



دانشگاه علامه طباطبائی

مدیریت آموزش های تخصصی آزاد و مهارت افزایی

سرفصل دروس MBA گرایش بازار سرمایه

ترم سوم

زبان تخصصی مالی

تعداد واحد و ساعات تدریس: ۱ واحد، ۱۶ ساعت آموزشی

تناسب با مفاد آزمون گواهینامه های حرفه ای: لغات تخصصی مالی و اقتصادی و درک مطلب

هدف: آشنایی دانش پذیران با لغات تخصصی مالی و اقتصادی است.

سرفصل اجمالی:

❖ درک مطلب گزارش های تحلیل و تخصصی و ترجمه آنها به فارسی

❖ ترجمه گزارش ها به انگلیسی

سرفصل تفصیلی:

۱-۱ لغات و اصطلاحات حوزه ابزارهای مختلف بازار سرمایه

۲-۱ لغات و اصطلاحات حوزه ساختار و عملکردی نهادهای بازار سرمایه

۳-۱ اصلاحات تخصصی حوزه بازار پول و بیمه مرتبط با فعالیت های بازار سرمایه

۴-۱ اصلاحات تخصصی حوزه معاملات و تحلیل های بنیادین ، تکنیکال، رفتاری و صورت های مالی

حسابداری ابزارها و نهادهای مالی

تعداد واحد و ساعات تدریس: ۲ واحد، ۳۲ ساعت آموزشی

تناسب با مفاد آزمون گواهینامه های حرفه ای: ---

هدف: آشنایی دانش پذیران با روش ها و فنون حسابداری ابزارها و رویدادهای غالب در نهادهای مالی فعال در بازار سرمایه است.

سرفصل اجمالی و تفصیلی:

- ❖ حسابداری اوراق قرضه
- ❖ حسابداری سهام عادی و سود تقسیمی، افزایش سرمایه
- ❖ حسابداری اوراق مشارکت و صکوک
- ❖ آشنایی با حسابداری ادغام ها به روش اتحاد منافع و خرید
- ❖ آشنایی با روش های ارزشگذاری سرمایه گذاری ها
- ❖ آشنایی با حسابداری در شرکت های سرمایه گذاری
- ❖ آشنایی با حسابداری در شرکت های تامین سرمایه
- ❖ آشنایی با حسابداری در بانک ها

مدیریت مالی بنگاه (۱)

تعداد واحد و ساعات تدریس: ۳ واحد، ۴۸ ساعت آموزشی

تناسب با مفاد آزمون گواهینامه های حرفه ای: مقدمات امور مالی شرکتی

هدف: آشنایی دانش پذیران با کاربرد نظریه های مرتبط با امور مالی شرکتی به منظور تصمیم گیری در جنبه های مختلف امور مالی و افزایش قدرت آنها در اتخاذ تصمیمات مالی بهینه می باشد.

سرفصل اجمالی:

- ❖ مقدمات بودجه بندی سرمایه ای
- ❖ مقدمات هزینه سرمایه
- ❖ مقدمات مدیریت تأمین مالی
- ❖ مقدمات تجزیه و تحلیل اهرم ها و نقطه سربه سر
- ❖ تعاریف مقدماتی مربوط به بازده
- ❖ تعاریف مقدماتی مربوط به ریسک

سرفصل تفصیلی:

۱-۱ مقدمات بودجه بندی سرمایه ای

۱. تعاریف، مفروضات و اهداف بودجه بندی سرمایه ای
۲. تحلیل فرآیند بودجه بندی سرمایه ای شامل شناخت مراحل فرآیند و تفاوت میان بخش های مختلف پروژه های سرمایه ای
۳. اصول زیربنایی بودجه بندی سرمایه ای شامل:
 - ✓ شناخت جریان های نقدی ورودی و خروجی و محاسبه آنها
 - ✓ شناخت جریان های نقدی متعارف و غیرمتعارف
 - ✓ انتخاب جریان های نقدی مناسب
 - ✓ تعیین نرخ تنزیل مناسب مورد استفاده در ارزیابی یک پروژه سرمایه ای و محاسبه نرخ بازدهی مورد انتظار آن
۴. آشنایی با سرفه جویی مالیاتی، سرمایه در گردش و محاسبه استهلاک در تخمین جریان های نقدی
۵. تشریح چگونگی تأثیر گذاری طرح های مستقل در برابر طرح های ناسازگار (مانعه الجمع) بر ارزیابی پروژه های سرمایه ای
۶. محاسبه، کاربرد و تفسیر نتایج هر یک از روش های زیر در ارزیابی یک پروژه سرمایه ای، بیان ویژگی ها و مزایای هر یک از آنها و مقایسه آنها:

