

5. คำอธิบายรายวิชา

ตราสารอนุพันธ์อัตราดอกเบี้ยและสัญญาเครดิตอนุพันธ์ การจัดสรรเงินลงทุนและการตัดสินใจที่เกี่ยวข้องในการบริหารพอร์ตลงทุน เทคนิคขั้นสูงในการบริหารพอร์ตตราสารหนี้ เทคนิคขั้นสูงในการบริหารพอร์ตตราสารทุน การเงินเชิงพฤติกรรมและการบริหารความมั่งคั่ง

6. เนื้อหาวิชา

1. บทบาทของตราสารหนี้ในพอร์ตลงทุน
2. กลยุทธ์การบริหารพอร์ตตราสารหนี้เพื่อชำระหนี้
3. กลยุทธ์การบริหารพอร์ตตราสารหนี้ภายใต้มุมมองเกี่ยวกับอัตราดอกเบี้ยในอนาคต
4. บทบาทของตราสารทุนในพอร์ตลงทุน
5. กลยุทธ์การสร้างพอร์ตเพื่อเลียนแบบดัชนี
6. รูปแบบต่างๆ ของการลงทุนในตราสารทุน
7. การบริหารพอร์ตตราสารทุนเพื่อทำกำไร
8. แนวคิดเบื้องต้นของการเงินพฤติกรรม
9. การประยุกต์ใช้การเงินเชิงพฤติกรรมในการลงทุน

7. การวัดผลสัมฤทธิ์ในการเรียน

1. การเข้าชั้นเรียนและการมีส่วนร่วม	10%
2. รายงาน	30%
3. สอบกลางภาค	30%
4. สอบปลายภาค	30%
รวม	100%

8. การประเมินผลการเรียน

A	B+	B	C+	C	D+	D	F
80 ขึ้นไป	75-79	70-74	65-69	60-64	55-59	50-54	ต่ำกว่า 50

9. วิธีการสอนที่เน้นผู้เรียนเป็นสำคัญ

ใช้การสอนที่เน้นผู้เรียนเป็นสำคัญ ได้แก่ การสอนบรรยายร่วมกับสื่อสองทาง โดยเน้นให้นักศึกษาหาทางค้นคว้า ข้อมูลเพิ่มเติม การสอนแบบร่วมมือกันเรียนรู้ การสอนแบบศึกษาด้วยตนเอง การค้นคว้าทางอินเทอร์เน็ต การทำงานกลุ่มและนำเสนอรายงานจากการค้นคว้า การวิเคราะห์กรณีศึกษาเพื่อเปรียบเทียบกับทฤษฎีต่างๆ ที่เรียน การศึกษาโดยใช้ปัญหาเป็นหลัก

รายงานกลุ่ม

ให้นักศึกษาแบ่งทีมทำรายงาน ทีมละไม่เกิน 3 คน โดยแต่ละทีมต้องส่งเล่มรายงาน และจัดทำ PowerPoint presentation (หรือการนำเสนอในรูปแบบอื่นที่เทียบเคียงกันได้) นำเสนอต่อชั้นเรียนในครั้งที่ 15 ของการสอน เวลาของการนำเสนอของแต่ละทีมต้องไม่เกิน 20 นาที (ถ้าเกินจะถูกหักคะแนน) การประเมินผลจะดูที่คุณภาพของเนื้อหา (20% ของเกรด) และคุณภาพของการนำเสนอ (10% ของเกรด)

รายงานฉบับนี้มุ่งหวังให้นักศึกษาทำความเข้าใจความก้าวหน้าทางด้านเทคโนโลยีและวิทยาการสมัยใหม่ที่ผลักดันให้เกิดนวัตกรรมทางการเงินในรูปแบบตราสารทางการเงินรูปแบบใหม่ๆ เพื่อนำเสนอเกี่ยวกับตราสารทางการเงินที่มีนวัตกรรม 1 ตราสาร ทั้งนี้ผู้ศึกษาจะต้องสมมติให้กลุ่มของตนเป็นทีมการตลาดขององค์กร ซึ่งจะต้องพยายามทำให้นักลงทุนสนใจลงทุนในตราสารทางการเงินรูปแบบใหม่ที่ผู้ศึกษานำเสนอให้ได้

เนื่องจากรายงานฉบับนี้มีจุดประสงค์ให้นักศึกษามีความคุ้นเคยกับนวัตกรรมทางการเงินของตลาดทุนในโลกความเป็นจริง เมื่อนักศึกษาเลือกตราสารทางการเงินที่จะทำการนำเสนอแล้ว ข้อมูลที่เกี่ยวข้องกับตราสารจะต้องเป็นข้อมูลจริงที่ตรวจสอบได้ โดยการนำเสนออย่างน้อยควรต้องประกอบด้วยเนื้อหาดังต่อไปนี้

