

فهرست

۷	فصل اول مقدمه
۷	۱.۱ موضوع و ساختار
۱۲	۲.۱ نرم افزار کامپیوتری
۱۳	۳.۱ داده ها
۱۴	۴.۱ منابع
۱۵	فصل دوم متغیرهای تصادفی و فرایندهای تصادفی
۱۵	۱.۲ مقدمه
۱۶	۲.۲ متغیرهای تصادفی و فرایندهای تصادفی
۱۶	۱.۲.۲ متغیرهای تصادفی
۲۶	۲.۲.۲ فرایندهای تصادفی
۳۰	۳.۲ مدل های سری زمانی
۳۰	۱.۳.۲ مدل های خودرگرسیون (AR) و میانگین متحرک (MA)
۳۴	۲.۳.۲ مدل های خودرگرسیون میانگین متحرک
۳۶	۳.۳.۲ سری های زمانی نامانا
۳۸	۴.۳.۲ مدل های خودرگرسیون میانگین متحرک انباشته
۳۹	۵.۳.۲ برآورد پارامتر و استنتاج
۴۶	۶.۳.۲ روش باکس - جنکینز
۵۱	۷.۳.۴ مدل های خودرگرسیون برداری
۵۳	۸.۳.۲ پیش بینی با مدل های سری زمانی
۵۷	۹.۳.۲ ارزیابی پیش بینی ها
۶۲	۱۰.۳.۲ مدل های سری زمانی غیرخطی

۶۵	۴.۲ خلاصه
۶۵	۵.۲ سؤال‌ها
۶۷	۶.۲ منابع
۷۰	فصل سوم رگرسیون و نوسان‌پذیری
۷۰	۱.۳ مقدمه
۷۱	۲.۳ مدل‌های رگرسیون
۷۱	۱.۲.۳ رگرسیون خطی
۸۰	۲.۲.۳ رگرسیون کاذب
۸۱	۳.۲.۳ آزمون‌های ریشه واحد
۸۴	۴.۲.۳ هم‌انباشتگی
۹۱	۵.۲.۳ پیش‌بینی با مدل‌های رگرسیون
۹۳	۳.۲ مدل‌سازی و پیش‌بینی نوسان‌پذیری شرطی
۹۳	۱.۳.۲ نوسان‌پذیری شرطی تک‌متغیره
۱۰۲	۲.۳.۲ ماتریس‌های کواریانس شرطی
۱۰۵	۴.۳ خلاصه
۱۰۶	۵.۳ سؤال‌ها
۱۰۸	۶.۳ منابع
۱۱۱	فصل چهارم تئوری پرتفوی و تخصیص دارایی
۱۱۱	۱.۴ مقدمه
۱۱۳	۲.۴ بازده
۱۲۱	۳.۴ مدل تنزیل سود تقسیمی
۱۲۳	۴.۴ تئوری نوین پرتفوی

فهرست □ ت

۱۲۳	۱.۴.۴ تئوری اصلی
۱۳۲	۲.۴.۴ تعمیم تئوری
۱۳۴	۳.۴.۴ نقاط قوت و ضعف
۱۳۶	۵.۴ مثال‌های تجربی
۱۴۵	۶.۴ خلاصه
۱۴۶	۵.۳ سؤال‌ها
۱۴۷	۸.۴ پیوست
۱۴۷	۱.۸.۴ داده‌ها
۱۴۸	۲.۸.۴ برنامه‌ها و جعبه‌ابزارهای متلب
۱۴۹	۹.۴ منابع
۱۵۱	فصل پنجم مدل‌های قیمت‌گذاری دارایی و مدل‌های عاملی
۱۵۱	۱.۵ مقدمه
۱۵۳	۲.۵ CAPM
۱۵۳	۱.۲.۵ نتایج اصلی
۱۵۶	۲.۲.۵ کاربردهای CAPM
۱۵۸	۳.۲.۵ آزمون تجربی CAPM
۱۶۰	۴.۲.۵ نقاط قوت و ضعف
۱۶۳	۳.۵ مدل‌های عاملی
۱۶۳	۱.۳.۵ مدل تک‌شاخص و مدل APT
۱۶۵	۲.۳.۵ مدل‌های عاملی اقتصاد کلان
۱۶۷	۳.۳.۵ مدل‌های فاما و فرنچ
۱۶۹	۴.۳.۵ برآورد ماتریس کواریانس

۱۷۲ ۵.۳.۵ نقاط قوت و ضعف
۱۷۳ ۴.۵ مثال‌های تجربی
۱۸۰ ۵.۵ خلاصه
۱۸۱ ۶.۵ سؤال‌ها
۱۸۲ ۷.۵ پیوست
۱۸۲ ۱.۷.۵ داده‌ها
۱۸۴ ۲.۷.۵ برنامه‌ها و جعبه‌ابزارهای متلب
۱۸۴ ۸.۵ منابع
۱۸۷ فصل ششم کارایی بازار
۱۸۷ ۱.۶ مقدمه
۱۹۰ ۲.۶ آزمون‌های کارایی بازار
۱۹۰ ۱.۲.۶ فرضیه بازار کارا
۱۹۲ ۲.۲.۶ آزمون‌های گشت تصادفی
۱۹۵ ۳.۲.۶ آزمون‌های دیگر
۱۹۹ ۳.۶ پیش‌بینی اقتصادسنجی
۲۰۳ ۴.۶ تحلیل تکنیکال
۲۰۳ ۱.۴.۶ مرور کلی
۲۰۸ ۲.۴.۶ آزمون سودمندی قواعد معاملاتی تکنیکال
۲۱۱ ۴.۶ واریانس داده‌ها
۲۱۳ ۶.۶ مثال‌های تجربی
۲۲۷ ۷.۶ خلاصه
۲۲۷ ۸.۶ سؤال‌ها

