

به نام خدا

تجزیه و تحلیل ریسک

مؤلفین:

دکتر یحیی زارع مهرجردی

دانشیار و عضو هیات علمی دانشکده صنایع دانشگاه یزد

احمد احمدی یزدی و علیرضا امیری

دانش آموختگان دانشکده صنایع دانشگاه یزد



سرشناسه	: زارع مهرجردی، یحیی، ۱۳۳۲ -
عنوان و نام پدیدآور	: تجزیه و تحلیل ریسک / مولفین یحیی زارع مهرجردی، احمد احمدی یزدی، علیرضا امیری.
مشخصات نشر	: تهران: مهرجرد، ۱۳۹۴.
مشخصات ظاهری	: ۲۳۲ص: مصور، جدول، نمودار.
شابک	: ۱۲۰۰۰۰ ریال 978-600-7230-19-0
وضعیت فهرست نویسی	: فیپا
موضوع	: مدیریت ریسک
شناسه افزوده	: احمدی یزدی، احمد، ۱۳۴۵ -
شناسه افزوده	: امیری اسفراجانی، علیرضا، ۱۳۶۰ -
رده بندی کنگره	: HD۱۳۹۴۶۱۳/۱۶
رده بندی دیویی	: ۱۵۵/۶۵۸
شماره کتابشناسی ملی	: ۳۹۱۸۸۶۱



انتشارات مهرجرد

تجزیه و تحلیل ریسک

مؤلفان: دکتر یحیی زارع مهرجردی - احمد احمدی یزدی - علیرضا امیری

شمارگان: ۱۰۰ جلد

چاپ اول: ۱۳۹۴

قیمت: ۱۲۰۰۰ تومان

تهران، میدان انقلاب، خیابان اردیبهشت، بن بست مبین، پلاک ۶

تلفن: ۶۶۴۹۱۹۰۲ و ۶۶۴۱۴۸۱۹ الی

مراکز پخش

انتشارات نص: تهران، میدان انقلاب، خیابان اردیبهشت، بن بست مبین، پلاک ۶

تلفن: ۶۶۹۵۳۸۸۳-۴ و ۶۶۴۰۵۳۷۲

برای خرید آنلاین به این سایت مراجعه نمایید. www.fardabook.com

شابک ۰-۱۹-۷۲۳-۶۰۰-۹۷۸

ISBN: 978-600-7230-19-0

فهرست مطالب

9	1 فصل اول (تعریف ریسک).....
11	1-1 مقدمه
13	2-1 اندازه‌گیری ریسک
15	3-1 عوامل ریسک
15	4-1 دسته بندی ریسک
16	5-1 ارزیابی ریسک
17	6-1 اولویت‌بندی ریسک
17	7-1 کنترل و پاسخ ریسک
18	8-1 استراتژی‌های نظارت و اجتناب از ریسک
18	9-1 ریسک‌های موجود در عناصر سازنده سازمان
19	1-9-1 ریسک اعتباری
20	10-1 مروری بر مفاهیم ریسک در بازار سهام
23	2 فصل دوم (رویکردهای تحلیل ریسک).....
25	1-2 مقدمه
27	2-2 روش‌های تحلیلی ریسک در اقتصاد
35	3-2 نکات مهم در مدیریت ریسک سرمایه‌گذاران سهام

37	فصل سوم (درخت تصمیم‌گیری)	3
38	مقدمه	1-3
53	تئوری احتمال شرطی	2-3
63	فصل چهارم (شبیه‌سازی مونت کارلو)	4
64	مقدمه	1-4
66	زمینه‌های کاربرد مونت کارلو	2-4
67	اعداد تصادفی در شبیه‌سازی مونت کارلو	3-4
87	فصل پنجم (پرتفوی)	5
89	تعریف پرتفوی	1-5
91	تشکیل پرتفوی	2-5
92	بازده مجموعه سرمایه‌گذاری	3-5
94	ریسک سبد سرمایه‌گذاری یا پرتفوی	4-5
96	ضریب همبستگی	5-5
98	محاسبه ریسک سبد اوراق بهادار (پرتفوی)	6-5
103	تعیین پرتفوی کارا و مرز کارا	7-5
106	تاثیر وام بر انتخاب پرتفوی در مرز کارا	8-5
106	خط بازار سرمایه	1-8-5

109.....	9-5 مسئله بهینه‌سازی پرتفوی
111.....	10-5 مدل‌های بهینه‌سازی پرتفوی
111.....	1-10-5 مدل مارکوویتز
116.....	2-10-5 مدل کونو و یامازاکی (1991)
121.....	3-10-5 مدل اسپرانزا (1995)
125.....	4-10-5 مدل یانگ (1998)
133.....	6 فصل ششم (Var)
135.....	1-6 ارزش در معرض ریسک
138.....	2-6 اهمیت ارزش در معرض ریسک
139.....	3-6 تعریف ارزش در معرض ریسک
142.....	4-6 انتخاب پارامترهای ارزش در معرض ریسک
143.....	1-4-6 سطح اطمینان
144.....	2-4-6 بازه زمانی
145.....	5-6 رویکردهای محاسبه ارزش در معرض ریسک
150.....	1-5-6 روش تاریخی
152.....	2-5-6 روش واریانس - کواریانس
166.....	3-5-6 روش شبیه‌سازی مونت کارلو
170.....	6-6 روشهای کاهش Var

- 170..... همبستگی 1-6-6
- 171..... تعداد دارایی 2-6-6
- 173..... VaR ابزارهای 7-6
- 173..... VaR حاشیه‌ای 1-7-6
- 175..... ارزش در معرض ریسک افزایشی 2-7-6
- 177..... مدل‌های پیش بینی نوسانات بازده 8-6
- 178 میانگین متحرک 1-8-6
- 183..... مدل‌های خودرگرسیون 2-8-6
- 184..... مدل‌های تعمیم یافته خود رگرسیونی 3-8-6
- 185..... مدل $GARCH(p,q)$ 4-8-6
- 187 $GARCH(1,1)$ مدل 5-8-6
- 188..... مدل ریسک سنجی ($Risk Metrics$) 6-8-6
- 189..... مزایا و معایب ارزش در معرض ریسک 9-6
- 190..... مزایا ارزش در معرض ریسک 1-9-6
- 190..... ضعف ارزش در معرض ریسک 2-9-6
- 192..... مفاهیم دیگر در معرض ریسک 10-6
- 197..... فصل هفتم (بویایی سیستم و اقتصاد مهندسی) 7
- 199..... تفکر سیستمی 1-7

200.....	متغیرهای زبان تفکر سیستمی	2-7
201.....	سیستم داینامیک	3-7
202.....	الگوی رفتار با رشد توانی	1-3-7
203.....	الگوی هدف گرا	2-3-7
203.....	رشد کشکول	3-3-7
204.....	رشد نوسانی	4-3-7
204.....	سایر گونه‌های رفتاری	5-3-7
205.....	بازخور و نمودارهای علت و معلولی	4-7
208.....	ساختار سیستم و الگوی رفتار	5-7
208.....	حلقه‌های مثبت تقویت کننده	1-5-7
209.....	حلقه‌های منفی تعدیل کننده	2-5-7
209.....	حلقه‌های منفی تعدیل کننده با تأخیر	3-5-7
211.....	ترکیب حلقه‌های مثبت و منفی	4-5-7
213.....	مطالعه موردی پویایی سیستم	6-7
213.....	مدل پویایی سیستم	1-6-7
221.....	پیوست ۱	
228.....	پیوست ۲	