

TỜ TRÌNH ĐĂNG KÝ ĐÀO TẠO CHUYÊN NGÀNH SDH

CHUYÊN NGÀNH ĐÀO TẠO:
KINH TẾ TÀI CHÍNH NGÂN HÀNG

MÃ SỐ 60.31.12.01
BẬC ĐÀO TẠO: TIẾN SĨ

I. TỜ TRÌNH ĐĂNG KÝ CHUYÊN NGÀNH ĐÀO TẠO SAU ĐẠI HỌC

1.1. Tên chuyên ngành đào tạo

Tên tiếng Việt: **Kinh Tế Tài Chính - Ngân Hàng**

Tên tiếng Anh: **Economics of Finance and Banking**

1.2. Mã Số: 60 31 12 01

1.3. Bậc đào tạo: Tiến sĩ

1.4. Tên văn bằng

Tên tiếng Việt: **Tiến sĩ kinh tế** chuyên ngành Kinh tế Tài chính Ngân hàng.

Tên tiếng Anh: **Doctor of Philosophy of Economics** – specialized in Finance and Banking

1.5 Nhu cầu của nền kinh tế xã hội:

Khi chuyển sang nền kinh tế thị trường, yêu cầu đổi mới trước tiên được chú trọng đó là lĩnh vực tài chính ngân hàng. Nhu cầu phát triển ngành tài chính ngân hàng theo yêu cầu của nền kinh tế thị trường và hội nhập kinh tế quốc tế đã và đang đặt ra cho chúng ta cần phải đào tạo một đội ngũ các chuyên gia tài chính-ngân hàng có kiến thức nâng cao và kỹ năng phân tích chính sách tài chính ngân hàng phù hợp với điều kiện mới. Việt nam với một thị trường tài chính còn non trẻ và hệ thống ngân hàng đang trong quá trình cải cách, các doanh nghiệp và các định chế tài chính trung gian trong bối cảnh nền kinh tế thị trường và hội nhập kinh tế thế giới đang rất cần một lực lượng chuyên gia kinh tế tài chính ngân hàng có trình độ và khả năng chuyên môn cao. Hơn nữa, theo Nghị Quyết 01 của Bộ Chính Trị, và định hướng quy hoạch phát triển kinh tế xã hội Việt Nam, TP.Hồ Chí Minh đến năm 2015, tầm nhìn 2020, TP.HCM sẽ trở thành Trung tâm tài chính của Việt Nam và khu vực, có thể cạnh tranh với các trung tâm tài chính khác trong khu vực như Bangkok, Singapore. Hơn nữa, Việt nam mới trở thành thành viên của Tổ chức thương mại thế giới WTO, thị

trường tài chính sẽ được mở rộng và hội nhập sâu hơn với thị trường tài chính khu vực và thế giới, đòi hỏi có đội ngũ chuyên gia có trình độ cao và kỹ năng quản lý, điều hành thị trường, nghiên cứu vận dụng kinh nghiệm quốc tế tốt. Với mục tiêu, yêu cầu trên, thì nhu cầu đào tạo đội ngũ chuyên gia có trình độ cao trong lĩnh vực Tài chính – Ngân hàng là rất cần thiết.

