

ΠΕΡΙΓΡΑΜΜΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ

(1) ΓΕΝΙΚΑ

ΣΧΟΛΗ	Επιστημών Διοίκησης και Οικονομίας		
ΤΜΗΜΑ	Λογιστικής και Χρηματοοικονομικής		
ΕΠΙΠΕΔΟ ΣΠΟΥΔΩΝ	Προπτυχιακό		
ΚΩΔΙΚΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	4	ΕΞΑΜΗΝΟ ΣΠΟΥΔΩΝ	4
ΤΙΤΛΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	Ανάλυση Και Διαχείριση Χαρτοφυλακίου		
ΑΥΤΟΤΕΛΕΙΣ ΔΙΔΑΚΤΙΚΕΣ ΔΡΑΣΤΗΡΙΟΤΗΤΕΣ	ΕΒΔΟΜΑΔΙΑΙΕΣ ΩΡΕΣ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ	ΠΙΣΤΩΤΙΚΕΣ ΜΟΝΑΔΕΣ	
Διαλέξεις και Ασκήσεις Πράξεις	3	5	
ΤΥΠΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	Υποχρεωτικό, Ειδικού Υποβάθρου.		
ΠΡΟΑΠΑΙΤΟΥΜΕΝΑ ΜΑΘΗΜΑΤΑ:	ΟΧΙ		
ΓΛΩΣΣΑ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ και ΕΞΕΤΑΣΕΩΝ:	ΕΛΛΗΝΙΚΗ		
ΤΟ ΜΑΘΗΜΑ ΠΡΟΣΦΕΡΕΤΑΙ ΣΕ ΦΟΙΤΗΤΕΣ ERASMUS	ΝΑΙ		
ΗΛΕΚΤΡΟΝΙΚΗ ΣΕΛΙΔΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ (URL)			

(2) ΜΑΘΗΣΙΑΚΑ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΑ

Μαθησιακά Αποτελέσματα
<p>Μετά την επιτυχή ολοκλήρωση του μαθήματος αναμένεται οι φοιτητές να μπορούν:</p> <ul style="list-style-type: none"> • να περιγράφουν να συνδυάζουν ή να αναγνωρίζουν τη σημασία της διαχείρισης χαρτοφυλακίου και τις σύγχρονες τεχνικές αξιολόγησης τους, έτσι ώστε οι γνώσεις που θα έχουν αποκτήσει να αποδεικνύονται από την κριτική κατανόηση των σύγχρονων μορφών ανάλυσης χαρτοφυλακίου. • να διακρίνουν, να εξηγούν ή να υπολογίζουν και να ταξινομούν, τις έννοιες της απόδοσης και του κινδύνου και διαφόρων τεχνικών αποτίμησης του χαρτοφυλακίου, έτσι ώστε να μπορούν να επιλύουν σύνθετα πραγματικά προβλήματα αποδεικνύοντας τη δεξιοτεχνία που απέκτησαν από το μάθημα. • να αναλύουν, να συνθέτουν και τελικώς να διατυπώνουν αξιολογικές κρίσεις, για τις εφαρμοζόμενες πρακτικές αξιολόγησης χαρτοφυλακίων και χρηματιστηριακών επενδύσεων, έτσι ώστε να μπορούν να συμβάλλουν στη λήψη χρηματοοικονομικών αποφάσεων τεκμηριώνοντας την ικανότητα που απέκτησαν από το μάθημα να αναλύουν νέες καταστάσεις. • Συνολικά, μετά την ολοκλήρωση του μαθήματος οι φοιτητές θα έχουν αποκτήσει επάρκεια γνώσεων και δεξιοτήτων, έτσι ώστε να εφαρμόζουν

επιτυχώς τις σύγχρονες τεχνικές της ανάλυσης και διαχείρισης χαρτοφυλακίου. Θα μπορούν επομένως να κατανοήσουν τις ανάγκες των επενδυτών, και τη χρήση υποδειγμάτων με σκοπό την αποτελεσματική ανάλυση και διαχείριση των επενδύσεων χαρτοφυλακίου, αλλά και να λειτουργήσουν υπεύθυνα και αυτόνομα ως χρηματοοικονομικοί αναλυτές σε Διεθνή Χρηματιστήρια.

