



**ΕΛΙΔΕΚ.**  
Ελληνικό Ίδρυμα Έρευνας & Καινοτομίας

**Περιγραφή Χρηματοδοτούμενου Ερευνητικού Έργου**  
**1η Προκήρυξη Ερευνητικών Έργων ΕΛ.ΙΔ.Ε.Κ. για την**  
**ενίσχυση των Μελών ΔΕΠ και Ερευνητών/τριών και την**  
**προμήθεια ερευνητικού εξοπλισμού μεγάλης αξίας**

**Επιστημονικός/ή Υπεύθυνος: : Καθ/της Ηλίας Τζαβαλής**

**Αντιμετώπιση του προβλήματος ενδογένειας σε υποδείγματα κατωφλίου**  
**Τίτλος Έρευνητικού Έργου:**

**Συνεργάτες καθ/τες: Δ. Χριστόπουλος, Γ. Δενδραμής και Σ Μπόικος –  
εξωτερικοί συνεργάτες καθ/τες: M. Leon-Ledesma, A. Magdalinos and P.  
McAdam)**

**Φιλικός προς τον αναγνώστη τίτλος: Ενδογένεια σε υποδείγματα κατωφλίου**

**Επιστημονική Περιοχή: Κοινωνικές Επιστήμες / Οικονομικά**

**Φορέας Προέλευσης και Χώρα: Οικονομικό Παν/μιο Αθηνών, Ελλάδα**

**Φορέας Υποδοχής: Οικονομικό Παν/μιο Αθηνών / Τμήμα Οικονομικής  
Επιστημης**

**Συνεργαζόμενος Φορέας: Παν/μιο Μακεδονίας, Παν/μιο Kent, Παν/μιο  
Southampton, Εθρωπαϊκή Κεντρική Τράπεζα.**

**Ποσό Χρηματοδότησης: 150126**

**Διάρκεια Χρηματοδότησης: 3 ΧΡΟΝΙΑ**

**Ιστοσελίδα προβολής του Έργου**

**ΕΛΙΑΔΕΚ**  
**(αντίστοιχα)**  
**Ελληνικό Ίδρυμα Έρευνας & Καινοτομίας**

Το ερευνητικό έργο αυτό σκοπεύει στην ανάπτυξη οικονομετρικών μεθόδων αντιμετώπισης του προβλήματος ενδογένειας σε οικονομετρικά υποδείγματα κατωφλίου, ή γενικότερα μη γραμμικά υποδείγματα, και γραμμικές παλινδρομήσεις στηριζόμενο στην θεωρία των *copulas*. Η θεωρία αυτή επιτρέπει ο διαταρακτικός όρος και η μεταβλητή κατωφλίου ή οποιαδήποτε άλλη μεταβλητή της παλινδρόμησης να μην είναι απαραίτητα κανονικά κατανομημένα και γραμμικά εξηρημένα, όπως συχνά θεωρείται. Αποφεύγοντας την υπόθεση της μη-κανονικότητας είναι σημαντικό, καθώς στην πράξη δεν αναμένεται πολλές από τις οικονομικές μεταβλητές να ναι κανονικά κατανομημένες. Η θεωρία των *copulas* επιτρέπει επίσης να αντιμετωπίσουμε προβλήματα ασυμμετρίας στην εξάρτηση ανάμεσα στο διαταρακτικό όρο και τις μεταβλητές της παλινδρόμησης ή την μεταβλητή κατωφλίου. Αυτές οι μορφές ασυμμετρίας έχουν σημαντικές συνέπειες σε μακροοικονομικές ή χρηματοοικονομικές μελέτες και σε μελέτες οικονομικής και κοινωνικής πολιτικής.

## Σύνοψη Ερευνητικού Έργου

Η πρωτοτυπία του επιστημονικού έργου στηρίζεται στις ακόλουθες ιδιότητες της θεωρίας των copulas. Πρώτον, οι copula συναρτήσεις μπορούν να αντιμετωπίσουν την εξάρτηση ανάμεσα σε τυχαίες μεταβλητές ανεξάρτητα από τις οριακές κατανομές τους. Δεύτερον, τα copulas μπορεί να λάβουν υπόψη τους γραμμικές και μη γραμμικές εξαρτήσεις ανάμεσα στις μεταβλητές και τέλος επιτρέπουν διαφορετικό βαθμό εξάρτησης ανάμεσα σε οικονομικά καθεστώτα. Οι παραπάνω ιδιότητες μπορούν να τύχουν μια σειρά εφαρμογών στα οικονομικά με ενδιαφέροντα αποτελέσματα από πλευράς οικονομικής και κοινωνικής πολιτικής.

## Πρωτοτυπία του Ερευνητικού Έργου

**Ένας σημαντικός αριθμός δημοσιεύσεων αναμένεται να παραχθούν από το έργο σε ακαδημαϊκά περιοδικά υψηλής αποδοχής. Δοκίμια των δημοσιεύσεων θα παρουσιαστών σε συνέδρια ή σε σεμινάρια, και θα εκδοθούν από το Οικονομικό Παν/μιο Αθηνών ή τα συνεργαζόμενα παν/μία. Η έρευνα που θα παραχθεί αναμένεται να έχει σημαντική επιρροή τόσο στην θεωρητική όσο και στην εφαρμοσμένη οικονομετρία, καθώς επίσης και σε εφαρμοσμένες μελέτες στα οικονομικά και τις κοινωνικές επιστήμες για τις οποίες το πρόβλημα ενδογένειας είναι σημαντικό και επηρεάζει τα αποτελέσματά τους.**

**Αναμενόμενα αποτελέσματα & Αντίκτυπος του  
Ερευνητικού Έργου**

Η χρηματοδότηση της έρευνας από το ΕΛΙΔΕΚ είναι πολύ σημαντική καθώς μας επιτρέπει να προσλάβουμε το κατάλληλο επιστημονική ή διοικητικό/τεχνικό προσωπικό για την ανάπτυξη των λογισμικών και των προσομοιώσεων των οικονομετρικών μεθόδων που θα αναπτυχθούν, την οργάνωση των συναντήσεων της ομάδας, των συνεδρίων και των σεμιναρίων καθώς και της διάχυσης των αποτελεσμάτων της έρευνας. Επιπλέον, θα επιτρέψει στα μέλη της ομάδας να συγκεντρωθούν πλήρως στο έργο και να αντιμετωπίσουν οποιοδήποτε διοικητικό ή άλλο κόστος συνεπάγεται αυτό.

## Η σημασία της χρηματοδότησης



**ΕΛΙΔΕΚ.**  
Ελληνικό Ίδρυμα Έρευνας & Καινοτομίας

## ΕΠΙΚΟΙΝΩΝΙΑ

Λ. Συγγρού 185 & Σάρδεων 2  
ΤΚ. 17121, Νέα Σμύρνη, Ελλάδα  
210 64 12 410, 420  
communication@elidek.gr  
[www.elidek.gr](http://www.elidek.gr)