

# Ειδικά Θέματα Χρηματοοικονομικής Οικονομετρίας

## ΠΕΡΙΓΡΑΜΜΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ

### 1. Γενικά

<b>ΣΧΟΛΗ</b>	Σχολή Χρηματοοικονομικής και Στατιστικής		
<b>ΤΜΗΜΑ</b>	Τμήμα Χρηματοοικονομικής και Τραπεζικής Διοικητικής		
<b>ΕΠΙΠΕΔΟ ΣΠΟΥΔΩΝ</b>	2ος Κύκλος Σπουδών		
<b>ΚΩΔΙΚΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ</b>	ΜΕΧΡΗ317	<b>ΕΞΑΜΗΝΟ ΣΠΟΥΔΩΝ</b>	3ο
<b>ΤΙΤΛΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ</b>	Ειδικά Θέματα Χρηματοοικονομικής Οικονομετρίας		
<b>ΑΥΤΟΤΕΛΕΙΣ ΔΙΔΑΚΤΙΚΕΣ ΔΡΑΣΤΗΡΙΟΤΗΤΕΣ</b>	<b>ΕΒΔΟΜΑΔΙΑΙΕΣ ΩΡΕΣ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ</b>	<b>ΠΙΣΤΩΤΙΚΕΣ ΜΟΝΑΔΕΣ</b>	
Διαλέξεις και Εφαρμογές (Σύνολο)	39	6	
<b>ΤΥΠΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ</b>	Ανάπτυξη δεξιοτήτων		
<b>ΠΡΟΑΠΑΙΤΟΥΜΕΝΑ ΜΑΘΗΜΑΤΑ:</b>	Κανένα		
<b>ΓΛΩΣΣΑ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ και ΕΞΕΤΑΣΕΩΝ:</b>	Ελληνική		
<b>ΤΟ ΜΑΘΗΜΑ ΠΡΟΣΦΕΡΕΤΑΙ ΣΕ ΦΟΙΤΗΤΕΣ ERASMUS</b>	Όχι		
<b>ΗΛΕΚΤΡΟΝΙΚΗ ΣΕΛΙΔΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ (URL)</b>	<a href="https://bankfin.unipi.gr/mastersbankfin/courses/eidika-themata-xrimatooikonomikis-oikonometrias/">https://bankfin.unipi.gr/mastersbankfin/courses/eidika-themata-xrimatooikonomikis-oikonometrias/</a>		

### 2. Μαθησιακά Αποτελέσματα

#### Μαθησιακά Αποτελέσματα

Ο σκοπός του μαθήματος είναι να εξοπλίσει τους φοιτητές με γνώση πάνω σε εξειδικευμένες τεχνικές που χρησιμοποιούνται σε διεθνή χρηματοοικονομική και χρηματοοικονομική. Οι φοιτητές θα είναι σε θέση να αναλύσουν και αξιολογήσουν τα προτεινόμενα υποδείγματα και θα έχουν την ικανότητα να μεταφράσουν ιδανικά τα αποτελέσματα που προκύπτουν. Ειδικότερα, οι φοιτητές θα μπορούν να χρησιμοποιήσουν σημαντικά οικονομετρικά εργαλεία με χρήση χρηματοοικονομικών δεδομένων. Έτσι θα έχουν:

- Την ικανότητα να χρησιμοποιούν τις καινούργιες τεχνικές με την χρήση οικονομετρικών πακέτων (R)
- Την ικανότητα να χρησιμοποιούν συγκεκριμένα χρηματοοικονομικά υποδείγματα μέσω των τεχνικών αυτών και να αναλύουν και να προβλέπουν την πορεία σημαντικών χρηματοοικονομικών μεταβλητών
- Την ικανότητα να αναπτύξουν ικανότητες επικοινωνίας
- Την ικανότητα να παρουσιάζουν με ικανοποιητικό και συνεπή τρόπο τα αποτελέσματα οικονομετρικής ανάλυσης
- Την ικανότητα να κατανοούν και να αναλύουν χρηματοοικονομικά δεδομένα

Τα αποτελέσματα μαθησιακής ικανότητας περιέχουν:

