

عنوان درس به فارسی: سمینار اقتصاد مالی

عنوان درس به انگلیسی: Seminar in Financial Economics

تعداد واحد: ۲

تعداد ساعت: ۳۲

نوع درس: اصلی

نوع واحد: ۲ واحد نظری

پیشنیاز: ندارد

آموزش تکمیلی عملی: دارد ندارد سفر علمی کارگاه آزمایشگاه سمینار

اهداف کلی درس: مطالعه مقالات مالی

اهداف رفتاری:

- توانمندسازی دانشجویان برای مطالعه مقالات علمی بروز در حوزه مالی؛
- توانمند ساختن دانشجویان برای نوشتن مقالات علمی در حوزه مالی؛
- قدرتمند ساختن دانشجویان برای تحلیل و نتیجه گیری علمی از مقالات و سمینارهای مالی؛
- قدرتمند ساختن دانشجویان برای تحلیل بازارهای مالی بر اساس اصول علمی.

سرفصل درس: مقالات علمی مشخص شده با نظر استاد مربوطه

روش ارزیابی:

ارزشیابی مستمر	میان ترم	آزمون های نهایی	پروژه
(بصورت درصد مشخص گردد)	(بصورت درصد مشخص گردد)	(بصورت درصد مشخص گردد)	(بصورت درصد مشخص گردد)
۶۵٪		آزمون های نوشتاری: ۳۵٪	
		عملکردی	



Text book

- Frank J. Fabozzi and Sergio M. Focardi (2013), *Mathematical Methods for Finance: Tools for Asset and Risk Management*, September.
- John C. Hull (2011), *Options, Futures, and Other Derivatives* (8th Edition).
- Salih N. Neftci (2004), *Principles of Financial Engineering* (Academic Press Advanced Finance).
- Salih N. Neftci (2000), *An Introduction to the Mathematics of Financial Derivatives*, Second Edition (Academic Press Advanced Finance).
- Hossein Askari, Zamir Iqbal, Noureddine Krichenne and Abbas Mirakhor (2010), *The Stability of Islamic Finance: Creating a Resilient Financial Environment for a Secure Future* (Wiley Finance).
- Hossein Askari, Zamir Iqbal and Abbas Mirakhor (2008), *New Issues in Islamic Finance and Economics: Progress and Challenges* (Wiley Finance).
- Bruce Tuckman and Angel Serrat (2011), *Fixed Income Securities: Tools for Today's Markets* (Wiley Finance).

Articles

-
- Turan Bali, Andrew Ang, Nusret Cakici, and Beyong-Je An, *The Joint Cross Section of Stocks and Options*, *Journal of Finance*, forthcoming.
 - Turan Bali, Linda Allen and Yi Tang (2012), *Does Systemic Risk in the Financial Sector Predict Future Economic Downturns?*, *Review of Financial Studies*, 25(10), 3000-3036.
 - Turan Bali (2008), *The Intertemporal Relation between Expected Returns and Risk*, *Journal of Financial Economics*, 87(1), 101-131.
 - Markus Leippold, and Liuren Wu (2002), *Asset Pricing Under The Quadratic Class*, *Journal of Financial and Quantitative Analysis*, 37(2), 271-295.
 - Turan Bali and Armen Hovakimian (2009), *Volatility Spreads and Expected Stock Returns*, *Management Science*, 55(11), 1797-1812.
 - Turan Bali and Liuren Wu (2010), *The Role of Exchange Rates in Intertemporal Risk-Return Relations*, *Journal of International Money and Finance*, 29(8), 1670-1686.
 - Liuren Wu (2008), *Modeling Financial Security Returns Using Levy Processes*, *Handbooks in Operations Research and Management Science: Financial Engineering*, 15, Eds. John Birge and Vadim Linetsky, Elsevier.
 - Lin Peng, Tim Bollerslev and Wei Xiong (2007), *Investor Attention and Time-Varying Comovements*, *European Financial Management*, 13, 394-422.
 - Lin Peng, Lin Peng, Ailsa Roell, *Managerial Incentives and Stock Price Manipulation*, *Journal of Finance*, forthcoming.