Mặt khác, nguồn tuyển sinh cho đào tạo bậc tiến sĩ, chuyên ngành kinh tế Tài chính-ngân hàng hiện nay khá phong phú và đa dạng. **Nguồn thứ nhất** là những cán bộ giảng dạy, cán bộ nghiên cứu, cán bộ công chức Nhà nước, các chuyên gia đã có bằng thạc sĩ chuyên ngành “tài chính, tín dụng và lưu thông tiền tệ” và các chuyên ngành kinh tế khác đang làm việc ở các Trường đại học, các Viện nghiên cứu phía nam, các cơ quan quản lý Nhà nước về tài chính ngân hàng, các định chế tài chính trung gian đóng trên địa bàn các tỉnh phía Nam. **Nguồn thứ hai**, là từ kết quả đầu ra của đào tạo cao học cùng chuyên ngành Kinh tế Tài chính Ngân hàng tại Khoa kinh Tế-ĐH Quốc Gia TP.HCM, mỗi năm có trên dưới 40 học viên tốt nghiệp sẽ tiếp tục học lên bậc tiến sĩ sẽ là đầu vào đúng chuyên ngành cho bậc Tiến sĩ. Hiện nay, ở phía nam có hai trường đào tạo bậc tiến sĩ về chuyên ngành “tài chính, tín dụng, lưu thông tiền tệ” là Đại học Kinh tế TP.HCM và Đại học Ngân hàng, nhưng chưa có trường nào mở chuyên ngành Kinh tế Tài chính-Ngân hàng bậc tiến sĩ-Nghiên cứu vận dụng kiến thức kinh tế học hiện đại giải quyết các vấn đề của ngành tài chính ngân hàng (khác với chuyên ngành đã và đang có ở các trường là đứng trên góc độ của khoa học quản lý nghiệp vụ của chuyên ngành tài chính, tín dụng, lưu thông tiền tệ). Vì lẽ đó nhu cầu mở ngành đào tạo bậc tiến sĩ, chuyên ngành Kinh tế Tài chính-ngân hàng đối với Khoa Kinh Tế-ĐH Quốc Gia là rất lớn, đáp ứng cho các tỉnh phía nam, nơi đang thiếu đội ngũ cán bộ có trình độ cao về tài chính Ngân hàng. Các nước có nền kinh tế và tài chính phát triển như Mỹ, Anh, Singapore, Úc... đã có kinh nghiệm lâu năm về đào tạo cao học và Tiến sĩ chuyên ngành Tài chính-Ngân hàng, đặc biệt là ứng dụng kinh tế học giải quyết các vấn đề chính sách tài chính ngân hàng và phát triển thị trường tài chính, hệ thống tài chính phục vụ phát triển kinh tế xã hội. Có nhiều chương trình của các trường ở Mỹ (University of California, Michigan University, Tech Texas University...), ở Singapore (NUS), ở Anh (Cambrigh, Stanford...) ở Úc (New South Wale, Sidney...) được xếp hạng cao, đào tạo kết hợp với thực hiện các chương trình nghiên cứu về Tài chính-Ngân hàng đã có những đóng góp nguồn nhân lực cao cho phát triển thị trường tài chính, cho các tổ chức tài chính quốc tế (IMF, World Bank, ADB...), cho hệ thống tài chính của các nước và thế giới. Đây cũng là cơ hội và thuận lợi để cho chúng ta đi sau học hỏi kinh nghiệm.

Do đặc trưng và yêu cầu thực tiễn phát triển của ngành Tài chính – Ngân hàng của khu vực phía nam, khi Việt nam hội nhập mở cửa thị trường tài chính, nguồn tuyển sinh cho đào tạo bậc tiến sĩ là dồi dào, phong phú đa dạng, cùng với cơ hội học hỏi kinh nghiệm các nước đi trước sẽ tạo điều kiện tốt cho thực hiện đào tạo đội ngũ chuyên gia kinh tế có trình độ cao, có kỹ năng phân tích chuyên sâu và khả năng ứng dụng các kỹ thuật phân tích hiện đại của kinh tế học trong ngành Tài chính -Ngân hàng. Vì vậy hình thành chương trình đào tạo Sau đại học Thạc sĩ và tiếp theo là bậc Tiến sĩ chuyên ngành kinh tế Tài chính-Ngân hàng tại Khoa kinh tế-ĐH Quốc Gia TP.HCM là rất cần thiết trong bối cảnh hội nhập quốc tế và nhu cầu phát triển kinh tế

xã hội đất nước. Chương trình đào tạo tiến sĩ chuyên ngành kinh tế Tài chính-Ngân hàng dự kiến sẽ đảm bảo đáp ứng được các nhu cầu phát triển lĩnh vực tài chính ngân hàng hiện nay cho Việt nam nói chung, cho khu vực phía nam nói riêng, đặc biệt là cho Vùng Kinh Tế Trọng điểm phía Nam, trong đó TP. Hồ Chí Minh là hạt nhân, nơi theo quy hoạch sẽ trở thành một trung tâm tài chính khu vực, có thể cạnh tranh với Thái Lan và Singapore trong tương lai.

