



ΕΛΛΗΝΙΚΗ ΔΗΜΟΚΡΑΤΙΑ
Εθνικόν και Καποδιστριακόν
Πανεπιστήμιον Αθηνών

— ΙΔΡΥΘΕΝ ΤΟ 1837 —

ΤΜΗΜΑ ΟΙΚΟΝΟΜΙΚΩΝ ΕΠΙΣΤΗΜΩΝ

ΠΡΟΣΚΛΗΣΗ ΕΚΔΗΛΩΣΗΣ ΕΝΔΙΑΦΕΡΟΝΤΟΣ ΓΙΑ ΕΚΠΟΝΗΣΗ
ΜΕΤΑΔΙΔΑΚΤΟΡΙΚΗΣ ΕΡΕΥΝΑΣ ΣΤΟ ΤΜΗΜΑ ΟΙΚΟΝΟΜΙΚΩΝ ΕΠΙΣΤΗΜΩΝ ΤΟΥ
ΕΚΠΑ

Το Τμήμα Οικονομικών Επιστημών του Εθνικού και Καποδιστριακού Πανεπιστημίου Αθηνών στη συνεδρίαση της Συνέλευσης της 24^{ης} Απριλίου 2024, αποφάσισε την προκήρυξη μεταδιδακτορικής έρευνας για 1 (έναν/μία) υποψήφιο (α) στο επιστημονικό πεδίο: **Τίτλος στα ελληνικά: «Στρατηγική κατανομή χαρτοφυλακίου: Χρήση μοντέλων μεταβλητότητας για τη βελτιστοποίηση της διαφοροποίησης σε δυναμικές αγορές περιουσιακών στοιχείων»**

Τίτλος στα αγγλικά: “Strategic Portfolio Allocation: Utilizing Volatility Models to Optimize Diversification in Dynamic Asset Markets”

Περιγραφή της θέσης:

Η τελευταία εποχή, όπου η τεχνολογική εξέλιξη και το γεωπολιτικό ρίσκο καθιστούν τη δημιουργία αποδοτικών χαρτοφυλακίων πιο σημαντική από ποτέ, απαιτεί νέες προσεγγίσεις και μεθόδους. Σε αυτό το πλαίσιο, προκηρύσσεται μια μεταδιδακτορική θέση ερευνητή για την ανάλυση της σύνθετης δυναμικής των αγορών περιουσιακών στοιχείων και την ανάπτυξη στρατηγικών διαχείρισης χαρτοφυλακίου με βάση προηγμένα μοντέλα και τεχνολογίες.

Οι κύριοι άξονες της έρευνας εστιάζουν στη χρήση εξελιγμένων μοντέλων μεταβλητότητας όπως το Multivariate GARCH, Local Gaussian Correlations, FC-VAR, και TVP-VAR. Ο σκοπός είναι η βαθύτερη κατανόηση των αλληλεπιδράσεων μεταξύ διαφορετικών τύπων αξιογράφων όπως πράσινα, μπλε και καφέ ομόλογα, καθώς και η μελέτη της επίδρασης της κλιματικής αλλαγής στις

ναυτιλιακές αγορές. Επίσης, η έρευνα θα επεκταθεί στην αξιολόγηση εναλλακτικών περιουσιακών στοιχείων όπως τα σπάνια μέταλλα, τα ακίνητα, και την τέχνη.

Ένας βασικός στόχος της έρευνας είναι η ενσωμάτωση της μηχανικής μάθησης στην ανάλυση χρηματοοικονομικών δεδομένων, με στόχο τη δημιουργία πιο αποδοτικών και διαφοροποιημένων στρατηγικών διαχείρισης χαρτοφυλακίου. Οι ερευνητικές προσπάθειες θα καθοδηγούνται από την ιδέα της ολοκληρωμένης ανάλυσης που συνδυάζει την οικονομική θεωρία με την εμπειρική πραγματικότητα των αγορών. Αυτό θα επιτευχθεί μέσα από την ενσωμάτωση ενός ευρύτερου φάσματος επεξηγηματικών μεταβλητών στα μοντέλα ανάλυσης.