- ✓ دوره برگشت سرمایه
- ✓ معکوس دوره برگشت سرمایه
- ✓ میانگین نرخ بازده حسابداری (ARR)
- ✓ ارزش فعلی خالص (NPV)
- ✓ نرخ بازده داخلی (IRR)
- ✓ شاخص سودآوری (PI)

۲-۱ مقدمات هزینه سرمایه

۱. محاسبه و تفسیر هزینه سهام عادی با استفاده از روش‌های مختلف
 ۲. محاسبه و تفسیر هزینه بدهی با نرخ ثابت با استفاده از رویکرد بازده تا سررسید و رویکرد رتبه‌بندی بدهی
 ۳. تعریف و محاسبه نرخ هزینه سهام ممتاز
 ۴. تعریف و محاسبه نرخ هزینه سرمایه سود انباشته
 ۵. محاسبه و تفسیر میانگین موزون هزینه سرمایه (WACC) یک شرکت
 ۶. چگونگی اثرگذاری مالیات‌ها و اعطای یارانه بر هزینه سرمایه منابع مختلف تأمین مالی
 ۷. روش‌های جایگزین برای محاسبه وزن‌ها در محاسبه میانگین موزون هزینه سرمایه، از جمله استفاده از ساختار سرمایه مطلوب شرکت
 ۸. چگونگی استفاده از هزینه نهایی سرمایه و ترکیب منابع مالی برای تعیین بودجه سرمایه بهینه
 ۹. نقش هزینه نهایی سرمایه در تعیین ارزش فعلی خالص یک پروژه
- ۳-۱ مقدمات مدیریت تأمین مالی

۱-۳-۱ مقدمات تأمین مالی بلندمدت

۱. ویژگی‌های تأمین مالی بلندمدت
 ۲. تأمین مالی از طریق حقوق صاحبان سهام
 ۳. تأمین مالی از طریق اوراق بهادار با درآمد ثابت
 ۴. تأمین مالی از طریق اجاره بلندمدت
- ۲-۳-۱ مقدمات تأمین مالی کوتاه مدت

۱. ویژگی‌های تأمین مالی کوتاه مدت
۲. مدیریت اعتبارات تجاری (عناصر موثر بر مدیریت اعتبارات تجاری و محاسبه هزینه عدم استفاده از تخفیف نقدی)
۳. مدیریت اوراق تجاری (آشنایی با انواع رتبه‌بندی اوراق تجاری و چگونگی استفاده از اوراق تجاری به‌عنوان یکی از ابزارهای تأمین مالی)
۴. آشنایی با عقود اسلامی بانکی و محاسن و معایب تأمین مالی از طریق آنها

۴-۱ مقدمات تجزیه تحلیل نقاط سربه سر و اهرم‌ها

۱. تعریف اهرم عملیاتی، اهرم مالی و اهرم مرکب یک شرکت و ویژگی‌های هر یک
 ۲. محاسبه و تفسیر درجه اهرم عملیاتی، درجه اهرم مالی و درجه اهرم مرکب
 ۳. نقاط سربه سر عملیاتی، مالی، نقدی و کل و محاسبه مقدار و مبلغ فروش در نقطه سربه سر و تعیین سود خالص شرکت در سطوح مختلف فروش
- ۵-۱ تعاریف مقدماتی مربوط به بازده

