

تحلیل مالی با استفاده از نرم افزار MATLAB

معرفی دوره:

با گسترش روزافزون ابزارهای مالی و پیچیده‌تر شدن عوامل تاثیرگذار بر بازارهای مالی، نیاز به نوشتن مدل‌های تحلیل‌گری است که بتواند تا حد امکان اطلاعات مناسبی به سرمایه‌گذاران جهت سرمایه‌گذاری و مدیریت ریسک سرمایه‌شان ارائه کند. یکی از قویترین و منعطف‌ترین نرم‌افزارهای موجود در این ارتباط، نرم‌افزار MATLAB است. کارشناسان حوزه‌های مختلف مالی با استفاده از این جعبه ابزار مالی می‌توانند سبد سرمایه‌گذاری را با در نظر گرفتن سود و زیان و هزینه‌های معاملاتی بهینه‌سازی کنند. این جعبه ابزار آن‌ها را قادر می‌سازد تا ریسک را برآورد نموده و سطح نرخ بهره را تحلیل نموده و کارایی سرمایه‌گذاری را اندازه‌گیری کنند.

اهداف دوره:

- آشنایی با جعبه ابزار مالی نرم‌افزار MATLAB
- بررسی کلی برخی از قابلیت‌های مالی آن

محتوای دوره:

آشنایی با نرم افزار MATLAB و معرفی جعبه ابزار مالی آن

- ماتریس‌ها، متغیرها، اعداد و عملگرها
- اعمال جبری روی ماتریس‌ها
- رسم انواع نمودارها
- برنامه‌نویسی و معرفی برخی از توابع مالی

تجزیه و تحلیل سبد سرمایه‌گذاری

- توابع بهینه‌سازی سبد سرمایه‌گذاری
- ابزارهای بهینه‌سازی سبد سرمایه‌گذاری با روش مارکوویتز
- ابزارهای بهینه‌سازی سبد سرمایه‌گذاری با استفاده از CVaR

روش‌های اندازه‌گیری ارزیابی عملکرد سرمایه‌گذاری

- اندازه‌گیری عملکرد با نسبت شارپ
- اندازه‌گیری عملکرد با استفاده از نسبت اطلاعات

خطای ردیابی

تحلیل رگرسیون و سری‌های زمانی مالی

- رگرسیون خطی چند متغیره
- تشکیل سری‌های زمانی مالی و نمایش آن‌ها

مخاطبان دوره:

مدیران و کارشناسان مالی بانک

پیشنیاز دوره: فاقد پیشنیاز

مدت دوره: ۲۴ ساعت

تاریخ برگزاری:

۴، ۵ و ۷ شهریور ۱۳۹۶ (از ساعت ۸/۳۰ الی ۱۶/۳۰)

هزینه دوره:

۵.۲۰۰.۰۰۰ ریال

هزینه برگزاری شامل محتوای آموزشی، پذیرایی میان وعده، ناهار و صدور گواهینامه می باشد



مدیریت آموزش های حرفه ای

آدرس: تهران، خیابان پاسداران، بالاتر از ایستگاه ضرابخانه، پلاک ۱۹۵

شماره های تماس: ۲۷۸۹۱ داخلی: ۲۴۵۸-۲۴۵۷-۲۴۹۸-۲۴۹۷

www.ibi.ac.ir

Telegram.me/ibi_ac_ir