

Turnitin Originality Report

Document Viewer

Processed on: 24-Oct-2024 12:09 AM HKT
ID: 2494816815
Word Count: 28349
Submitted: 2

DeAnNEU By Tran Bao Hoang Linh

Similarity Index 12%	Similarity by Source	
	Internet Sources:	15%
	Publications:	15%
	Student Papers:	6%

include quoted
 include bibliography
 excluding matches < 1%
mode:

- 3% match (Internet from 26-Sep-2022)
<https://www.econstor.eu/bitstream/10419/224434/1/gbfr2019-24-4-024.pdf>
- 2% match (Internet from 01-Dec-2020)
https://www.ctu.edu.vn/images/upload/TT36/2020/Bieu_18_E.pdf
- 1% match (Internet from 17-Sep-2021)
https://hvtc.edu.vn/Portals/29/Ky_yeu_OLP_KTL_2020_Tap_2.docx
- 1% match (Internet from 17-Sep-2021)
https://hvtc.edu.vn/Portals/29/Ky_yeu_OLP_KTL_2019_tap_1.docx
- 1% match (Internet from 17-Sep-2021)
https://hvtc.edu.vn/Portals/29/Ky_yeu_OLP_KTL_2019_tap_2.docx
- 1% match (Internet from 17-Sep-2021)
https://hvtc.edu.vn/Portals/29/Ky_yeu_OLP_KTL_2018_tap_1.pdf
- 1% match (student papers from 31-Jul-2024)
[Submitted to Foreign Trade University on 2024-07-31](#)
- 1% match (Internet from 16-Jan-2021)
<http://en.ueh.edu.vn>
- 1% match (Internet from 28-Sep-2021)
https://ueh.edu.vn/images/upload/editer/UEH_Ky%20yeu%20hoi%20thao%20quoc%20gia_27.04.2021.pdf
- 1% match (publications)
Ton Duc Thang University
- 1% match (Internet from 21-Oct-2021)
<https://psdh.uel.edu.vn/Resources/Docs/SubDomain/psdh/Daotao/TienSi/TT-LATS/Kinh%20t%E1%BA%BF%20h%E1%BB%8Dc/16%20Nguy%E1%BB%85n%20V%C4%83n%20N%C3%AAn/5.%20Luan%20an%20tie%20Nguy%E1%BB%85n%20V%C4%83n%20N%C3%AAn.pdf>

BỘ GIÁO DỤC VÀ ĐÀO TẠO TRƯỜNG ĐẠI HỌC KINH TẾ QUỐC DÂN TRẦN BẢO HOÀNG LINH MÔ HÌNH HÓA LỢI TỨC CỔ PHIẾU TRÊN THỊ TRƯỜNG CHỨNG KHOÁN VIỆT NAM: CÁC YẾU TỐ TÁC ĐỘNG VÀ DỰ BÁO ĐỀ ÁN TỐT NGHIỆP THẠC SĨ NGÀNH TOÁN KINH TẾ TÀI CHÍNH HẠ NỘI - 2024 BỘ GIÁO DỤC VÀ ĐÀO TẠO TRƯỜNG ĐẠI HỌC KINH TẾ QUỐC DÂN TRẦN BẢO HOÀNG LINH MÔ HÌNH HÓA LỢI TỨC CỔ PHIẾU TRÊN THỊ TRƯỜNG CHỨNG KHOÁN VIỆT NAM: CÁC YẾU TỐ TÁC ĐỘNG VÀ DỰ BÁO Chuyên ngành: Toán kinh tế - tài chính Mã số: 8310101 ĐỀ ÁN TỐT NGHIỆP THẠC SĨ Người hướng dẫn khoa học: TS. Lê Anh Đức HẠ NỘI - 2024 LỜI CAM KẾT Tôi đã đọc và hiểu về các hành vi vi phạm sự trung thực trong học thuật. Tôi cam đoan rằng, đề án này do tôi tự thực hiện và không vi phạm yêu cầu về sự trung thực trong học thuật. Học viên Trần Bảo Hoàng Linh LỜI CAM ON Trước hết, tôi xin gửi lời cảm ơn chân thành đến TS. Lê Anh Đức - người hướng dẫn khoa học, người đã tận tình chỉ bảo, hướng dẫn tôi trong suốt quá trình thực hiện đề án. Tôi xin gửi lời cảm ơn sâu sắc tới TS. Nguyễn Mạnh Thế vì sự hỗ trợ, kiến thức chuyên môn, cùng với những đóng góp quý báu của thầy đã giúp tôi không chỉ hoàn thành đề án này, mà còn học hỏi được nhiều kinh nghiệm có giá trị. Bên cạnh đó, tôi cũng xin chân thành cảm ơn đến các chuyên gia, nhà nghiên cứu tại khoa Toán trường Đại học Kinh tế Quốc dân, những người đã cung cấp những kiến thức chuyên sâu trong suốt quá trình tôi học tập và nghiên cứu tại khoa. Những sự giúp đỡ này đã giúp tôi có thêm nền tảng để hoàn thiện đề án của mình. Tôi xin bày tỏ sự cảm ơn tới Phòng Sau Đại học và các phòng chức năng của trường Đại học Kinh tế Quốc dân, những đơn vị đã tạo điều kiện thuận lợi và hỗ trợ tôi trong suốt quá trình học tập và nghiên cứu. Cuối cùng, tôi xin cảm ơn gia đình đã hỗ trợ tôi trong suốt thời gian thực hiện đề án này.

MỤC LỤC DANH MỤC HÌNH MỞ ĐẦU.....1

CHƯƠNG 1: CƠ SỞ LÝ THUYẾT VÀ TỔNG QUAN NGHIÊN CỨU.....5

1.1. Cơ sở lý thuyết.....5

1.1.1. Thị trường chứng khoán Việt Nam5

1.1.2. Các chỉ số chứng khoán tại Việt Nam.....7

1.1.3. Khái niệm cơ bản về lợi tức cổ phiếu.....9

1.1.4. Khái niệm về các loại dự báo.....10

1.1.5. Khái niệm về các mô hình dự báo.....12

1.2. Tổng quan nghiên cứu.....14

CHƯƠNG 2: PHƯƠNG PHÁP NGHIÊN CỨU VÀ DỮ LIỆU THU THẬP.....20

2.1. Phương pháp nghiên cứu.....20

2.1.1. Phương pháp nghiên cứu định lượng20

2.1.2. Phương pháp nghiên cứu dữ liệu theo thời gian.....20

2.1.3. Phương pháp kết hợp.....21

2.2. Mô hình kinh tế lượng trong phân tích lợi tức cổ phiếu.....21

2.2.1. Mô Hình VECM (Vector Error Correction Model)21

2.2.2. Diễn giải chi tiết các thành phần trong mô hình VECM:.....22

2.2.3. Ước lượng mô hình VECM.....26

2.2.4. Ưu nhược điểm của mô hình VECM:.....27

2.3. Dữ liệu thu thập.....28

2.3.1. Cơ sở lý thuyết và nghiên cứu trước đây.....28

2.3.2. Lý do lựa chọn dữ liệu giai đoạn 2012-2022.....28

2.3.3. Dữ liệu giá cổ phiếu.....29

2.3.4. Dữ liệu chỉ số vĩ mô trong