

ΒΙΟΓΡΑΦΙΚΟ ΣΗΜΕΙΩΜΑ
ΣΠΥΡΙΔΩΝ Δ. ΣΥΜΕΩΝΙΔΗΣ

Πανεπιστήμιο Ιωαννίνων
Τμήμα Οικονομικών Επιστημών
Πανεπιστημιούπολη 45 500, Ιωάννινα
Τηλ. 6976407518, 2651005930
e-mail: symseoni@cc.uoi.gr, spyros_symeonides@yahoo.com

Προσωπικά

Στοιχεία:

Ημερομηνία Γέννησης: 24 Δεκεμβρίου, 1962
Τόπος Γέννησης: Αθήνα, Ελλάδα
Οικογενειακή Κατάσταση: Διαζευγμένος (με ένα παιδί)
Εθνικότητα: Ελληνική
Στρατιωτικές Υποχρεώσεις: Εκπληρωμένες

Σπουδές:

**ΟΙΚΟΝΟΜΙΚΟ ΠΑΝΕΠΙΣΤΗΜΙΟ ΑΘΗΝΩΝ (Πρώην Α.Σ.Ο.Ε.Ε.)
Διδακτορικό στην Οικονομετρία (1987--1991)**

Τίτλος Διδακτορικής Διατριβής:

Εφαρμογές της Εκλεπτυσμένης Ασυμπτωτικής Θεωρίας στους Οικονομετρικούς Ελέγχους

Επιβλέπων Καθηγητής: Μιχάλης Α. Μαγδαληνός

**ΟΙΚΟΝΟΜΙΚΟ ΠΑΝΕΠΙΣΤΗΜΙΟ ΑΘΗΝΩΝ (Πρώην Α.Σ.Ο.Ε.Ε.)
Μεταπτυχιακό Δίπλωμα (M. A.) στην Οικονομική Επιστήμη (1985-1987)**

**ΟΙΚΟΝΟΜΙΚΟ ΠΑΝΕΠΙΣΤΗΜΙΟ ΑΘΗΝΩΝ (Πρώην Α.Σ.Ο.Ε.Ε.)
Πτυχίο (B. A.) στην Οικονομική Επιστήμη (1981-1985)**

**Δημοσιεύσεις σε
Περιοδικά και
Τόμους με κριτές:**

Seemingly Unrelated Systems of Econometric Equations, Journal of Applied Statistics (2016), **Published Online:** 2016-05-12,

<http://dx.doi.org/10.1080/02664763.2016.1182131>

Συνεργασία με την Ευδοξία Κακαράντζα

Size corrected Significance Tests in Seemingly Unrelated Regressions with Autocorrelated Errors, Journal of Time Series Econometrics vol. 9 issue 1 (Jan. 2017), **Published Online:** 2016-04-14, <https://doi.org/10.1515/jtse-2015-0014>

Συνεργασία με τον Γιάννη Καραβία και τον Ηλία Τζαβαλή

On the finite-sample distribution of the feasible GLS estimator: an application of the Cornish-Fisher correction, The Journal of World Economic Review vol. 3 number 2 (2008), σελ. 91–103.

Cornish-Fisher Size Corrected t and F Statistics for the Linear Regression Model with Heteroscedastic Errors, G.D.A. Phillips and E. Tzavalis, ed. "The Refinement of Econometric Estimation and Test Procedures: Finite Sample and Asymptotic Analysis", (2007), σελ. 173--204 (Cambridge University Press).

Συνεργασία με την Ελένη Κανδηλώρου και τον Ηλία Τζαβαλή

A reinterpretation of the tests of overidentifying restrictions, Journal of Econometrics 73 (1996), σελ. 325--353.

Συνεργασία με τον Μιχάλη Α. Μαγδαληνό

Μία προγενέστερη εκδοχή του άρθρου παρουσιάστηκε στην Ευρωπαϊκή Συνάντηση της Οικονομετρικής Εταιρείας (Ουψάλα, Σουηδία, Αύγουστος 1993).

Alternative size corrections for some GLS test statistics: The case of the AR(1) model, Journal of Econometrics 66 (1995), σελ. 35--59.

