

وادی

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

۱۰۳۸۷۲۲

مدیریت ریسک جامع بنگاه "حل مسائل کاربردی"

www.ketab.ir

نویسنده: شاهین شایان آرائی

نشر جالش

سرشناسه	:	شایان آرانی، شاهین، ۱۳۳۷ -
عنوان و نام پدیدآورنده	:	مدیریت ریسک جامع بنگاه "حل مسائل کاربردی" / نویسنده شاهین شایان آرانی
مشخصات نشر	:	تهران: چالش، ۱۳۹۸.
مشخصات ظاهری	:	۱۹۳ ص.: جدول، نمودار.
شابک	:	۹۷۸-۶۲۲-۶۰۱۷-۳۵-۰
وضعیت فهرست‌نویسی	:	فیا
یادداشت	:	کتابنامه.
موضوع	:	مدیریت ریسک مالی - راهنمای آموزشی (عالی)
موضوع	:	Financial risk management - Study and teaching (Higher)
موضوع	:	مدیریت ریسک مالی - پرسش‌ها و پاسخ‌ها (عالی)
موضوع	:	Financial risk management - Question and answers (Higher)
رده‌بندی کنگره	:	HD۶۱
رده‌بندی دیویی	:	۶۵۸/۱۵۵



www.chalesh.ir

مدیریت ریسک جامع بنگاه

نویسنده: شاهین شایان آرانی

طرح جلد: شاهین شایان آرانی

اجرای طرح جلد: چاووش

امور فنی و صفحه‌آرایی: نشر چالش

لیتوگرافی، چاپ و صحافی: فرشپوه

چاپ دوم: زمستان ۱۴۰۰

شمارگان: ۲۰۰

شابک: ۹۷۸-۶۲۲-۶۰۱۷-۳۵-۰

نشر چالش: تهران، خیابان انقلاب، خ ۱۲ فروردین، خ وحید نظری، شماره ۸۲، طبقه ۵، واحد ۹

تلفن: ۶۶۴۱۴۶۱۰

قیمت: ۱۰۰۰۰۰ تومان

کلیه حقوق مادی و معنوی این اثر برای نویسنده محفوظ است. هرگونه تکثیر و تولید مجلد آن کلاً جزاً به صورت چاپی، کپی، انتشار الکترونیک این اثر بدون اجازه کتبی ناشر ممنوع و موجب پیگرد قانونی است.

فهرست



- پیشگفتار..... ۵
- بخش اول: اصول حاکمیت و راهبری و مدیریت ریسک جامع بنگاه..... ۷
- بخش دوم: کلیات مدیریت ریسک جامع بنگاه..... ۲۹
- بخش سوم: مدل اجرایی مدیریت ریسک جامع بنگاه..... ۵۹
- بخش چهارم: مدل‌های کلاسیک ارزیابی و مدیریت ریسک..... ۱۰۷

www.ketab.ir

پیشگفتار

کتاب حاضر، تجربیات اجرایی نزدیک به ۳۰ سال در حوزه‌های مدیریت، مالی، سرمایه‌گذاری در داخل و خارج از کشور به‌اضافه تدریس به مدت ۸ سال در دانشگاه‌ها و ۲۰ سال برگزاری دوره‌های مدیریت مالی، مهندسی مالی و مالیه اسلامی در داخل و خارج از کشور را به خود اختصاص داده است. سعی گردیده تا در ۱۳۰ مسئله کاربردی طراحی‌شده در چهار بخش، توضیحات لازم ارائه و راه‌حل‌های پیشنهادی با نگرشی کاربردی و واقع‌بینانه نسبت به محیط اجرایی ایران ارائه گردد. فرض بر این است که خوانندگان محترم به‌عنوان پیش‌نیاز با اصول مطرح‌شده در کتاب "مدیریت سرمایه‌گذاری و ریسک، حل مسائل پیشرفته و کاربردی"^۱ و یا مبانی و اصول مدیریت سرمایه‌گذاری پیشرفته در سطح حداقل لیسانس و تئوری‌های ریاضیات مرتبط، آشنایی کامل داشته باشند.

پیش‌شرط آشنایی و استفاده صحیح از این کتاب، شامل موضوعات زیر است:

۱. روش‌های ارزشیابی انواع اوراق بهادار
۲. ریسک اوراق بهادار، نحوه اندازه‌گیری و مدیریت آن
۳. روش‌های ارزشیابی قراردادهای آتی، آبی و اختیار معاملات و کاربرد آن‌ها در اجرای استراتژی‌های مرتبط با ایمن‌سازی ارزش‌ها
۴. اصول مدیریت سبدهای سرمایه‌گذاری در سطح ملی و بین‌المللی

سعی گردیده تا در هر بخش این کتاب، مبانی و توضیحات لازم برای حل مسائل بیان و به ارائه راه‌حل‌های پیشنهادی پرداخته شود. جهت اطلاع خوانندگان، در بخش چهارم این کتاب، مطالب مرتبط با مدل‌های کلاسیک ارزیابی و مدیریت ریسک، اقتباس‌شده از بخش‌های چهارم تا هفتم کتاب "مدیریت سرمایه‌گذاری و ریسک، حل

^۱ شاپان آرانی، شاهین (۱۳۹۷). مدیریت سرمایه‌گذاری و ریسک. "حل مسائل پیشرفته و کاربردی". نوشته شاهین شاپان آرانی. تهران: چاپ نشر جالش.

مسائل پیشرفته و کاربردی"، این نویسنده می‌باشد. برای روشن‌تر نمودن موضوع، در متن تعدادی از مسائل توضیحات اضافی ارائه شده است. بعضی از مسائل در قالب نیاز به بحث‌های گروهی ارائه گردیده و جواب قطعی برای آن‌ها متصور نخواهد بود ولی ارائه جواب منطقی متصور است. باید توجه نمود که بعضی از مسائل مدیریتی دارای یک جواب خاص نمی‌باشند و به‌طور کلی با در نظر گرفتن میانی و تئوری‌های موجود، واقعیت‌های عملیاتی و منطق و اصول علم مدیریت مالی، سرمایه‌گذاری و ریسک، جواب مسئله باید تعیین گردند.

به دلیل اهمیت و نقش مدیریت اجرایی ریسک جامع و مخاطرات در سطح جزعی و کلی، و نیاز شدید به امر آشنایی، آگاهی و آموزش‌های کاربردی، علمی و عملیاتی، اقدام به نگارش این کتاب گردیده است.

این کتاب را به دو فرزند و همسر عزیزم که برکت‌های زندگی و عوامل شادی و امید من می‌باشند هدیه می‌نمایم. لازم است که از کلیه عزیزانی که در کمک به نگارش، چاپ و ویراستاری این کتاب زحمات زیادی کشیدند قدرمندی نمایم. امیدوارم این تلاش موردپذیرش خداوند متعال و پستند مردم عزیز کشورم قرار بگیرد.

شاهین شایان آرانی

۵ تیرماه ۱۳۹۸