ΠΕΡΙΓΡΑΜΜΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ

(1) ΓΕΝΙΚΑ

ΣΧΟΛΗ	ΘΕΤΙΚΩΝ ΕΠΙΣΤΗΜΩΝ		
ΤΜΗΜΑ	ΣΤΑΤΙΣΤΙΚΗΣ & ΑΝΑΛΟΓΙΣΤΙΚΩΝ – ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΩΝ ΜΑΘΗΜΑΤΙΚΩΝ		
ΕΠΙΠΕΔΟ ΣΠΟΥΔΩΝ	ΜΕΤΑΠΤΥΧΙΑΚΟ **Στατιστική & Αναλογιστικά – Χρηματοοικονομικά Μαθηματικά**		
ΚΩΔΙΚΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	**333-2105**	**ΕΞΑΜΗΝΟ ΣΠΟΥΔΩΝ**	**Β**
ΤΙΤΛΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	ΜΕΤΡΗΣΗ ΚΑΙ ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΗ ΚΙΝΔΥΝΟΥ		

ΑΥΤΟΤΕΛΕΙΣ ΔΙΔΑΚΤΙΚΕΣ ΔΡΑΣΤΗΡΙΟΤΗΤΕΣ	**ΕΒΔΟΜΑΔΙΑΙΕΣ ΩΡΕΣ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ**	**ΠΙΣΤΩΤΙΚΕΣ ΜΟΝΑΔΕΣ**
	2	6

ΤΥΠΟΣ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ	ΕΙΔΙΚΕΥΣΗΣ ΓΕΝΙΚΩΝ ΓΝΩΣΕΩΝ
ΠΡΟΑΠΑΙΤΟΥΜΕΝΑ ΜΑΘΗΜΑΤΑ:	ΟΧΙ
ΓΛΩΣΣΑ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ και ΕΞΕΤΑΣΕΩΝ:	ΕΛΛΗΝΙΚΗ
ΤΟ ΜΑΘΗΜΑ ΠΡΟΣΦΕΡΕΤΑΙ ΣΕ ΦΟΙΤΗΤΕΣ ERASMUS	ΝΑΙ
ΗΛΕΚΤΡΟΝΙΚΗ ΣΕΛΙΔΑ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ (URL)	http://msc.actuar.aegean.gr/modules.html

(2) ΜΑΘΗΣΙΑΚΑ ΑΠΟΤΕΛΕΣΜΑΤΑ

Μαθησιακά Αποτελέσματα
ρκληρώνοντας επιτυχώς το μάθημα οι φοιτητές θα έχουν αποκτήσει μια σφαιρική εικόνα του ρόλου και της λειτουργίας ενός χρηματοοικονομικού οργανισμού από την οπτική της διοικητικής των κινδύνων που αυτή αντιμετωπίζει και θα είναι σε θέση να κατανοούν, να αξιολογούν, να υπολογίζουν και να ερμηνεύουν διάφορα μέτρα, μοντέλα και μεθόδους διαχείρισης χρηματοοικο-νομικών κινδύνων όπως περιγράφονται στο περιεχόμενο του μαθήματος.
Γενικές Ικανότητες
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 Σχεδιασμός και διαχείριση έργων Άσκηση κριτικής και αυτοκριτικής Προαγωγή της ελεύθερης, δημιουργικής και επαγωγικής σκέψης

(3) ΠΕΡΙΕΧΟΜΕΝΟ ΜΑΘΗΜΑΤΟΣ

Χρηματοοικονομικοί κίνδυνοι και μέτρα κινδύνου, θεσμικό πλαίσιο, οικονομικό κεφάλαιο και κεφαλαιακή επάρκεια, διαχείριση ενεργητικού παθητικού, αξία σε κίνδυνο (VaR), Backtesting, Mapping, αναμενόμενο υπερβάλον έλλειμμα (Expected Shortfall), Φασματικά μέτρα κινδύνου, Συνεπή μέτρα κινδύνου, κίνδυνος αγοράς, κίνδυνος επιτοκίων, κίνδυνος ρευστότητας, πιστωτικός κίνδυνος.