۱. اشکال مختلف بازده سرمایه‌گذاری و محاسبه و تمایز بین مفاهیم بازده به شرح زیر:
 - ✓ بازده دوره نگهداری (بازده کل)
 - ✓ بازده تحقق یافته
 - ✓ بازده پیش‌بینی شده
 - ✓ بازده مورد انتظار
 ۲. عوامل تأثیرگذار بر نرخ بازده مورد انتظار یک سرمایه‌گذار (نرخ بازده بدون ریسک، نرخ تورم مورد انتظار و صرف ریسک)
- ۶-۱ مفاهیم پایه ریسک
۱. تعاریف ریسک‌پذیری و ریسک‌گریزی و تحلیل منحنی‌های بی تفاوتی و مطلوبیت ثروت افراد ریسک‌پذیر و ریسک‌گریز
 ۲. تعریف انواع و منابع ریسک و عوامل مؤثر بر آنها
 ۳. انواع ریسک‌های مرتبط با سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار با درآمد ثابت
 ۴. تعریف انواع ریسک‌های اعتباری اوراق بهادار با درآمد ثابت شامل ریسک عدم پرداخت، ریسک شکاف اعتبار و ریسک تنزیل رتبه اعتباری و تمایز میان آنها و نقش آن در رتبه‌بندی اعتباری

ابزارهای تأمین مالی در بازار پول و بازار سرمایه

تعداد واحد و ساعات تدریس: ۲ واحد، ۳۲ ساعت آموزشی

تناسب با مفاد آزمون گواهینامه های حرفه ای: ---

هدف: آشنایی دانش پذیران با ابزارهای مختلف تأمین مالی در حوزه بازار پول و سرمایه کشور و تبیین ویژگی های مالی، مزایا و معایب هر کدام جهت ارائه یک بعد تحلیلی کلان نگر است.

سرفصل اجمالی و تفصیلی:

- ❖ معرفی اوراق خزانه و اوراق قرضه دولتی و شهرداری ها
- ❖ روش های تأمین مالی بین المللی
- ❖ مفاهیم، سازوکار و جریانات نقدی اوراق صکوک
- ❖ روش های تأمین مالی نهادهای سپرده پذیر
- ❖ روش های تأمین مالی نهادهای سرمایه گذار
- ❖ روش های تأمین مالی ساختار یافته
- ❖ آشنایی با ابزارهای نوین حوزه بازار پول

قوانین و مقررات بازار سرمایه (۲)

تعداد واحد و ساعات تدریس: ۲ واحد، ۳۲ ساعت آموزشی

تناسب با مفاد آزمون گواهینامه های حرفه ای: مقررات تحلیل گری بازار سرمایه / مقررات مدیریت سبد اوراق بهادار

هدف: آشنایی دانش پذیران با قوانین حرفه ای حوزه بازار سرمایه و مقررات مرتبط با مدیریت سبد اوراق بهادار در بازار سرمایه است.

سرفصل اجمالی:

- ❖ فصول منتخبی از قانون مالیات های مستقیم
- ❖ قانون مالیات بر ارزش افزوده
- ❖ قانون مبارزه با پولشویی و آیین نامه های اجرایی
- ❖ قواعد عمومی قراردادها و شرایط حاکم بر عقود معین در قانون مدنی ج.ا.ا.
- ❖ دستورالعمل های تأسیس و فعالیت موسسات پردازش اطلاعات مالی، سبدگردان و مشاوره سرمایه گذاری
- ❖ دستور العمل تأسیس و فعالیت صندوق های زمین و ساختمان
- ❖ دستور العمل های تأسیس، فعالیت و گزارش دهی مالی صندوق های سرمایه گذاری مشترک

سرفصل تفصیلی:

- ۱- فصول اول و دوم قانون تجارت در مورد دفاتر تجارتي
- ۲- اصلاحیه قانون تجارت، مبحث اول بخش های ۹ و ۱۱
- ۳- مباحث دوم تا هفتم قانون تجارت در مورد سایر شرکت های تجاری
- ۴- باب های چهاردهم و پانزدهم قانون تجارت در مورد اسم تجارتي و شخصیت حقوقی
- ۵- فصول دوم تا چهارم قانون تجارت در مورد تصفیه امور شرکت ها و سایر مقررات در مورد شرکت های تجاری
- ۶- باب های چهارم و پنجم قانون تجارت، راجع به برات، فته طلب، چک، اسناد در وجه حامل
- ۷- باب دهم قانون تجارت در مورد ضمانت
- ۸- قانون تجارت الکترونیک
- ۹- قانون صدور چک و سایر مقررات در مورد چک

