

ĐỀ CƯƠNG MÔN HỌC TÀI CHÍNH PHÁI SINH VÀ QUẢN TRỊ RỦI RO

A. THÔNG TIN CHUNG VỀ MÔN HỌC

1. Tên môn học (tiếng Việt) : TÀI CHÍNH PHÁI SINH VÀ QUẢN TRỊ RỦI RO
2. Tên môn học (tiếng Anh) : Derivatives and Risk Management
3. Mã số môn học : FIN701
4. Trình độ đào tạo : Đại học
5. Ngành đào tạo áp dụng : Tài chính - Ngân hàng, Chuyên ngành Tài chính
6. Số tín chỉ : 3
 - Lý thuyết : 2 tín chỉ
 - Thảo luận và bài tập : 1 tín chỉ
 - Thực hành : 0
7. Phân bổ thời gian :
 - Tại giảng đường : 45 tiết
 - Tự học ở nhà : 90 giờ
 - Trực tuyến : Giảng viên có thể bố trí học online nhưng tổng số không quá 30% số tiết của toàn môn học
 - Khác (cụ thể) : 00
8. Khoa quản lý môn học : Tài chính
9. Môn học trước : Kinh tế vĩ mô
10. Mô tả môn học

Môn học này gồm 5 chương, được thiết kế để giới thiệu cho sinh viên *hiểu* về thị trường tài chính phái sinh và các sản phẩm tài chính phái sinh, cụ thể là hợp đồng kỳ hạn, hợp đồng tương lai, hợp đồng hoán đổi và hợp đồng quyền chọn. Thông qua môn học này,

sinh viên *hiểu* được nguyên tắc vận hành của các sản phẩm tài chính phái sinh và biết cách *tính toán* giá trị của các sản phẩm này. Cuối cùng, môn học này giúp sinh viên biết cách *vận dụng* những kiến thức về các sản phẩm tài chính phái sinh đã học được để quản trị rủi ro tài chính thông qua các chiến lược khác nhau.

11. Yêu cầu môn học

- Hoàn thành tất cả bài tập cá nhân và bài tập nhóm.
- Đọc tài liệu môn học theo yêu cầu của giảng viên. Sinh viên được kiểm tra bằng cách gọi ngẫu nhiên để trình bày ý kiến của mình về một số điểm trong tài liệu.
- Kiểm tra giữa kỳ.
- Kiểm tra cuối kỳ: Sinh viên vắng thi sẽ bị điểm 0 ngoại trừ trường hợp vắng thi theo quy chế đào tạo của trường Đại học ngân hàng.
- Thực hiện các hoạt động khác theo yêu cầu của giảng viên.

12. Học liệu của môn học

12.1. Giáo trình

[1] Hull, J. (2018). *Options, futures and other derivatives*. (10th ed.). New Jersey: Pearson.

12.2. Tài liệu tham khảo

[2] Chance, D., Brooks, R. (2015). *Sản phẩm phái sinh và quản trị rủi ro tài chính* (9th ed.) (Trần Ngọc Thơ, Nguyễn Thị Ngọc Trang, Nguyễn Khắc Quốc Bảo, Dịch). Singapore: Cengage Learning Asia Pte Ltd.

B. PHƯƠNG THỨC ĐÁNH GIÁ MÔN HỌC

Các thành phần đánh giá môn học

Thành phần đánh giá	Phương thức đánh giá	Các CDR MH	Trọng số
A.1. Đánh giá quá trình	A1.1. Chuyên cần	CLO1-CLO4	10%
	A1.2. Bài tập nhóm, thảo luận	CLO1-CLO4	20%
	A 1.3. Kiểm tra giữa kỳ	CLO1-CLO4	20%
A.2. Đánh giá cuối kỳ	A.2. Thi cuối kỳ	CLO1-CLO4	50%

C. NỘI DUNG CHI TIẾT GIẢNG DẠY

CHƯƠNG 1: GIỚI THIỆU

CHƯƠNG 2: HỢP ĐỒNG KỲ HẠN

CHƯƠNG 3: HỢP ĐỒNG TƯƠNG LAI

CHƯƠNG 4: HỢP ĐỒNG HOÁN ĐỔI

CHƯƠNG 5: QUYỀN CHỌN