

Εργαστηριακές διαλέξεις με τη χρήση STATA
ΔΠΜΣ στη Χρηματοοικονομική και Τραπεζική
Οικονομικό Πανεπιστήμιο Αθηνών
Αίθ.: Εργαστήρια Η/Υ Κέντρου Υπολογιστών (Διάρκεια: 6 ώρες)
Εισηγητής: Γ. Χρόνης

Περιγραφή μαθήματος:

Στόχος του εργαστηρίου είναι η γνωριμία και η εξοικείωση των φοιτητών με το οικονομετρικό πακέτο STATA, ένα ευρέως χρησιμοποιούμενο προγράμματα για οικονομετρία και στατιστική γενικότερα. Η διδασκαλία ξεκινάει με μια εισαγωγή στον τρόπο με τον οποίο το πρόγραμμα δέχεται τα δεδομένα και τις εντολές, καθώς και τον τρόπο με τον οποίο παρουσιάζει αλλά και σώζει τα αποτελέσματα της ανάλυσης. Μέχρι το τέλος των διαλέξεων όλοι οι συμμετέχοντες έχουν την τεχνική επάρκεια να χρησιμοποιήσουν το STATA ως εργαλείο για την υλοποίηση και εφαρμογή των όσων διδαχθούν κατά την διάρκεια του μεταπτυχιακού προγράμματος.

Προαπαιτούμενα μαθήματος:

Βασικές γνώσης χρήσης Η/Υ με λειτουργικού σύστημα της Microsoft. Εμπειρία στην χρήση του προγράμματος επεξεργασίας λογιστικών φύλλων, Excel.

Περιγραφή διαλέξεων:

Σύντομη περιγραφή του STATA. Εισαγωγή, διαχείριση και επεξεργασία μεταβλητών. Δημιουργία και επεξεργασία απλών γραφημάτων. Βασικά περιγραφικά μεγέθη. Επεξεργασία και τροποποίηση μεταβλητών και παρατηρήσεων. Αποθήκευση αποτελεσμάτων και εντολών. Έλεγχοι κανονικότητας. Κατανομές και κριτικές τιμές. Στατιστικοί έλεγχοι υποθέσεων και διαστήματα εμπιστοσύνης. Παραδείγματα πολλαπλής παλινδρόμησης με δυαδικές μεταβλητές και αλληλεπιδράσεις. Έλεγχοι Chow, White (WLS), Durbin-Watson (GLS) και εκτίμηση βοηθητικών μεταβλητών. Εκτίμηση, ανάλυση, προσομοίωση και προβλέψεις ARIMA μοντέλων. Εκτίμηση μοναδιαίων ριζών και ανάλυση συνολοκλήρωσης.

Βιβλιογραφία:

1. Alan C. Acock (2014): A Gentle Introduction to STATA. Fourth Edition, Stata Press, Texas.
2. A. Colin Cameron and Pravin K. Trivedi (2009): Microeconometrics using STATA. First edition, Stata Press, Texas
3. Lee C. Adkins and R. Carter Hill (2011): Using Stata for Principles of Econometrics. Fourth edition, John Wiley & Sons, New York.