

۲۲۲
۱۴۰۰/۷/۲۵

بازارها و نهادهای مالی: مدیریت ریسک در مؤسسات مالی

(جلد دوم)

تألیف

آنتونی ساندرز

مارسیا میلون کورنت

www.ketab.ir

ترجمه

دکتر رضا تهرانی

عضو هیأت علمی دانشگاه تهران

دکتر عسگر نوربخش

عضو هیأت علمی دانشگاه تهران



شماره مسلسل ۱۰۸۵۷

شماره انتشار ۴۴۵۹

انتشارات دانشگاه تهران

سرشناسه	: ساندرز، آنتونی، ۱۹۴۹-م.
عنوان و نام پدیدآور	: بازاریا و نهادهای مالی (کتاب) / تألیف آنتونی ساندرز، مارسیا کورنت؛ ترجمه رضا تهرانی، عسگر نوربخش.
مشخصات نشر	: تهران: دانشگاه تهران، مؤسسه انتشارات، ۱۴۰۰.
مشخصات ظاهری	: ۲ ج: مصور، جدول، نمودار.
فروست	: انتشارات دانشگاه تهران؛ شماره انتشار ۴۴۵۹.
شابک	: ۹۷۸-۹۶۴-۰۳-۰۲۹۸-۹
وضعیت فهرست‌نویسی	: فایا
یادداشت	: عنوان اصلی: Financial Markets and Institutions, 4th.ed, c2009.
یادداشت	: جلد اول این کتاب در سال‌های ۱۳۹۳-۱۳۹۸ تجدید چاپ شده است.
یادداشت	: ج: ۲ (چاپ اول: ۱۴۰۰) (فایا)
یادداشت	: عنوان مکرر: بازارها و مؤسسات مالی
یادداشت	: کتابنامه.
عنوان دیگر	: بازارها و مؤسسات مالی
موضوع	: اوراق بهادار-- ایالات متحده
موضوع	: بورس-- ایالات متحده
موضوع	: سازمان‌های مالی-- ایالات متحده
موضوع	: بانک بازده-- ایالات متحده
موضوع	: بانک‌های بهره-- ایالات متحده
شناسه افزوده	: Cornett, Marcia Millon
شناسه افزوده	: کورنت، مارسیا
شناسه افزوده	: تهرانی، رضا، مترجم
شناسه افزوده	: نوربخش، عسگر، ۱۳۵۸-م
شناسه افزوده	: دانشگاه تهران، مؤسسه انتشارات
رده‌بندی کنگره	: ۱۴۰۰ ۲ب ۲س/ HG۴۹۱۰
رده‌بندی دیویی	: ۳۳۲
شماره کتابشناسی ملی	: ۲۶۳۸۷۰۱

این کتاب مشمول قانون حمایت از حقوق مؤلفان و مصنفان است. تکثیر کتاب به هر روش اعم از فتوکپی، ریسوگرافی، تهیه فایل‌های pdf، لوح فشرده، بازنویسی در وبلاگ‌ها، سایت‌ها، مجله‌ها و کتاب، بدون اجازه کتبی ناشر مجاز نیست و موجب پیگرد قانونی می‌شود و تمامی حقوق برای ناشر محفوظ است.
(این کتاب با کاغذ حمایتی به چاپ رسیده است.)

عنوان: بازارها و نهادهای مالی: مدیریت ریسک در مؤسسات مالی (جلد دوم)

تألیف: آنتونی ساندرز

ترجمه: دکتر رضا تهرانی- دکتر عسگر نوربخش

نوبت چاپ: اول

تاریخ انتشار: ۱۴۰۰

شمارگان: ۲۰۰ نسخه

ناشر: مؤسسه انتشارات دانشگاه تهران

چاپ و صحافی: مؤسسه انتشارات دانشگاه تهران



«مسئولیت صحت مطالب کتاب با مترجمان است»