Γενικές Ικανότητες

Το μάθημα αποσκοπεί στην απόκτηση, από τον πτυχιούχο, των παρακάτω γενικών ικανοτήτων:

Αναζήτηση, ανάλυση και σύνθεση δεδομένων και πληροφοριών, με τη χρήση και των απαραίτητων τεχνολογιών,
Προσαρμογή σε νέες καταστάσεις,
Λήψη αποφάσεων,
Ομαδική εργασία,
Εργασία σε διεθνές περιβάλλον,
Προαγωγή της ελεύθερης, δημιουργικής και επαγωγικής σκέψης.

(3) ΠΕΡΙΕΧΟΜΕΝΟ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ

- Χρηματοπιστωτικό Σύστημα.
- Χρηματιστήρια. Χρηματιστήριο Αξιών Αθηνών.
- Απόδοση και Κίνδυνος.
- Θεωρία Χαρτοφυλακίου.
- Υποδείγματα CAPM και APT.
- Έννοια και Μορφές Αποτελεσματικής Αγοράς.
- Μέθοδοι Εκτίμησης της Αποτελεσματικότητας της Αγοράς.
- Στάδια Διαχείρισης Επενδυτικού Χαρτοφυλακίου.
- Συμπεριφορά των Εισηγμένων Τίτλων (Κυμαινόμενη, Σταθερή, Κυκλική).
Αμυντικές / Επιθετικές και Παθητικές / Ενεργητικές Επενδυτικές Στρατηγικές.

(4) ΔΙΔΑΚΤΙΚΕΣ και ΜΑΘΗΣΙΑΚΕΣ ΜΕΘΟΔΟΙ - ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗ

ΤΡΟΠΟΣ ΠΑΡΑΔΟΣΗΣ	Πρόσωπο με πρόσωπο	
ΧΡΗΣΗ ΤΕΧΝΟΛΟΓΙΩΝ ΠΛΗΡΟΦΟΡΙΑΣ ΚΑΙ ΕΠΙΚΟΙΝΩΝΙΩΝ	Χρήση Πίνακα και ΤΠΕ στην Διδασκαλία (PowerPoint στις Διαλέξεις). Πλατφόρμα E-class & e-mail στην επικοινωνία με τους φοιτητές. Ώρες γραφείου απαραίτητες. Διαθεσιμότητα των διαφανειών των διαλέξεων καθώς και λουπού υλικού του μαθήματος στην πλατφόρμα E-Class.	
ΟΡΓΑΝΩΣΗ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ	Δραστηριότητα	Φόρτος Εργασίας Εξαμήνου
	Διαλέξεις	125
	Σύνολο Μαθήματος	125
ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗ ΦΟΙΤΗΤΩΝ	Οι εξετάσεις γίνονται στην Ελληνική γλώσσα, εκτός αν υπάρχουν φοιτητές ERASMUS οπότε μπορούν να γίνουν επιπλέον και στην Αγγλική. Γραπτή τελική εξέταση με θεωρητικές/πρακτικές Ερωτήσεις που καλύπτουν το σύνολο της ύλης και αφορούν τόσο στην αξιολόγηση των γνώσεων (θεωρία) όσο και των δεξιοτήτων (ασκήσεων) και ικανοτήτων (λήψη αποφάσεων εκτός των διδαχθέντων αλλά με βάση αυτά) των φοιτητών στο μάθημα. Είναι στη διάθεση των φοιτητών η κόλλα των εξετάσεών τους για να τους εξηγήσουμε τα λάθη τους.	

(5) ΣΥΝΙΣΤΩΜΕΝΗ-ΒΙΒΛΙΟΓΡΑΦΙΑ

Προτεινόμενη Βιβλιογραφία:

- Elton, E. J., Gruber, M. J., Brown, S. J., Goetzmann, W. N., Σύγχρονη θεωρία χαρτοφυλακίου και ανάλυση επενδύσεων, UTOPIA ΕΚΔΟΣΕΙΣ, 2016
- Reilly, K. F., Brown C. K., Ανάλυση Επενδύσεων και Διαχείριση Χαρτοφυλακίου, BROKEN HILL, 2018

Συναφή επιστημονικά περιοδικά:

Άρθρα από τη διεθνή βιβλιογραφία μπορεί να αναζητηθούν στους εκδοτικούς οίκους ELSEVIER, TAYLOR AND FRANCIS, WILEY, SPRINGER, EMERALD.