

ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΗ ΟΙΚΟΝΟΜΕΤΡΙΑ

Εξεταστέα ύλη

Η εξέταση του μαθήματος θα βασιστεί στις παραδόσεις του διδάσκοντα και το προτεινόμενο σύγγραμμα διδασκαλίας. Συγκεκριμένα, η εξεταστέα ύλη για τις περιόδους Ιανουαρίου και Σεπτεμβρίου διαμορφώνεται ως εξής:

- Βασικά θέματα οικονομετρίας (εκτίμηση συντελεστών, στατιστικοί έλεγχοι σημαντικότητας t & F , παθογένειες μοντέλου παλινδρόμησης)
- Βασικά θέματα στην ανάλυση χρονολογικών σειρών (δεσμευμένη μέση τιμή δεσμευμένη διακύμανση, πρόβλεψη στις δύο ροπές, διαδικασίες τυχαίου περιπάτου και λευκού θορύβου - βασικές ιδιότητες)
- Αυτοπαλίνδρομα υποδείγματα AR (διαγράμματα αυτοσυσχετίσεων, βραχυπρόθεσμες και μακροπρόθεσμες προβλέψεις)
- Μοναδιαία ρίζα (εντοπισμός μοναδιαίας ρίζας με πρακτικές μεθόδους και στατιστικούς ελέγχους DF , ADF , PP)
- Μοντέλα μεταβλητότητας $ARCH$ (εκτίμηση συντελεστών, προβλέψεις, ασυμμετρίες στη δυναμική της μεταβλητότητας)

Από το βιβλίο του Γεώργιου Χρήστου ιδιαίτερη έμφαση πρέπει να δοθεί στα κεφάλαια 3, 7, 8, 14 (χωρίς τις ενότητες 2 και 3.5), 19, 20 και 23 (χωρίς τις ενότητες 4 και 5).

Κατά την εξέταση επιτρέπονται σημειώσεις, βιβλία και Η/Υ. Απαγορεύεται η χρήση κινητού τηλεφώνου και Internet