



به نام ایزودانا

دانشکده ریاضی، آمار و علوم کامپیوتر

نیمسال دوم سال تحصیلی ۹۸/۹۷

نام درس		فارسی: ارزیابی و مدیریت ریسک	تعداد واحد: نظری ۳	مقطع: کارشناسی □ کارشناسی ارشد ● دکتری □
مدرس/مدرسین: دکتر علیرضا بحیرایی		پیش نیازها و هم نیازها:		
پست الکترونیکی: alireza.bahiraie@yahoo.com		شماره تلفن اتاق:		
منزلگاه اینترنتی:				
برنامه تدریس در هفته و شماره کلاس: شنبه ۱۰-۱۲ و یکشنبه ۱۴-۱۵				
اهداف درس: هدف از این درس آشنایی دانشجویان با انواع ریسک و سنجه های آن آشنا می شوند و تفاوت انواع مختلف ریسک را از نظر داده ها و انواع اندازه گیری و توزیع ضرر ناشی از آن می بینند.				
امکانات آموزشی مورد نیاز: ویدیو پروژکتور				
نحوه ارزشیابی	فعالیت های کلاسی و آموزشی	ارزشیابی مستمر (کوئیز)	امتحان میان ترم	امتحان پایان ترم
درصد نمره	۲	--	۸	۱۲
منابع و مآخذ درس		<ul style="list-style-type: none"> - Hull John, risk management and financial institution, prentice hall, ۲۰۱۲ - Elton, Gruber: Modern portfolio theory and investment analysis. New York, ۱۹۹۵ - علیرضا بحیرایی، مدیریت ریسک در ایران، انتشارات دانشگاه شهید بهشتی، ۱۳۹۸ - راعی، مهندسی مالی و مدیریت ریسک، انتشارات دانشگاه تهران ۱۳۹۰ - علیرضا بحیرایی، مدیریت ثروت، مدیریت ریسک اختصاصی، انتشارات آگاه، ۱۳۹۷ 		

بودجه بندی درس

شماره هفته آموزشی	مبحث	توضیحات
۱	ماهیت ریسک، ریسک ذاتی، سبد مالی، تنوع بازارها و صنایع،	
۲	ریسک ذاتی، توابع مولد، فرآیند مدیریت ریسک	
۳	ریسک نرخ بهره، ریسک زمانی، تلاطم، پرش، نوسان،	
۴	ارزش در معرض ریسک، SML, CML	
۵	همبستگی های ریسک، کاپیولا،	
۶	پیمانهای بازل / کوزو	
۷	رویکرد شبیه سازی، مدلسازی، مدل های تک دوره ای و چند دوره ای	
۸	ریسک و احتمال، تحلیل سناریو، محاسبه مرز های کارآمد	
۹	آزمون استرس، مدلها و روشها ریاضی	
۱۰	ریسک عملیاتی، ریسک نقدینگی، ریسک اعتباری، ریسک بازار	
۱۱	مدل های مالی کارا، مدل های تعادل در صنایع مختلف	
۱۲	آربیتراژ، مدل قیمت دارایی و مدل قیمت گذاری آربیتراژ	
۱۳	ساختار همبستگی، مدل های ریاضی همبستگی ایستا و پویا	
۱۴	مدلسازی ریاضی ریسک، مدل های تک دوره ای و چند دوره ای، ERM	
۱۵	مدل های ریاضی و روشها، محاسبه مرز های کارآمد	
۱۶	مدل های رتبه بندی در ایران و خارج از کشور	