

Διαχείριση Χαρτοφυλακίου

Περίγραμμα Μαθήματος
Ακαδημαϊκό Έτος: 2025/26

1. Γενικά

Σχολή	Χρηματοοικονομικής και Στατιστικής		
Τμήμα	Χρηματοοικονομικής και Τραπεζικής Διοικητικής		
Επίπεδο Σπουδών	1ος Κύκλος Σπουδών		
Κωδικός Μαθήματος	ΧΡΧΡΗ21		
Εξάμηνο Σπουδών	8ο		
Τίτλος Μαθήματος	Διαχείριση Χαρτοφυλακίου		
Αυτοτελείς Διδακτικές Δραστηριότητες	Εβδομαδιαίες Ώρες Διδασκαλίας	Πιστωτικές Μονάδες	
	Διαλέξεις	4	7,5
Τύπος Μαθήματος	Γενικού Υποβάθρου		
Προαπαιτούμενα Μαθήματα			
Γλώσσα Διδασκαλίας και Εξετάσεων	Ελληνικά		
Το μάθημα προσφέρεται σε Φοιτητές Erasmus;	Ναι (στην Ελληνική)		
Url (Eclass)	https://eclass.unipi.gr/modules/auth/opencourses.php?fc=64		

2. Μαθησιακά Αποτελέσματα

Μαθησιακά Αποτελέσματα

Στο τέλος των διαλέξεων, οι φοιτητές-φοιτήτριες αναμένεται να μπορούν να:

- Αξιολογούν μετοχές και χαρτοφυλάκια μετοχών
- Μπορούν να υπολογίζουν κινδύνους μετοχών και χαρτοφυλακίων μετοχών
- Μπορούν να υπολογίζουν χαρτοφυλάκια ελάχιστου κινδύνου
- Κατανοούν την έννοια της Στοχαστικής Κυριαρχίας ενός χαρτοφυλακίου
- Κατανοούν την έννοια του ασφάλιστρου κινδύνου και από τι αυτό εξαρτάται

Γενικές Ικανότητες

- Να αναλύουν και να αξιολογούν μετοχές
- Να αναλύουν χαρτοφυλάκια μετοχών
- Να μπορούν να υπολογίζουν τους κινδύνους μετοχών και χαρτοφυλακίων μετοχών
- Να είναι σε θέση να γνωρίζουν πώς να επιλέγουν χαρτοφυλάκια ελάχιστου κινδύνου
- Να είναι σε θέση να εφαρμόζουν την έννοια της Στοχαστικής Κυριαρχίας ενός χαρτοφυλακίου στη διαδικασία λήψης επενδυτικών αποφάσεων
- Να εφαρμόζουν την έννοια του ασφάλιστρου κινδύνου στην τιμολόγηση μετοχών

3. Περιεχόμενο

Το μάθημα αυτό καλύπτει τις σχετικές θεωρίες και τα εμπειρικά πορίσματα σχετικά με τη σύνθεση, διαχείριση και αξιολόγηση χαρτοφυλακίων μετοχών και άλλων αξιογράφων.

Επίσης το μάθημα αναλύει συναφείς θεωρητικές έννοιες όπως αυτές της «Στοχαστικής Κυριαρχίας» και του «ασφάλιστρου κινδύνου»

Αναλυτική Περιγραφή του Μαθήματος:

- Εισαγωγή στην Ανάλυση και Διαχείριση Χαρτοφυλακίου Αξιογράφων
- Ανάλυση Μετοχών με τα Κριτήρια του Markowitz
- Ανάλυση Χαρτοφυλακίων I
- Ανάλυση Χαρτοφυλακίων II
- Υπόδειγμα της Αγοράς
- Θεωρίες Αποτίμησης
- Αποτελεσματικές Αγορές
- Στοχαστική Κυριαρχία
- Ασφάλιστρο Κινδύνου και Συναρτήσεις Χρησιμότητας

4. Διδακτικές και Μαθησιακές Μέθοδοι - Αξιολόγηση

Τρόπος Παράδοσης	Πρόσωπο με πρόσωπο	
Χρήση Τεχνολογιών Πληροφορίας και Επικοινωνιών	Χρήση διαδικτύου για εύρεση σχέσεων και φαινομένων που σχετίζονται με το αντικείμενο του μαθήματος	
Οργάνωση Διδασκαλίας	Δραστηριότητα	Φόρτος Εργασίας Εξαμήνου
	Διαλέξεις	52
	Αυτοτελής Μελέτη	135,5
	Σύνολο Μαθήματος	187,5
Αξιολόγηση Φοιτητών	Ελληνικά, 100% Τελική εξέταση	

5. Συνιστώμενη Βιβλιογραφία

Προτεινόμενη Βιβλιογραφία

Πιττής Ν. Σημειώσεις Διαλέξεων

Συναφή Επιστημονικά Περιοδικά

- Basu, S. (1977) Investment performance of common stocks in relation to their price earnings ratios: A test for market efficiency, Journal of Finance, 32, 663-682.
- Black, F., M.C. Jensen and M. Scholes, 1972, The capital asset pricing model: Some empirical tests, in: M. Jensen, ed., Studies in the theory of capital markets, (Praeger Publishers, Inc., New York), 79-121.
- Blume, M.E. and I. Friend, 1973, A new look at the capital asset pricing model, Journal of Finance, 28, 19-33.
- Diacogiannis G. (1986) Arbitrage Pricing Model: A Critical Examination of its Empirical Applicability for the London Stock Exchange, Journal of Business Finance and Accounting, 13, 489-504.
- Fama, E. F. and MacBeth (1973) Risk, Return and Equilibrium: Empirical Tests, Journal of Political Economy 81: 607–636.