

Genel Bilgiler

Dersin Amacı

Zaman serisi yapısındaki finans verilerinin tek değişkenli ve çok değişkenli zaman serisi şeklinde modellenmesi ve analiz yapılabilmesi için gerekli altyapı bilgisiyle öğrencilerin donatılmasıdır.

Dersin İçeriği

Zaman serisi ve panel verilerin analizi yapılmaktadır. Zaman serisi ve panel yapıdaki veriler için analizler (Durağanlık testleri; ARIMA modelleri; asimetrik GARCH modelleri; koentegrasyon ve hata düzeltme mekanizmaları; VAR; nedensellik) ve bilgisayar programında uygulanma.

Dersin Kitabı / Malzemesi / Önerilen Kaynaklar

Uygulamalı Ekonometri, Aziz KUTLAR, Nobel Yayın Dağıtım, Ankara, 2005 Ekonometri I / E-Views Uygulamalı ve Çözümlü Sorular, H. Hatice ÖZKAN ve M. Hanifi VAN, Nobel Yayın Dağıtım, Ankara, 2013 E - Views Uygulamalı Temel Ekonometri (Makro Ekonomik Verilerle), Z. Dina ÇAKMUR YILDIRTAN, Türkmen Kitabevi, İstanbul, 2000. Finansal Ekonometri, Nilgün ÇİL YAVUZ, DER Yayınları, İstanbul, 2014

Planlanan Öğrenme Etkinlikleri ve Öğretme Yöntemleri

Konu anlatımı ve problem çözümü

Ders İçin Önerilen Diğer Hususlar

YOKTUR.

Dersi Veren Öğretim Elemanı Yardımcıları

YOKTUR.

Dersin Verilişi

Konu anlatımı ve problem çözümü

Dersi Veren Öğretim Elemanları

Doç. Dr. Ebrucan İslamoğlu

Program Çıktısı

1. DÖÇ-1 Zaman serisi ve panel veriler için birim kök testleri yapabilme
2. DÖÇ-2 Zaman serisi ve panel veriler için modelleme yapabilme
3. DÖÇ-3 E-Views ve Stata programda zaman serileri ve panel verilerini analiz edebilmek

Haftalık İçerikler

Sıra	Hazırlık Bilgileri	Laboratuvar	Öğretim Metodları	Teorik	Uygulama
1				Finansal ekonometrinin tanımı	
2				Finansal veriler ve temel finansal teorik modeller	
3				Zaman serisi verilerinin düzenlemesi ve birim kök testleri	
4				AR, MA, ARMA ve ARIMA modelleri	
5				AR, MA, ARMA ve ARIMA modelleri	
6				Koentegrasyon	
7				Klasik ve asimetrik GARCH modelleri	
8				Ara Sınav	
9				VAR ve Grenger nedensellik analizi	
10				Panel veriler için düzenlemeler ve birim kök testleri	
11				Panel veriler için modelleme	
12				Panel veriler için modelleme	
13				Panel veriler için modelleme	
14				Panel veriler için örnek uygulamalar	
15				Panel veriler için örnek uygulamalar	

P.Ç. 1	P.Ç. 2	P.Ç. 3	P.Ç. 4	P.Ç. 5	P.Ç. 6	P.Ç. 7	P.Ç. 8	P.Ç. 9	P.Ç. 10	P.Ç. 11	P.Ç. 12	P.Ç. 13	P.Ç. 14	P.Ç. 15	P.Ç. 16	P.Ç. 17	P.Ç. 18	P.Ç. 19	P.Ç. 20	P.Ç. 21	P.Ç. 22	P.Ç. 23	P.Ç. 24	P.Ç. 25
Ö.Ç. 1	1																							
Ö.Ç. 2			1	1																				
Ö.Ç. 3																								

Tablo :

