

راهنمای شاخص‌ها در بازارهای سرمایه

نویسندگان:

دکتر حسن قالیباف اصل، علی‌عباس کریمی

مهسا جمشیدی ویسمه، سولماز باطبی



انتشارات بورس وابسته به شرکت اطلاع‌رسانی و خدمات بورس
دفتر: تهران، خیابان حافظ، نرسیده به جمهوری، بن‌بست ازهری، شماره ۱۰،
تلفن: ۶۴۰۸۴۰۰۰
نمایشگاه و فروشگاه: تهران، میدان ونک، خیابان ملاصدرا، شماره ۲۵
تلفن: ۸۸۶۴۸۱۹۲، دورنگار: ۶۴۰۸۴۹۲۶
تارنمای انتشارات: www.boursepub.ir
رایانامه: info@boursepub.ir

راهنمای شاخص‌ها در بازارهای سرمایه

- نویسندگان: حسن قالیباف اصل، علی عباس کریمی، مهسا جمشیدی ویسمه، سولماز باطبی
- ناشر: انتشارات بورس وابسته به شرکت اطلاع‌رسانی و خدمات بورس
- طراح جلد: علی ماعت‌او
- چاپ اول: ۱۱۹۹
- قیمت: ۸۵/۰۰۰ تومان
- شمارگان: ۱۰۰۰ نسخه
- چاپ و صحافی: انتشارات جابر
- شابک: ۹۷۸-۶۰۰-۷۸۷۲-۸۵-۷

همه حقوق محفوظ و ملحق به ناشر است.

عنوان و نام پدیدآور: راهنمای شاخص‌ها در بازارهای سرمایه. نویسندگان: قالیباف اصل، علی عباس کریمی، مهسا جمشیدی ویسمه، سولماز باطبی.

مشخصات نشر: تهران: شرکت اطلاع‌رسانی و خدمات بورس، انتشارات بورس، ۱۳۹۸.

مشخصات ظاهری: ۳۰۰ ص.

شابک: 978-600-7872-85-7

وضعیت فهرست‌نویسی: فیا

یادداشت: نویسندگان: حسن قالیباف اصل، علی عباس کریمی، مهسا جمشیدی ویسمه، سولماز باطبی.

موضوع: ۱. سهام — قیمت‌ها — شاخص‌ها / Stock price indexes

موضوع: ۲. سهام — ایران — قیمت‌ها — شاخص‌ها / Stock price indexes -- Iran

موضوع: ۳. بازار سرمایه / Capital market

موضوع: ۴. بورس — ایران ت تهران / Stock exchanges -- Iran -- Tehran

شناسه افزوده: قالیباف اصل، حسن

شرکت اطلاع‌رسانی و خدمات بورس. انتشارات بورس

Company Information Exchange Services. Publication Exchange /

رده‌بندی کنگره: ۱۳۹۸ / ۲ / HG۴۶۳۶

رده‌بندی دیویی: ۳۳۲/۶۳۲۲۲

شماره کتابشناسی ملی: ۵۵۷۵۰۱۵

فهرست مطالب

۱.....	سخن ناشر.....
۳.....	پیش گفتار.....
۵.....	فصل ۱: مفاهیم پایه در طراحی شاخص ها.....
۵.....	مقدمه.....
۵.....	۱. تاریخچه شاخص.....
۷.....	۲. مفهوم شاخص.....
۸.....	۳. کارکردهای شاخص.....
۱۰.....	۴. مشکلات شاخص.....
۱۴.....	۵. محاسبه شاخص.....
۱۷.....	۶. ایجاد شاخص و مدیریت آن.....
۲۲.....	۷. شرکت های ارائه کننده شاخص (شاخص سازها).....
۲۹.....	فصل ۲: ترکیب سبد شاخص ها.....
۲۹.....	مقدمه.....
۳۱.....	۱. شاخص های سهام.....
۷۴.....	۲. شاخص های اوراق قرضه.....
۸۴.....	۳. شاخص های کالایی.....
۸۸.....	۴. شاخص های استراتژی.....
۱۳۰.....	۵. شاخص های نرخ ارز.....
۱۳۳.....	۶. شاخص های املاک و مستغلات.....
۱۴۰.....	۷. سایر شاخص ها.....

