

فهرست مطالب

فصل اول: ریسک (RISK).....	۱۳
بخش ۱: مفاهیم (Concepts).....	۱۴
ریسک Risk.....	۱۵
ریسک در مفاهیم مالی.....	۱۵
تفاوت ریسک و خطر.....	۱۶
اهمیت ریسک.....	۱۶
ریسک و بازده.....	۱۶
بخش ۲: شناخت ریسک (Recognition Risk).....	۱۹
اهمیت شناخت ریسک.....	۲۰
انواع ریسک.....	۲۱
ریسک سیستماتیک و غیرسیستماتیک.....	۲۳
ریسک‌های اقتصاد کلان Macroeconomic Risks.....	۳۰
ریسک‌های بازار Market Risks.....	۳۴
سایر ریسک‌های مهم در بازارهای مالی.....	۳۸
بخش ۳: ارزیابی ریسک (Risk Evaluation).....	۴۸
معیارهای ارزیابی ریسک.....	۴۹
۱- ضریب آلفا Alpha Coefficient.....	۵۰
۲- ضریب بتا Coefficient Beta.....	۵۲
۳- ضریب تعیین یا معیار R-Squared.....	۵۴
۴- انحراف معیار Standard Deviation.....	۵۶
۵- نسبت شارپ Sharp Ratio.....	۵۷
۶- مدل قیمت‌گذاری دارایی‌های سرمایه‌ای (CAPM) Capital Asset Pricing Model.....	۵۹
مفروضات مدل قیمت‌گذاری دارایی‌های سرمایه‌ای CAPM.....	۶۱
انواع مدل‌های قیمت‌گذاری دارایی‌های سرمایه‌ای.....	۶۳
محاسبه ارزش در معرض خطر.....	۶۶
بخش ۴: مدیریت و کاهش ریسک (Risk Management and Mitigation).....	۶۸
استراتژی‌ها و ابزارهای مدیریت و کاهش ریسک.....	۶۹
الف- تنوع‌بخشی Diversification.....	۷۰
ب- مدیریت فعال Active Management یا غیرفعال Passive دارایی‌ها.....	۷۰
ج- سرمایه‌گذاری در دارایی‌های با ریسک کمتر.....	۷۱
د- پوشش ریسک Hedging.....	۷۱
بخش ۵: ریسک‌پذیری (Risk Taking).....	۷۳
ریسک‌پذیری Risk Taking.....	۷۴
دسته‌بندی سرمایه‌گذاران براساس ریسک‌پذیری.....	۷۴

۷۵	عوامل مؤثر بر ریسک پذیری
۷۵	کنترل ریسک یا بازدهی
۷۷	بخش ۶: ریسک بازارهای مالی (بورس ایران، فارکس و ارز دیجیتال) (Financial Market Risk)
۷۸	ریسک بازارهای مالی Financial Market Risk
۷۸	الف- ریسک‌های ناشی از ماهیت بازار
۷۸	الف-۱- ریسک‌های مهم در بازار بورس ایران
۷۹	الف-۲- ریسک‌های مهم در بازار فارکس
۸۰	الف-۳- ریسک‌های مهم در بازار ارزهای دیجیتال
۸۷	نکات مهم جهت حفظ امنیت در بازار رمزارزها
۸۸	ب- ریسک‌های ناشی از عملکرد
۹۳	سخن پایانی
۹۵	فصل دوم: مدیریت سرمایه (Capital Management)
۹۶	بخش ۱: مفاهیم (Concepts)
۹۷	هدف از مدیریت سرمایه
۹۸	عوامل مؤثر در مدیریت سرمایه
۱۰۰	جایگاه مدیریت سرمایه
۱۰۱	بخش ۲: مراحل مدیریت سرمایه (Steps Of Capital Management)
۱۰۲	مراحل مدیریت سرمایه
۱۰۲	الف- اولویت‌بندی فرصت‌ها
۱۰۳	ب- کنترل میزان سرمایه در معرض ریسک
۱۰۳	ج- تخصیص سرمایه و ریسک
۱۰۴	د- ارزیابی زیان قابل قبول برای هر معامله
۱۰۴	هـ- تصمیم‌گیری در مورد تعداد معاملات باز
۱۰۵	و- تعادل در معامله‌گری
۱۰۵	ز- ارزیابی پیش از معامله
۱۰۵	ح- ارزیابی و پایش مستمر
۱۰۶	بخش ۳: شاخص‌های کلیدی عملکرد (Key Performance Indicators)
۱۰۷	نرخ موفقیت یا نرخ برد Win Rate (WR)
۱۱۲	سود Profit
۱۱۴	نسبت بازدهی Risk/Reward Ratio (R.R)
۱۱۶	محاسبه نسبت بازدهی Risk.Reward
۱۲۰	رابطه بین نرخ برد و نسبت بازدهی
۱۲۳	شاخص سودآوری Profit Factor (PF)
۱۲۵	افت سرمایه Draw Down or Max Draw Down (MDD)
۱۳۰	عوامل مؤثر بر افت سرمایه
۱۳۳	آستانه تحمل ضرر یا حداکثر افت سرمایه شخصی (MDD) _p
۱۳۴	زمان بهبود Recovery Time