Συνεργασία με τον Μιχάλη Α. Μαγδαληνό

Μία προγενέστερη εκδοχή του άρθρου παρουσιάστηκε στο 6ο Παγκόσμιο Συνέδριο της Οικονομετρικής Εταιρείας (Βαρκελώνη, Ισπανία, Αύγουστος 1990).

Alternative size corrections for some significance tests in the S.U.R. model, Alogoskoufis, G., T. Kollintzas, and G. Provanopoulos, ed. Essays in honor of Constantine G. Dracatos (1994), σελ. 193--216 (Εκδόσεις Παπαζήση, Αθήνα).

Συνεργασία με τον Μιχάλη Α. Μαγδαληνό

**Βιβλιογραφικές
Αναφορές:**

• **Aris Spanos:**

The Instrumental Variables Method Revisited: on the Nature and Choice of Optimal Instruments, G.D.A. Phillips and E. Tzavalis, ed. *The Refinement of Econometric Estimation and Test Procedures: Finite Sample and Asymptotic Analysis* (2007), σελ. 34--59 (Cambridge University Press).

• **Magdalinos, M. A. and Kandilorou, H:**

Specification Analysis in Equations with Stochastic Regressors, *Journal of Business and Economic Statistics* 19 vol. 2 (2001), σελ. 226--232.

Έρευνα σε Εξέλιξη:

• ***Data instigated critical values of some commonly used statistical tests***

• ***Alternative size corrections for the t and F tests statistics in the linear model with long memory error terms*** (με τον Θεόδωρο Σίμο)

**Τρέχουσα Θέση:
2002 - 2017**

**ΠΑΝΕΠΙΣΤΗΜΙΟ ΙΩΑΝΝΙΝΩΝ,
Τμήμα Οικονομικών Επιστημών**

Αναπληρωτής Καθηγητής

**Διδασκόμενα
Μαθήματα:**

- Οικονομετρία I (3^ο εξάμηνο)
- Οικονομετρία II (4^ο εξάμηνο)
- Αγορές Χρήματος και Κεφαλαίου (7^ο εξάμηνο)
- Χρηματοοικονομική Μηχανική (8^ο εξάμηνο)
- Διδασκαλία και επίβλεψη εργασιών των επισκεπτών φοιτητών του Προγράμματος Erasmus
- Οικονομετρία I (1^ο εξάμηνο του Μεταπτυχιακού Προγράμματος Σπουδών)
- Ειδικά Θέματα Οικονομετρίας (2^ο εξάμηνο του Μεταπτυχιακού Προγράμματος Σπουδών)

**Επίβλεψη
Διατριβών:**

- Επίβλεψη Διατριβών Μεταπτυχιακών Φοιτητών
- Επίβλεψη Διδακτορικής Διατριβής της κας Ευδοξίας Κακαράντζα με Τίτλο: "The Use of Refined Asymptotic Methods to Correct the Size of the t and F Tests in Systems of Econometric Equations"

Διοικητικό Έργο:

- Επιστημονικώς υπεύθυνος του Μεταπτυχιακού Προγράμματος Σπουδών (μέχρι το 2009)
- Οργανωτής Σειράς Σεμιναρίων του Μεταπτυχιακού Προγράμματος Σπουδών (μέχρι το 2008)
- Εκπρόσωπος του Τμήματος Οικονομικών Επιστημών στην Επιτροπή Ερευνών του Πανεπιστημίου Ιωαννίνων (από Σεπτέμβριο του 2002 μέχρι Σεπτέμβριο του 2006)
- Εισηγητής για την πλήρωση θέσεων Δ.Ε.Π. του Τμήματος (Θ. Σίμος)
- Εισηγητής για την πλήρωση θέσεων Π.Δ. 407/80 του Τμήματος (Α. Σταυρακούδης)
- Εξεταστής: Εξετάσεις Εισαγωγής στο Μεταπτυχιακό Πρόγραμμα Σπουδών & Κατατακτήριες Εξετάσεις
- Συμμετοχή στην Αναβάθμιση του Προγράμματος Σπουδών
- Μέλος Επιτροπής για την παραλαβή των αγοραζόμενων ειδών, οργάνων και υλικών και τη διαπίστωση εργασιών που θα γίνουν για τις ανάγκες του Τμήματος
- Μέλος της Συγκλητικής Επιτροπής Βιβλιοθήκης του Πανεπιστημίου Ιωαννίνων (2007)

