

โครงการอบรมหลักสูตร
ติวเข้มสำหรับนักวิเคราะห์การเงิน เพื่อเตรียมความพร้อมในการสอบ
Chartered Financial Analyst (CFA)
Level 1
ปี 2553

โดย
คณะกรรมการธุรกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์ (NIDA)
ร่วมกับ
สมาคมนักวิเคราะห์หลักทรัพย์ (SAA)
และ
สถาบันพัฒนาความรู้ตลาดทุน ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (TSI)

หลักการและเหตุผล

หลักสูตร Chartered Financial Analyst (CFA) เป็นหลักสูตรที่รู้จักภายใต้ชื่อ CFA Program ซึ่งเป็นหลักสูตรในระดับอุดมศึกษา โดยมุ่งเน้นกลุ่มบุคลากรที่เกี่ยวข้องในวิชาชีพด้านการวิเคราะห์และการลงทุน ซึ่งได้แก่นักวิเคราะห์หลักทรัพย์และผู้จัดการกองทุน เป็นต้น

จากสถิติที่ผ่านมา พบว่ามีผู้สมัคร 1 ใน 5 ราย ที่สมัครเข้าร่วมหลักสูตรและมีความพยายามต่อเนื่องจนประสบความสำเร็จได้รับสิทธิเป็น CFA charterholders โดย CFA Institute ได้จัดให้มีการสอบข้อสอบ CFA ระดับ 1 ปีละ 2 ครั้ง คือในเดือนมิถุนายน และธันวาคม ของทุกปี สำหรับการสอบข้อสอบ CFA ในระดับ 2 และ 3 จัดขึ้นปีละครั้งในเดือนมิถุนายน ปัจจุบัน CFA Institute มีสมาชิกที่สอบผ่านหลักสูตร CFA แล้วจำนวนกว่า 69,600 คนจาก 134 สมาชิกสมาคมของ CFA Institute ใน 55 ประเทศทั่วโลก

การสอบผ่านและได้รับ CFA Chartered นั้นถือเป็นปัจจัยที่สำคัญในการก้าวสู่ความเป็นผู้เชี่ยวชาญในสายวิชาชีพการลงทุนทั้งในและต่างประเทศ เพื่อที่จะได้ CFA Chartered ผู้เข้าสอบ CFA Program นั้นจะต้องสอบผ่านทั้ง 3 ระดับ ในระยะเวลาขั้นต่ำ 3 ปี และผู้ที่สอบผ่านข้อสอบ CFA ทั้ง 3 ระดับ จะได้รับใบประกาศนียบัตร Chartered Financial Analyst® (CFA®) และได้รับอนุญาตให้ใช้ CFA ต่อท้ายชื่อ (เมื่อมีคุณสมบัติในด้านต่างๆ ครบถ้วน ซึ่งรวมถึงประสบการณ์ทำงานในสาขาที่เกี่ยวกับการเงินและการลงทุน การลงนามยอมรับการปฏิบัติงานตามหลักจรรยาบรรณที่กำหนดโดย CFA Institute) เมื่อนับรวมผู้มีสิทธิเป็น CFA charterholders ใหม่ทั้งหมดในประเทศไทยขณะนี้ มีจำนวนประมาณ 260 ราย

คณะกรรมการธุรกิจ สถาบันบัณฑิตพัฒนบริหารศาสตร์ (NIDA) จึงได้ร่วมมือกับ สถาบันพัฒนาความรู้ตลาดทุน ตลาดหลักทรัพย์แห่งประเทศไทย (TSD) และสมาคมนักวิเคราะห์หลักทรัพย์ (SAA) จัด “หลักสูตรติวเข้มสำหรับนักวิเคราะห์การเงิน เพื่อเตรียมความพร้อมในการสอบ Chartered Financial Analysts (CFA) – Level 1” ขึ้น เพื่อสร้างความก้าวหน้าให้กับผู้ที่สนใจในวิชาชีพสำหรับนักวิเคราะห์การเงิน โดยเฉพาะ