Η μεταδιδακτορική έρευνα θα ξεκινήσει το χειμερινό εξάμηνο του επόμενου ακαδημαϊκού έτους (2024-2025) και η διάρκειά της θα είναι το πολύ τρία (3) έτη.

Προσόντα υποψηφίου:

Ο υποψήφιος, προκειμένου να γίνει δεκτός για μεταδιδακτορική έρευνα, οφείλει:

- να είναι κάτοχος διδακτορικού διπλώματος ελληνικού Πανεπιστημίου ή ομοταγούς του εξωτερικού, αναγνωρισμένου από το Ελληνικό Κράτος.
- να διαθέτει ακαδημαϊκό υπόβαθρο (διδακτορικό, δημοσιεύσεις, συμμετοχή σε συλλογικούς τόμους, βιβλία, ερευνητική εμπειρία) συναφές με το ανωτέρω πεδίο. Ειδικότερα, ερευνητική εμπειρία σε θέματα σχετικά με τη χρηματοοικονομική και τις οικονομετρικές εφαρμογές, καθώς και στις τεχνικές μηχανικής μάθησης για προβλέψεις σε χρηματοοικονομικές κρίσεις, θα εκτιμηθούν θετικά. Επίσης, δεξιότητες στη χρήση λογισμικών για την ανάλυση χρονοσειρών θα αποτελέσουν πρόσθετο προσόν.
- να υποβάλει αίτηση στη Γραμματεία του Τμήματος καθώς και βιογραφικό υπόμνημα, που θα περιλαμβάνει βιογραφικά στοιχεία, σπουδές, αποκτηθέντες τίτλους σπουδών, επιστημονικές και επαγγελματικές δραστηριότητες, ακαδημαϊκές διακρίσεις, δημοσιεύσεις σε έγκριτα επιστημονικά περιοδικά στην Ελλάδα ή το εξωτερικό, ή αποδεκτές προς δημοσίευση εργασίες, συμμετοχή σε συλλογικούς τόμους, βιβλία, συμμετοχές με ανακοίνωση σε συνέδρια, κλπ. Με την αίτηση και το βιογραφικό υπόμνημα, ο υποψήφιος υποβάλλει επίσης παραστατικά πανεπιστημιακών τίτλων, βεβαιώσεων και πιστοποιήσεων. Επίσης, οφείλει να καταθέσει έκθεση στην οποία θα τεκμηριώνει επιστημονικά το ενδιαφέρον του για τη συγκεκριμένη ερευνητική περιοχή για την οποία υποβάλλει αίτηση και

παράλληλα να καταθέσει σχέδιο εργασίας για το ερευνητικό θέμα που έχει προταθεί από το μέλος ΔΕΠ.

