

## ΠΕΡΙΓΡΑΜΜΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ

### (1) ΓΕΝΙΚΑ

<b>ΣΧΟΛΗ</b>	Σχολή Χρηματοοικονομικής και Στατιστικής		
<b>ΤΜΗΜΑ</b>	Τμήμα Χρηματοοικονομικής και Τραπεζικής Διοικητικής		
<b>ΕΠΙΠΕΔΟ ΣΠΟΥΔΩΝ</b>	Προπτυχιακό επίπεδο σπουδών		
<b>ΚΩΔΙΚΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ</b>	<b>ΧΡΕΦΟ01</b>	<b>ΕΞΑΜΗΝΟ ΣΠΟΥΔΩΝ</b>	<b>5 ή 7</b>
<b>ΤΙΤΛΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ</b>	Εφαρμοσμένη Οικονομετρία		
<b>ΑΥΤΟΤΕΛΕΙΣ ΔΙΔΑΚΤΙΚΕΣ ΔΡΑΣΤΗΡΙΟΤΗΤΕΣ</b>			
<i>σε περίπτωση που οι πιστωτικές μονάδες απονέμονται σε διακριτά μέρη του μαθήματος π.χ. Διαλέξεις, Εργαστηριακές Ασκήσεις κ.λπ. Αν οι πιστωτικές μονάδες απονέμονται ενιαία για το σύνολο του μαθήματος αναγράψτε τις εβδομαδιαίες ώρες διδασκαλίας και το σύνολο των πιστωτικών μονάδων</i>		<b>ΕΒΔΟΜΑΔΙΑΙΕΣ ΩΡΕΣ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ</b>	<b>ΠΙΣΤΩΤΙΚΕΣ ΜΟΝΑΔΕΣ</b>
Διαλέξεις		4	7.5
<i>Προσθέστε σειρές αν χρειαστεί. Η οργάνωση διδασκαλίας και οι διδακτικές μέθοδοι που χρησιμοποιούνται περιγράφονται αναλυτικά στο (δ).</i>			
<b>ΤΥΠΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ</b> <i>γενικού υποβάθρου, ειδικού υποβάθρου, ειδίκευσης, γενικών γνώσεων, ανάπτυξης δεξιοτήτων</i>	Ειδικού υποβάθρου		
<b>ΠΡΟΑΠΑΙΤΟΥΜΕΝΑ ΜΑΘΗΜΑΤΑ:</b>	Δεν έχει		
<b>ΓΛΩΣΣΑ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ και ΕΞΕΤΑΣΕΩΝ:</b>	ελληνική		
<b>ΤΟ ΜΑΘΗΜΑ ΠΡΟΣΦΕΡΕΤΑΙ ΣΕ ΦΟΙΤΗΤΕΣ ERASMUS</b>	Ναι		
<b>ΗΛΕΚΤΡΟΝΙΚΗ ΣΕΛΙΔΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ (URL)</b>			

### (2) ΜΑΘΗΣΙΑΚΑ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΑ

<p><b>Μαθησιακά Αποτελέσματα</b>  <i>Περιγράφονται τα μαθησιακά αποτελέσματα του μαθήματος οι συγκεκριμένες γνώσεις, δεξιότητες και ικανότητες καταλλήλου επιπέδου που θα αποκτήσουν οι φοιτητές μετά την επιτυχή ολοκλήρωση του μαθήματος.</i></p> <p><i>Συμβουλευτείτε το Παράρτημα Α</i></p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Περιγραφή του Επιπέδου των Μαθησιακών Αποτελεσμάτων για κάθε ένα κύκλο σπουδών σύμφωνα με το Πλαίσιο Προσόντων του Ευρωπαϊκού Χώρου Ανώτατης Εκπαίδευσης</li> <li>• Περιγραφικοί Δείκτες Επιπέδων 6, 7 &amp; 8 του Ευρωπαϊκού Πλαισίου Προσόντων Διά Βίου Μάθησης και το Παράρτημα Β</li> <li>• Περιληπτικός Οδηγός συγγραφής Μαθησιακών Αποτελεσμάτων</li> </ul>
<ul style="list-style-type: none"> <li>• Στόχος του μαθήματος είναι να βοηθήσει τον φοιτητή να κατανοήσει πως πραγματοποιείται ο σωστός προσδιορισμός και εκτίμηση ενός οικονομετρικού μοντέλου για παραγωγή προβλέψεων των υπό μελέτη οικονομικών μεταβλητών, την λήψη βέλτιστων αποφάσεων ή και την άσκηση οικονομικής πολιτικής.</li> <li>• Ο σκοπός είναι να παρουσιαστεί πως η εφαρμοσμένη οικονομετρική ανάλυση των δεδομένων μπορεί να συνδυαστεί με την οικονομική θεωρία ώστε να βελτιστοποιηθεί η επεξηγηματική ισχύς διάφορων οικονομικών μοντέλων.</li> <li>• Οι φοιτητές θα εξοικειωθούν μέσω πολλών παραδειγμάτων και εμπειρικών εφαρμογών με την χρήση οικονομετρικών μεθόδων για να ελέγξουν αν ισχύουν συγκεκριμένες οικονομικές θεωρίες αλλά και υποθέσεις, με σκοπό την τροποποίηση</li> </ul>

των οικονομικών θεωρητικών υποδειγμάτων έτσι ώστε να είναι συνεπή με τα οικονομικά δεδομένα.

