

Διδάσκων: Κ. Κατρακυλίδης

Ιανουάριος 2014

ΕΞΕΤΑΣΤΕΑ ΥΛΗ ΤΟΥ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ ΟΙΚΟΝΟΜΕΤΡΙΑ II

Για τις εξετάσεις θα πρέπει να διαβαστούν οι ακόλουθες ενότητες:

- Εξειδικευμένα κριτήρια και έλεγχοι
 - Κριτήρια για τον έλεγχο γραμμικών περιορισμών και τον έλεγχο της στατιστικής σημαντικότητας των συντελεστών (LR, Wald, LM)
 - Κριτήρια για τον έλεγχο της ευστάθειας των συντελεστών ενός υποδείγματος (CUSUM, CUSUMSQ)
 - Έλεγχοι σφαλμάτων εξειδίκευσης (ο έλεγχος RESET του Ramsey, έλεγχος γραμμικότητας)
 - Κριτήρια επιλογής ενός υποδείγματος (Akaike, Amemiya, Schwarz)
 - Άλλα κριτήρια (Jarque-Bera)
- Επιδράσεις ARCH
- Εναλλακτικές μέθοδοι εκτίμησης (η μέθοδος μέγιστης πιθανότητας ή πιθανοφάνειας (ML), η γενικευμένη μέθοδος ελαχίστων τετραγώνων (GLS), η μέθοδος ελαχίστων τετραγώνων με περιορισμούς (RLS))
- Μη γραμμικά υποδείγματα (συνάρτηση παραγωγής Cobb-Douglas)
- Η μέθοδος των βοηθητικών μεταβλητών
- Υποδείγματα κατανεμημένων χρονικών υστερήσεων
- Υποδείγματα φαινομενικά μη συνδεδεμένων παλινδρομήσεων - Η μέθοδος εκτίμησης SUR
- Συστήματα αλληλεξαρτημένων στοχαστικών εξισώσεων (η έννοια της αλληλεξάρτησης, διαρθρωτική και ανηγμένη μορφή, ταυτοποίηση συστημάτων, μέθοδος ελαχίστων τετραγώνων σε δυο, δυναμικά συστήματα 1^{ου} βαθμού, κ.λπ.)
- Θέματα από την ανάλυση χρονολογικών σειρών (πλασματική παλινδρόμηση, ολοκληρωμένες σειρές, έλεγχοι στασιμότητας, συνολοκλήρωση, έλεγχοι συνολοκλήρωσης, υποδείγματα διόρθωσης λαθών, αιτιότητα κατά Granger, υποδείγματα VAR και ECVAR)

Οι ανωτέρω ενότητες μπορούν να διαβαστούν από το βιβλίο του καθηγητή **A. Κάτου:**

"ΟΙΚΟΝΟΜΕΤΡΙΑ-ΘΕΩΡΙΑ ΚΑΙ ΕΦΑΡΜΟΓΕΣ" (Έκδοση 2004)

• **ΚΕΦΑΛΑΙΟ 5: Ειδικές περιπτώσεις και επεκτάσεις στην παλινδρόμηση**

Να διαβαστούν τα τμήματα 5.4.1, 5.4.2, 5.4.3, 5.4.4, 5.5, 5.6.1, 5.6.2, 5.6.3 (γ1, γ2)

• **ΚΕΦΑΛΑΙΟ 6: Παραβίαση βασικών υποθέσεων: Η μη σφαιρικότητα των σφαλμάτων**

Να διαβαστούν τα τμήματα 6.1, 6.2, 6.7 (μόνον οι ενότητες (α), (β), και (δ)), 6.8

(συνέχεια στην επόμενη σελίδα...)

(...συνέχεια της εξεταστέας ύλης στο μάθημα: “Οικονομετρία II”)

- **ΚΕΦΑΛΑΙΟ 7: Παραβίαση των βασικών υποθέσεων: Προβλήματα του δείγματος**

Να διαβαστούν τα τμήματα 7.3.3 (β), 7.5, 7.5.5 (όχι τα γ3 και γ4)

- **ΚΕΦΑΛΑΙΟ 9: Υποδείγματα κατανομής χρονικών υστερήσεων**

Να διαβαστούν τα τμήματα 9.1, 9.2, 9.4.2, 9.5, 9.5.1, 9.6, 9.6.1, 9.6.2, 9.7.2 (μόνον την ενότητα (β), με τις υποενότητες (β.1) και (β.2))

- **ΚΕΦΑΛΑΙΟ 10: Υποδείγματα συστημάτων εξισώσεων**

Να διαβαστούν τα τμήματα 10.1, 10.2, 10.3, 10.4, 10.5, 10.5.1, 10.5.2, 10.6.1 (μόνον την ενότητα (δ)), 10.6.2 (μόνον την ενότητα (α)), 10.7, 10.7.1, 10.7.2, 10.7.3, 10.7.4 (μόνον την ενότητα (α)), 10.10, 10.10.1

