



ΤΕΧΝΟΛΟΓΙΚΟ ΠΑΝΕΠΙΣΤΗΜΙΟ ΚΥΠΡΟΥ
ΤΜΗΜΑ ΕΜΠΟΡΙΟΥ ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΩΝ ΚΑΙ ΝΑΥΤΙΛΙΑΣ
ΕΧΝ 310 – ΠΟΣΟΤΙΚΕΣ ΜΕΘΟΔΟΙ
ΦΘΙΝΟΠΩΡΙΝΟ ΕΞΑΜΗΝΟ 2009-10

Καθηγητής: Χρήστος Σ. Σάββα
Γραφείο: Ανεξαρτησίας 33
Ώρες Γραφείου: ΤΡ 11:00–13:00
Τηλ.: 25002349
E-mail: christos.savva@cut.ac.cy

Αίθουσα Διδασκαλίας: ΛΕΜΕΣΟΣ και ΛΕΥΚΩΣΙΑ
Ώρες Διαλέξεων: ΤΡ (13:00-14:30) & ΠΑ (11:00–12:30)
Αίθουσα Φροντιστηρίου: ΚΧΕ1
Ώρες Φροντιστηρίου: ΠΕ 16:00 – 17:00

ΠΕΡΙΓΡΑΦΗ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ

Το μάθημα αυτό επιτρέπει στους φοιτητές να καταλάβουν πώς η οικονομετρία μπορεί να εφαρμοστεί για να αποκτηθούν χρήσιμες γνώσεις που σχετίζονται με τη συμπεριφορά των χρηματοοικονομικών αγορών. Οι φοιτητές θα μάθουν πώς να εφαρμόζουν οικονομετρικές τεχνικές σε επιχειρηματικά ή χρηματοοικονομικά δεδομένα. Το μάθημα καλύπτει την απλή γραμμική παλινδρόμηση τον έλεγχο υποθέσεων την πολλαπλή παλινδρόμηση στατιστικές βαθμού αναντιστοιχίας και τις παραβιάσεις των υποθέσεων κλασικού προτύπου. Κατά τη διάρκεια του μαθήματος αυτού θα συζητηθεί επίσης η οικονομετρική μεθοδολογία που περιβάλλει τις μακροπρόθεσμες σχέσεις στα χρηματοοικονομικά όπως έλεγχος στασιμότητας έλεγχος μοναδιαίων ριζών συνολοκλήρωση κλπ.

ΒΙΒΛΙΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ

- **Υποχρεωτικό:**
 - J.H. Stock and M.W. Watson, *Introduction to Econometrics* (second edition), Publisher: Prentice Hall, 2007. ISBN: 9780321278876
- **Προαιρετικό:**
 - J.M. Wooldridge, *Introductory Econometrics*, South-Western College Publishing.
 - Γ. Κ. Χρήστου, *Εισαγωγή στην Οικονομετρία*, Εκδοτικός Οίκος: GUTENBERG, 2002. ISBN: 9789600109566

ΔΙΑΛΕΞΕΙΣ – ΦΡΟΝΤΙΣΤΗΡΙΑ

Τα μαθήματα θα γίνονται υπό μορφή διαλέξεων (τρεις ώρες την εβδομάδα) και φροντιστηρίων (μια ώρα την εβδομάδα). Στη διάλεξη παραδίδεται η ύλη του μαθήματος και γίνεται ανάλυση των θεμάτων της ύλης. Οι σημειώσεις που θα καλύπτονται σε κάθε διάλεξη και που αντιστοιχούν στα διάφορα κεφάλαια του βιβλίου βρίσκονται στην ιστοσελίδα: <http://ecourses.cut.ac.cy/>

Ο κάθε φοιτητής θα πρέπει να προμηθευτεί τις σημειώσεις πριν την έναρξη της διάλεξης ώστε να τις έχει μαζί του κατά την διάρκεια της διάλεξης. Στην τελευταία σελίδα των σημειώσεων κάθε κεφαλαίου σας υποδεικνύεται ένας αριθμός ερωτήσεων/ασκήσεων από το κάθε κεφάλαιο του βιβλίου που θα πρέπει να λύσετε. Τις λύσεις θα τις παραδίνετε στα φροντιστήρια. Στα φροντιστήρια γίνεται συζήτηση της ύλης που καλύπτει η διάλεξη και λύνονται οι ασκήσεις. Η παρακολούθηση είναι υποχρεωτική τόσο για τις διαλέξεις όσο και στα φροντιστήρια.

ΕΞΕΤΑΣΕΙΣ – ΒΑΘΜΟΛΟΓΙΑ

Η επίδοση του κάθε φοιτητή/τριας κρίνεται με τον πιο κάτω τρόπο:

<u>Εξέταση</u>	<u>Στάθμιση</u>
Ενδιάμεση εξέταση	30%
Τελική εξέταση	70%

ΚΑΛΥΨΗ ΘΕΜΑΤΩΝ – Χρονοδιάγραμμα

<u>Class #</u>	<u>Date/Day</u>	<u>Topic</u>	<u>Readings:</u> <u>SW Ch. #</u>
1	Σεπτ. 7	Τρίτη Introduction and review of statistics	2,3
2	10	Παρ Review of statistics	2,3
3	14	Τρίτη Bivariate regression I	4
4	17	Παρ Bivariate regression II	4-5
5	21	Τρίτη Bivariate regression II	5
6	24	Παρ Multiple regression I	6
7	28	Τρίτη Multiple regression II	6
8	Οκτ. 1	Παρ <i>No class – National Holiday</i>	
9	5	Τρίτη Multiple regression III	7
10	8	Παρ Multiple regression III	7
11	12	Τρίτη Nonlinear regression models I	8
12	15	Παρ Nonlinear regression models II	8
13	19	Τρίτη Ενδιάμεση Εξέταση	
14	22	Παρ Assessing regression studies I	9
15	26	Τρίτη Assessing regression studies II	9
16	29	Παρ Panel Data I	10
17	Νοεβ. 2	Τρίτη Panel Data II	10
18	5	Παρ Binary dependent variable I	11
19	9	Τρίτη Binary dependent variable II	11
20	12	Παρ Instrumental variable regression I	12
21	16	Τρίτη Instrumental variable regression II	12
22	19	Παρ Instrumental variable regression III	12
23	23	Τρίτη Time series regression I	14
24	26	Παρ Time series regression II	14
25	30	Τρίτη Time series regression III	15
26	Δεκ. 3	Παρ Discussion of final exercise	