

ΥΛΗ ΕΞΕΤΑΣΗΣ - ΠΡΟΟΔΟΥ ΟΙΚΟΝΟΜΕΤΡΙΑΣ II

Από το βιβλίο

Γ. Χάλκος (2019). *Οικονομετρία: Θεωρία και Πράξη*. Εκδόσεις ΔΙΣΙΓΜΑ

1. Κριτήρια επιλογής ανάμεσα στην γραμμική και λογαριθμική γραμμική μορφή (Box-Cox, Bera-McAleer, McKinnon-White-Davidson) και Έλεγχοι σταθερότητας των συντελεστών (κριτήριο Hansen, έλεγχοι CUSUM, CUSUMSQ) Κριτήρια AIC, SC

Ενότητες 4.4.3, 4.10-4-11: σελ. 259-261, 279-291 και 293-296

2. Υποδείγματα αυτοπαλίνδρομης υπό συνθήκη ετεροσκεδαστικότητας (έλεγχος για ARCH, υπόδειγμα GARCH)

Ενότητα 6.6: σελ. 376-384

(απλά διαβάστε εκτός ύλης 385-390)

3. Υποδείγματα με ψευδομεταβλητή ως εξαρτημένη μεταβλητή (υπόδειγμα γραμμικής πιθανότητας, Logit, Probit)

Ενότητα 8.4: σελ. 461-472

4. Υποδείγματα κατανεμημένων χρονικών υστερήσεων. Υποδείγματα με απεριόριστο αριθμό χρονικών υστερήσεων (υπόδειγματα Koyck, Solow). Υποδείγματα με περιορισμένο αριθμό χρονικών υστερήσεων (υπόδειγμα του Almon). Εμπειρικά υποδείγματα με χρονικές υστερήσεις (υπόδειγμα μερικής προσαρμογής, υπόδειγμα αναπροσαρμοσμένων προσδοκιών). Αιτιότητα στα Οικονομικά: το τεστ Granger

Κεφάλαιο 9: σελ. 493-534

5. Συστήματα αλληλεξαρτημένων εξισώσεων (οικονομική διάρθρωση, ανηγμένη μορφή, στοχαστικά υποδείγματα, είδη συστημάτων εξισώσεων). Το οικονομετρικό υπόδειγμα αλληλεξαρτημένων εξισώσεων και το σφάλμα αλληλεξάρτησης. Μέθοδοι εκτίμησης συστημάτων αλληλεξαρτωμένων εξισώσεων (έμμεση μέθοδος ελαχίστων τετραγώνων και μέθοδος ελαχίστων τετραγώνων σε δύο στάδια)

Κεφάλαιο 10: σελ. 535-582

6. Κύριες συνιστώσες χρονολογικών σειρών: έλεγχοι στασιμότητας και συνολοκλήρωσης

Κεφάλαιο 11 ενότητες 11.2, 11.5, 11.6, 11.8: σελ. 588-590, 606-613, 621-642

Από το βιβλίο

Γ. Χάλκος (2011). *Οικονομετρία: Θεωρία, εφαρμογές & χρήση προγραμμάτων σε H/Y*. Εκδόσεις Gutenberg

Κεφάλαια 9-12 και ενότητα 3.9 (σελ 200-201).

Επίσης πρόσθετες σημειώσεις σχετικές με κριτήρια επιλογής ανάμεσα στη γραμμική και λογαριθμική γραμμική μορφή (Bera-McAleer, McKinnon-White-Davidson) και εμπειρικά υποδείγματα με χρονικές υστερήσεις (υπόδειγμα μερικής προσαρμογής, υπόδειγμα αναπροσαρμοσμένων προσδοκιών και μίξη των δύο).