

۱۵۳۳۲۰۱
۴۲/۱۱/۳

به نام خدا

مهندسی مالی و مدیریت ریسک با نگرشی بر آزمون های CFA

تألیف:

فریبرز کبیری

سرشناسه	: کبیری، فریبرز، ۱۳۴۴ -
عنوان و نام پدیدآور	: مهندسی مالی و مدیریت ریسک با نگرشی بر آزمون‌های CFA / مولف فریبرز کبیری.
مشخصات نشر	: تهران: اتحاد، ۱۳۹۶.
مشخصات ظاهری	: ۴۷۴ ص.
شابک	: 978-600-197-103-7
وضعیت فهرست نویسی	: فیبا
یادداشت	: کتابنامه: ص. ۴۶۴.
موضوع	: Financial engineering مهندسی مالی
موضوع	: Risk management مدیریت ریسک
موضوع	: سرمایه‌گذاری -- تجزیه و تحلیل -- آزمون‌ها و تمرین‌ها
موضوع	: Investment analysis -- Examinations, questions, etc
رده بندی کنگره	: HG۷/۱۷۶/۵۲م۹ ۱۳۹۶
رده بندی دسی	: ۱۵/۶۵۸
شماره ک. شناسی ملی	: ۴۸۸۲۱۳۰

نام کتاب : مهندسی مالی و مدیریت ریسک

نگرشی بر آزمون‌های CFA

مولف : فریبرز کبیری

ناشر : اتحاد

لیتوگرافی : طیف نگار

چاپ : دیبا - طنین

نوبت چاپ : اول - ۱۳۹۶

تیراژ : ۱۰۰۰ نسخه

قیمت : ۳۲۰۰۰ تومان

شابک: ۹۷۸-۶۰۰-۱۹۷-۱۰۳-۷

ISBN : 978-600-197-103-7

دفتر مرکزی کتاب آیلاز

انقلاب - خیابان شهید منیری جاوید (اردیبهشت) - خیابان شهدای ژاندارمری شرقی - شماره ۱۴۶

تلفن: ۲۵۵ ۴۰۰ / دورنگار: ۶۶۴۹۴۴۳۱ (ساختمان آیلاز)

فروشگاه شماره ۱ (کتاب آیلاز)

تلفن: ۶۶۴۱۱۸۶۵ - ۶۶۹۵۶۴۳۳ انقلاب - روبروی دبیرخانه دانشگاه تهران - بازارچه کتاب

فروشگاه شماره ۲ (کتاب آیلاز)

تلفن: ۸۸۳۱۹۷۴۰-۱ کریمخان زند - مابین ایرانشهر و خردمند جنوبی - شماره ۱۳۲

این اثر مشمول قانون حمایت از حقوق مؤلفان، مصنفان و هنرمندان مصوب ۱۳۴۸ است، هر کس تمام یا قسمتی از این اثر را بدون اجازه ناشر، نشر یا پخش یا الکترونیک عرضه کند تحت پیگرد قانونی قرار خواهد گرفت.

ای نام تو بهترین سرآغاز بی نام تو نامه کی کنم باز (نظامی)

یکی از حوزه‌های جدید مالی، مهندسی مالی و مدیریت ریسک است که در آن ابزارهای مشتقه مورد بحث واقع می‌شوند. از آنجایی که ریسک و مدیریت آن چالش اصلی سرمایه‌گذاران و مدیران سرمایه‌گذاری می‌باشد، لذا ابزارهای مدیریت ریسک به سرعت رو به توسعه هستند. از اوراق بهادار مشتقه می‌توان به عنوان یکی از با اهمیت ترین ابزارهای مالی برای مدیریت ریسک، نام برد. اگرچه ما قصد نداریم اوراق بهادار مشتقه را به طور کامل در این کتاب بحث کنیم اما با توجه به موضوع کتاب، همه‌ی تلاش خود را می‌نماییم تا ضمن ارائه شیوه‌ها و استفاده از این ابزارها؛ در حد حوصله کتاب، اوراق بهادار مشتقه را معرفی نماییم. بدیهی است؛ علی‌رغم دقت و حد است فراوان به کار رفته در تدوین مطالب، مجموعه‌ای ارائه شده عاری از اشکال نیست و پیشنهادهای اصرح می‌سازند و دانشجویان گرانقدر و معزز می‌توانند موجب غنای بیش‌تر مطالب گردد.

در پایان از همکاری ناشر عالی‌قدر که که شایسته اصل تلاش انجام شده را به صورتی پاکیزه و زیبا درآوردند، متنتی قدردانی می‌گردد.

فریبرز کیبیری

فهرست مطالب

۱	قراردادهای آتی - قسمت اول
۴۷	مسائل حل شده پایان فصل
۴۸	سوالات چند گزینه‌ای آزمون‌های CFA
۵۳	سوال‌های مفهومی
۵۵	تمرینات و مسائل
۵۹	۲. اختیار معاملات سهام - قسمت اول
۱۲۳	مسائل حل شده آزمون‌های CFA
۱۲۵	سوالات چند گزینه‌ای آزمون‌های CFA
۱۳۱	سوال‌های مفهومی آزمون‌های CFA
۱۳۴	مسائل آزمون‌های CFA
۱۴۱	۳. ارزیابی اختیار معاملات - قسمت اول
۱۸۳	مسائل حل شده آزمون‌های CFA
۱۸۵	سوالات چند گزینه‌ای آزمون‌های CFA
۱۹۰	سوال‌های مفهومی آزمون‌های CFA
۱۹۱	مسائل آزمون‌های CFA
۱۹۷	۴. قراردادهای آتی و اختیار معاملات - قسمت دوم
۳۳۳	مسائل حل شده آزمون‌های CFA
۳۶۷	۵. راهبردهای سوآپ برای مدیریت ریسک
۴۴۱	سوالات و مسائل آزمون CFA سال ۲۰۱۷
۴۶۴	ماخذ و منابع اضافی برای مطالعه‌ی بیشتر