

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 507	Ekonomi ve Finansta Sayısal Yöntemler	1	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Seçmeli
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	Öğrencilerin kalkülüs becerilerini, finansal iktisat programını için yeterli olacak şekilde geliştirmek.
İçerik	<ul style="list-style-type: none">-Fonksiyonlar-Limit-Süreklilik-Türev-Integral
Kaynaklar	Thomas, Kalkülüs kitabı

Teori Konu Başlıklarısı

Hafta	Konu Başlıklarısı
-------	-------------------

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 513	Kaos ve Finans	2	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Seçmeli
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	<p>Öğrencide Zaman Serileri, Kaos, Risk-Belirsizlik, Davranışsal ekonomi, Finansal piyasalar kavramsal çerçevesini oluşturmak, ve ilişkilerini modelleme metodları açısından değerlendirmek.</p> <p>Ekonominik, Finansal piyasalardaki Stokastik süreçlerin modellemesi, test edilmesi</p> <p>Ekonominik ajanların karar verme süreçleri (davranışsal ekonomi) ile ilişkilendirilmesi</p> <p>Lineer Stokastik süreçlerin Stata 10., Kaotik süreçlerin ise R programı ile analizi. Kestirim ve Öngörü yöntemleri.</p> <p>Bu linkten program akış dosyasını bulabilirsiniz: http://iktisat.gsu.edu.tr/ata-ozkaya/dersler/</p>
İçerik	<p>Verimli Piyasalar Hipotezi analizi-eleştiri,</p> <p>Risk ve Belirsizlik, Zaman,</p> <p>Enformasyon, Bayesian Karar verme süreci ve rasyonellik</p> <p>Davranışsal ekonomi uygulamaları</p> <p>Denge kavramı</p> <p>Zaman serisi analizi,</p> <p>1. Stokastik süreçler Lineer modellemesi</p> <p>Stata 10.0 programı ile uygulama</p> <p>2. Nonlineer modellemesi</p> <p>R programı ile uygulama</p> <p>3. Kaotik süreçler</p> <p>Yüksek ve düşük hacimli piyasalarda (Borsa, Forex, Tahvil i.e.,) Zaman serisi analiz yöntemlerini finansal değişkenlere uygulama.</p>
Kaynaklar	<p>Johansen, S. (1991) Estimation and hypothesis testing of cointegration vectors in gaussian vector autoregressive models. <i>Econometrica</i>, 59, p 1151-1181</p> <p>Johansen, S., Juselius, K. (1991) Testing structural hypotheses in a multivariate cointegration analysis of the PPP and the UIP for UK. <i>Journal of Econometrics</i>, 53, p 211-244</p> <p>Kahneman, D., Slovic, P., Tversky, A. (1982). <i>Judgment Under Uncertainty: Heuristics and Biases</i>. New York: Cambridge University Press.</p> <p>Kantz, H. (1994) A robust method to estimate the maximal Lyapunov exponent of a time series, <i>Physics Letters A</i> 185, 77-87.</p> <p>Kantz, H., Schreiber T.(1997) <i>Nonlinear time series analysis</i>. Cambridge, UK: Cambridge University Press.</p> <p>Karanfil, F., Ozkaya, A. (2007). Estimation of real GDP and unrecorded economy in Turkey based on environmental data. <i>Energy Policy</i> 35 (10), 4902-4908.</p> <p>Grassberger, P., Procaccia, I. (1983a). Characterization of strange attractors. <i>Phy. Rev. Lett.</i>, 50: 346-349</p>

