



**ΠΑΝΤΕΙΟΝ ΠΑΝΕΠΙΣΤΗΜΙΟ ΚΟΙΝΩΝΙΚΩΝ ΚΑΙ ΠΟΛΙΤΙΚΩΝ ΕΠΙΣΤΗΜΩΝ
ΤΜΗΜΑ ΟΙΚΟΝΟΜΙΚΗΣ & ΠΕΡΙΦΕΡΕΙΑΚΗΣ ΑΝΑΠΤΥΞΗΣ**

**PANTEION UNIVERSITY OF SOCIAL AND POLITICAL SCIENCES
DEPARTMENT OF ECONOMIC & REGIONAL DEVELOPMENT**

**Πρόγραμμα Μεταπτυχιακών Σπουδών
“Εφαρμοσμένων Οικονομικών και Περιφερειακής Ανάπτυξης”
Κατεύθυνση Εφαρμοσμένων Οικονομικών και Διοίκησης**

ΠΕΡΙΓΡΑΦΗ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ

A. ΑΝΑΓΝΩΡΙΣΗ - ΤΑΥΤΟΤΗΤΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ

1. ΤΙΤΛΟΣ: Εφαρμοσμένη Οικονομετρία για Οικονομικά, Χρηματοοικονομικά και Μάνατζμεντ
2. ΤΥΠΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ: ΘΕΩΡΗΤΙΚΟ ΕΡΓΑΣΤΗΡΙΑΚΟ ΜΙΚΤΟ X
3. ΕΙΔΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ: ΥΠΟΧΡΕΩΤΙΚΟ ΕΠΙΛΟΓΗΣ ΥΠΟΧΡΕΩΤΙΚΟ X
4. ΤΥΠΙΚΟ ΕΞΑΜΗΝΟ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ: A B X
5. ΩΡΕΣ ΕΒΔΟΜΑΔΙΑΙΑΣ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ: ΘΕΩΡΙΑ : 2 ΕΡΓΑΣΤΗΡΙΟ : 2
6. ΔΙΔΑΚΤΙΚΕΣ ΜΟΝΑΔΕΣ (ECTS):

B. ΣΚΟΠΟΣ ΤΟΥ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ

7. Κατανόηση του θεωρητικού υπόβαθρου της οικονομετρίας και εκμάθηση των εφαρμογών της στα οικονομικά, χρηματοοικονομικά και το μάνατζμεντ.

Γ. ΣΤΟΧΟΙ ΤΟΥ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ

Η σωστή χρήση της οικονομετρίας από τους απόφοιτους του μεταπτυχιακού προγράμματος στην εργασία τους.

Δ. ΠΕΡΙΕΧΟΜΕΝΟ ΤΟΥ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ/ΚΑΤΑ ΕΒΔΟΜΑΔΑ

Εβδ-1. Η χρήση των ψευδομεταβλητών. Ανάλυση διαχρονικών επιδράσεων, εποχικών επιδράσεων, αλληλεπίδραση ψευδομεταβλητών. Παράδειγμα εφαρμογών σε Μάνατζμεντ.

Εβδ-2-3. Πολυσυγγραμμικότητα και σφάλμα εξειδίκευσης, έλεγχοι και διορθώσεις. Παλινδρόμηση με κύριες συνιστώσες - Εκτίμηση υποδείγματος για μακροοικονομικές μεταβλητές. Παράδειγμα εφαρμογών σε Οικονομικές εφαρμογές.

Εβδ-4-5. Μοντελοποίηση της Ετεροσκεδαστικότητας. Χρηματοοικονομικές Εφαρμογές.

Γενικευμένα Αυτό-παλίνδρομα υποδείγματα δεσμευμένης ετεροσκεδαστικότητας. Παράδειγμα εφαρμογών σε Χρηματοοικονομικές εφαρμογές.

