

Phân tích & quản lý đầu tư

Giới thiệu

Học phần này cung cấp kiến thức và kỹ năng liên quan đến hoạt động đầu tư trên thị trường tài chính. Các nội dung chính bao gồm giới thiệu về môi trường và các hoạt động đầu tư, lý thuyết về thiết lập và quản trị danh mục đầu tư, các mô hình và phương pháp phân tích, định giá các chứng khoán cơ bản như cổ phiếu, trái phiếu, hỗ trợ cho việc ra quyết định đầu tư hiệu quả.

Mục tiêu

- Hiểu về bản chất của đầu tư và môi trường đầu tư trên thị trường tài chính
- Nhận diện và tính toán được tỷ suất sinh lợi và rủi ro
- Hiểu về lý thuyết danh mục và ứng dụng
- Ứng dụng các mô hình định giá chứng khoán cơ bản
- Hiểu và ứng dụng quy trình phân tích cơ bản trong phân tích chứng khoán

Mục tiêu

- Hiểu và phân tích dữ liệu tài chính liên quan đến đầu tư
- Ứng dụng một công cụ thống kê hoặc ngôn ngữ lập trình vào việc mô phỏng và phân tích dữ liệu tài chính
- Thực hành viết báo cáo trong phân tích đầu tư

Tài liệu tham khảo

- Bodie, Kane, Marcus, Perrakis and Ryan (2017),
Investments, 11th edition, McGraw – Hill.
- Từ Quang Phương, Phạm Văn Hùng, *Kinh tế Đầu tư*,
Nxb Đại học Kinh tế quốc dân, 2013, 2024

Đánh giá

Quá trình (50%) gồm:

25% (dự học và nộp các bài tập ngắn trên lớp)

25% thực hiện và trình bày bài tập nhóm

Kết thúc học phần (50%): thực hiện đề án cá nhân cuối kỳ

Các chủ đề & lịch trình

- Cơ bản về đầu tư (5/1)
- Lợi nhuận và rủi ro của tài sản (12/1)
- Phân tích vĩ mô và ngành (19/1)
- Phân tích tài chính công ty (26/1)
- Cơ bản về định giá cổ phiếu (2/2)

Các chủ đề & lịch trình

- Thuyết trình bài tập nhóm trên lớp (2/3)
- Phân tích và định giá trái phiếu (9/3 & 16/3)
- Lý thuyết đa dạng hóa danh mục và ứng dụng (20/3 & 30/3)
- CAPM và các mô hình định giá tài sản khác (06/04)

Lưu ý

- Nên thông báo trước cho GV qua email nếu bạn không thể đến lớp, trừ trường hợp bất khả kháng
- Không cần làm bài tập trên giấy, không thi tập trung nhưng phải hiểu công thức để làm đề án nhóm và cá nhân
- Cần có mặt đầy đủ tại buổi thuyết trình nhóm
- GV không giải quyết các trường hợp nộp bài trễ hạn trên LMS dù với bất cứ lý do gì
- Ghi họ tên đầy đủ trên báo cáo nhóm ở trang đầu tiên

Lưu ý

- Môn học có thể hơi nặng về tính toán và phân tích dữ liệu. Tuy nhiên rất hữu ích để phát triển kỹ năng xử lý dữ liệu tài chính.
- Nên liên hệ với trải nghiệm bản thân để hiểu bài sâu hơn và nắm được tinh thần của các lý thuyết đầu tư.
- Email: levanlamtcnh@ueh.edu.vn