- ۱۰- قانون مالیات های مستقیم، باب اول در مورد اشخاص مشمول مالیات، فصل پنجم باب دوم در مورد حق تمبر، فصول پنج و هفتم باب سوم در مورد مالیات بر درآمد اشخاص حقوقی و مالیات بر جمع درآمد ناشی از منابع مختلف، باب چهارم فصل اول در مورد معافیت ها و فصل دوم در مورد هزینه های قابل قبول و استهلاك و فصل چهارم در مورد مقررات عمومی و فصل نهم در مورد وصول مالیات
- ۱۱- قانون مالیات بر ارزش افزوده
- ۱۲- قواعد عمومی قراردادها و شرایط حاکم بر عقود معین در قانون مدنی ایران
- ۱۳- دستورالعمل تأسیس و فعالیت پردازش اطلاعات مالی (مصوب ۱۳۸۹/۵/۲۳ هیأت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار)
- ۱۴- دستورالعمل تأسیس و فعالیت سبدگردان (مصوب ۱۳۸۹/۸/۲۹ هیأت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار)
- ۱۵- دستورالعمل تأسیس و فعالیت مشاور سرمایه گذاری (مصوب ۱۳۸۹/۳/۴ هیأت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار)
- ۱۶- دستورالعمل اجرایی ثبت و گزارش دهی رویدادهای مالی صندوق های سرمایه گذاری مشترک (مصوب ۱۳۸۸/۷/۵ هیأت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار)
- ۱۷- راهنمای تهیه گزارش امکان سنجی پروژه های ساختمانی (مصوب ۱۳۸۸/۱/۲۹ هیأت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار)
- ۱۸- فرم تقاضای صدور مجوز تأسیس صندوق زمین و ساختمان (مصوب ۱۳۸۸/۱/۲۹ هیأت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار)
- ۱۹- دستورالعمل صدور واحد سرمایه گذاری صندوق های زمین و ساختمان (مصوب ۱۳۸۸/۱/۲۹ هیأت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار)
- ۲۰- دستورالعمل بازارگردانی واحدهای سرمایه گذاری صندوق های زمین و ساختمان (مصوب ۱۳۸۸/۱/۲۹ هیأت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار)
- ۲۱- دستورالعمل تأسیس صندوق زمین و ساختمان (مصوب ۱۳۸۸/۱/۲۹ هیأت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار)
- ۲۲- دستورالعمل تدوین روش و تهیه اسناد مزایده در صندوق های زمین و ساختمان (مصوب ۱۳۸۸/۱/۲۹ هیأت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار)
- ۲۳- دستورالعمل نحوه ی محاسبه خالص ارزش واحدهای سرمایه گذاری صندوق زمین و ساختمان (مصوب ۱۳۸۸/۱/۲۹ هیأت مدیره سازمان بورس و اوراق بهادار)

۲۴- مصوبه اصلاحی دستورالعمل نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق های

سرمایه گذاری (مصوب ۱۳۸۷/۷/۹ هیأت مدیره سازمان بورس)

۲۵- اساسنامه و امیدنامه نمونه صندوق های سرمایه گذاری مشترک (شامل تمامی انواع آن)

تحلیل آماری و اقتصادسنجی مالی

تعداد واحد و ساعات تدریس: ۳ واحد، ۴۸ ساعت آموزشی

تناسب با مفاد آزمون گواهینامه های حرفه ای: روش های کمی پیشرفته

هدف: آشنایی دانش پذیران با مباحث آماری پیشرفته و تحلیل داده های مالی حوزه بازار سرمایه با بهره گیری از تکنیک های پیشرفته است.