**Λοιπή Εργασιακή
Εμπειρία:**

Εαρινό εξάμηνο 2002

- Οικονομικό Πανεπιστήμιο Αθηνών, Τμήμα ΔΕΟΣ: Διδάσκων - Π.Δ. 407/80 του μαθήματος "Οικονομετρία"

Απρίλιος 2001 -
Ιούνιος 2002

**ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΟ ΑΞΙΩΝ ΑΘΗΝΩΝ
Τμήμα Έρευνας & Ανάπτυξης
Χρηματοοικονομικός Αναλυτής**

- Ανάπτυξη Χρηματιστηριακών Δεικτών
- Ανάπτυξη Νέων Προϊόντων
- Ανάλυση των εξελίξεων στην Ελληνική και τις Διεθνείς Αγορές Χρήματος και Κεφαλαίου

Ιούνιος 2000 -
Μάρτιος 2001

S. & K. ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΑΚΗ Α.Ε. - Ε.Π.Ε.Υ.
Προϊστάμενος Τμήματος Αναλύσεων και Μελετών
Χρηματοοικονομικός Αναλυτής

- Θεμελιώδης και Τεχνική Ανάλυση των Εισηγμένων στο Χ.Α.Α. Ελληνικών Μετοχών
- Κλαδικές Αναλύσεις της Ελληνικής Κεφαλαιαγοράς
- Ανάλυση των εξελίξεων στην Ελληνική και τις Διεθνείς Αγορές Χρήματος και Κεφαλαίων

Αύγουστος 1999 -
Ιούνιος 2000

ΓΕΝΕΣΙΣ ΧΡΗΜΑΤΙΣΤΗΡΙΑΚΗ Α.Ε.
Τμήμα Αναλύσεων
Χρηματοοικονομικός Αναλυτής

- Θεμελιώδης και Τεχνική Ανάλυση των Εισηγμένων στο Χ.Α.Α. Ελληνικών Μετοχών

Απρίλιος 1994 -
Αύγουστος 1999

ΙΟΝΙΚΗ & ΛΑΪΚΗ ΤΡΑΠΕΖΑ ΤΗΣ ΕΛΛΑΔΟΣ Α.Ε.
Διεύθυνση Οικονομικών Μελετών
Ερευνητής - Αναλυτής

- Ανάπτυξη εφαρμογών Αξιολόγησης Πιστοληπτικής Ικανότητας στις Λιανικές Τραπεζικές Εργασίες
- Στατιστική ανάλυση της Ελληνικής Αγοράς Αμοιβαίων Κεφαλαίων
- Μελέτες σκοπιμότητας στους τομείς της Ανάπτυξης Νέων Προϊόντων & της Υλοποίησής τους
- Υπεύθυνος για στατιστικές εφαρμογές με εξειδικευμένο στατιστικό λογισμικό (SPSS, TSP)
- Στατιστική έρευνα για την ανάπτυξη του Επιχειρηματικού Σχεδίου της Ιονικής Τράπεζας

Επί πλέον, από τον Ιούνιο 1995 μέχρι τον Νοέμβριο 1997 απασχολήθηκα ως εισηγητής σε σεμινάρια εκπαίδευσης του προσωπικού της Ιονικής Τράπεζας που διοργάνωνε η Ιονική Εκπαιδευτική Α.Ε. σχετικά με

- Εφαρμογές αξιολόγησης πιστοληπτικής ικανότητας πελατών καταναλωτικής πίστης και
- Εφαρμογές αξιολόγησης πελατών στεγαστικής πίστης

Έρευνα: Οικονομική έρευνα για το Κέντρο Οικονομικής Έρευνας του Οικονομικού Πανεπιστημίου Αθηνών (Σεπτέμβριος 1987--Δεκέμβριος 1991) στα πεδία

- Εκλεπτυσμένης Ασυμπτωτικής Θεωρίας
- Εφαρμοσμένης Στατιστικής και Οικονομικής Έρευνας

