

گواهی نامه مدیریت
سبد اوراق بهادار



الف- عنوان گواهی نامه: مدیریت سبد اوراق بهادار

ب- پیش نیاز:

مدرک تحلیل گری بازار سرمایه

ج- حدنصاب قبولی:

۱. حدنصاب مدیریت سبد اوراق بهادار ۴۰ از ۱۰۰

۲. حدنصاب مقررات ۵۰ از ۱۰۰

د- تعداد پرسش‌ها: ۷۰

ه- مدت زمان آزمون: ۹۰ دقیقه

و- معافیت‌ها:

۱. دارندگان مدرک CFA (سطوح دوم و سوم) در صورت دریافت گواهی نامه تحلیل گری بازار سرمایه و کسب حداقل ۵۰ درصد نمره مقررات مدیریت سبد اوراق بهادار، با تأیید کمیته گواهی نامه‌های حرفه‌ای، گواهی نامه مدیریت سبد اوراق بهادار را دریافت خواهند کرد.

۲. دارندگان مدرک CIIA در صورت دریافت گواهی نامه تحلیل گری بازار سرمایه و کسب حداقل ۵۰ درصد نمره مقررات مدیریت سبد اوراق بهادار، با تأیید کمیته گواهی نامه‌های حرفه‌ای، گواهی نامه مدیریت سبد اوراق بهادار را دریافت خواهند کرد.

ز- سرفصل مواد امتحانی: (جهت اطلاع از شرح تفصیلی هریک از سرفصل‌ها به سایت <https://icmc.seo.ir> مراجعه نمایید.)

۱- مدیریت سبد اوراق بهادار (تعداد پرسش: ۴۰)

۱-۱ تصمیمات سرمایه‌گذاری و تخصیص دارایی

۲-۱ تعاریف بنیادین و رویکردهای مدیریت سبد اوراق بهادار

۳-۱ مدل‌های تک عاملی، چندعاملی و بازار

۴-۱ مدل قیمت‌گذاری دارایی‌های سرمایه‌ای

۵-۱ مدل قیمت‌گذاری آربیتراژ

۶-۱ ارزیابی عملکرد سبد اوراق بهادار

۷-۱ تجزیه و تحلیل شرکت

۲- مقررات مدیریت سبد اوراق بهادار: (تعداد پرسش: ۳۰)

۱. دستورالعمل تأسیس و فعالیت سبدگردان (براساس آخرین اصلاحات و الحاقات)

۲. دستورالعمل تأسیس و فعالیت مشاور سرمایه‌گذاری (براساس آخرین اصلاحات و الحاقات)

۳. دستورالعمل اجرایی ثبت و گزارش‌دهی رویدادهای مالی صندوق‌های سرمایه‌گذاری مشترک (براساس آخرین اصلاحات و الحاقات)
۴. دستورالعمل صدور واحد سرمایه‌گذاری صندوق‌های سرمایه‌گذاری زمین و ساختمان (براساس آخرین اصلاحات و الحاقات)
۵. دستورالعمل تأسیس صندوق سرمایه‌گذاری زمین و ساختمان (براساس آخرین اصلاحات و الحاقات)
۶. دستورالعمل تدوین روش و تهیه اسناد مزایده در صندوق‌های سرمایه‌گذاری زمین و ساختمان (براساس آخرین اصلاحات و الحاقات)
۷. دستورالعمل نحوه محاسبه خالص ارزش واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق سرمایه‌گذاری زمین و ساختمان (براساس آخرین اصلاحات و الحاقات)
۸. مصوبه اصلاحی دستورالعمل نحوه تعیین قیمت خرید و فروش اوراق بهادار در صندوق‌های سرمایه‌گذاری (براساس آخرین اصلاحات و الحاقات)
۹. اساسنامه و امیدنامه نمونه صندوق‌های سرمایه‌گذاری مشترک (شامل تمامی انواع آن) (براساس آخرین اصلاحات و الحاقات)
۱۰. اساسنامه و امیدنامه نمونه صندوق‌های سرمایه‌گذاری زمین و ساختمان (براساس آخرین اصلاحات و الحاقات)
۱۱. دستورالعمل تأسیس صندوق‌های سرمایه‌گذاری پروژه (براساس آخرین اصلاحات و الحاقات)
۱۲. دستورالعمل تأسیس صندوق‌های سرمایه‌گذاری جسورانه (براساس آخرین اصلاحات و الحاقات)

ی- کاربرد گواهی‌نامه مذکور در نهادهای مالی و شرکت‌های کارگزاری برای تصدی سمت‌های مختلف

ردیف	نام مجوز	سمت	مدرک مورد نیاز مطابق دستورالعمل	مدرک جایگزین مطابق دستورالعمل	توضیحات
۱	سیدگردان	مدیر سید	گواهینامه مدیریت سید اوراق بهادار یا گواهی‌نامه ارزشیابی اوراق بهادار		دستورالعمل تأسیس و فعالیت سیدگردان - پیوست شماره ۴ - اصلاحیه ۱۳۹۳/۰۷/۰۵
۲	صندوق سرمایه‌گذاری	مدیر سرمایه‌گذاری	گواهی‌نامه مدیریت سید اوراق بهادار یا گواهی‌نامه ارزشیابی اوراق بهادار با حداقل یک سال سابقه کار مرتبط -		مطابق تبصره ۴ ماده ۳۹ اساسنامه صندوق‌های سرمایه‌گذاری