordinatörü | Hüseyin Taştan |
|---------------------|----------------|

|                  |                                      |
|------------------|--------------------------------------|
| Dersi Veren(ler) | Hüseyin Taştan, Hasan Ağan Karaduman |
|------------------|--------------------------------------|

|               |  |
|---------------|--|
| Asistan(lar)ı |  |
|---------------|--|

|              |   |
|--------------|---|
| Dersin Amacı | Bu dersin amacı finans alanında kullanılan modern ekonometrik yöntemleri orta/ileri düzeyde öğretilmesidir. |
|--------------|---|

|                |   |
|----------------|---|
| Dersin İçeriği | Finansal Zaman Serileri ve Getiri, Doğrusal ve Doğrusal Olmayan Zaman Serisi Modelleri, Koşullu Değişen Varyans Modelleri, Çok Değişkenli Finansal Zaman Serisi Analizi, Riske Maruz Değer, Temel Bileşen Analizi ve Faktör Modelleri, Sürekli-zaman Modelleri, State Space Modelleri ve Kalman Filtresi, Markov Zinciri Mone Carlo Metodu. |
|----------------|---|

|                               |     |
|-------------------------------|-----|
| Opsiyonel Program Bileşenleri | Yok |
|-------------------------------|-----|

### Ders Öğrenim Çıktıları

|   |   |
|---|---|
| 1 | Öğrenciler finans uygulamalarında sıklıkla kullanılan tahmin ve test yöntemleri hakkında işlevsel bilgi sahibi olacaktır.   |
| 2 | Öğrenciler ekonometrik modelleme, tahmin ve çıkarılma yöntemlerini kullanarak finans alanında uygulamalı bağımsız araştırma yürütebilme bilgi ve becerisi kazanacaktır. |
| 3 | Öğrenciler birden fazla ekonometri programını amaçlarına uygun olarak kullanabileceklerdir.   |
| 4 | Öğrenciler finansal karar alma süreçlerinde ekonometrik yöntemleri kullanabileceklerdir.  |
| 5 | Öğrenciler finansal ekonometrik yöntemlere dair güncel literatüre hakim olacaktır.  |

### Haftalık Konular ve İlgili Ön Hazırlık Çalışmaları

| Hafta | Konular                           | Ön Hazırlık               |
|-------|-----------------------------------|---------------------------|
| 1     | Finansal Zaman Serileri ve Getiri | FY Ch1, BU Ch1, Tsay Ch1  |
| 2     | Doğrusal Zaman Serisi Modelleri   | FY Ch2, BU Ch2, Tsay Ch2  |
| 3     | Koşullu Heteroskedastik Modeller  | FY Ch 3, BU Ch3, Tsay Ch3 |
| 4     | Doğrusal Olmayan Modeller         | Tsay Ch4                  |
| 5     | Yüksek Frekanslı Veri Analizi     | Tsay Ch5                  |
| 6     | Sürekli Zaman Modelleri           | FY Ch9, Tsay Ch6          |

|    |   |                    |
|----|---|--------------------|
| 7  | Ekstrem Değerler ve VaR                   | BU Ch5-6, Tsay Ch7 |
| 8  | Midterm 1                                 |                    |
| 9  | Çok Değişkenli Zaman Serisi Modelleri     | FY Ch 4, Tsay Ch8  |
| 10 | Temel Bileşen Analizi ve Faktör Modelleri | FY Ch 6, Tsay Ch9  |
| 11 | Çokdeğişkenli Oynaklık Modelleri          | BU Ch4, Tsay Ch10  |
| 12 | State Space Modelleri                     | Tsay Ch11          |
| 13 | Kalman Filtresi                           | Tsay Ch11          |
| 14 | Markov Zinciri Monte Carlo Metodu         | Tsay Ch12          |
| 15 | Final                                     |                    |

## Değerlendirme Sistemi

| Etkinlikler   | Sayı | Katkı Payı |
|---|------|------------|
| Devam/Katılım                                       |      |            |
| Laboratuvar   |      |            |
| Uygulama  |      |            |
| Arazi Çalışması                                     |      |            |
| Derse Özgü Staj                                     |      |            |
| Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği                       |      |            |
| Ödev  | 8    | 30         |
| Sunum/Jüri  |      |            |
| Projeler  |      |            |
| Seminer/Workshop                                    |      |            |
| Ara Sınavlar  | 1    | 30         |
| Final   | 1    | 40         |
| <b>Dönem İçi Çalışmaların Başarı Notuna Katkısı</b> |      | 60         |
| <b>Final Sınavının Başarı Notuna Katkısı</b>        |      | 40         |
| <b>TOPLAM</b>                                       |      | 100        |

## AKTS İşyükü Tablosu

| Etkinlikler                   | Sayı | Süresi (Saat) | Toplam İşyükü |
|-------------------------------|------|---------------|---------------|
| Ders Saati                    | 13   | 3             | 39            |
| Laboratuvar                   |      |               |               |
| Uygulama                      |      |               |               |
| Arazi Çalışması               |      |               |               |
| Sınıf Dışı Ders Çalışması     | 14   | 6             | 84            |
| Derse Özgü Staj               |      |               |               |
| Ödev                          | 8    | 9             | 72            |
| Küçük Sınavlar/Stüdyo Kritiği |      |               |               |
| Projeler                      |      |               |               |
| Sunum / Seminer               |      |               |               |

|   |     |    |      |
|---|-----|----|------|
| Ara Sınavlar (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi) | 1   | 15 | 15   |
| Final (Sınav Süresi + Sınav Hazırlık Süresi)        | 1   | 15 | 15   |
| <b>Toplam İşyükü</b>                                |     |    | 225  |
| <b>Toplam İşyükü / 30(s)</b>                        |     |    | 7.50 |
| <b>AKTS Kredisi</b>                                 |     |    | 7.5  |
| Diğer Notlar  | Yok |    |      |