

Εργασία για το Μάθημα

Πληροφορίες για την βαθμολογία

Η Εργασία αντιστοιχεί σε βαθμό έξι (6).

Η επίδραση του βαθμού της εργασίας στο τελικό βαθμό σας γίνεται ως εξής:

Αν στις εξετάσεις γράψετε κάτω από πέντε (5) αλλά με τον βαθμό της εργασίας συγκεντρώνετε πέντε (5) βαθμούς ή μεγαλύτερο τότε ο τελικός σας βαθμός θα είναι πέντε (5)

Αν στις εξετάσεις γράψετε πέντε (5) ή περισσότερο ο βαθμός της εργασίας προστίθεται με τον περιορισμό ότι ο μέγιστος βαθμός δεν θα είναι μεγαλύτερος του δέκα (10)

Πληροφορίες για την εργασία

Για τις ανάγκες της εργασίας θα πρέπει να κατεβάσετε ημερήσιες τιμές από τρεις (3) μετοχές της επιλογής σας και τις τιμές του Γενικού δείκτη του Χρηματιστηρίου ή τις τιμές του FTSE-20, από το www.capital.gr , www.nafteboriki.gr ή από όποια άλλη πηγή έχετε πρόσβαση.

Άσκηση 1 (50%)

Για κάθε μετοχή και τον δείκτη θα πρέπει να υπολογίσετε

1. Την ετήσια ποσοστιαία απόδοση που για τα έτη 2021, 2022, 2023 και την απόδοση του 2024. Για το 2024 χρησιμοποιήστε όσες παρατηρήσεις (τιμές) είναι διαθέσιμες.
2. Την τυπική απόκλιση για τα έτη 2021, 2022, 2023 και 2024.
3. Την ετήσια ποσοστιαία απόδοση για την περίοδο 2021-2023.
4. Την τυπική απόκλιση για την περίοδο 2021-2023.
5. Χρησιμοποιώντας τις τιμές των τριών μετοχών, να δημιουργήσετε έναν δείκτη Σταθμισμένο με βάση την τιμή (price weighted)
6. Να συγκρίνετε τον δείκτη που δημιουργήσατε με τον Γενικό δείκτη του Χρηματιστηρίου ή τον FTSA-20.

Άσκηση 2 (50%)

Χρησιμοποιώντας της αποδόσεις των τριών (3) μετοχών της 1ης ενότητας να υπολογίστε το χαρτοφυλάκιο ελάχιστου κινδύνου.

Θα πρέπει να αναφέρετε την μέση απόδοση και τον κίνδυνο του χαρτοφυλακίου καθώς και τις βέλτιστες σταθμίσεις.

Τέλος θα πρέπει να περιγράψετε τα βήματα που ακολουθήσατε για να φτάσετε στην λύση.

Για όποια απορία τυχών έχετε παρακαλώ επικοινωνήστε μαζί μου στο s.nikolopoulos@go.uop.gr

Με εκτίμηση