Đề cương ôn tập thi tốt nghiệp thị trường chứng khoán

ĐỀ CƯƠNG ÔN THI MÔN THỊ TRƯỜNG CHƯNG KHOÁN

CHƯƠNG I: TỔNG QUAN VỀ TTTC VÀ TTCK

1. Sự hình thành của TTTC. Sơ đồ luôn chuyển vốn trong hệ thống TC

2. K/n, cấu trúc TTTC (chú ý phân biệt TTSC & TTTC)

3. K/n, cấu trúc TTCK (chú ý phân biệt TT tập trung & OTC)

4. Các chủ thể thamgia TTCK và các nguyên tắc hoạt động TTCK.

CHƯƠNG II: CHỨNG KHOÁN

1. Trái phiếu

1.1. K/n và các yếu tố của TP

1.2. Phân loại TP

1.3. Đặc điểm của TP công ty (so sánh với CP, CPUD)

2. Cổ phiếu

2.1. Công ty CP và cổ phiếu

2.2. Các loại CP

- Phân loại theo lợi ích cổ đông (CP thường, CP ưu đãi, đặc điểm quyền của cổ đông,

so sanh với TP)

- Phân loại theo tình trạng phát hành

2.3. Lợi nhuận và đầu tư cổ phiếu

2.4. Các loại giá CP: mệnh giá, thư giá, thị giá, giá trị nội tại

3. Chứng chỉ quỹ

➢ K/n quỹ đầu tư và vai trò của quỹ đầu tư

➢ Các loại hình QĐT

➢ NAV của QDT (bài tập)

4. Các CK phái sinh

➢ Quyền mua cổ phần (K/n, vai trò, giá quyền mua cp, Bài tập)

➢ Chứng quyền (phân biệt quyền mua CP và chứng quyền)

➢ Hợp đồng tương lai (so sánh với HD kỳ hạn)

➢ Hợp đồng quyền chọn (K/n, các yế tố của HD, các kiễu HD, LN, RR các bên khi tham gia

option, các yếu tố ảnh hưởng tối giá option, bài tập.

CHƯƠNG III: TTCK SƠ CẤP

1. K/n, đđ, chủ thể tham gia TTSC

2. Các hình thức chào bán

3. Các vấn đề về phát hành CK ra công chúng

➢ K/n

➢ Nguyên tắc phát hành ck ra công chúng

➢ Đk phát hành

➢ Quy trình, hồ sơ phát hành

4. Bảo lảnh phát hành(k/n, vai trò, các loại hình BL phát hành)

5. Phát hành Cp

➢ Phát hành quyền cho cổ đông hiện hữu

➢ Đánh giá CP

➢ Phát hành CP thường

➢ Trả cổ tức bằng CP

6. Phát hành TP (đấu thầu Tp, Bài tập)

CHƯƠNG IV: SỞ GIAO DỊCH CK1. K/n, chức năng của SGDCK

2. tổ chức hoạt động của SGDCK

3. Thành viên của SGDCK

4. Niêm yết CK

➢ Lợi ích, bất lợi khi niêm yết

➢ DK niêm yết CK (quy định cụ thể tại HOSE)

➢ hủy bỏ niêm yết

5. Giao dịch CK (nghiên cứu kỹ các phương thức giao dịch, các loại lệnh, các quy định về GD, bài

tập về khớp lệnh định kì, liên tục)

CHƯƠNG V: HỆ THỐNG ĐĂNG KÝ, LƯU KÝ, THANH TOÁN BÙ TRỪ, HỆ THỐNG THÔNG

TIN CỦA TTCK

1. K/n, vai trò của hệ thống đăng ký, lưu ký, bù trừ thanh toán

2. K/n, vai trò và phân loại thông tin trên ttck

3. Nguyên tắc công bố thông tin

4. chỉ số CK, PP tính chỉ số, ý nghĩa, áp dụng tính chỉ số Ck BÀI TẬP

CHƯƠNG VI: PHÂN TÍCH VÀ ĐẦU TƯ TRÁI PHIẾU

1. Các loại rủi ro trong đầu tư TP

2. PP đo lường lợi suất (LS hiện hành, LS đáo hạn)

3. Định giá TP

4. Đo lường rủi ro TP (duration, độ lôi)

CHƯƠNG VII: PHÂN TÍCH VÀ ĐẦU TƯ CỔ PHIẾU

1. K/n, phân biệt phân tích cơ bản, phân tích kỹ thuật

2. Quy trình phân tích Top down, Bottom up

3. Tính toán các chỉ tiêu EPS, BV, DPS, SPS, P/E, P/B

4. Định giá cp theo phương pháp chiết khấu dòng cổ tức

➢ Các mô hình CK

➢ Ước lượng suất CK- CAPM

➢ Ước lượng tốc độ tăng trưởng g= b* ROE

Bài tập

CHƯƠNG VIII: QUẢN LÝ DANH MỤC ĐẦU TƯ

1. Tính LN kì vọng, rủi ro của từng Ck riêng lẻ

2. Hệ số hiệp phương sai, tương quan

3. Tính LN, RR của DMDT

4. Các giả thuyết của mô hình Markowitc

5. Mô hình CAPM