۱۳۵.....	Leverage Asymmetrical (AL) اهرم نامتقارن
۱۳۶.....	Consecutive Losses (CL) تعداد ضررهای متوالی
۱۳۷.....	Risk Per Trade (RPT) ریسک هر معامله
۱۳۸.....	(ME) Mathematical Expectation شاخص امیدریاضی
۱۴۲.....	Ruin ورشکستگی
۱۴۴.....	Risk of Ruin (ROR) ریسک ورشکستگی
۱۴۹.....	بخش ۴: افزایش بازدهی معاملات (Increase The Efficiency Of Transactions)
۱۵۰.....	افزایش بازدهی معاملات
۱۵۰.....	الف- تکنیک‌های مبتنی بر کاهش ریسک
۱۵۰.....	۱- ورود پلکانی
۱۵۶.....	۲- کاهش ریسک معامله
۱۵۸.....	۳- تنوع‌بخشی Diversification
۱۶۱.....	همبستگی سهام Correlation
۱۶۴.....	همافزایی Aggregation
۱۶۵.....	معامله‌گر همافزا و معامله‌گر اسپردی
۱۶۵.....	تنوع‌بخشی برای حرفه‌ایها
۱۶۶.....	تنوع‌بخشی در بازار بورس ایران
۱۷۰.....	۴- ابزارهای مشتقه و کاهش ریسک Derivative
۱۷۲.....	ب- تکنیک‌های مبتنی بر تعدیل سود معامله
۱۷۲.....	۱- ذخیره کردن بخشی از سود معامله Partial Exit
۱۷۳.....	۲- تعدیل سود معامله
۱۷۵.....	بخش ۵: انتخاب نماد (Symbol Selection)
۱۷۶.....	ریسک فرصت هزینه Opportunity Cost Risk
۱۷۸.....	فرصت‌های مانع الجمع Mutually Exclusive
۱۷۸.....	فرآیند انتخاب نماد
۱۸۰.....	شاخص نسبت بازده تعدیل شده
۱۸۲.....	ارزش بازار و ویژگی‌های بنیادی نماد
۱۸۴.....	انواع نسبت‌های مالی و سودآوری
۱۸۷.....	شرایط تکنیکالی نماد
۱۸۹.....	تمرکز بر یک نماد
۱۹۰.....	بخش ۶: حجم معامله (Position Sizing)
۱۹۱.....	حجم معامله Position Sizing
۱۹۲.....	سرمایه‌گذاری Investing یا معامله‌گری Trading
۱۹۳.....	سرمایه‌گذاری Investing
۱۹۴.....	معامله‌گری Trading
۱۹۶.....	محاسبه حجم مجاز معامله
۱۹۶.....	الف- محاسبه حجم، با رویکرد معامله‌گری
۱۹۶.....	۱- محاسبه حجم مجاز معامله در بازار فارکس