(4) ΔΙΔΑΚΤΙΚΕΣ και ΜΑΘΗΣΙΑΚΕΣ ΜΕΘΟΔΟΙ - ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗ

<table>
<tr><td>ΤΡΟΠΟΣ ΠΑΡΑΔΟΣΗΣ</td><td>• Σύγχρονη και Ασύγχρονη Εξ αποστάσεως διδασκαλία.
• Πρόσωπο με πρόσωπο διδασκαλία.</td></tr>
<tr><td>ΧΡΗΣΗ ΤΕΧΝΟΛΟΓΙΩΝ ΠΛΗΡΟΦΟΡΙΑΣ ΚΑΙ ΕΠΙΚΟΙΝΩΝΙΩΝ</td><td>• Επικοινωνία με τους φοιτητές μέσω της πλατφόρμας τηλεκπαίδευσης eclass και email.
• Ανάρτηση υλικού του μαθήματος στην πλατφόρμα τηλεκπαίδευσης eclass.</td></tr>
<tr><td>ΟΡΓΑΝΩΣΗ ΔΙΔΑΣΚΑΛΙΑΣ</td><td><table>
<tr><th>Δραστηριότητα</th><th>Φόρτος Εργασίας Εξαμήνου</th></tr>
<tr><td>Διαλέξεις</td><td>24</td></tr>
<tr><td>Εργασίες – projects – εργαστήρια</td><td>52</td></tr>
<tr><td>Αυτοτελής μελέτη</td><td>74</td></tr>
<tr><td></td><td></td></tr>
<tr><td>Σύνολο Μαθήματος (25 ώρες φόρτου εργασίας ανά πιστωτική μονάδα)</td><td>150</td></tr>
</table></td></tr>
<tr><td>ΑΞΙΟΛΟΓΗΣΗ ΦΟΙΤΗΤΩΝ</td><td>Η αξιολόγηση των φοιτητών πραγματοποιείται μέσω εκπόνησης και παρουσίασης εργασίας και γραπτής εξέτασης η οποία περιλαμβάνει ερωτήσεις σύντομης απάντησης, και επίλυση προβλημάτων.

Οι φοιτητές με μαθησιακές δυσκολίες εξετάζονται προφορικά.</td></tr>
</table>

(5) ΣΥΝΙΣΤΩΜΕΝΗ-ΒΙΒΛΙΟΓΡΑΦΙΑ

- Προτεινόμενη Βιβλιογραφία:

1. Quantitative Risk Management: Concepts, Techniques and Tools, Alexander J. McNeil, Rudiger Frey, Paul Embrechts, Princeton Univ. Press, 2005
2. Risk Management, Michael Crouhy, Dan Galai and Robert Mark, McGraw-Hill.
3. Value at Risk, Philippe Jorion, 3rd Ed., Mc Graw Hill, 2006
4. Measuring Market Risk, Kevin Dowd, 2nd Ed., Wiley 2005”
5. On credit risk modelling and management, S. Xanthopoulos, Lecture Notes
6. Risk Management and Shareholders’ Value in Banking, A. Resti, A. Sironi, Wiley Finance
7. The Professional’s Handbook of Financial Risk Management, GARP (Global Association of Risk Professionals), Butterworth-Heinemann
8. Risk Management and Capital Adequacy, Reto Gallati, McGraw-Hill.
9. Financial Institutions Management, Anthony Saunders and Marcia Million Cornett, McGraw-Hill.
10. Understanding Market, Credit, and Operational Risk: The Value at Risk Approach, Linda Allen, Jacob Boudoukh and Anthony Saunders, Oxford: Blackwell Publishing
11. Θέματα στη διαχείριση Τραπεζικών Κινδύνων, Σ. Ξανθόπουλος, Σημειώσεις Παραδόσεων.