

۲۰۰۰ سوال چهار گزینه‌ای

۲۰۰۰

مدیریت سرمایه گذاری و ریسک

مؤلفین:

رضا مناجاتی

محمد کریمی آرا



سرشناسه	مناجاتی، رضا
عنوان و نام پدیدآور	۲۰۰۰ سوال چهار گزینه‌ای مدیریت سرمایه‌گذاری و ریسک / مولفین رضا مناجاتی، محمد گرجی‌آرا
مشخصات نشر	تهران: نگاه دانش، ۱۳۹۲
مشخصات ظاهری	۵۶۸ ص
شابک	۹۷۸-۹۶۴-۱۵۷-۲۴۶-۶
وضعیت فهرست‌نویسی	فیا
عنوان گسترده	دو هزار سوال چهار گزینه‌ای مدیریت سرمایه‌گذاری و ریسک
شناسه افزوده	گرجی‌آرا، محمد
موضوع	دانشگاه‌ها و مدارس عالی -- ایران -- آزمون‌ها
موضوع	سرمایه‌گذاری -- آزمون‌ها و تمرین‌ها (عالی)
موضوع	مدیریت ریسک -- آزمون‌ها و تمرین‌ها (عالی)
موضوع	آزمون دوره‌های تحصیلات تکمیلی -- ایران
رده‌بندی کنگره	۱۳۹۲ ۵۹ ۷۷۸۸۸۶ / م ۲۲۵۲ LB
رده‌بندی دیویی	۳۷۸ / ۱۶۶۴
شماره کتابشناسی ملی	۳۲۴۱۵۵۲

محمد محمد بخوانید
 منابع پیشنهادی اساتید نگاه دانش برای کارشناسی ارشد و دکتری
 و
 خرید الکترونیک کتاب‌های نگاه دانش
 در
www.negahedanesh.com



انتشارات نگاه دانش

۲۰۰۰ سوال چهار گزینه‌ای مدیریت سرمایه‌گذاری و ریسک	♦ نام کتاب:
رضا مناجاتی- محمد گرجی‌آرا	♦ مولفین:
نگاه دانش	♦ ناشر:
سجیلا مرادی	♦ حروف‌نگاری، صفحه‌آرایی:
نگاه دانش	♦ طراحی جلد:
اول، ۱۳۹۲	♦ نوبت چاپ:
۱۰۰۰ جلد	♦ تیراژ:
۲۸,۰۰۰ تومان	♦ قیمت:
باختر- شاهین- چاوش	♦ لیتوگرافی / چاپ و صحافی:
۹۷۸-۹۶۴-۱۵۷-۲۴۶-۶	♦ شابک:

مق چاپ محفوظ و مفسوص ناشر است.

انتشارات نگاه دانش: انقلاب- ف ۱۷ فروردین- ساغتمان نشران پلاک ۲۷۱- طبقه ۲- واحد ۴

تلفن: ۶۶۴۸۶۱۵۴

تلفن: ۶۶۹۵۴۸۹۲

مقدمه

با عنایت به نیاز روز افزون جامعه ایران به متخصصین مالی و همچنین شکل گیری رشته مالی به عنوان یک رشته تخصصی در ایران و مجزا شدن آن از رشته مدیریت بازرگانی و حسابداری، و از سویی دیگر اضافه شدن درس مدیریت سرمایه گذاری و ریسک به سرفصل های کنکور سراسری در سال های اخیر، نیاز به منابع آموزشی در این زمینه کاملاً محسوس می باشد.

با توجه به تجربه سال های تدریس گروه مؤلفین در درس های مدیریت سرمایه گذاری و ریسک و مدیریت مالی به صورت آکادمیک و کاربردی، و همچنین نیاز به منبع تست به علت جوان و نوپا بودن این رشته در کشور، بر آن شدیم تا در قالب مجموعه کتاب های ۲۰۰۰ تست انتشارات نگاه دانش، مجموعه ای از تست های متناسب با سرفصل آزمون کنکور مقطع کارشناسی ارشد، دکتری و گواهی نامه های حرفه ای بازار سرمایه، تدوین و تألیف بنماییم. این کتاب در شش بخش و پانزده فصل تقدیم حضور داوطلبان گرامتدر می گردد. تست های کتاب حاضر از شبیه سازی تست های کنکور سراسری، آزمون های سطح یک و دو بین المللی CFA و آزمون های گواهی نامه های حرفه ای بازار سرمایه گردآوری و تألیف شده است.