سرفصل اجمالی:

- ❖ مفاهیم احتمال
- ❖ توزیع احتمالات معمولی
- ❖ نمونه گیری و برآورد
- ❖ آزمون فرضیه
- ❖ همبستگی و رگرسیون
- ❖ رگرسیون های چند متغیره
- ❖ تجزیه و تحلیل سری زمانی

سرفصل تفصیلی:

۶-۱ مفاهیم احتمال

۱. تعریف متغیر تصادفی، پیشامد، رویداد، رویدادهای ناسازگار (مانعه الجمع) و فراگیر (exhaustive)
۲. توضیح توزیع احتمال و تمایز میان احتمال تجربی، ذهنی و قیاسی
۳. احتمال یک پیشامد بر حسب تعداد دفعات وقوع یا عدم وقوع
۴. تمایز میان احتمالات شرطی و غیرشرطی
۵. محاسبه و تفسیر احتمال مشترک دو پیشامد، وقوع حداقل یکی از دو پیشامد در شرایطی که احتمال وقوع آنها داده شده باشد و احتمال مشترک هر تعداد پیشامد مستقل
۶. تمایز میان پیشامدهای مستقل و وابسته
۷. محاسبه و تفسیر یک احتمال غیرشرطی با استفاده از قضیه احتمال کامل (total porabability rule)
۸. محاسبه و تفسیر کوواریانس یک تابع احتمال مشترک
۹. محاسبه یک توزیع احتمالی با استفاده قضیه بیز
۱۰. حل مسایل کمی با استفاده از قواعد فاکتوریل، ترکیب و ترتیب

۶-۲ توزیع احتمالات معمولی

۱. توزیع احتمال و تمایز میان متغیر تصادفی گسسته و پیوسته
 ۲. مجموعه رویدادهای ممکن برای یک متغیر تصادفی گسسته
 ۳. تابع احتمال، تابع چگالی احتمال، تابع توزیع تجمعی و احتمالات یک متغیر تصادفی با استفاده از تابع توزیع تجمعی
 ۴. تعریف و محاسبه توابع احتمال متغیر تصادفی گسسته یکنواخت و متغیر تصادفی دو جمله‌ای
 ۵. تعریف و محاسبه توزیع احتمال پیوسته یکنواخت
 ۶. ویژگی‌های یک تابع توزیع نرمال و تمایز میان توزیع نرمال یک متغیره و چند متغیره و نقش ضریب همبستگی در توزیع نرمال چند متغیره
 ۷. تعیین فاصله اطمینان برای توزیع نرمال یک متغیر تصادفی و تعیین احتمال قرار گرفتن یک متغیر تصادفی در فاصله اطمینان مورد نظر
 ۸. تعریف توزیع نرمال استاندارد، توضیح چگونگی استاندارد کردن یک متغیر تصادفی و محاسبه احتمالات با استفاده از توزیع نرمال استاندارد
 ۹. ارتباط میان توزیع نرمال و توزیع لگاریتمی نرمال (log normal) و دلیل استفاده از توزیع لگاریتمی نرمال در مدل قیمت‌گذاری دارایی‌های سرمایه‌ای
 ۱۰. تمایز میان نرخ‌های بازده مرکب گسسته و پیوسته و محاسبه نرخ بازده مرکب پیوسته باتوجه به نرخ بازده دوره نگهداری (بازده کل) (holding period return)
- ۳-۶ نمونه‌گیری و برآورد

۱. تعریف نمونه‌گیری ساده تصادفی، خطای نمونه‌گیری، توزیع نمونه‌گیری و تفسیر خطای نمونه‌گیری
 ۲. تمایز میان نمونه‌گیری ساده تصادفی و نمونه‌گیری تصادفی طبقه‌بندی شده
 ۳. تمایز میان داده‌های سری زمانی و داده‌های مقطعی
 ۴. تعریف قضیه حد مرکزی و اهمیت آن
 ۵. محاسبه خطای استاندارد میانگین نمونه
 ۶. تمایز میان برآورد نقطه‌ای و برآورد فاصله اطمینان پارامترهای جامعه
 ۷. ویژگی‌های لازم برای یک برآوردکننده مطلوب
 ۸. ویژگی‌های توزیع t-student و محاسبه درجه آزادی آن
 ۹. محاسبه فاصله اطمینان برای میانگین جامعه در شرایطی که :
 ✓ واریانس جامعه مشخص باشد
 ✓ واریانس جامعه نامشخص باشد
 ✓ واریانس جامعه نامشخص ولی اندازه نمونه بسیار بزرگ باشد
 ۱۰. تعیین اندازه مناسب نمونه و انواع خطاهای نمونه‌گیری
- ۴-۶ آزمون فرضیه

