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 |