Εβδ-6-7. Εισαγωγή στην έννοια της μέτρησης του κινδύνου. Υποδείγματα εκτίμησης αξίας σε διακινδύνευση. Εφαρμογές με τη χρήση του EViews με δεδομένα από κεφαλαιαγορές και χρηματαγορές.

Εβδ-8. Εργασία: Μοντελοποίηση της μεταβλητότητας των αγορών και διαχείριση κινδύνου.

Εβδ-9-10. Θεωρία τιμολόγησης δικαιωμάτων προαίρεσης. Τιμολόγηση δικαιωμάτων προαίρεσης με τη χρήση υποδειγμάτων δεσμευμένης ετεροσκεδαστικότητας. Εφαρμογές με τη χρήση του EViews με δεδομένα από κεφαλαιαγορές.

Ε. ΠΡΟΑΠΑΙΤΟΥΜΕΝΕΣ ΓΝΩΣΕΙΣ

Μαθηματικά, Στατιστική, Excel

ΣΤ. ΣΥΜΜΕΤΕΧΟΝΤΕΣ ΕΙΣΗΓΗΤΕΣ

Σταύρος Ντεγιαννάκης

Ζ. ΔΙΑΔΙΚΑΣΙΑ ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗΣ

Εργασίες και Εξετάσεις

Η. ΒΙΒΛΙΟΓΡΑΦΙΑ

1. Ντεγιαννάκης Σταύρος (2014). Εφαρμογές Οικονομετρίας με τη Χρήση του Πακέτου EViews, Πανεπιστημιακές Σημειώσεις, Πάντειο Πανεπιστήμιο, Τμήμα Οικονομικής και Περιφερειακής Ανάπτυξης, Πρόγραμμα Μεταπτυχιακών Σπουδών, Αθήνα.
2. Χρήστου Γεώργιος (2008). Εισαγωγή στην Οικονομετρία (Τόμοι Α&Β), Gutenberg, Αθήνα.
3. Δημέλη Σοφία (2013). Σύγχρονες Μέθοδοι Ανάλυσης Χρονολογικών Σειρών. Εκδόσεις ΟΠΑ, Αθήνα.
4. Asteriou, Dimitrios (2006). Applied Econometrics, A Modern Approach Using Eviews and Microfit, Palgrave Macmillan.
5. Brooks, Chris (2002). Introductory Econometrics for Finance, Cambridge University Press.
6. Chan, Ngai Hang (2002). Time Series Applications to Finance. Wiley Series in Probability and Statistics.
7. Clements, Michael P. (2005). Evaluating Econometric Forecasts of Economic and Financial Variables, Palgrave Macmillan.
8. Degiannakis, Stavros and Evdokia Xekalaki (2010). ARCH Models for Financial Applications, Wiley, New York.
9. Enders Walter (2003). Applied Econometric Times Series, Wiley.
10. Franses, Philip Hans and van Dijk, Dick (2000). Nonlinear Time Series Models in Empirical Finance. Cambridge University Press.
11. Freedman, David A. (2009). Statistical Models: Theory and Practice, Cambridge University Press, Cambridge.
12. Gouriéroux, Christian and Jasiak, Joann (2001). Financial Econometrics: Problems, Models, and Methods.
13. Greene, Willian H. (2012). Econometric Analysis, Prentice Hall, New York.
14. Hamilton, J.D. (1994). Time Series Analysis, Princeton University Press, New Jersey.
15. Lütkepohl, Helmut (2005). New Introduction to Multiple Time Series Analysis, Springer.

16. Lütkepohl, Helmut and Krätzig, Markus (2004). Applied Time Series Econometrics. Cambridge University Press.
17. Richard Harris, Robert Sollis (2003). Applied Time Series Modelling and Forecasting, Wiley
18. Tsay, Ruey (2002). Analysis of Financial Time Series, Wiley.
19. Wooldridge, Jeffrey (2006). Introductory Econometrics - A Modern Approach 3rd Edition. Tomson - South Western.