



İleri Düzey Finansal Zaman Serisi Analizleri Eğitimi

07
ŞUBAT
2020

09
ŞUBAT
2020

Eğitim Yeri: Burdur Gelişim Merkezi

Toplam 24 saat Kurs Ücreti 450 TL

Üniversitemiz öğrencilerine %15 indirim uygulanacaktır.

Eğitim İçeriği

1. Finansal Zaman Serilerinde Volatilite Modelleri
2. Farklı Hata Dağılım Varsayımları Altında GARCH Tahminleri
3. Finansal Verilerin Fraktallığı ve Uzun Hafıza Testleri (GPH, R/S, GSP, Modified GPH)
(Autoregressive Fractionally Integrated Moving Average- ARFIMA)
(Fractionally Integrated GARCH-FIGARCH, FIEGARCH, FIAPARCH, HYGARCH)
4. Yapısal Kırımların ve Rejim Değişikliklerinin Oynaklığa Etkisi
5. Zamana Bağlı Değişen Beta Tahmininde Çok Değişkenli GARCH Modelleri (DCC-GARCH, BEKK GARCH, DECO-GARCH)
6. Finansal Piyasalar Arasında Volatilite Yayılımları