

**ΠΕΡΙΓΡΑΜΜΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ ΠΡΟΓΡΑΜΜΑΤΟΣ ΣΠΟΥΔΩΝ
(βάσει προτύπου της ΑΔΙΠ)**

Ημερομηνία: 1 Νοε 2021

1. ΓΕΝΙΚΑ

ΑΚΑΔ. ΕΤΟΣ	2021-22
ΣΧΟΛΗ	Σχολή Επιστημών & Τεχνολογίας της Πληροφορίας
ΤΜΗΜΑ	Στατιστικής
ΠΡΟΓΡΑΜΜΑ	Μεταπτυχιακό
ΤΙΤΛΟΣ ΠΜΣ	ΠΜΣ στη Στατιστική
ΚΩΔΙΚΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	9036
ΕΞΑΜΗΝΟ ΣΠΟΥΔΩΝ	ΕΑΡ
ΤΙΤΛΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	FINANCIAL ECONOMETRICS
ΑΥΤΟΤΕΛΕΙΣ ΔΙΔΑΚΤΙΚΕΣ ΔΡΑΣΤΗΡΙΟΤΗΤΕΣ	
ΕΒΔΟΜΑΔΙΑΙΕΣ ΩΡΕΣ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ ΓΙΑ:	
Διαλέξεις	3.00
Φροντιστήρια	
Εργαστήρια	
Ασκήσεις Πράξης	
Άλλες Διδακτικές Δραστηριότητες	
ΠΙΣΤΩΤΙΚΕΣ ΜΟΝΑΔΕΣ ECTS	3.50
ΓΝΩΣΤΙΚΟ ΠΕΔΙΟ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	Γενικού Υποβάθρου
ΠΡΟΑΠΑΙΤΟΥΜΕΝΑ ΜΑΘΗΜΑΤΑ	Statistical Inference, Regression Analysis, Basic Knowledge of R
ΓΛΩΣΣΑ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ ΚΑΙ ΕΞΕΤΑΣΕΩΝ	Ελληνικά
ΤΟ ΜΑΘΗΜΑ ΠΡΟΣΦΕΡΕΤΑΙ ΣΕ ΦΟΙΤΗΤΕΣ ERASMUS;	Ναι
ΗΛΕΚΤΡΟΝΙΚΗ ΣΕΛΙΔΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ (URL)	

2. ΜΑΘΗΣΙΑΚΑ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΑ

ΜΑΘΗΣΙΑΚΑ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΑ

Ο φοιτητής μετά το πέρας του μαθήματος θα είναι σε θέση να αναλύει χρηματοοικονομικά δεδομένα, να εκτιμά μονομεταβλητά και πολυμεταβλητά οικονομετρικά υποδείγματα, και να τα εφαρμόζει σε προβλήματα κατασκευής χαρτοφυλακίου και εκτίμησης της επίδοσης των διαχειριστών κεφαλαίου.

ΓΕΝΙΚΕΣ ΙΚΑΝΟΤΗΤΕΣ

Λαμβάνοντας υπόψη τις γενικές ικανότητες που πρέπει να έχει αποκτήσει ο πτυχιούχος (όπως αυτές αναγράφονται στο Παράρτημα Διπλώματος και παρατίθενται ακολούθως) σε ποια / ποιες από αυτές αποσκοπεί το μάθημα;

Αναζήτηση, ανάλυση και σύνθεση δεδομένων και πληροφοριών, με τη χρήση και των απαραίτητων τεχνολογιών
Προσαρμογή σε νέες καταστάσεις
Λήψη αποφάσεων
Αυτόνομη εργασία
Ομαδική εργασία
Εργασία σε διεθνές περιβάλλον
Εργασία σε διεπιστημονικό περιβάλλον
Παράγωγή νέων ερευνητικών ιδεών
Σχεδιασμός και διαχείριση έργων
Σεβασμός στη διαφορετικότητα και στην πολυπολιτισμικότητα
Σεβασμός στο φυσικό περιβάλλον
Επίδειξη κοινωνικής, επαγγελματικής και ηθικής υπευθυνότητας και ευαισθησίας σε θέματα φύλου
Άσκηση κριτικής και αυτοκριτικής
Προαγωγή της ελεύθερης, δημιουργικής και επαγωγικής σκέψης

