

Uygulamalı Ekonometri I

İsteğe bağlı Ödev

Excel dosyasının ikinci sekmesinde aşağıdaki şirketlerin 03.01.2018 ile 01.12.2019 tarihleri arasındaki fiyat ve getiri oranları (r_aaa) yer almaktadır.

1. Şirketlerin BETA değerlerini hesaplayıp, sınıflandırıp, sıralayınız. Sadece Orijinden geçen regresyon modeli uygulayınız.
2. BİST 100 endeksinin %10 artması ve azalması durumunda hisse senetlerinin muhtemel kazanç ve kayıplarını hesaplayınız.
3. Veri seti 2018 ve 2019 olarak ikiye ayrılması durumunda şirketlerin BETA larının değişimlerini yorumlayınız.

Ödev STATA çıktıları, sınıflandırmaları ve sıralamaları gösterecek şekilde Word dosyasına yapıp, elden teslim edilecektir. Son teslim tarihi 12/12/2019 Saat 17:30

Ödevin puan karşılığı teslim eden sayısı ve doğru cevaplayan sayısına göre farklılık gösterecektir.

PETKM,GSRAY,FENER,SISE,BJKAS

TTKOM,VAKBN,ARCLK,KCHOL,THYAO

Başarılar

Koray Yapa