

ΠΕΡΙΓΡΑΜΜΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ

(1) ΓΕΝΙΚΑ

ΣΧΟΛΗ	ΠΟΛΥΤΕΧΝΙΚΗ ΣΧΟΛΗ		
ΤΜΗΜΑ	ΜΗΧΑΝΙΚΩΝ ΟΙΚΟΝΟΜΙΑΣ ΚΑΙ ΔΙΟΙΚΗΣΗΣ		
ΕΠΙΠΕΔΟ ΣΠΟΥΔΩΝ	ΠΡΟΠΤΥΧΙΑΚΟ		
ΚΩΔΙΚΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	ΟΙ0112	ΕΞΑΜΗΝΟ ΣΠΟΥΔΩΝ	9
ΤΙΤΛΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	ΑΝΑΛΥΣΗ/ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΗ ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΩΝ ΚΙΝΔΥΝΩΝ		
ΑΥΤΟΤΕΛΕΙΣ ΔΙΔΑΚΤΙΚΕΣ ΔΡΑΣΤΗΡΙΟΤΗΤΕΣ <i>σε περίπτωση που οι πιστωτικές μονάδες απονέμονται σε διακριτά μέρη του μαθήματος π.χ. Διαλέξεις, Εργαστηριακές Ασκήσεις κ.λπ. Αν οι πιστωτικές μονάδες απονέμονται ενιαία για το σύνολο του μαθήματος αναγράψτε τις εβδομαδιαίες ώρες διδασκαλίας και το σύνολο των πιστωτικών μονάδων</i>	ΕΒΔΟΜΑΔΙΑΙΕΣ ΩΡΕΣ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ	ΠΙΣΤΩΤΙΚΕΣ ΜΟΝΑΔΕΣ	
	3	5	
<i>Προσθέστε σειρές αν χρειαστεί. Η οργάνωση διδασκαλίας και οι διδακτικές μέθοδοι που χρησιμοποιούνται περιγράφονται αναλυτικά στο (δ).</i>			
ΤΥΠΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ <i>γενικού υποβάθρου, ειδικού υποβάθρου, ειδίκευσης γενικών γνώσεων, ανάπτυξης δεξιοτήτων</i>	ΕΙΔΙΚΟΥ ΥΠΟΒΑΘΡΟΥ/ΕΙΔΙΚΕΥΣΗΣ ΓΕΝΙΚΩΝ ΓΝΩΣΕΩΝ/ΑΝΑΠΤΥΞΗΣ ΔΕΞΙΟΤΗΤΩΝ		
ΠΡΟΑΠΑΙΤΟΥΜΕΝΑ ΜΑΘΗΜΑΤΑ:	Τα ακόλουθα μαθήματα προτείνονται: <ul style="list-style-type: none"> - Θεωρία Πιθανοτήτων - Στατιστική - Παράγωγα και νέα χρηματοοικονομικά προϊόντα 		
ΓΛΩΣΣΑ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ και ΕΞΕΤΑΣΕΩΝ:	ΕΛΛΗΝΙΚΗ		
ΤΟ ΜΑΘΗΜΑ ΠΡΟΣΦΕΡΕΤΑΙ ΣΕ ΦΟΙΤΗΤΕΣ ERASMUS	ΝΑΙ		
ΗΛΕΚΤΡΟΝΙΚΗ ΣΕΛΙΔΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ (URL)	http://www.fme.aegean.gr/el/c/analysis-diaheirisi-hrimatooikonomikon-kindynon		

