

داوطلبان گرامی

معرفی منابع مورد نیاز جهت مطالعه در آزمون دکتری پس از ثبت نام در آزمون، به داوطلبان ارائه خواهد شد.

آزمون‌های آزمایشی دکتری مجموعه مالی کد ۲۱۷۱

عناوین درسی
۱) آمار و کاربرد آن در مدیریت
۲) مبانی سازمان و مدیریت
۳) اصول و مبانی مدیریت از دیدگاه اسلام
۴) ریسک و مدیریت سرمایه‌گذاری
۵) بازارها و نهادهای مالی
۶) استعداد تحصیلی
۷) زبان انگلیسی

تاریخ برگزاری آزمون‌های آنلاین:

شماره آزمون	آزمون اول (۵۰٪ اول)	آزمون دوم (۵۰٪ دوم)	آزمون سوم (۱۰۰٪ - جامع اول)	آزمون چهارم (۱۰۰٪ - جامع دوم)
تاریخ برگزاری	۱۴۰۴/۰۹/۲۱	۱۴۰۴/۱۰/۰۵	۱۴۰۴/۱۰/۱۹	۱۴۰۴/۱۱/۰۳

آزمون اول - ۵۰٪ اول

ردیف	عنوان درس	فهرست مباحث
۱	آمار و کاربرد آن در مدیریت	آمار توصیفی: کلیات آمار، پارامترهای مرکزی و پراکندگی داده‌های پیوسته و گسسته، مبنای احتمال: احتمال، احتمال شرطی، قضایای بیز و روابط احتمال متغیرهای تصادفی و توابع چگالی احتمال پیوسته و گسسته، امید ریاضی، میان، گشتاور متغیرهای تصادفی توام، کوواریانس، ضریب تعیین و عدم تعیین. متغیرهای تصادفی مستقل قضایای مارکوف، چی بی شف، توزیع‌های احتمال گسسته و پیوسته، تابع مولد گشتاور
۲	مبنای سازمان و مدیریت	بخش اول کتاب ماهان چاپ دوم به بعد
۳	اصول و مبنای مدیریت از دیدگاه اسلام	بخش اول کتاب ماهان چاپ هشتم
۴	ریسک و مدیریت سرمایه‌گذاری	تعاریف سرمایه‌گذاری، محیط و فرایند سرمایه‌گذاری، انواع سفارشات معاملات، انواع ودایع، فروش استقراضی و بازده آن، نظریات کارایی بازار و انواع کارایی، سطوح کارایی، شاخص‌های بورس و شاخص‌های بین‌المللی، نحوه محاسبه شاخص‌ها، ریسک و بازده و محاسبات آن، انواع میانگین‌ها، انواع ریسک، دیرش و تحذب، قوانین دیرش و تحذب، تئوری پرتفلیو، تئوری مدرن و فرا مدرن، مدل مارکوویتز، منحنی بی‌تفاوتی، ماتریس واریانس و کوواریانس، مرز کارا و بهینه‌سازی، پرتفوی حداقل واریانس، انتخاب پرتفوی، مدل‌های عاملی، مدل تک عاملی و چند عاملی، مدل بازار، ریسک و تنوع بخشی، نرخ بازده و ریسک در مدل‌های عاملی، مدل تعادلی، CAPM، تئوری تفکیک، خط بازار سرمایه و خط بازار اوراق بهادار، مفهوم آربیتراژ، مفروضات مدل آربیتراژ، اوراق زیر قیمت و بالای قیمت، ارزیابی عملکرد پرتفلیو، اندازه‌گیری بازده به روش میانگین موزون پول و زمانی، معیارهای ترینر، جنسن و ...، موقعین سنجی و گزینش، تجزیه و تحلیل بنیادی، مفاهیم و روش‌ها
۵	بازارها و نهادهای مالی	نظام مالی، دارایی مالی و انواع آن، بازارهای مالی و طبقه‌بندی بازارها، نقش و کارکرد بازارهای مالی، مقررات ناظر بر بازارهای مالی، اوراق بهادار قابل معامله، اوراق بهادار غیر قابل معامله، اوراق بهادار اسلامی، وراق رهنی، ابزارهای اسلامی شامل صکوک اجاره و استصناع، اوراق مشارکت، آشنایی با نهادهای مالی کشور، نرخ بهره، ارزش زمانی پول، ارزش فعلی پرداختها، ارزش آتی پرداختها، ارزش گذاری اوراق، نرخ کوپن، حداقل نرخ بازده مورد انتظار، ارزشیابی اوراق قرضه، بازار اوراق قرضه، تقسیم بندی اوراق قرضه، رتبه اعتباری اوراق قرضه، تغییرات نرخ بهره و دیرش، بازار پول، اوراق بهادار بازار پول، بازده اوراق بهادار بازار پول، بازار سرمایه و سهام، اوراق بهادار بازار سهام، سهام عادی، حقوق سهام عادی، سایر سهام، سهام ممتاز، حقوق سهام ممتاز، بازار اولیه و ثانویه

