**دانشکدۀ مدیریت دانشگاه تهران رشته: مالی؛ مقطع: دکترا سال تحصیلی 91-90**

**ریزدرس مدیریت ریسک**

جلسۀ اول:

* ابزار، نهاد و بازارهای مالی
* کتاب: شمارۀ: / Chapter1: Introduction and Overview of Financial Markets
* کتاب: شمارۀ / Chapter 1: Financial Markets and Their Products; Chapter 2: Secondary Markets
* اسلاید: ابزار، نهاد و بازاهای مالی با رویکرد معرفی ریسک‌*‌*ها ] اسلایدهای آموزشی/مالی شرکت‌ها[ (در دست تدوین)
* سایت: http://www.bis.org/bcbs/

جلسۀ دوم:

* بازار جهانی ارز
* کتاب: شمارۀ ‏15/ مقالة بازار جهاني ارز و كاركردهاي آن
* کتاب: شمارۀ / Chapter 9: Foreign Exchange Markets
* کتاب: شمارۀ 12 Chapter 10: Foreign Exchange
* اسلايد: بازار ارز و كاركردهاي آن ] اسلایدهای آموزشی/ بازارها و نهادهای مالی[ (در دست تدوین)
* اسلاید: قیمت‌گذاری نادرست ارز در ایران ] اسلایدهای آموزشی/ بازارها و نهادهای مالی[
* سایت: http://www. forexfactory.com

جلسۀ سوم:

* نمای واقعی ریسک: بحران‌های جهانی
* اسلاید: بحران مالی بین‌المللی و ریشه‌های آن ] اسلایدهای آموزشی/ بازارها و نهادهای مالی[
* اسلاید: بحران وام‌های شک‌دار ] اسلایدهای آموزشی/ بازارها و نهادهای مالی[
* اسلاید: بحران منطقۀ یورو ] اسلایدهای آموزشی/ بازارها و نهادهای مالی[ (در دست تدوین)

جلسۀ چهارم:

* کلیات ریسک
* کتاب: شمارۀ 13 / فصل اول: کلیات ریسک
* اسلاید: ریسک ] اسلایدهای آموزشی/ مهندسی مالی و مدیریت ریسک[

جلسۀ پنجم:

* [مدل‌سازی](#_Toc238720274) ریسک‌های مالی: مفاهیم و مقدمات
* کتاب: شمارۀ 1/ Chapter 1: Value -at-Risk
* کتاب شمارۀ 3/ Chapter 1: Probability
* کتاب: شمارۀ 13/ فصل اول: کلیات ریسک، فصل ششم: نظریۀ ارزش فرین
* کتاب: شمارۀ 14 / کل کتاب
* اسلاید: مفاهیم و مقدمات مدل‌سازی ریسک ] اسلایدهای آموزشی/ مهندسی مالی و مدیریت ریسک [ ( در دست تدوین)
* اسلاید: توزیع احتمال ] اسلایدهای آموزشی/ مهندسی مالی و مدیریت ریسک [ ( در دست تدوین)

جلسۀ ششم:

* [مدل‌سازی ریسک](#_Toc238720331): توسعۀ مدل‌ها ، برآورد پارامترها
* کتاب: شمارۀ 1/ Chapter 4: Statistics and Time Series Analysis
* کتاب: شمارۀ 2/ Toolkit: Tool No. 7: Forecasting Volatilities, Covariances and Correlations
* کتاب: شمارۀ 13/ فصل چهارم: مدل‌سازی ریسک
* اسلاید: مدل‌های بازده و ریسک ] اسلایدهای آموزشی/ مهندسی مالی و مدیریت ریسک [ ( در دست تدوین)

جلسۀ هفتم:

* شبیه‌سازی مونت‌کارلو
* کتاب شمارۀ 5/ Chapters 2: Some Basic Theories of Finance, Chapter 3: Basic Monte Carlo Methods
* کتاب: شمارۀ 13/ فصل نهم: شبیه‌سازی مونت‌کارلو
* اسلاید: شبیه‌سازی مونت‌کارلو ] اسلایدهای آموزشی/ مهندسی مالی و مدیریت ریسک [

جلسۀ هشتم:

* مدل‌سازی ریسک: کار با نرم‌افزار
* کتاب شمارۀ 4/- Linear Models, Chapter5: Univariate Time Series - Volatility Models Chapters 3: Univariate Time Series
* اسلاید: مدل‌سازی ریسک در Matlab و Eviews ] اسلایدهای آموزشی/ مهندسی مالی و مدیریت ریسک [ (در دست تدوین)

جلسۀ نهم:

* ریسک بازار
* کتاب شمارۀ 13/ فصل پنجم: رویکردهای پارامتریک
* اسلاید: ریسک بازار ] اسلایدهای آموزشی/ مهندسی مالی و مدیریت ریسک [

جلسۀ دهم:

* ریسک اعتباری: مفاهیم و مقدمات
* کتاب شمارۀ 6/ Chapter 1: Revolution in Credit- Capital Is Key
* کتاب شمارۀ 7/ Chapter 5: Modeling Credit Risk
* کتاب: شمارۀ8/ Chapter 1: Estimating Credit Scores with Logit
* اسلاید: ریسک اعتباری ] اسلایدهای آموزشی/ مهندسی مالی و مدیریت ریسک [

جلسۀ یازدهم:

* ریسک اعتباری: مدل‌ها
* اسلاید: رویکردهای کمیتۀ بازل در مدل‌سازی ریسک اعتباری ] اسلایدهای آموزشی/ مهندسی مالی و مدیریت ریسک [ (در دست تدوین)
* اسلاید: مدل CR+ ] اسلایدهای آموزشی/ مهندسی مالی و مدیریت ریسک [

جلسۀ دوازدهم:

* ریسک نقدینگی و نرخ بهره
* اسلاید: مدیریت دارایی-بدهی ] اسلایدهای آموزشی/ مهندسی مالی و مدیریت ریسک [ (در دست تدوین)
* اسلاید: هزینۀ وجوه بانک ] سمینارها و کنفرانس‌ها[

جلسۀ سیزدهم:

* [ریسک](#_Toc238720380) عملیاتی
* کتاب: شمارۀ 9 / Part I: Database Modeling
* اسلاید: ریسک عملیاتی ] اسلایدهای آموزشی/ مهندسی مالی و مدیریت ریسک [

جلسۀ چهاردهم

* پوشش ریسک
* اسلاید: مشتقه‌های اعتباری و کارکرد آن‌ها در پوشش ریسک (در دست تدوین)
* اسلاید: محصولات بازار جهانی ارز (در دست تدوین)

جلسۀ پانزدهم:

* [پس‌آزمایی](#_Toc238720492) مدل‌ها
* کتاب: شمارۀ 13/ فصل یازدهم: پس‌آزمایی ارزش در معرض ریسک
* اسلاید: پس‌آزمایی ] اسلایدهای آموزشی/ مهندسی مالی و مدیریت ریسک [

جلسه شانزدهم:

* خلاصه و جمع‌بندي از نشست‌ها
1. Holton, G. A. (2004), *Value-at-Risk: Theory and Practice*, Academic Press.
2. Dowd, K (2005), *Measuring Market Risk*, John Wiley & Sons Ltd, Second Edition.
3. Ross, SH, M., *An Elementary Introduction to Mathematical Finance*.
4. Kozhan, R., *Financial Econometrics with Eviews*.
5. Sak, Halis., *Monte Carlo Simulation and Finance.*
6. Smithson, CH., *Credit Portfolio Management.*
7. Ramaswamy, S., *Managing Credit Risk in Corporate Bond Portfolios*.
8. Loffler, G., Posch, P.N., *Credit Risk Modeling Using Excel and VBA*.
9. Cruz, M. G., *Modeling, Measuring and Hedging Operational Risk*.
10. Fabbozi, F., Ferri, M. and Modigliani, F. *Foundations of Financial Market & Institutions*
11. Saunders, A., Cornett, M., *Financial Markets and Institutions: a modern perspective*.
12. McInish, T. H., Capital Markets: *A Global Perspective*
13. اندازه‌گیری و مدیریت ریسک بازار/ حسین عبده تبریزی و میثم رادپور
14. آمار و کاربرد آن در مدیریت/ عادل آذر و منصور مؤمنی/ جلد اول
15. مجموعۀ مقالات مالی و سرمایه‌گذاری جلد 3/ حسین عبده تبریزی و میثم رادپور ( در دست انتشار)