

ĐỀ CƯƠNG MÔN HỌC

QUẢN LÝ DANH MỤC ĐẦU TƯ

A. THÔNG TIN CHUNG VỀ MÔN HỌC

- 1. Tên môn học (tiếng Việt) : QUẢN LÝ DANH MỤC ĐẦU TƯ**
- 2. Tên môn học (tiếng Anh) : Portfolio management**
- 3. Mã số môn học : FIN308**
- 4. Trình độ đào tạo : Đại học**
- 5. Ngành đào tạo áp dụng : Tài chính - Ngân hàng**
- 6. Số tín chỉ : 3**
 - Lý thuyết : 2 tín chỉ (30 tiết)
 - Thảo luận và bài tập : 2/3 tín chỉ (10 tiết)
 - Thực hành : 0
 - Khác (thuyết trình) : 1/3 tín chỉ (5 tiết)
- 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 : Tài chính doanh nghiệp**
- 10. Mô tả môn học :**

Môn học cung cấp những kiến thức cơ bản đến chuyên sâu, những công cụ quan trọng và phương pháp tư duy cho hoạt động quản lý tài sản chuyên nghiệp phục vụ trong hoạt động quản lý quỹ đầu tư chứng khoán, quản lý danh mục đầu tư chứng

khoán, quản lý tài chính cá nhân. Sinh viên được tiếp cận nền tảng các lý thuyết danh mục đầu tư hiện đại và kỹ năng thực hành về việc xây dựng, quản lý danh mục đầu tư chứng khoán, ra quyết định trong đầu tư tài chính cũng như tư vấn danh mục đầu tư theo yêu cầu của khách hàng, làm cơ sở. Bên cạnh đó, các bài thực hành trên bộ dữ liệu thực tế được cấu trúc đi kèm bài giảng nhằm trang bị những kỹ năng cần thiết và hữu ích cho những sinh viên có định hướng nghề nghiệp liên quan đến lĩnh vực đầu tư tài chính như nhà đầu tư, nhà tư vấn đầu tư chuyên nghiệp, nhà phân tích chứng khoán, nhà quản lý tài sản chuyên nghiệp ...

Đây là môn học bắt buộc dành cho Chuyên ngành Tài chính và là tiền đề cho môn QLDMĐT nâng cao chương trình Thạc sĩ.

11. Yêu cầu môn học

- Sinh viên tích cực tham dự các buổi học theo lịch giảng, tần suất tham gia lớp học là cơ sở đánh giá điểm chuyên cần trong tổng số điểm 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. Bài kiểm tra giữa kỳ và cuối kỳ cũng bao gồm nội dung trong tài liệu tham khảo.
- Kiểm tra giữa kỳ và 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] Bodie, Z., Kane, A., & Marcus, A. J. (2018). *Investments and portfolio management*. 11 edition McGraw-Hill/Irwin.

12.2. Tài liệu tham khảo

[2] Reilly, F. K., & Brown, K. C. (2019). *Investment analysis and portfolio management*. 11 edition South-Western Cengage Learning.

[3] Nguyễn Thành Long (2010) *Giáo trình Quản lý danh mục đầu tư chứng khoán*. Nhà xuất bản văn hóa thông tin.

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 và phát biểu cá nhân	CLO1 đến CLO5	10%
	A1.2. Thuyết trình và thảo luận nhóm	CLO1 đến CLO5	20%
	A 1.3. Bài kiểm tra giữa kỳ	CLO1, CLO2, CLO3, CLO5	20%
A.2. Đánh giá cuối kỳ	A.2.1. Thi cuối kỳ	CLO1 đến CLO5	50%

C. NỘI DUNG CHI TIẾT GIẢNG DẠY

CHƯƠNG 1: NHỮNG VẤN ĐỀ CƠ BẢN VỀ DANH MỤC ĐẦU TƯ

CHƯƠNG 2: LÝ THUYẾT MARKOWITZ

CHƯƠNG 3: MỘT SỐ MÔ HÌNH ĐỊNH GIÁ TÀI SẢN

CHƯƠNG 4: LÝ THUYẾT THỊ TRƯỜNG HIỆU QUẢ

CHƯƠNG 5: QUẢN LÝ DANH MỤC ĐẦU TƯ CỔ PHIẾU

CHƯƠNG 6: QUẢN LÝ DANH MỤC ĐẦU TƯ TRÁI PHIẾU

CHƯƠNG 7: ĐÁNH GIÁ HIỆU QUẢ DANH MỤC ĐẦU TƯ