

Δεύτερο Φυλλάδιο Ασκήσεων στο μάθημα  
"Χρηματοοικονομική Μοντελοποίηση"

1. Να περιγράψετε αναλυτικά τον ορισμό και τη χρήση του Hosmer test για την απόρριψη -αποδοχή ενός μοντέλου δίτιμης λογιστικής παλινδρόμησης.
2. Να αναφέρετε ποιες είναι οι μεταβλητές βάσει των οποίων αξιολογεί τα κρατικά ομόλογα ένας από τους τρεις βασικούς οίκους πιστοληπτικής αξιολόγησης -π.χ. Moody's, S& P, Fitch.
3. Λαμβάνοντας ένα δείγμα από 100 τιμές κλεισίματος μίας μετοχής (100 διαδοχικές ημέρες συναλλαγών) και την τιμή κλεισίματος του EURIBOR στις ίδιες ημέρες, να δείξετε
  - α) ποιος είναι ο πίνακας σχεδιασμού για την Ανάλυση Κυρίων Συνιστωσών,
  - β) ποιος είναι ο πίνακας διακυμάνσεων -συνδιακυμάνσεων  $\Sigma$ ,
  - γ) να γίνει ανάλυση ιδιοτιμών του παραπάνω πίνακα,
  - δ) να προσδιοριστεί η συνεισφορά κάθε κύριας συνιστώσας στην πληροφορία που αντλούμε από τον πίνακα  $\Sigma$ .
  - ε) Να προσδιοριστούν τα διανύσματα όλων των κυρίων συνιστωσών.