Εκπαίδευση: • Οικονομικό Πανεπιστήμιο Αθηνών (Οκτώβριος 1997--Ιανουάριος 2001): Πέντε διαλέξεις περί των τεχνικών χαρακτηριστικών των Δεικτών των Ελληνικών Αμοιβαίων Κεφαλαίων της Ιονικής Τράπεζας

- Οικονομικό Πανεπιστήμιο Αθηνών (Σεπτέμβριος 1988--Δεκέμβριος 1991): Βοηθός Εισηγητής στην "Στατιστική κατά Bayes" και την "Πολυμεταβλητή Στατιστική Ανάλυση"

Σεμινάρια που παρακολούθησα:

- **Εργαστήριο Credit Scoring της CCN**, Φεβρουάριος 1996
- **Προχωρημένες Στατιστικές Εφαρμογές με το Πρόγραμμα SPSS**, Μάρτιος 1996, SPSS Hellas S.A.
- **Σεμινάριο στο Credit Scoring**, Οκτώβριος 1996, Ένωση Ελληνικών Τραπεζών
- **Σεμινάριο στις Εκπαιδευτικές Τεχνικές**, Μάιος 1997, Ιονική Εκπαιδευτική Α.Ε.
- **Εφαρμογές Πολυκριτηριακής Μεθοδολογίας στο χρηματοοικονομικό και τραπεζικό management**, Νοέμβριος 1997, Ελληνική Εταιρεία Επιχειρησιακών Ερευνών
- **Σεμινάριο στις Τεχνικές Προβλέψεων, βραχυχρόνιες και μακροχρόνιες εφαρμογές**, Οκτώβριος 1998, Ένωση Ελληνικών Τραπεζών

Επιπρόσθετες Πληροφορίες:

- Επαρκείς γνώσεις των Linux, Windows '98 - 2000, Office 2000 (Word, Excel), SPSS, TSP, Fortran '90/95.
- Ξένες γλώσσες: Αγγλική

ΣΠΥΡΙΔΩΝ Δ. ΣΥΜΕΩΝΙΔΗΣ

ΥΠΟΜΝΗΜΑ ΕΡΕΥΝΑΣ

Διδακτορική
Διατριβή:

ΟΙΚΟΝΟΜΙΚΟ ΠΑΝΕΠΙΣΤΗΜΙΟ ΑΘΗΝΩΝ (Πρώην Α.Σ.Ο.Ε.Ε.)
Διδακτορικό στην Οικονομετρία, (1987--1991)

Τίτλος: *Εφαρμογές της Εκλεπτυσμένης Ασυμπτωτικής Θεωρίας στους Οικονομετρικούς Ελέγχους*

Επιβλέπων Καθηγητής: Μιχάλης Α. Μαγδαληνός

Επιτομή: Το γεγονός μη ύπαρξης γενικής ακριβούς θεωρίας στατιστικής συμπερασματολογίας υπαγορεύει την αποδοχή ασυμπτωτικών μεθόδων ως αποδεκτών λύσεων των συμπερασματολογικών προβλημάτων στη Στατιστική και την Οικονομετρία. Αυτή η διατριβή ασχολείται με την εφαρμογή Εκλεπτυσμένων Ασυμπτωτικών τεχνικών για τη βελτίωση μερικών πολύ γνωστών οικονομικών ελέγχων. Εναλλακτικές διορθώσεις του μεγέθους αναπτύσσονται για τους t και F ελέγχους στο Γενικευμένο Γραμμικό Υπόδειγμα, καθώς και για τους ελέγχους Anderson-Rubin-Sargan-Basmann για πιθανώς κακή εξειδίκευση μιας διαρθρωτικής εξίσωσης μέσα σε ένα Σύστημα Ταυτόχρονων Εξισώσεων. Διορθωμένες κριτικές τιμές μπορούν να υπολογιστούν με τη χρήση Edgeworth προσεγγίσεων που βασίζονται στην κανονική, Student- t , χ^2 και F κατανομή. Επιπλέον, αντί της διόρθωσης των κριτικών τιμών, μπορούμε να χρησιμοποιήσουμε Cornish-Fisher διορθώσεις των στατιστικών ελέγχου. Με αυτόν τον τρόπο αποφεύγουμε το πρόβλημα των ενδεχόμενων αρνητικών "πιθανοτήτων" στις ουρές μιας Edgeworth "κατανομής". Χρησιμοποιώντας τις ακριβείς κατανομές αντί των αντιστοιχών οριακών (ασυμπτωτικών) κατανομών βρίσκουμε προσεγγίσεις που είναι "τοπικά ακριβείς", δηλαδή μεταπίπτουν στις ακριβείς κατανομές για μια επαρκή απλοποίηση του υποδείγματος. Monte Carlo πειράματα υποστηρίζουν τις θεωρητικές απόψεις υπέρ των τοπικά ακριβών Cornish-Fisher διορθώσεων.

