



ΠΑΝΕΠΙΣΤΗΜΙΟ ΠΕΙΡΑΙΩΣ

ΣΧΟΛΗ	Οικονομικών, Επιχειρηματικών και Διεθνών Σπουδών																
ΤΜΗΜΑ	Οικονομικής Επιστήμης																
ΕΠΙΠΕΔΟ ΣΠΟΥΔΩΝ	Προπτυχιακό																
ΚΩΔΙΚΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	ΟΚΟΙΜ03	ΕΞΑΜΗΝΟ ΣΠΟΥΔΩΝ	7 ^ο														
ΤΙΤΛΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	ΘΕΜΑΤΑ ΕΦΑΡΜΟΣΜΕΝΗΣ ΟΙΚΟΝΟΜΕΤΡΙΑΣ																
ΕΒΔΟΜΑΔΙΑΙΕΣ ΩΡΕΣ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ	4	ΠΙΣΤΩΤΙΚΕΣ ΜΟΝΑΔΕΣ	5														
ΤΥΠΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	Επιλογής																
ΠΡΟΑΠΑΙΤΟΥΜΕΝΑ ΜΑΘΗΜΑΤΑ	-																
ΓΛΩΣΣΑ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ	Ελληνική	ΓΛΩΣΣΑ ΕΞΕΤΑΣΕΩΝ	Ελληνική														
ΔΙΑΘΕΣΙΜΟ ΣΕ ERASMUS	Ναι																
ΜΑΘΗΣΙΑΚΑ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΑ	<p>Σκοπός του μαθήματος είναι η παρουσίαση της ανάλυσης χρονοσειρών, καθώς και η σύνδεσή της στην οικονομετρία για την αναγνώριση και πρόβλεψη της συμπεριφοράς οικονομικών και άλλων φαινομένων. Αρχικά, γίνεται μία σύντομη αναφορά στις μεθόδους ανάλυσης χρονοσειρών. Κατόπιν, γίνεται λεπτομερή παρουσίαση της μεθοδολογίας των Box & Jenkins, γνωστή και ως ARIMA ανάλυση. Ειδικότερα, μελετώνται τα χαρακτηριστικά στάσιμων και μη-στάσιμων χρονοσειρών, καθώς και οι τρόποι αναγνώρισής τους. Αναλύονται επίσης θέματα που αφορούν τους ελέγχους μοναδιαίας ρίζας, της αιτιότητας κατά Granger, της συνολοκλήρωσης, των υποφαινομενικών σχέσεων, καθώς και ARCH υποδειγμάτων.</p> <p>Με την επιτυχή ολοκλήρωση του μαθήματος οι φοιτητές θα έχουν πολύ καλή γνώση ανάλυσης χρονοσειρών τόσο μεμονομένα όσο και σε θέματα οικονομετρίας για την εμπειρική διερεύνηση της συμπεριφοράς φαινομένων στη λήψη οικονομικών αλλά και άλλων αποφάσεων.</p>																
ΓΕΝΙΚΕΣ ΙΚΑΝΟΤΗΤΕΣ	<ul style="list-style-type: none"> • Ανάλυση δεδομένων από χρονοσειρές • Αναγνώριση συμπεριφοράς και πρόβλεψης φαινομένων • Ποσοτική προσέγγιση • Λήψη Αποφάσεων • Σχεδιασμός και διαχείριση έργων. 																
ΠΕΡΙΕΧΟΜΕΝΟ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	<ul style="list-style-type: none"> • Βασικές έννοιες Ανάλυσης Χρονοσειρών. • Παρουσίαση ARMA(p, q) Υποδειγμάτων. • Μη-στάσιμες Χρονοσειρές. • Εκτίμηση γραμμικών υποδειγμάτων με χρονοσειρές. • Εκτίμηση συναρτήσεων ζήτησης και παραγωγής. • Υποφαινομενικές παλινδρομήσεις και συσχετίσεις. • Αιτιότητα κατά Granger. • Συνολοκλήρωση δύο μεταβλητών. 																
ΧΡΗΣΗ ΤΠΕ ΣΤΗ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑ	Οι διαλέξεις υποστηρίζονται και από τη χρήση ΤΠΕ																
ΟΡΓΑΝΩΣΗ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ	<table border="1"> <thead> <tr> <th>Δραστηριότητα</th> <th>Φόρτος Εργασίας Εξαμήνου</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Διαλέξεις</td> <td>52</td> </tr> <tr> <td>Φροντιστήριο</td> <td>10</td> </tr> <tr> <td>Μελέτη</td> <td>35</td> </tr> <tr> <td>Ατομικές Ασκήσεις</td> <td>26</td> </tr> <tr> <td>Εξετάσεις</td> <td>2</td> </tr> <tr> <td>ΣΥΝΟΛΟ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ</td> <td>125</td> </tr> </tbody> </table>			Δραστηριότητα	Φόρτος Εργασίας Εξαμήνου	Διαλέξεις	52	Φροντιστήριο	10	Μελέτη	35	Ατομικές Ασκήσεις	26	Εξετάσεις	2	ΣΥΝΟΛΟ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	125
Δραστηριότητα	Φόρτος Εργασίας Εξαμήνου																
Διαλέξεις	52																
Φροντιστήριο	10																
Μελέτη	35																
Ατομικές Ασκήσεις	26																
Εξετάσεις	2																
ΣΥΝΟΛΟ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	125																
ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗ ΦΟΙΤΗΤΩΝ	<p>Η αξιολόγηση του μαθήματος γίνεται με γραπτές εξετάσεις στο τέλος του μαθήματος που διδάσκεται το εξάμηνο και με τη συγγραφή εργασίας</p> <p>Η γλώσσα της εξέτασης και της συγγραφής της εργασίας είναι η ελληνική.</p>																
ΣΥΝΙΣΤΩΜΕΝΗ ΒΙΒΛΙΟΓΡΑΦΙΑ	<p>- Προτεινόμενη Βιβλιογραφία:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Σ. Δημέλη “Σύγχρονες Μέθοδοι Ανάλυσης Χρονοσειρών” <p>- Συναφή επιστημονικά περιοδικά:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Journal of econometrics • Journal of applied econometrics • Journal of time series analysis • Journal of applied economics 																