Finansal Ekonometri II Final Soruları

1. Finansal Verilerin özellikleri nelerdir? (5 puan)
2. En Küçük Kareler Yöntemine ait varsayımlar nelerdir? İhlalleri hangi sorunlara yol açar?Her bir ihlal sonucunda Parametre tahmincilerine ait hangi özellikler bozulur? (5 puan)
3. Durağanlık nedir? Neden Önemlidir? (5 puan)
4. Durağanlık varsayımı ihlal edilirse hangi sorunla karşılaşılır? Bu sorunun Parametre tahmincilerine etkisi nasıl olur? (5 puan)
5. Korelasyon,Otokorelasyon ve kovaryans arasındaki farkları birer örnek ile açıklayınız. (5 puan)
6. Correlogram ne işe yarar. (5 puan)
7. Farklı derecelerde durağan olan serilerin regresyon analizi hangi yöntemle yapılmalıdır. (5 puan)

Araştırmacı elinde tuttuğu Ford hissesenedinin beklenen getirisinin S&P verilerinden nasıl etkilendiğini merak etmektedir. Bu durumda aşağıdaki regresyonu tahmin etmek istemektedir. (getiri hesaplamsını seri için sizin yapmanız gerekmektedir.) (Ocak 2002-Nisan 2013)

1. Değişkenlere ait tanımlayıcı istatistikleri bularak yorumlayınız. (5 puan)
2. Getiri Serileri Normal dağılıma sahipler mi? (5 puan)
3. Bilgi kriteri testlerini kullanarak Gecikme değerlerini bulunuz.(max lag 12) (5 puan)
4. Bulduğunuz gecikme değerlerini kullanarak Birim kök testlerini her bir getiri değişkeni için yapınız. İlgili hipotezleri kurunuz. (10 puan)
5. Modeli tahmin ederek, Tahmini modeli raporlayınız. (5 puan)
6. Modelde tahmin edilen parametre katsayılarının tek başına anlamlı olup olmadığını %5 anlamlılık düzeyinde hipotezleri kurarak ve ilgili dağılım grafiğini çizerek test ediniz. (10 puan)
7. Modelin parametre tahmincileri bir bütün olarak %5 anlamlılık düzeyinde anlamlı mıdır hipotezleri kurarak ve ilgili dağılım grafiğini çizerek test ediniz. (5 puan)
8. Parametre tahmincilerini elde ettiğiniz bulgulara göre yorumlayınız. (10 puan)
9. Tahmini değer, gerçek değer ve hata terimine ait grafiği çiziniz. (10 puan)