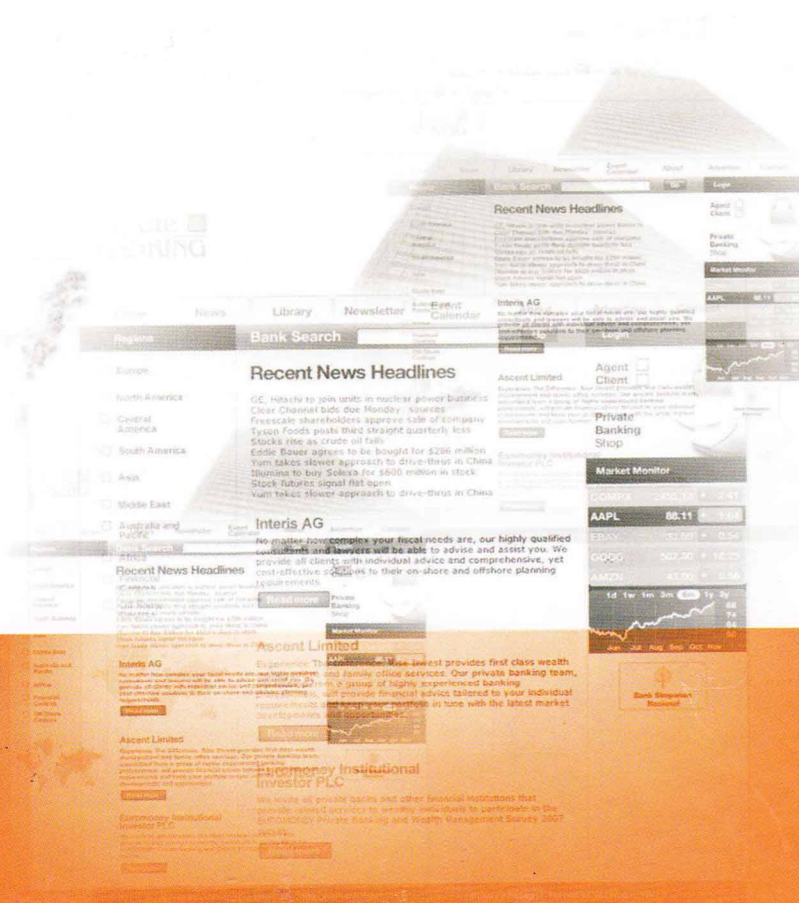


إدارة المخاطر المالية



الدكتور

خالد وهيب الراوي



مختصر المحتويات Brief Contents

5	 المقدمة
7	 الفصل الأول : طبيعة إدارة المخاطر
65	 الفصل الثاني : أنواع الاسواق المالية والمستثمرين
105	 الفصل الثالث : أنواع الاستثمار
177	 الفصل الرابع : نظرية المحفظة الاستثمارية
239	 الفصل الخامس : نظرية السوق الكفاءة
297	 الفصل السادس : المستقبلات المالية
374	 الفصل السابع : مراقبة الأداء
432	 الفصل الثامن : طريقة إدارة الاستثمار

جدول المحتويات التفصيلي Contents

7	الفصل الأول : طبيعة إدارة المخاطر
7	المقدمة
9	معنى إدارة الخطر
10	الاستجابة للخطر
12	أهداف إدارة الخطر
13	تحديد الخطر
17	تحليل الخطر
18	السيطرة على الخطر
23	مدير المخاطر
24	فلسفة إدارة المخاطر
25	قائمة إدارة المخاطر
26	الدليل الخاص بإدارة المخاطر
30	موقع وهيكل قسم إدارة المخاطر
34	جمع البيانات
35	طرق جمع البيانات
36	تمثيل البيانات
43	قياس البيانات
62	أسئلة محلولة
63	الخلاصة
63	أسئلة الفصل الأول
64	مصادر الفصل الأول

65	 الفصل الثاني : أنواع الأسواق المالية والمستثمرين
65	 المقدمة
67	 أنواع المستثمرين في الأوراق المالية
69	 أنواع أسواق الأوراق المالية
73	 أنواع الأوراق المالية المتداولة
75	 العقود المستقبلية
82	 فرص المضاربة
84	 أسواق الأوراق المالية المسعرة بكفاءة
86	 منافع السوق الأولية
90	 منافع الإدارة المحترفة للأوراق المالية
92	 إدارة الاستثمار في التسعينات
96	 أمثلة محلولة
101	 الخلاصة
103	 أسئلة الفصل الثاني
104	 مصادر الفصل الثاني
105	 الفصل الثالث : أنواع الاستثمار
105	 المقدمة
106	 الأوراق المالية لسوق المال
108	 سندات الخزنة الأميركية
114	 الأوراق التجارية
118	 اليورو دولار
119	 أسواق رأس المال ذات الدخل الثابت
122	 إصدارات الخزنة الأميركية
124	 ستربس
125	 الإلتزامات الحكومية

