

بسم الله الرحمن الرحيم

مجموعه سوالات
مدیریت سرمایه‌گذاری و ریسک

تألیف:

دکتر رضا تهرانی

عضو هیات علمی دانشگاه تهران

عسگر نوربخش

- سرشناسه : تهرانی، رضا
 عنوان و نام پدیدآورنده : مجموعه سوالات مدیریت سرمایه‌گذاری و ریسک / تألیف: رضا تهرانی، عسگر نوربخش
 مشخصات نشر : تهران: نگاه دانش نوین، ۱۳۸۸
 مشخصات ظاهری : ۴۴۰ ص
 شابک : 978-600-90162-9-7
 وضعیت فهرست نویسی : فیا
 موضوع : مدیریت دارایی و بدهی — آزمون‌ها و تمرین‌ها
 شناسه افزوده : نوربخش، عسگر
 رده‌بندی کنگره : ۱۳۸۸ م۳ ت/۲۵/۱۶۱۵ HG
 رده‌بندی دیویی : ۳۳۲/۱۰۶۸۱
 شماره کتابشناسی ملی : ۱۸۲۹۷۰۸



انتشارات نگاه دانش نوین

- ♦ نام کتاب: مجموعه سوالات مدیریت سرمایه‌گذاری و ریسک
 ♦ مؤلف: دکتر رضا تهرانی، عسگر نوربخش
 ♦ ناشر: نگاه دانش نوین با همکاری انتشارات نگاه دانش
 ♦ طراح: مرتضی فرزاد
 ♦ حروف نگاری، صفحه‌آرایی (نگاه دانش): کبری صابری
 ♦ نوبت چاپ: اول، ۱۳۸۸
 ♦ تیراژ: ۲۰۰۰ نسخه
 ♦ قیمت: ۷۰۰۰ تومان
 ♦ لیتوگرافی / چاپ و صحافی: باختر/ گنج شایگان / کیمیا
 ♦ شابک: ۹۷۸-۶۰۰-۹۰۱۶۲-۹-۷

حق چاپ محفوظ و مخصوص ناشر است

وب سایت اینترنتی نگاه دانش: www.negahedanesh.ir

انتشارات نگاه دانش: انقلاب - خ ۱۲ فروردین - ساختمان ناشران پلاک ۱۶ - طبقه ۲ - واحد ۲

تلفن: ۶۶۹۵۴۸۹۲

تلفکس: ۶۶۴۸۶۱۵۴

پیشگفتار

توسعه بازار سرمایه در ایران، تخصصی شدن مسائل سرمایه‌گذاری و به دنبال آن توسعه رشته‌های مالی و سرمایه‌گذاری در دانشگاه‌ها، شرایطی را فراهم ساخته است که دانش‌پژوهان، علاقمندان و محققین در این رشته نیاز به منابع بیشتری دارند تا پاسخگوی نیازهای آنها باشد.

... در ادامه ترجمه کتاب «مدیریت سرمایه‌گذاری» (چارلز پی جونز) بر آن شدیم تا مجموعه سؤالاتی را تقدیم شما علاقمندان نمائیم که از کفایت علمی مناسبی برخوردار باشد. لذا این مجموعه سؤالات، برگرفته از مجموعه سؤالاتی است که «چارلز پی جونز» بر مبنای کتاب مذکور تهیه کرده است. کلیه پاسخ‌ها که بخش عمده‌ای از کتاب را به خود اختصاص داده، توسط اینجانبان تهیه گردیده است.

با امید به اینکه کتاب حاضر پاسخگوی نیازهای علمی شما علاقمندان به دانش سرمایه‌گذاری باشد و ضمن پوشش از کاستی‌هایی که ملاحظه می‌فرمائید، امیدواریم ما را از راهنمایی‌های خود دریغ نفرمائید. ضمناً از انتشارات نگاه دانش و کسانی که در تهیه این کتاب ما را یاری نموده‌اند تشکر می‌نمائیم.

دکتر رضا تهرانی

عضو هیأت علمی دانشگاه تهران

عسگر نوربخش

فهرست مطالب

فصل ۱: فهم سرمایه‌گذاری	۵
فصل ۲: انواع اوراق بهادار	۲۱
فصل ۳: شرکت‌های سرمایه‌گذاری	۴۱
فصل ۴: بازارهای اوراق بهادار	۵۹
فصل ۵: نحوه معامله اوراق بهادار	۷۵
فصل ۶: ریسک و بازده سرمایه‌گذاری (مفاهیم ریسک و بازده)	۹۷
فصل ۷: تئوری پرتفوی	۱۱۷
فصل ۸: گزینش پرتفوی	۱۳۷
فصل ۹: مدل قیمت‌گذاری دارایی‌های سرمایه‌ای (تئوری بازار سرمایه)	۱۵۱
فصل ۱۰: ارزشیابی سهام عادی	۱۷۳
فصل ۱۱: سهام عادی: تجزیه و تحلیل و استراتژی‌ها	۱۹۵
فصل ۱۲: کارایی بازار	۲۱۳
فصل ۱۳: تجزیه و تحلیل اقتصاد / بازار	۲۳۵
فصل ۱۴: تجزیه و تحلیل صنعت	۲۵۱
فصل ۱۵: تجزیه و تحلیل شرکت	۲۶۷
فصل ۱۶: تجزیه و تحلیل تکنیکی (نموداری)	۲۹۱
فصل ۱۷: قیمت و بازده اوراق قرضه	۳۰۷
فصل ۱۸: اوراق قرضه: تجزیه و تحلیل و استراتژی‌ها	۳۳۵
فصل ۱۹: اوراق اختیار معامله	۳۵۵
فصل ۲۰: پیمان‌های آتی	۳۸۳
فصل ۲۱: مدیریت پرتفوی	۴۰۵
فصل ۲۲: ارزیابی عملکرد سرمایه‌گذاری	۴۲۳