วัตถุประสงค์

1. เพื่อเตรียมความพร้อมให้นักศึกษา และบุคลากรทางด้านวิชาชีพทางการเงินในการสอบ CFA (Level 1)
2. เพื่อเป็นการต่อยอดการศึกษาในระดับ MBA และพัฒนาบุคลากรทางด้านบริหารธุรกิจระดับปริญญาโท ให้มีความเชี่ยวชาญเป็นพิเศษทางด้านวิชาชีพนักวิเคราะห์การเงิน

กลุ่มเป้าหมาย

- ผู้ที่ต้องการเตรียมความพร้อมในการสอบ CFA – Level 1
- รับจำนวนไม่เกิน 60 คน

คุณสมบัติของผู้เข้าร่วมโครงการฯ

1. จบการศึกษาหรือกำลังศึกษาระดับปริญญาโท MBA หรือเทียบเท่า
2. จบการศึกษาระดับปริญญาตรี และมีประสบการณ์ทำงานด้านการเงินนับจากจบการศึกษาระดับปริญญาตรีอย่างน้อย 1 ปี

เนื้อหาหลักสูตร

หลักสูตรนี้เหมาะสำหรับนักวิเคราะห์การเงิน เพื่อเตรียมความพร้อมในการสอบ (CFA) Level 1 ครอบคลุมเนื้อหาในการสอบ โดยประกอบด้วย 4 หมวดวิชา ดังนี้

หมวดที่ 1: Ethical and Professional Standards

การมุ่งเน้นสร้างจริยธรรมและจรรยาบรรณ และความเป็นมืออาชีพทางการเงินแก่ผู้ประกอบการวิชาชีพทางการเงิน

หมวดที่ 2: Investment Tools

2.1 Quantitative Analysis ศึกษาหลักการและการวิเคราะห์เชิงปริมาณสำหรับปัญหาทางธุรกิจ โดยใช้ทฤษฎีและวิธีการทางสถิติและคณิตศาสตร์เข้ามาใช้ในการตัดสินใจทางการบริหาร รวมทั้งการใช้เทคนิคต่างๆ เป็นหลักของการวิเคราะห์ดำเนินงานที่ให้ผลสูงสุดในเชิงปริมาณ

2.2 Economics มุ่งเน้นการนำเอาทฤษฎีทางเศรษฐศาสตร์มาช่วยในการตัดสินใจ และการวางแผนธุรกิจ รวมทั้งศึกษาวิเคราะห์กรณีตัวอย่างจากสถานการณ์เศรษฐกิจทั้งประเทศไทยและต่างประเทศ โดยศึกษาความสัมพันธ์ของตัวแปรที่สำคัญทางเศรษฐกิจ

2.3 Financial Statement Analysis แนวคิดในการตัดสินใจการวางแผนแก้ปัญหาทางธุรกิจ โดยใช้ความรู้ทางด้านการบัญชีบริหาร กลยุทธ์การเงินระยะยาวของบริษัท

2.4 Corporate Finance การแนะนำการประยุกต์หลักทางการเงินของธุรกิจหน่วยงานสมัยใหม่ การพยากรณ์กระแสเงินสด นโยบายการจ่ายเงินปันผลที่เหมาะสม การควบคุมกิจการ โครงสร้างทางการเงิน เงินทุนกับความเสี่ยง และความเสี่ยงจากการปรับเปลี่ยนผลตอบแทนของเงินทุน

หมวดที่ 3: Asset Valuation

3.1 Equity Investment ศึกษาความสำคัญของการลงทุนในระบบเศรษฐกิจ ประเภทของหลักทรัพย์ แนวความคิดที่จำเป็นสำหรับการตัดสินใจเลือกลงทุนในหลักทรัพย์ประเภทต่างๆ ปัจจัยที่มีผลต่อระดับราคาหลักทรัพย์ การประเมินราคาหลักทรัพย์ ความเสี่ยง ความพอใจในความเสี่ยง การคำนวณหาอัตราผลตอบแทนจากการลงทุน นโยบายการลงทุนอันมีวัตถุประสงค์เพื่อให้ได้มาซึ่งอัตราผลตอบแทนที่ต้องการในระดับความเสี่ยงที่ผู้ลงทุนยอมรับได้

