



ΑΡΙΣΤΟΤΕΛΕΙΟ ΠΑΝΕΠΙΣΤΗΜΙΟ ΘΕΣΣΑΛΟΝΙΚΗΣ
ΣΧΟΛΗ ΟΙΚΟΝΟΜΙΚΩΝ ΚΑΙ ΠΟΛΙΤΙΚΩΝ ΕΠΙΣΤΗΜΩΝ
ΤΜΗΜΑ ΟΙΚΟΝΟΜΙΚΩΝ ΕΠΙΣΤΗΜΩΝ

ΜΑΘΗΜΑ: ΟΙΚΟΝΟΜΕΤΡΙΑ Ι
ΔΙΔΑΣΚΩΝ ΚΑΘΗΓΗΤΗΣ: ΚΩΝΣΤΑΝΤΙΝΟΣ ΚΑΤΡΑΚΥΛΙΔΗΣ
<http://users.auth.gr/katrak/>

ΠΕΡΙΓΡΑΜΜΑ ΕΡΓΑΣΙΑΣ ΣΤΗΝ ΟΙΚΟΝΟΜΕΤΡΙΑ Ι

Η εργασία στην Οικονομετρία Ι, λαμβάνοντας κυρίως υπόψη τα όσα έχουν αναφερθεί στις θεωρητικές παραδόσεις του μαθήματος αλλά και στα σχετικά εργαστηριακά μαθήματα, ενδείκνυται να περιλαμβάνει τις ακόλουθες ενότητες:

1. Εισαγωγή

2. Το υπόδειγμα

2.1 Θεωρητική θεμελίωση

2.2 Σχετικές απόψεις

2.3 Εξειδίκευση του υποδείγματος

Η εξειδίκευση του υποδείγματος αναφέρεται στον **καθορισμό των μεταβλητών** που θα περιληφθούν στο υπόδειγμα και ειδικότερα στον καθορισμό της εξαρτημένης και των ερμηνευτικών μεταβλητών του υποδείγματος, καθώς και στη **μαθηματική διατύπωση του υποδείγματος**.

Επιπρόσθετα, στο σημείο αυτό ενδείκνυται να γίνει αναφορά στα **αναμενόμενα πρόσημα** καθώς και στα **πιθανά όρια των συντελεστών με βάση την ανάλογη οικονομική θεωρία**.

3. Εμπειρική ανάλυση

3.1 Δεδομένα

3.2 Γραφικές παραστάσεις των μεταβλητών

3.3 Εκτίμηση του υποδείγματος

- Εκτιμητές των συντελεστών,
- τυπικές αποκλίσεις των εκτιμητών,
- τυπική απόκλιση της εκτίμησης,
- πηγές μεταβλητικότητας στην παλινδρόμηση (SSR, SST, SSE),
- εκτίμηση της μέσης **ελαστικότητας** της εξαρτημένης μεταβλητής ως προς τις ερμηνευτικές μεταβλητές,
- **συντελεστής προσδιορισμού** και **διορθωμένος συντελεστής προσδιορισμού**, καθώς και
- ορισμένα διαγράμματα που σχετίζονται με την εκτίμηση, όπως **διάγραμμα πραγματικών και εκτιμημένων τιμών της εξαρτημένης μεταβλητής, διάγραμμα καταλοίπων**, κ.λπ.

Στο σημείο αυτό θα πρέπει επίσης να γίνει αναφορά αν τα πρόσημα και τα όρια των συντελεστών είναι **σύμφωνα** με την οικονομική θεωρία.

3.4 Έλεγχοι σημαντικότητας των συντελεστών του υποδείγματος

3.4.1 Έλεγχοι με τη στατιστική t

3.4.2 Έλεγχοι με τη στατιστική F

- 3.5 Έλεγχος για την ύπαρξη αυτοσυσχέτισης α' βαθμού
- 3.6 Έλεγχος καταλληλότητας του υποδείγματος για προβλέψεις
- 3.7 Έλεγχος γραμμικών περιορισμών για τους συντελεστές του υποδείγματος
- 3.8 Ορισμένοι εξειδικευμένοι έλεγχοι
 - 3.8.1 Έλεγχος ευστάθειας των συντελεστών του υποδείγματος
(Έλεγχος του Chow, έλεγχοι CUSUM-CUSUMSQ)
 - 3.8.2 Έλεγχος κανονικότητας των καταλοίπων
(Έλεγχος Jarque-Bera)
 - 3.8.3 Έλεγχος σφαλμάτων εξειδίκευσης
(Έλεγχος RESET του Ramsey)

4. Συμπεράσματα

Στα συμπεράσματα, μετά από μια σύντομη ανασκόπηση της εργασίας, θα πρέπει να γίνει **ερμηνεία των αποτελεσμάτων και σύνδεσή τους με την ανάλογη οικονομική θεωρία.**

5. Βιβλιογραφία