۶	استعداد تحصیلی	بخش حل مساله و مقایسه های کمی: مباحث هوش (رابطه اعداد، رابطه حروف، دنباله اعداد، شمارش مربع، مثلث و ...); عبارت های جبری؛ مسایل کار؛ سرعت_مسافت، تقسیم به سهم، تشکیل معادله، نسبت و درصد بخش استدلال منطقی: ادامه متن، نتیجه گیری، پیش فرض استدلال، توجیه تناقض، تضعیف استدلال، تقویت استدلال، ارزیابی استدلال
۷	زبان انگلیسی	کلیه مطالب

آزمون دوم - ۵۰٪ دوم

ردیف	عنوان درس	فهرست مباحث
۱	آمار و کاربرد آن در مدیریت	نمونه گیری، قضیه حد مرکزی، توزیع نمونه‌ای واریانس، توزیع نمونه‌ای نسبت نمونه، توزیع نمونه‌ای تفاضل نسبت دو نمونه برآوردهای نقطه‌ای و فاصله‌ای، فاصله اطمینان برای واریانس، نسبت و مجموع نسبت دو جامعه و ... آزمون فرض ها، خطاهای آماری، آزمون نکویی برازش، آزمون استقلال، خطاهای نوع اول و دوم و ... رگرسیون و همبستگی، خطای معیار برآورد، ضریب همبستگی اسپیرمن، سری‌های زمانی و ... تحلیل واریانس تک عامله و دو عامله و ...
۲	مبانی سازمان و مدیریت	بخش دوم کتاب ماهان چاپ دوم به بعد
۳	اصول و مبانی مدیریت از دیدگاه اسلام	بخش دوم کتاب ماهان چاپ هشتم
۴	ریسک و مدیریت سرمایه‌گذاری	تحلیل تکنیکی، مفروضات و اندیکاتورها، تحلیل کنسلیم، ارزش در معرض خطر و سنجه های ریسک، تئوری مطلوبیت و تئوری انتظارات، تئوری چشم انداز، مالی رفتاری و دام های رفتاری، ارزش گذاری اوراق بهادار بدون ریسک، نرخ بهره اسمی و واقعی، نرخ بازده تا سررسید، نرخ بهره نقدی و آتی، ساختار زمانی نرخ بهره، نظریات کلاسیک ساختار زمانی، نظریه رجحان نقدینگی، نظریه انتظارات محض، صرف نقدینگی، منحنی بازده پولی و بازدهی، نظریه رفتار ترجیحی، مبانی قرارداد آتی و پیمان آتی، تفاوت قرارداد آتی و پیمان آتی، نحوه تسویه یا تحویل در پیمان آتی، مشکلات قراردادی در بازار پیمان، مکانیزم بازار قرارداد آتی، همگرایی قیمت آتی با قیمت نقدی، ریسک پایه یا منا، تعیین ارزش قرارداد، اختیار معامله، انواع اختیار معامله اروپایی، امریکایی و برمودا، اختیار خرید، اختیار خرید بی قیمت و با قیمت و به قیمت، اختیار فروش، اختیار فروش بی قیمت و با قیمت و به قیمت، باردهی حاصل از خرید یا فروش اختیار معامله، استراتژی های اختیار معامله، استراتژی های ترکیبی، استراتژی های ترکیبی، تعادل اختیار خرید و فروش، مدل دو جمله ای قیمت گذاری اختیار، مدل دو جمله ای یک دوره ای، مدل بلک شولز، قرارداد های تاخت، تعاریف و مفاهیم، ساز و کار معاملات، انواع قرارداد تاخت، تفاوت تاخت ارز با تاخت بهره
۵	بازارها و نهادهای مالی	بازار اوراق مشتقه، بازارهای مشتقه، بازارهای آتی، بازار وام های رهنی، وام رهنی، انواع وام رهنی، فروش وام های رهنی، نهادهای مالی سپرده پذیر، تعاریف و طبقه بندی ها، دارایی و بدهی موسسات سپرده پذیر، خطر تامین مالی، بانک های تجاری، خدمات، سپرده ها، تامین مالی، نهادهای بازار اوراق بهادار، نهادهای مالی بازار سرمایه، بورس اوراق بهادار، وظایف و مقررات بورس، نهاد های سرمایه گذاری، صندوق ها و انواع آنها، شرکت های بیمه، صندوق های بازنشستگی، تقسیم بندی صندوق ها، صندوق های با مزایای مشخص، صندوق ها با سهم تعیین شده کارفرما

