به نام ایزد دانا

(کاربرگ طرح درس) تاریخ به­روز رسانی:

دانشکده علوم انسانی نیمسال دوم سال تحصیلی-97-98

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| مقطع: کارشناسی□ کارشناسی ارشد\* دکتری□ | تعداد واحد: نظری 3 عملی... | مدیریت سرمایه گذاری | نام درس |
| پیش­نیازها و هم­نیازها: | Investment management |
| شماره تلفن اتاق: | مدرس/مدرسین: غلامحسین گل ارضی  |
| منزلگاه اینترنتی: | g\_golarzi@semnan.ac.ir پست الکترونیکی: |
| برنامه تدریس در هفته و شماره کلاس:  |
| اهداف درس:آموزش مفاهیم سرمایه گذاری در اوراق بهادار و چگونگی ارزیابی آن  |
| امکانات آموزشی مورد نیاز:  |
| امتحان پایان­ترم | امتحان میان­ترم | ارزشیابی مستمر(کوئیز) | فعالیت­های کلاسی و آموزشی | نحوه ارزشیابی |
| 14 | 4 |  | 2 | درصد نمره |
| نظریه جدید سبد دارایی و تحلیل سرمایه گذاری نوشته التون ، گروبر، براون و گوتزمان ترجمه دکتر علی سوری  | منابع و مآخذ درس |

بودجه­بندی درس

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| توضیحات | مبحث | شماره هفته آموزشی |
|  | مقدمه شامل تعریف سرمایه گذاری ، نظریه اقتصادی انتخاب در شرایط اطمینان  | 1 |
|  | نظریه مصرف - سرمایه گذاری در شرایط اطمینان و عدم اطمینان با مفروضات مختلف و چگونگی شناسایی الگوی بهینه مصرف – سرمایه گذاری  | 2 |
|  | بازده (انواع بازده و روشهای محاسبه آن ) | 3 |
|  | بازده (انواع بازده و روشهای محاسبه آن) – ادامه  | 4 |
|  | ریسک (سنجش ریسک از دیدگاههای مختلف )  | 5 |
|  | نظریه سبد دارایی  | 6 |
|  | *انتخاب سبد بهینه دارایی* | 7 |
|  | *انتخاب سبد بهینه دارایی ( ادامه)*  | 8 |
|  | *مدلهای عاملی – مدل تک عاملی*  | 9 |
|  | *مدلهای عاملی – مدل تک عاملی ( ادامه) و مدل چند عاملی*  | 10 |
|  | *مدلهای عاملی – ادامه مدل چند عاملی(ادامه)*  | 11 |
|  | مدلهای تعادلی  | 12 |
|  | مدل قیمت گذاری دارائیهای سرمایه ای  | 13 |
|  | مدل قیمت گذاری دارائیهای سرمایه ای ( ادامه)  | 14 |
|  | تئوری قیمت گذاری آربیتراژ  | 15 |
|  | ارزیابی عملکرد پرتفولیو  | 16 |