



طرح درس اقتصاد مالی ۱ – دکتری

به نام خدا

مدرس: بهنام امین رستمکلائی

تحصیلات مدرس:

- فرصت مطالعاتی در زمینه ریاضیات مالی و روش های عددی از دانشگاه ایالتی کارولینای شمالی در آمریکا.
- دکتری اقتصاد ریاضی، مالی و بین الملل از دانشگاه علامه طباطبائی.
- دانشجوی دکتری کامپیوتر-محاسبات نرم و هوش مصنوعی در دانشگاه تهران.

زمان کلاس:

- یکشنبه ها ساعت ۱۰:۴۵ الی ۱۲.

اطلاعات تماس:

• ایمیل: behnam.amin@ut.ac.ir & b.aminro1@gmail.com

- تلفن: ۰۹۱۲۰۵۰۲۳۹۱

مقدمه:

هدف دوره فهمیدن نظریات تصمیم سازی مالی، ابزار های مالی و مدیریت سرمایه گذاری و ریسک می باشد. اقتصاد مالی در واقع تخصیص منابع طی زمان همراه با اطمینان ناقص یا عدم اطمینان نسبت به آینده می باشد. در این دوره علاوه بر این که نظریات و موضوعات به کار رفته در مالی مورد بحث قرار می گیرد، کاربرد آنها در پایتون، متلب، اکسل و اکسس مورد بررسی قرار می گیرد. در این دوره انتظار بر این است که دانشجویان با مباحث مقدماتی مالی آشنایی نسبی پیدا کنند.

موضوعات دوره:

- اقتصاد مالی و سیستم مالی
- مفاهیم کمی و آمار پایه در مالی
- تخصیص منابع و زمان
- مدل های ارزش گذاری
- نظریه سبد یا پرتفوی
- نظریه بازار کارا



طرح درس اقتصاد مالی ۱ – دکتری

به نام خدا

- مدل ها و نظریات سرمایه گذاری (CAPM و)
- مالی در پایتون، متلب، اکسل و اکسس

ارزیابی دوره:

- ۱ نمره حضور کامل در کلاس
- ۷ نمره فعالیت کلاسی
- ۱۲ نمره پایان ترم

منابع:

- اصلی:

- I. Cuthbertson (2004) Quantitative financial economics: stocks, bonds and foreign exchange /. Wiley.
- II. Elton, E. J., Martin, J., Gruber, M. J., Brown, S. J., & Goetzmann, W. N. (2014). Modern Portfolio Theory and Investment Analysis (9th ed.). John Wiley & Sons.
- III. Bodie, Zvi. and Robert C. Merton (2009), *Financial Economics*, Pearson Education.
- IV. Dahlquist, J. et.al. (2022), *Principales of Finance*, OpenStax, Rice University.
- V. Fabozzi, Frank J. and Pamela Peterson, Drake (2009), *Finance*, Wiley & Sons.
- VI. Bodie, Z., Kane, A. and Marcus, A. (2014) Investments. Global Edition, 10th Edition, McGraw Hill Higher Education, New York.
- VII. فرانک جی. فابوزی، ادوین اچ. نیو، گوفو زو (۱۴۰۱). "اقتصاد مالی". مترجمان: رضا طالبلو، بهاره عربانی. انتشارات سمت.

- فرعی:

- I. Lewinson, Eryk (2020), *Python for Finance Cookbook*. Packt Publishing.
- II. Hilpisch, Yves (2015), *Python for Finance*, Oreilly Publishing.
- III. Jorion Philippe (2011), *Financial Risk Manager Handbook*. GARP, Wiley.
- IV. بادی. کین و مارکوس (۱۳۹۳). "مدیریت سرمایه گذاری". مترجمان: سید مجید شریعت پناه، روح الله فرهادی و محمد ایمنی فر. انتشارات بورس.