

تصمیم‌گیری در مسائل مالی

www.ketab.ir

نویسندگان:

محمد جواد همتی

نیلوفر قمیان



سرشناسه: همتی، محمدجواد، ۱۳۶۶
عنوان و نام پدیدآور: تصمیم‌گیری در مسائل مالی / نویسندگان محمدجواد
همتی، نیلوفر قمیان.
مشخصات نشر: تهران: نوآوران دانش، ۱۴۰۰
مشخصات ظاهری: ۱۷۱ ص.
شابک: ۹۷۸-۶۲۲-۷۴۹۵-۸۳-۶
وضعیت فهرست نویسی: فیپا
موضوع: مدیریت مالی، تصمیم‌گیری
موضوع: Finance – Management*, Decision making
موضوع: امور مالی، تصمیم‌گیری
موضوع: Finance, Decision making
شناسه افزوده: قمیان، نیلوفر، ۱۳۶۳
رده‌بندی کنگره: HG۴۰۲۶
رده‌بندی دیویی: ۶۵۸/۱۵
شماره کتابشناسی ملی: ۷۹۴۷۲۷۲
وضعیت رکورد: فیپا

عنوان: تصمیم‌گیری در مسائل مالی

نویسندگان: محمد جواد همتی، نیلوفر قمیان

طراح جلد: الویرا صیامی

نوبت چاپ: اول، ۱۴۰۰

شمارگان: ۵۰۰ جلد

شابک: ۹۷۸-۶۲۲-۷۴۹۵-۸۳-۶

قیمت: ۹۰۰,۰۰۰ ریال

انتشارات نوآوران دانش

کلیه حقوق چاپ و نشر مخصوص و محفوظ ناشر است.

میدان انقلاب، ابتدای خیابان آزادی، تقاطع خیابان جمالزاده جنوبی، پلاک ۸۴، واحد ۴

تلفن مرکز پخش: ۶۶۵۶۸۹۱۷ - ۶۶۵۶۸۹۰۳ - ۹۳۷۹۶۶۴۶۰۸

سفارش اینترنتی: www.novinlc.com

فصل اول: بورس اوراق بهادار و بازارهای مالی و نحوه سرمایه‌گذاری در آن ----- ۱۱

مقدمه ----- ۱۲

بازارهای مالی ----- ۱۲

واسطه‌های مالی ----- ۱۴

فرآیند سرمایه‌گذاری در بورس اوراق بهادار ----- ۱۵

صدور اعلامیه خرید و فروش و گواهینامه موقت سهام ----- ۱۸

چگونه در بازار بورس اوراق بهادار سرمایه‌گذاری کنیم؟ ----- ۲۰

تجزیه و تحلیل صورت‌ها و نسبت‌های مالی ----- ۲۰

انواع دارایی جاری ----- ۲۱

دارایی‌های غیرجاری ----- ۲۲

بدهی‌ها و حقوق صاحبان سهام ----- ۲۴

حقوق صاحبان سهام ----- ۲۴

انواع نسبت‌های مالی ----- ۲۸

رویکردهای نگرشی به بازار سهام و تجزیه و تحلیل آن ----- ۳۳

برآورد حاشیه سود شرکت ----- ۳۴

فصل دوم: مدل استاندارد قیمت‌گذاری ----- ۳۷

دارایی‌های سرمایه‌ای ----- ۳۷

مقدمه ----- ۳۸

مفروضات اصلی مدل استاندارد قیمت‌گذاری دارایی سرمایه‌ای (CAPM) ----- ۳۸

CAPM ----- ۴۰

استخراج CAPM، رویکرد سختگیرانه‌تر ----- ۴۹

قیمت‌ها و CAPM ----- ۵۲

۵۵	فصل سوم: استفاده از CAPM برای اندازه‌گیری عملکرد
۵۶	مقدمه
۵۶	معیار ترینر
۵۷	معیار شارپ
۵۹	معیار جنسن
۶۰	روابط بین شاخص‌های مختلف و استفاده از شاخص‌ها
۶۲	استفاده از معیارهای مختلف
۶۵	خطای ردیابی
۶۶	نسبت اطلاعات
۶۸	شاخص سورتینو
۶۸	تجزیه و تحلیل بر اساس VaR
۷۳	فصل چهارم: تئوری قیمت‌گذاری آربیتراژ و مدل‌های چند عاملی ریسک و بازده
۷۴	مقدمه
۷۵	مدل‌های چند عاملی: نمای کلی
۷۵	مدل‌های عاملی بازده‌های اوراق بهادار
۷۶	نظریه قیمت‌گذاری آربیتراژ
۷۸	پرتفوی‌های بسیار متنوع
۸۰	اجرای آربیتراژ
۸۱	معادله بدون آربیتراژ APT
۸۸	مدل سه عاملی فاما- فرنچ (FF)
۹۱	فصل پنجم: مالی رفتاری
۹۲	مقدمه
۹۲	مالی رفتاری
۹۳	تورش‌های رفتاری

۹۴	روش‌های ابتکاری
۹۸	تئوری‌های رفتاری
۱۰۰	رفتار سرمایه‌گذاران
۱۰۱	عوامل مؤثر بر رفتار سرمایه‌گذاران در بورس
۱۰۳	رفتار توده‌وار و فرضیه بازار کارا
۱۰۶	توده‌واری اطلاعاتی
۱۰۷	توده‌واری مبتنی بر مشاهده عواقب (نتایج) و تصمیمات دیگران
۱۰۷	توده‌واری مبتنی بر حسن شهرت
۱۰۸	پیامدهای رفتار توده‌وار
۱۱۱	فصل ششم: تقسیم سود
۱۱۲	مقدمه
۱۱۲	تقسیم سود
۱۱۴	استراتژی‌های تقسیم سود
۱۱۵	جانمایی استراتژی تقسیم سود
۱۱۶	خط مشی تقسیم سود و چرخه عمر شرکت
۱۱۷	اهداف سیاست تقسیم سود
۱۱۸	عوامل مؤثر بر سیاست تقسیم سود
۱۲۵	تعیین سیاست تقسیم سود
۱۲۷	تئوری‌های مطرح در حوزه سیاست تقسیم سود
۱۳۰	نظریات توجیه‌کننده مقدار سود تقسیمی
۱۳۰	شیوه‌های پرداخت سود سهام
۱۳۲	تجزیه سهام
۱۳۲	رابطه پروژه‌ها و جریان نقد شرکت با سیاست تقسیم سود