- Οι φοιτητές θα εξοικειωθούν με την γλώσσα προγραμματισμού R.
- Οι διαλέξεις εστιάζουν στην εφαρμογή ελέγχων σωστού προσδιορισμού του μοντέλου παλινδρόμησης, έτσι ώστε να είμαστε περισσότερο σίγουροι για την ακρίβεια των εκτιμημένων συντελεστών του μοντέλου και την αξιοπιστία της στατιστικής επαγωγής.
- Οι φοιτητές θα μάθουν πως να εκτιμούν γραμμικά μοντέλα παλινδρόμησης λαμβάνοντας υπόψιν την ενδογένεια.
- Θα μάθουν πως να προσδιορίζουν, και να εκτιμούν υποδείγματα panel data.

### **Γενικές Ικανότητες**

*Λαμβάνοντας υπόψη τις γενικές ικανότητες που πρέπει να έχει αποκτήσει ο πτυχιούχος (όπως αυτές αναγράφονται στο Παράρτημα Διπλώματος και παρατίθενται ακολούθως) σε ποια / ποιες από αυτές αποσκοπεί το μάθημα;*

*Αναζήτηση, ανάλυση και σύνθεση δεδομένων και πληροφοριών, με τη χρήση και των απαραίτητων τεχνολογιών*

*Προσαρμογή σε νέες καταστάσεις*

*Λήψη αποφάσεων*

*Αυτόνομη εργασία*

*Ομαδική εργασία*

*Εργασία σε διεθνές περιβάλλον*

*Εργασία σε διεπιστημονικό περιβάλλον*

*Παράγωγή νέων ερευνητικών ιδεών*

*Σχεδιασμός και διαχείριση έργων*

*Σεβασμός στη διαφορετικότητα και στην πολυπολιτισμικότητα*

*Σεβασμός στο φυσικό περιβάλλον*

*Επίδειξη κοινωνικής, επαγγελματικής και ηθικής υπευθυνότητας*

*και ευαισθησίας σε θέματα φύλου*

*Άσκηση κριτικής και αυτοκριτικής*

*Προαγωγή της ελεύθερης, δημιουργικής και επαγωγικής σκέψης*

*.....*

*Άλλες...*

*.....*

- Αναζήτηση, ανάλυση και σύνθεση δεδομένων και πληροφοριών, με τη χρήση και των απαραίτητων τεχνολογιών
- Λήψη αποφάσεων
- Αυτόνομη εργασία
- Εργασία σε διεθνές περιβάλλον

### **(3) ΠΕΡΙΕΧΟΜΕΝΟ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ**

- Το κλασικό μοντέλο παλινδρόμησης: Γίνεται εισαγωγή στο κλασικό γραμμικό μοντέλο πολλαπλής παλινδρόμησης. Συγκεκριμένα παρουσιάζονται η μορφή του, τα συστατικά του στοιχεία, η ερμηνεία του, οι βασικές υποθέσεις στις οποίες στηρίζεται, ενώ αναλύεται η εκτίμηση του μοντέλου με την χρήση της μεθόδου των ελαχίστων τετραγώνων.
- Συλλογή, διαχείριση και εισαγωγή δεδομένων για την εκτίμηση ενός οικονομετρικού υποδείγματος.

- Στατιστικοί έλεγχοι υποθέσεων εκτιμημένων συντελεστών ενός μοντέλου παλινδρόμησης: έλεγχος t, έλεγχος F.
- Πολυσυγγραμικότητα: πως ελέγχουμε για πολυσυγγραμικότητα και πως αντιμετωπίζουμε τέτοιου είδους προβλήματα.
- Έλεγχος για αυτοσυσχέτιση και πως επιλύουμε τέτοιου είδους θέματα.
- Ετεροσκεδαστικότητα: πως ελέγχουμε αν στα κατάλοιπα ενός μοντέλου παλινδρόμησης υπάρχει ετεροσκεδαστικότητα και προτείνονται τρόποι αντιμετώπισης.
- Μέθοδοι επιλογής μεταβλητών σε μοντέλα παλινδρόμησης: θα δείξουμε πως από ένα σύνολο μεταβλητών επιλέγουμε ένα μικρό υποσύνολο με σκοπό να κατασκευάσουμε ένα μοντέλο παλινδρόμησης με καλή προβλεπτική ικανότητα για την μεταβλητή ενδιαφέροντος.
- Σταθερότητα εκτιμημένων συντελεστών ενός οικονομετρικού υποδείγματος: έλεγχοι για να διαπιστωθεί αν οι εκτιμημένοι συντελεστές είναι σταθεροί και τρόποι αντιμετώπισης όταν παρουσιάζονται προβλήματα αστάθειας.
- Ενδογένεια και βοηθητικές μεταβλητές: γίνεται εισαγωγή στο τι είναι ενδογένεια, πως αντιμετωπίζεται αυτό το πρόβλημα με την χρήση της μεθόδου της εκτίμησης ελαχίστων τετραγώνων δύο σταδίων.
- Panel Data models: θα δούμε πως προσδιορίζουμε και εκτιμούμε οικονομετρικά μοντέλα χρησιμοποιώντας δεδομένα που ανήκουν σε περισσότερες από δύο διαστάσεις, όπως ο χρόνος και οι μεμονωμένες μονάδες (εταιρίες, χώρες κλπ). Θα εξεταστούν διαφορετικά είδη ανάλυσης panel data (pooled regression, first-difference, fixed effects, random effects, common correlated effects).

