

عنوان درس: مدیریت ریسک و سرمایه در بازار جهانی

تعداد ساعات درس: ۱۰ ساعت

هدف: دانش پذیران پس از گذراندن این درس ، می توانند پس از تحلیل و انتخاب دارایی مورد نظر خود میزان سرمایه قابل تخصیص به آن را به صورت دقیق با در نظر گرفتن محدودیت های مدیریت ریسک و سرمایه و بازده مورد انتظار محاسبه کنند.

سرفصل های درس:

ردیف	سرفصل	ساعت آموزشی	نوع فعالیت درسی			
			مباحث نظری	کار عملی	مرور کس	انجام پروژه
۱	ریسک و انواع آن تعریف ریسک، منابع ریسک (مالی و غیر مالی)، ریسک سیستماتیک/غیر سیستماتیک	۰.۵	*			
۲	مروری بر شاخص های اندازه گیری ریسک سنجه های حساسیت، سنجه های نوسان، سنجه های ریسک نا مطلوب	۰.۵	*			
۳	مروری بر مبانی مدیریت سبد دلیل اصلی تشکیل سبد، مرور کاربردی بر مدل مارکوویتز	۰.۵	*			
۴	مفاهیم مربوط به بازارهای اهرمی معاملات اهرمی، مارجین، مفهوم تسویه لحظه ای، Margin call، Margin Level ، Liquidation/stop out، حد ضرر و حد سود (Stop loss & Take Profit)، نسبت ریوارد به ریسک (R/R)، نسبت ریوارد به ریسک (R/R) طراحی و عملیاتی، Success Rate، ترکیب Success Rate و نسبت R/R، سود مورد انتظار سیستم معاملاتی، Drawdown، ضررهای متوالی و ریسک به فنا رفتن (Risk of Ruin)، مفهوم Short، محاسبات Short	۲				
۶	طراحی استراتژی معاملاتی استراتژی تحلیلی، استراتژی مدیریت ریسک و مدیریت سرمایه	۱	*	*	*	
۷	مفاهیم مربوط به استراتژی معاملاتی حد سود و ضرر، (R/R) و انواع آن، درصد موفقیت (WR)، سود مورد انتظار سیستم معاملاتی، DrawDown، Risk of Ruin	۱	*			
۸	اجزای اصلی سیستم مدیریت ریسک و طراحی آن چگونگی محاسبه ریسک و سرمایه قابل تخصیص، رابط مدیریت ریسک و سرمایه، مثال و تمرین	۱.۵	*	*	*	*

			*	۱	مدیریت ریسک در حین معامله محقق کردن سود، اضافه کردن سرمایه در ضرر، Trailing SL /TP, Trailing STOP بر اساس سوئینگ، سبب معاملات	۹
			*	۱	انواع مدیریت سرمایه مفهوم Balance و Equity، مدیریت سرمایه پویا و ثابت	۱۰
			*	۱	توصیه‌های معامله‌گری و مالی رفتاری رویکردهای ریسک‌پذیری، اصل تصادفی بودن، ویژگی‌های سرمایه، ورود و خروج سرمایه، برنامه خروج سرمایه، ژورنال، سبک معاملاتی شما، هیجان سنج	۱۱
				۱۰	جمع کل ساعات آموزشی	