



**ΕΝΤΥΠΟ ΥΠΟΒΟΛΗΣ ΠΡΟΤΑΣΗΣ**  
**ΘΕΜΑΤΟΣ ΔΙΠΛΩΜΑΤΙΚΗΣ ΕΡΓΑΣΙΑΣ**

(για ένταξη στην Τράπεζα Θεμάτων Διπλωματικών Εργασιών του Π.Μ.Σ.)

**1. ΣΤΟΙΧΕΙΑ ΠΡΟΤΑΣΗΣ**

| Πεδίο   | Στοιχεία                         |
|---|----------------------------------|
| <b>Κωδικός Θέματος</b><br>(συμπληρώνεται από τη Γραμματεία μετά την έγκριση του θέματος από τη Συντονιστική Επιτροπή) |                                  |
| <b>Ημερομηνία Υποβολής</b>  | 25/6/2026                        |
| <b>Προτείνων</b>  | Proteas Fund / Αχιλλέας Ζαπράνης |
| <b>Φορέας Προέλευσης Θέματος</b><br>(FAC, FTSAI, RES, IND, STU, EXT) <sup>1</sup>                                     | IND                              |
| <b>Κύρια Θεματική Περιοχή</b><br>(FINTECH, , RISK, AI-DATA,, DLT, REG, GOV, PROG, IND)                                | AI-DATA                          |
| <b>Δευτερεύουσα Θεματική Περιοχή</b><br>(προαιρετικά)   | RISK                             |
| <b>Τριτεύουσα Θεματική Περιοχή</b><br>(προαιρετικά)   | FINTECH                          |

<sup>1</sup> **FAC:** Μέλος Δ.Ε.Π. ή Διδάσκων του Π.Μ.Σ., **FTSAI:** Financial Technology and Strategic Artificial Intelligence Laboratory, **RES:** Άλλη ερευνητική δομή ή ερευνητικό έργο, **IND:** Επιχείρηση ή οργανισμός, **STU:** Πρόταση φοιτητή, **EXT:** Εξωτερικός συνεργάτης ή φορέας.

## 2. ΤΙΤΛΟΣ ΘΕΜΑΤΟΣ

Τίτλος στα Ελληνικά

**Αναγνώριση Καθεστώτων Αγοράς και Επιπτώσεις στη Διαχείριση Χαρτοφυλακίων**

Title in English

**Market Regime Detection and Its Implications for Portfolio Management**

## 3. ΚΑΤΗΓΟΡΙΑ ΔΙΠΛΩΜΑΤΙΚΗΣ ΕΡΓΑΣΙΑΣ

- Ερευνητική Διπλωματική Εργασία
- Εφαρμοσμένη Διπλωματική Εργασία
- Τεχνολογική Διπλωματική Εργασία
- Διπλωματική σε Συνεργασία με Οργανισμό ή Επιχείρηση
- Διπλωματική Ενταγμένη σε Ερευνητική Δράση

Εφόσον επιλεγεί η τελευταία κατηγορία – Ονομα Ερευνητικής Δράσης

## 4. ΜΕΘΟΔΟΛΟΓΙΚΗ ΠΡΟΣΕΓΓΙΣΗ

- Βιβλιογραφική ή Θεωρητική Μελέτη
- Συστηματική Βιβλιογραφική Ανασκόπηση
- Εμπειρική ή Ποσοτική Ανάλυση
- Μελέτη Περίπτωσης
- Συγκριτική Ανάλυση
- Ανάπτυξη ή Αξιολόγηση Τεχνολογικού Συστήματος
- Σχεδιασμός Πλαισίου, Μεθοδολογίας ή Μοντέλου
- Μικτή Προσέγγιση

## 5. ΣΥΝΤΟΜΗ ΠΕΡΙΓΡΑΦΗ ΤΟΥ ΘΕΜΑΤΟΣ

(ενδεικτική έκταση: 100 έως 250 λέξεις)

Οι χρηματοοικονομικές αγορές μεταβάλλονται διαρκώς. Περίοδοι ισχυρής ανόδου, αυξημένης μεταβλητότητας, κρίσεων ή ανάκαμψης δημιουργούν διαφορετικά καθεστώτα αγοράς (market regimes), στα οποία μια επενδυτική στρατηγική μπορεί να αποδίδει πολύ διαφορετικά.

Το θέμα προτείνεται σε συνεργασία με επενδυτικό οργανισμό και έχει ως στόχο την ανάπτυξη ενός συστήματος τεχνητής νοημοσύνης που θα αναγνωρίζει αυτόματα το τρέχον καθεστώς της αγοράς αξιοποιώντας ιστορικά δεδομένα και χρηματοοικονομικούς δείκτες. Στο πλαίσιο της εργασίας θα διερευνηθεί ποιες πληροφορίες είναι πραγματικά απαραίτητες για την αξιόπιστη αναγνώριση των συνθηκών της αγοράς και κατά πόσο η γνώση του καθεστώτος μπορεί να χρησιμοποιηθεί για τη βελτίωση της διαχείρισης χαρτοφυλακίων και της διαχείρισης κινδύνου.

