

Sosyal Bilimler Enstitüsü / Bankacılık ve Finans Doktora Programı
2022 - 2023 Eğitim Öğretim Yılı
FİNANSAL EKONOMETRİ
Syllabus

Dersin Tanımı					
Adı	Kodu	Yarıyıl	T+U Saat	Kredi	AKTS
FİNANSAL EKONOMETRİ	FİBD1243780	Bahar Dönemi	3+0	3	8
Ön Koşul Dersleri					
Önerilen Seçmeli Dersler					
Dersin Dili	Türkçe				
Dersin Seviyesi	Doktora				
Dersin Türü	Zorunlu				
Dersin Koordinatörü	Dr.Öğr.Üye. Mutlu GÜRİSOY				
Dersi Verenler	Dr.Öğr.Üye. Mutlu GÜRİSOY				
Dersin Yardımcıları					
Dersin Amacı	Bu ders finans problemlerinin analizinde kullanılan temel ekonometrik yöntem ve teknikleri üzerinde odaklanır.				
Dersin İçeriği	Bu ders; 1) Stokastik süreçler ve finansal veriyi üreten süreçler,2) Regresyon Analizi: Teori ve Kestirim,3) Regresyon Analizinde Seçilmiş Konular,4) Finansta Regresyon Uygulamaları,5) Tek Değişkenli Zaman Serilerinin Modellenmesi,6) ARIMA modellemesi ve Tahminlemesine Yaklaşımlar,7) Otoregresif Koşullu Heteroskedastik Modeller Aradönem,8) Vektör Otoregresif Modeller,9) Koentegrasyon ve Durum Uzayı (State Space) Modelleri,10)Robust (varsayımlardan sapmalara karşı dirençli) Kestirim,11)Panel Veri,12)Simülasyon Yöntemleri,13)Finansta Veri Madenciliği,14)Finans Alanında Ampirik Çalışmaların yürütülmesi / Proje Çalışması / Tez Yazımı; konularını içermektedir.				
Dersin Öğrenme Çıktıları				Öğretim Yöntemleri	Ölçme Yöntemleri
Bu dersin sonunda öğrenci;					
- finansal zaman serisi verilerinin özelliklerini öğrenecektir					
- finansal ekonometrinin temel konuları hakkında tam bir bilgiye sahip olacaktır					
- finansal ekonometride sıklıkla kullanılan kavram ve notasyonların kullanımını bilecektir					
- istatistiksel / ekonometrik teknikleri kullanarak gerçek finansal verilere dayalı ampirik uygulamalar yürütebilecektir					
Öğretim Yöntemleri					
Ölçme Yöntemleri					
Ders Akışı					
Sıra	Konular	Ön Hazırlık			
1	1) Stokastik süreçler ve finansal veriyi üreten süreçler				
2	2) Regresyon Analizi: Teori ve Kestirim				
3	3) Regresyon Analizinde Seçilmiş Konular				
4	4) Finansta Regresyon Uygulamaları				
5	5) Tek Değişkenli Zaman Serilerinin Modellenmesi				
6	6) ARIMA modellemesi ve Tahminlemesine Yaklaşımlar				
7	7) Otoregresif Koşullu Heteroskedastik Modeller Aradönem				
8	8) Vektör Otoregresif Modeller				
9	9) Koentegrasyon ve Durum Uzayı (State Space) Modelleri				
10	10)Robust (varsayımlardan sapmalara karşı dirençli) Kestirim				
11	11)Panel Veri				
12	12)Simülasyon Yöntemleri				
13	13)Finansta Veri Madenciliği				
14	14)Finans Alanında Ampirik Çalışmaların yürütülmesi / Proje Çalışması / Tez Yazımı				
Değerlendirme Yöntemleri		Sınava Katkısı			
Ara Sınav		50			
Genel Sınav		50			

Kaynaklar
Ders Notları Campbell, J.Y., Lo, A.W., McKinlay, A.C., The Econometrics of Financial Markets, Princeton University Press, 1997 Rachev, S.T., Et al, Financial Econometrics: From Basic to Advanced Modeling Techniques, John Wiley&Sons, 2007 Wang, Peijie, Financial Econometrics, Second Edition, Routledge, 2009 Tsay, R.S., Analysis of Financial Time Series, Third Edition, Wiley, 2010