۲۰۰.....	۲- محاسبه حجم مجاز معامله در بازار بورس ایران
۲۰۴.....	۳- محاسبه حجم در بازار ارزهای دیجیتال
۲۰۶.....	ب- محاسبه حجم، بارویکرد سرمایه‌گذاری
۲۰۶.....	سرمایه ریسک
۲۰۶.....	محاسبه حجم براساس مقدار مساوی سرمایه <i>Fixed Percentage</i>
۲۰۷.....	محاسبه حجم براساس تخصیص ریسک برابر
۲۰۷.....	محاسبه حجم براساس احتمال موفقیت یا کسر ثابت
۲۰۹.....	محاسبه حجم براساس احتمال موفقیت و نسبت بازده <i>Kelly Criterion</i>
۲۱۰.....	محاسبه حجم براساس رویکرد اصلاح شده کلی <i>Kelly</i>
۲۱۲.....	محاسبه حجم براساس رابطه تجربی امید ریاضی
۲۱۵.....	محاسبه حجم براساس معیار نقدشوندگی
۲۱۵.....	جمع بندی
۲۱۹.....	نتیجه‌گیری
۲۲۰.....	بخش ۷: استراتژی‌های ورود و خروج پله‌ای (<i>Staggered Entry and Exit Strategies</i>)
۲۲۱.....	ورود و خروج پله‌ای
۲۲۴.....	الف- ورود پله‌ای
۲۲۵.....	ب- خروج پله‌ای
۲۲۵.....	استراتژی کم کردن میانگین <i>Averaging Down</i>
۲۲۸.....	ملاحظات استراتژی میانگین کم کردن
۲۲۹.....	استراتژی مارتینگل <i>Martingale</i>
۲۳۴.....	مارتینگل معکوس یا پارولی (<i>Paroli</i>) <i>Reverse Martingale</i>
۲۳۷.....	استراتژی میانگین هزینه دلاری <i>(DCA) Dollar Cost Averaging</i>
۲۴۲.....	استراتژی کم ریسک <i>Low-Risk Strategy</i>
۲۴۵.....	فصل سوم: استراتژی سرمایه‌گذاری (<i>Investment Strategy</i>)
۲۴۶.....	بخش ۱: مفاهیم (<i>Concepts</i>)
۲۴۷.....	استراتژی‌های مبتنی بر ریسک‌پذیری
۲۴۹.....	بخش ۲: سرمایه‌گذاری محافظه‌کارانه (<i>Conservative Investment Strategy</i>)
۲۵۰.....	آشنایی با استراتژی محتاطانه
۲۵۱.....	دارایی‌های تدافعی <i>Risk-Off</i>
۲۵۱.....	الف- دارایی‌های با درآمد ثابت <i>Fixed Income Securities</i>
۲۶۰.....	ب- سهام با ثبات و با ارزش <i>Blue-Chip Stocks</i>
۲۶۱.....	ج- دارایی‌های شناخته شده <i>Known Assets</i>
۲۶۲.....	د- صندوق‌های شاخصی <i>Index Funds</i>
۲۶۴.....	ه- کالاهای اساسی
۲۶۵.....	و- املاک و مستغلات
۲۶۷.....	دوره‌های رکود و رونق در بازار املاک و مستغلات ایران
۲۷۰.....	سرمایه‌گذاری محتاطانه و بازار ارزهای دیجیتال

