

ΒΙΟΓΡΑΦΙΚΟ ΣΗΜΕΙΩΜΑ

Ιωάννης Α. Βενέτης

**Πανεπιστήμιο Πατρών, Τμήμα Οικονομικών Επιστημών,
Πανεπιστημιούπολη, Ρίο, 26504**

ΠΡΟΣΩΠΙΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ

Επώνυμο : Βενέτης **Όνομα :** Ιωάννης **Έτος Γέννησης :** 1972

Email : ivenetis@upatras.gr

Διεύθυνση : Πανεπιστήμιο Πατρών, Τμήμα Οικονομικών Επιστημών,
Πανεπιστημιούπολη, Ρίο, 26504

Τηλ : +30 2610 969964 **Fax:** +30 2610 997622

Ιστοσελίδα: <https://sites.google.com/site/ioannisvenetisgr/>

Στρατιωτική Θητεία : Ικανότητα Ι1, Μάιος 27, 2002 – Ιούλιος 27, 2003

ΣΠΟΥΔΕΣ

1996-2000. University of Essex, Department of Economics, U.K,
(Πανεπιστήμιο Essex, Τμήμα Οικονομικών, Μεγ. Βρετ), **Διδακτορικό
δίπλωμα στην Οικονομική Επιστήμη,** (Ph.D in Economics). Τίτλος
διδακτορικής διατριβής: «*Κείμενα σχετικά με την εκτίμηση κλασματικά
συνολοκληρωμένων συστημάτων*» (*Essays on the estimation of fractionally
cointegrated systems*).

1995-1996. University of Essex, Department of Economics, U.K,
(Πανεπιστήμιο Essex, Τμήμα Οικονομικών, Μεγ. Βρετ), **Μεταπτυχιακό
Δίπλωμα Ειδίκευσης στην Οικονομική Επιστήμη,** (MA in Economics),
απονεμήθηκε με διάκριση

1994-1995. University of Essex, Department of Economics, U.K,
(Πανεπιστήμιο Essex, Τμήμα Οικονομικών, Μεγ. Βρετ), Diploma στην
Οικονομική Επιστήμη

1990-1994. Πανεπιστήμιο Μακεδονίας, Τμήμα Οικονομικών Επιστημών.
Πτυχίο Οικονομικών Επιστημών με βαθμό (7/10). Είσοδος στο τμήμα
Οικονομικών Επιστημών: Σεπ 1990. Ολοκλήρωση σπουδών: Ιουν 1994

Φοιτητικές Διακρίσεις

- Οι διδακτορικές μου σπουδές χρηματοδοτήθηκαν, (Σεπ 1996- Σεπ 1999), από το Οικονομικό τμήμα του Πανεπιστημίου του Essex μέσω ερευνητικής και διδακτικής υποτροφίας ("Research and Teaching Studentship") που περιλάμβανε και ετήσια κάλυψη των διδάκτρων των διδακτορικών σπουδών
- Οι σπουδές μου για την απόκτηση του Μεταπτυχιακού Διπλώματος Ειδίκευσης στα Οικονομικά επίσης χρηματοδοτήθηκαν από το Οικονομικό τμήμα του Πανεπιστημίου του Essex μέσω των υποτροφιών E.S.F, (European Social Fund bursaries)
- Μου απονεμήθηκε από το Πανεπιστήμιο του Essex, Τμήμα Οικονομικών, το βραβείο "**Leatherland Book Prize Award**" για την καλύτερη τελική βαθμολογία στα μεταπτυχιακά προγράμματα σπουδών του τμήματος την ακαδημαϊκή χρονιά 1995-1996

ΤΡΕΧΟΥΣΑ ΘΕΣΗ

- **Αυγ 2013 - : Αναπληρωτής Καθηγητής** στο Πανεπιστήμιο Πατρών, Τμήμα Οικονομικών Επιστημών, Γνωστικό Αντικείμενο «Οικονομετρία»

Και

- **Οκτ 2013 - Συνεργαζόμενο Εκπαιδευτικό Προσωπικό (Σ.Ε.Π)**, Ελληνικό Ανοικτό Πανεπιστήμιο, μάθημα: ΔΕ013 - Ποσοτικές Μέθοδοι, στη θεματική Ενότητα "Διοίκηση Επιχειρήσεων και Οργανισμών".