فهرست □ ج

۲۲۹ پیوست ۹.۶
۲۲۹ داده‌ها ۱.۹.۶
۲۳۰ برنامه‌ها و جعبه‌ابزارهای متلب ۲.۹.۶
۲۳۲ منابع ۱۰.۶
۲۳۵ فصل هفتم مدل‌سازی و پیش‌بینی نرخ ارز
۲۳۵ ۱.۷ مقدمه
۲۳۷ ۲.۷ نرخ ارز
۲۴۰ ۳.۷ کارایی بازار و شرایط برابری نرخ ارز
۲۴۰ ۱.۳.۷ برابری نرخ بهره بدون پوشش
۲۴۱ ۲.۳.۷ برابری نرخ بهره با پوشش
۲۴۲ ۳.۳.۷ ناریبی نرخ آتی
۲۴۲ ۴.۷ آزمون‌های کارایی بازار
۲۴۲ ۱.۴.۷ آزمون‌های گشت تصادفی
۲۴۴ ۲.۴.۷ آزمون‌های مدل رگرسیون
۲۴۸ ۵.۷ برابری قدرت خرید
۲۴۸ ۱.۵.۷ قانون قیمت واحد و فرضیه برابری قدرت خرید
۲۴۹ ۲.۵.۷ آزمون فرضیه برابری قدرت خرید: آزمون‌های خطی
۲۵۴ ۳.۵.۷ آزمون فرضیه برابری قدرت خرید: آزمون‌های غیرخطی
۲۶۴ ۶.۷ پیش‌بینی نرخ ارز
۲۶۴ ۱.۶.۷ مدل‌های اقتصادسنجی
۲۶۹ ۲.۶.۷ تحلیل تکنیکال
۲۷۲ ۷.۷ مثال‌های تجربی

۲۸۱	۸.۷ خلاصه
۲۸۱	۹.۷ سؤال‌ها
۲۸۳	۱۰.۷ پیوست
۲۸۳	۱.۱۰.۷ داده‌ها
۲۸۶	۲.۹.۶ برنامه‌ها و جعبه‌ابزارهای متلب
۲۸۷	۱۱.۷ منابع
۲۹۲	فصل هشتم مدل‌سازی و پیش‌بینی نرخ بهره
۲۹۲	۱.۸ مقدمه
۲۹۳	۲.۸ اوراق قرضه
۲۹۳	۱.۲.۸ بازده و قیمت
۲۹۸	۲.۲.۸ ساختار زمانی نرخ بهره
۳۰۲	۳.۲.۸ دیرش و تحذب
۳۰۷	۳.۸ مدل‌های نرخ بهره
۳۰۷	۱.۳.۸ مدل واسیچک
۳۱۶	۲.۳.۸ مدل CIR
۳۱۸	۳.۳.۸ مدل CKLS
۳۲۲	۴.۳.۸ پیش‌بینی نرخ بهره
۳۲۳	۴.۸ آزمون تجربی فرضیه انتظارات
۳۲۳	۱.۴.۸ مقدمه
۳۲۳	۲.۴.۸ آزمون فرضیه انتظارات
۳۲۸	۳.۴.۸ نتایج و تناقض فرضیه انتظارات
۳۳۱	۵.۸ مثال‌های تجربی

فهرست □ خ

۳۳۹	۶.۸ خلاصه
۳۳۹	۷.۸ سؤال‌ها
۳۴۰	۸.۸ پیوست
۳۴۰	۱.۸.۸ داده‌ها
۳۴۲	۲.۸.۸ برنامه‌ها و جعبه‌ابزارهای متلب
۳۴۳	۹.۸ منابع
۳۴۵	فصل نهم مدیریت ریسک بازار
۳۴۵	۱.۹ مقدمه
۳۴۷	۲.۹ VaR با استفاده از رویکرد دلتا - نرمال
۳۴۷	۱.۲.۹ VaR برای یک دارایی
۳۵۰	۲.۲.۹ VaR برای پرتفوی
۳۵۲	۳.۲.۹ RiskMetrics و رویکرد دلتا - نرمال
۳۵۵	۳.۹ VaR با استفاده از شبیه‌سازی تاریخی
۳۵۷	۴.۹ VaR با استفاده از شبیه‌سازی مونت کارلو
۳۵۹	۵.۹ VaR برای اوراق قرضه
۳۶۲	۶.۹ VaR برای اوراق مشتقه
۳۶۲	۱.۶.۹ VaR با استفاده از دلتا - گاما
۳۷۰	۲.۶.۹ VaR با استفاده از شبیه‌سازی مونت کارلو
۳۷۲	۷.۹ پس‌آزمایی
۳۷۷	۸.۹ مقررات مالی و VaR
۳۸۶	۹.۹ مثال‌های تجربی
۴۰۱	۱۰.۹ خلاصه

د مالی تجربی

۴۰۲ ۱۱.۹ سؤال‌ها

۴۰۳ ۱۲.۹ پیوست

۴۰۳ ۱.۱۲.۹ داده‌ها

۴۰۴ ۲.۱۲.۹ برنامه‌ها و جعبه‌ابزارهای متلب

۴۰۵ ۱۳.۹ منابع

۴۰۷ پیوست جداول آماری

۴۲۰ واژه‌نامه