ΥΠΟΧΡΕΩΣΕΙΣ ΥΠΟΨΗΦΙΟΥ

1. Οι μεταδιδάκτορες ερευνητές οφείλουν να συντάσσουν έκθεση προόδου της έρευνας τους σε συνεργασία με το Επιβλέπον μέλος. Η έκθεση κατατίθεται στη Συνέλευση του Τμήματος προς ενημέρωση για την πρόοδο της Μ.Ε. και τα επόμενα στάδια αυτής, εντός των χρονικών ορίων που ορίζει το άρθρο 8 του παρόντος.
2. Οι μεταδιδάκτορες ερευνητές είναι υποχρεωμένοι να αναφέρουν το Τμήμα υπό την “ακαδημαϊκή στέγη” του οποίου εκπονούν την Μ.Ε. τους σε κάθε δημοσίευση τους, καθώς και το ερευνητικό εργαστήριο του Τμήματος στο οποίο τυχόν έχουν ενταχθεί.
3. Οι μεταδιδάκτορες ερευνητές οφείλουν να συμμετέχουν σε σεμινάρια ή συνέδρια που διοργανώνει το Τμήμα για την παρουσίαση της προόδου της έρευνας τους.
4. Η Συνέλευση του Τμήματος δύναται να αναθέσει επικουρικά εκπαιδευτικό έργο στον/στην ερευνητή, στο πλαίσιο των προπτυχιακών ή/και μεταπτυχιακών σπουδών του, εφόσον αυτό δεν αντίκειται με τις υποχρεώσεις της Μ.Ε.
5. Οι μεταδιδάκτορες ερευνητές οφείλουν, εφόσον τους ζητηθεί, να επικουρούν μέλη ΔΕΠ του Τμήματος στο εκπαιδευτικό και εργαστηριακό έργο, χωρίς αυτό να σημαίνει ανάληψη διδακτικού έργου.
6. Οι μεταδιδάκτορες ερευνητές οφείλουν να ανταποκρίνονται στις προτάσεις βελτίωσης που πραγματοποιούνται από την Ομάδα Εσωτερικής Αξιολόγησης του Τμήματος, στο πλαίσιο της διαδικασίας εσωτερικής αξιολόγησης του.
7. Οι μεταδιδάκτορες ερευνητές οφείλουν να τηρούν τον “Κώδικα Δεοντολογίας και Καλής Πρακτικής”, του Ε.Κ.Π.Α. καθώς και τις διατάξεις του Οργανισμού και του Εσωτερικού Κανονισμού Λειτουργίας του Ιδρύματος και να συμπεριφέρονται όπως αρμόζει σε Μέλη της Ακαδημαϊκής Κοινότητας.

ΥΠΟΒΛΗΘΕΝΤΑ ΔΙΚΑΙΟΛΟΓΗΤΙΚΑ

- Να υποβάλει σχετική αίτηση μέσω της ηλεκτρονικής διεύθυνσης: <https://eprotocol.uoa.gr/> του Πανεπιστημίου σύμφωνα με το ακόλουθο υπόδειγμα όπου και αναγράφονται και τα δικαιολογητικά που απαιτούνται:



ΕΛΛΗΝΙΚΗ ΔΗΜΟΚΡΑΤΙΑ

Εθνικόν και Καποδιστριακόν
Πανεπιστήμιον Αθηνών

ΙΔΡΥΘΕΝ ΤΟ 1837

ΑΙΤΗΣΗ

ΕΚΠΟΝΗΣΗΣ ΜΕΤΑΔΙΔΑΚΤΟΡΙΚΗΣ ΕΡΕΥΝΑΣ

ΠΡΟΣ:	το Τμήμα								
Ο – Η Όνομα:				Επώνυμο:					
Όνομα και Επώνυμο Πατέρα:									
Όνομα και Επώνυμο Μητέρας:									
Ημερομηνία γέννησης ⁽²⁾ :									
Τόπος Γέννησης:									
Αριθμός Δελτίου Ταυτότητας:									
Τόπος Κατοικίας:			Οδός:			Αριθ:		ΤΚ:	
Δ/νση Ηλεκτρ. Ταχυδρομείου (Email):									

