

TRƯỜNG ĐẠI HỌC NHA TRANG

Khoa: KẾ TOÁN – TÀI CHÍNH

Bộ môn: TÀI CHÍNH – NGÂN HÀNG

ĐỀ CƯƠNG HỌC PHẦN

1. Thông tin về học phần

Tên học phần

- Tiếng Việt: **QUẢN TRỊ RỦI RO TÀI CHÍNH**

- Tiếng Anh: Financial Risk Management

Mã học phần: FIB365

Số tín chỉ: 3 (3-0)

Đào tạo trình độ: *Đại học*

Học phần tiên quyết: *Quản trị tài chính 1,2, Tài chính quốc tế.*

2. Mô tả tóm tắt học phần

Học phần trang bị cho sinh viên những kiến thức cơ bản về rủi ro và quản trị rủi ro tài chính, giới thiệu hoạt động trên thị trường các công cụ phái sinh như Forward, Future, Options, Swap. Đồng thời, học phần cũng trình bày ứng dụng các công cụ phái sinh để đầu tư vào các tài sản tài chính như lãi suất, tỷ giá và chứng khoán, cũng như thiết lập các chiến lược bảo hiểm rủi ro do biến động giá trên thị trường tài chính.

3. Mục tiêu:

Giúp sinh viên biết nhận dạng và đo lường được rủi ro tài chính tại doanh nghiệp và thị trường, đồng thời vận dụng kiến thức và kỹ năng trong việc ra quyết định quản trị rủi ro tài chính cho doanh nghiệp.

4. Kết quả học tập mong đợi (KQHT): Sau khi học xong học phần, sinh viên có thể:

- a. Nhận dạng và phân tích được rủi ro tài chính tại doanh nghiệp và trên thị trường.
- b. Hiểu, biết các chiến lược quản trị rủi ro tài chính
- c. Ứng dụng các sản phẩm phái sinh trong việc quản trị rủi ro tài chính

5. Nội dung giảng dạy

STT	Chương/Chủ đề	Nhằm đạt KQHT	Số tiết	
			LT	TH
1	Chủ đề 1. Rủi ro và các công cụ phòng ngừa rủi ro	a	6	
1.1	Rủi ro tài chính	a		
1.2	Các công cụ phòng ngừa rủi ro	a		
2	Chủ đề 2. Hợp đồng kỳ hạn và giao sau	B,c	16	
2.1	Cấu trúc thị trường kỳ hạn và giao sau	b,c		
2.2	Các nguyên tắc định giá kỳ hạn và giao sau	b,c		
2.3	Ứng dụng hợp đồng kỳ hạn và giao sau trong quản trị rủi ro	b,c		
3	Chủ đề 3. Hợp đồng quyền chọn	b,c	17	
3.1	Cấu trúc thị trường quyền chọn	b,c		
3.2	Nguyên tắc định giá quyền chọn	b,c		
3.3	Các chiến lược phòng ngừa rủi ro bằng hợp đồng quyền chọn	b,c		
3.4				
4	Chủ đề 4. Hoán đổi	b,c	6	
4.1	Hoán đổi tiền tệ	b,c		
4.2	Hoán đổi lãi suất	b,c		

6. Tài liệu dạy và học:

STT	Tên tác giả	Tên tài liệu	Năm xuất bản	Nhà xuất bản	Địa chỉ khai thác tài liệu	Mục đích sử dụng	
						Tài liệu chính	Tham khảo
1	Bộ môn	Bài giảng	2016		Thư viện số	x	

	TCNH	Quản trị rủi ro tài chính			ĐHNT		
2	Nguyễn Minh Kiều	Quản lý rủi ro tài chính	2009	Thống kê	Thư viện ĐHNT		x
3	Nguyễn Thị Ngọc Trang	Quản trị rủi ro tài chính	2007	Thống kê	Thư viện ĐHNT		x
4	Phan Thị Cúc, Nguyễn Trung Trực	Tài chính doanh nghiệp 3	2010	Tài chính	Thư viện ĐHNT		x
5	Hull, J.C	Options, Futures and Other Derivatives	2005	Prentice Hall			x

7. Đánh giá kết quả học tập:

STT	Hình thức đánh giá	Nhằm đạt KQHT	Trọng số (%)
1	Các lần kiểm tra giữa kỳ	a,b	25
2	Bài tập cá nhân và nhóm	a,b,c,	25
3	Thi kết thúc học phần	a, b, c	50

NHÓM GIẢNG VIÊN BIÊN SOẠN

(Ký và ghi họ tên)

Ths Chu Thị Lê Dung

ThS. Nguyễn Thị Kim Dung

TRƯỞNG KHOA/VIỆN

(Ký và ghi họ tên)

TRƯỞNG BỘ MÔN

(Ký và ghi họ tên)

ĐỀ CƯƠNG CHI TIẾT HỌC PHẦN

1. Thông tin về học phần

Tên học phần

- Tiếng Việt: **QUẢN TRỊ RỦI RO TÀI CHÍNH**

- Tiếng Anh: Financial Risk Management

Mã học phần: FIB365

Số tín chỉ: 3 (3-0)

Đào tạo trình độ: *Đại học*

Học phần tiên quyết: *Quản trị tài chính 1,2, Tài chính quốc tế.*

2. Thông tin giảng viên

Họ và tên:

Chu Thị Lê Dung Chức danh, học hàm, học vị: Thạc sỹ

Điện thoại: Email: dungctl@ntu.edu.vn

Nguyễn Thị Kim Dung Chức danh, học hàm, học vị: ThS

Điện thoại: Email: dungnnk@ntu.edu.vn

Địa điểm, lịch tiếp SV: Văn phòng Bộ môn Tài chính, Tầng 5, Khu nhà đa năng.