Ενδεικτικά, η εργασία μπορεί να εξετάσει δεδομένα όπως αποδόσεις χρηματιστηριακών δεικτών, μεταβλητότητα, όγκους συναλλαγών και άλλους δείκτες αγοράς, αναπτύσσοντας μοντέλα μηχανικής μάθησης που ταξινομούν αυτόματα το περιβάλλον της αγοράς και αξιολογώντας την αποτελεσματικότητά τους σε πραγματικά ιστορικά δεδομένα.

Η εργασία συνδυάζει χρηματοοικονομική ανάλυση, τεχνητή νοημοσύνη και διαχείριση κινδύνου και εισάγει τον φοιτητή σε τεχνικές που χρησιμοποιούνται από σύγχρονους επενδυτικούς οργανισμούς για την υποστήριξη των επενδυτικών αποφάσεων.

## 6. ΣΤΟΧΟΙ ΚΑΙ ΕΡΕΥΝΗΤΙΚΑ ΕΡΩΤΗΜΑΤΑ

- Κατανόηση της έννοιας των καθεστώτων αγοράς.
- Διερεύνηση τεχνικών αναγνώρισης διαφορετικών συνθηκών αγοράς.
- Αξιολόγηση της επίδρασης των market regimes στην απόδοση χαρτοφυλακίων.
- Ανάλυση της χρησιμότητας τέτοιων προσεγγίσεων στη διαχείριση επενδύσεων.

## 7. ΠΡΟΤΕΙΝΟΜΕΝΗ ΜΕΘΟΔΟΛΟΓΙΑ

1. Πώς μπορούν να προσδιοριστούν διαφορετικά καθεστώτα αγοράς;
2. Ποιες μεταβλητές συμβάλλουν περισσότερο στην αναγνώρισή τους;
3. Ποιες τεχνικές ανάλυσης δεδομένων και μηχανικής μάθησης είναι καταλληλότερες;
4. Πώς επηρεάζονται οι αποδόσεις και ο κίνδυνος χαρτοφυλακίων από διαφορετικά καθεστώτα αγοράς;
5. Μπορεί η έγκαιρη αναγνώριση αλλαγών καθεστώτος να βελτιώσει τη διαδικασία λήψης επενδυτικών αποφάσεων;

## 8. ΔΕΔΟΜΕΝΑ ΚΑΙ ΠΗΓΕΣ ΔΕΔΟΜΕΝΩΝ

- Δεδομένα χρηματιστηριακών αγορών.
- Δείκτες μεταβλητότητας και κινδύνου.
- Μακροοικονομικές μεταβλητές.
- Δεδομένα ή δείγματα δεδομένων που ενδέχεται να διατεθούν από συνεργαζόμενο επενδυτικό οργανισμό.

## 9. ΠΡΟΑΠΑΙΤΟΥΜΕΝΕΣ ΓΝΩΣΕΙΣ Ή ΔΕΞΙΟΤΗΤΕΣ

- Βασικές γνώσεις επενδύσεων.
- Βασικές γνώσεις στατιστικής ανάλυσης.
- Βασικές γνώσεις ανάλυσης δεδομένων.
- Εξοικείωση με εργαλεία ανάλυσης δεδομένων αποτελεί πρόσθετο προσόν.

## 10. ΑΝΑΜΕΝΟΜΕΝΑ ΠΑΡΑΔΟΤΕΑ

- Πλήρης διπλωματική εργασία.
- Τεκμηριωμένη ανάλυση καθεστώτων αγοράς.
- Συγκριτική αξιολόγηση διαφορετικών προσεγγίσεων.
- Συμπεράσματα και προτάσεις για εφαρμογή στη διαχείριση χαρτοφυλακίων.

## 11. ΕΚΤΙΜΗΣΗ ΔΥΣΚΟΛΙΑΣ

Κλίμακα 1 (χαμηλή) έως 5 (υψηλή)

| Κατηγορία                   | 1                        | 2                                   | 3                                   | 4                        | 5                        |
|-----------------------------|--------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| Θεωρητική Δυσκολία          | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/>            | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| Προγραμματιστική Δυσκολία   | <input type="checkbox"/> | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/>            | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| Δυσκολία Συλλογής Δεδομένων | <input type="checkbox"/> | <input checked="" type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/>            | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |

## 12. ΣΥΝΟΛΙΚΗ ΔΥΣΚΟΛΙΑ

- Χαμηλή
- Μέτρια
- Υψηλή

*Σύντομη αιτιολόγηση*

Η εργασία συνδυάζει εμπειρική ανάλυση χρηματοοικονομικών δεδομένων με σύγχρονες τεχνικές ανάλυσης αγοράς. Παρότι απαιτεί επεξεργασία δεδομένων και βασικές ποσοτικές δεξιότητες, παραμένει προσιτή σε φοιτητές με υπόβαθρο στη χρηματοοικονομική τεχνολογία και τις επενδύσεις.