

| 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                                                        |         |       |          |     |         |      |
|                       | Zaman serileri analizi                                                               |         |       |          |     |         |      |
|                       | Yapısal kırılma                                                                      |         |       |          |     |         |      |
|                       | 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: İstatistikî 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                                             |