Μαθήματα που διδάσκω

Προπτυχιακό:

- Οικονομετρία (3^ο έτος, Χειμερινό εξάμηνο, Υποχρεωτικό)
- Μαθηματικά για Οικονομολόγους I (1^ο έτος, Χειμερινό εξάμηνο, Υποχρεωτικό)
- Μαθηματικά για Οικονομολόγους II (1^ο έτος, Εαρινό εξάμηνο, Υποχρεωτικό)
- Εφαρμοσμένη Οικονομετρία (3ο -4ο έτος, Χειμερινό εξάμηνο, Επιλογής)

**Μεταπτυχιακό (Π.Μ.Σ «Εφαρμοσμένη Οικονομική & Ανάλυση Δεδομένων»,
Τμήμα Οικονομικών Επιστημών, Παν. Πατρών):**

- Εφαρμοσμένη Μακρο-Οικονομετρία (Applied Macroeconometrics), υποχρεωτικό μάθημα 1^{ου} εξαμήνου μεταπτυχιακού προγράμματος.

Μαθήματα που έχω διδάξει

Προπτυχιακό

- Μαθηματική Οικονομική (Σεπ 2005 – Ιουν 2011, 3ο -4ο έτος, Εαρινό εξάμηνο, Επιλογής)

Μεταπτυχιακό:

- Οικονομετρία (Σεπ 2005 – Σεπ 2009)
- Ειδικά Θέματα Οικονομετρίας (Φεβ 2006 – Σεπ 2009)
- Ειδικά Θέματα Ποσοτικής Ανάλυσης (Οκτ 2009- Ιαν 2011)
- Ανάλυση Χρονοσειρών και Προβλέψεις (Φεβ 2010 – Ιουν 2011)

Διοικητικές και άλλες ακαδημαϊκές δραστηριότητες

- Διευθυντής του Προγράμματος Μεταπτυχιακών Σπουδών, 2015 -
- Ήμουν μέλος της Συντονιστικής Επιτροπής (Σ.Ε) του Μεταπτυχιακού Προγράμματος Σπουδών από το 2005
- Διοργάνωση του εσωτερικού σεμιναρίου παρουσιάσεων διδακτορικών φοιτητών/τριών του τμήματος 2010/2011 , 2011/2012 , 2012/2013
- Είμαι επιστημονικός υπεύθυνος του προγράμματος πρακτικής άσκησης των φοιτητών του Τμήματος Οικονομικών Επιστημών του Παν. Πατρών, διάρκεια έργου 2010-2013, 2014-2015
- Έχω επιβλέψει την εκπόνηση **20 μεταπτυχιακών εργασιών** στα πλαίσια της απόκτησης του μεταπτυχιακού διπλώματος ειδίκευσης του Τμήματος Οικονομικών Επιστημών του Παν. Πατρών από το 2005 μέχρι και το 2011
- Επιβλέπω **2 διδακτορικούς φοιτητές**. Έχω επιβλέψει επιτυχώς **3 διδακτορικές διατριβές**.

ΠΡΟΗΓΟΥΜΕΝΗ ΕΜΠΕΙΡΙΑ

Νοε 2008 - : Ιουλ 2013 Μόνιμος Επίκουρος Καθηγητής στο Πανεπιστήμιο Πατρών, Τμήμα Οικονομικών Επιστημών, Γνωστικό Αντικείμενο «Οικονομετρία»

Φεβ 2005 - Οκτ 2008 Επίκουρος Καθηγητής στο Πανεπιστήμιο Πατρών, Τμήμα Οικονομικών Επιστημών, Γνωστικό Αντικείμενο «Οικονομετρία»

2003-2008, Συνεργαζόμενο Εκπαιδευτικό Προσωπικό (Σ.Ε.Π).
2009-2011, Ελληνικό Ανοικτό Πανεπιστήμιο. Έχω διδάξει Ποσοτικές
2013-2015 Μεθόδους στη θεματική Ενότητα “Διοίκηση Επιχειρήσεων και Οργανισμών” (μάθημα Δ.Ε.Ο 13)

Ιαν 2004 - Φεβ 2005. Ερευνητής Γ' Βαθμίδας στο ΚΕΠΕ (Κέντρο Προγραμματισμού και Οικονομικών Ερευνών)

