

سئوالات امتحانی درس مدیریت سرمایه گذاری، مقطع کارشناسی ارشد موسسه آموزش عالی الغدیر (گرایش مدیریت مالی)

- 1- نقش بازار های کارا را انتخاب پرتفوی بهینه توضیح دهید؟
- 2- شاخص قیمت بازار بورس تهران را شرح دهید و فرمول آن را نیز بیان کنید؟
- 3- ابزار های مشتقه چیست و نقش ابزارهای مشتقه در مدیریت ریسک پرتفوی؟
- 4- ارزش در معرض ریسک را توضیح داده و روشهای محاسبه آن را نام ببرید؟
- 5- مدل های عاملی (تک عاملی و چند عاملی) را تشریح نمایید؟
- 6- مدل قیمت گذاری دارایی های سرمایه ای یا $capm$ را تشریح نمایید؟
- 7- مدل قیمت گذاری آربیتراژ را توضیح داده و با یک مثال تشریح نمایید که این مدل چگونه می تواند به افزایش بازده پرتفوی بدون افزایش ریسک کمک کند؟
- 8- نظریه مدیریت مالی نوین در مورد مدل های انتخاب پرتفوی بهینه را تشریح کنید؟
- 9- عوامل موثر بر بتای اساسی را شرح دهید؟
- 10- بازار های مالی و انواع آن را توضیح دهید؟
- 11- بازار فرابورس را تشریح نمایید؟
- 12- تفاوت مدل تک عاملی با $capm$ چیست؟
- 13- مفهوم بازار کارا را از نظر اطلاعاتی در سه سطر تشریح نمایید؟
- 14- مزایای مدل چند عاملی نسبت به مدل تک عاملی چیست؟
- 15- مدل مارکویتز را در انتخاب پرتفوی بهینه توضیح دهید؟
- 16- به نظر شما در بازار سرمایه ایران کدام یک از مدل های انتخاب پرتفوی مناسب است؟

با آرزوی موفقیت

دکتر زینالی