

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

Teori Konu Başlıkları

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