3. Mô tả tóm tắt học phần

Học phần trang bị cho sinh viên những kiến thức cơ bản về rủi ro và quản trị rủi ro tài chính, giới thiệu hoạt động trên thị trường các công cụ phái sinh như Forward, Future, Options, Swap. Đồng thời, học phần cũng trình bày ứng dụng các công cụ phái sinh để đầu tư vào các tài sản tài chính như lãi suất, tỷ giá và chứng khoán, cũng như thiết lập các chiến lược bảo hiểm rủi ro do biến động giá trên thị trường tài chính.

4. Mục tiêu:

Giúp sinh viên biết nhận dạng và đo lường được rủi ro tài chính tại doanh nghiệp và thị trường, đồng thời vận dụng kiến thức và kỹ năng trong việc ra quyết định quản trị rủi ro tài chính cho doanh nghiệp.

5. Kết quả học tập mong đợi (KQHT): Sau khi học xong học phần, sinh viên có thể:

- a. Nhận dạng và phân tích được rủi ro tài chính tại doanh nghiệp và trên thị trường.
- b. Hiểu, biết các chiến lược quản trị rủi ro tài chính
- c. Ứng dụng các sản phẩm phái sinh trong việc quản trị rủi ro tài chính

6. Nội dung giảng dạy

<i>STT</i>	<i>Chương/Chủ đề</i>	<i>Nhằm đạt KQHT</i>	<i>Số tiết</i>	<i>Phương pháp dạy – học</i>	<i>Chuẩn bị của người học</i>
1	Chủ đề 1. Rủi ro và các công cụ phòng ngừa rủi ro	a	6	Trao đổi và diễn giải	
1.1	Rủi ro tài chính	a			
1.2	Các công cụ phòng ngừa rủi ro	a			
2	Chủ đề 2. Hợp đồng kỳ hạn và giao sau	B,c	16	Thuyết giảng lý thuyết, kết hợp với làm bài tập	Đọc tài liệu và chuẩn bị bài trước khi đến lớp theo yêu cầu và hướng dẫn cụ thể của giáo viên
2.1	Cấu trúc thị trường kỳ hạn và giao sau	b,c			
2.2	Các nguyên tắc định giá kỳ hạn và giao sau	b,c			
2.3	Ứng dụng hợp đồng kỳ hạn và giao sau trong quản trị rủi ro	b,c			
3	Chủ đề 3. Hợp đồng quyền chọn	b,c	17	Thuyết giảng lý thuyết, kết hợp với làm bài tập	Đọc tài liệu và chuẩn bị bài trước khi đến lớp theo
3.1	Cấu trúc thị trường quyền chọn	b,c			
3.2	Nguyên tắc định giá quyền chọn	b,c			
3.3	Các chiến lược phòng ngừa rủi ro bằng hợp đồng quyền chọn	b,c			
3.4					

					yêu cầu và hướng dẫn cụ thể của giáo viên
4	Chủ đề 4. Hoán đổi	b,c	6	Thuyết giảng lý thuyết, kết hợp với làm bài tập	Đọc tài liệu và chuẩn bị bài trước khi đến lớp theo yêu cầu và hướng dẫn cụ thể của giáo viên
4.1	Hoán đổi tiền tệ	b,c			
4.2	Hoán đổi lãi suất	b,c			

7. Tài liệu dạy và học:

STT	Tên tác giả	Tên tài liệu	Năm xuất bản	Nhà xuất bản	Địa chỉ khai thác tài liệu	Mục đích sử dụng	
						Tài liệu chính	Tham khảo
1	Bộ môn TCNH	Bài giảng Quản trị rủi ro tài chính	2016		Thư viện số ĐHNT	x	

2	Nguyễn Minh Kiều	Quản lý rủi ro tài chính	2009	Thống kê	Thư viện ĐHNT		x
3	Nguyễn Thị Ngọc Trang	Quản trị rủi ro tài chính	2007	Thống kê	Thư viện ĐHNT		x
4	Phan Thị Cúc, Nguyễn Trung Trực	Tài chính doanh nghiệp 3	2010	Tài chính	Thư viện ĐHNT		x
5	Hull, J.C	Options, Futures and Other Derivatives	2005	Prentice Hall			x

8. Yêu cầu của giảng viên đối với học phần:

Sinh viên tham dự học tập đầy đủ tại lớp, làm bài tập và đọc bài trước ở nhà.

9. Đánh giá kết quả học tập:

9.1 Lịch kiểm tra giữa kỳ (dự kiến):

Lần kiểm tra	Tiết thứ	Hình thức kiểm tra	Chủ đề/Nội dung được kiểm tra	Nhằm đạt KQHT
1	22	Viết	Chủ đề 1 và 2	a,b

9.2 Thang điểm học phần:

STT	Hình thức đánh giá	Nhằm đạt KQHT	Trọng số (%)
1	Các lần kiểm tra giữa kỳ	a,b	25
2	Bài tập cá nhân và nhóm	a,b,c,	25
3	Thi kết thúc học phần - Hình thức thi: Viết - Đề mở: .. Đề đóng: ..	a, b, c	50

NHÓM GIẢNG VIÊN BIÊN SOẠN

(Ký và ghi họ tên)

Ths Chu Thị Lê Dung

ThS. Nguyễn Thị Kim Dung

TRƯỞNG KHOA/VIỆN

(Ký và ghi họ tên)

TRƯỞNG BỘ MÔN

(Ký và ghi họ tên)