1. ΤΙΤΛΟΙ ΣΠΟΥΔΩΝ

ΠΡΟΠΤΥΧΙΑΚΕΣ ΣΠΟΥΔΕΣ

ΠΑΝΕΠΙΣΤΗΜΙΟ ή ΤΕΙ	ΤΜΗΜΑ	ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΑΠΟΚΤΗΣΗΣ ΠΤΥΧΙΟΥ	ΒΑΘΜΟΣ ΠΤΥΧΙΟΥ

ΜΕΤΑΠΤΥΧΙΑΚΕΣ ΣΠΟΥΔΕΣ

ΠΑΝΕΠΙΣΤΗΜΙΟ ή ΤΕΙ	ΤΜΗΜΑ	ΗΜΕΡΟΜΗΝΙΑ ΑΠΟΚΤΗΣΗΣ ΠΤΥΧΙΟΥ	ΒΑΘΜΟΣ ΠΤΥΧΙΟΥ

2. ΔΙΑΚΡΙΣΕΙΣ/ΥΠΟΤΡΟΦΙΕΣ

3. ΔΙΠΛΩΜΑΤΙΚΕΣ, ΠΤΥΧΙΑΚΕΣ, ΜΕΤΑΠΤΥΧΙΑΚΕΣ ΕΡΓΑΣΙΕΣ και ΔΙΔΑΚΤΟΡΙΚΗ ΔΙΑΤΡΙΒΗ

ΕΙΔΟΣ ΕΡΓΑΣΙΑΣ	ΤΙΤΛΟΣ	ΕΠΙΒΛΕΠΩΝ	ΒΑΘΜΟΣ

4. ΆΛΛΕΣ ΕΠΙΣΤΗΜΟΝΙΚΕΣ ΔΗΜΟΣΙΕΥΣΕΙΣ

--

5. ΕΡΕΥΝΗΤΙΚΗ/ΕΠΑΓΓΕΛΜΑΤΙΚΗ ΔΡΑΣΤΗΡΙΟΤΗΤΑ

--

6. ΞΕΝΕΣ ΓΛΩΣΣΕΣ

ΓΛΩΣΣΑ	ΔΙΠΛΩΜΑ ή ΕΠΙΠΕΔΟ ΓΝΩΣΗΣ

Συνημμένα δικαιολογητικά:

- Αντίγραφο πτυχίου ή διπλώματος ΑΕΙ του εσωτερικού ή ισότιμου τίτλου σπουδών του εξωτερικού
- Αντίγραφο Μεταπτυχιακού Διπλώματος Ειδίκευσης ΑΕΙ του εσωτερικού ή ισότιμου τίτλου σπουδών του εξωτερικού

- Αντίγραφο Διδακτορικού Διπλώματος από ΑΕΙ του εσωτερικού ή ισότιμου τίτλου σπουδών του εξωτερικού
- Αναλυτικό βιογραφικό σημείωμα
- Συστατικές επιστολές
- Κατάλογος επιστημονικών εργασιών που έχουν εκπονηθεί
- Πρόταση εκπόνησης Μεταδιδακτορικής Έρευνας σύμφωνα με το υπόδειγμα που έχει καθιερώσει το Τμήμα ως ακολούθως
- Επιστολή αποδοχής επίβλεψης από μέλος του Τμήματος (σε περίπτωση που ο επιβλέπων προτείνεται από τον υποψήφιο)

Αθήνα, .../.../...

Ο/Η Αιτών/ ουσια



ΕΛΛΗΝΙΚΗ ΔΗΜΟΚΡΑΤΙΑ

Εθνικόν και Καποδιστριακόν
Πανεπιστήμιον Αθηνών

ΙΔΡΥΘΕΝ ΤΟ 1837

Υπόδειγμα Πρότασης Εκπόνησης Μεταδιδακτορικής Έρευνας

ΣΧΟΛΗ:		ΤΜΗΜΑ:	
		Αθήνα	
Πρόταση Εκπόνησης Μεταδιδακτορικής Έρευνας			
Όνοματεπώνυμο:			
Τίτλος Μ.Ε.:			
Προτεινόμενος Επιβλέπων:			
Περίληψη:			
Λέξεις – Κλειδιά:			
Εισαγωγή:			
Ανασκόπηση Ερευνητικής Περιοχής:			

--

Αντικείμενο Έρευνας και Στόχοι

--

Μεθοδολογία Έρευνας

--

Χρονοδιάγραμμα:

--

Ενδεικτική Βιβλιογραφία:

Αθήνα, .../.../...

Όνοματεπώνυμο υποψήφιου μεταδιδάκτορα ερευνητή

(Υπογραφή)

Βεβαιώνω ότι έχω λάβει γνώση και εγκρίνω την ανωτέρω πρόταση Μεταδιδακτορικής Έρευνας.

Όνοματεπώνυμο/ιδιότητα

Προτεινόμενου Επιβλέποντα

(Υπογραφή)

Οι ενδιαφερόμενοι μπορούν να υποβάλλουν τις αιτήσεις τους από 25/04/2024 έως 12/05/2024

Αθήνα, 24/04/2024

Ο Πρόεδρος



Καθηγητής Στυλιανός Κώτσιος