

<b>ΠΕΡΙΓΡΑΦΜΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ «Χρηματοοικονομική Οικονομετρία»</b>			
<b>ΣΧΟΛΗ</b>	Σχολή Οικονομικών Επιστημών		
<b>ΤΜΗΜΑ</b>	Λογιστικής και Χρηματοοικονομικής		
<b>ΕΠΙΠΕΔΟ ΣΠΟΥΔΩΝ</b>	Προπτυχιακό		
<b>ΚΩΔΙΚΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ</b>	AF703	<b>ΕΞΑΜΗΝΟ ΣΠΟΥΔΩΝ</b>	7 <sup>ο</sup>
<b>ΤΙΤΛΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ</b>	Χρηματοοικονομική Οικονομετρία		
<b>ΑΥΤΟΤΕΛΕΙΣ ΔΙΔΑΚΤΙΚΕΣ ΔΡΑΣΤΗΡΙΟΤΗΤΕΣ</b>	<b>ΕΒΔΟΜΑΔΙΑΙΕΣ ΩΡΕΣ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ</b>	<b>ΠΙΣΤΩΤΙΚΕΣ ΜΟΝΑΔΕΣ</b>	
Διαλέξεις	3	5	
<b>Σύνολο</b>	<b>3</b>	<b>5</b>	
<b>ΤΥΠΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ</b>	Επιστημονικής Περιοχής		
<b>ΠΡΟΑΠΑΙΤΟΥΜΕΝΑ ΜΑΘΗΜΑΤΑ:</b>	Οικονομετρία I & II, Μαθηματικά, Στατιστική		
<b>ΓΛΩΣΣΑ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ και ΕΞΕΤΑΣΕΩΝ:</b>	Ελληνική		
<b>ΤΟ ΜΑΘΗΜΑ ΠΡΟΣΦΕΡΕΤΑΙ ΣΕ ΦΟΙΤΗΤΕΣ ERASMUS</b>	Ναι		
<b>ΗΛΕΚΤΡΟΝΙΚΗ ΣΕΛΙΔΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ (URL)</b>			
<b>Μαθησιακά Αποτελέσματα</b>			
<p>Το μάθημα της χρηματοοικονομικής οικονομτρίας επικεντρώνεται στη διδασκαλία γραμμικής άλγεβρας, στατιστικής και οικονομτρικών τεχνικών που επιτρέπουν την εξαγωγή ποσοτικών συμπερασμάτων από εμπειρικά χρηματοοικονομικά δεδομένα. Γίνεται εκτενής αναφορά στην εμπειρική διερεύνηση της ισχύος χρηματοοικονομικών θεωριών και στη διενέργεια προβλέψεων με τη χρήση χρηματο - οικονομτρικών υποδειγμάτων.</p>			
<b>Γενικές Ικανότητες</b>			
<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Αναζήτηση, ανάλυση και σύνθεση δεδομένων και πληροφοριών, με τη χρήση και των απαραίτητων τεχνολογιών</li> <li>2. Λήψη αποφάσεων</li> <li>3. Αυτόνομη Εργασία</li> <li>4. Παραγωγή νέων ερευνητικών ιδεών</li> </ol>			
<b>Περιεχόμενο Μαθήματος</b>			
<ol style="list-style-type: none"> <li>1. Βασικές έννοιες (Χρονική σειρά, Στοχαστική διαδικασία, Λευκός θόρυβος, Τυχαίος περίπατος, Ολοκληρωμένη χρονική σειρά, Κίβδηλες παλινδρομήσεις)</li> <li>2. Στασιμότητα/ Έλεγχοι Μοναδιαίας Ρίζας (Εφαρμογές με το Οικονομετρικό Πακέτο Eviews).</li> <li>3. Υποδείγματα AR, MA, ARMA, ARIMA</li> <li>4. Μεθοδολογία Box-Jenkins</li> <li>5. Προβλέψεις</li> <li>6. Υποδείγματα ARCH-GARCH</li> <li>7. Αποτελεσματικότητα, Προβλεπτική Ικανότητα και αστάθεια των χρηματοοικονομικών χρονικών σειρών.</li> </ol>			

8. Έλεγχος της αποτελεσματικότητας της αγοράς και time varying risk premium: μετοχές, ομόλογα, συναλλαγματικές ισοτιμίες.		
