

۱- فرآیند دو مرحله ای در تصمیم گیری ها سرمایه گذاری را توضیح دهید.

۲- تفاوت بازده مورد انتظار و بازده تحقق یافته را بیان نمایید.

۳- ریسک را تعریف کنید.

۴- رابطه بین ریسک و بازده را توضیح دهید.

۵- مفهوم بازار کار چیست؟

۶- تفاوت بین بهره پس انداز و گواهی بهره را توضیح دهید.

۷- انواع اوراق قرضه را نام ببرید.

۸- چرا سهام متمایز جزء اوراق بهادار باسود ثابت تقسیم بندی شده است؟

۹- منظور از سرمایه گذاری غیر مستقیم چیست؟

۱۰- شاخص قیمت سهام شرکت های صنعتی داو جونز (Dow Jones) چیست؟ تفاوت آنرا با شاخص ترکیبی ۵۰ سهم استندارد و بورز (S & P) چیست؟

۱۱- نقش فعلی سازمان بورس نیویورک (NYSE) براد معاملات جهانی بیان نماید.

۱۲- تفاوت میان NASD و Nasdaq را بیان کنید.

۱۳- چگونه سرمایه گذار می تواند در حالیکه مالک ^{اوراق بهادار} ~~سهام~~ نیست آنرا بفروشد؟

۱۴- نحوه سرمایه گذاری سرمایه گذاران بدون استفاده از کارگزار را توضیح دهید.

۱۵- تفاوت میان سفارش روز و سفارش به قیمت بازار چیست؟

۱۶- چرا سرمایه گذاران تمایل دارند حساب های اعتباری داشته باشند؟ این حساب ها ممکن است در برگزیده چه ریسک داشته باشند؟

۱۷- تفاوت ریسک بازار و ریسک تجاری را توضیح دهید.

۱۸- در مورد بازار سهام چه وقت از میانگین هندس استفاده می شود؟

۱۹- نحوه برآورد انحراف معیار برای سهام خاص را بیان کنید. انحراف معیار یک سهام خاص چه تفاوتی با انحراف معیار یک پرتفوی متنوع دارد؟

۲۰- بازده مورد انتظار یک پرتفوی با ۵۰٪ اوراق بهادار و چگونه می توان محاسبه کرد؟

۲۱- با استفاده از مدل مارکوویتس چگونه پرتفوی بهینه را انتخاب می کنند؟

۲۲- چهار اوراق بهادار با بازه های مورد انتظار برابر دارند :

الف = $\frac{1}{15}$ ب = $\frac{1}{12}$ ج = $\frac{1}{10}$ د = $\frac{1}{22}$

آرزوی اوراق بهادار الف در این برتفلیو $\frac{1}{10}$ و ماتریک بصورت مساوی در بین سهام رتیر برتفلیو تقسیم شود، بازه مورد انتظار برتفلیو تمام چهار اوراق بهادار را محاسبه کنید.

۲۳- سبب CML چیست و چه چیزی را اندازه گیری میکند ؟

۲۴- چگونه می توان بصورت تجربی CAPM را آزمون کرد ؟

آزمود ؟

۲۵- اگر برتفلیو ها با استفاده از معیار شارب و جنس ارزش یابی شوند آیا رتیب بندی یکسانی از محکومیت خواهد

۲۶- تفاوت ارزش اسمی، ارزش دفتری و ارزش بازار سهام عادی را بیان کنید.

۲۷- چرا بازار سهام به عنوان بازار مانوید مطرح است ؟

۲۸- نحوه محاسبه بازه سهام چگونه است ؟

۲۹- نحوه محاسبه ریسک سیستماتیک برای سهام چگونه است ؟

۳۰- مدل تنزیل سود تقسیمی چیست ؟ این مدل را بصورت فرمول بنویسید.

۳۱- ضریب $\frac{P}{E}$ چه کاربردهای دارد ؟

۳۲- سه استراتژی فعال مربوط به سهام عادی را توضیح دهید.

۳۳- هرزفکر (عمل نفعه) در پس فرقیه کارایی بازار را بیان کنید.

۳۴- سه شکل بازار کارا را توضیح دهید.

۳۵- ارزش ذاتی سهام چیست ؟

۳۶- منظور از CAPM چیست ؟

۳۷- نرخ رشد سود چگونه تعیین شود ؟

۳۸- بجز خلاصه فرآیند تعیین سود هر سهم (EPS) را بیان کنید.

۳۹- تفاوت (تعیین) قیمت سهام و اختیار خرید سهام را بیان کنید.

۴۰- تغییرات مورد انتظار در مدل بلیک شولز (Black Scholes) را توضیح دهید.