Απρ 2000 - Μαΐ 2002. Ερευνητικός Συνεργάτης, Μεταδιδακτορικό (Research Associate, Post Doctoral position), Cardiff Business School. Από την 1η Απριλίου μέχρι την 31η Μαρτίου εργάστηκα σε ένα διετές ερευνητικό πρόγραμμα χρηματοδοτούμενο από το ESRC, (European Social Research Council). Το πρόγραμμα είχε τίτλο: “Nonlinear Adjustment mechanisms and the asymmetric impact of shocks” και ήταν μέρος του ευρύτερου προγράμματος του ESRC με τίτλο: “UNDERSTANDING THE EVOLVING MACROECONOMY”. Εργοδότης μου και επιβλέπων καθηγητής του προγράμματος ήταν ο καθηγητής David Peel. Το συμβόλαιό μου ανανεώθηκε για δύο επιπλέον μήνες (Απρίλιο και Μάιο 2002) παρ’ότι είχα επιστρέψει στην Ελλάδα για να εκπληρώσω τις στρατιωτικές μου υποχρεώσεις. Η συνολική εργασία μας για το πρόγραμμα έλαβε εξαιρετική μνεία από το ESRC. Για περισσότερες πληροφορίες παρακαλώ επικοινωνήστε με τον καθηγητή κ. David Peel.

Οκτ 2000 - Μαρ 2002. Επικουρική διδασκαλία (Teaching associate), Επιχειρηματική Σχολή Cardiff. Επικουρική διδασκαλία σε προπτυχιακό επίπεδο, (α) Εφαρμοσμένα Οικονομικά και μεταπτυχιακό επίπεδο (α) Οικονομετρία και (β) Υπολογιστικές Μέθοδοι (αφορούσαν την χρήση του Microfit 4.0 σε μεταπτυχιακό επίπεδο)

Οκτ 1996 - Ιουν 1999. Επικουρική διδασκαλία (Teaching assistant), Πανεπιστήμιο του Essex. Επικουρική διδασκαλία φροντιστηριακού τύπου με λύση ασκήσεων σε προπτυχιακό επίπεδο (2ο έτος) των μαθημάτων: (α) Μαθηματικά για Οικονομολόγους (β) Οικονομετρία (γ) Μικροοικονομική θεωρία (με έμφαση στη θεωρία παιγνίων). Συνολικά 360 ώρες διδασκαλίας

ΔΗΜΟΣΙΕΥΣΕΙΣ (ΜΕ ΔΙΑΔΙΚΑΣΙΑ ΚΡΙΣΗΣ)

1. Venetis I.A & Salamaliki P.K (2015). Unit roots and trend breaks in the Greek labor market. *Journal of Economic Studies*, Vol. 42, Iss 4, 641-658
2. Siakoulis V.G & Venetis I.A (2015). On inter-arrival times of bond market extreme events. An application to seven European markets. *Journal of Economics and Finance*, Volume 39, Issue 4, 717-741
3. Chatzikonstanti V & Venetis I.A (2015). Long memory in log-range series: Do structural breaks matter? *Journal of Empirical Finance*, 33, 104-113
4. Salamaliki P.K & Venetis I.A (2014). Smooth transition trends and labor force participation rates in the United States. *Empirical Economics*, March 2014, Volume 46, Issue 2, 629-652
5. Salamaliki P.K & Venetis I.A (2013). Energy consumption and real GDP in G-7: Multi-horizon causality testing in the presence of capital stock. *Energy Economics*, Volume 39, 108-121
6. Salamaliki P.K & Venetis I.A & Giannakopoulos N (2013). The causal relationship between female labor supply and fertility in the USA: updated evidence via a time series multi-horizon approach. *Journal of Population Economics*, Volume 26(1), 109-145
7. Venetis I.A & Paya I & Peel D.A (2007). Deterministic impulse response in a nonlinear model. An analytical expression. *Economics Letters*, vol. 95(3), 315-319
8. Duarte A & Venetis I.A & Paya I (2005). Predicting real growth and the probability of recession in the Euro area using the yield spread. *International Journal of Forecasting*, vol. 21(2), 261-277
9. Venetis I.A & Peel D.A (2005). Non-linearity in stock index returns: the volatility and serial correlation relationship. *Economic Modelling*, vol. 22(1), 1-19
10. Peel D.A & Venetis I.A (2005). Smooth Transition Models and Arbitrage Consistency. *Economica*, vol. 72(3), 413-430
11. Peel D.A & Paya I & Venetis I.A (2004). Estimates of US monetary policy rules with allowance for changes in the output gap. *Applied Economics Letters*, vol. 11(10), 601-605
12. Duarte A & Venetis I.A & Paya I (2004). Curva de rendimientos y crecimiento de la producción real en la UEM: eficiencia y estabilidad predictiva./Yield Curve and Real Output Growth in the EMU: Efficiency and Predictive Stability. *Estudios de Economía Aplicada*, vol. 22(1), 1-21
13. Peel D.A & Peel M.J & Venetis I.A (2004). Further empirical analysis of the time series properties of financial ratios based on a panel data approach. *Applied Financial Economics*, vol. 14(3), 155-163

