

ΒΙΟΓΡΑΦΙΚΟ ΣΗΜΕΙΩΜΑ

Ιωάννης Α. Βενέτης

ΠΡΟΣΩΠΙΚΑ ΣΤΟΙΧΕΙΑ

Επώνυμο : Βενέτης
Όνομα : Ιωάννης
Email : ivenetis@upatras.gr
Διεύθυνση : Πανεπιστήμιο Πατρών, Τμήμα Οικονομικών Επιστημών,
Πανεπιστημιούπολη, Ρίο, 26504
Τηλ : +30 2610 969964
Ιστοσελίδα: <https://www.econ.upatras.gr/el/people/teaching-staff/venetis-ioannis>

ΣΠΟΥΔΕΣ

- 1996-2000. University of Essex, Department of Economics, U.K.** (Πανεπιστήμιο Essex, Τμήμα Οικονομικών, Η.Β.), **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*). <https://ethos.bl.uk/OrderDetails.do?uin=uk.bl.ethos.364513>
- 1995-1996. University of Essex, Department of Economics, U.K.** (Πανεπιστήμιο Essex, Τμήμα Οικονομικών, Η.Β.), **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, Η.Β.), **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»

Μαθήματα που διδάσκω (2020/21). Παν. Πατρών

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)

Μεταπτυχιακό

- Εφαρμοσμένη Μακρο-Οικονομετρία (Applied Macro-econometrics), υποχρεωτικό μάθημα 1^ο εξαμήνου. Πρόγραμμα Μεταπτυχιακών Σπουδών «Εφαρμοσμένη Οικονομική & Ανάλυση Δεδομένων», Τμήμα Οικονομικών Επιστημών, Παν. Πατρών.

Μαθήματα που έχω διδάξει

Προπτυχιακό

- Μαθηματική Οικονομική (Σεπ 2005 – Ιουν 2011, 3ο - 4ο έτος, Εαρινό εξάμηνο, Επιλογής)
- Εφαρμοσμένη Οικονομετρία (3ο - 4ο έτος, Εαρινό εξάμηνο, Επιλογής)
- Εφαρμοσμένη Οικονομετρία (3ο - 4ο έτος, Εαρινό εξάμηνο, Επιλογής) στους φοιτητές/τριες Erasmus

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

- **Πρόεδρος** του Τμήματος Οικονομικών Επιστημών του Πανεπιστημίου Πατρών, **05/2021 - μέχρι σήμερα**
- Είμαι επιστημονικός υπεύθυνος του προγράμματος πρακτικής άσκησης των φοιτητών του Τμήματος Οικονομικών Επιστημών του Παν. Πατρών, διάρκεια έργου **2010/2011 - μέχρι σήμερα**
- Μέλος της Συντονιστικής Επιτροπής (Σ.Ε) του Μεταπτυχιακού Προγράμματος Σπουδών, **2005 - μέχρι σήμερα**
- **Διευθυντής** του Προγράμματος Μεταπτυχιακών Σπουδών, **2015 - 2017**
- Διοργάνωση του εσωτερικού σεμιναρίου παρουσιάσεων διδακτορικών φοιτητών/τριών του τμήματος **2010/2011 , 2011/2012 , 2012/2013**
- Έχω επιβλέψει την εκπόνηση **μεγάλου αριθμού μεταπτυχιακών εργασιών** στα πλαίσια της απόκτησης του μεταπτυχιακού διπλώματος ειδίκευσης του Τμήματος Οικονομικών Επιστημών του Παν. Πατρών από το 2005 μέχρι και το 2011 και από το 2015 μέχρι σήμερα
- Επιβλέπω **3 διδακτορικούς φοιτητές**. Έχω επιβλέψει **επιτυχώς 4** διδακτορικές διατριβές.

ΠΡΟΗΓΟΥΜΕΝΗ ΕΜΠΕΙΡΙΑ

Παν. Πατρών

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»

15 έτη υπηρεσία ως Σ.Ε.Π στο Ελληνικό Ανοικτό Πανεπιστήμιο

2003-2008, Συνεργαζόμενο Εκπαιδευτικό Προσωπικό (Σ.Ε.Π),
2009-2011, Ελληνικό Ανοικτό Πανεπιστήμιο. Μάθημα: ΔΕ013
2013-2017 «Ποσοτικές μέθοδοι», στο πρόγραμμα σπουδών «Διοίκηση Επιχειρήσεων και Οργανισμών (ΔΕΟ)»

2017-2021 Συνεργαζόμενο Εκπαιδευτικό Προσωπικό (Σ.Ε.Π),
Ελληνικό Ανοικτό Πανεπιστήμιο. Μάθημα: ΔΕ041 «Αγορές Χρήματος και Κεφαλαίου», στο πρόγραμμα σπουδών «Διοίκηση Επιχειρήσεων και Οργανισμών (ΔΕΟ)»

Ερευνητής

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

Μεταδιδακτορικός Ερευνητής

Απρ 2000 – Μαϊ 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.