3.2 Fixed Income Investment ศึกษาชนิดของหลักทรัพย์การเงิน แหล่งและชนิดของข้อมูลที่ใช้ในการวิเคราะห์วิธีการและหลักการต่างๆ เพื่อใช้เป็นแนวทางในการตัดสินใจลงทุน

3.3 Derivatives ความรู้ในเชิงวิเคราะห์ทั้งในด้านทฤษฎี และด้านกลไกการทำงานของตราสารอนุพันธ์ โดยใช้ตัวอย่างทั้งเชิงคณิตศาสตร์ และเชิงตัวเลขเพื่อพัฒนาความเข้าใจในเรื่องราวของตราสารอนุพันธ์ทางการเงินให้มากยิ่งขึ้น หลักการ

พื้นฐานของตราสารอนุพันธ์ทางการเงินประเภทต่างๆ ได้แก่ การซื้อขายล่วงหน้า (Futures), สัญญาซื้อขายล่วงหน้า (forward), การแลกเปลี่ยน (swaps), และสิทธิในการซื้อ หรือขายหุ้นสามัญ (options) แนวคิดในเรื่องกลยุทธ์การซื้อขาย และการป้องกันความเสี่ยงโดยใช้ตราสารอนุพันธ์

3.4 Alternative Investments หลักการ และการปฏิบัติขั้นพื้นฐานในการจัดการลงทุนในหลักทรัพย์อื่นๆ

หมวดที่ 4: Securities Analysis and Portfolio Management

ชนิดของหลักทรัพย์การเงิน แหล่งและชนิดของข้อมูลที่น่ามาใช้ในการวิเคราะห์วิธีการและหลักการต่างๆ เพื่อใช้เป็นแนวทางในการตัดสินใจลงทุน หลักการ และการปฏิบัติขั้นพื้นฐานในการจัดการลงทุนในหลักทรัพย์ทั้งการจัดการการลงทุนของบุคคล และการจัดการการลงทุนของสถาบันการเงิน

หัวข้อการอบรม

CFA (Level 1) อบรมทุกวันเสาร์-อาทิตย์ เวลา 9.00-16.00 น. โดยใช้เวลาอบรมและติวเข้มรวม 6 วันๆ ละ 6 ชั่วโมง รวม 36 ชั่วโมง (หรือประมาณ 1.5 เดือน)

วัน	ครั้งที่	หัวข้อวิชา	วิทยากร	หมายเหตุ
เสาร์ที่ 1 (9.00-16.00 น.)	1	Intro & Ethics	อ. กำพล	
	2	Quantitative Methods	อ. ณรงค์ฤทธิ์	
อาทิตย์ที่ 1 (9.00-16.00 น.)	3	Financial Statement Analysis	อ. บัญชา	
	4	Financial Statement Analysis	อ. บัญชา	
เสาร์ที่ 2 (9.00-16.00 น.)	5	Economics	อ. สุปรียา	
	6	Economics	อ. สุปรียา	
อาทิตย์ที่ 2 (9.00-16.00 น.)	7	Equity Investments	อ. บัญชา	
	8	Derivative Instruments	อ. บัญชา	
เสาร์ที่ 3 (9.00-16.00 น.)	9	Alternative Investments	อ. ณรงค์ฤทธิ์	
	10	Securities Analysis and Portfolio Management	อ. ณรงค์ฤทธิ์	
อาทิตย์ที่ 4 (9.00-16.00 น.)	11	Fixed Income Investments	อ. กำพล	
	12	Ethics	อ. จอมขวัญ	
รวม 36 ชม.	6 วัน			

ระยะเวลาการอบรม

- รุ่นที่ 1 : 8-9, 15-16, 22- 23 พฤษภาคม 2553
- รุ่นที่ 2 : 13-14, 20-21, 27-28 พฤศจิกายน 2553

เวลาอบรม วันเสาร์ และอาทิตย์ เวลา 09.00-16.00 น.

