

## مدیریت ریسک جامع بنگاه

### راه حل‌های کاربردی

کتاب حاضر، تجربیات اجرایی نزدیک به ۳۰ سال در حوزه‌های مدیریت، مالی، سرمایه‌گذاری در داخل و خارج از کشور به‌اضافه 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 ۱۳۰ مسئله کاربردی طراحی‌شده در چهار بخش، توضیحات لازم ارائه و راه‌حل‌های پیشنهادی با نگرشی کاربردی و واقع‌بینانه نسبت به محیط اجرایی ایران ارائه گردد. فرض بر این است که خوانندگان محترم به‌عنوان پیش‌نیاز با اصول مطرح‌شده در کتاب «[مدیریت سرمایه‌گذاری و ریسک، حل مسائل پیشرفته و کاربردی](#)» و یا مبانی و اصول مدیریت سرمایه‌گذاری پیشرفته در سطح حداقل لیسانس و تئوری‌های ریاضیات مرتبط، آشنایی کامل داشته باشند.

پیش‌شرط آشنایی و استفاده صحیح از این کتاب، شامل موضوعات زیر است:

- ۱- روش‌های ارزشیابی انواع اوراق بهادار
- ۲- ریسک اوراق بهادار، نحوه اندازه‌گیری و مدیریت آن
- ۳- روش‌های ارزشیابی قراردادهای آتی، آتی و اختیار معاملات و کاربرد آن‌ها در اجرای استراتژی‌های مرتبط با ایمن‌سازی ارزش‌ها
- ۴- اصول مدیریت سبدهای سرمایه‌گذاری در سطح ملی و بین‌المللی

سعی گردیده تا در هر بخش این کتاب، مبانی و توضیحات لازم برای حل مسائل بیان و به ارائه راه‌حل‌های پیشنهادی پرداخته شود. جهت اطلاع خوانندگان، در بخش چهارم این کتاب، مطالب مرتبط با مدل‌های کلاسیک ارزیابی و مدیریت ریسک، اقتباس‌شده از بخش‌های چهارم تا هفتم کتاب «[مدیریت سرمایه‌گذاری و ریسک، حل مسائل پیشرفته و کاربردی](#)»، این نویسنده می‌باشد. برای روشن‌تر نمودن موضوع، در متن تعدادی از مسائل توضیحات اضافی ارائه شده است. بعضی از مسائل در قالب نیاز به بحث‌های گروهی ارائه گردیده و جواب قطعی برای آن‌ها متصور نخواهد بود ولی ارائه جواب منطقی متصور است. باید توجه نمود که بعضی از مسائل مدیریتی دارای یک جواب خاص نمی‌باشند و به‌طورکلی با در نظر گرفتن مبانی و تئوری‌های موجود، واقعیت‌های عملیاتی و منطقی و اصول علم مدیریت مالی، سرمایه‌گذاری و ریسک، جواب مسئله باید تعیین گردد.

## فهرست مطالب:

بخش اول: اصول حاکمیت و راهبری و مدیریت ریسک جامع بنگاه

بخش دوم: کلیات مدیریت ریسک جامع بنگاه

بخش سوم: مدل اجرایی مدیریت ریسک جامع بنگاه

بخش چهارم: مدل‌های کلاسیک ارزیابی و مدیریت ریسک