- Grassberger, P., Procaccia, I. (1983b.) Estimation of the Kolmogorov entropy from a chaotic signal. *Phys Rev [A]* 29:2591-3.
- Rosenstein, M.T., Collins, J.J., De Luca, C.J. (1993) A practical method for calculating largest Lyapunov exponents from small data sets, *Physica D* 65, 117-34.
- Sachs, J.D. (1984) Theoretical issues in international borrowing. *Princeton Studies in International Finance*, vol. 54. Department of Economics, Princeton University, Princeton.
- Said, S.E., Dickey, D.A. (1984) Testing for unit roots in autoregressive moving average models of unknown order. *Biometrika*, 71, p 599-608
- Takens, F. (1981) Detecting strange attractors in turbulence. In: *Dynamical systems and turbulence*. Berlin: Springer; p. 366.
- Wolf, A., Swift, J.B., Swinney, H.L., Vastano, J.A. (1985) Determining Lyapunov Exponents from a time series, *Physica D* 16, 285-317.
- World Bank (2000, September). Turkey—Country economic memorandum— Structural reforms for sustainable Growth (Vols. I and II) (Report No.20657TU), Washington, DC.

Teori Konu Başlıklarları

Hafta	Konu Başlıklarları
1	Dinamik ekonomik modellerin sistem teorisi açısından eleştirisi
2	Verimli pazar hipotezi ve sayısal eleştirisi
3	Zaman serisi analizi ve modellemesine giriş ve lineer zaman serileri
4	Lineer olmayan zaman serileri
5	Kaos teorisine metodolojik bir yaklaşım
6	Takens teoremi ve Rekürans grafikleri
7	Avrupa ülkeleri kamu borç faizlerinin faz uzayı yapılandırması ve analizi,
8	Borc faizlerinin öncül politikalara hassas bağlılığı ve Lyapunov katsayısı,
9	BISE - 100 ve FTSE-100 indeksleri maksimal Lyapunov katsayısı hesabı,
10	Belli başlı dünya borsalarının kaotik davranışları
11	Ticarette ve pazarlarda Kaosa neden olabilecek ajan davranışları
12	Ticarette ve pazarlarda Kaosa neden olabilecek ajan davranışları
13	Finansal krizler ve kaos

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 513	Kaos ve Finans	1	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Seçmeli
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	Öğrencide zaman serisi ve kaos mefhumlarını oluşturmak ve finans verileri üzerine tatbiki analizi
İçerik	Yüksek istatistikî ve ekonometrik analiz teorisi ve pratiği
Kaynaklar	<p>Johansen, S. (1991) Estimation and hypothesis testing of cointegration vectors in gaussian vector autoregressive models. <i>Econometrica</i>, 59, p 1151-1181</p> <p>Johansen, S., Juselius, K. (1991) Testing structural hypotheses in a multivariate cointegration analysis of the PPP and the UIP for UK. <i>Journal of Econometrics</i>, 53, p 211-244</p> <p>Kahneman, D., Slovic, P., Tversky, A. (1982). <i>Judgment Under Uncertainty: Heuristics and Biases</i>. New York: Cambridge University Press.</p> <p>Kantz, H. (1994) A robust method to estimate the maximal Lyapunov exponent of a time series, <i>Physics Letters A</i> 185, 77-87.</p> <p>Kantz, H., Schreiber T.(1997) Nonlinear time series analysis. Cambridge, UK: Cambridge University Press.</p> <p>Karanfil, F., Ozkaya, A. (2007). Estimation of real GDP and unrecorded economy in Turkey based on environmental data. <i>Energy Policy</i> 35 (10), 4902-4908.</p> <p>Grassberger, P., Procaccia, I. (1983a). Characterization of strange attractors. <i>Phy. Rev. Let.</i>, 50: 346-349</p>

Grassberger, P., Procaccia, I. (1983b.) Estimation of the Kolmogorov entropy from a chaotic signal. Phys Rev [A] 29:2591-3.

Rosenstein, M.T., Collins, J.J., De Luca, C.J. (1993) A practical method for calculating largest Lyapunov exponents from small data sets, Physica D 65, 117-34.

Sachs, J.D. (1984) Theoretical issues in international borrowing. Princeton Studies in International Finance, vol. 54. Department of Economics, Princeton University, Princeton.

Said, S.E., Dickey, D.A. (1984) Testing for unit roots in autoregressive moving average models of unknown order. Biometrika, 71, p 599-608

Takens, F. (1981) Detecting strange attractors in turbulence. In: Dynamical systems and turbulence. Berlin: Springer; p. 366.

