

GENEL TANIM / GENERAL DESCRIPTION

Ders Adı / Course Name	Financial Econometrics / Financial Econometrics	
Ders Kodu / Course Code	UTF511	
Ders Türü / Course Type		
Ders Seviyesi / Course Level	Master with Thesis / Master with Thesis	
Ders Akts Kredi / ECTS	6.00	
Haftalık Ders Saati (Kuramsal) / Course Hours For Week (Theoretical)	3.00	
Haftalık Uygulama Saati / Course Hours For Week (Objected)	0.00	
Haftalık Laboratuar Saati / Course Hours For Week (Laboratory)	0.00	
Dersin Verildiği Yıl / Year	1	
Öğretim Sistemi / Teaching System	Daytime Class / Daytime Class	
Eğitim Dili / Education Language	Turkish / Turkish	
Ön Koşulu Olan Ders(ler) / Precondition Courses	Yok	None
Amacı / Purpose	Bu dersin amacı, finansal ekonometri kavramlarını, yöntemlerini ve uygulamalarını öğrencilere tanıtmaktır. Finansal verilerin analizi, zaman serisi modelleri, finansal risk analizi, panel veri analizi ve finansal modelleme gibi temel konuları kapsayan ders, öğrencilere finansal piyasalarda veri analizi ve tahmin yapma becerilerini kazandırmayı hedeflemektedir.	The aim of this course is to introduce students to the concepts, methods and applications of financial econometrics. The course covers basic topics such as analysis of financial data, time series models, financial risk analysis, panel data analysis and financial modeling and aims to provide students with the skills to analyze and forecast data in financial markets.
İçeriği / Content	Bu dersin amacı, finansal ekonometri kavramlarını, yöntemlerini ve uygulamalarını öğrencilere tanıtmaktır. Finansal verilerin analizi, zaman serisi modelleri, finansal risk analizi, panel veri analizi ve finansal modelleme gibi temel konuları kapsayan ders, öğrencilere finansal piyasalarda veri analizi ve tahmin yapma becerilerini kazandırmayı hedeflemektedir.	The aim of this course is to introduce students to the concepts, methods and applications of financial econometrics. The course covers basic topics such as analysis of financial data, time series models, financial risk analysis, panel data analysis and financial modeling and aims to provide students with the skills to analyze and forecast data in financial markets.
Önerilen Diğer Hususlar / Recommended Other Considerations	Yok	None
Staj Durumu / Internship Status	Yok	None

Kitabı / Malzemesi / Önerilen Kaynaklar / Books / Materials / Recommended Reading	"Financial Econometrics: Methods and Models" - Ruey S. Tsay "Analysis of Financial Time Series" - Ruey S. Tsay "Econometric Analysis of Financial Markets" - John Y. Campbell, Andrew W. Lo, A. Craig MacKinlay "Financial Modeling and Valuation: A Practical Guide to Investment Banking and Private Equity" - Paul Pignataro	"Financial Econometrics: Methods and Models" - Ruey S. Tsay "Analysis of Financial Time Series" - Ruey S. Tsay "Econometric Analysis of Financial Markets" - John Y. Campbell, Andrew W. Lo, A. Craig MacKinlay "Financial Modeling and Valuation: A Practical Guide to Investment Banking and Private Equity" - Paul Pignataro
Öğretim Üyesi (Üyeleri) / Faculty Member (Members)		

ÖĞRENME ÇIKTILARI / LEARNING OUTCOMES

1	Finansal ekonometri konularını anlama ve analiz etme becerisi geliştirme.	Develop the ability to understand and analyze topics in financial econometrics.
2	Finansal veri setlerini analiz etmek ve finansal modeller oluşturmak için ekonometri yöntemlerini kullanma yetkinliği kazanma.	Gain competence in using econometric methods to analyze financial datasets and construct financial models.
3	Finansal riski ölçme ve yönetme becerisi geliştirme.	Develop the ability to measure and manage financial risk.
4	Finansal ekonometri modellerini kullanarak tahmin yapma ve karar verme yetkinliği kazanma.	Gain the ability to make forecasts and decisions using financial econometric models.
5	Finansal ekonometri uygulamalarını değerlendirme ve eleştirel bir bakış açısıyla analiz etme becerisi geliştirme.	Develop the ability to evaluate and analyze financial econometric applications with a critical perspective.

