

ΤΙΤΛΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ: ΑΝΑΛΥΣΗ ΑΠΟΦΑΣΕΩΝ ΚΑΙ ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗ ΚΙΝΔΥΝΟΥ

ΚΩΔΙΚΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ: ΔΕΒ305

ΕΞΑΜΗΝΟ ΣΠΟΥΔΩΝ: 2^ο

ΠΡΟΑΠΑΙΤΟΥΜΕΝΑ ΜΑΘΗΜΑΤΑ: -

ΓΛΩΣΣΑ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ ΚΑΙ ΕΞΕΤΑΣΕΩΝ: Ελληνική

ΗΛΕΚΤΡΟΝΙΚΗ ΣΕΛΙΔΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ (URL): -

ΜΑΘΗΣΙΑΚΑ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΑ

Με την επιτυχή ολοκλήρωση του μαθήματος ο φοιτητής / τρια θα έχουν τη δυνατότητα να:

- κατανοούν τις ποσοτικές μεθόδους που χρησιμοποιούνται στην Ανάλυση Αποφάσεων για τον εμπειρικό προσδιορισμό της συμπεριφοράς Οικονομικών, Χρηματοοικονομικών αλλά και Επιχειρηματικών φαινομένων.
- εξάγουν συμπεράσματα πολιτικής και να κατανοήσουν πώς λειτουργεί η ποσοτική ανάλυση στη διαδικασία λήψεων αποφάσεων
- προσδιορίζουν πιθανές απώλειες που σχετίζονται με τη διαχείριση κινδύνων, δηλαδή τη διαδικασία εντοπισμού πιθανών κινδύνων εκ των προτέρων και τη διαχείρισή τους λαμβάνοντας προληπτικά μέτρα ώστε να μειώσουν το μέγεθος και την εμφάνισή τους
- είναι προετοιμασμένοι/ες για ενδεχόμενες απώλειες σε μια επένδυση
- εντοπίζουν πιθανές ζημιές καθώς και την εκμάθηση για τον τρόπο αντιμετώπισής τους

ΓΕΝΙΚΕΣ ΙΚΑΝΟΤΗΤΕΣ

- Ανάλυση δεδομένων
- Πρόβλεψη
- Λήψη αποφάσεων
- Διαχείριση Κινδύνου
- Αυτόνομη εργασίες
- Ομαδικές εργασίες

ΠΕΡΙΕΧΟΜΕΝΟ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ

I. Εισαγωγή

1. Ανάλυση Αποφάσεων
2. Διαχείριση Κινδύνου
3. Ποσοτική και Ποιοτική Ανάλυση
4. Οικονομικό και Οικονομετρικό Υπόδειγμα

II. Στατιστική

1. Ανάλυση Δεδομένων
2. Τυχαία Μεταβλητή – Ροπές και Ιδιότητες
3. Επενδυτικές Αποφάσεις
4. Δένδρα Αποφάσεων
5. Κατανομές Τυχαίων Μεταβλητών
6. Έννοιες Κινδύνου
7. Ιδιότητες Εκτιμητών
8. Στατιστική Αναφορά στο μέσο όρο και στη Διακύμανση

III. ECONOMETRICS

1. Συνδιακύμανση και Ανάλυση Συσχέτισης
2. Αντιμετώπιση και Θεραπείες Κινδύνου

-MBA in SUSTAINABILITY

3. Ανάλυση Χαρτοφυλακίου
4. Απλό Γραμμικό Υπόδειγμα
5. Υπόδειγμα CAPM και Συντελεστής Βήτα
6. Πολλαπλό Γραμμικό Υπόδειγμα
7. Προβλήματα στην Παλινδρόμηση
8. Ειδικά θέματα
9. Κίνδυνος Αγοράς και τα Ελληνικά Γράμματα
10. Καθοδικός Κίνδυνος

ΣΥΝΙΣΤΩΜΕΝΗ ΒΙΒΛΙΟΓΡΑΦΙΑ

- Συγγράμματα
 - Newbold, P., Carlson, W. L. and Thorne, B. Statistics for Business and Economics, 6th edition, Pearson Prentice Hall, 2006.
 - John Hull, Risk Management and Financial Institutions, Prentice Hall, 2015.
 - John Hull, Options, Futures and Other Derivative Securities, Prentice Hall, 2015.
 - Defusco, A. R., McLeavey, W. D., Pinto, E. J. and Runkle, E.D., Quantitative Investment Analysis, second edition, CFA Institute, 2007.
 - Enders, W., Applied Econometric Time Series, John Wiley & Sons, Inc., 2009. Greene, W. H., Econometric Analysis, Prentice Hall, 2003.
 - Johnston, J. and Dinardo, J., Econometric Methods, McGraw Hill, 1997.
 - McClave, T. J., Benson, P. G. and Sincish, T., Statistics for Business and Economics, 9th edition, Prentice Hall, 2005.
 - Mills, T., The Econometric Modeling of Financial Time Series, Second Edition, Cambridge University Press, 1999.
 - Pindyck, S. R. and Rubinfeld, L. D., Econometric Models and Economic Forecasts, McGraw Hill, 1998.
 - Watsham, J. T. and Parramore, K., Quantitative Methods in Finance, International Thomson Business Press, 1997.
- Συναφή Επιστημονικά περιοδικά:
 - Annals of Statistics
 - Journal of Business and Economic Statistics Journal of the American Statistical Association
 - Journal of the Royal Statistical Society. Series B: Statistical Methodology Review of Economics and Statistics
 - Computational Statistics and Data Analysis International
 - Statistical Review
 - Journal of Computational and Graphical Statistics
 - Journal of the Royal Statistical Society. Series A: Statistics in
 - Society Journal of the Royal Statistical Society. Series C: Applied
 - Statistics Oxford Bulletin of Economics and Statistics
 - Scandinavian Journal of Statistics Annals of Applied Statistics
 - Computational Statistics
 - Journal of Applied Statistics