<b>Διδακτικές και Μαθησιακές Μέθοδοι - Αξιολόγηση</b>		
<b>ΤΡΟΠΟΣ ΠΑΡΑΔΟΣΗΣ</b>	Πρόσωπο με πρόσωπο	
<b>ΧΡΗΣΗ ΤΕΧΝΟΛΟΓΙΩΝ ΠΛΗΡΟΦΟΡΙΑΣ ΚΑΙ ΕΠΙΚΟΙΝΩΝΙΩΝ</b>	Υποστήριξη Μαθησιακής διαδικασίας μέσω της ηλεκτρονικής πλατφόρμας e-class Χρήση οικονομετρικού λογισμικού E-Views	
<b>ΟΡΓΑΝΩΣΗ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ</b>	<b>Δραστηριότητα</b>	<b>Ώρες</b>
	Διαλέξεις	50
	Εκμάθηση λογισμικού E-Views με τη βοήθεια υπολογιστών σε Εργαστήριο	50
	Αυτοτελής Μελέτη	50
	<b>Σύνολο Φόρτου Εργασίας Εξαμήνου Μαθήματος</b>	<b>150</b>
<b>ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗ ΦΟΙΤΗΤΩΝ</b>	Γραπτή Εργασία 30% Γραπτή τελική εξέταση 70%	
<b>Συνιστώμενη Βιβλιογραφία</b>		
<b>Βιβλιογραφία:</b>		
1) Δριτσάκης, Ν., Δριτσάκη Χ. και Δριτσάκη Μ. (2022) Εισαγωγή στη Χρηματοοικονομική Οικονομετρία με τη χρήση του λογισμικού EViews, Εκδόσεις Κλειδάριθμος, Αθήνα		
2) Δημέλη Σ. (2013) Σύγχρονες Μέθοδοι Ανάλυσης Χρονολογικών Σειρών, Εκδόσεις ΟΠΑ, Αθήνα		
3) Chris Brooks (2022) Εισαγωγή στην Χρηματοοικονομική Οικονομετρία, Εκδόσεις Gutenberg, Αθήνα		
4) Campbell J., A. Lo and G. MacKinlay, (1997) The Econometrics of Financial Markets, Princeton Univ. Press		
5) Hamilton J. D. (1994) Time Series Analysis, Princeton University Press.		
6) Mills T. and R Markellos (2008) The Econometric Modelling of Financial Time Series, Cambridge Univ. Press		
<b>Συναφή Επιστημονικά Περιοδικά:</b>		
1) Dritsaki M. and Dritsaki, C. (2021). "Comparison of the Holt-Winters exponential smoothing method with ARIMA models: Forecasting of GDP per capita in five Balkan countries members of European Union (EU) post COVID", Modern Economy, Vol.12 No.12, pp.1972-1998. (Impact Factor).		
2) Dritsaki M. and Dritsaki, C. (2020). "Forecasting European Union CO2 emissions using autoregressive integrated moving average-autoregressive conditional heteroscedasticity models", International Journal of Energy Economics and Policy, Vol.10, No.4, pp.411-423. (Impact Factor, Scopus)		
3) Dritsaki C. (2019). "Modeling the volatility of exchange rate currency using GARCH model", Economia Internazionale, Vol.72, No.2, pp.209-230. (Impact Factor).		
4) Dritsaki C. (2018). "The performance of hybrid ARIMA-GARCH modelling and forecasting oil price" International Journal of Energy Economics and Policy, Vol.8, No.3, pp.14-21. (Scopus, Impact Factor).		
5) Dritsaki C. (2017). "An empirical evaluation in GARCH volatility modeling: Evidence from the Stockholm stock exchange" Journal of Mathematical Finance, Vol.7, No.2, pp.366-390. (Scopus, Impact Factor).		

