



ΠΑΝΕΠΙΣΤΗΜΙΟ ΠΕΙΡΑΙΩΣ

1) ΓΕΝΙΚΑ

ΣΧΟΛΗ	ΟΙΚΟΝΟΜΙΚΩΝ, ΕΠΙΧΕΙΡΗΜΑΤΙΚΩΝ ΚΑΙ ΔΙΕΘΝΩΝ ΣΠΟΥΔΩΝ		
ΤΜΗΜΑ	ΟΙΚΟΝΟΜΙΚΗΣ ΕΠΙΣΤΗΜΗΣ		
ΕΠΙΠΕΔΟ ΣΠΟΥΔΩΝ	ΠΡΟΠΤΥΧΙΑΚΟ		
ΚΩΔΙΚΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	ΟΚΟΙΜ03	ΕΞΑΜΗΝΟ ΣΠΟΥΔΩΝ	7
ΤΙΤΛΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	ΘΕΜΑΤΑ ΕΦΑΡΜΟΣΜΕΝΗΣ ΟΙΚΟΝΟΜΕΤΡΙΑΣ		
ΑΥΤΟΤΕΛΕΙΣ ΔΙΔΑΚΤΙΚΕΣ ΔΡΑΣΤΗΡΙΟΤΗΤΕΣ	ΕΒΔΟΜΑΔΙΑΙΕΣ ΩΡΕΣ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ	ΠΙΣΤΩΤΙΚΕΣ ΜΟΝΑΔΕΣ	
Διαλέξεις	4	5	
ΤΥΠΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	ΕΙΔΙΚΕΥΣΗΣ		
ΠΡΟΑΠΑΙΤΟΥΜΕΝΑ ΜΑΘΗΜΑΤΑ	ΟΧΙ		
ΓΛΩΣΣΑ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ	ΕΛΛΗΝΙΚΗ	ΓΛΩΣΣΑ ΕΞΕΤΑΣΕΩΝ	ΕΛΛΗΝΙΚΗ
ΤΟ ΜΑΘΗΜΑ ΠΡΟΣΦΕΡΕΤΑΙ ΣΕ ΦΟΙΤΗΤΕΣ ERASMUS	ΝΑΙ		
ΗΛΕΚΤΡΟΝΙΚΗ ΣΕΛΙΔΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ (URL)	https://eclass.unipi.gr/courses/OEP141/		

2) ΜΑΘΗΣΙΑΚΑ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΑ

Μαθησιακά Αποτελέσματα

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. 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.

Γενικές Ικανότητες

- Ανάλυση δεδομένων από χρονοσειρές
- Αναγνώριση συμπεριφοράς και πρόβλεψης φαινομένων
- Ποσοτική προσέγγιση
- Λήψη Αποφάσεων
- Σχεδιασμός και διαχείριση έργων.

3) ΠΕΡΙΕΧΟΜΕΝΟ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ

- 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.

4) ΔΙΔΑΚΤΙΚΕΣ ΚΑΙ ΜΑΘΗΣΙΑΚΕΣ ΜΕΘΟΔΟΙ – ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗ

ΤΡΟΠΟΣ ΠΑΡΑΔΟΣΗΣ	Πρόσωπο με πρόσωπο	
ΧΡΗΣΗ ΤΠΕ ΣΤΗ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑ	Οι διαλέξεις υποστηρίζονται και από τη χρήση ΤΠΕ	
ΟΡΓΑΝΩΣΗ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ	Δραστηριότητα	Φόρτος Εργασίας Εξαμήνου
	Διαλέξεις	52
	Μελέτη	40
	Ατομικές Ασκήσεις	31
	Εξετάσεις	2
	ΣΥΝΟΛΟ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	125
ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗ ΦΟΙΤΗΤΩΝ	Η αξιολόγηση του μαθήματος γίνεται με γραπτές εξετάσεις στο τέλος του μαθήματος που διδάσκεται το εξάμηνο και με τη συγγραφή εργασίας. Η γλώσσα της εξέτασης και της συγγραφής της εργασίας είναι η ελληνική.	
ΣΥΝΙΣΤΩΜΕΝΗ ΒΙΒΛΙΟΓΡΑΦΙΑ	- Προτεινόμενη Βιβλιογραφία: <ul style="list-style-type: none">• Σ. Δημέλη “Σύγχρονες Μέθοδοι Ανάλυσης Χρονοσειρών” - Συναφή επιστημονικά περιοδικά: <ul style="list-style-type: none">• Journal of Econometrics• Journal of Applied Econometrics• Journal of Quantitative Economics• Journal of Applied Economics	