Κατά τη διάρκεια των Διδακτορικών Σπουδών

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)

(επικαιροποίηση 27/05/20220)

1. Krimpas, N.A., Salamaliki, P.K., Venetis, I.A. Factor decomposition of disaggregate inflation: The case of Greece (2021) *International Journal of Computational Economics and Econometrics*, 11 (1), pp. 84-104.
DOI: 10.1504/IJCEE.2021.111713
AUTHOR KEYWORDS: Disaggregate CPI; Dynamic factor model; Greece; Pure inflation; Relative prices
2. Lucchetti, R., Venetis, I.A. A replication of a quasi-maximum likelihood approach for large, approximate dynamic factor models (Review of economics and statistics, 2012) (2020) *Economics*, 14, art. no. 2020-14, pp. 1-14.
DOI: 10.5018/economics-ejournal.ja.2020-14
AUTHOR KEYWORDS: Dynamic factor models; EM algorithm; Kalman filter; Principal components
3. Salamaliki, P.K., Venetis, I.A. TRANSMISSION CHAINS of ECONOMIC UNCERTAINTY on MACROECONOMIC ACTIVITY: NEW EMPIRICAL EVIDENCE (2019) *Macroeconomic Dynamics*, 23 (8), pp. 3355-3385. Cited 1 time.
DOI: 10.1017/S1365100518000081
AUTHOR KEYWORDS: Causality Measure; Economic Uncertainty; Macroeconomic Activity; Multi-Horizon Causality; Transmission Chains
4. Siakoulis, V.G., Venetis, I.A. On inter-arrival times of bond market extreme events. An application to seven European markets (2015) *Journal of Economics and Finance*, 39 (4), pp. 717-741. Cited 1 time.
DOI: 10.1007/s12197-013-9276-9
AUTHOR KEYWORDS: Autoregressive conditional duration; Co-exceedance; Sovereign bond yields; Structural breaks
5. Venetis, I.A., Salamaliki, P.K. Unit roots and trend breaks in the Greek labor market (2015) *Journal of Economic Studies*, 42 (4), pp. 641-658. Cited 2 times.
DOI: 10.1108/JES-12-2013-0194
AUTHOR KEYWORDS: Labour market time series; Structural change; Trend break; Unemployment; Unit roots
6. Chatzikonstanti, V., Venetis, I.A. Long memory in log-range series: Do structural breaks matter? (2015) *Journal of Empirical Finance*, 33, pp. 104-113. Cited 9 times.
DOI: 10.1016/j.jempfin.2015.06.003
AUTHOR KEYWORDS: Log-range volatility proxy; Long memory; Stock market; Structural breaks
7. Salamaliki, P.K., Venetis, I.A. Smooth transition trends and labor force participation rates in the United States (2014) *Empirical Economics*, 46 (2), pp. 629-652. Cited 5 times.
DOI: 10.1007/s00181-013-0690-9

AUTHOR KEYWORDS: Deterministic smooth transition; Labor force participation rate; Non-linear trend; Unit root

8. Psomopoulos, C.S., Venetis, I., Themelis, N.J. The impact from the implementation of "Waste to Energy" to the economy. A macroeconomic approach for the trade balance of Greece (2014) *Fresenius Environmental Bulletin*, 23 (11), pp. 2735-2741. Cited 7 times.

AUTHOR KEYWORDS: Greenhouse gasses emission reduction; Gross domestic product (GDP); Investment; Trade balance; Waste to Energy (WTE)

9. Salamaliki, P.K., Venetis, I.A. Energy consumption and real GDP in G-7: Multi-horizon causality testing in the presence of capital stock (2013) *Energy Economics*, 39, pp. 108-121. Cited 22 times.

DOI: 10.1016/j.eneco.2013.04.010

AUTHOR KEYWORDS: Capital stock; Energy consumption; Multiple horizon causality; Real GDP; Structural breaks

10. Salamaliki, P.K., Venetis, I.A., Giannakopoulos, N. The causal relationship between female labor supply and fertility in the USA: Updated evidence via a time series multi-horizon approach (2013) *Journal of Population Economics*, 26 (1), pp. 109-145. Cited 8 times.

