

دانشکده اقتصاد دانشگاه تهران
برگزار می‌کند:



موسسه توسعه و تحقیقات اقتصادی



دانشکده اقتصاد

Financial Modeling

مدلسازی مالی

۳۲ ساعت آموزش



با اعطای مدرک رسمی
از دانشگاه تهران



فهرست



۴	مقدمه
۴	شرح دوره
۶	مدرس دوره
۶	مخاطبین دوره
۷	سرفصل‌ها و زمان‌بندی
۱۵	راه‌های ارتباطی



مقدمه



در دنیای پیچیده و پر از تغییرات امروز، تصمیمات مالی به دقت و استراتژی‌های مبتنی بر تحلیل‌های عمیق نیاز دارند. با توجه به حجم گسترده معاملات اقتصادی و ریسک‌های متعدد موجود در بازار، داشتن ابزارهای مناسب برای پیش‌بینی و تحلیل وضعیت‌های مختلف بازار ضروری است. اینجاست که مدل‌های مالی به کمک می‌آیند تا به‌عنوان راهنمایی برای تصمیمات هوشمندانه در شرایط عدم اطمینان عمل کنند.

در دوره آموزشی «مدلسازی مالی با اکسل»، تلاش بر این است که شرکت‌کنندگان با طراحی مدل‌های مالی دقیق و انعطاف‌پذیر آشنا شوند. در این دوره، نحوه استفاده از نرم‌افزار اکسل برای ساخت مدل‌های مالی، وارد کردن متغیرهای کلیدی مانند ریسک و حساسیت بازار، و تحلیل سناریوهای مختلف به روشی کاربردی و عملی آموزش داده خواهد شد.



شرح دوره



دوره مدل‌سازی مالی با اکسل به شما این امکان را می‌دهد تا مهارت‌های تحلیلی خود را با استفاده از این ابزار قدرتمند ارتقا دهید. در ابتدا، با مباحث پایه‌ای اکسل، از جمله توابع آماری و جستجو آشنا خواهید شد که ابزارهای اساسی برای تحلیل داده‌ها را در اختیارتان قرار می‌دهد. سپس، با تحلیل توابع مالی در اکسل آشنا می‌شوید و می‌توانید مسائل مالی پیچیده را با دقت بررسی کنید.

در ادامه، با تحلیل حساسیت اقتصادی پروژه‌ها آشنا خواهید شد و قادر خواهید بود اثر تغییرات متغیرها را بر مدل‌های اقتصادی شبیه‌سازی کنید. مباحثی چون بودجه‌بندی سرمایه و برنامه‌ریزی مالی نیز در این دوره مطرح می‌شود که شما را در مدیریت مالی و تصمیم‌گیری‌های استراتژیک سرمایه‌گذاری یاری خواهد کرد.

دوره شامل تحلیل مدل قیمت‌گذاری دارایی‌های
نیز است که به شما کمک می‌کند (CAPM) سرمایه‌ای
تا ریسک و بازدهی سرمایه‌گذاری‌ها را به طور دقیق
ارزیابی کنید. در نهایت، شبیه‌سازی و بهینه‌سازی
سبد سرمایه‌گذاری، به شما این امکان را می‌دهد تا
ترکیب مناسبی از دارایی‌ها را برای کسب بالاترین
بازدهی در شرایط مختلف اقتصادی انتخاب کرده و
سبد سرمایه‌گذاری خود را به طور حرفه‌ای مدیریت
کنید



مدرس دوره



کورش صادقی



■ Data Scientist at Maximus Canada

مشاور سابق مدیرعامل شرکت سرمایه‌گذاری توسعه ملی
طراح نرم‌افزار PRAPEX (ارزیابی اقتصادی و مالی پروژه‌ها با استفاده از اکسل)
طراح نرم‌افزار گزارش‌گیری معاملات آتی سکه با استفاده از اکسل

مخاطبین دوره



تحلیل‌گران مالی

مدیران

حسابداران

مشاوران

سرمایه‌گذاران



سرفصل‌ها و زمان‌بندی



هفته اول

مباحث کلی اکسل، توابع آماری و جستجو

- معرفی توابع آماری و تحلیل داده‌ها
- استفاده از توابع شرطی برای تجزیه و تحلیل داده‌های مالی
- آشنایی با ابزارهای جستجو و بازیابی داده‌ها

هفته دوم

تحلیل توابع مالی در اکسل

- بررسی توابع مالی کلیدی
- تحلیل تسهیلات بانکی و قسط بندی
- بررسی روش‌های مستهلک کردن دارایی‌ها
- تحلیل نرخ بهره و بازده موثر

هفته سوم

تحلیل حساسیت اقتصادی پروژه



- معرفی توابع اقتصادی و تحلیل سناریوها
- ارزیابی حساسیت پارامترهای اقتصادی
- استفاده از ابزارهای اکسل برای تحلیل ریسک و بهینه سازی

هفته چهارم

بودجه بندی سرمایه و برنامه ریزی مالی



- بودجه بندی سرمایه ای و برنامه ریزی مالی
- معرفی مدل (CAPM) و کاربردهای آن

هفته پنجم

تحلیل مدل قیمت گذاری دارایی های سرمایه ای (CAPM)



- معرفی مدل رگرسیونی و محاسبه ریسک سیستماتیک
- محاسبه میانگین موزون هزینه سرمایه
- ترسیم و تحلیل خط بازار سرمایه

هفته ششم

شبیه سازی و بهینه سازی سبد سرمایه گذاری

Solver

شبیه سازی مونت کارلو برای تحلیل سود
بهینه سازی سبد سرمایه گذاری با ابزار

هفته هفتم

تحلیل و بهینه سازی سبد سرمایه گذاری

معرفی آرایه ها و تئوری مارکوویتز
مدلسازی و یافتن وزن های بهینه در سبد
سرمایه گذاری
تحلیل سبد بهینه تحت شرایط مختلف ریسک
و بازده



@CBSut_info



021-88004278



Contact@utcbs.ir



www.utcbs.ir