(2) ΜΑΘΗΣΙΑΚΑ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΑ

<p>Μαθησιακά Αποτελέσματα <i>Περιγράφονται τα μαθησιακά αποτελέσματα του μαθήματος οι συγκεκριμένες γνώσεις, δεξιότητες και ικανότητες καταλλήλου επιπέδου που θα αποκτήσουν οι φοιτητές μετά την επιτυχή ολοκλήρωση του μαθήματος.</i></p> <p><i>Συμβουλευτείτε το Παράρτημα Α</i></p> <ul style="list-style-type: none"> • Περιγραφή του Επιπέδου των Μαθησιακών Αποτελεσμάτων για κάθε ένα κύκλο σπουδών σύμφωνα με το Πλαίσιο Προσόντων του Ευρωπαϊκού Χώρου Ανώτατης Εκπαίδευσης • Περιγραφικοί Δείκτες Επιπέδων 6, 7 & 8 του Ευρωπαϊκού Πλαισίου Προσόντων Διά Βίου Μάθησης και το Παράρτημα Β • Περιληπτικός Οδηγός συγγραφής Μαθησιακών Αποτελεσμάτων
<p>Το μάθημα απευθύνεται σε προπτυχιακούς φοιτητές που ακολουθούν την κατεύθυνση της χρηματοοικονομικής μηχανικής. Έχει ως βασικό στόχο την εισαγωγή του φοιτητή στο καίριο ζήτημα της ανάλυσης και στρατηγικής διαχείρισης των χρηματοοικονομικών κινδύνων. Πιο συγκεκριμένα, ο φοιτητής θα είναι σε θέση, αφού συνδέσει την έννοια του κινδύνου με την έννοια της πιθανότητας, να μπορεί να χρησιμοποιήσει τόσο τεχνικές μέτρησης όσο και τεχνικές διαχείρισης - αντιστάθμισης των χρηματοοικονομικών κινδύνων. Με την επιτυχή ολοκλήρωση του μαθήματος θα είναι σε θέση:</p> <ul style="list-style-type: none"> • Να αντιλαμβάνεται την έννοια του κινδύνου και την διάκρισή της από την έννοια της αβεβαιότητας.

- Να γνωρίζει τους βασικούς χρηματοοικονομικούς κινδύνους:
 - Πιστωτικός κίνδυνος
 - Κίνδυνος επιτοκίων
 - Κίνδυνος ρευστότητας
 - Λειτουργικός κίνδυνος
 - Κίνδυνος αγοράς.
- Να γνωρίζει και να είναι σε θέση να εφαρμόζει τις διάφορες τεχνικές μέτρησης των διαφόρων χρηματοοικονομικών κινδύνων, με έμφαση στον πιστωτικό, τον επιτοκιακό και τον κίνδυνο αγοράς.
- Να κατανοήσει τον τρόπο με τον οποίο τα σύγχρονα χρηματοοικονομικά εργαλεία (π.χ. Παράγωγα) χρησιμοποιούνται για την αντιστάθμιση των χρηματοοικονομικών κινδύνων (π.χ. Credit Default Swaps, Interest Rate Swaps, κ.λ.π)
- Να εξοικειωθεί με την έννοια της αξίας σε κίνδυνο (VaR) και τις παραφυάδες της, να γνωρίζει και να μπορεί να εφαρμόζει διαφόρους τρόπους υπολογισμού της, και να αντιλαμβάνεται την χρησιμότητά της όσον αφορά την μέτρηση του κινδύνου.
- Να εξοικειωθεί με σύγχρονες τεχνικές μέτρησης του κινδύνου (Expected Shortfall).

Γενικές Ικανότητες

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

.....

Άλλες...

.....

- 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.
- Παραγωγή νέων ερευνητικών ιδεών.
- Άσκηση κριτικής και αυτοκριτικής.

Προαγωγή της ελεύθερης, δημιουργικής και επαγωγικής σκέψης.

(3) ΠΕΡΙΕΧΟΜΕΝΟ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ

Εισαγωγή στην έννοια του κινδύνου και διάκρισή του από την έννοια της αβεβαιότητας. Βασικά περιγραφικά μέτρα κινδύνου. Πιστωτικός κίνδυνος. Διαχείριση πιστωτικού κινδύνου. Κίνδυνος επιτοκίου. Διαχείριση κινδύνου επιτοκίου. Κίνδυνος ρευστότητας. Διαχείριση κινδύνου ρευστότητας. Λειτουργικός κίνδυνος. Κίνδυνος αγοράς. Εισαγωγή στην έννοια της αξίας σε κίνδυνο (VaR). Ειδικά θέματα VaR: Οριακή και επαυξητική VaR, Η περίπτωση που οι διακυμάνσεις και οι συσχετίσεις είναι συναρτήσεις του χρόνου, Ιστορική προσομοίωση και προσομοίωση Monte-Carlo. Expected Shortfall.