Δημοσιεύσεις σε
Περιοδικά και
Τόμους
με κριτές:

Seemingly Unrelated Systems of Econometric Equations, Journal of Applied Statistics (2016), Published online, <http://dx.doi.org/10.1080/02664763.2016.1182131>

Συνεργασία με την Ευδοξία Κακαράντζα

Επιτομή: Αναπτύσσουμε μια γενίκευση του υποδείγματος S.U.R. του Zellner για ένα σύνολο Φαινομενικά Ασυσχετίστων Συστημάτων Οικονομικών Εξισώσεων. Η διαρθρωτική μορφή που προκύπτει---εξειδικευμένη για ένα σύνολο Συστημάτων Ταυτόχρονων Εξισώσεων της Επιτροπής Cowles---είναι επαρκώς γενική ώστε να περιλαμβάνει κάθε εξειδίκευση Συστημάτων Οικονομικών Εξισώσεων με συσχετιζόμενους στοχαστικούς όρους. Αποτελεσματικοί εκτιμητές προκύπτουν από την από κοινού εκτίμηση όλων των συστημάτων ταυτόχρονα.

Size corrected Significance Tests in Seemingly Unrelated Regressions with Autocorrelated Errors, Journal of Time Series Econometrics vol. 9 issue 1 (Jan. 2017), **Published Online:** 2016-04-14, <https://doi.org/10.1515/jtse-2015-0014>

Συνεργασία με τον Γιάννη Καραβία και τον Ηλία Τζαβαλή

Επιτομή: Για το υπόδειγμα παλινδρόμησης S.U.R. με αυτοσυσχετιζόμενους στοχαστικούς όρους, αναπτύσσουμε διορθώσεις του μεγέθους των t και F ελέγχων. Βρίσκουμε τις διορθωμένες κατά Edgeworth κριτικές τιμές από την κανονική, Student- t , χ^2 και F κατανομή, καθώς και τα κατά Cornish-Fisher διορθωμένα, τοπικά ακριβή στατιστικά ελέγχου, των οποίων η κατανομή μετατρέπεται στην αντίστοιχη ακριβή κατανομή (Student- t ή F) για μια επαρκή απλοποίηση του υποδείγματος. Τα κατά Cornish-Fisher διορθωμένα στατιστικά ελέγχου είναι καλά ορισμένες τυχαίες μεταβλητές και δεν εμφανίζουν το πρόβλημα των αρνητικών "πιθανοτήτων" στις ουρές της κατανομής τους.

On the finite-sample distribution of the feasible GLS estimator: an application of the Cornish-Fisher correction, The Journal of World Economic Review vol. 3 number 2 (2008), σελ. 91--103.

Επιτομή: Για το γραμμικό υπόδειγμα παλινδρόμησης με μη-βαθμωτή μήτρα διακύμανσης των στοχαστικών όρων, βρίσκουμε την κατανομή σε μικρά δείγμα-

τα του εφικτού GLS εκτιμητή με μια προσέγγιση τάξης $O(\tau^3)$, $\tau=1/\sqrt{T}$ (T είναι το μέγεθος του δείγματος), χρησιμοποιώντας Edgeworth προσεγγίσεις με βάση την κανονική και την t κατανομή. Προτείνουμε Cornish-Fisher διορθώσεις του εφικτού GLS εκτιμητή προς αποφυγή του προβλήματος των αρνητικών “πιθανοτήτων” στις ουρές μιας Edgeworth “κατανομής”. Η Edgeworth προσέγγιση με βάση την t κατανομή δίνει τοπικά ακριβείς Cornish-Fisher διορθωμένους εφικτούς GLS εκτιμητές των παραμέτρων του υποδείγματος.