۱. تعریف فرضیه، مراحل آزمون فرضیه، نحوه انتخاب فرضیه صفر (H_0) و فرضیه مقابل (H_1)، تمایز میان فرضیه یک طرفه و دو طرفه
 ۲. تعریف آزمون آماری، خطای نوع اول و نوع دوم، تعریف سطح معنی داری و کاربرد آن در آزمون فرضیه
 ۳. تعریف قاعده تصمیم‌گیری و توان آزمون و رابطه فاصله اطمینان و آزمون فرضیه
 ۴. تمایز میان یک نتیجه آماری و یک نتیجه معنی دار اقتصادی
 ۵. تعریف آزمون آماری مناسب و تفسیر نتایج آن برای :
 ✓ توزیع میانگین نمونه‌ای در جامعه نرمال وقتی که:
 - واریانس معلوم است
 - واریانس نامعلوم است
 - ✓ تساوی میانگین نمونه‌ای دو جامعه نرمال بر اساس نمونه تصادفی مستقل با:
 - واریانس معلوم
 - واریانس نامعلوم
 - ✓ تفاوت میانگین نمونه‌ای در دو جامعه نرمال (آزمون مقایسه زوجی)
 ۶. تعریف آزمون آماری مناسب و تفسیر نتایج آزمون فرضیه شامل:
 - ✓ واریانس جامعه با توزیع نرمال
 - ✓ تساوی واریانس دو جامعه با توزیع نرمال براساس دو نمونه تصادفی مستقل
 ۷. تمایز میان آزمون‌های پارامتریک و ناپارامتریک و تعیین شرایطی که آزمون ناپارامتریک می‌تواند مناسب باشد
- ۵-۶ همبستگی و رگرسیون

۱. محاسبه و تفسیر کوواریانس نمونه و ضریب همبستگی نمونه و تفسیر نمودار پراکنش
۲. محدودیت‌های آنالیز واریانس شامل نقاط دورافتاده و همبستگی کاذب
۳. تنظیم آزمون فرضیه آماری با فرض صفر بودن ضریب همبستگی جامعه و تعیین معیارهای پذیرش یا رد فرضیات آزمون در سطح معنی داری مشخص
۴. تمایز میان متغیرهای مستقل و وابسته در رگرسیون خطی
۵. تعریف مفروضات زیربنایی رگرسیون خطی و تفسیر ضرایب رگرسیون
۶. محاسبه و تفسیر خطای استاندارد تخمین، ضرایب تعیین و فاصله اطمینان برای ضرایب رگرسیون
۷. تنظیم فرضیه صفر (H_0) و فرضیه مقابل (H_1) ضرایب رگرسیون جامعه، انتخاب آزمون آماری مناسب و تعیین رد یا قبول فرض صفر در سطح معنی داری مشخص
۸. محاسبه مقدار پیش‌بینی شده متغیر وابسته با فرض مشخص بودن مدل رگرسیون تخمینی و مقدار متغیر مستقل و محاسبه و تفسیر فاصله اطمینان برای مقدار پیش‌بینی شده متغیر وابسته
۹. کاربرد آنالیز واریانس در تجزیه و تحلیل رگرسیون و تفسیر نتایج آنالیز واریانس (ANOVA) و محاسبه و تفسیر آماره