- **ΚΕΦΑΛΑΙΟ 11: Ανάλυση χρονολογικών σειρών**

Να διαβαστούν τα τμήματα 11.1, 11.2, 11.4, 11.4.1, 11.4.2, 11.4.6 (μόνον την ενότητα (ζ)), 11.5, 11.5.1, 11.5.2 (μόνον η ενότητα (α)), 11.5.3, 11.6, 11.6.1, 11.6.2, 11.6.3, 11.7, 11.7.1 (εκτός από τις ενότητες (α) και (β)), 11.7.4 (μόνον η ενότητα (α))

Εναλλακτικά, μπορεί να χρησιμοποιηθεί το βιβλίο των **D. Gujarati & D. Porter**:

“ΟΙΚΟΝΟΜΕΤΡΙΑ, Αρχές και Εφαρμογές” (5^η Έκδοση)

Εκδόσεις Τζιόλα (Θεσσαλονίκη 2013)

- **ΚΕΦΑΛΑΙΟ 4: Κλασικό γραμμικό υπόδειγμα παλινδρόμησης (CNLRM)**

Από το κεφάλαιο αυτό μόνο το τμήμα 4.4

- **ΚΕΦΑΛΑΙΟ 7: Ανάλυση πολλαπλής παλινδρόμησης: Το πρόβλημα της εκτίμησης**

Από το κεφάλαιο αυτό να διαβαστούν τα τμήματα 7.9 και 7.10

- **ΚΕΦΑΛΑΙΟ 8: Ανάλυση πολλαπλής παλινδρόμησης: Το πρόβλημα της επαγωγής**

Από το κεφάλαιο αυτό να διαβαστεί το τμήμα 8.9

- **ΚΕΦΑΛΑΙΟ 12: Αυτοσυσχέτιση: Τι συμβαίνει εάν οι όροι σφάλματος συσχετίζονται**

Από το κεφάλαιο αυτό να διαβαστεί το τμήμα 12.9

- **ΚΕΦΑΛΑΙΟ 13: Οικονομετρική υποδειματοποίηση: Εξειδίκευση υποδείγματος και διαγνωστικοί έλεγχοι**

Από το κεφάλαιο αυτό να διαβαστούν τα τμήματα: 13.1, 13.2, 13.3, 13.4, 13.9

- **ΚΕΦΑΛΑΙΟ 14: Μη γραμμικά υποδείγματα παλινδρόμησης**

Από το κεφάλαιο αυτό να διαβαστούν τα τμήματα: 14.1 και 14.2

- **ΚΕΦΑΛΑΙΟ 17: Δυναμικά οικονομετρικά υποδείγματα: Αυτοπαλινδρόμα υποδείγματα και υποδείγματα κατανομής χρονικών υστερήσεων**

(συνέχεια στην επόμενη σελίδα...)

(...συνέχεια της εξεταστέας ύλης στο μάθημα: "Οικονομετρία II")

- **ΚΕΦΑΛΑΙΟ 18: Υποδείγματα ταυτόχρονων εξισώσεων**
- **ΚΕΦΑΛΑΙΟ 19: Το πρόβλημα της ταυτοποίησης**
Από το κεφάλαιο αυτό να μη διαβαστεί το τμήμα 19.5
- **ΚΕΦΑΛΑΙΟ 20: Μέθοδοι ταυτόχρονων εξισώσεων**
- **ΚΕΦΑΛΑΙΟ 21: Οικονομετρία χρονοσειρών: Οι βασικές έννοιες**
- **ΚΕΦΑΛΑΙΟ 22: Οικονομετρία χρονοσειρών: Πρόβλεψη**
Από το κεφάλαιο αυτό να διαβαστούν τα τμήματα 22.9 και 22.10

Για εφαρμογές και ασκήσεις οι φοιτητές μπορούν να χρησιμοποιήσουν το βιβλίο των **Κ. Κατρακυλίδη & Ν. Ταμπάκη: "ΕΙΣΑΓΩΓΗ ΣΤΗΝ ΟΙΚΟΝΟΜΕΤΡΙΑ - ΑΣΚΗΣΕΙΣ", (Έκδοση 2011)** από όπου θα πρέπει να διαβαστεί η συνοπτική θεωρία και οι ασκήσεις που περιλαμβάνονται στα κεφάλαια: **5** (οι εναλλακτικές μέθοδοι εκτίμησης), **6, 7** (τα μη γραμμικά υποδείγματα), **9** (την επίδραση ARCH), **10, 11, 12** και **13**.

Σημειώνεται ότι οι φοιτητές παρελθόντων ετών μπορούν να διαβάσουν την ύλη του μαθήματος από τα βιβλία που είχαν διανεμηθεί κατά τα προηγούμενα ακαδημαϊκά έτη.

ΠΡΟΣΟΧΗ: Θα πρέπει να δοθεί ιδιαίτερη βαρύτητα στα όσα έχουν αναφερθεί στις θεωρητικές παραδόσεις του μαθήματος

Καλή επιτυχία
Καλή επιτυχία