

بِسْمِ اللَّهِ الرَّحْمَنِ الرَّحِيمِ

۲۰۰۰ تست مدیریت سرمایه گذاری و ریسک

جلد دوم

اختصاصی بازار اوراق بهادار
و معامله اوراق بهادار
رایج بازار

دکتر سعید فتحی

استادیار دانشگاه اصفهان

ابراهیم صدرالدین

سرشناسه

فجی، سعید، ۱۳۵۶ -

عنوان و نام پدیدآور	۳۰۰ مدیریت سرمایه‌گذاری و ریسک/ سعید فجی، ابراهیم صدرالدین
مشخصات نشر	اصفهان: انتشارات نگارخانه، ۱۳۰۰
مشخصات ظاهری	ج۲
شابک	۹۷۸-۶۰۰-۷۱۴۸-۱۶-۷:۲
حقیقت فهرست نویسی	فیا
حقیقت	فهرست نویسی بر اساس جلد دوم
حقیقت	ج۲ (چاپ اول: ۱۳۹۳) (فیا)
دانش	کتابنامه
شعنوان شمرده	دو هزار و بیست مدیریت سرمایه‌گذاری و ریسک
موضوع	دانشگاه‌ها و مدارس عالی -- ایران -- آزمون‌ها
موضوع	مدیریت ریسک -- آزمون‌ها و تمرین‌ها (عالی)
موضوع	سرمایه‌گذاری -- آزمون‌ها و تمرین‌ها (عالی)
شناسه داده	صدرالدین، ابراهیم، ۱۳۴۷ -
رده بندی کنگر	ی. ۱۳۰۰ ۲۹۱۳/ف/ل۲۵۲ LB
رده بندی دیویی	۷۸/۱
شماره کتابشناسی ملی	۲۳۲۶

۳۰۰ مدیریت سرمایه‌گذاری و ریسک

صدرالدین، ابراهیم

انتشارات نگارخانه

مدیر تولید:

صفحه آرا:

طرح جلد:

چاپخانه:

تیراژ:

قطع:

قیمت:

شابک: ۹۷۸-۶۰۰-۷۱۴۸-۱۶-۷

این اثر مشمول ققون حمایت مؤلفان و مصنفان و هنرمندان مصوب ۱۳۶۸ ه.ش.

هر کس تمام و یا قسمتی از این اثر را بدون اجازه مؤلف/نشر/انتشر، بخش یا مرشد کند مورد پیگرد قانونی خواهد گرفت.

pubnegar@yahoo.com

مقدمه و پیشگفتار

از اوایل دهه ۱۳۵۰ درس مدیریت مالی به عنوان یکی از دروس دانشگاهی در کشور معرفی شد. با توجه روز افزون به بازار های سرمایه، این مبحث به صورت جدی تر توسعه یافت به طوری که امروزه مدیریت مالی در سطوح مختلف کارشناسی، کارشناسی ارشد و دکتری در تعدادی از دانشگاههای کشور به صورت یک رشته ی مستقل تدریس می شود.

در تدریس سرمایه گذاری و ریسک به عنوان یکی از پایه های مباحث مالی در آزمون های ورودی دانشگاه ها و موسسات آموزش عالی در این رشته مورد سوال قرار می گیرد. لیکن با توجه به جوان بودن مبحث مدیریت سرمایه گذاری و ریسک در کشور و نیز بسط بودن این حوزه ضروری می نمود داوطلبین آزمون های ورودی دانشگاه ها به منابع و کتب متعدد روی آورند که پیچیدگی و تخصصی بودن آن ها از استنباط این منابع باعث سردرگمی این دسته از داوطلبین می شد. لذا تلاش در گردآوری مجموعه ای آموزشی در قالب سؤالات چند گزینه ای پدید آید به صورتی که بیان ساده به صورتی متمرکز به بخش هایی از منابع اصلی بپردازد که امکان پاسخ سوال از این قسمت ها در آزمون ها وجود دارد. این مجموعه دارای چند وجهی است با سایر کتب موجود در این زمینه می باشد که اجمالاً مورد اشاره قرار می گیرد.

