

## 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  | Ekonometrik yöntemlerin finansal alanda uygulanması ve finansal modellemeler yapmak.               |
| İçerik        | Doğrusal Ekonometrik Modeller<br>Zaman serileri analizi<br>Yapısal kırılma<br>ARCH-GARCH modelleri |
| Kaynaklar     | 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                                             |