

1. Thông tin chung về môn học

- Tên môn học: Thị trường tài chính
- Mã môn học: FIB2003-1
- Số tín chỉ: 3
- Các môn học tiên quyết: Kinh tế học tiền tệ ngân hàng
- Giờ tín chỉ đối với các hoạt động:
 - Lý thuyết: 32 giờ
 - Thảo luận và bài tập: 7 giờ
 - Tự học: 5 giờ
 - Kiểm tra giữa kỳ: 1 giờ

2. Tóm tắt nội dung môn học

Môn học cung cấp kiến thức cơ bản, toàn diện về các thị trường tài chính, các định chế tài chính, các tài sản tài chính, và sự tương tác giữa chúng trong quá trình vận hành để thực hiện chức năng cơ bản của hệ thống tài chính là chuyển quỹ từ người tiết kiệm tới các mục đích chi tiêu và đầu tư. Sau phần lý thuyết nền tảng về các yếu tố quy định và ảnh hưởng tới lãi suất, lần lượt các thị trường nợ, thị trường cổ phiếu và một số thị trường các công cụ phái sinh, được đề cập dưới góc độ chức năng, công cụ và mục đích giao dịch, các thành phần tham gia. Các tài sản tài chính được trình bày theo bản chất, cách định giá, cách tính toán rủi ro, các yếu tố tác động tới giá cả của chúng. Các định chế tài chính, bao gồm các ngân hàng thương mại và các định chế tài chính phi ngân hàng như công ty bảo hiểm, công ty tài chính, quỹ đầu tư..., được nghiên cứu theo các chức năng đặc thù và một số nguyên tắc quản trị.

3. Học liệu

3.1. Học liệu bắt buộc

1. Tập bài giảng “Các thị trường và định chế tài chính”. (Biên soạn: PGS.TS Trần Thị Thái Hà)
2. Giáo trình *Financial Institutions Management – A risk Mamagement Approach* (Anthony Saunders; Marcia Millon Cornett; Fourth Edition; McGraw Hill); Các chương 8 và 9.

3. *Money and Capital Markets-Financial Institutions and Instruments in a Global Marketplace* (Peter S. Rose; Milton H. Marquis; Ninth Edition; Tiếng Anh).
4. *Giáo trình Corporate Finance*, Ross, Westerfield; Jaffe; Irwin McGraw-Hill; Chương 19.

3.2. Học liệu tham khảo:

5. *Nghề môi giới chứng khoán*. NXB Chính trị quốc gia – 2001 (Trần Thị Thái Hà) (thư viện trường)
6. *Thị trường vốn mạo hiểm- Lý thuyết, Kinh nghiệm quốc tế và những vấn đề đặt ra cho Việt Nam* (Đề tài đặc biệt cấp ĐHQG 2006. – PGS.TS Trần Thị Thái Hà).
7. *Phát triển thị trường trái phiếu Chính phủ ở Việt Nam* (luận văn cao học chuyên ngành KTCT, Trường ĐHKT ĐHQGHN năm 2007 – Nguyễn Thụy Hương).
8. *Ngành bảo hiểm Việt Nam trước và sau WTO* (luận văn cao học, chuyên ngành KTĐN, Trường ĐHKT ĐHQGHN năm 2007 – Vũ Phương Anh)

Các tài liệu khác do giảng viên giao theo từng bài

4. Lịch trình chung :

Tuần	Nội dung	Hình thức tổ chức dạy học			Tổng số	Ghi chú
		Lên lớp		Tự học		
		Lý thuyết	Bài tập/thảo luận			
1	Nội dung 1. Vai trò của các thị trường và định chế tài chính	2		1	3	Bài tập 1
2	Nội dung 2. Các yếu tố quyết định lãi suất	2	1		3	
3	Nội dung 3. Cấu trúc của lãi suất	2	1		3	Bài tập 2
4	Nội dung 4. Thị trường tiền tệ	2		1	3	Bài tập 3
5	Nội dung 5. Thị trường trái phiếu	3			3	Bài tập 4

6	Nội dung 6. Thị trường khoản vay thế chấp nhà (mortgages)	2	1		3	Bài tập 5
7	Nội dung 7. Thị trường cổ phiếu : Thị trường sơ cấp và thứ cấp	2		1	3	Bài tập 6
8	Nội dung 8. Thị trường cổ phiếu : Lợi suất, rủi ro và giá	2	1		3	
9	Nội dung 9. Thị trường Hợp đồng kỳ hạn và hợp đồng tương lai tài chính + Kiểm tra giữa kỳ	2			2	Kiểm tra giữa kỳ + Bài tập 7
10	Nội dung 10. Thị trường Hợp đồng tương lai (tiếp) và thị trường Quyền chọn	3			3	Bài tập 8
11	Nội dung 11. Thị trường công cụ phái sinh lãi suất	2	1		3	
12	Nội dung 12. Ngân hàng thương mại	3			3	
13	Nội dung 13. Các định chế dạng tiết kiệm theo hợp đồng	2		1	3	Bài tập 9
14	Nội dung 14. Các định chế tài chính dạng đầu tư	2		1	3	Bài tập 10
15	Nội dung 15. Bài tập + Tổng kết	1	2		3	
	Kiểm tra giữa kỳ				1	
	Số giờ tín chỉ	32	7	5	45	

5. Phương pháp, hình thức kiểm tra-đánh giá kết quả học tập môn học

5.1 Kiểm tra-đánh giá thường xuyên

- Có 10 bài tập cá nhân tuần, kết hợp với việc đi học đầy đủ để lấy điểm thường xuyên.

5.2 Kiểm tra-đánh giá định kỳ:

- 1 bài kiểm tra giữa kỳ, vào tuần 9.
- Bài thi hết môn theo kế hoạch chung.

Trọng số các điểm như sau:

- Bài tập cá nhân, chuyên cần: 20%

- Kiểm tra giữa kỳ: 20%.
- Điểm thi hết môn: 60%

5.3. Tiêu chí đánh giá các bài kiểm tra

- Bài tập cá nhân nộp đúng hạn, làm bài đầy đủ, nghiêm túc, mỗi bài 1 điểm, 10 bài được 10 điểm. Số giờ nghỉ học sẽ bị trừ điểm, theo tỷ lệ % so với tổng số giờ.
- Bài kiểm tra giữa kỳ: yêu cầu tính độc lập, sáng tạo, không được sử dụng tài liệu.
- Bài thi: Thể hiện được các kỹ năng tính toán, phân tích, khái quát hóa. Được sử dụng tài liệu khi làm bài.

5.4. Lịch thi, kiểm tra đánh giá

- Bài tập cá nhân được giao theo lịch (10 tuần)
- Bài kiểm tra giữa kỳ: tuần 9.
- Lịch thi cuối kỳ theo lịch của Phòng ĐT&NCKH.

cuu duong than cong. com

cuu duong than cong. com