

ΠΕΡΙΓΡΑΜΜΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ

(1) ΓΕΝΙΚΑ

ΣΧΟΛΗ	Επιστημών Διοίκησης και Οικονομίας		
ΤΜΗΜΑ	Λογιστικής και Χρηματοοικονομικής		
ΕΠΙΠΕΔΟ ΣΠΟΥΔΩΝ	Προπτυχιακό		
ΚΩΔΙΚΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	4	ΕΞΑΜΗΝΟ ΣΠΟΥΔΩΝ	6
ΤΙΤΛΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	Διαχείριση Χρηματοοικονομικών Κινδύνων		
ΑΥΤΟΤΕΛΕΙΣ ΔΙΔΑΚΤΙΚΕΣ ΔΡΑΣΤΗΡΙΟΤΗΤΕΣ	ΕΒΔΟΜΑΔΙΑΙΕΣ ΩΡΕΣ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ	ΠΙΣΤΩΤΙΚΕΣ ΜΟΝΑΔΕΣ	
Διαλέξεις και Ασκήσεις Πράξεις	3	6	
ΤΥΠΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	Υποχρεωτικό, Ειδικού Υποβάθρου.		
ΠΡΟΑΠΑΙΤΟΥΜΕΝΑ ΜΑΘΗΜΑΤΑ:	ΟΧΙ		
ΓΛΩΣΣΑ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ και ΕΞΕΤΑΣΕΩΝ:	ΕΛΛΗΝΙΚΗ		
ΤΟ ΜΑΘΗΜΑ ΠΡΟΣΦΕΡΕΤΑΙ ΣΕ ΦΟΙΤΗΤΕΣ ERASMUS	ΝΑΙ		
ΗΛΕΚΤΡΟΝΙΚΗ ΣΕΛΙΔΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ (URL)	https://eclass.hmu.gr/courses/DLH148/		

(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 των χρηματοοικονομικών κινδύνων και τις σύγχρονες τεχνικές αξιολόγησης τους, έτσι ώστε οι γνώσεις που θα έχουν αποκτήσει να αποδεικνύονται από την κριτική κατανόηση των σύγχρονων μορφών χρηματοοικονομικών κινδύνων. • να διακρίνουν, να εξηγούν ή να υπολογίζουν και να ταξινομούν, τις έννοιες της δυνητικής ζημίας (Value-at-Risk) και διαφόρων τεχνικών αποτίμησης των κινδύνων, 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 αποφάσεων τεκμηριώνοντας την ικανότητα που απέκτησαν από το μάθημα να αναλύουν νέες καταστάσεις. <p>Συνολικά, μετά την ολοκλήρωση του μαθήματος οι φοιτητές θα έχουν αποκτήσει επάρκεια γνώσεων και δεξιοτήτων, έτσι ώστε να εφαρμόζουν επιτυχώς τις σύγχρονες τεχνικές της διαχείρισης χρηματοοικονομικών κινδύνων. Θα μπορούν επομένως να είναι σε θέση να κατανοούν τη σημασία των χρηματοοικονομικών κινδύνων και των μεθόδων VaR, ώστε να λειτουργήσουν υπεύθυνα και αυτόνομα</p>

ως χρηματοοικονομικοί αναλυτές σε Διεθνή Χρηματιστήρια και Οργανισμούς (τράπεζες).

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

Έννοια και Κατηγορίες Κινδύνου. Κίνδυνος Αγοράς. Πιστωτικός Κίνδυνος. Κίνδυνος Επιτοκίου. Συναλλαγματικός Κίνδυνος. Λειτουργικός Κίνδυνος. Κίνδυνος Ρευστότητας. Κίνδυνος Μετοχών και Χαρτοφυλακίων. Η Επιτροπή της Βασιλείας. Υπολογισμός Αξίας σε Κίνδυνο (VaR). Διαχείριση Κινδύνων. Τεχνικές Εκτίμησης Κινδύνου. Υπολογισμός του κινδύνου σε χρηματοοικονομικά παράγωγα. μετοχές και χαρτοφυλάκια (με παραδείγματα). Διαχείριση Κινδύνου: Διδάγματα από τη κρίση και προοπτικές.

ΕΝΟΤΗΤΕΣ:

- Εισαγωγή στους Χρηματοοικονομικούς Κινδύνους
- Μέτρηση κινδύνου και μεταβλητότητας αγοράς
- Εισαγωγή στη μέθοδο VaR
- Υπολογισμός VaR με αναλυτικές μεθόδους
- Υπολογισμός VaR με μεθόδους προσομοίωσης
- Τραπεζικοί Κίνδυνοι I
- Τραπεζικοί Κίνδυνοι II
- Πιστωτικός Κίνδυνος
- Προσομοίωση Καταστάσεων Κρίσης (Stress Testing)
- Ειδικά θέματα Διαχείρισης Κινδύνων

(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:

- Saunders, A., Cornett, M., Διοίκηση Χρηματοπιστωτικών Ιδρυμάτων και Διαχείριση Κινδύνων, BROKEN HILL, 2017
- Συλλιγάρδος Γ., Σχοινιωτάκης Ν., Χρήμα, Τράπεζες, Αγορές και Διαχείριση Κινδύνων, ΔΙΣΙΓΜΑ, 2018

Συναφή επιστημονικά περιοδικά:

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