

Τίτλος Μαθήματος	Επενδύσεις και Διαχείριση Κινδύνων				
Κωδικός Μαθήματος	MBA650				
Τύπος μαθήματος	Επιλεγόμενο				
Επίπεδο	Μάστερ (2 <sup>ος</sup> κύκλος)				
Έτος / Εξάμηνο φοίτησης	2 <sup>ο</sup> Έτος / 3 <sup>ο</sup> Εξάμηνο				
Όνομα Διδάσκοντα	Θα ανακοινωθεί				
ECTS	10	Διαλέξεις / εβδομάδα	Μέχρι 6 τηλεσυναντήσεις	Εργαστήρια / Εβδομάδα	Κανένα
Στόχοι Μαθήματος	<p>Αυτό το μάθημα θα εισαγάγει τους φοιτητές στις βασικές αρχές των επενδύσεων, των χρηματοοικονομικών αγορών και τα κύρια είδη των παραγόντων κινδύνου που αντιμετωπίζουν τα χρηματοοικονομικά ιδρύματα σένα μεταβαλλόμενο οικονομική περιβάλλον. Το μάθημα θα εξοικείωση τους φοιτητές με τα εργαλεία και τις τεχνικές που χρησιμοποιούνται συνήθως για την αναγνώριση και την διαχείριση του χρηματοοικονομικού κίνδυνου. Οι φοιτητές θα διερευνούν και θα αναπτύσσουν μεθόδους εκτίμησης για την αξιολόγηση, τη μέτρηση και τον μετριασμό του κινδύνου των χρηματοοικονομικών αξιογράφων.</p>				
Μαθησιακά Αποτελέσματα	<p>Αναμένεται, ότι με την ολοκλήρωση του μαθήματος οι φοιτητές/τριες θα είναι σε θέση να :</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>• Αναγνωρίζουν τα βασικά χαρακτηριστικά των διαφόρων επενδυτικών μέσων και την οργάνωση και λειτουργία των αγορών χρεογράφων.</li> <li>• Αναγνωρίζουν τις έννοιες της απόδοσης και του κινδύνου, τους τρόπους με τους οποίους μπορούν να μετρηθούν και τη σημασία τους όσον αφορά τους στόχους των επενδυτών.</li> <li>• Αναλύουν το πλαίσιο της διαχείρισης του κινδύνου, τον εντοπισμός των κινδύνων και την ιεράρχηση του.</li> <li>• Αναγνωρίζουν και εφαρμόζουν τις θεωρίες διαχείρισης κινδύνων στην πράξη, τις εφαρμόζουν στον τραπεζικό, ασφαλιστικό, χρηματοπιστωτικό τομέα και τις επιχειρήσεις.</li> <li>• Εφαρμόζουν και αναλύουν εργαλεία Δικαιωμάτων Προαίρεσης.</li> </ul>				

	<ul style="list-style-type: none"> <li>• Εφαρμόζουν τον τύπο Black-Scholes και το Διωνυμικό Δέντρο για την αποτημηση Δικαιωμάτων Προαίρεσης.</li> <li>• Εφαρμόζουν το μοντέλο VAR.</li> </ul>		
Προαπαιτούμενα	Κανένα	Συναπαιτούμενα	Κανένα
Περιεχόμενο Μαθήματος	<p>Μια σύντομη ιστορική διαδρομή του κινδύνου και της απόδοσης. Αγορά και πώληση χρεογράφων. Είδη Χρεογράφων. Αμοιβαία κεφάλαια. Το χρηματιστήριο και η αποτίμηση κοινών μετοχών. Η συμπεριφορά της τιμής της μετοχής και αποτελεσματικότητα της αγοράς. Επιτόκια. Τιμές των ομολόγων και αποδόσεις. Εταιρικά ομόλογα. Κρατικά ομόλογα. Τίτλων που εξασφαλίζονται με υποθήκη. Δικαιώματα προαίρεσης μετοχών. Αποτίμησης αξίας δικαιωμάτων προαίρεσης. Συμβόλαια μελλοντικής εκπλήρωσης. Διαφοροποίηση και κατανομή περιουσιακών στοιχείων. Απόδοση, Κίνδυνος και Γραμμή κεφαλαιαγοράς. Αξιολόγηση της απόδοσης και διαχείριση κινδύνων Αξία σε κίνδυνο (VAR μοντέλο).</p>		
Μεθοδολογία Διδασκαλίας	Εξ Αποστάσεως Εκπαίδευση		
Βιβλιογραφία	<p>Corrado C. and Jordan B.: FUNDAMENTALS OF INVESTMENT, Irwin McGraw Hill, (latest edition)</p> <p>Hull John: Risk Management and Financial Institutions, Prentice Hall, (latest edition)</p> <p>Zvi Bodie, Alex Kane &amp; Alan J. Marcus: Investments, McGraw-Hill, International Editions, (latest edition)</p> <p>Hull John: Option, Futures &amp; Other Derivatives, Prentice Hall, (latest edition)</p> <p>Jorion, Phillippe: Value at Risk, McGraw Hill, (latest edition)</p> <p>Sharpe W., Alexander G. and Bailey J.: INVESTMENTS, Prentice Hall, (latest edition).</p>		

Αξιολόγηση	Εξετάσεις	50%	
	Συνεχιζόμενες Δραστηριότητες Αξιολόγησης	50%	
Γλώσσα	Ελληνική		