

ΤΜΗΜΑ ΔΙΕΘΝΩΝ ΟΙΚΟΝΟΜΙΚΩΝ ΣΧΕΣΕΩΝ ΚΑΙ ΑΝΑΠΤΥΞΗΣ

Δημοκρίτειο Πανεπιστήμιο της Θράκης Περιγραφή και Πρόγραμμα Μαθήματος: *Οικονομετρία I*

Εξάμηνο:	Άνοιξη 2007
Μέρα και Ώρα:	Δευτέρα 2-6 μ.μ.
Καθηγητής:	Σάββας Παπαδόπουλος
Ηλεκτρονική Διεύθυνση:	metrika@otenet.gr
Ιστοσελίδα:	http://www.riskmetrica.wordpress.com

Σκοπός του Μαθήματος: Ο στόχος του μαθήματος είναι να εξοικειώσει και να διδάξει στους φοιτητές την αξιόπιστη εφαρμογή του βασικού οικονομετρικού μοντέλου της πολλαπλής παλινδρόμησης σε διαστρωματικά δεδομένα. Η εφαρμογή τους γίνεται με την χρήση του EXCEL και του οικονομετρικού πακέτου EViews.

Κυρίως Σύγγραμμα:

Jeffrey M. Wooldridge, (2003). «Εισαγωγή στην Οικονομετρία – Μια Νέα Προσέγγιση», Τόμος Α, Εκδόσεις Παπαζήση.

Ελληνική Βιβλιογραφία:

1. Jack Johnston and John Dinardo, (2004). «Οικονομετρικές Μέθοδοι», Τέταρτη Αμερικάνικη Έκδοση, Κλειδάριθμος.
2. Γεώργιος Χρήστου, (2003). «Εισαγωγή στην Οικονομετρία», Τόμος Α & Β, Εκδόσεις Gutenberg.
3. Γεώργιος Χάλκος, (2006). «Οικονομετρία – Θεωρία και Πράξη», Εκδόσεις Γιούρδας.

Ξένη Βιβλιογραφία:

1. James H. Stock, (2007). “Introduction to Econometrics” 2nd Edition, Pearson International Edition.
2. Damodar N. Gujarati, (2003). “Basic Econometrics” 4th Edition, Tata McGraw-Hill.
3. Carter R. Hill, William E. Griffiths, and George G. Judge, (2001). 2nd Edition, John Wiley & Sons. Inc.

Οικονομετρία I

Ελληνική Βιβλιογραφία για EViews:

Ευθύμιος Τσιόνας, «Εισαγωγή στο EIEWS», Οικονομικό Πανεπιστήμιο Αθηνών
Τμήμα Οικονομικής Επιστήμης

Download: <http://www.aueb.gr/users/tsionas/eviews1.pdf>

Download: <http://www.aueb.gr/users/tsionas/eviews2.pdf>

Ξένα Βιβλιογραφία για EViews:

1. Ben Vogelpang, (2005). “Econometrics – Theory and Applications with EViews”, Pearson Education.
2. “EViews 5 User’s Guide” Quantitative Micro Software. See Help in EViews.
3. Κωνσταντίνος Φραγιαδάκης, «Software for an Economist – EXCEL, EViews, MATLAB», Download: <http://www.econ.uoa.gr/UA/files/67775812..pdf>

Προγράμματα και Πακέτα Υπολογιστών:

- i) EXCEL – Data Analysis Tool Pac - Functions
- ii) EIEWS, <http://www.eviews.com/eviews3/eviews31/31win.html>

Προαιρετική Εργασία: 35% ή 0% του συνολικού βαθμού συν γραπτές Εξετάσεις.
Συγγραφή εφαρμογής οικονομετρικής θεωρίας με παλινδρόμησης σε διαχρονικά. Δες οδηγίες για την εργασία.

