

# مدلسازی مالی و سرمایه گذاری در متلب

حسین فلاح طلب

(انتشارات چالش)

خواننده گرامی

سی دی حاضر ضمیمه کتاب مدلسازی مالی و سرمایه گذاری در متلب بوده و شامل موارد زیر است:

(۱) خروجی عکس ها و نمودارهای رسم شده در کتاب با دو پسوند **fig** و **bmp** در حقیقت از آنجاییکه کتاب بصورت سیاه و سفید انتشار یافته و خواننده ممکن است نیازمند مشاهده اشکال بصورت رنگی باشد، بنابراین تمامی اشکال خروجی مثال ها و مسائل طرح شده به تفکیک هر فصل در این سی دی موجود است.

(۲) حل مثال های جامع مطرح شده در کتاب بصورت فایل کد و با پسوند **m**: کتاب شامل مثال های جامعی است که پیاده سازی آنها در قالب کدنویسی های متوالی و بعضاً طولانی صورت گرفته و با پسوند **m** و به تفکیک هر فصل در سی دی همراه موجود می باشد.

(۳) هرگونه فایل داده جهت پیاده سازی عملی یا حل تمرینات (با پسوند **xls** و **csv**).



مدلسازی مالی و سرمایه گذاری در متلب

حسین فلاح طلب

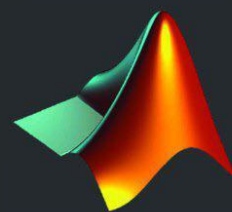
## مدلسازی مالی و سرمایه گذاری در متلب

(کاربرد متلب در علوم مالی)

حسین فلاح طلب

آشنایی با نرم افزار متلب  
تجزیه و تحلیل جریان نقدی  
ارزیابی اوراق با درآمد ثابت  
ارزیابی اختیار معامله سهام  
تجزیه و تحلیل سبد سرمایه گذاری  
ارزیابی ریسک (بازار و اعتباری)  
کار با سری های زمانی مالی  
تحلیل تکنیکال در متلب  
طراحی واسطه های گرافیکی و ...

همراه با لوح فشرده



Investment and Financial modeling in MATLAB

Hossein Falahtalab

متلب یک محیط نرم افزاری بمنظور انجام محاسبات عددی و یک زبان برنامه نویسی است که در بسیاری از رشته ها از جمله علوم مالی کاربرد دارد. متلب شامل جعبه ابزارهای متنوعی می باشد که هر کدام بمنظور خاصی توسعه یافته اند. جعبه ابزار مالی متلب امکان انجام تجزیه و تحلیل های مالی و سرمایه گذاری را فراهم می کند. به عنوان نمونه به کمک این جعبه ابزار می توانید ابزارهای مالی نظیر اوراق قرضه و اختیار معامله را ارزیابی کنید. سید پهنه دارایی ها را تشکیل دهید، ریسک بازار و ریسک اعتباری را تخمین بزنید یا سری های زمانی مالی را تجزیه و تحلیل نمایید. این کتاب با بیانی ساده و با فرض عدم آشنایی خواننده با زبان برنامه نویسی متلب، ضمن تشریح برخی تئوری های مالی، نحوه پیاده سازی آنها در محیط نرم افزاری متلب را تشریح می کند. همچنین سعی شده است که در هر یک از بخش های کتاب، مثال ها و مسائل متعددی جهت کمک به فهم بهتر مطالب مطرح شود.