14. Venetis I.A & Peel D.A & Paya I (2004). Asymmetry in the link between the yield spread and industrial production: threshold effects and forecasting. *Journal of Forecasting*, vol. 23(5), 373-384
15. Venetis I.A & Paya I & Peel D.A (2003). Re-examination of the predictability of economic activity using the yield spread: a nonlinear approach. *International Review of Economics & Finance*, vol. 12(2), 187-206
16. Paya I & Venetis I.A & Peel D.A (2003). Further Evidence on PPP Adjustment Speeds: the Case of Effective Real Exchange Rates and the EMS. *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, vol. 65(4), 421-437
17. Peel D.A & Venetis I.A (2003). Purchasing power parity over two centuries: trends and nonlinearity. *Applied Economics*, vol. 35(5), 609-617

ΕΤΕΡΟΑΝΑΦΟΡΕΣ (πηγή SCOPUS, author ID 6506807268)

Μέχρι Μάιο 2015: ετεροαναφορές: 137 (Citations:137 total citations by 125 documents), h-index: 7

ΤΡΕΧΟΥΣΕΣ ΕΡΕΥΝΗΤΙΚΕΣ ΕΡΓΑΣΙΕΣ

1. Venetis, I., (2015). Log-range based detection of random level shifts, (work in progress)
2. Economic Policy Uncertainty effects through VAR models
3. Trend structural breaks
4. Forecasting using factor models

ΔΟΚΙΜΙΑ ΕΡΓΑΣΙΑΣ

1. Venetis I.A & Emmanuilidi E 2005. Tail-Fatness in Equity Returns. The Case of Athens Stock Exchange. Centre of Planning and Economic Research, Working paper No. 77
2. Naraidoo R & Minford P & Venetis I.A 2006. The political economy of unemployment and threshold effects. A nonlinear time series approach. Keele Economics Research Papers KERP 2006/21, Centre for Economic Research, Keele University.
3. Venetis I.A & Duarte A & Paya I 2006. The long memory story of real interest rates. Can it be supported? Working Papers 004341, Lancaster University Management School, Economics Department.
4. Sibbertsen P & Venetis I.A 2003. Distinguishing between long-range dependence and deterministic trends. Universitat Dortmund, Technical Report 16/2003, SFB 475.
5. Venetis I.A & Paya I & Peel D 2009. ESTAR model with multiple fixed points. Testing and estimation. Lancaster University Management School Working Paper 2009/010

ΛΟΙΠΕΣ ΔΗΜΟΣΙΕΥΣΕΙΣ

1. Βενέτης, Ιωάννης & Ζωγραφάκης, Σταύρος, (2008). «Πληθωρισμός και σταθερότητα: Μια προβληματική σύγκλιση», Έκδοση Πρακτικών Συνεδρίου του Ιστορικού Αρχείου της ALPHA BANK με τίτλο «Ελληνική Οικονομία: Κρίσιμα Ζητήματα Οικονομικής Πολιτικής» που έλαβε χώρα στο Ναύπλιο 1^η-2^η Ιουνίου 2007 . Επιμέλεια έκδοσης Τάσος Γιαννίτσης
2. Βενέτης Ιωάννης, (2004). «Προς ένα βραχυχρόνιο δείκτη μέτρησης της οικονομικής δραστηριότητας», Οικονομικές Εξελίξεις, Τεύχος 5, Απρίλιος, Κέντρο Προγραμματισμού και Οικονομικών Ερευνών (ΚΕΠΕ)

ΒΙΒΛΙΑ

- Εισαγωγή στην Οικονομετρία. Συγγραφέας: Ιωάννης Α. Βενέτης, Εκδόσεις: ΓΚΟΤΣΗΣ ΚΩΝ/ΝΟΣ & ΣΙΑ Ε.Ε, ISBN: 978-960-9427-25-8, 2013

