

Εργασία για το Μάθημα

Πληροφορίες για την βαθμολογία

Η μέγιστη βαθμολογία της εργασίας είναι 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)

Καταληκτική Ημερομηνία υποβολής της εργασίας στο eclass: 31-5-2025

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.naftemporiki.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 2022, 2023, 2024 και 2025. Για το 2025 χρησιμοποιήστε όσες παρατηρήσεις (τιμές) είναι διαθέσιμες.
2. Την τυπική απόκλιση για τα έτη 2022, 2023, 2024 και 2025.
3. Την ετήσια ποσοστιαία απόδοση για την περίοδο 2022-2025.
4. Την τυπική απόκλιση για την περίοδο 2022-2025.
5. Χρησιμοποιήστε τις μετοχές που επιλέξατε και δημιουργήσετε έναν δείκτη σταθμισμένο με βάση την τιμή (price weighted indexes) και έναν με βάση την κεφαλαιοποίηση (capitalization-weighted index).
6. Να συγκρίνετε τους δείκτες που δημιουργήσατε με τον Γενικό δείκτη του Χρηματιστηρίου ή τον FTSA-20 και να σχολιάσετε κριτικά τα ευρήματά σας.

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 τυχόν έχετε παρακαλώ επικοινωνήστε μαζί μου στο s.nikolopoulos@go.uop.gr

Με εκτίμηση

Σωτήριος Δ. Νικολόπουλος