

۲.۴۹۴۲۴

مدل‌های ریاضی در تحلیل پرتفوی

MATHEMATICAL MODELS IN PORTFOLIO ANALYSIS

ویسنده:

فاریدا کاشاپووا

Farida Kachapova

مترجمان:

دکتر پرویز سعیدی

دانشیار مدیریت مالی دانشگاه آزاد اسلامی واحد علی‌آباد

میشم کاویانی

دکترای مدیریت مالی دانشگاه آزاد اسلامی

سرشناسه	کاجاپووا، فاریدا Kachapova, Farida
عنوان و نام پدیدآور	مدلهای ریاضی در تحلیل پرتفوی/ نویسنده فاریدا کاجاپووا؛ مترجمان پرویز سعیدی، میثم کاویانی.
مشخصات نشر	تهران: مؤسسه انتشارات برآیند پویش، ۱۳۹۸.
مشخصات ظاهری	۱۳۶ ص.: مصور.
شابک	۳۰۰۰۰ ریال-0-978-622-95690-3:
وضعیت فهرست نویسی	فیبا
یادداشت	عنوان اصلی: Mathematical models in portfolio analysis.
موضوع	مدیریت سبد سرمایه‌گذاری -- الگوهای ریاضی
موضوع	Portfolio management -- Mathematical models
موضوع	سرمایه‌گذاری -- تجزیه و تحلیل -- الگوهای ریاضی
موضوع	Investment analysis -- Mathematical models
شناسه افزوده	سعیدی، پرویز، ۱۳۲۲ -، مترجم
شناسه افزوده	کاویانی، میثم، ۱۳۶۳ -، مترجم
رده بندی کنگره	HG۴۵۲۹/۵
رده بندی دیویی	۳۳۲
شماره کتابشناسی ملی	۵۰۱۶۸

مؤسسه‌ی انتشارات برآیند پویش

نام کتاب : مدل‌های ریاضی در تحلیل پرتفوی
 مؤلف : فاریدا کاجاپووا
 مترجمان: دکتر پرویز سعیدی- میثم کاویانی
 ناشر : انتشارات برآیند پویش
 طراحی جلد: مؤسسه انتشارات برآیند پویش
 نوبت چاپ : دوم زمستان ۱۳۹۸
 شمارگان : ۱۰۰۰ جلد
 قیمت : ۳۰۰۰۰ تومان
 شابک : ۹۷۸-۶۲۲-۹۵۶۹۰-۳-۰۰

برآیند پویش: میدان انقلاب، خ منیری جاوید، بن بست توحید، پلاک ۲
 تلفن: ۶۶۴۸۵۴۱۴-۶۶۹۶۸۴۶۳

هر گونه تقلید و استفاده از این اثر به هر شکل بدون اجازه‌ی کتبی از ناشر ممنوع می‌باشد

فهرست مطالب

صفحه

عنوان

بخش اول: مقدمه‌ای از ریاضی

فصل اول - ماتریس‌ها و کاربردهای آن

۱	واژگان
۳	عملیات ماتریس
۴	ضرب عدد در ماتریس
۴	ترانپوذه
۵	جمع ماتریس
۵	ضرب ماتریس‌ها
۶	ماتریس معکوس
۷	دترمینان
۹	دستگاه معادلات خطی
۱۲	هذلولی
۱۲	هذلولی استاندارد
۱۳	هذلولی انتقال یافته عمود
۱۵	فصل دوم - تصویر متعامد (قائم)
۱۷	تصویر متعامد بر یک زیرفضا
۱۸	تصویر متعامد بر روی یک بردار
۱۹	خاصیت مینیمال تصویر متعامد
۲۰	فصل سوم - متغیرهای تصادفی
۲۲	ویژگی‌های عددی یک متغیر تصادفی
۲۸	کوواریانس و ضریب همبستگی
۳۰	ماتریس کوواریانس
۳۳	فصل چهارم - رگرسیون
۳۵	فضای آفلیدسی متغیرهای تصادفی
۴۱	رگرسیون
۴۲	رگرسیون با یک مقدار ثابت
۴۳	رگرسیون خطی ساده

بخش دوم: تجزیه و تحلیل پرتفوی

فصل پنجم - مدل سازی پرتفوی

۴۵	واژگان
۴۷	فروش استقراری
۵۰	حداقل سازی (کمینه کردن) ریسک
۵۱	پارامترهای آماری یک پرتفوی با n دارایی
۵۴	آنولوپ دارایی‌های مالی
۵۵	

۶۳	فصل ششم - تجزیه و تحلیل میانگین - واریانس
۶۵	اصل تفکیک دو صندوق
۶۸	پرتفوی کارا
۶۸	رابطه میانگین - واریانس
۷۷	رابطه میانگین - واریانس پرتفوی با دو دارایی
۸۷	فصل هفتم - تئوری بازار سرمایه
۸۹	دارایی بدون ریسک
۹۱	پرتفوی مماس
۹۶	پرتفوی بازار: خط بازار سرمایه
۹۷	یافتن پرتفوی بازار و معادله CML
۱۱۰	رگرسیون د مالی: ضریب بتا
۱۱۵	مدل قیمت: رری دارایی سرمایه‌ای و خط بازار اوراق بهادار

پیشگفتار مترجمان

امروزه توسعه و پیشرفت بسیاری از مدل‌ها و تئوری‌های اقتصادی و مالی مربوط به کاربرد مدل‌های و بهی ریاضیات و آمار در این رشته‌ها بوده است. از اینرو تاکنون کتب زیادی در سطح جهان در راستای توسعه رشته‌های فوق و خصوصاً مهندسی مالی با رویکرد مفاهیم ریاضی به نگارش درآمده است. همچنین با توجه به اینکه در سال‌های اخیر در کشورمان کتب متعددی در حوزه مهندسی مالی توسط اعضای هیأت علمی دانشگاه‌ها و خبرگان امر ترجمه گردیده است، علی‌رغم تعدد آنها، مطالب ارائه شده در مجموعه حاضر که برگرفته از ترجمه کتابی با عنوان *Mathematical Models in Portfolio Analysis* که به قلم فاریدا کاچاپووا است می‌تواند به معرفی و توسعه مکتب دیگری از کاربرد ریاضیات در مدیریت سرمایه‌گذاری و علی‌الخصوص تجزیه و تحلیل پرتفوی بپردازد. توجه به موارد فوق مترجمان از ترجمه این کتاب انتظار دارند که تأثیر مثبتی در تولید دانش جدید در حوزه مهندسی مالی و ارتقاء دانش موثر سایر علوم از جمله ریاضی و آمار بر اندیشه و فعالیت‌های دانشجویان دانشجوین رشته‌های مالی، حسابداری، اقتصاد، بازرگانی و بانکداری بگذارد.

نهایتاً اینکه چون این کتاب ترجمه است، لذا بدیهی است مطالب ترجمه شده خالی از نقص نباشد. نقد علمی را انتظار می‌کشیم، منت بر ما نهاده، تا نقایص در چاپ بعدی کتاب رفع گردد. بر این اساس رهنمودها و انتقادات علمی را از طریق ایمیل‌های زیر بخواهیم بپذیریم.

با سپاس فراوان

پرویز سعیدی، میثم کاویانی

Meysamkaviani@gmail.com - dr.parvizsaedi@yahoo.com