- تقسیم بندی موضوعات و بخش های مختلف در جلد های جداگانه به طوری که هر داوطلب با توجه به نقاط ضعف و قوت خود بتواند بر نظر گرفتن نوع نیاز خود بتواند موضوع مورد نظر را مورد بررسی و مطالعه دقیق قرار دهد.
- ارائه روش ها و الگوهای ابتکاری به شیوه ای که ضمن کمک به هضم

مباحث بتواند باعث افزایش سرعت داوطلب در پاسخ گویی به سؤالات شود.

- آموزش مطالب و نکات با استفاده از تکنیک تشریح، تکرار و روش های ذهنی سازی

- تطبیق مباحث مطروحه با رویدادهای واقعی به طوری که خواننده روش کاربرد این مباحث را در عمل به صورت ملموس احساس نماید.

- مورد توجه قرار دادن منابع و کتب مربوطه در زمینه بازارها، نهادها و مؤسسات اخلاقی

صرف نظر از این مسائل و مباحثی که برای گردآوری این مجموعه صرف شد، بدیهی است این اثر برای کسانی نبوده لذا رهنمودها و نظرات خوانندگان محترم، اساتید گرامی و دانشجویان عزیز به آینده منت در تکمیل و چاپ آتی این مجموعه مدنظر قرار خواهد گرفت. در پایان جا دارد از پشتیبانی و حمایت مرکز توسعه مالی پیشرفت همیمانه تشکر نماییم.

دکتر سعید فتحی

دکتر ایم صدرالدین

فهرست مطالب

۷..... فصل سوم: شاخص‌های بازار اوراق بهادار

- محاسبه شاخص‌های قیمتی بی وزن
- محاسبه شاخص‌های قیمتی با وزن برابر
- محاسبه شاخص‌های قیمتی با وزن برابر با ارزش بازار سهام
- شاخص‌های ارزش بورس اوراق بهادار تهران
- شاخص‌های ارزش بورس اوراق بهادار تهران (TEPIX)
- شاخص‌های ارزش بورس اوراق بهادار تهران (TEPIX) نحوه محاسبه
- انواع شاخص‌های ارزش بازار
- شاخص‌های ارزش بازار (Value at Risk)

۵۵..... فصل چهارم: نحوه معامله در بورس اوراق بهادار

- بخش اول: انواع سفارش‌ها
 - سفارش روزانه (GFD Order)
 - سفارش بزرگ یا پیرچ تا زمان ابطال (GFT Order)
 - سفارش فوری و فوری (FoK Order)
 - سفارش صلاح‌دید
 - سفارش به قیمت بازار (Market Price Order)
 - سفارش به قیمت معین (Limit Order)
 - سفارش متوقف شونده (Stop Order)
 - سفارش متوقف شونده با قیمت معین (Stop Limit Order)
 - نمودارهای تقاضای سهام (خرید سهام)
 - نمودارهای عرضه سهام (فروش سهام)
- بخش دوم: خرید و فروش اوراق بهادار
 - حساب نقدی و حساب ودیعه
 - خرید اعتباری

ترازنامه در خرید اعتباری
 ودیعه اولیه، ودیعه واقعی و حداقل ودیعه در خرید اعتباری
 حساب پیش و دیعه، محدود شده و کم و دیعه
 درخواست ترمیم و دیعه (Margin Call)
 بازده خرید اعتباری
 فروش استقراضی
 قانون قیمت گذاری صعودی
 ریسک بابت در فروش استقراضی
 سبب بزرگی تقسیم سود نقدی در فروش استقراضی
 رازنامه در فروش استقراضی
 سبب های نقدی بابت در فروش استقراضی

فصل پنجم: کارایی بازار ۱۵۵

کارایی اطلاعاتی (بیرر)
 کارایی عملیاتی (دانی)
 کارایی تخصیصی
 کارایی اطلاعاتی در سطح هیئت مدیره قوی و قوی
 بازارهای کارا با وجود هزینه مباد
 انواع آزمون های کارایی بازار
 بررسی آزمون گردش
 بررسی آزمون همبستگی
 بررسی آزمون قواعد فیلتر
 بررسی آزمون رویداد کاوی (جستجوی الگوها)

سؤالات آزمون های سراسری ۱۸۱

منابع ۱۸۵