DOI: 10.1007/s00148-012-0418-8

AUTHOR KEYWORDS: Female labor supply; Fertility; Multi-horizon causality

11. Venetis, I.A., Paya, I., Peel, D.A. Deterministic impulse response in a nonlinear model. An analytical expression (2007) *Economics Letters*, 95 (3), pp. 315-319. Cited 2 times.

DOI: 10.1016/j.econlet.2006.10.007

AUTHOR KEYWORDS: ESTAR; Impulse response; Lambert W-function

12. Peel, D.A., Venetis, I.A. Smooth transition models and arbitrage consistency (2005) *Economica*, 72 (287), pp. 413-430. Cited 17 times.

DOI: 10.1111/j.0013-0427.2005.00423.x

13. Duarte, A., Venetis, I.A., Paya, I. Predicting real growth and the probability of recession in the Euro area using the yield spread (2005) *International Journal of Forecasting*, 21 (2), pp. 261-277. Cited 37 times.

DOI: 10.1016/j.ijforecast.2004.09.008

AUTHOR KEYWORDS: Forecasting accuracy; Recession; Term spread and real growth; Threshold models

14. Venetis, I.A., Peel, D. Non-linearity in stock index returns: The volatility and serial correlation relationship (2005) *Economic Modelling*, 22 (1), pp. 1-19. Cited 9 times.

DOI: 10.1016/j.econmod.2003.08.004

AUTHOR KEYWORDS: Autocorrelation; Non-linear; Volatility

15. Peel, D.A., Paya, I., Venetis, I. Estimates of US monetary policy rules with allowance for changes in the output gap (2004) *Applied Economics Letters*, 11 (10), pp. 601-605. Cited 1 time.

DOI: 10.1080/1350485042000227287

16. Paya, I., Venetis, I.A., Peel, D.A. Asymmetry in the link between the yield spread and industrial production: Threshold effects and forecasting (2004) *Journal of Forecasting*, 23 (5), pp. 373-384. Cited 2 times.

DOI: 10.1002/for.921

AUTHOR KEYWORDS: Forecasting; Industrial production; Predictive accuracy; Threshold model; Yield spread

17. Peel, D.A., Peel, M.J., Venetis, I.A. Further empirical analysis of the time series properties of financial ratios based on a panel data approach (2004) *Applied Financial Economics*, 14 (3), pp. 155-163. Cited 8 times.
DOI: 10.1080/0960310042000187342
18. Peel, D.A., Venetis, I.A. Purchasing power parity over two centuries: Trends and nonlinearity (2003) *Applied Economics*, 35 (5), pp. 609-617. Cited 30 times.
DOI: 10.1080/0003684022000035773
19. Paya, I., Venetis, I.A., Peel, D.A. Further evidence on PPP adjustment speeds: The case of effective real exchange rates and the EMS (2003) *Oxford Bulletin of Economics and Statistics*, 65 (4), pp. 421-437. Cited 41 times.
DOI: 10.1111/1468-0084.t01-1-00055
20. Venetis, I.A., Paya, I., Peel, D.A. Re-examination of the predictability of economic activity using the yield spread: A nonlinear approach (2003) *International Review of Economics and Finance*, 12 (2), pp. 187-206. Cited 31 times.
DOI: 10.1016/S1059-0560(02)00147-8
AUTHOR KEYWORDS: Real GDP growth; Smooth transition nonlinearity; STR; Time-varying parameters; TV-STR models; Yield spread

ΕΤΕΡΟΑΝΑΦΟΡΕΣ

- **SCOPUS:** author ID 6506807268, Ετεροαναφορές: 233 (233 total citations by 214 documents), h-index: **8**
- **Google Scholar:** Ετεροαναφορές: 508, h-index: **11**,
<https://scholar.google.gr/citations?user=STKypqYAAAAI&hl=el&oi=ao>

ΕΡΓΑΣΙΕΣ ΠΡΟΣ ΣΥΖΗΤΗΣΗ

1. Lucchetti R. & Venetis I.A (2020). A replication of "A quasi-maximum likelihood approach for large, approximate dynamic factor models" (*Review of Economics and Statistics*, 2012). *Economics, e-journal*, No. 2020-5, February 04,
<http://www.economics-ejournal.org/economics/discussionpapers/2020-5>

ΠΡΑΚΤΙΚΑ ΣΥΝΕΔΡΙΩΝ

1. Lucchetti R. & Venetis I.A (2019). Generalized Dynamic Factor Models. Estimation and forecasting using gretl. [GRETl 2019, Proceedings of the International Conference on the Gnu Regression, Econometrics and Time-series Library](#)

