

آمادگی آزمون تحلیل‌گری بازار سرمایه

مبتنی بر استاندارد CFA و آخرین سرفصل‌های آزمون

جلد اول شامل سرفصل‌های

اقتصاد پیشرفته

مباحث پیشرفته سرمایه‌گذاری

مباحث پیشرفته در فهم و تحلیل صورت‌های مالی

لغات تخصصی مالی - اقتصادی و درک مطلب متون مالی

گردآوری و تألیف

محمد احمدی، علی ابراهیم‌نژاد، علی سرزعی‌م، طاهره حیاتی و حمیداسلامیان



گروه پژوهشی علمی-ایرانی
انجمن اقتصاددانان ایران



کارگزاری آینده نگر خاورزم
(شرکت سهامی خاص)

فهرست مطالب

۱۰	آشنایی با آزمون تحلیل‌گری بازار سرمایه
۱۰	فهرست مواد آزمون و شرایط قبولی
۱۱	سخن ناشر
۱۲	پیشگفتار حامی کتاب

بخش اول

مباحث پیشرفته سرمایه‌گذاری

	فصل اول
	بازده
۱۵	انواع بازده
۲۴	صرف ریسک سهام
۳۰	بازده مورد نظر سهام
۳۸	میانگین موزون هزینه سرمایه

فصل دوم

	ریسک
۴۱	واریانس، انحراف معیار و کوواریانس
۴۳	ریسک سبد سرمایه‌گذاری
۴۴	تحلیل میانگین-واریانس بدون نرخ بهره بدون ریسک
۴۷	خطوط هم‌بازده و بیضی‌های ریسک یکسان
۵۲	تنوع‌بخشی و بازده
۵۳	تحلیل میانگین-واریانس با نرخ بهره بدون ریسک
۵۵	ارزش در معرض ریسک

فصل سوم

۵۷	ارزش گذاری سهام
۵۷	مفاهیم ارزش گذاری سهام
۶۰	فرآیند ارزش گذاری سهام
۷۰	تکنیک‌های ارزش گذاری سهام
۷۷	ارزش گذاری سهام ممتاز
۷۸	ارزش گذاری حق تقدم
۷۹	تحلیل تکنیکی
۸۱	فرضیه بازارهای کارآ
۸۴	بی‌قاعدگی‌های بازار
۸۵	مالی رفتاری
۸۷	مفاهیم پایه‌ای نرخ بهره

فصل چهارم

۸۷	ساختار زمانی نرخ سود
۸۷	مفاهیم پایه‌ای نرخ بهره
۸۹	عوامل تأثیرگذار بر شکاف بازده
۹۲	منحنی بازده
۹۶	تئوری‌های ساختار زمانی نرخ سود
۹۸	نوسانات بازده و اندازه‌گیری آن
۱۰۰	اندازه‌گیری ریسک نرخ سود

فصل پنجم

۱۰۹	اوراق قرضه
۱۰۹	ریسک اوراق با درآمد ثابت
۱۲۰	ارزش گذاری اوراق بدهی

فصل ششم

۱۲۷	سایر اوراق با درآمد ثابت
۱۲۷	اوراق رهنی

۱۴۰	اوراق بهادار به پشتوانه دارایی‌ها
۱۴۵	تعهدات بدهی وثیقه‌گذاری شده
۱۴۷	اوراق اجاره
۱۵۰	اوراق مشارکت

بخش دوم

مباحث پیشرفته در فهم و تحلیل صورت‌های مالی

فصل هفتم

۱۵۵	مکانیسم‌ها و استانداردهای گزارشگری مالی
۱۵۵	مقدمه
۱۵۸	شناخت در صورت‌های مالی
۱۶۳	صورت‌های مالی میان دوره‌ای
۱۶۶	گزارش‌های حسابرسی اجمالی
۱۷۵	انواع واحدهای پولی
۱۷۸	تجدید ارزیابی و تأثیر آن بر صورت‌های مالی
۱۸۰	لزوم افشای سیاست‌های حسابداری با اهمیت توسط شرکت‌ها
۱۸۲	اهمیت استانداردهای گزارشگری در تجزیه و تحلیل اوراق بهادار

فصل هشتم

۱۸۷	مسائلی در مورد صورت سود و زیان و ترازنامه
۱۸۷	اصول کلی شناسایی هزینه‌ها
۱۹۳	تجزیه و تحلیل اقلام غیرمستمر صورت سود و زیان
۱۹۷	محاسبه سود هر سهم (EPS)
۲۱۵	محاسبه سود جامع و گزارشگری صورت سود و زیان جامع
۲۱۷	کیفیت سود و روش‌های تعیین آن
۲۲۳	تأثیر سرمایه‌ای کردن هزینه‌ها یا به حساب دوره منظور نمودن آنها بر صورت‌های مالی

فصل نهم

۲۲۵	مسایلی در مورد صورت جریان وجوه نقد
۲۲۵	روش‌های مستقیم و غیرمستقیم ارایه جریانات نقدی حاصل از فعالیت‌های عملیاتی
۲۳۰	مراحل تهیه صورت جریان وجوه نقد به صورت مستقیم و غیرمستقیم
۲۳۴	جریان وجه نقد آزاد

فصل دهم

۲۳۷	تکنیک‌های پیشرفته در تجزیه و تحلیل نسبت‌های مالی
۲۳۷	ارزیابی و مقایسه شرکت‌ها با استفاده از تجزیه و تحلیل نسبت‌های مالی
۲۴۵	محدودیت‌های استفاده از تجزیه و تحلیل نسبت‌های مالی
۲۴۶	بازده سرمایه با استفاده از مدل دوپونت و نرخ رشد پایدار یک شرکت

بخش سوم اقتصاد پیشرفته

فصل یازدهم

۲۵۱	مباحث پیشرفته در اقتصاد کلان
۲۵۳	تقاضای کلان
۲۵۳	بازار محصول
۲۵۹	بازار پول
۲۶۱	درآمد کلان تعادلی
۲۶۴	تابع تقاضای کل
۲۶۶	تابع عرضه کل
۲۶۷	عوامل موثر بر منحنی عرضه و تقاضای کل
۲۷۱	ادوار تجاری
۲۷۱	سیاست پولی
۲۷۴	تورم
۲۷۹	منحنی فیلیپس

۲۸۱	سیاست مالی
۲۸۳	تجارت بین الملل
۲۸۸	نرخ ارز
۲۹۵	سیاست پولی و مالی در اقتصاد باز

فصل دوازدهم

۲۹۹	مباحث پیشرفته در اقتصاد خرد
۲۹۹	رفتار تولید کننده در بازار رقابت کامل
۳۰۵	رفتار تولیدکننده در بازار انحصاری
۳۰۸	رفتار تولیدکننده در رقابت انحصاری

بخش چهارم

لغات تخصصی مالی-اقتصادی و درک مطلب متون مالی-اقتصادی زبان

۳۱۷	فصل سیزدهم درک مطلب
-----	------------------------

۳۲۵	فصل چهاردهم سوالات چندگزینه‌ای
-----	-----------------------------------

بخش پنجم، ششم و هفتم

شامل «مباحث پیشرفته در امور مالی شرکتی»، «روش‌های کمی پیشرفته» و «قوانین و مقررات تحلیل‌گری بازار سرمایه» در جلد دوم آورده شده است.