فصل ۳: متدولوژی شاخص‌ها.....	۱۴۹
مقدمه.....	۱۴۹
۱. از لحاظ وزن‌دهی.....	۱۵۱
۲. از لحاظ عوامل کلی یا بنیادی.....	۲۰۵
۳. از لحاظ کاربرد استراتژی.....	۲۰۷
۴. از لحاظ در نظر گرفتن سود.....	۲۱۶
۵. از لحاظ در نظر گرفتن ریسک.....	۲۱۹
۶. از لحاظ در نظر گرفتن نرخ ارز.....	۲۴۰
فصل ۴: شاخص‌های مهم بازارهای مختلف.....	۲۵۳
مقدمه.....	۲۵۳
۱. شاخص‌های بین‌المللی.....	۲۵۳
۲. بازارهای آمریکا.....	۲۵۴
۳. بازارهای آفریقا.....	۲۵۸
۴. بازارهای آسیا و اقیانوسیه.....	۲۶۰
۵. بازارهای اروپا.....	۲۷۸
فصل ۵: شاخص‌های بازار سرمایه ایران.....	۲۸۹
واژه‌نامه.....	۳۰۵
منابع.....	۳۰۵

سخن ناشر

«طولانی‌ترین راه‌ها با نخستین گام‌ها آغاز می‌شوند»؛ گرچه این سخن درست است، اما در تولید محتوای علمی و انتقال دانش، کسی نخستین گام‌ها را به خاطر ندارد و همچنین در این راه، به درستی نمی‌توان از نقطه آغاز سفر سخن گفت و خط سیر و منزلگاه‌های آن را با نشانه‌هایی معین نمایان ساخت. براین اساس، در حال حاضر نکته شایان توجه یافتن راهکارها و کنش گرانی است که با تولید، نشر و انتقال یافته‌ها و تجربیات افراد صاحب‌نظر، گامی هرچند کوچک، در راستای گسترش و به اشتراک گذاشتن دانش و آگاهی در قالب یک محصول فرهنگی دارند.

با گسترش بازارهای مالی و به توجّه به نیاز روزافزون طیف وسیعی از دانشجویان و پژوهشگران رشته‌های مختلف از جمله علم اقتصاد، مدیران، مشاوران سرمایه‌گذاری، سرمایه‌گذاران و نیز علاقمندان به موضوعات بازار سرمایه و همچنین فراگیر شدن این بازار در میان آحاد جامعه، اهمیت سرمایه‌گذاری و تخصصی در حوزه بازارهای مالی بیش از پیش اهمیت یافته است. در این راستا، انتشارات بورس با هدف انتشار فرهنگ سرمایه‌گذاری در دارایی‌های مالی، توسط شرکت اطلاع‌رسانی و خدمات بورس تاسیس شد. این انتشارات در شهریور ۱۳۹۰ مجوز خود را از وزارت فرهنگ و ارشاد اسلامی دریافت کرد و با برداشتن نخستین گام‌های خود و انتشار کتاب‌های حوزه مالی با تأکید بر مباحث بازار سرمایه وارد عرصه تولید و نشر دانش و آگاهی شد.

انتشارات بورس «مرجعیت در انتشار کتاب‌های مالی در سطح کشور و نتایج» را چشم‌انداز خود قرار داده است؛ و براساس نشست‌های متعدد کارشناسی، انتشار کتاب با محوریت‌های حقوق بازار سرمایه، فناوری اطلاعات در بازار سرمایه، مالی اسلامی و مالی عمومی را در اولویت نخست خود قرار داده است و پس‌دین کتاب را نیز با محوریت‌های حسابداری و حسابرسی در بازار سرمایه، اقتصاد مالی و همچنین موضوعات بین‌رشته‌ای مرتبط با بازار سرمایه را به عنوان اولویت بعدی خود، روانه بازار کرده است.

انتشارات بورس، افزون بر چاپ و نشر کتاب‌هایی که از سوی سازمان بورس و اوراق بهادار، پژوهشگران، نگارندگان و برگرداندگان معرفی می‌شوند، اقدام به نشر بولتن‌ها، فصلنامه‌های سازمان بورس و نیز محصولات نرم‌افزاری همچون دی‌وی‌دی حاوی متن کتاب، کتاب‌گویا و فلش کارت نیز کرده است. از جمله دیگر اقدامات این انتشارات، می‌توان به مجموعه «کندو» اشاره کرد؛ مجموعه کندو با رویکرد آموزش، فرهنگ‌سازی و ارتقای سطح سواد و هوش مالی گروه کودک و نوجوان ایجاد شده است.

انتشارات بورس در مدت زمان فعالیت کوتاه خود، موفق به انتشار بیش از ۱۵۰ عنوان شده است. این آثار به زبان فارسی و انگلیسی در حوزه‌های مرجع، تخصصی-دانشگاهی، عمومی و کودک در زمینه دستاوردهای روز بازار سرمایه در ایران و

جهان و همچنین آموزش‌های عمومی و تخصصی در حوزه بازار سرمایه مشتمل بر کتب دانشگاهی در حوزه بازار سرمایه، کتب آموزشی با هدف پاسخگویی به نیاز عموم جامعه و انتشار برخی از منابع آزمون‌های بازار سرمایه است.

www.ketab.ir