۱۰. محدودیت‌های تجزیه و تحلیل رگرسیون

۶-۶ رگرسیون چند متغیره و مباحث مرتبط با تجزیه و تحلیل آن

۱. تنظیم معادله رگرسیون چندمتغیره و تعیین ارتباط میان متغیر وابسته و چندین متغیر مستقل، تعیین معنی‌داری آماری هر متغیر مستقل، و تفسیر ضرایب برآورد شده و P-Value هر یک آنها
۲. تنظیم آزمون فرضیه صفر (H_0) و فرضیه مقابل (H_1) برای ضرایب رگرسیون جامعه و محاسبه مقدار آزمون آماری و تعیین رد یا قبول فرضیه صفر (H_0) در سطح معنی‌داری مشخص با استفاده از آزمون یک یا دوطرفه و تفسیر نتایج آزمون
۳. محاسبه فاصله اطمینان برای ضرایب رگرسیون جامعه و مقدار پیش بینی شده متغیر وابسته با مشخص بودن مدل رگرسیون تخمینی و مقادیر متغیرهای مستقل
۴. مفروضات زیربنایی مدل رگرسیون چند متغیره
۵. محاسبه و تفسیر آماره F و چگونگی استفاده آن در رگرسیون چند متغیره، تعریف، تمایز و تفسیر ضریب تعیین (R^2) و ضریب تعیین تعدیل شده در رگرسیون چند متغیره و چگونگی تبیین متغیر وابسته با استفاده از نتایج حاصل از معادله رگرسیون و جدول NOVA
۶. تنظیم معادله رگرسیون چند متغیره با استفاده از متغیر مجازی (dummy) بجای متغیرهای کیفی برای تفسیر نتایج ضرایب رگرسیون
۷. انواع ناهمسانی واریانس‌ها (heteroscedasticity) و تأثیر ناهمسانی واریانس‌ها و همبستگی پیاپی (Serial Correlation) بر استنتاجات آماری
۸. تأثیر بیان نامناسب مدل بر نتایج رگرسیون چندمتغیره و چگونگی جلوگیری از آن
۹. تفسیر اقتصادی نتایج رگرسیون چند متغیره و انتقادات وارده بر مدل رگرسیون

۶-۷ تجزیه و تحلیل سری زمانی

۱. محاسبه و ارزیابی مقدار پیش‌بینی‌شده سری‌های زمانی با توجه به ضرایب روند تخمینی
۲. عوامل تعیین کننده استفاده از روند خطی یا لگاریتمی در یک سری زمانی خاص و ارزیابی محدودیت‌های آن
۳. تعریف الزامات ثبات کواریانس (Covariance Stationary) یک سری زمانی و تحلیل معنی‌داری سری‌های زمانی بی‌ثبات
۴. تبیین ساختار یک مدل خودرگرسیون (Auto Regressive) مرتبه P، محاسبه پیش‌بینی‌های یک‌دوره‌ای و دودوره‌ای چنانچه ضرایب تخمینی مشخص باشند و توضیح اینکه چطور خودهمبستگی پس‌ماندها برای آزمون مناسب بودن یک مدل خودرگرسیون سری زمانی مورد استفاده قرار می‌گیرد
۵. تعریف بازگشت به میانگین (Mean reversion) و محاسبه مرتبه بازگشت به میانگین
۶. بی‌ثباتی مدل‌های سری زمانی
۷. ویژگی‌های فرآیند گام تصادفی (Random walk)
۸. کاربرد آزمون ریشه واحد در تجزیه و تحلیل سری‌های زمانی

۹. مراحل انجام آزمون ریشه واحد برای تعیین بی‌ثباتی و ارتباط آن با مدل‌های خودرگرسیون سری زمانی
۱۰. چگونگی آزمون تصحیح اثر فصلی در تجزیه و تحلیل سری‌های زمانی و محاسبه و تفسیر مقادیر پیش‌بینی‌شده با استفاده از مدل AR با فاصله زمانی
۱۱. مدل خود رگرسیون شرطی ناهمسانی واریانس (Auto regressive conditional heteroskedasticity (ARCH)) و چگونگی استفاده از آن برای پیش‌بینی واریانس سری زمانی
۱۲. چگونگی تجزیه و تحلیل متغیرهای سری زمانی برای بررسی بی‌ثباتی (nonstationarity) و هم‌جمعی (cointegration)، پیش از استفاده در مدل رگرسیون خطی
۱۳. انتخاب یک مدل سری زمانی خاص از میان مجموعه‌ای از مدل‌ها و توجیه استفاده از آن