ΕΠΙΜΕΛΕΙΑ ΜΕΤΑΦΡΑΣΗΣ

Επιμέλεια μετάφρασης από την Αγγλική στην Ελληνική του βιβλίου των **J., Johnston και J., DiNardo**, "**Econometric Methods**". Εκδόσεις Κλειδάριθμος 2005

ΚΡΙΤΗΣ

Applied Economics • Applied Financial Economics • Economic Modelling • Emerging Markets Finance and Trade • Emerging Markets Review • Empirical Economics • Energy Economics • International Journal of Finance and Economics • International Journal of Forecasting • International Review of Financial Analysis • Journal of Economic Growth • Journal of Economic Studies • Journal of International Financial Markets and Institutions • Journal of International Money and Finance • Journal of Money, Credit and Banking • The Manchester School • Quarterly Review of Economics and Finance • Singapore Economic Review • Sustainability • South-Eastern Europe Journal Of Economics

ΠΡΟΓΡΑΜΜΑΤΑ

- **09/2010 – 12/2015, Επιστημονικός Υπεύθυνος**, Πρόγραμμα Πρακτικής Άσκησης, Τμήματος Οικονομικών Επιστημών, Πανεπιστημίου Πατρών, Φορέας διαχείρισης του Προγράμματος: Πανεπιστήμιο Πατρών, Ειδικός λογαριασμός κονδυλίων έρευνας (ΕΛΚΕ), Φορέας χρηματοδότησης: ΕΣΠΑ 2007 – 2013
- **01/02/2010 – 31/01/2013, Επιστημονικός Επιβλέπων**. Πρόγραμμα Καραθεοδωρή 2009. Τίτλος: Μελέτες σχετικά με την ανίχνευση διαρθρωτικών μεταβολών στην «αστάθεια» των αποδόσεων χρηματοοικονομικών περιουσιακών στοιχείων. (Essays on the detection of volatility structural breaks in asset returns.) Στα πλαίσια του προγράμματος δίδεται υποτροφία στην υποψήφια διδάκτωρ του τμήματος Οικονομικών Επιστημών κα Βασιλική Χατζηκωνσταντή. Φορέας διαχείρισης του Προγράμματος: Πανεπιστήμιο Πατρών, Ειδικός λογαριασμός κονδυλίων έρευνας (ΕΛΚΕ), Φορέας χρηματοδότησης: Πανεπιστήμιο Πατρών, Ειδικός λογαριασμός κονδυλίων έρευνας (ΕΛΚΕ)
- **01/03/2009 – 30/09/2009, Επιστημονικός Υπεύθυνος μαζί με τον Δρ. Τζαγκαράκη Εμμανουήλ**, Λέκτορα του Τμήματος Οικονομικών Επιστημών, Παν. Πατρών. Τίτλος: «Ελληνοποίηση ελεύθερου λογισμικού ανοιχτού κώδικα GRETΛ (Λογισμικό διδασκαλίας Οικονομετρίας)» , http://www.ellak.gr/index.php?option=com_openwiki&Itemid=103&id=ellak:gretl. Φορέας διαχείρισης του Προγράμματος: Εταιρεία Ελεύθερου Λογισμικού / Λογισμικού Ανοικτού Κώδικα (ΕΕΛ/ΛΑΚ), Φορέας χρηματοδότησης: ΕΕΛ/ΛΑΚ

- **01/11/2007 – 30/04/2010, Επιστημονικός Υπεύθυνος** για το τμήμα Οικονομικών Επιστημών που συμμετείχε ως partner. Τίτλος προγράμματος: “Reinforcing investments in biogas technologies for small-scale RES applications in islands” Φορέας διαχείρισης του Προγράμματος: ΕΠΤΑ Α.Ε, Φορέας χρηματοδότησης: Ε.Ε
- **01/04/2006 – 31/05/2008, Επιστημονικός Συνεργάτης**, Τίτλος: “ΜΕΘΟΔΙΚΑ: Ανάπτυξη Μεθόδων Οργάνωσης, Διοίκησης και Λειτουργίας Κατανεμημένων Εικονικών Επιχειρήσεων Ανάπτυξης Συστημάτων Πληροφορικής”, Φορέας διαχείρισης του Προγράμματος: ΓΓΕΤ, Φορέας χρηματοδότησης: ΓΓΕΤ

ΣΥΝΕΔΡΙΑ

Το πρώτο κεφάλαιο της διδακτορικής μου διατριβής με τίτλο “Cointegration with fractionally integrated errors and fractional cointegration” έγινε δεκτό και παρουσιάστηκε στο Young Economists Conference 2000, στο Πανεπιστήμιο της Οξφόρδης τον Μάρτιο του **2000**.