بها: ۹۰۰،۰۰۰ ریال

خیابان کارگر شمالی - خیابان شهید فرش مقدم - مؤسسه انتشارات دانشگاه تهران

پست الکترونیک: press @ ut. ac. ir - تارنما: http://press.ut.ac.ir

بخش و فروش: تلفکس ۸۸۳۳۸۷۱۲

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

فهرست مطالب

۱	فصل اول - انواع ریسک در مؤسسات مالی
۱	اهتمامی فصل
۲	ضرورت نیاز مؤسسات مالی به مدیریت ریسک چیست؟
۲	مروری بر فصل
۳	ریسک اعتباری
۶	ریسک نقدینگی
۸	ریسک نرخ بهره
۱۱	ریسک بازار
۱۴	ریسک تأمین مالی از طریق اقلام خارج از ترازنامه
۱۷	ریسک ارز خارجی
۲۰	ریسک کشور
۲۱	ریسک عملیاتی و فناوری
۲۳	ریسک ورشکستگی
۲۴	سایر ریسک‌ها و اثر متقابل بین آن‌ها
۲۶	خلاصه
۲۶	پیش‌ها
۳۰	مسائل
۳۳	فصل دوم - مدیریت ریسک اعتباری در ترازنامه
۳۳	اهتمامی فصل
۳۴	مدیریت ریسک اعتباری
۳۴	مروری بر فصل
۳۵	مسائل و مشکلات مربوط به کیفیت اعتبار
۳۹	تحلیل اعتبار
۳۹	وام مستغلات

۴۵	وام مصرفی (فردی) و کسب و کارهای کوچک
۴۵	وامهای تجاری و صنعتی متوسط
۵۳	نسبت‌های نقدینگی
۵۴	نسبت‌های مدیریت دارایی (فعالیت یا کارایی)
۵۵	نسبت‌های بدهی و ورشکستگی
۵۶	نسبت‌های سودآوری
۵۸	وامهای تجاری و صنعتی کلان
۶۳	محاسبه بازده وام
۶۳	بازده دارایی‌ها (ROA)
۶۶	مدل‌های RAROC
۶۸	خلاصه
۶۹	پرسش‌ها
۶۹	مسائل
۷۷	ضمیمه الف - ۲: ریسک و مدیریت ریسک وام
۸۱	فصل سوم - مدیریت ریسک نقدینگی در ترازنامه
۸۱	راهنمای فصل
۸۲	مدیریت ریسک نقدینگی
۸۲	مرووری بر فصل
۸۳	علل ریسک نقدینگی
۸۴	ریسک نقدینگی و مؤسسات سپرده‌پذیر
۸۴	ریسک نقدینگی ناشی از بدهی
۸۹	ریسک نقدینگی ناشی از دارایی
۹۰	اندازه‌گیری ریسک نقدینگی مؤسسات سپرده‌پذیر
۹۹	ریسک نقدینگی، برداشت غیرمنتظره سپرده‌ها، و هجوم بانکی
۱۰۱	هجوم بانکی، تسهیلات تنزیل، و بیمه سپرده‌ها
۱۰۶	ریسک نقدینگی و شرکت‌های بیمه
۱۰۶	شرکت‌های بیمه عمر
۱۰۶	شرکت‌های بیمه سوانح و اموال

۱۰۷	طرح‌های تضمین برای شرکت‌های بیمه سوانح و اموال
۱۰۸	ریسک نقدینگی و صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۱۱۱	خلاصه
۱۱۱	پرسش‌ها
۱۱۳	مسائل
۱۱۹	فصل چهارم- مدیریت ریسک نرخ بهره و ریسک ورشکستگی در ترازنامه
۱۱۹	راهنمای فصل
۱۲۰	مدیریت ریسک نرخ بهره و ریسک ورشکستگی
۱۲۰	مروری بر فصل
۱۲۰	اندازه‌گیری و مدیریت ریسک نرخ بهره
۱۲۱	مدل قیمت‌گذاری مجدد
۱۳۵	مدل دیرش
۱۴۶	مدیریت ریسک ورشکستگی
۱۴۶	سرمایه و ریسک ورشکستگی
۱۵۴	خلاصه
۱۵۵	پرسش‌ها
۱۵۷	مسائل
۱۶۳	فصل پنجم- مدیریت ریسک خارج از ترازنامه با استفاده از اوراق مشتقه
۱۶۳	راهنمای فصل
۱۶۴	اوراق مشتقه مورد استفاده برای مدیریت ریسک
۱۶۴	مروری بر فصل
۱۶۵	قراردادها و پیمان‌های آتی
۱۶۶	پوشش ریسک با استفاده از قراردادهای آتی
۱۶۸	پوشش ریسک با استفاده از پیمان‌های آتی
۱۷۲	اوراق اختیار معامله
۱۷۲	ویژگی‌های اصلی اوراق اختیار معامله
۱۷۷	اوراق اختیار معامله نرخ بهره