



وزارت علوم، تحقیقات و فناوری
دانشگاه صنعتی بیرجند

دانشکده صنایع و کامپیوتر گروه مهندسی صنایع

نام درس: اصول مهندسی مالی			
نوع واحد: نظری		تعداد واحد: ۳	مقطع: کارشناسی
کد درس: ۱۲۱۱۳		پیش‌نیاز:	هم‌نیاز: -
نام مدرس: سید محمد رضا کاظمی		ایمیل: kazemi@birjandut.ac.ir	
مراجع و منابع			
نام کتاب		نویسنده / مترجم	
مبانی مهندسی مالی و مدیریت ریسک		نویسنده: جان هال مترجمان: دکتر سجاد سیاح، دکتر علی صالح‌آبادی	
ناشر/توضیحات		انتشارات بورس	
رئوس مطالب			
ردیف	عنوان	تعداد جلسه	توضیحات
۱	مفاهیم و مقدمات	۲	
۲	سازوکار بازار قراردادهای آتی	۲	
۳	بازارهای نرخ بهره	۲	
۴	سازوکار بازارهای اختیار معامله	۲	
۵	ویژگیهای اختیار معاملات سهام	۲	
۶	مقدمه ای بر مدل درخت دوجمله ای	۳	
۷	ارزشگذاری اختیار معامله، مدل بلک-شولز	۳	
۸	پارامترهای ریسک اختیار معامله	۳	
۹	ارزش در معرض ریسک	۳	
۱۰	ارزشگذاری با استفاده از درخت دوجمله ای	۲	
ارزیابی			
ملاکهای ارزیابی		نمره از بیست	نوع فعالیت
پایانترم		۸	
میانترم		۶	
پروژه		۵	
حضور در کلاس		۱	

نام استاد درس: سید محمد رضا کاظمی
امضاء

نام مدیر گروه:
امضاء