สถานที่อบรม ณ โรงแรมวินเซอร์

รับสมัครจำนวน ไม่เกิน 60 คน

ค่าธรรมเนียมการอบรมทั้งหลักสูตร 18,500 บาท

พิเศษ ผู้ที่ชำระค่าธรรมเนียมล่วงหน้าอย่างน้อย 15 วัน จะได้รับ เครื่องคิดเลข TEXAS รุ่น PRO 1 (เครื่อง ฟรี)

ระเบียบการสมัคร และชำระค่าลงทะเบียน

กรุณากรอกข้อความในใบสมัครให้ชัดเจน และปฏิบัติตามขั้นตอนในการชำระเงินค่าลงทะเบียน (ทำได้ 4 ช่องทาง) ดังต่อไปนี้

1. ใช้แคชเชียร์เช็ค สั่งจ่าย "ศูนย์นวัตกรรมทางธุรกิจ คณะบริหารธุรกิจ" และจัดส่งมาที่

“ศูนย์นวัตกรรมทางธุรกิจ คณะบริหารธุรกิจ นิศา ชั้น 8 อาคารเอนกประสงค์ 118 ถ.เสรีไทย แขวงคลองจั่น เขตบางกะปิ กรุงเทพฯ 10240”

2. ชำระโดยเงินสด โดยโอนเงินเข้าบัญชี ธนาคารกสิกรไทย สาขาคลองจั่น ในนาม “ศูนย์นวัตกรรมทางธุรกิจ

คณะบริหารธุรกิจ” เลขที่ 040-2-25750-6 พร้อม แฟกซ์หลักฐานการโอนเงิน พร้อมใบสมัครที่กรอกข้อมูลครบถ้วนแล้วมาที่เบอร์ 0-2374-3282 หรือ 0-2375-3924

รายละเอียดการรับวุฒิปัต

-เข้าอบรมไม่ต่ำกว่า 80% ของการอบรมทั้งหมด

-สามารถรับวุฒิปัตได้หลังการอบรมวันสุดท้าย

หมายเหตุ

1. ค่าธรรมเนียมนี้รวม คู่มือเตรียมสอบ เอกสารประกอบการบรรยาย และอาหารกลางวัน อาหารว่าง
2. ผู้เข้าอบรมจะได้รับสิทธิในการทดลองทำตัวอย่างข้อสอบผ่าน e-Tutor เป็นระยะเวลา 3 เดือน หลังจากวันที่เข้าอบรม
3. วันและเวลาการอบรมอาจมีการเปลี่ยนแปลงได้ตามความเหมาะสม

TRIP

ความแตกต่างระหว่าง CISA กับ CFA

1. แหล่งที่มา หลักสูตร CFA เป็นหลักสูตรดั้งเดิมสำหรับนักวิเคราะห์การลงทุน มีผู้บริหารโครงการ คือ CFA Institute [เดิมคือ Association for Investment Management and Research (AIMR)] ซึ่งมีสำนักงานอยู่ที่ประเทศสหรัฐอเมริกา และได้รับการยอมรับในหลายประเทศทั่วโลก

หลักสูตร CISA มีโครงสร้างและองค์ความรู้เดียวกับ CFA โดยได้รับอนุญาตและการสนับสนุนจาก AIMR และสมาคมนักวิเคราะห์หลักทรัพย์ (Securities Analysts Association หรือ SAA) เป็นผู้บริหารจัดการโครงการ และปรับปรุงหลักสูตรให้เข้ากับสถานการณ์ในประเทศไทย

2. ภาษาที่ใช้ในการสอบ ทั้งคำถามและคำตอบสำหรับการสอบ CFA เป็นภาษาอังกฤษ ในขณะที่การสอบ CISA ใช้ภาษาไทยเป็นหลัก
3. ความเชี่ยวชาญในด้านกฎหมายไทยและจรรยาบรรณ ผู้สมัครสอบ CISA จะต้องมีความรู้ในด้านกฎหมายไทยด้วย เนื่องจากหลักสูตร CISA มีวิชาที่เพิ่มเติม คือ วิชากฎหมายไทย (ระดับ 1)