

به نام خدا

موسسه عالی بانکداری تبریز

سوالات امتحان مدیریت پرتفوی و تحلیل ریسک

زمان: 90 دقیقه

نیمسال اول 91

نام خانوادگی:

- (2) 1. انواع بازارهای مالی را نام برده و به اختصار توضیح دهید؟
2. شاخص کل قیمت بازار بورس تهران TEPIX را توضیح داده و دلایل افزایش شاخص در سال 90 و 91 را تشریح نمایید؟
- (2) 3. نظریه قیمت گذاری آریترایژ را به همراه یک مثال تشریح نمایید؟
- (3) 4. نقش مدل مارکویتز در انتخاب پرتفوی بهینه را تشریح نمایید؟
- 2 5. صندوق سرمایه گذاری مشترک را توضیح داده و انواع آن را نام ببرید؟
- 6- نقش بازار کارا در انتخاب پرتفوی بهینه را تشریح نمایید؟ 2
- 7- نقش اختیارات در مدیریت ریسک را به همراه یک مثال تشریح نمایید؟ 2

موفق و پیروز باشید - زینالی

جمع بارم: 16 نمره