

طرح درس: اقتصاد مالی ۲ دوره دکترا

اهداف

- ۱- مروری بر مکاتب فکری و تئوری‌های نوین مالی در حوزه بازارهای مالی
- ۲- آشنایی با تئوری‌های ارزشگذاری و سرمایه‌گذاری در بازارهای مالی خطرپذیر سنتی
- ۳- آشنایی با تئوری‌های ارزشگذاری و سرمایه‌گذاری در بازارهای مالی خطرپذیر نوین

فهرست موضوعی جلسات درس

مروری بر تئوری‌های نوین مالی در بازارهای مالی خطرپذیر	جلسه ۱
	جلسه ۲
بررسی تئوری‌های مبتنی بر مدیریت ریسک در بازارهای مالی	جلسه ۳
	جلسه ۴
بررسی تئوری‌های مبتنی بر مدیریت سبد اوراق بهادار	جلسه ۵
	جلسه ۶
بررسی تئوری‌های مبتنی بر بازار مشتقات دارایی‌های مالی	جلسه ۷
	جلسه ۸
کاربرد مدل‌های آماری در بهینه‌سازی سبد سهام (با استفاده از نرم‌افزار پایتون)	جلسه ۹
	جلسه ۱۰
کاربرد مدل‌های اقتصادسنجی در بهینه‌سازی سبد سهام (با استفاده از نرم‌افزار پایتون)	جلسه ۱۱
	جلسه ۱۲
کاربرد مدل‌های هوش مصنوعی در بهینه‌سازی سبد سهام (با استفاده از نرم‌افزار پایتون)	جلسه ۱۳
	جلسه ۱۴
مروری بر تئوری‌های مالی در بازارهای ارز (فارکس) و رمزارزها	جلسه ۱۵
	جلسه ۱۶

ارزشیابی

- ۱- شرکت در مباحث جلسات
- ۲- تکالیف ارائه شده در طول نیم‌سال تحصیلی
- ۳- ترجمه مقاله مرتبط به موضوع درس

تخصیص نمره

- ۱- شرکت در مباحث جلسات = ۳
- ۲- ارائه تکالیف ارائه شده در طول نیم‌سال تحصیلی = ۲
- ۳- ترجمه مقاله مرتبط به موضوع درس = ۵
- ۴- آزمون = ۱۰

منابع:

- 1- Hull, J. (2012). *Risk management and financial institutions*,+ Web Site (Vol. 733). John Wiley & Sons.
- 2- Brownlee, J. (2018). *Deep learning for time series forecasting: predict the future with MLPs, CNNs and LSTMs in Python*. Machine Learning Mastery.
- 3- Li, B., & Hoi, S. C. H. (2018). *Online portfolio selection: principles and algorithms*. Crc Press.