



خدا یا چنان کن سرانجام کار تو خوشنود باشی و ما رستگار

www.ketab.ir

مدیریت سرمایه‌گذاری و ریسک کارشناسی ارشد - دکتری

مؤلف: سهیل ذوقی

چاپ یازدهم - پاییز ۱۴۰۰

سرشناسه: ذوقی، سهیل، ۱۳۶۴

عنوان و نام پدیدآور: مدیریت سرمایه‌گذاری و ریسک کارشناسی ارشد - دکتر / مؤلف سهیل ذوقی

مشخصات نشر: تهران: مدرسان شریف، ۱۴۰۰.

مشخصات ظاهری: [۱۰]: ۴۵۰ ص: ۲۹×۲۲ س.م.

شابک: 978-964-11-1354-6

وضعیت فهرست نویسی: فیپای مختصر

یادداشت: چاپ یازدهم.

شماره کتابشناسی ملی: ۵۳۵۰۰۶۵

نام کتاب: مدیریت سرمایه‌گذاری و ریسک (کارشناسی ارشد - دکتر)

مؤلف: دکتر سهیل ذوقی

ناشر: انتشارات مدرسان شریف

تیراژ: ۵۰۰ نسخه

نوبت چاپ: یازدهم

تاریخ چاپ: آبان‌ماه ۱۴۰۰

حروف چینی: واحد تایپ انتشارات مدرسان شریف

چاپ و صحافی: مهدی - مینو

قیمت: ۲۶۵۰۰۰ تومان

شابک: 978-964-11-1354-6

هر گونه استفاده از مطالب این کتاب اعم از بازنویسی، خلاصه‌سازی، نقل مطالب آموزشی، استفاده از سؤالات یا پاسخ‌ها، برداشت به صورت دست‌نویس، کپی، تکثیر و یا هرگونه چاپ سنتی و دیجیتالی، استفاده به صورت کتاب الکترونیکی، لوح فشرده، قرار دادن مطالب بر روی اینترنت و وب سایت‌ها و یا هر گونه شبکه کامپیوتری دیگر و به طور کل هر گونه استفاده‌ی اشخاص حقیقی و حقوقی در جهت منافع معنوی و مادی خود، بدون اجازه کتبی ناشر ممنوع و بر اساس بند (۵) ماده ۲۳ قانون حمایت از حقوق مؤلفان و مصنفان و قوانین مربوط به جرایم رایانه‌ای کشور قابل پیگیری در محاکم قضایی می‌باشد.

فصل اول: مفاهیم سرمایه‌گذاری

۱	مقدمه
۱	تعاریف سرمایه‌گذاری
۱	محیط سرمایه‌گذاری
۲	فرآیند سرمایه‌گذاری
۴	عوامل اثرگذار بر فرآیند تصمیم‌گیری
۵	تست‌های تألیفی فصل اول
۷	پاسخنامه تست‌های تألیفی فصل اول
۹	آزمون فصل اول

فصل دوم: بازارها و ابزارهای مالی

۱۰	مقدمه
۱۰	انتقال وجوه بین پس‌اندازکنندگان و وام‌گیرندگان
۱۰	روش‌های سرمایه‌گذاری
۱۱	سرمایه‌گذاری مستقیم
۱۱	اوراق بهادار غیرقابل معامله
۱۲	اوراق بهادار قابل معامله
۱۲	اوراق بهادار بازار پول
۱۳	اوراق بهادار بازار سرمایه
۱۵	سایر اوراق بهادار
۱۵	سرمایه‌گذاری غیرمستقیم
۱۵	صندوق سرمایه‌گذاری
۱۵	انواع صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۱۷	بازارهای مالی
۲۰	تست‌های تألیفی فصل دوم
۲۵	پاسخنامه تست‌های تألیفی فصل دوم
۳۱	سؤالات آزمون‌های بازار سرمایه فصل دوم
۳۳	پاسخنامه سؤالات آزمون‌های بازار سرمایه فصل دوم
۳۵	تست‌های طبقه‌بندی شده فصل دوم
۳۵	پاسخنامه تست‌های طبقه‌بندی شده فصل دوم
۳۶	آزمون فصل دوم

فصل سوم: خرید و فروش اوراق بهادار

۳۷	مقدمه
۳۷	انواع سفارش
۳۸	خرید اعتباری
۳۹	ودیعه اولیه
۳۹	ودیعه واقعی
۴۰	بازدهی در خرید اعتباری
۴۱	فروش استقراضی
۴۱	نحوه تقسیم سود نقدی پس از فروش استقراضی

مدرسین شریف



صفحه	عنوان
۴۱	ودیعہ اولیہ
۴۲	ودیعہ واقعی و حداقل ودیعہ
۴۳	بازدہی در فروش استقراضی
۴۴	تست‌های تألیفی فصل سوم
۴۶	پاسخنامه تست‌های تألیفی فصل سوم
۴۹	سؤالات آزمون‌های بازار سرمایه فصل سوم
۵۰	پاسخنامه سؤالات آزمون‌های بازار سرمایه فصل سوم
۵۱	تست‌های طبقه‌بندی شده فصل سوم
۵۱	پاسخنامه تست‌های طبقه‌بندی شده فصل سوم
۵۲	آزمون فصل سوم
فصل چهارم: کارایی بازار سرمایه	
۵۳	مقدمه: نظریه کارایی بازار چگونه مطرح شد؟
۵۳	انواع کارایی
۵۳	ویژگی‌های بازار کارا
۵۴	اشکال سه‌گانه کارایی اطلاعاتی بازار سرمایه
۵۵	آزمون‌های کارایی بازار سرمایه
۵۶	تست‌های تألیفی فصل چهارم
۵۷	پاسخنامه تست‌های تألیفی فصل چهارم
۵۹	سؤالات آزمون‌های بازار سرمایه فصل چهارم
۶۰	پاسخنامه سؤالات آزمون‌های بازار سرمایه فصل چهارم
۶۱	تست‌های طبقه‌بندی شده فصل چهارم
۶۱	پاسخنامه تست‌های طبقه‌بندی شده فصل چهارم
۶۲	آزمون فصل چهارم
فصل پنجم: شاخص‌های بازار اوراق بهادار	
۶۳	تعریف شاخص
۶۳	طبقه‌بندی شاخص‌های بورس
۶۴	روش میانگین‌گیری حسابی برای محاسبه شاخص (براساس شیوه‌های مختلف وزن‌دهی)
۶۵	روش میانگین‌گیری هندسی برای محاسبه شاخص
۶۸	تست‌های تألیفی فصل پنجم
۷۰	پاسخنامه تست‌های تألیفی فصل پنجم
۷۲	سؤالات آزمون‌های بازار سرمایه فصل پنجم
۷۴	پاسخنامه سؤالات آزمون‌های بازار سرمایه فصل پنجم
۷۶	تست‌های طبقه‌بندی شده فصل پنجم
۷۶	پاسخنامه تست‌های طبقه‌بندی شده فصل پنجم
۷۷	آزمون فصل پنجم

مدرسین شریف