- ชื่อของตราสารอย่างเป็นทางการ
- ลักษณะสำคัญของตราสาร
- ปัจจัยที่ส่งผลกระทบต่อประเมินมูลค่าของตราสารและการทำกำไรของนักลงทุน
- ความเสี่ยงจากการลงทุนในตราสาร
- ข้อดีและข้อด้อยจากการลงทุนในตราสารดังกล่าว

ห้ามคัดลอกผลงานคนอื่นโดยไม่ได้อ้างอิง (plagiarism) ถ้าเป็นข้อความที่ไม่ได้เขียนขึ้นด้วยตนเอง ต้องมีการอ้างอิงทุกครั้ง (ถ้าตรวจสอบพบ จะถูกหักคะแนนครึ่งหนึ่งจากคะแนนเต็ม)

10. เอกสารอ่านประกอบ

ตำราหรือบทความวิชาการที่เกี่ยวข้องกับหัวข้อที่สอน ซึ่งจะกำหนดโดยวิทยากรผู้สอน

11. ตารางกิจกรรมการเรียนรู้การสอน (หน้าถัดไป)

week	Date	Time	Topic	Lecturer
1	10-Nov-18	9.00 – 12.00	บทบาทของตราสารหนี้ในพอร์ตลงทุน	อ.ณัฐวุฒิ คุ้มพัฒนเกียรติชัย, CFA
2	10-Nov-18	13.00 – 16.00	กลยุทธ์การบริหารพอร์ตตราสารหนี้เพื่อชำระหนี้	อ.ณัฐวุฒิ คุ้มพัฒนเกียรติชัย, CFA
3	10-Nov-18	17.00 – 20.00	กลยุทธ์การบริหารพอร์ตตราสารหนี้ภายใต้มุมมองเกี่ยวกับอัตราดอกเบี้ยในอนาคต	อ.ณัฐวุฒิ คุ้มพัฒนเกียรติชัย, CFA
4	11-Nov-18	13.00 – 16.00	การเงินพฤติกรรมเบื้องต้น	อ.ณัฐวุฒิ เจนวิทยาโรจน์, CFA
5	11-Nov-18	17.00 – 20.00	การทดสอบความมีประสิทธิภาพของตลาด	อ.ณัฐวุฒิ เจนวิทยาโรจน์, CFA
6	17-Nov-18	9.00 – 12.00	กลยุทธ์การสร้างพอร์ตเพื่อเลียนแบบดัชนี	อ.ณัฐวุฒิ คุ้มพัฒนเกียรติชัย, CFA
7	17-Nov-18	13.00 – 16.00	กลยุทธ์การลงทุนภายใต้เส้นอัตราผลตอบแทน	อ.ณัฐวุฒิ คุ้มพัฒนเกียรติชัย, CFA
8	17-Nov-18	17.00 – 20.00	กลยุทธ์การลงทุนภายใต้ความน่าเชื่อถือ	อ.ณัฐวุฒิ คุ้มพัฒนเกียรติชัย, CFA
สอบ Midterm วันเสาร์ที่ 24 พฤศจิกายน 2561 เวลา 09.00 - 12.00 น.				
9	24-Nov-18	13.00 – 16.00	กลยุทธ์การบริหารพอร์ตตราสารทุน 1	อ.ธนัท เจตจันทร์ประภา, CFA
10	24-Nov-18	17.00 – 20.00	กลยุทธ์การบริหารพอร์ตตราสารทุน 2	อ.ธนัท เจตจันทร์ประภา, CFA
11	1-Dec-18	9.00 – 12.00	สิ่งผิดปกติในตลาด	อ.ณัฐวุฒิ เจนวิทยาโรจน์, CFA
12	1-Dec-18	13.00 – 16.00	ทฤษฎี prospect	อ.ณัฐวุฒิ เจนวิทยาโรจน์, CFA
13	1-Dec-18	17.00 – 20.00	ความเอนเอียงของพฤติกรรมนักลงทุน	อ.ณัฐวุฒิ เจนวิทยาโรจน์, CFA
14	15-Dec-18	9.00 – 12.00	ผลิตภัณฑ์การเงินเชิงซ้อน	อ.ณัฐวุฒิ คุ้มพัฒนเกียรติชัย, CFA
15	15-Dec-18	13.00 – 16.00	นำเสนอรายงานกลุ่ม	อ.ณัฐวุฒิ คุ้มพัฒนเกียรติชัย, CFA
สอบ Final วันเสาร์ที่ 22 ธันวาคม 2561 เวลา 09.00 - 12.00 น.				