ΔΟΚΙΜΙΑ ΕΡΓΑΣΙΑΣ

1. Lucchetti R. & Venetis I.A (2019). Dynamic Factor Models in gretl. The DFM package. [gretl working papers, No 7, Universita' Politecnica delle Marche \(I\), Dipartimento di Scienze Economiche e Sociali](#)

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)

ΠΑΛΑΙΟΤΕΡΑ ΔΟΚΙΜΙΑ ΕΡΓΑΣΙΑΣ

1. Venetis I.A 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

ΔΙΑΛΕΞΕΙΣ ΜΕΤΑ ΑΠΟ ΠΡΟΣΚΛΗΣΗ

- 2014** *Interpreting Granger causality: the role of infrequent structural shifts and omitted variables. An empirical application.* (9 Μαΐου 2014). Παρουσίαση στο Διατμηματικό Πρόγραμμα Μεταπτυχιακών Σπουδών “Μαθηματικά των Υπολογιστών και των Αποφάσεων” (“Mathematics of Computers and Decision Making”) που συνδιοργανώνεται από το Τμήμα Μηχανικών Η/Υ και Πληροφορικής της Πολυτεχνικής Σχολής και το Τμήμα Μαθηματικών της Σχολής Θετικών Επιστημών για το μάθημα «Μελέτη Περιπτώσεων στη Λήψη Αποφάσεων».
- 2015** *Macroeconomic uncertainty. Definition, measurement and its effects.* 5 Ιουνίου 2015) . Παρουσίαση στο Διατμηματικό Πρόγραμμα Μεταπτυχιακών Σπουδών “Μαθηματικά των Υπολογιστών και των Αποφάσεων” (“Mathematics of Computers and Decision Making”) που συνδιοργανώνεται από το Τμήμα

Μηχανικών Η/Υ και Πληροφορικής της Πολυτεχνικής Σχολής και το Τμήμα Μαθηματικών της Σχολής Θετικών Επιστημών για το μάθημα «Μελέτη Περιπτώσεων στη Λήψη Αποφάσεων».

- 2017** *Structural Vector Autoregressive Models (SVAR): An introduction with empirical applications.* (28 Απριλίου 2017). Παρουσίαση στο Διατμηματικό Πρόγραμμα Μεταπτυχιακών Σπουδών “Μαθηματικά των Υπολογιστών και των Αποφάσεων” (“Mathematics of Computers and Decision Making”) που συνδιοργανώνεται από το Τμήμα Μηχανικών Η/Υ και Πληροφορικής της Πολυτεχνικής Σχολής και το Τμήμα Μαθηματικών της Σχολής Θετικών Επιστημών για το μάθημα «Μελέτη Περιπτώσεων στη Λήψη Αποφάσεων».
- 2017** *QML-EM estimation of dynamic factor models in gretl. Towards a Labor Market Condition Index for Greece.* Marche Polytechnic University, Department of Economics and Social Sciences, Ανκόνα, Ιταλία (9 Νοεμβρίου 2017)
- 2018** *Time series forecasting and forecast evaluation in economics. An introduction.* (26 Απριλίου 2018). Παρουσίαση στο Διατμηματικό Πρόγραμμα Μεταπτυχιακών Σπουδών “Μαθηματικά των Υπολογιστών και των Αποφάσεων” (“Mathematics of Computers and Decision Making”) που συνδιοργανώνεται από το Τμήμα Μηχανικών Η/Υ και Πληροφορικής της Πολυτεχνικής Σχολής και το Τμήμα Μαθηματικών της Σχολής Θετικών Επιστημών για το μάθημα «Μελέτη Περιπτώσεων στη Λήψη Αποφάσεων».
- 2019** *FRED-MD: A Monthly Database for Macroeconomic Research (Using gretl)* (28 Μαρτίου 2019). Παρουσίαση στο Διατμηματικό Πρόγραμμα Μεταπτυχιακών Σπουδών «Υπολογιστική Δεδομένων και Αποφάσεων» («Data Driven Computing and Decision Making») του Πανεπιστημίου Πατρών που συνδιοργανώνεται από το Τμήμα Μηχανικών Η/Υ και Πληροφορικής της Πολυτεχνικής Σχολής και το Τμήμα Μαθηματικών της Σχολής Θετικών Επιστημών για το μάθημα «Μεθοδολογία Έρευνας και Μελέτη Περιπτώσεων στη Λήψη Αποφάσεων από Δεδομένα».
- 2020** *Introduction to Big Data in Macroeconomic Research (Using gretl & FRED-MD dataset).* (8 Μαΐου 2020). Παρουσίαση στο Διατμηματικό Πρόγραμμα Μεταπτυχιακών Σπουδών «Υπολογιστική Δεδομένων και Αποφάσεων» («Data Driven Computing and Decision Making») του Πανεπιστημίου Πατρών που συνδιοργανώνεται από το Τμήμα Μηχανικών Η/Υ και Πληροφορικής της Πολυτεχνικής Σχολής και το Τμήμα Μαθηματικών της Σχολής Θετικών Επιστημών για το μάθημα «Μεθοδολογία Έρευνας και Μελέτη Περιπτώσεων στη Λήψη Αποφάσεων από Δεδομένα».
- 2022** *Greek Inflation -Overview and recent developments (Using gretl & large disaggregated datasets).* (2 Ιουνίου 2022). Παρουσίαση στο Διατμηματικό Πρόγραμμα Μεταπτυχιακών Σπουδών «Υπολογιστική Δεδομένων και Αποφάσεων» («Data Driven Computing and Decision Making») του