۲۷۱.....	دلایل محافظه کاری
۲۷۷.....	بخش ۳: سرمایه گذاری تهاجمی (Aggressive Investment Strategy)
۲۷۸.....	آشنایی با استراتژی تهاجمی
۲۷۹.....	دارایی تهاجمی Risk-On
۲۷۹.....	۱- سهام شرکت ها Stocks
۲۸۲.....	۲- صندوق های سرمایه گذاری مشترک Stock Mutual Funds
۲۸۳.....	۳- صندوق های سرمایه گذاری اهرمی Leveraged Funds
۲۸۹.....	۴- کالاهای اساسی (طلا) Commodities
۲۹۲.....	۵- صندوق سرمایه گذاری در طلا
۲۹۵.....	۶- بازارهای نوظهور Emerging Markets
۲۹۶.....	۷- قراردادهای اختیار معامله Options و آتی Futures
۳۰۱.....	۸- ارزهای دیجیتال Cryptocurrencies
۳۰۴.....	۹- صندوق پوشش ریسک Hedge Fund
۳۰۹.....	جمع بندی
۳۱۱.....	بخش ۴: سرمایه گذاری پوششی (Hedging Investment Strategy)
۳۱۲.....	آشنایی با سرمایه گذاری پوششی
۳۱۳.....	مفهوم پوشش ریسک در مباحث مالی
۳۱۴.....	مزایا و معایب استراتژی های پوششی
۳۱۵.....	ابزارهای پوشش ریسک مالی
۳۱۷.....	انواع استراتژی های پوشش ریسک
۳۲۶.....	پوشش ریسک در بازار بورس ایران
۳۲۷.....	پوشش ریسک در بازار ارزهای دیجیتال
۳۳۱.....	بخش ۵: استراتژی های هوشمند (Smart Investment Strategy)
۳۳۲.....	آشنایی با استراتژی های هوشمند
۳۳۲.....	توصیه هایی برای اجرای استراتژی های هوشمند
۳۳۵.....	بخش ۶: استراتژی های سرمایه گذاری مبتنی بر هدف و افق زمانی
۳۳۵.....	Investment Strategies Based on Goal and Time horizon
۳۳۶.....	استراتژی های مبتنی بر هدف و افق زمانی
۳۴۰.....	بخش ۷: تجزیه، تحلیل و انتخاب استراتژی سرمایه گذاری
۳۴۰.....	Decomposition, Analysis, and Selection of Investment Strategy
۳۴۱.....	عوامل مؤثر بر انتخاب استراتژی
۳۴۵.....	نصل چهارم: تخصیص سرمایه (Capital Allocation)
۳۴۶.....	بخش ۱: طبقه بندی دارایی ها (Classification of Assets)
۳۴۷.....	کلاس دارایی ها
۳۴۸.....	۱- دارایی های مالی
۳۵۰.....	۲- دارایی های فیزیکی
۳۵۲.....	۳- دارایی های دیجیتال

۳۵۵.....	بخش ۲: معیارهای تخصیص سرمایه (Asset Allocation Criteria)
۳۵۶.....	۱- میزان سرمایه
۳۵۶.....	۲- دانش، مهارت و آزادی زمانی
۳۵۷.....	۳- شرایط اقتصادی و بازدهی تاریخی Historical Return
۳۵۷.....	۴- نقدشوندگی Liquidity
۳۶۰.....	۵- شفافیت بازار Economic Transparency
۳۶۰.....	۶- ریسک پذیری Risk Taking
۳۶۱.....	۷- اهداف سرمایه گذاری Investment Objectives
۳۶۱.....	۸- افق زمانی سرمایه گذاری Investment time horizon
۳۶۲.....	بخش ۳: استراتژی‌های تخصیص سرمایه (Capital Allocation Strategies)
۳۶۴.....	استراتژی‌های تخصیص سرمایه
۳۷۱.....	مزایا و معایب تخصیص سرمایه
۳۷۴.....	بخش ۴: روش‌های بهینه برای تخصیص سرمایه (Optimal Methods for Capital Allocation)
۳۷۵.....	تخصیص سرمایه به دارایی‌های مختلف
۳۷۵.....	صرف ریسک
۳۷۶.....	روش‌های بهینه برای تخصیص سرمایه
۳۷۶.....	۱- تخصیص سرمایه براساس مقدار دلار برابر
۳۷۷.....	۲- استفاده از ریسک بهینه برای تخصیص
۳۷۹.....	۳- تخصیص سرمایه بهینه براساس تئوری سبد مدرن
۳۸۴.....	بهینه‌سازی پرتفوی براساس مدل مارکویتز Markowitz
۳۸۸.....	۴- تخصیص سرمایه براساس بودجه بندی ریسک Risk Budgeting Approach
۳۹۳.....	بخش ۵: تخصیص منابع مالی در بازارهای مختلف
۳۹۳.....	Financial Resource Allocation In Various Markets
۳۹۴.....	تخصیص بهینه منابع مالی
۳۹۵.....	پیشنهاد یک پرتفو بهینه
۳۹۶.....	تخصیص سرمایه در بازارهای مختلف
۳۹۶.....	الف- تخصیص سرمایه در بازار بورس ایران
۳۹۹.....	ب- تخصیص سرمایه در بازار فارکس
۴۰۱.....	توصیه‌های مهم برای تخصیص سرمایه در بازار فارکس
۴۰۵.....	۴- شرکت‌های تأمین سرمایه Proprietary Trading Firms
۴۰۶.....	تخصیص سرمایه در بازار ارزهای دیجیتال
۴۰۷.....	عوامل مؤثر در تخصیص سرمایه به ارزهای دیجیتال
۴۰۹.....	نمونه‌ای از مدیریت سرمایه در بازار ارزهای دیجیتال
۴۱۰.....	تفاوت مدیریت ریسک با مدیریت سرمایه در ارز دیجیتال
۴۱۱.....	معامله گری یا سرمایه گذاری در ارزهای دیجیتال
۴۱۲.....	معامله در بازار فارکس یا ارزهای دیجیتال