1.6 Quy mô đào tạo: 02 NCS/Khóa

1.7 Nguồn kinh phí phục vụ đào tạo: học phí/ngân sách

II . NỘI DUNG , CHƯƠNG TRÌNH ĐÀO TẠO

2.1. MỤC TIÊU ĐÀO TẠO

Mục tiêu của chương trình là đào tạo các chuyên gia kinh tế có trình độ cao và chuyên sâu trong lĩnh vực Tài chính-Ngân hàng, có trình độ kiến thức cơ bản hiện đại, có kiến thức nâng cao về các môn cơ sở ngành, tạo điều kiện để tiếp cận các vấn đề thuộc chuyên ngành chuyên sâu hơn, hoặc những lĩnh vực chuyên ngành mới đã và đang phát triển tại Việt nam trong quá trình chuyển đổi nền kinh tế, hội nhập kinh tế, hội nhập với hệ thống tài chính khu vực và quốc tế. Đồng thời chương trình đào tạo này cũng sẽ cung cấp cho xã hội (các trường đại học, viện nghiên cứu, các cơ quan quản lý nhà nước, các doanh nghiệp thuộc các thành phần kinh tế, các tổ chức tài chính trung gian: thị trường tài chính, ngân hàng thương mại, công ty tài chính, quỹ đầu tư, công ty chứng khoán, các công ty bảo hiểm...), kể cả các tổ chức Tài chính-Ngân hàng quốc tế những nhà kinh tế, các chuyên gia Tài chính-Ngân hàng có trình độ chuyên môn cao, có năng lực và kỹ năng phân tích hiện đại và đặc biệt có khả năng nghiên cứu áp dụng các kiến thức nâng cao, kinh tế học hiện đại, kinh nghiệm quốc tế vào điều hành và quản lý hệ thống tài chính phù hợp với điều kiện hội nhập của Việt Nam, cũng như có khả năng thực hành và điều hành kinh doanh đạt hiệu quả cao trong lĩnh vực Tài chính – Ngân hàng.

2.2 ĐỐI TƯỢNG DỰ THI

2.2.1 Đối tượng không phải bổ túc kiến thức: Thạc sĩ / Cử nhân kinh tế (đối với cử nhân có kết quả học tập loại xuất sắc và được đề nghị cho phép dự thi NCS) chuyên ngành Tài chính – Ngân hàng theo các lĩnh vực chuyên sâu:

- Tài chính Nhà nước/Tài chính công
- Tài chính Doanh nghiệp
- Ngân hàng

2.2.2 Đối tượng phải bổ túc kiến thức: Thạc sĩ kinh tế, Thạc sĩ quản trị kinh doanh không thuộc chuyên ngành Tài chính – Ngân hàng phải học các môn học bổ sung sau (xem bảng).

Danh Mục các môn học bổ sung kiến thức:

STT	Môn học chuyển đổi	Số tiết học	Ghi chú
1	Tài chính phát triển	45	
2	Tài chính công (nâng cao)	45	
3	Tài chính doanh nghiệp 2 (nâng cao)	45	
4	Quản trị ngân hàng	45	
5	Tài chính quốc tế	45	
6	NHTW và chính sách tiền tệ	45	
7	Phân tích thị trường tài chính	30	
8	Đầu tư Tài chính	30	
9	Thuế	30	
10	Quản lý Ngân sách Nhà nước	30	

Tuy nhiên, đối với những ứng viên NCS học cao học chuyên ngành khác, nếu đã được học một hoặc một số môn học theo liệt kê biểu trên sẽ được miễn môn tương ứng (sẽ xem xét từng trường hợp cụ thể).

