

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: İstatistiksel 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 - I |
| 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 |