

ΑΝΑΛΥΣΗ-ΔΙΑΧΕΙΡΙΣΗ ΧΡΗΜΑΤΟΟΙΚΟΝΟΜΙΚΩΝ ΚΙΔΥΝΩΝ

Η εξεταστέα ύλη για τις περιόδους Φεβρουαρίου και Σεπτεμβρίου 2012-13 διαμορφώνεται ως εξής:

- Είδη χρηματοοικονομικού κινδύνου
- Ο ρόλος των ελεγκτικών αρχών
- Αξία στο κίνδυνο (Value-at-Risk)
- Μεθοδολογίες ανάλυσης / διαχείρισης κινδύνου αγοράς
- Ιστορική προσομοίωση
- Η προσέγγιση διακύμανσης διακύμανσης – συνδιακύμανσης (περίπτωση 2 και N χρεογράφων)
- Αλλαγή του χρονικού ορίζοντα υπολογισμού της VaR
- Μεθοδολογία ανάλυσης κινδύνου αγοράς RiskMetrics
- Η δέλτα-κανονική προσέγγιση
- Εξειδίκευση στις περιπτώσεις χαρτοφυλακίου συναλλάγματος, μετοχών και ομολόγων

Από το βιβλίο του κ. Ζαπράνη ιδιαίτερη έμφαση δίνεται στα κεφάλαια 1, 2, 4, 7 & 9 (ενότητες 9.1-9.2).

Συμπληρωματικές σημειώσεις που διανεμήθηκαν στην τάξη:

- Εισαγωγικές διαφάνειες
- Αξία στον Κίνδυνο
- Μεθοδολογία Ανάλυσης Κινδύνου Αγοράς

Κατά την εξέταση επιτρέπονται σημειώσεις και βιβλία, απαγορεύεται η χρήση του κινητού και του Internet