در انتخاب و طراحی تست ها سعی بر آن بوده است که استانداردهای بین المللی طراحی تست و همچنین کامل بودن پاسخ تشریحی رعایت شود. پاسخ های این مجموعه تست به صورت کاملاً تشریحی بوده و مبحث مورد نظر در قسمت پاسخنامه به صورت کامل مورد بحث و بررسی قرار گرفته است. لذا به دانشجویان گرامتدر توصیه می نمایم حتی در صورت پاسخ دادن صحیح سوالات اقدام به مطالعه پاسخنامه تشریحی نمایند چرا که در این قسمت به سایر نکات مهم بحث مورد سوال نیز اشاره شده است. همچنین در پاسخ گویی به سوالات اشتباه و توجه مؤلفین بر آن بوده است که اشکالات رایج در کتاب های آموزشی و برخی از منابع کنکور در این کتاب به حداقل رسیده و روابط ریاضی و مفاهیم به صورت صحیح و متناسب با منابع اصلی بین المللی ارائه گردد.

همچنین بر خود لازم می دانیم از جناب آقای مجید آبکار و سرکار خانم لیلا زارعی بابت همکاری صمیمانه شان، جناب آقای پژمان کیا بابت حمایت های معنوی ایشان، مدیریت محترم انتشارات نگاه دانش و همچنین کلیه اساتید، دوستان، دانشجویان و همکارانی که در تدوین و تهیه این کتاب مارا به هر نحوی یاری رساننده، کمال تشکر را داشته باشیم.

در پایان ضمن ارائه تکنیک مطالعاتی هر فصل برای داوطلبان آزمون های مختلف از کلیه خوانندگان، اساتید، صاحب نظران و دانشجویان گرامتدر تقاضا داریم تا نظرات و پیشنهاد های سازنده خود را در رابطه با این مجموعه و یا سایر مجموعه های تألیف شده توسط گروه مؤلفین به اینجانبان ارائه دهند تا در چاپ های بعدی مشکلات کتاب به حداقل ممکن کاهش یابد.

سرفصل های مطالعاتی هر داوطلب برای آزمون ها:

شماره فصل	۱	۲	۳	۴	۵	۶	۷	۸	۹	۱۰	۱۱	۱۲	۱۳	۱۴	۱۵
آزمون کارشناسی ارشد سراسری مالی	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*
آزمون کارشناسی ارشد آزاد مالی و حسابداری	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*
آزمون اصول بازار سرمایه	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*
آزمون معامله گری اوراق تأمین مالی	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*
آزمون معامله گری اوراق مشتقه	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*
آزمون تحلیل گری بازار سرمایه	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*
آزمون مدیریت سبد سرمایه گذاری	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*
آزمون ارزشیابی اوراق بهادار	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*
آزمون دکتری مالی	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*	*

♦ بخش اول: مقدمه‌ای بر بازارها و ابزارهای مالی

فصل ۱: بازارها و نهادهای مالی

سوالات	۹
پاسخ‌ها	۲۷

فصل ۲: شاخص

سوالات	۵۵
پاسخ‌ها	۶۳

فصل ۳: خرید و فروش اوراق بهادار

سوالات	۷۷
پاسخ‌ها	۸۳

♦ بخش دوم: تئوری پرتفوی

فصل ۴: مفاهیم پایه در نظریه نوین پرتفوی

سوالات	۹۹
پاسخ‌ها	۱۱۸

فصل ۵: بهینه سازی پرتفوی (مدل مارکوویتز)

سوالات	۱۵۱
پاسخ‌ها	۱۷۷

♦ بخش سوم: معرفی مدل‌های عاملی و تعادلی

فصل ۶: تئوری بازار سرمایه

سوالات	۲۱۹
پاسخ‌ها	۲۲۹

فصل ۷: مدل‌های عاملی

سوالات	۲۴۳
پاسخ‌ها	۲۵۵

فصل ۸: مدل قیمت‌گذاری دارایی‌های سرمایه‌ای

سوالات	۲۷۳
پاسخ‌ها	۲۹۳

فصل ۹: مدل قیمت‌گذاری آربیتراژ

سوالات	۳۲۵
پاسخ‌ها	۳۳۱

❖ بخش چهارم: ارزیابی عملکرد پرتفوی و کارایی بازار

فصل ۱۰: ارزیابی عملکرد پرتفوی

سوالیات	۳۴۱
پاسخ‌ها	۳۵۳

فصل ۱۱: کارایی بازار سرمایه

سوالیات	۳۷۳
پاسخ‌ها	۳۸۲

❖ بخش پنجم: ارزش‌گذاری اوراق بهادار

فصل ۱۲: ارزش‌گذاری اوراق بهادار با درآمد ثابت

سوالیات	۳۹۷
پاسخ‌ها	۴۰۸

فصل ۱۳: ارزش‌گذاری اوراق بهادار با درآمد متغیر

سوالیات	۴۲۷
پاسخ‌ها	۴۴۲

❖ بخش ششم: مبانی مهندسی مالی و ابزار مشتقه

فصل ۱۴: معاملات آتی و سوآپ

سوالیات	۴۷۱
پاسخ‌ها	۴۸۵

فصل ۱۵: اوراق اختیار معامله

سوالیات	۵۱۳
پاسخ‌ها	۵۳۲