فصل پنجم: روانشناسی مدیریت سرمایه (The Psychology of Capital Management)	۴۱۵
بخش ۱: اهمیت روانشناسی (The Importance of Psychology)	۴۱۸
نقش احساسات و ذهنیت در تصمیمات مالی	۴۱۹
مدیریت احساسات و ذهنیت	۴۲۰
مدیریت سرمایه و صبر	۴۲۱
ابعاد مختلف مدیریت سرمایه	۴۲۱
اثر روانی احساسات بر روی تحلیل بازار	۴۲۲
تفاوت تحلیل منطقی و تصمیم‌گیری احساسی	۴۲۲
تأثیر روانشناسی بر بازدهی سرمایه‌گذاری	۴۲۳
بخش ۲: تأثیر هیجانات و سوگیری‌ها	۴۲۴
The Impact of Emotions and Cognitive Biases	۴۲۴
الف- طمع Greed	۴۲۵
ب- ترس Fear	۴۲۶
ج- سوگیری‌های شناختی Cognitive Biases	۴۲۹
راه‌های کاهش سوگیری ناکیدی	۴۳۰
جمع‌بندی	۴۴۱
بخش ۳: نظم، انضباط و کنترل احساسات (Discipline and emotional control)	۴۴۲
الف- نظم و انضباط Discipline	۴۴۳
ب- کنترل احساسات Emotional Control	۴۴۴
مدیریت استرس و اضطراب در معاملات	۴۴۷
پذیرش ضرر Loss Acceptance و جلوگیری از تصمیمات احساسی	۴۴۹
تعامل نظم و کنترل احساسات	۴۵۱
بخش ۴: روانشناسی ریسک و بازده (The Psychology of Risk and Return)	۴۵۲
تحمل ریسک شخصی Risk Tolerance	۴۵۳
اهمیت تحمل ریسک در مدیریت سرمایه‌گذاری	۴۵۳
تفاوت تحمل ریسک و ظرفیت ریسک	۴۵۴
عوامل مؤثر بر تحمل ریسک شخصی	۴۵۵
راهکارهای افزایش تحمل ریسک	۴۵۷
نقش تحمل ریسک در انتخاب استراتژی	۴۵۹
ابزارهای سنجش تحمل ریسک	۴۶۰
خطاهای رایج در ارزیابی تحمل ریسک	۴۶۲
تغییر تحمل ریسک در طول زمان	۴۶۴
ریسک واقعی و ریسک ادراک شده	۴۶۶
بخش ۵: تکنیک‌های تقویت ذهن (Mind Strengthening Techniques)	۴۶۹
همه چیز در ذهن می‌گذرد	۴۷۰
الف) رشد ذهنیت	۴۷۱
ب) حذف باورهای غلط	۴۷۳

۴۷۷.....	ج- مطالعه کتاب‌های پرورش ذهن.....
۴۷۹.....	د- بررسی و اصلاح فلسفه شخصی در معامله‌گری.....
۴۸۱.....	بخش ۶: شناسایی و ارزیابی تیپ‌های شخصیتی در معامله‌گری.....
۴۸۱.....	Identification and Assessment of Personality Thypes in Trading
۴۸۲.....	تست تارپ <i>Tharp</i>
۴۸۶.....	تست <i>MBTI</i>
۴۹۱.....	تست <i>DISC</i>