3. ΠΕΡΙΕΧΟΜΕΝΟ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ

Σκοπός του μαθήματος είναι η παρουσίαση, ανάπτυξη και εφαρμογή οικονομετρικών υποδειγμάτων σε χρηματοοικονομικά εμπειρικά προβλήματα όπως η κατασκευή βέλτιστων χαρτοφυλακίων, η εκτίμηση της επίδοσης/απόδοσης των διαχειριστών κεφαλαίων και η εκτίμηση του κινδύνου των χρηματοοικονομικών προϊόντων. Τα οικονομετρικά υποδείγματα τα οποία εισάγονται και αναπτύσσονται, αποτελούν μια αξιόπιστη προσέγγιση στην ανάλυση χρηματοοικονομικών εμπειρικών θεμάτων γιατί 'συλλαμβάνουν' τα ιδιαίτερα χαρακτηριστικά των χρηματοοικονομικών δεδομένων. Τα χαρακτηριστικά αυτά αφορούν τις μεταβαλλόμενες στο χρόνο διακυμάνσεις και συνδιακυμάνσεις των αποδόσεων των χρηματοοικονομικών στοιχείων, το φαινόμενο των 'παχιών' ουρών των αποδόσεων, και την απόκλιση από την κανονικότητα που εμφανίζουν τα χρηματοοικονομικά δεδομένα.

4. ΔΙΔΑΚΤΙΚΕΣ ΚΑΙ ΜΑΘΗΣΙΑΚΕΣ ΜΕΘΟΔΟΙ - ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗ

Τρόπος Παράδοσης	Πρόσωπο με Πρόσωπο
------------------	--------------------

ΧΡΗΣΗ ΤΕΧΝΟΛΟΓΙΩΝ ΠΛΗΡΟΦΟΡΙΑΣ ΚΑΙ ΕΠΙΚΟΙΝΩΝΙΩΝ

Χρήση Τ.Π.Ε. στη Διδασκαλία	Ναι	
Χρήση Τ.Π.Ε. στην Εργαστηριακή Εκπαίδευση	Ναι	
Χρήση Τ.Π.Ε. στην Επικοινωνία με τους φοιτητές	Ναι	

ΟΡΓΑΝΩΣΗ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ

Αναγράφονται οι ώρες μελέτης του φοιτητή για κάθε μαθησιακή δραστηριότητα καθώς και οι ώρες μη καθοδηγούμενης μελέτης σύμφωνα με τις αρχές του ECTS

ΔΡΑΣΤΗΡΙΟΤΗΤΑ	ΦΟΡΤΟΣ ΕΡΓΑΣΙΑΣ ΕΞΑΜΗΝΟΥ
Διαλέξεις στην τάξη	30

ΔΡΑΣΤΗΡΙΟΤΗΤΑ	ΦΟΡΤΟΣ ΕΡΓΑΣΙΑΣ ΕΞΑΜΗΝΟΥ
Μελέτη και ανάλυση βιβλιογραφίας	20
Συγγραφή εργασίας / εργασιών	10
Αυτοτελής μελέτη	27.5
Σύνολο Μαθήματος	87.5

ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗ ΦΟΙΤΗΤΩΝ

ΠΕΡΙΓΡΑΦΗ ΤΗΣ ΔΙΑΔΙΚΑΣΙΑΣ ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗΣ	ΠΟΣΟΣΤΟ % ΣΥΜΜΕΤΟΧΗΣ ΚΑΘΕ ΕΞΕΤΑΣΗΣ ΣΤΟΝ ΤΕΛΙΚΟ ΒΑΘΜΟ
Γραπτή εξέταση στο τέλος του εξαμήνου	80
Κατ' οίκον εργασία	20

Να αναφέρετε εάν και που είναι προσβάσιμα τα συγκεκριμένα κριτήρια από τους φοιτητές.	eclass
---	--------

5. ΣΥΝΙΣΤΩΜΕΝΗ-ΒΙΒΛΙΟΓΡΑΦΙΑ

<p>Tsay, R.S. (2002). Analysis of Financial Time Series, Wiley Elton, E. J., Gruber, M. J., Brown, S. J., and Goetzmann, W. N. (2006). Modern Portfolio Theory and Investment Analysis (7th Ed.), Wiley. Sharpe, W., Alexander, G. and Bailey, J. (1995). Investments (5th Ed.), Prentice Hall</p>
--