HAFTALIK DERS İÇERİĞİ / DETAILED COURSE OUTLINE

Hafta / Week					
1	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Giriş				
	Introduction to Financial Econometrics				
2	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Finansal Verilerin Özellikleri				
	Characteristics of Financial Data				
3	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Zaman Serisi Modelleri I				
	Time Series Models I				
4	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Zaman Serisi Modelleri II				
	Time Series Models II				
5	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Finansal Piyasa Verimliliği				
	Financial Market Efficiency				

6	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Finansal Risk Analizi				
	Financial Risk Analysis				
7	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Panel Veri Analizi I				
	Panel Data Analysis I				
8	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Ara Sınav				
	Midterm Exam				
9	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Regresyon Modelleri I				
	Regression Models I				
10	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Regresyon Modelleri II				
	Regression Models II				
11	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Finansal Modelleme I				
	Financial Modeling I				

12	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Finansal Modelleme II				
	Financial Modeling II				
13	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Finansal Krizler ve Analizi				
	Financial Crises and Analysis				
14	Teorik Dersler / Theoretical	Uygulama	Lab	Öğretim Yöntem ve Teknikleri/Teaching Methods Techniques	Ön Hazırlık / Preliminary
	Uygulama ve Proje Sunumları				
	Application and Project Presentations				

DEĞERLENDİRME / EVALUATION

Yarıyıl (Yıl) İçi Etkinlikleri / Term (or Year) Learning Activities	Sayı / Number	Katkı Yüzdesi / Percentage of Contribution (%)
Ara Sınav / Midterm Examination	1	100
Toplam / Total:	1	100
Başarı Notuna Katkı Yüzdesi / Contribution to Success Grade(%):		40

Yarıyıl (Yıl) Sonu Etkinlikleri / End Of Term (or Year) Learning Activities	Sayı / Number	Katkı Yüzdesi / Percentage of Contribution (%)
Final Sınavı / Final Examination	1	100
Toplam / Total:	1	100
Başarı Notuna Katkı Yüzdesi / Contribution to Success Grade(%):		60

Etkinliklerinin Başarı Notuna Katkı Yüzdesi(%) Toplamı / Total Percentage of Contribution (%) to Success Grade:	100
Değerlendirme Tipi / Evaluation Type:	

İŞ YÜKÜ / WORKLOADS

Etkinlikler / Workloads	Sayı / Number	Süresi (Saat) / Duration (Hours)	Toplam İş Yüğü (Saat) / Total Work Load (Hour)
Ara Sınav / Midterm Examination	1	1.00	1.00
Ara Sınav İçin Bireysel Çalışma / Individual Study for Mid term Examination	1	76.00	76.00
Final Sınavı / Final Examination	1	1.00	1.00
Final Sınavı için Bireysel Çalışma / Individual Study for Final Examination	1	72.00	72.00
Toplam / Total:	4	150.00	150.00
Dersin AKTS Kredisi = Toplam İş Yüğü (Saat) / 25.00 (Saat/AKTS) = 150.00/25.00 = 6.00 ~ 6.00 / Course ECTS Credit = Total Workload (Hour) / 25.00 (Hour / ECTS) = 150.00 / 25.00 = 6.00 ~ 6.00			

PROGRAM VE ÖĞRENME ÇIKTISI / PROGRAM LEARNING OUTCOMES

Öğrenme Çıktıları / Learning Outcomes	Program Çıktıları / Program Outcomes														
	1.1.1	1.1.2	1.1.3	1.1.4	1.1.5	1.1.6	1.1.7	1.1.8	1.1.9	1.1.10	1.1.11	1.1.12	1.1.13	1.1.14	1.1.15
1.Finansal ekonometri konularını anlama ve analiz etme becerisi geliştirme. / Develop the ability to understand and analyze topics in financial econometrics.	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4
2.Finansal veri setlerini analiz etmek ve finansal modeller oluşturmak için ekonometri yöntemlerini kullanma yetkinliği kazanma. / Gain competence in using econometric methods to analyze financial datasets and construct financial models.	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4
3.Finansal riski ölçme ve yönetme becerisi geliştirme. / Develop the ability to measure and manage financial risk.	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4	4
4.Finansal ekonometri modellerini kullanarak tahmin yapma ve karar verme yetkinliği kazanma. / Gain the ability to make forecasts and decisions using financial econometric models.	4	4	4	5	5	5	5	5	5	5	5	5	5	4	4
5.Finansal ekonometri uygulamalarını değerlendirme ve eleştirel bir bakış açısıyla analiz etme becerisi geliştirme. / Develop the ability to evaluate and analyze financial econometric applications with a critical perspective.	4	4	4	5	5	5	4	4	4	4	5	5	4	4	4

Katkı Düzeyi / Contribution Level : 1-Çok Düşük / Very low, 2-Düşük / Low, 3-Orta / Moderate, 4-Yüksek / High, 5-Çok Yüksek / Very high