

مدیریت سرمایه‌گذاری

نظریه مدرن پرتفوی: طراحی ، ساخت و حفاظت
(جلد چهارم)

تألیف:

فریدون کبیری

www.ketab.ir

آراد کتاب

سرشناسه	: کیبری، فریبرز، ۱۳۴۴.
عنوان و پدیدآور	: مدیریت سرمایه‌گذاری / تالیف فریبرز کیبری.
مشخصات نشر	: تهران، آراد کتاب،
مشخصات ظاهری	: ج ۴،
شابک	: ۲-۳۴۶-۱۸۶-۶۰۰-۹۷۸ ج ۳
مندرجات	: ج ۱: حوزه سرمایه‌گذاری، بازارها و نهادهای ج ۲: تجزیه و تحلیل اوراق بهادار اصلی ج ۳: مالی رفتاری، کارانی بازار و تحلیل‌گری فنی و بنیادی ج ۴: نظریه مدرن پرتفوی: طراحی، ساخت و حفاظت
موضوع	: سرمایه‌گذاری - مدیریت
موضوع	: سرمایه‌گذاری
رده بندی کنگره	: ۱۳۹۶ م ۴۲۳/۵ HG ۴۵۲۱
رده بندی دیویی	: ۳۳۲/۶
شماره کتابخانه ملی	: ۴۹۳۱۶۸۲

مدیریت سرمایه‌گذاری

(جلد چهارم)

نظریه مدرن پرتفوی: طراحی، ساخت و حفاظت

✑ ناشر: آراد کتاب

✑ تیراژ: ۲۰۰ جلد

✑ قیمت: ۶۵۰۰۰۰ ریال

✑ تالیف: فریبرز کیبری

✑ نوبت چاپ: اول ۱۳۹۹

✑ چاپ و صحافی: مهرین

شابک: ۲-۳۴۶-۱۸۶-۶۰۰-۹۷۸

حق چاپ برای ناشر محفوظ است. کلیه حقوق و حق چاپ متن، طرح روی جلد و عنوان کتاب با نگرش به قانون حمایت حقوق مؤلفان، مصنفان و هنرمندان مصوب ۱۳۴۸ برای انتشارات آراد کتاب محفوظ است و متخلفین تحت پیگرد قانونی قرار می‌گیرند.

مرکز پخش و فروش:

انتشارات آراد کتاب تلفن: ۶۶۹۷۵۲۸۵ - ۶۶۴۸۲۲۲۶ - ۹۱۲۳۰۶۲۴۵۸

خرید آنلاین از سایت: www.aradbook.com

توانا بود هر که دانا بود

نظریه نوین پرتفوی یکی از مباحث بسیار مهم و البته با اهمیت در سلسله مطالب مدیریت سرمایه گذاری است. در سه جلد قبلی این مجموعه در مورد بازارها و نهادهای مالی، ابزار و اوراق بهادار اصلی و نظریه های کارایی بازار و ... که از مباحث اصلی نظریه پرتفوی هستند بحث کردیم. در نتیجه در این جلد از مجموعه مدیریت سرمایه گذاری، نظریه مدرن پرتفوی را مورد بررسی قرار می دهیم. در این مورد لازم به توضیح است که ما در پاره ای از مواقع برای پیوستگی مطالب، خلاصه ای از مباحث قبلی را نیز ارائه می نماییم. بخش اول این کتاب جنبه های عمومی تر از نظریه مدرن پرتفوی را بحث می کند و بخش دوم نظریه مدرن پرتفوی را در تطابق با CFA بیان می نماید.

بدیهی است؛ علی رغم دقت و حساسیت فراوان به کار رفته در تدوین مطالب، مجموعه ای ارائه شده عاری از اشکال نیست و پیشنهادهای اصلاحی اساتید و دانشجویان گرانقدر و معزز می تواند موجب غنای بیش تر مطالب گردد.

در پایان از همکاری ناشر عالی قدر که کوشیدند حاصل تلاش انجام شده را به صورتی پاکیزه و زیاده در آورند، منتهی قدر دانی می گردد.

www.ketab.ir

فریبرز کبیری

سودابه ذوالفقارزاده

تهران، زمستان ۱۳۹۵

فهرست مطالب

۲۵	مروری بر اصول اولیه نظریه مدرن پرتفوی	۱
۲۶	دو مفهوم کلیدی در موضوعات مالی	۹
۲۷	ریاضیات تنوع بخشی	۱۰۵
۲۸	مدیریت پرتفوی در عمل (قسمت اول: ریسک و بازده)	۱۵۵
۲۹	مدیریت پرتفوی در عمل (قسمت دوم: ریسک و بازده)	۲۵۷
۳۰	مدل های چند عاملی	۳۲۹
۳۱	ارزیابی عمل کرد و مدیریت ریسک	۳۵۳
۳۲	طراحی، ساخت و مدیریت پرتفوی در عمل	۳۸۵
۴۳۵	تمرین ها و مسائلی برای مرور کتاب	۴۳۵
۵۰۳	ماخذ و منابع اضافی برای مطالعه ی بیشتر	۵۰۳