Wolf, A., Swift, J.B., Swinney, H.L., Vastano, J.A. (1985) Determining Lyapunov Exponents from a time series, Physica D 16, 285-317.

World Bank (2000, September). Turkey—Country economic memorandum— Structural reforms for sustainable Growth (Vols. I and II) (Report No.20657TU), Washington, DC.

Teori Konu Başlıkları

Hafta	Konu Başlıkları
-------	-----------------

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 506	Finansal Ekonometri	1	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Zorunlu
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıklarısı

Hafta	Konu Başlıklarısı
--------------	--------------------------

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 509	İstatistik ve Ekonometri	1	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Dersle Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Zorunlu
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıkları

Hafta	Konu Başlıkları

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 505	Açık Ekonomilerde Makro İktisat	2	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Seçmeli
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıklarısı

Hafta	Konu Başlıklarısı

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 514	Finans Piyasalarında Karar Alma	2	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Zorunlu
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıkları

Hafta	Konu Başlıkları

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 516	Uluslararası Finansal Sistemler	1	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Seçmeli
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıklarları

Hafta	Konu Başlıklarları

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 508	Türev Piyasaları	2	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Zorunlu
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıklarısı

Hafta	Konu Başlıklarısı

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 505	Açık Ekonomilerde Makro İktisat	1	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Seçmeli
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıkları

Hafta	Konu Başlıkları
--------------	------------------------

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC503	Finansal Piyasalar	2	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Zorunlu
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıklarları

Hafta	Konu Başlıkları

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 508	Türev Piyasaları	1	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Zorunlu
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıklarları

Hafta	Konu Başlıkları

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 510	Finansal Krizler ve Yönetimi	2	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Seçmeli
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıklarısı

Hafta	Konu Başlıklarısı
--------------	--------------------------

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 507	Ekonomi ve Finansta Sayısal Yöntemler	2	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Seçmeli
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıklarları

Hafta	Konu Başlıkları

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 511	Para ve Finansal Sistem	2	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Seçmeli
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıkları

Hafta	Konu Başlıkları
--------------	------------------------

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 514	Finans Piyasalarında Karar Alma	1	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Zorunlu
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıkları

Hafta	Konu Başlıkları

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 502	Finans Teorisi	2	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Zorunlu
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıkları

Hafta	Konu Başlıkları

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 503	Finansal Piyasalar	1	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Zorunlu
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıklarısı

Hafta	Konu Başlıklarısı

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC501	Mikroekonomi	2	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Dersle Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Zorunlu
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıklarları

Hafta	Konu Başlıkları

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 511	Para ve Finansal Sistem	1	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Seçmeli
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıklarısı

Hafta	Konu Başlıklarısı

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC509	İstatistik ve Ekonometri	2	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Zorunlu
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıkları

Hafta	Konu Başlıkları
--------------	------------------------

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 520	Dönem Projesi	2	0	0	0	0	30

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Tez/Proje
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıklarları

Hafta	Konu Başlıklarları

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 502	Finans Teorisi	1	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Zorunlu
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıklarısı

Hafta	Konu Başlıklarısı
--------------	--------------------------

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 510	Finansal Krizler ve Yönetimi	1	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Seçmeli
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıklarları

Hafta	Konu Başlıkları

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 506	Finansal Ekonometri	2	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Zorunlu
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıklarısı

Hafta	Konu Başlıklarısı
--------------	--------------------------

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 516	Uluslararası Finansal Sistemler	2	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Seçmeli
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıkları

Hafta	Konu Başlıkları
--------------	------------------------

İçerik

Ders Kodu	Dersin Adı	Yarıyıl	Teori	Uygulama	Lab	Kredisi	AKTS
EC 501	Mikroekonomi	1	3	0	0	3	6

Ön Koşul	
Derse Kabul Koşulları	

Dersin Dili	Türkçe
Türü	Zorunlu
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	
İçerik	
Kaynaklar	

Teori Konu Başlıklarları

Hafta	Konu Başlıklarları