Κεφάλαιο	ΘΕΜΑΤΑ
1	Η Φύση της Οικονομετρίας και των Οικονομικών Δεδομένων
2	Το Μοντέλο της Απλής Παλινδρόμησης
3	Εκτίμηση στην Πολλαπλή Παλινδρόμηση
4	Επαγωγή στην Πολλαπλή Παλινδρόμηση
5	Ασυμπτωτικές Καμπύλες Ελαχίστων Τετραγώνων
6	Μη-γραμμική Παλινδρόμηση, Αλληλεπιδράσεις Όρων, Ανάλυση Καταλοίπων
7	Ανάλυση της Πολλαπλής Παλινδρόμησης με Ποιοτικού Χαρακτήρα Πληροφορίες: Ψευδομεταβλητές (όχι την Ενότητα 7.5)

Οικονομετρία Ι

ΠΡΟΤΕΙΝΟΜΕΝΑ ΣΗΜΕΙΑ ΚΑΙ ΠΑΡΑΔΕΙΓΜΑΤΑ

ΒΙΒΛΙΟ: **Jeffrey M. Wooldridge**, (2003). «*Εισαγωγή στην Οικονομετρία – Μια Νέα Προσέγγιση*»

Πίνακας: 2.3 (σελ. 61), και 3.2

Παραδείγματα: 2.3, 2.4, 2.5, 2.6, 2.8, 2.10, 2.11,

3.1, 3.2, 3.4, 3.5,

4.1, 4.2, 4.3, 4.4, 4.5, 4.7, 4.8, 4.9, 4.10, και τα παραδείγματα στις σελίδες: 185-188, 188, 210, 213, 217

Το παράδειγμα 5.3 και το παράδειγμα στις σελίδες 249-259 με την μεθοδολογία στην σελίδα 251,

Τα παραδείγματα 6.1, 6.2, 6.3, 6.7 και το παράδειγμα στις σελίδες **268-271**.

Τα παραδείγματα **7.1**, 7.2, 7.3, 7.4. **7.5**, **7.6**, 7.7, **7.8**, **7.9**, και το παράδειγμα στις σελίδες **352-354** σχετικά με την στατιστική του Chow στις σελίδες 342-344.

ΠΡΟΤΕΙΝΟΜΕΝΕΣ ΑΣΚΗΣΕΙΣ

ΒΙΒΛΙΟ: **Jeffrey M. Wooldridge**, (2003). «*Εισαγωγή στην Οικονομετρία – Μια Νέα Προσέγγιση*»

2.3, **2.5**, **2.6**, 2.10, 2.12, **2.14**,

3.1, 3.3, 3.5, 3.7, 3.9, 3.10, 3.12, 3.13, **3.15**, 3.17,

4.1, **4.3**, 4.5, **4.7**, 4.9, **4.11**, 4.12, 4.14, 4.16, 4.18,

5.1, 5.3, 5.5, 5.7

6.1, 6.3, 6.5, 6.7, 6.8, 6.10, 6.12, 6.14, 6.16,

7.1, 7.3, 7.5, 7.7, 7.9, 7.11, 7.13, 7.15, 7.17, 7.19,

Από το Παράρτημα Γ: Γ1 (C1) και Γ3 (C3)

Οικονομετρία Ι

ΥΛΗ ΤΟΥ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ ΑΠΟ ΤΟ ΠΑΛΑΙΟ ΒΙΒΛΙΟ

«ΕΙΣΑΓΩΓΗ ΣΤΗΝ ΟΙΚΟΝΟΜΕΤΡΙΑ », Γεώργιος Χρήστου, Τόμος Α, Εκδ. Gutenberg

Κεφάλαιο 1: σελ. 3-10

Κεφάλαιο 2: σελ. 13-60 (όχι Ενότητα 4,2), όχι Αποδείξεις Β ii) και Γ σελ. 40-43

Κεφάλαιο 3: σελ. 75-98, 103-123
(όχι την απόδειξη για Guass-Markov, σελ. 94-95)

Κεφάλαιο 4: σελ.129-143, σελ. 149-151

Κεφάλαιο 5: σελ. 157-183 (όχι σελίδες 184-196)

Κεφάλαιο 6: σελ. 201-207, 209-210, όχι 5.1, 5.2 (ναι την αρχή της 5), όχι 4.2, 4.3, 4.4

Κεφάλαιο 10: σελ. 313-317, 319-320 (όχι Ενότητα 3.1, ναι Ενότητα 3.2)

Παράρτημα - Κεφάλαιο 3: σελ. 399-411