**PHỤ LỤC**

**MẪU ĐỀ CƯƠNG CHI TIẾT HỌC PHẦN**

*(Kèm theo Quyết định số: 796 /QĐ-ĐHNT, ngày 06 tháng 9 năm 2021*

*của Hiệu trưởng Trường Đại học Nha Trang)*

**TRƯỜNG ĐẠI HỌC NHA TRANG**

**Khoa/Viện: KẾ TOÁN TÀI CHÍNH**

**Bộ môn: TÀI CHÍNH NGÂN HÀNG**

**ĐỀ CƯƠNG CHI TIẾT HỌC PHẦN**

**1. Thông tin về học phần:**

Tên học phần:

* Tiếng Việt: **CÔNG CỤ TÀI CHÍNH PHÁI SINH**
* Tiếng Anh: DERIVATIVES

Mã học phần: FIB

Số tín chỉ: 3(3-0)

Đào tạo trình độ: Đại học

Học phần tiên quyết: Thị trường chứng khoán

**2. Thông tin về GV:**

Chu Thị Lê Dung Chức danh, học hàm, học vị: Giảng viên, thạc sĩ

Điện thoại: Email: dungctl@ntu.edu.vn

Địa chỉ Google Meet: <https://meet.google.com/iat-uhyi-wcm>

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

**3. Mô tả học phần:**

.Học phần cung cấp cho sinh viên những kiến thức cơ bản về thị trường phái sinh cũng như cơ chế giao dịch các công cụ phái sinh trong kinh doanh và quản trị rủi ro của các định chế tài chính và phi tài chính tham gia vào thị trường. Ngoài ra, học phần cũng giới thiệu các phương pháp định giá quyền chọn, hợp đồng giao sau, hợp đồng kỳ hạn và hợp đồng hoán đổi để từ đó đề xuất các chiến lược phòng ngừa rủi ro

**4. Mục tiêu:**

Giúp sinh viên xác định cơ chế giao dịch của các các công cụ phái sinh và định giá được quyền chọn, tương lai, kỳ hạn và hoán đổi. Từ những kiến thức này sinh viên có thể hiểu, đánh giá và phân tích chính sách và cơ hội trên thị trường chứng khoán phái sinh Việt Nam.

**5. Chuẩn đầu ra (CLOs):** Sau khi học xong học phần, người học có thể:

a. Nhận biết và phân tích được thị trường giao dịch các công cụ phái sinh và các công cụ sử dụng trên thị trường;

b. Nhận biết và phân tích được các rủi ro cũng như cơ hội kinh doanh của các định chế tài chính;

c. Đề xuất việc sử dụng các công cụ phái sinh để kinh doanh và phòng ngừa rủi ro

**6. Đánh giá kết quả học tập:**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **TT.** | **Hoạt động đánh giá** | **Nhằm đạt CLOs** | **Trọng số (%)** |
| 1 | Đánh giá quá trình: tụ luận, vấn đáp, trắc nghiệm | a,b,c | 30% |
| 2 | Thi giữa kỳ : tự luận , vấn đáp | a,b,c | 20% |
| 3 | Thi cuối kỳ: tự luận, vấn đáp, trắc nghiệm |  a,b,c | 50% |

 **7. Tài liệu dạy 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 | Nguyễn Minh Kiều | Quản lý rủi ro tài chính | 2009 | Thống kê | Thư viện số ĐHNT | x |  |
| 2 | Nguyễn Thị Ngọc Trang  | Quản trị rủi ro tài chính  | 2007 | Thống kê | Thư viện số ĐHNT | x |  |
| 3 | Robert L. McDonald | Derivatives markets  | 2006 | Boston : Addison-Wesley |  |  | x |
| 4 | Claudio Albanese and Giuseppe Campolieti | Advanced derivatives pricing and risk management : theory, tools and hands-on programming application  | 2006 | Amsterdam ; Boston : Elsevier Academic Press  |  |  | x |

**8. Kế hoạch dạy học:**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **Tuần**  | **Nội dung**  | **Nhằm đạtCLOs** | **Phương pháp dạy học** | **Nhiệm vụ người học** |
| 1(6/2-12/2) | **Tổng quan về TTCKPS**  | a | Diễn giải và thảo luận | Tham gia thảo luận  |
|  |
|  |
| 2(13/2-19/2) |  **Hợp đồng kỳ hạn**Khái niệm và đặc điểm của hợp đồng kỳ hạnĐịnh giá kỳ hạn cho các tài sản và xác định giá trị của hợp đồng kỳ hạnHợp đồng kỳ hạn ngoại hốiHợp đồng kỳ hạn lãi suất | a,b,c | Diễn giải và thảo luận | Đọc trước tài liệu và làm bài tập  |
|  |
|  |
| 3(20/2-26/2) |  Hợp đồng kỳ hạn  | a,b,c | Diễn giải, thảo luận | Đọc trước tài liệu , làm bài tập  |
| 4 (27/2-5/3) | **Hợp đồng tương lai**Khái niệm và đặc điểm của hợp đồng tương laiCơ chế giao dịch trên thị trường tương laiĐịnh giá hợp đồng tương lai.Chiến lược sử dụng hợp đồng tương lai để phòng ngừa rủi ro  | a.b.c | Diễn giải, thảo luận, thuyết trình nhím  | Đọc trước tài liệu, làm bài tập, thuyết trình nhóm |
|  |
|  |
| 5(6/3-12/3) | **Hợp đồng tương lai ( tt)****Hợp đồng quyền chọn**Khái niệm về quyền chọn Các chiến lược kinh doanh cơ bản về Quyền chọnĐịnh giá quyền chọn.Các loại quyền chọn khác | a,b,c | Diễn giải, thảo luận, thuyết trình  | Đọc trước tài liệu, làm bài tập |
| 6(13/3- 19/3) |  Hợp đồng quyền chọn ( tt)  | a,b,c | Diễn giải, hướng dẫn, thuyết trình  | Đọc trước tài liệu, làm bài tập |
| Thi giữa kỳ  |
| 7(20/3-26/3) | Hợp đồng quyền chọn ( tt)  | A,b,c | Diễn giải,thuyết trình  | Đọc trước tài liệu, làm bài tập, thuyết trình nhóm  |
| 8(27/3-2/4) |  **Hợp đồng hoán đổi**Khái niệm và bản chất hợp đồng hoán đổiHợp đồng hoán đổi lãi suất Hợp đồng hoán đổi tiền tệ | a,,b,c |  Diễn giải, hướng dẫn, thuyết trình | Đọc trước tài liệu, làm bài tập, thuyết trình nhóm  |

**9. Yêu cầu đối với người học:**

*+* Thường xuyên cập nhật và thực hiện đúng kế hoạch dạy học, kiểm tra, đánh giá theo Đề cương chi tiết học phần trên hệ thống NTU E-learning lớp học phần;

+ Thực hiện đầy đủ và trung thực các nhiệm vụ học tập, kiểm tra, đánh giá theo Đề cương chi tiết học phần và hướng dẫn của GV giảng dạy học phần;

+ Người học phải chuẩn bị đầy đủ các bài tập, báo cáo do giảng viên yêu cầu.

+ Tham gia đầy đủ các hoạt động thảo luận nhóm.

*Ngày cập nhật*: 6/3/2023

 **GIẢNG VIÊN CHỦ NHIỆM HỌC PHẦN**

 *(Ký và ghi họ tên) (Ký và ghi họ tên)*



**TRƯỞNG BỘ MÔN**

*(Ký và ghi họ tên)*



**Nguyễn Văn Bảy**