**ΠΕΡΙΓΡΑΜΜΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ**

1. **ΓΕΝΙΚΑ**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **ΣΧΟΛΗ** | Οικονομικών και Διοικητικών Επιστημών | | | | |
| **ΤΜΗΜΑ** | Λογιστικής και Χρηματοοικονομικής | | | | |
| **ΕΠΙΠΕΔΟ ΣΠΟΥΔΩΝ** | Προπτυχιακό | | | | |
| **ΚΩΔΙΚΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ** | **ΠΜ403** | **ΕΞΑΜΗΝΟ ΣΠΟΥΔΩΝ** | | **Δ’** | |
| **ΤΙΤΛΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ** | Χρηματοοικονομική Οικονομετρία | | | | |
| **ΑΥΤΟΤΕΛΕΙΣ ΔΙΔΑΚΤΙΚΕΣ ΔΡΑΣΤΗΡΙΟΤΗΤΕΣ** *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* | | | **ΕΒΔΟΜΑΔΙΑΙΕΣ ΩΡΕΣ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ** | | **ΠΙΣΤΩΤΙΚΕΣ ΜΟΝΑΔΕΣ** |
| Διαλέξεις | | | 3 | | 5 |
|  | | |  | |  |
|  | | |  | |  |
| *Προσθέστε σειρές αν χρειαστεί. Η οργάνωση διδασκαλίας και οι διδακτικές μέθοδοι που χρησιμοποιούνται περιγράφονται αναλυτικά στο (δ).* | | |  | |  |
| **ΤΥΠΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ**  *γενικού υποβάθρου,  ειδικού υποβάθρου, ειδίκευσης*  *γενικών γνώσεων, ανάπτυξης δεξιοτήτων* | Ειδικού Υποβάθρου | | | | |
| **ΠΡΟΑΠΑΙΤΟΥΜΕΝΑ ΜΑΘΗΜΑΤΑ:** | ΟΧΙ | | | | |
| **ΓΛΩΣΣΑ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ και ΕΞΕΤΑΣΕΩΝ:** | Ελληνικά | | | | |
| **ΤΟ ΜΑΘΗΜΑ ΠΡΟΣΦΕΡΕΤΑΙ ΣΕ ΦΟΙΤΗΤΕΣ ERASMUS** |  | | | | |
| **ΗΛΕΚΤΡΟΝΙΚΗ ΣΕΛΙΔΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ (URL)** | https://eclass.uth.gr/courses/ACCFIN\_U\_127/ | | | | |

1. **ΜΑΘΗΣΙΑΚΑ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΑ**

|  |  |
| --- | --- |
| **Μαθησιακά Αποτελέσματα** | |
| *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.*  *Συμβουλευτείτε το Παράρτημα Α*   * *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* | |
| Σκοπός του μαθήματος είναι η κατανόηση και μελέτη οικονομετρικών τεχνικών και μεθόδων που εφαρμόζονται στα χρηματοοικονομικά και ιδιαίτερα στις χρηματοοικονομικές χρονολογικές σειρές. Στο τέλος του μαθήματος οι διδασκόμενοι με την επιτυχή ολοκλήρωση του μαθήματος:  ● Θα έχει αποκτήσει βασικές γνώσεις πάνω στο αντικείμενο της οικονομετρίας.  ● Θα είναι εξοικειωμένος με τις διαφορετικές κατηγορίες των χρηματοοικονομικών δεδομένων και με τον τρόπο με τον οποίο τους χρησιμοποιούμε στην οικονομετρική ανάλυση.  ● Θα έχει αποκτήσει βασικές γνώσεις πάνω στο αντικείμενο των χρονολογικών σειρών.  ● Θα είναι σε θέση να εφαρμόζει τις τεχνικές αυτές στην μελέτη σημαντικών προβλημάτων της χρηματοοικονομικής.  ● Θα μπορεί να κάνει πρόβλεψη με χρηματοοικονομικά δεδομένα χρησιμοποιώντας προχωρημένες οικονομετρικές τεχνικές, καθώς επίσης θα είναι και σε θέση να εξετάζει την αποτελεσματικότητά τους.  ●Σημαντικό μέρος του μαθήματος περιλαμβάνει την ενασχόληση των φοιτητών με εφαρμογή των υποδειγμάτων σε πραγματικά δεδομένα. | |
| **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…*  *…….* |
| Λήψη αποφάσεων Αυτόνομη Εργασία Εργασία σε διεθνές περιβάλλον Παραγωγή νέων ερευνητικών ιδεών  Προσαρμογή σε νέες καταστάσεις  Αναζήτηση, ανάλυση και σύνθεση δεδομένων και πληροφοριών, με τη χρήση και των απαραίτητων τεχνολογιών  Σχεδιασμός και διαχείριση έργων  Εργασία σε διεπιστημονικό περιβάλλον  Εργασία σε διεθνές περιβάλλον | |