2.2.3 Đối tượng được chuyển tiếp sinh: Đối với các đối tượng dự tuyển khác (tuyển thẳng, chuyển tiếp, người nước ngoài...) áp dụng theo quy định hiện hành của Bộ Giáo dục và Đào tạo và Đại học Quốc gia Tp. Hồ Chí Minh. Theo điều 6 của Quy chế tuyển sinh sau đại học, ứng viên là cử nhân kinh tế phải đảm bảo các tiêu chuẩn (kết quả học đại học đạt loại giỏi, có hai bài báo đăng trên tạp chí chuyên ngành, đã làm chủ nhiệm đề tài NCKH bảo vệ thành công, đúng ngành học tại Khoa) được dự thi NCS, nếu đỗ NCS phải học hoàn tất chương trình đào tạo cao học đang có tại Khoa Kinh Tế-ĐH Quốc Gia TP.HCM.

2.3 Môn thi tuyển: Thí sinh phải dự thi các môn sau:

- Ngoại ngữ : **tương đương trình độ C** (Các thí sinh thuộc đối tượng miễn thi ngoại ngữ không phải thi môn này)
- Môn chuyên ngành: **Lý thuyết Tài chính – Tiền tệ** (Có đề cương ôn tập đính kèm phần sau hồ sơ này)
- Bảo vệ đề cương nghiên cứu

2.4 CHƯƠNG TRÌNH ĐÀO TẠO

2.4.1 Khái quát chương trình đào tạo:

Cấu trúc và khối lượng kiến thức được xây dựng theo:

- Quyết định số 250/ĐHQG-SĐH ngày 01/06/2001 của Giám đốc ĐHQG-HCM

- Quy chế đào tạo sau đại học của Bộ giáo dục và Đào tạo ban hành theo quyết định số 18/2000/ QĐ-BGT-ĐT ngày 08/06/2000 của Bộ trưởng Bộ giáo dục và Đào tạo.
- a. **Đối với NCS có trình độ Thạc sĩ:** Chương trình đào tạo bao gồm 2 phần
- Phần 1: Các chuyên đề nhằm trang bị cho các NCS năng lực nghiên cứu khoa học, cập nhật và nâng cao kiến thức chuyên sâu có liên quan đến đề tài làm cơ sở xây dựng phương pháp luận của đề tài luận án tiến sĩ. Mỗi NCS phải hoàn tất 03 chuyên đề, tương đương với khoảng từ 5 đến 10 ĐVHT. (Danh mục chuyên đề tiến sĩ tham khảo ở phần phụ lục).
 - Phần 2: NCS phải thực hiện và bảo vệ Luận án tiến sĩ cấp cơ sở và cấp Quốc gia theo Quy chế tổ chức đào tạo Tiến sĩ đã ban hành.
- b. **Đối với NCS có trình độ cử nhân:** NCS phải hoàn thành khối lượng các môn học chuyên môn của chương trình Thạc sĩ chuyên ngành Tài chính - Ngân hàng do Khoa Kinh tế ĐHQG thiết kế và đào tạo đã được chấp thuận và đang thực hiện (xem danh mục môn học của chương trình cao học đã được duyệt)

2.4.2 Điều kiện tốt nghiệp:

- NCS phải hoàn thành 03 chuyên đề Tiến sĩ theo đề xuất của Cán bộ hướng dẫn
- Đối với NCS có trình độ cử nhân, ngoài 03 chuyên đề tiến sĩ còn phải hoàn tất chương trình đào tạo đã nêu ở Mục 2.4.1 b.
- Được Hội đồng bảo vệ Luận án cấp cơ sở và cấp Nhà Nước thông qua.

2.4.3 Bảo vệ luận án: Luận án có thể được bảo vệ bằng Tiếng Việt hoặc Tiếng Anh (khi đủ điều kiện)

2.4.4 Thời gian đào tạo:

Thời gian đào tạo là 03 năm, hệ không tập trung. NCS phải hoàn thành 03 chuyên đề tiến sĩ trước khi bảo vệ luận án tiến sĩ cấp cơ sở và bảo vệ thành công kết quả nghiên cứu của mình trước Hội đồng chấm luận án Tiến sĩ cấp cơ sở và cấp Nhà Nước.

