

 İZMİR KÂTİP ÇELEBİ ÜNİVERSİTESİ ISO 9001:2008	T.C. <b>İZMİR KÂTİP ÇELEBİ ÜNİVERSİTESİ</b> <b>Öğrenci İşleri Daire Başkanlığı</b>	 <b>Dok. No: FR/72/07</b>
	<b>DERS TANITIM FORMU</b>	<b>İlk Yayın Tar.: 25.12.2013</b> <b>Rev. No/Tar.: 00/...</b> <b>Sayfa: 1 / 4</b>

<b>Ders Kodu</b>	ISL8_126
<b>Dersin Adı (Türkçe/İngilizce)</b>	<b>FİNANSTA İLERİ KANTİTATİF YÖNTEMLER</b>
<b>Dersin süresi</b>	3
<b>Teorik Ders Saati</b>	3
<b>Pratik Ders Saati</b>	0
<b>Uygulama Ders Saati</b>	0
<b>ECTS</b>	6
<b>Ulusal Kredisi</b>	3
<b>Yıl / Yarıyıl</b>	2017 / GÜZ
<b>Ders Düzeyi</b>	DOKTORA
<b>Dersin Türü</b>	SEÇMELİ
<b>Bölümü</b>	İŞLETME
<b>Ön Koşul</b>	YOK
<b>Öğretim Dili</b>	TÜRKÇE
<b>Öğretim Şekli</b>	TEORİK
<b>Staj Durumu</b>	YOK
<b>Koordinatör Öğretim Üyesi</b>	Yrd.Doç.Dr. Şaban Çelik
<b>Dersi Veren Öğretim Üyeleri</b>	Yrd.Doç.Dr. Şaban Çelik
<b>Dersin Yardımcıları</b>	
<b>Dersin Amacı</b>	Bu ders finansal karar almada yaygın olarak kullanılan istatistiksel yöntemlerin öğrenciler tarafından uygulanabilirliğini arttırmayı hedeflemektedir. Ders ayrıca temel ekonometriyi finanstaki uygulamalarına değinerek sunmayı planlamaktadır.
<b>Dersin Öğrenme Çıktıları</b>	İki adet makale
<b>Dersin İçeriği</b>	

 <b>İZMİR KÂTİP ÇELEBİ ÜNİVERSİTESİ</b> ISO 9001:2008	<b>T.C.</b> <b>İZMİR KÂTİP ÇELEBİ ÜNİVERSİTESİ</b> <b>Öğrenci İşleri Daire Başkanlığı</b>	 <b>Dok. No: FR/72/07</b>
	<b>DERS TANITIM FORMU</b>	<b>İlk Yayın Tar.: 25.12.2013</b> <b>Rev. No/Tar.: 00/...</b> <b>Sayfa: 2 / 4</b>

<b>Haftalık Detaylı Ders İçeriği</b>	
<b>Hafta</b>	<b>Detaylı İçerik</b>
1	Giriş
2-3	Klasik Doğrusal Regresyon Modeli (KDRM)
4-5	KDRM Varsayımları
6-7	Tek Değişkenli Zaman Zerileri
8	Uzun Dönemli İlişkinin Modellenmesi
9	Oynaklık Modellemesi
10-11	Panel Data
12	Kategorik Bağımlı Değişkenli Regresyonlar
13	Özel Oturum: Makale Yazımı Uygulamaları
	Birinci Ders Çıktısı: Tarama Makalesi
	İkinci Ders Çıktısı: Uygulama Makalesi

 İZMİR KÂTİP ÇELEBİ ÜNİVERSİTESİ  ISO 9001:2008	T.C. <b>İZMİR KÂTİP ÇELEBİ ÜNİVERSİTESİ</b> Öğrenci İşleri Daire Başkanlığı	 Dok. No: FR/72/07
	<b>DERS TANITIM FORMU</b>	İlk Yayın Tar.: 25.12.2013 Rev. No/Tar.: 00/... Sayfa: 3 / 4

Değerlendirme		
Yarıyıl İçi Etkinlikleri	Adet	Değer
Birinci Ders Çıktısı	1	% 50
<b>Toplam</b>		
Yarıyıl Sonu Etkinlikleri	Adet	Değer
İkinci Ders Çıktısı	1	% 50
<b>Toplam</b>		
Yarıyıl İçi Etkinlikleri	1	% 50
Yıl Sonu Etkinlikleri	1	% 50
<b>Toplam</b>		

Öğrenci İş Yüğü			
İşlem adı	Sayısı	Süresi (saat)	Toplam İş Yüğü (Saat)
Derse Katılım	14	3	42
Ara sınav için hazırlık			
Ders Öncesi Hazırlık			
Ders Sonrası Hazırlık			
Ara sınav			
Dönem sonu sınavı için hazırlık			
Dönem sonu sınavı	2	100	200
**			
<b>Toplam İş Yüğü (Saat)</b>			242

 İZMİR KÂTİP ÇELEBİ ÜNİVERSİTESİ ISO 9001:2008	<b>T.C.</b> <b>İZMİR KÂTİP ÇELEBİ ÜNİVERSİTESİ</b> <b>Öğrenci İşleri Daire Başkanlığı</b>	 <b>Dok. No: FR/72/07</b>
	<b>DERS TANITIM FORMU</b>	<b>İlk Yayın Tar.: 25.12.2013</b> <b>Rev. No/Tar.: 00/...</b> <b>Sayfa: 4 / 4</b>

<b>Dersin Kaynağı</b>	
1.	[1] Finansal Ekonometri, Nilgün Çil Yavuz, Der Yayınları , İktisat Dizisi [2] EViews ile Temel Ekonometri, Ebru Çağlayan, Burak Güriş, Selahattin Güriş, Der Yayınları [3] Introductory Econometrics for Finance, Cambridge University Press, 2 <sup>ND</sup> Ed. by Brooks, C. [4] Basic Econometrics, McGraw–Hill, 4 <sup>th</sup> Ed., by Gujarati, D.N. [5] The Econometrics of Financial Markets, Princeton University Press, by Campbell, J.Y., Lo, A.W., and MacKinlay, A.G.
<b>Yardımcı Kaynaklar</b>	
1.	[6] Econometric Analysis, Prentice Hall, 5 <sup>th</sup> Ed., by Green, W.H. [7] Time Series Applications to Finance, Wiley, by Chan, N.H. [8] Econometric Analysis of Panel Data, John Wiley & Sons, 3 <sup>RD</sup> Ed. by Baltagi, B. H. [9] Discrete Choice Methods with Simulations, Cambridge University Press, by Train, K.E. [10] Analysis of Financial Time Series, Wiley, 3 <sup>rd</sup> Ed., by Tsay, R.S. [11] Econometric Theory and Methods, Oxford University Press, by Davidson, R. and MacKinnon, J.G. [12] Financial Econometrics Methods and Models, Routledge, by, Wang, P. [13] Introductory Econometrics A Modern Approach, Cengage Learning, 4 <sup>th</sup> Ed., by Wooldridge, J.M. [14] Evaluating Econometric Forecasts of Economic and Financial Variables, Palgrave, by Clements, M.P.
2.	Detaylı ders içeriğindeki ek kaynaklar ile gerekli görüldüğünde sınıfta duyurulacak kaynaklar
3.	

**\*Dersin İngilizce verilmesi durumunda formdaki tüm bilgiler İngilizce olarak doldurulacaktır.**

**\*\* Ödev, dönem projesi, vb. şekilde hesaplamada kullanılacak tüm veriler açıklanarak doldurulacaktır.**