ΔΙΔΑΚΤΙΚΕΣ και ΜΑΘΗΣΙΑΚΕΣ ΜΕΘΟΔΟΙ - ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗ

ΤΡΟΠΟΣ ΠΑΡΑΔΟΣΗΣ <i>Πρόσωπο με πρόσωπο, Εξ αποστάσεως εκπαίδευση κ.λπ.</i>	Λόγω covid η διδασκαλία διεξάγεται εξ αποστάσεως μέσω της πλατφόρμας zoom	
ΧΡΗΣΗ ΤΕΧΝΟΛΟΓΙΩΝ ΠΛΗΡΟΦΟΡΙΑΣ ΚΑΙ ΕΠΙΚΟΙΝΩΝΙΩΝ <i>Χρήση Τ.Π.Ε. στη Διδασκαλία, στην Εργαστηριακή Εκπαίδευση, στην Επικοινωνία με τους φοιτητές</i>	Χρήση ΤΠΕ στη διδασκαλία. Χρήση ΤΠΕ στην εργαστηριακή εκπαίδευση.	
ΟΡΓΑΝΩΣΗ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ <i>Περιγράφονται αναλυτικά ο τρόπος και μέθοδοι διδασκαλίας. Διαλέξεις, Σεμινάρια, Εργαστηριακή Άσκηση, Άσκηση Πεδίου, Μελέτη & ανάλυση βιβλιογραφίας, Φροντιστήριο, Πρακτική (Τοποθέτηση), Κλινική Άσκηση, Καλλιτεχνικό Εργαστήριο, Διαδραστική διδασκαλία, Εκπαιδευτικές επισκέψεις, Εκπόνηση μελέτης (project), Συγγραφή εργασίας / εργασιών, Καλλιτεχνική δημιουργία, κ.λπ.</i> <i>Αναγράφονται οι ώρες μελέτης του φοιτητή για κάθε μαθησιακή δραστηριότητα καθώς και οι ώρες μη καθοδηγούμενης μελέτης σύμφωνα με τις αρχές του ECTS</i>	Δραστηριότητα	Φόρτος Εργασίας Εξαμήνου
	Διαλέξεις/Εργαστηριακές εφαρμογές	39
	Μελέτη βιβλιογραφίας	90
	Επίβλεψη εργαστηριακών ασκήσεων	18
	Τελική εξέταση	3
	Σύνολο Μαθήματος	150
ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗ ΦΟΙΤΗΤΩΝ <i>Περιγραφή της διαδικασίας αξιολόγησης</i> <i>Γλώσσα Αξιολόγησης, Μέθοδοι αξιολόγησης, Διαμορφωτική ή Συμπερασματική, Δοκιμασία Πολλαπλής Επιλογής, Ερωτήσεις Σύντομης Απάντησης, Ερωτήσεις Ανάπτυξης Δοκιμίων, Επίλυση Προβλημάτων, Γραπτή Εργασία, Έκθεση / Αναφορά, Προφορική Εξέταση, Δημόσια Παρουσίαση, Εργαστηριακή Εργασία, Κλινική Εξέταση Ασθενούς, Καλλιτεχνική Ερμηνεία, Άλλη / Άλλες</i> <i>Αναφέρονται ρητά προσδιορισμένα κριτήρια αξιολόγησης και εάν και που είναι προσβάσιμα από τους φοιτητές.</i>	Εργασίες κατά τη διάρκεια του εξαμήνου (υποχρεωτικές μέχρι και το 6 ^ο έτος): 30% Τελική γραπτή εξέταση ή απαλλακτική εργασία με παρουσίαση: 70%	

(4) ΣΥΝΙΣΤΩΜΕΝΗ-ΒΙΒΛΙΟΓΡΑΦΙΑ

<p>Διαχείριση τραπεζικών και χρηματοοικονομικών κινδύνων (2010). Ν. Σχοινιωτάκης και Γ.Συλλιγάρδος. Εκδόσεις Δίσιγμα.</p> <p>Διαχείριση χρηματοοικονομικών κινδύνων με το MATLAB: Μια εφαρμοσμένη προσέγγιση (2009). Α. Ζαπράνης. Εκδόσεις Κλειδάριθμος.</p> <p>Financial risk manager handbook, second edition (2003). P. Jorion. Wiley</p> <p>Διαχείριση χρηματοπιστωτικών ιδρυμάτων και διαχείριση κινδύνων (2017). Α. Saumders & M.M. Cornett. Broken Hill.</p> <p>Εισαγωγή στην τραπεζική χρηματοοικονομική διοικητική, Τόμος Α (2002). Κ. Μελλάς. Εκδόσεις Εξάντας.</p> <p>Διαχείριση πιστωτικού κινδύνου (2009). Κ. Ζοπουνίδης και Χ. Λεμονάκης. Εκδόσεις Κλειδάριθμος.</p>
--