#### (4) ΔΙΔΑΚΤΙΚΕΣ και ΜΑΘΗΣΙΑΚΕΣ ΜΕΘΟΔΟΙ - ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗ

<b>ΤΡΟΠΟΣ ΠΑΡΑΔΟΣΗΣ</b> <i>Πρόσωπο με πρόσωπο, Εξ αποστάσεως εκπαίδευση κ.λπ.</i>	Πρόσωπο με πρόσωπο		
<b>ΧΡΗΣΗ ΤΕΧΝΟΛΟΓΙΩΝ ΠΛΗΡΟΦΟΡΙΑΣ ΚΑΙ ΕΠΙΚΟΙΝΩΝΙΩΝ</b> <i>Χρήση Τ.Π.Ε. στη Διδασκαλία, στην Εργαστηριακή Εκπαίδευση, στην Επικοινωνία με τους φοιτητές</i>	Εργαστηριακή Εκπαίδευση		
<b>ΟΡΓΑΝΩΣΗ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ</b> <i>Περιγράφονται αναλυτικά ο τρόπος και μέθοδοι διδασκαλίας. Διαλέξεις, Σεμινάρια, Εργαστηριακή Άσκηση, Άσκηση Πεδίου, Μελέτη &amp; ανάλυση βιβλιογραφίας, Φροντιστήριο, Πρακτική (Τοποθέτηση), Κλινική Άσκηση, Καλλιτεχνικό Εργαστήριο, Διαδραστική διδασκαλία, Εκπαιδευτικές επισκέψεις, Εκπόνηση μελέτης (project), Συγγραφή εργασίας / εργασιών, Καλλιτεχνική δημιουργία, κ.λπ.  Αναγράφονται οι ώρες μελέτης του φοιτητή για κάθε μαθησιακή δραστηριότητα καθώς και οι ώρες μη καθοδηγούμενης μελέτης σύμφωνα με τις αρχές του ECTS</i>	<b>Δραστηριότητα</b>	<b>Φόρτος Εργασίας Εξαμήνου</b>	
	Διαλέξεις	30	
	Εργαστηριακή Άσκηση	22	
	Μελέτη & ανάλυση βιβλιογραφίας	73	
	<b>Σύνολο Μαθήματος</b>	<b>1 ECTS</b>	
<b>ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗ ΦΟΙΤΗΤΩΝ</b> <i>Περιγραφή της διαδικασίας αξιολόγησης  Γλώσσα Αξιολόγησης, Μέθοδοι αξιολόγησης, Διαμορφωτική ή Συμπερασματική, Δοκιμασία Πολλαπλής Επιλογής, Ερωτήσεις Σύντομης Απάντησης, Ερωτήσεις Ανάπτυξης Δοκιμίων, Επίλυση Προβλημάτων, Γραπτή Εργασία, Έκθεση / Αναφορά, Προφορική Εξέταση, Δημόσια Παρουσίαση, Εργαστηριακή Εργασία, Κλινική Εξέταση Ασθενούς, Καλλιτεχνική Ερμηνεία, Άλλη / Άλλες  Αναφέρονται ρητά προσδιορισμένα κριτήρια αξιολόγησης και εάν και που είναι προσβάσιμα από τους φοιτητές.</i>	Η αξιολόγηση των φοιτητών θα γίνει μέσω γραπτής εξέτασης που θα περιλαμβάνει ερωτήσεις σύντομης απάντησης, εργαστηριακή εργασία και επίλυση προβλημάτων.		

#### (5) ΣΥΝΙΣΤΩΜΕΝΗ-ΒΙΒΛΙΟΓΡΑΦΙΑ

- Προτεινόμενη Βιβλιογραφία:

Ηλίας Τζαβαλής, 2008. Οικονομετρία. Εκδόσεις ΟΠΑ.

Jack Johnston, John Dinardo. Οικονομετρικές μέθοδοι. Εκδόσεις Κλειδάριθμος.

James D. Hamilton. Time Series Analysis. Princeton University Press.