- Γνώση και κατανόηση ποσοτικών μεθόδων που χρησιμοποιούν φοιτητές στα οικονομικά και χρηματοοικονομικά, όπως συλλογή δεδομένων, ανάλυση και διαχείριση ποσοτικών δεδομένων, σχεδιασμό υποδειγμάτων
- Ικανότητα εφαρμογής και κατανόησης τεχνικών μεθόδων που αναλύουν ποσοτικά δεδομένα στα οικονομικά και χρηματοοικονομικά
- Ικανότητα να προβαίνουν σε κρίσεις σχετικά με την καταλληλότητα συγκεκριμένων οικονομετρικών μεθόδων σε θέματα έρευνας σε οικονομικά και χρηματοοικονομικά
- Ικανότητα να φτάνουν σε πλήρως πληροφορημένες αποφάσεις σχετικά με την έρευνα σε οικονομικά και χρηματοοικονομικά μέσω συγκεκριμένων οικονομετρικών πακέτων και ποσοτικών δεδομένων
- Ικανότητα να επικοινωνούν με τους καθηγητές τους και τους προϊσταμένους τους, ερευνητές και αυτούς που παίρνουν αποφάσεις πολιτικής σε οικονομικά και χρηματοοικονομικά γεγονότα ώστε να φτάνουν σε σωστά αποτελέσματα κατά την διάρκεια της έρευνάς τους
- Ικανότητα να προωθούν, μέσω της ακαδημαϊκής και πρακτικής βιβλιογραφίας, τεχνολογική και κοινωνικοοικονομική γνώση υψηλού επιπέδου

## Γενικές Ικανότητες

- Αναζήτηση, ανάλυση και σύνθεση δεδομένων και πληροφοριών, με τη χρήση και των απαραίτητων τεχνολογιών
- Λήψη αποφάσεων
- Αυτόνομη & Ομαδική εργασία
- Εργασία σε διεθνές περιβάλλον

### 3. Περιεχόμενο Μαθήματος

- Asset returns and efficient markets
- Linear time series and dynamics of returns
- Discrete time volatility models of returns
- Multivariate time series and volatility
- Efficient portfolios and CAPM
- Multifactor pricing models
- Portfolio allocation and risk assessment
- Consumption-based CAPM
- Present value models
- Econometrics of continuous time finance
- Forecast and management of market risks

### 4. Διδακτικές και Μαθησιακές Μέθοδοι - Αξιολόγηση

<b>ΤΡΟΠΟΣ ΠΑΡΑΔΟΣΗΣ</b> Πρόσωπο με πρόσωπο, Εξ αποστάσεως εκπαίδευση κ.λπ.	Δια ζώσης και με μέσα εξ αποστάσεως εκπαίδευσης	
<b>ΧΡΗΣΗ ΤΕΧΝΟΛΟΓΙΩΝ ΠΛΗΡΟΦΟΡΙΑΣ ΚΑΙ ΕΠΙΚΟΙΝΩΝΙΩΝ</b>	Χρήση του Microsoft Powerpoint για τη διδασκαλία. Επικοινωνία μέσω email με τους φοιτητές, πλατφόρμα ηλεκτρονικής μάθησης Eclass, MS-Team, Webex κ.α	
<b>ΟΡΓΑΝΩΣΗ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ</b>	<b>Δραστηριότητα</b>	<b>Φόρτος Εργασίας Εξαμήνου</b>
	Διαλέξεις	39
	Αυτοτελής Μελέτη	44
	Ασκήσεις / Εφαρμογές	47
	Εργασία	20
	Σύνολο Μαθήματος	150
<b>ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗ ΦΟΙΤΗΤΩΝ</b>	Για την αξιολόγηση των φοιτητών υπάρχει μια τελική εξέταση η οποία γίνεται στο εργαστήριο του Τμήματος και περιλαμβάνει διάφορου βαθμού δυσκολίας επίλυση εφαρμογών	

### 5. Συνιστώμενη Βιβλιογραφία

#### -Προτεινόμενη Βιβλιογραφία

- Y. Campbell, A.W. Lo, A.C. MacKinlay (1997): The Econometrics of Financial Markets, Princeton University Press
- Σημειώσεις του μαθήματος

#### -Συναφή Επιστημονικά Περιοδικά

- Journal of Applied Economics
- Journal of Applied Economic Letters
- Journal of Empirical Finance