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	Seçmeli
Dersin Düzeyi	Yüksek Lisans
Dersin Amacı	Ekonometrik yöntemlerin finansal alanda uygulanması ve finansal modellemeler yapmak.
İçerik	Doğrusal Ekonometrik Modeller Zaman serileri analizi Yapısal kırılma ARCH-GARCH modelleri
Kaynaklar	Ders materyalleri Wooldridge, "Introduction to econometrics".

Teori Konu Başlıkları

Hafta	Konu Başlıkları
1	Finansal Ekonometri: Kapsamı ve Araçları
2	OLS Yöntemi ile Regresyon: Teori + Uygulama
3	Ekonometrik Analiz: İstatistiki Anlamlılık Testleri & Gauss Markov Teoremi
4	Ekonometrik Analiz: Yapısal Varsayım Testleri - I
5	Ekonometrik Analiz: Yapısal Varsayım Testleri - II
6	Ekonometrik Analiz: Uygulama
7	Zaman Serileri Analizi - II
8	Zaman Serileri Analizi - II
9	Zaman Serileri Analizi - III: Uygulama
10	Yapısal Kırılma - I
11	Yapısal Kırılma - II: Uygulama
12	Proje Sunumları
13	ARCH-GARCH Modelleri
14	ARCH-GARCH Modelleri: Uygulama