Cornish-Fisher Size Corrected t and F Statistics for the Linear Regression Model with Heteroscedastic Errors, G.D.A. Phillips and E. Tzavalis, ed. “The Refinement of Econometric Estimation and Test Procedures: Finite Sample and Asymptotic Analysis”, (2007), σελ. 173--204 (Cambridge University Press).

Συνεργασία με την Ελένη Κανδηλώρου και τον Ηλία Τζαβαλή

Επιτομή: Προτείνουμε τη χρήση προσαρμοσμένων για τους βαθμούς ελευθερίας Cornish-Fisher διορθωμένων t και F στατιστικών ελέγχου για το γραμμικό υπόδειγμα παλινδρόμησης με ετεροσκεδαστικούς στοχαστικούς όρους. Με μια προσέγγιση τάξης $O(\tau^3)$, $\tau=1/\sqrt{T}$ (T είναι το μέγεθος του δείγματος), τα προτεινόμενα στατιστικά ελέγχου κατανομούνται ως Student- t και F τυχαίες μεταβλητές, αντίστοιχα. Με Monte Carlo προσομοιώσεις δείχνουμε ότι σε μικρά δείγματα οι έλεγχοί μας έχουν καλύτερη συμπεριφορά από τους ασυμπτωτικούς (κλασσικούς ή διορθωμένους κατά Edgeworth) ελέγχους που δεν προσαρμόζονται για τους βαθμούς ελευθερίας.

A reinterpretation of the tests of overidentifying restrictions, Journal of Econometrics 73 (1996), σελ. 325--353.

Συνεργασία με τον Μιχάλη Α. Μαγδαληνό

Μία προγενέστερη εκδοχή του άρθρου παρουσιάστηκε στην Ευρωπαϊκή Συνάντηση της Οικονομετρικής Εταιρείας (Ουψάλα, Σουηδία, Αύγουστος 1993).

Επιτομή: Οι έλεγχοι Anderson-Rubin-Sargan-Basmann συνήθως θεωρούνται ως έλεγχοι της εγκυρότητας των υπερταυτοποιητικών διαρθρωτικών περιορισμών. Αποδεικνύουμε ότι μια ικανοποιητικότερη ερμηνεία είναι ότι ελέγχουν την εγκυρότητα των υπερταυτοποιητικών συνθηκών ορθογωνιότητας. Οι έλεγχοι χαρακτηρίζονται από αμεροληψία δεύτερης τάξης έναντι της εναλλακτικής υπόθεσης της εγκυρότητας των υπερταυτοποιητικών συνθηκών ορθογωνιότητας, ενώ όταν εξετάζεται η εναλλακτική υπόθεση της εγκυρότητας των υπερταυτοποιητικών διαρθρωτικών περιορισμών, υπάρχει ένα υποσύνολο του παραμετρικού χώρου όπου οι έλεγχοι είναι μεροληπτικοί. Υπολογίζουμε την τρίτης τάξης τοπική ισχύ υπό την υπόθεση των ψευδών συνθηκών ορθογωνιότητας και τη χρησιμοποιούμε για την εύρεση της επαγόμενης (implied) μηδενικής υπόθεσης των ελέγχων και για την διατύπωση μιας πλέον ενδελεχούς ερμηνείας. Διαφορετικές μέθοδοι διόρθωσης του μεγέθους συγκρίνονται με τη χρήση Monte Carlo πειραμάτων.

Alternative size corrections for some GLS test statistics: The case of the AR(1) model, Journal of Econometrics 66 (1995), σελ. 35--59.

Συνεργασία με τον Μιχάλη Α. Μαγδαληνό

Μία προγενέστερη εκδοχή του άρθρου παρουσιάστηκε στο 6ο Παγκόσμιο Συνέδριο της Οικονομετρικής Εταιρείας (Βαρκελώνη, Ισπανία, Αύγουστος 1990).