“Analysis of the Spread in the EMU and its predictive ability over the Euro-land real activity”. Co-authors: Dr. Ivan Paya and Prof. Agustin Duarte. Παρουσιάστηκε στο Eleventh Annual Symposium of the Society for Nonlinear Dynamics and Econometrics (SNDE) στην Villa La Pietra στην Φλωρεντία Ιταλία, 13-15 Μαρτίου **2003**

1ο Εθνικό Συνέδριο Επιστημονικής Εταιρείας Χρηματοοικονομικής Μηχανικής & Τραπεζικής, Αθήνα, Δεκέμβριος 3-4, 2010. Paper: Siakoulis, V.G., & Venetis, I.A., (**2010**). Contagious bank failures. Determinant factors and prediction.

8th Augustin Cournot Doctoral Conference (ACDD) April **2011**, Strasbourg, France. Paper: Salamaliki, P.K., & Venetis, I.A., (2011). Energy Consumption and real GDP in G-7 : multi-horizon causality testing in the presence of capital stock.

2ο Εθνικό Συνέδριο Επιστημονικής Εταιρείας Χρηματοοικονομικής Μηχανικής & Τραπεζικής, Αθήνα, Δεκέμβριος 2-3-4, **2011**. Paper: Siakoulis, V.G., & Venetis, I.A., (2011). Contagious stock crises in developing markets.

5th CSDA International Conference on Computational and Financial Econometrics (CFE'11) 17-19 December **2011**, Senate House, University of London, UK. Paper: Chatzikonstanti, V.I., & Venetis, I.A., (2012). Log-range based detection of volatility mean breaks.

3ο Εθνικό Συνέδριο Επιστημονικής Εταιρείας Χρηματοοικονομικής Μηχανικής & Τραπεζικής, Αθήνα, Δεκέμβριος 17-18, **2012**. Paper: Siakoulis, V.G., & Venetis, I.A., (2012). On inter-arrival times of bond market extreme events. An application to seven European markets.

ΠΡΟΣΦΑΤΕΣ ΠΑΡΟΥΣΙΑΣΕΙΣ ΣΕ ΣΥΝΕΔΡΙΑ

- *Testing and measuring multi-horizon causality in VAR models: Two new user-written functions for the Gretl time series menu.* 4th biennial gretl Conference June 12-13, 2015, Berlin, Germany, Hans Boeckler Foundation and Free University of Berlin
- *Transmission channels of economic uncertainty effects on macroeconomic activity.* 2nd Annual Conference of the International Association for Applied Econometrics (IAAE), June 25-27, 2015, hosted by the University of Macedonia, Thessaloniki, Greece

ΕΡΕΥΝΗΤΙΚΑ ΕΝΔΙΑΦΕΡΟΝΤΑ

Θεωρητική οικονομετρία με έμφαση στον τομέα των ασυμπτωτικών κατανομών εκτιμητών και στατιστικών που περιέχουν μη-στάσιμες χρονοσειρές, χρονοσειρές μακροχρόνιας μνήμης και μη-γραμμικές συναρτήσεις χρονοσειρών καθώς και η διερεύνηση διαρθρωτικών μεταβολών σε κύρια συστατικά της χρονοσειράς όπως η τάση, ο τύπος της τάσης (προσδιοριστική ή στοχαστική), το επίπεδο της «εμμονής» της χρονοσειράς.

Εφαρμοσμένη Οικονομετρία με έμφαση στην υποδειματοποίηση μακροοικονομικών και χρηματοοικονομικών χρονοσειρών. Ειδικότερα,

- Μη-γραμμικά υποδείγματα χρονοσειρών τύπου threshold και smooth transition
- Διαρθρωτικές μεταβολές στις τάσεις χρονοσειρών
- Υποδείγματα VAR, αιτιότητα και διαρθρωτικές μεταβολές
- Υποδείγματα δεσμευμένης ετεροσκεδαστικότητας (ARCH/GARCH)
- Διαρθρωτικές μεταβολές στην υπο-συνθήκη διακύμανση
- Υποδείγματα διακριτών θετικών χρονοσειρών Poisson (autoregressive conditional Poisson models)
- Υποδείγματα δεσμευμένης διάρκειας (conditional duration models)
- Υποδείγματα δυναμικών κοινών παραγόντων (dynamic factor models)