



به نام ایزدوانا

(کاربرگ طرح درس)

تاریخ بهروز رسانی: ۱۳۹۷/۰۷/۱۰

نیمسال اول سال تحصیلی ۹۸-۱۳۹۷

دانشکده ریاضی، آمار و علوم کامپیوتر

فارسی: مهندسی مالی		تعداد واحد: نظری ۳ عملی -		مقطع: کارشناسی □ کارشناسی ارشد ✓ دکتری □	
نام درس		لاتین: Financial Engineering		پیش نیاز یا هم نیاز: -	
مدرس/مدرسین: کاظم نوری		شماره تلفن اتاق: ۰۲۳-۳۱۵۳۵۷۶۹			
پست الکترونیکی: knouri@semnan.ac.ir		منزلگاه اینترنتی: http://knouri.profile.semnan.ac.ir			
برنامه تدریس در هفته و شماره کلاس: یک شنبه ۱۹-۱۷ دوشنبه ۱۱-۱۲					
اهداف درس: آشنایی دانشجویان با انواع مشتقات و اختیارات معامله، قیمت گذاری ها، استراتژی های معاملاتی و پوشش ریسک					
امکانات آموزشی مورد نیاز: ---					
نحوه ارزشیابی		فعالیت های کلاسی و آموزشی		ارزشیابی مستمر (کوئیز)	
درصد نمره		۵		۵	
مباحث		امتحان میان ترم		امتحان پایان ترم	
منابع و مأخذ درس		۷۰		۲۰	
J. C. Hull, Options, Futures, and Other Derivatives, 9th ed. Pearson, 2014.					

بودجه بندی درس

شماره هفته آموزشی	مبحث	توضیحات
۱	مفاهیم و مقدمات اولیه (قراردادهای آتی، بازارهای آتی، پیمان های آتی، قراردادهای اختیار معامله، انواع معامله گران)	
۲	ساز و کار بازار قراردادهای آتی و پیمان های آتی	
۳	تعیین قیمت قراردادهای آتی و پیمان های آتی	
۴	راهبردهای پوشش ریسک با استفاده از قراردادهای آتی	
۵	بازارهای نرخ بهره	
۶	قراردادهای معاوضه ای	
۷	ساز و کار بازارهای اختیار معامله	
۸	ویژگی های اختیار معاملات سهام	
۹	راهبردهای معاملاتی با استفاده از قراردادهای اختیار معامله	
۱۰	ارزش گذاری بی تفاوت نسبت به ریسک و مدل درخت دو جمله ای	
۱۱	ارزش گذاری اختیار معامله، مدل بلک-شولز-مرتون	
۱۲	اختیار معاملات شاخص سهام و ارزها	
۱۳	اختیار معامله قراردادهای آتی	
۱۴	پارامترهای ریسک اختیار معامله و حروف یونانی	
۱۵	ارزش در معرض ریسک	
۱۶	اختیارات نامتعارف	