129	إصدارات المنشآت
138	أوراق مالية الملكية
142	الملكية الدولية
145	المحافظ الاستثمارية المختلطة
148	مصادر عوائد صناديق الاستثمار المشتركة
156	الأوراق المالية المشتقة
160	المقايضة
162	أمثلة محلولة
169	الخلاصة
171	أسئلة الفصل الثالث
175	مصادر الفصل الثالث
177	الفصل الرابع : نظرية المحفظة الاستثمارية
177	المقدمة
178	أبعاد مخاطر الاستثمار
182	المخرجات غير المؤكدة والعوائد المتوقعة
185	قياس خطر المحفظة الاستثمارية
192	التنوع الساذج
193	الخطر المتناسق وغير المتناسق
194	متى ولماذا يقلل التنوع الخطر
201	خطر المحفظة الاستثمارية الأدنى
205	التنوع الكفوء
206	نموذج ماركوثز
213	تأثيرات العائد الخالي من الخطر
217	نظرية انفصال المحفظة الاستثمارية
219	قياس خطر الورقة المالية

222	أمثلة محلولة
233	الخلاصة
235	أسئلة الفصل الرابع
238	مصادر الفصل الرابع
239	الفصل الخامس : نظرية السوق الكفاءة
239	المقدمة
241	ثلاثة مداخل لاختبار الأوراق المالية
249	مفهوم السوق الكفاءة
254	تطبيقات تجريبية
255	نماذج نظرية السوق الكفاءة وتسعير الأصول
258	اختبارات المشي العشوائي
260	اختبارات مرشح قاعدة التداول
268	نماذج العائد
272	نتيجة الدراسات
282	دراسات أخرى
286	مدراء المحفظة الاستثمارية
288	الاستراتيجية في سوق كفاءة
289	مثال محلول
291	الخلاصة
293	أسئلة الفصل الخامس
296	مصادر الفصل الخامس
297	الفصل السادس : المستقبلات المالية
297	المقدمة
300	مبادئ العقود المستقبلية

301	المؤجلات والمستقبلات
306	دافع الحماية لتداول المستقبلات
310	مبادئ تسعير المستقبلات
314	التعريف الاقتصادي لعقد المستقبلات
317	الاختلافات في المستقبلات والآجلة
320	التغطية التامة مقابل غير التامة
321	التغطية المثلى عندما تكون النقطة التامة مستحيلة
322	مستقبلات الدين القصيرة الأجل
323	مستقبلات سندات الخزينة
326	أساس التغطية الطويلة
329	المضاربة
330	الارbitراج
332	عقود ودائع اليورودولار
333	مستقبلات سندات الخزينة الاميركية
335	الاستعمال المحتمل في إدارة المحفظة
338	مستقبلات مؤشر الملكية
341	إستراتيجيات التغطية
342	تعديل بيتا المحفظة الاستثمارية
345	إنشاء مؤشر المحفظة الاستثمارية
353	مستقبلات العملة
358	أمثلة محلولة
368	الخلاصة
369	أسئلة الفصل السادس
372	مصادر الفصل السادس
374	الفصل السابع : مراقبة الأداء

374	 المقدمة
376	 إنجاز (AIMR) في تقديم المعايير
379	 احتساب عوائد المحفظة الاستثمارية
380	 المحفظة بدون تدفقات نقدية
381	 المحفظة بتدفقات نقدية
386	 محاسبة تاريخ التسوية مقابل التداول
387	 تقرير مكونات محفظة عوائد الوقت المرجح
390	 مراقبة أداء الملكية
395	 مؤشر إنجاز شارب
396	 مؤشر إنجاز ترينور
398	 مؤشر أداء جنسن
401	 معنوية الفا الاحصائية
402	 الصعوبات في إيجاد المغزى الاحصائي
404	 مشاكل مقاييس أداء نموذج تسعير الأصول الرأسمالية
410	 تقديرات معدل التوقيت والاختبار
413	 مساهمة الانجاز
416	 شواهد تجريبية للتوقيت والاختيار
420	 أمثلة محلولة
427	 الخلاصة
428	 أسئلة الفصل السابع
431	 مصادر الفصل السابع
432	 الفصل الثامن : طريقة إدارة الاستثمار
432	 المقدمة
434	 طريقة استثمار المحفظة
443	 استراتيجية تخصيص الأصول

444	إعادة الموازنة السلبية
445	استراتيجية المضاربة
448	قائمة السياسة الاستثمارية
451	المحددات
454	أنواع المحافظ الاستثمارية واحتياجاتها
457	دورة حياة الاستثمار
461	صناديق الاعانات
463	تمويل خطة المنافع المحددة
467	الاعتبارات في تحديد الاهداف والقيود
469	خطط المساهمة المحددة
470	حالة عملية
474	الخلاصة
475	أسئلة الفصل الثامن
480	مصادر الفصل الثامن