

İndirilme Tarihi

10.02.2026 09:17:30

BF424 - APPLIED FINANCIAL ECONOMETRICS II - İktisadi ve İdari Bilimler Fakültesi - Finans ve Bankacılık Bölümü

General Info

Objectives of the Course

This course aims that equipping students to knowledge about modeling time series financial data in form of univariate and multivariate time series and analyzing these models and results.

Course Contents

Time series and panel data analysis is performed. Time series and panel data analysis for the structure (Stationarity tests, ARIMA models, the asymmetric GARCH models, cointegration and error correction mechanisms, YES; causality) and the implementation of a computer program.

Recommended or Required Reading

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

Planned Learning Activities and Teaching Methods

Lecturing and problem solving

Recommended Optional Programme Components

YOKTUR.

Instructor's Assistants

There are no teaching assistants assigned to this course.

Presentation Of Course

Lecturing and problem solving

Dersi Veren Öğretim Elemanları

Assoc. Prof. Dr. Ebrucan İslamoğlu

Program Outcomes

- 1.
- 2.
- 3.

Weekly Contents

Order	PreparationInfo	Laboratory TeachingMethods	Theoretical Practise
1	Review of ECTS information, Course preparation work	Subject presentation, Discussion, Problem Solving, Interpretation	
2	Review of fundamental concepts related to Student Course Notes	Subject presentation, Discussion, Problem Solving, Interpretation	
3	Examining relevant reports .	Subject presentation, Discussion, Problem Solving, Interpretation	
4		Subject presentation, Discussion, Problem Solving, Interpretation	
5	Research on Types of Analysis Student Notes	Subject presentation, Discussion, Problem Solving, Interpretation	
6	Research on the content scope of tests	Subject presentation, Discussion, Problem Solving, Interpretation	
7	Analysis Study Notes and Questions	Subject presentation, Discussion, Problem Solving, Interpretation	
8			Midterm Exam
9	Midterm exam evaluation shortcomings and necessary actions	Subject presentation, Discussion, Problem Solving, Interpretation	
10	Analysis, lecture notes and questions.	Subject presentation, Discussion, Problem Solving, Interpretation	
11	Analysis, lecture notes and questions	Subject presentation, Discussion, Problem Solving, Interpretation	
12	Analysis, lecture notes and questions	Subject presentation, Discussion, Problem Solving, Interpretation	
13	presentations	Subject presentation, Discussion, Problem Solving, Interpretation	
14	presentations	Subject presentation, Discussion, Problem Solving, Interpretation	
15	presentations	Subject presentation, Discussion, Problem Solving, Interpretation	

Workload

Activities	Number	PLEASE SELECT TWO DISTINCT LANGUAGES
Vize	1	1,00
Final	1	1,00
Derse Katılım	12	1,00
Ders Öncesi Bireysel Çalışma	15	1,00
Ders Sonrası Bireysel Çalışma	15	1,00
Ara Sınav Hazırlık	1	30,00
Final Sınavı Hazırlık	1	50,00
Problem Çözme	10	1,00
Proje	1	40,00
Araştırma Sunumu	1	20,00
Ödev	10	1,00

Assesments

Activities	Weight (%)
Ara Sınav Hazırlık	40,00
Araştırma Sunumu	20,00
Final	40,00

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

Table :

- P.O. 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.O. 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.O. 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.O. 4 :** Finansal piyasa (para ve sermaye piyasaları) araçlarını tanıır, belirli risk düzeyinde en yüksek getiriye sağlayacak portföyler oluşturabilir ve bu portföyleri yönetebilir.
- P.O. 5 :** Ulusal / uluslararası finansal piyasa ve kurumları hakkında yeterli düzeyde bilgiye sahip olur ve bu alanlardaki değişim ve yenilikleri takip edebilir.
- P.O. 6 :** Finansal / bankacılık ürün ve hizmetler ile bu ürün ve hizmetlerin pazarlaması hakkında gerekli bilgiye sahip olur.
- P.O. 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.O. 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.O. 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.O. 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.O. 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.O. 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.O. 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.O. 14 :** Para, banka ve finansal sistemin temel öğeleri ve bu öğelerin işleyişlerini yorumlama becerisine sahip olur.
- P.O. 15 :** İktisadi konularda temel kavramlar ve ekonomik göstergeler hakkında bilgilere sahip olur.
- P.O. 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.O. 17 :** Bireyler, piyasalar ve ülkeler arasındaki ekonomik ilişkilerin işleyiş kurallarına dair temel bilgilere sahip olur.
- P.O. 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.O. 19 :** Bilişim teknolojileri başta olmak üzere analitik düşünme gibi işletmeciliğin çağdaş yöntem ve teknolojilerini kullanır.
- P.O. 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.O. 21 :** Bilimsel araştırma yapmak için araştırma yöntem ve tekniklerini kullanır.
- P.O. 22 :** Atatürk ilke ve inkılapları ile Türk dilinin temel özellikleri hakkında bilgiye sahip olur.
- P.O. 23 :** Sanatsal ve sportif konulara ilişkin bireysel yeteneklerini geliştirir.
- P.O. 24 :** Dünya kültürlerine açık, farklı inanç, düşünce ve yaşam biçimlerine saygılı, bilimsel düşünce çerçevesinde bilgiyi sorgulama yetkinliğine sahip olur.
- P.O. 25 :** Sözlü ve yazılı etkin iletişim kurar; bir yabancı dili en az Avrupa Dil Portföyü B1 genel düzeyinde kullanır.
- L.O. 1 :** DÖÇ-1 Excel ile istatistik: çapraz tablolama veri süzme ve fonksiyonları yapabilme
- L.O. 2 :** DÖÇ-2 Özet tablo hazırlayabilme
- L.O. 3 :** DÖÇ-3 Veri sıralama, Veri filtreleme,Veri doğrulama, Gruplandırma ve gurubu çözme, Alt toplamalar, Metni sütunlara dönüştürme,Formülleri uygulayabilme