Πανεπιστημίου Πατρών που συνδιοργανώνεται από το Τμήμα Μηχανικών Η/Υ και Πληροφορικής της Πολυτεχνικής Σχολής και το Τμήμα Μαθηματικών της Σχολής Θετικών Επιστημών για το μάθημα «Μεθοδολογία Έρευνας και Μελέτη Περιπτώσεων στη Λήψη Αποφάσεων από Δεδομένα».

BIBΛΙΑ

- Εισαγωγή στην Οικονομετρία, Ιωάννης Α. Βενέτης, Πάτρα, Gotsis Εκδόσεις, **2015** - 720σ. - 17x24εκ, ISBN: 978-960-9427-51-7 (Β' Έκδοση, αναθεωρημένη)
- Εισαγωγή στην Οικονομετρία, Ιωάννης Α. Βενέτης, Πάτρα, Gotsis Εκδόσεις, **2013** - 640σ. - 17x24εκ. ISBN: 978-960-9427-25-8 (Α έκδοση)
- Εισαγωγικές διαλέξεις στην Οικονομετρία, Ιωάννης Α. Βενέτης, Αθήνα, Γκιούρδας Εκδοτική, **2009**, ISBN: 978-960-387-744-8, ISBN2: 9789603877448

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 • Macroeconomic Dynamics • 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

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
- *"QML estimation (EM) of dynamic factor models in gretl"*. [5th biennial Gretl Conference June 2-3, 2017, Athens, Greece](#)
- *"Generalized Dynamic Factor Models. Estimation and forecasting using gretl"*. [6th biennial gretl Conference June 13-14, 2019, Naples, Italy](#)

ΔΙΟΡΓΑΝΩΣΗ ΣΥΝΕΔΡΙΟΥ

- Μαζί με τον συνάδελφο Εμμανουήλ Τζαγκαράκη Επίκουρο Καθηγητή του Τ.Ο.Ε και την μεταδιδακτορική ερευνήτρια κα Σαλαμαλίκη Παρασκευή διοργανώσαμε στην Αθήνα το [5th biennial Gretl Conference June 2-3, 2017, Athens, Greece](#)

ΣΥΜΜΕΤΟΧΗ ΣΕ ΣΥΝΕΔΡΙΑ

- **(presenter)** 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.
- **(presenter)** "*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](#)
- **(presenter)** "*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
- **(presenter)** "*QML estimation (EM) of dynamic factor models in gretl*". [5th biennial Gretl Conference June 2-3, 2017, Athens, Greece](#)
- **(presenter)** "*Generalized Dynamic Factor Models. Estimation and forecasting using gretl*". [6th biennial gretl Conference June 13-14, 2019, Naples, Italy](#)
- 11th International Conference of the Financial Engineering and Banking Society Climate Change, Regulatory Responses and Sustainable Finance Portsmouth, United Kingdom 10 – 12 June **2022**
- Ioannina Meeting on Applied Economics and Finance (IMAEF 2022) Conference in-person 22nd to 24th June **2022** Argostoli, Kefallinia, Greece

ΕΡΕΥΝΗΤΙΚΑ ΕΝΔΙΑΦΕΡΟΝΤΑ

Η τρέχουσα ερευνητική μου δραστηριότητα εστιάζεται στο θέμα: Μεγάλα σύνολα Μακροοικονομικών Δεδομένων και δυναμικά υποδείγματα κοινού παράγοντα (dynamic factor models)

Γενικότερα:

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 υποδειγματοποίηση 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)