

قسمتی از سوالات : مدیریت و ارزیابی ریسک

- بازار خارج از بورس جزء کدام یک از موارد زیر است؟

الف) بازار پول

☒ ب) بازار سرمایه

ج) بازار تأمین اطمینان

د) بازار کالا

- بازار سرمایه ایران جزء کدام یک از موارد زیر است؟

الف) بازار پول

☒ ب) بازار ثانویه

ج) بازار تأمین اطمینان

د) بازار کالا

- کدام ریسک بیانگر رابطه بین نرخ بازده دارایی مورد نظر، با بازده پرتفوی بازار است؟

☒ الف) سیستماتیک

ب) غیر سیستماتیک

ج) سیستماتیک و غیر سیستماتیک

د) کل

- وجه مشخصه این بازار تبادل مستقیم قیمت بین خریدار و فروشنده و یا کارگزاران آنهاست؟

الف) بازار دلالی

ب) بازار کارگزاری

☒ ج) بازار مزایده

د) بازار ثانویه

- بازار کارگزاری جزء کدام دسته از بازارهاست؟

الف) بازار اولیه

☒ ب) بازار ثانویه

الف) بازار حراج

د) بازار خارج از بورس

- کدام شاخص از حاصل ضرب تعداد سهام در قیمت جاری سهام منتشره شرکتها به دست می

آید؟

الف) شاخص قیمتی بی وزن

ب) شاخص قیمتی با وزن برابر

ج) ☒ شاخص قیمتی با وزنی برابر با ارزش بازاری سهام

د) شاخص قیمتی با وزنی برابر با ارزش اسمی سهام

– کدام ریسک به انتظارات سرمایه گذار نسبت به آینده سیاسی کشور بستگی دارد و تغییراتی

که در قیمت رخ میدهد از کنترل شرکت منتشر کننده سهام، خارج است؟

الف) ریسک تجاری

ب) ریسک تورم

ج) ☒ ریسک سیاسی

د) ریسک مالی

– معیار اصلی ریسک کل کدام است؟

الف) کوواریانس

ب) بتا

ج) ☒ واریانس

د) آلفا

– در کدام رویکرد ابتدا ارزش عاملها شناخته می شود و سپس حساسیتها برآورد می گردد؟

الف) ☒ رویکرد سریها ی زمانی

ب) رویکرد مقطعی

ج) رویکرد تحلیل عاملی

د) رویکرد بنیاد ی

– کدامیک به عنوان اوراق بهادار دورگه شناخته شده است؟

الف) اوراق قرضه دولتی

ب) اوراق خزانه

ج) سهام عادی

د) ☒ سهام ممتاز