

## İçerik

| Ders Kodu | Dersin Adı                       | Yarıyıl | Teori | Uygulama | Lab | Kredisi | AKTS |
|-----------|----------------------------------|---------|-------|----------|-----|---------|------|
| ECON419   | Finansal Ekonometri ve Modelleme | 7       | 3     | 0        | 0   | 3       | 6    |

|                       |  |
|-----------------------|--|
| Ön Koşul              |  |
| Derse Kabul Koşulları |  |

|               |  |
|---------------|--|
| Dersin Dili   | Fransızca  |
| Türü          | Seçmeli  |
| Dersin Düzeyi | Lisans   |
| Dersin Amacı  | Finansal sistemlerin dinamik işleyişinin modellenmesi<br>Finansal piyasalardaki fiyat süreçlerinin analiz edilmesi<br>Bunun için gerekli dinamik analiz metodlarının öğretilmesi   |
| İçerik        | Önermeler mantığı<br>Boyut, uzay<br>Information vs Bilgi<br>Risk vs Belirsizlik<br>Sistem teorisi<br>Geri beslemeli sistemler<br>Fiyat oluşumu ve rassal süreçler<br>Lineer vs non-lineer süreçler<br>VAR modeli,<br>Sistem çıktıları Kestirim |
| Kaynaklar     | J.D. Hamilton "Time Series Analysis" Princeton 1994<br>F. Hayashi " Econometrics" Princeton, 2001<br>Kantz&Schreiber 2001 "Nonlinear Time Series Analysis"   |

## Teori Konu Başlıkları

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