1. **ΠΕΡΙΕΧΟΜΕΝΟ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ**

|  |
| --- |
| Σκοπός του μαθήματος είναι να παρουσιάσει την απλή και πολλαπλή παλινδρόμηση σε χρηματοοικονομικές σειρές δεδομένων. Παριαβάσεις υποθέσεων: αυτοσυσχέτιση, ετεροσκεδαστικότητα, στατιστικοί έλεγχοι, εκτιμητές GLS και FGLS, συσχέτιση ερμηνευτικών μεταβλητών και στοχαστικού όρου, πολυσυγγραμικότητα, λανθασμένη εξειδίκευση. Μοντέλα παλινδρόμησης περιορισμένης εξαρτημένης μεταβλητής. Μοντέλα ARIMA και μεθοδολογία Box-Jenkins. Μοντέλα ARCH-GARCH. Μοντέλα αυτοπαλίνδρομου διανύσματος και έλεγχοι αιτιότητας. Μη στασιμότητα και έλεγχοι μοναδιαίας ρίζας. Συνολοκλήρωση και μοντέλα διόρθωσης σφάλματος. Ταυτοποίηση σε τυπικά και συνολοκληρωμένα συτήματα. Παραδοσιακά μοντέλα με δεδομένα πάνελ. Δυναμικά ετερογενή πάνελ. Μη στάσιμα πάνελ. |

1. **ΔΙΔΑΚΤΙΚΕΣ και ΜΑΘΗΣΙΑΚΕΣ ΜΕΘΟΔΟΙ - ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗ**

|  |  |
| --- | --- |
| **ΤΡΟΠΟΣ ΠΑΡΑΔΟΣΗΣ** *Πρόσωπο με πρόσωπο, Εξ αποστάσεως εκπαίδευση κ.λπ.* | Δια ζώσης διδασκαλία |
| **ΧΡΗΣΗ ΤΕΧΝΟΛΟΓΙΩΝ ΠΛΗΡΟΦΟΡΙΑΣ ΚΑΙ ΕΠΙΚΟΙΝΩΝΙΩΝ** *Χρήση Τ.Π.Ε. στη Διδασκαλία, στην Εργαστηριακή Εκπαίδευση, στην Επικοινωνία με τους φοιτητές* | Χρήση ΤΠΕ στη Διδασκαλία (παρουσιάσεις σε power point). Επικοινωνία με τους φοιτητές μέσω της πλατφόρμας του eclass και email. Ανάρτηση διαφανειών και υλικού μαθήματος στην πλατφόρμα του eclass. |
| **ΟΡΓΑΝΩΣΗ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ**  *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.*  *Αναγράφονται οι ώρες μελέτης του φοιτητή για κάθε μαθησιακή δραστηριότητα καθώς και οι ώρες μη καθοδηγούμενης μελέτης σύμφωνα με τις αρχές του ECTS* | |  |  | | --- | --- | | ***Δραστηριότητα*** | ***Φόρτος Εργασίας Εξαμήνου*** | | Διαλέξεις | 39 | | Αυτόνομη Μελέτη | 61 | | Μελέτη και Ανάλυση Βιβλιογραφίας | 25 | |  |  | |  |  | |  |  | |  |  | |  |  | |  |  | | Σύνολο Μαθήματος | ***125*** | |
| **ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗ ΦΟΙΤΗΤΩΝ**  *Περιγραφή της διαδικασίας αξιολόγησης*  *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*  *Αναφέρονται ρητά προσδιορισμένα κριτήρια αξιολόγησης και εάν και που είναι προσβάσιμα από τους φοιτητές.* | Τελική γραπτή εξέταση/Απαλλακτική πρόοδος |

1. **ΣΥΝΙΣΤΩΜΕΝΗ-ΒΙΒΛΙΟΓΡΑΦΙΑ**

|  |
| --- |
| Εφαρμοσμένη Οικονομετρία, Dimitrios Asteriou, Stephen Hall. Έκδοση: 1η Ελληνική από 3η Αγγλική/2018, Εκδόσεις ΠΡΟΠΟΜΠΟΣ.  Οικονομετρία: Πρακτικός Οδηγός Χρήσης, Studenmund A. Έκδοση: 1η έκδ./2016, Διαθέτης (Εκδότης): BROKEN HILL PUBLISHERS LTD |