- P.Ç. 1 :** İşletme finansmanı konusunda temel bilgileri kavrama, kullanabilme, değerlendirme ve yorum yapabilme, ekonomik-sosyal ve mali gelişmeleri analiz edebilme, finansal sistemleri anlama, finansal planlama ve işletmelere ait mali tabloları yorumlama konularında bilgi sahibi olur.
- P.Ç. 2 :** Finansın çeşitli alanlarındaki (bankacılık, dış ticaret, factoring, leasing işlemleri, finansal piyasa ve borsa işlemleri, risk yönetimi, kredi yönetimi, işletme finansmanı vb.) temel kavramlarını anlar ve anlatabilir.
- P.Ç. 3 :** İşletmelerde finansal yönetim işlevini (analiz, planlama/bütçeleme, yatırım, finansman ve denetim) yerine getirme, yatırım projeleri hazırlama, değerlendirme, yönetme ve yatırım stratejileri geliştirme konularında yeterli bilgiye sahip olur.
- P.Ç. 4 :** Finansal piyasa (para ve sermaye piyasaları) araçlarını tanıır, belirli risk düzeyinde en yüksek getiriyi sağlayacak portföyler oluşturabilir ve bu portföyleri yönetebilir.
- P.Ç. 5 :** Ulusal / uluslararası finansal piyasa ve kurumları hakkında yeterli düzeyde bilgiye sahip olur ve bu alanlardaki değişim ve yenilikleri takip edebilir.
- P.Ç. 6 :** Finansal / bankacılık ürün ve hizmetler ile bu ürün ve hizmetlerin pazarlaması hakkında gerekli bilgiye sahip olur.
- P.Ç. 7 :** Muhasebenin işletmeler açısından önemi ve kapsamı, temel muhasebe kavramları, işletmelerin finansal rasyo ve tabloları hakkında teorik bilgilere sahip olur ve bu bilgileri kullanabilir.
- P.Ç. 8 :** Bu bölümü başarı ile bitiren öğrenciler: (1) İşletmeciliğin temel kavramları, işletmenin temel fonksiyonları, işletme biliminin tarihsel gelişimi, diğer bilim dallarıyla olan ilişkileri, işletmeler ve çevreleri, işletmenin amaçları, fizibilite etütleri, işletme işlevleri, firmalar arası işbirlikleri ve girişimcilik konularında ileri düzeyde bilgiye sahiptir ve bu konularda yönetsel kararları alır ve uygular.
- P.Ç. 9 :** Modern yönetim perspektifi ile örgütsel düzeyde analiz yapma ve tasarlama, işletme yönetiminin; planlama, örgütlenme, yürütme, koordinasyon ve denetim işlevlerini kavrama, anlatma ve uygulama konusunda bilgi sahibi olur.
- P.Ç. 10 :** İşletme yönetimi, stratejik yönetim, insan kaynakları yönetimi, örgütsel davranış, girişimcilik ve etik konusundaki süreçler, teoriler ve kavramları açıklayabilme ve analiz edebilme becerisine sahip olur.
- P.Ç. 11 :** Organizasyonlardaki insan ve insan davranışı ile algı, tutum ve kişilik gibi konuların yanı sıra son yıllarda örgütsel davranış alanında ortaya çıkan yeni kavram teknik ve uygulamalara ilişkin ileri düzeyde akademik bilgi ve birikime sahip olur.
- P.Ç. 12 :** Küreselleşme sürecinde işletmelerin sürekliliklerini sağlama noktalarında, pazar araştırması, bilgi sistemleri, tüketici davranışları, stratejik pazarlama, küresel pazarlar, ürün ve hizmet stratejileri, ürün hayat eğrisi, fiyatlama, tedarik zinciri konularını anlar ve kavrar.
- P.Ç. 13 :** Matematik, istatistik ve ekonometri alanlarında beceri kazanma, sayısal verilerden faydalanarak geliştirilecek olan istatistiksel ve ekonometrik çözümlerle daha etkin kararlar alabilme, alınacak kararların sonuçlarını öngörebilme ve doğru tahminlerde bulunabilme ve sebep-sonuç ilişkilerini yorumlama becerisi kazanır.
- P.Ç. 14 :** Para, banka ve finansal sistemin temel öğeleri ve bu öğelerin işleyişlerini yorumlama becerisine sahip olur.
- P.Ç. 15 :** İktisadi konularda temel kavramlar ve ekonomik göstergeler hakkında bilgilere sahip olur.
- P.Ç. 16 :** Bir ekonomideki karar birimlerinin, tüketicilerin ve firmaların, nasıl karar aldıkları ve piyasada birbirlerini nasıl etkilediklerini analiz edebilmek için gerekli bilgilere kuramsal ve uygulama düzeyinde sahip olur.
- P.Ç. 17 :** Bireyler, piyasalar ve ülkeler arasındaki ekonomik ilişkilerin işleyiş kurallarına dair temel bilgilere sahip olur.
- P.Ç. 18 :** Temel hukuk bilgisinin yanı sıra, asgari düzeyde borçlar hukuku, ticaret hukuku, bankacılık hukuku, sermaye piyasası hukuku ve kıymetli evrak hukuku bilgisine sahip olur.
- P.Ç. 19 :** Bilişim teknolojileri başta olmak üzere analitik düşünme gibi işletmeciliğin çağdaş yöntem ve teknolojilerini kullanır.
- P.Ç. 20 :** Yaşam boyu öğrenme davranışına sahip, iletişim becerisi yüksek, takım çalışmasına yatkın, inisiyatif sahibi, analitik ve eleştirel düşünme ve problem çözme yeteneklerine sahip, kendini ifade etmede ve kurumunu temsil etmede Türkçeyi ve mesleki yabancı dil bilgisini yazılı ve sözlü iletişimde kullanabilme becerilerine sahip olur.
- P.Ç. 21 :** Bilimsel araştırma yapmak için araştırma yöntem ve tekniklerini kullanır.
- P.Ç. 22 :** Atatürk ilke ve inkılapları ile Türk dilinin temel özellikleri hakkında bilgiye sahip olur.

- P.Ç. 23 :** Sanatsal ve sportif konulara ilişkin bireysel yeteneklerini geliştirir.
- P.Ç. 24 :** Dünya kültürlerine açık, farklı inanç, düşünce ve yaşam biçimlerine saygılı, bilimsel düşünce çerçevesinde bilgiyi sorgulama yetkinliğine sahip olur.
- P.Ç. 25 :** Sözlü ve yazılı etkin iletişim kurar; bir yabancı dili en az Avrupa Dil Portföyü B1 genel düzeyinde kullanır.
- Ö.Ç. 1 :** DÖÇ-1 Zaman serisi ve panel veriler için birim kök testleri yapabilme
- Ö.Ç. 2 :** DÖÇ-2 Zaman serisi ve panel veriler için modelleme yapabilme
- Ö.Ç. 3 :** DÖÇ-3 E-Views ve Stata programda zaman serileri ve panel verilerini analiz edebilmek