Επιτομή: Αναπτύσσουμε εναλλακτικές διορθώσεις του μεγέθους για τους t και F ελέγχους στο κανονικό γραμμικό υπόδειγμα με AR(1) σφάλματα. Κατά Edgeworth διορθωμένες κριτικές τιμές υπολογίζονται από την κανονική, Student- t , χ^2 και F κατανομή. Εναλλακτικά, χρησιμοποιούμε τα Cornish-Fisher διορθωμένα στατιστικά ελέγχου προς αποφυγή του προβλήματος των αρνητικών “πιθανοτήτων” στις ουρές μιας Edgeworth “κατανομής”. Χρησιμοποιώντας τις ακριβείς κατανομές (Student- t , F) βρίσκουμε προσεγγίσεις που είναι τοπικά ακριβείς, δηλαδή μεταπίπτουν στις ακριβείς κατανομές για μια επαρκή απλοποίηση του υποδείγματος. Monte Carlo πειράματα υποστηρίζουν τις θεωρητικές απόψεις υπέρ των τοπικά ακριβών Cornish-Fisher διορθώσεων.

Alternative size corrections for some significance tests in the S.U.R. model, Alogoskoufis, G., T. Kollintzas, and G. Provopoulos, ed. Essays in honor of Constantine G. Dracatos (1994), σελ. 193--216 (Εκδόσεις Παπαζήση, Αθήνα).

Συνεργασία με τον Μιχάλη Α. Μαγδαληνό

Επιτομή: Χρησιμοποιούμε εκλεπτυσμένες ασυμπτωτικές μεθόδους για να αναπτύξουμε εναλλακτικές διορθώσεις του μεγέθους των t και F ελέγχων στο Υπό-

δείγμα Φαινομενικά Ασυσχέτιστων Παλινδρομήσεων (S.U.R.). Υπολογίζουμε διορθωμένες κριτικές τιμές με τη χρήση Edgeworth προσεγγίσεων που βασίζονται στη κανονική, Student- t , χ^2 και F κατανομή. Αντί της διόρθωσης των κριτικών τιμών, προτείνουμε Cornish-Fisher διορθώσεις των στατιστικών ελέγχου προς αποφυγή του προβλήματος των αρνητικών “πιθανοτήτων” στις ουρές μιας Edgeworth “κατανομής”. Χρησιμοποιώντας τις ακριβείς κατανομές, αντί των αντιστοιχών οριακών (ασυμπτωτικών) κατανομών, βρίσκουμε προσεγγίσεις που είναι τοπικά ακριβείς, δηλαδή μετατρέπονται στις ακριβείς κατανομές για μια επαρκή απλοποίηση του υποδείγματος.

**Έρευνα σε
Εξέλιξη:**

- ***Data instigated critical values of some commonly used statistical tests***

Επιτομή: Διερευνάται η δυνατότητα ανάπτυξης μεθόδου για τον προσδιορισμό των κριτικών τιμών των οικονομετρικών ελέγχων με βάση τις πληροφορίες που περιέχονται στις παρατηρήσεις του χρησιμοποιούμενου δείγματος. Εξετάζεται η δυνατότητα ανάπτυξης τεχνικών προσδιορισμού της πλέον αντιπροσωπευτικής εναλλακτικής υπόθεσης, καθώς και της εγγύτερης εναλλακτικής υπόθεσης που μπορεί να διακριθεί στατιστικά από τη μηδενική υπόθεση του ελέγχου.

- ***Alternative size corrections for the t and F tests statistics in the linear model with long memory error terms*** (με τον Θεόδωρο Σίμο)

Επιτομή: Αναπτύσσονται εναλλακτικές διορθώσεις του μεγέθους για τους t και F ελέγχους στο κανονικό γραμμικό υπόδειγμα με αυτοσυσχέτιση μακράς μνήμης. Οι διορθωμένες κατά Edgeworth κριτικές τιμές συνάγονται από την κανονική, Student- t , χ^2 και F κατανομή και αναπτύσσονται κατά Cornish-Fisher διορθωμένα στατιστικά ελέγχου προς αποφυγή του προβλήματος των αρνητικών “πιθανοτήτων” στις ουρές μιας Edgeworth “κατανομής”. Η χρήση των ακριβών κατανομών (Student- t και F) οδηγεί σε διορθωμένα στατιστικά που είναι “τοπικά ακριβή”, με την έννοια ότι η κατανομή τους μετατρέπεται στην αντίστοιχη ακριβή κατανομή (Student- t ή F) για μια επαρκή απλοποίηση του υποδείγματος.