۶	استعداد تحصیلی	بخش حل مساله: مباحث هوش (رابطه اعداد، رابطه حروف، دنباله اعداد، شمارش مربع، مثلث و ...) ؛ عبارت های جبری؛ مسایل کار؛ سرعت_مسافت، تقسیم به سهم، تشکیل معادله، نسبت و درصد، هندسه، بخش پذیری، آنالیز ترکیبی بخش استدلال منطقی: ادامه متن، نتیجه گیری، پیش فرض استدلال، توجیه تناقض، تضعیف استدلال، تقویت استدلال، ارزیابی استدلال، استدلال مشابه، نقش عبارت، نقص استدلال، گزاره های منطقی بخش درک مطلب کل مباحث بخش تحلیلی کل مباحث
۷	زبان انگلیسی	کلیه مطالب

آزمون سوم- جامع اول

ردیف	عنوان درس	فهرست مباحث
۱	آمار و کاربرد آن در مدیریت	کلیه مطالب
۲	مبانی سازمان و مدیریت	کلیه مطالب
۳	اصول و مبانی مدیریت از دیدگاه اسلام	کلیه مطالب
۴	ریسک و مدیریت سرمایه‌گذاری	کلیه مطالب
۵	بازارها و نهادهای مالی	کلیه مطالب
۶	استعداد تحصیلی	کلیه مطالب
۷	زبان انگلیسی	کلیه مطالب

آزمون چهارم- جامع دوم

ردیف	عنوان درس	فهرست مباحث
۱	آمار و کاربرد آن در مدیریت	کلیه مطالب
۲	مبانی سازمان و مدیریت	کلیه مطالب
۳	اصول و مبانی مدیریت از دیدگاه اسلام	کلیه مطالب
۴	ریسک و مدیریت سرمایه‌گذاری	کلیه مطالب
۵	بازارها و نهادهای مالی	کلیه مطالب
۶	استعداد تحصیلی	کلیه مطالب
۷	زبان انگلیسی	کلیه مطالب

منابع مطالعاتی پیشنهادی:

ردیف	عنوان درس	فهرست مباحث
۱	آمار و کاربرد آن در مدیریت	آمار در اقتصاد و بازرگانی، محمد نوفرستی، نشر رسا آمار و کاربرد آن در مدیریت، عادل آذر، منصور مؤمنی و سعید جعفری آمار و احتمالات، عادل آذر آمار و کاربرد آن در مدیریت، هادی رنجبران آمار و کاربرد آن در مدیریت، وحید ناصحی فر تئوری احتمالات و آمار کاربردی (تحلیل آماری)، اکبر عالم تبریز، بابک حاجی محمدرضا تبریزی
۲	مبانی سازمان و مدیریت	مدیریت عمومی، مهدی الوانی، نشر نی مبانی سازمان و مدیریت، علی رضاییان، انتشارات سمت تئوری سازمان: ساختار و طرح سازمان، تالیف استیون رابینز، مهدی الوانی و حسن دانایی فرد، انتشارات اشراقی مبانی سازمان و مدیریت، محمد مقیمی، انتشارات نگاه دانش مبانی تئوری و طراحی سازمان، تالیف ریچاردال دفت، ترجمه علی پارساییان و محمد اعرابی، انتشارات دفتر پژوهش‌های فرهنگی
۳	اصول و مبانی مدیریت از دیدگاه اسلام	اصول و مبانی مدیریت از دیدگاه اسلام، سید محمد مقیمی، نشر راه دان مدیریت در اسلام، علی آقا پیروز، ابوطالب خدمتی، عباس شفیعی و سید محمود بهشتی‌نژاد، زیر نظر مهدی الوانی، انتشارات پژوهشگاه حوزه و دانشگاه مدیریت ما (مدیریت اسلامی در پرتو نهج‌البلاغه امام علی علیه السلام)، علی اصغر پورعزت، بنیاد نهج البلاغه مدیریت اسلامی، محمد حسن نبوی، انتشارات بوستان کتاب قم مدیریت اسلامی، سید علی اکبر افجه‌ای، انتشارات جهاد دانشگاهی دانشگاه علامه طباطبائی مدیریت از منظر کتاب و سنت، سید صمصام‌الدین قوامی، تهران، دبیرخانه مجلس خبرگان اصول و مبانی مدیریت از دیدگاه اسلام، نشر مهربان مدیریت اسلامی و الگوهای آن، لطف‌الله فروزنده دهکردی، علی اکبر جوکار، انتشارات دانشگاه پیام نور مدیریت اسلامی (رویکردها)، علی نقی امیری و حسن عابد جعفری، انتشارات سمت اصول مدیریت اسلامی و الگوهای آن، ولی‌الله نقی پورفر، انتشارات مرکز مطالعات و تحقیقات مدیریت اسلامی

۴	ریسک و مدیریت سرمایه‌گذاری	مدیریت سرمایه‌گذاری و ریسک، امیر صفوی، مهربان نشر ۱۰۰۰ پرسش، ۱۰ آزمون، سرمایه‌گذاری و ریسک، امیر صفوی و پژمان عباسی، مهربان نشر مبانی مهندسی مالی و مدیریت سرمایه‌گذاری، راعی و سعیدی، انتشارات سمت مبانی مهندسی مالی و مدیریت ریسک، جان ادوارد هال، ترجمه علی صالح‌آبادی و سجاد سیاح، انتشارات گروه رایانه تدبیر پرداز مدیریت سرمایه‌گذاری، تالیف جونز، ترجمه رضا تهرانی و عسگر نوربخش، انتشارات نگاه دانش مدیریت سرمایه‌گذاری، تالیف زوی بودی، الکس کین، الان جی. مارکوس، ترجمه مجید شریعت پناهی، روح‌الله فرهادی، محمد ایمنی‌فر، انتشارات شرکت اطلاع‌رسانی و خدمات بورس مدیریت سرمایه‌گذاری، تالیف ویلیام اف. شارپ، گوردون الکساندر، جفری وی. بیلی، ترجمه مجید شریعت پناهی، نشر اتحاد سرمایه‌گذاری پیشرفته، راعی و پویانفر، انتشارات سمت
۵	بازارها و نهادهای مالی	نهادهای مالی، تالیف ساندرز و کورنت، ترجمه رضا تهرانی و عسگر نوربخش، مؤسسه انتشارات دانشگاه تهران بازارها، نهادها و ابزارهای مالی ((رویکرد نوین)): مدیریت ریسک مبتنی بر ارزش آفرینی، فرشاد هیبتي، هاشم نیکومرام و فریدون رهنمای پشته بازارها و نهادهای مالی، تالیف فردریک میشکین و استانیلی ایکینز، ترجمه حمید کردبچه، انتشارات پژوهشکده پولی و بانکی مبانی بازارها و نهادهای مالی، تالیف فرانک فبوزی، فرانکو مودیلیانی، مایکل فری، ترجمه حسین عبده تبریزی، نشر پیشبرد

توجه:

۱- دروس عمومی شامل "استعداد تحصیلی و زبان انگلیسی" از مجموعه کتاب‌های عمومی انتشارات ماهان مطالعه شوند.

۲- سوالات درس‌های عمومی شامل "استعداد تحصیلی و زبان انگلیسی" در تمامی مراحل بصورت جامع خواهد بود.