

مدیریت سرمایه‌گذاری و ریسک

حل مسائل پیشرفته و کاربردی

این کتاب مجموعه‌ای از مسائل مرتبط با مدیریت سرمایه‌گذاری، اوراق مالی مشتقه و ریسک، در سطح کاربردی و با استفاده از تجربیات عملی و آموزشی برای استفاده مدیران فعال در بازار سرمایه و دانشجویان دوره کارشناسی ارشد و دکترای مدیریت مالی دانشگاه‌ها است.

کتاب حاضر، حاصل تجربیات اجرایی نزدیک به ۳۰ سال در حوزه‌های مالی، سرمایه‌گذاری در داخل و خارج از کشور به اضافه تدریس به مدت ۸ سال در دانشگاه‌ها و ۲۰ سال برگزاری دوره‌های مدیریت مالی، مهندسی مالی و مالیه اسلامی در داخل و خارج از کشور را به خود اختصاص داده است. سعی گردیده تا در ۳۵۰ مسئله طراحی شده، توضیحات لازم ارائه شده و راه‌حل‌های پیشنهادی با نگرشی واقع‌بینانه نسبت به محیط اجرایی ایران تهیه گردند.

فهرست مطالب:

بخش اول: ارزش‌های فعلی، آتی و خالص فعلی

بخش دوم: ساختار زمانی نرخ‌های بازدهی تا سررسید، آنی و آتی

بخش سوم: مدل‌های ارزشیابی اوراق بهادار

بخش چهارم: مدل‌های ارزیابی ریسک اوراق بهادار

بخش پنجم: اوراق مالی مشتقه

بخش ششم: ارزشیابی اوراق مالی مشتقه

بخش هفتم: مصونیت‌سازی با اوراق مالی مشتقه

بخش هشتم: مدیریت ریسک جامع در بنگاه‌ها

بخش نهم: انتشار در بازار اولیه و معاملات در بازار ثانویه اوراق بهادار

بخش دهم: ارکان و مدل‌های نظارتی بازار سرمایه