Học viên phải thực hiện đầy đủ các yêu cầu, nghĩa vụ, nội quy học tập và nghiên cứu khoa học của Khoa Kinh tế –ĐHQG-HCM.

III-ĐỘI NGŨ, NĂNG LỰC GIẢNG DẠY VÀ NGHIÊN CỨU KHOA HỌC PHỤC VỤ CHUYÊN NGÀNH ĐÀO TẠO

3.1 Danh sách các giảng viên cơ hữu và thỉnh giảng đã và đang tham gia đào tạo sau đại học, chuyên ngành Kinh tế Tài chính-Ngân hàng:

STT	Họ và tên	Giảng viên		Học hàm học vị	Chuyên ngành có văn bằng cao nhất	Tên môn học mới sẽ đảm trách
		Cơ hữu	Thỉnh giảng			
1	Nguyễn Văn Luân	X		PGS-TS	Kinh tế học	Kinh tế vĩ mô
2	Nguyễn Thị Cành	X		GS-TS	Kinh tế -tài chính	Tài chính công – Tài chính phát triển Phương pháp NCKH
3	Nguyễn Văn Trình	X		PGS. TS	Kinh tế học	Kinh tế vi mô
4	Nguyễn Tiến Dũng	X		TS	Kinh tế học	Kinh tế vi mô
5	Nguyễn Chí Hải	X		TS	Kinh tế học	Kinh tế chính trị
6	Nguyễn Văn Bằng	X		TS	Kinh tế chính trị	Kinh tế chính trị
7	Đinh Thị Ánh Nguyệt	X		TS	Ngoại ngữ	Ngoại ngữ
8	Trần Việt Hoàng	X		TS	Dự báo tài chính	Lý thuyết Tài chính – tiền tệ Đầu tư tài chính
9	Hoàng Vĩnh Long	X		TS	Kinh tế quốc tế	Tài chính quốc tế
10	Phan Đức Dũng	X		TS	Kế toán	Thẩm định dự án đầu tư
11	Trần Văn Đức	X		TS	Kinh tế quốc tế	Tài chính quốc tế
12	Trịnh Doãn Chính		X	PGS-TS	Triết học	Triết học
13	Vũ Tình		X	PGS-TS	Triết học	Triết học
14	Nguyễn Hoàng Tuấn		X	TS	Ngoại Ngữ	Ngoại Ngữ
15	Dương Thị Bình Minh		X	GS-TS	Tài chính	Quản lý ngân sách NN Lý thuyết tài chính tiền tệ

16	Nguyễn Thị Nhung		X	PGS-TS	Ngân Hàng	Marketing Ngân Hàng Quản trị rủi ro trong KD ngân hàng
17	Hồ Diệu		X	TS	Ngân Hàng	Quản trị Ngân hàng Quản trị rủi ro KD ngân hàng
18	Ngô Hường		X	PGS-TS	Ngân hàng	Quản trị ngân hàng Marketing ngân hàng
19	Nguyễn Văn Thuận		X	TS	Tài chính	Tài chính doanh nghiệp 2-Quản trị tài chính Đầu tư tài chính
20	Nguyễn Hồng Thắng		X	TS	Tài chính	Hợp nhất và Sáp nhập công ty Tài chính doanh nghiệp 2(Quản trị Tài chính)
21	Nguyễn Thanh Tuyền		X	GS-TS	Tài chính	Tài chính công Thuế
22	Lê Hồng Nhật	X		TS	Kinh tế	Kinh tế lượng Tài chính phát triển Đầu tư tài chính
23	Lại Tiến Dĩnh		X	TS	Tài chính	Thẩm định dự án
24	TS. Peter Kien Pham, School of Banking and Finance, University of New South Wales - Australia		x	TS	Tài chính	Phân tích thị trường tài chính – Quyền chọn Quản trị tài chính
25	TS. Trương Quang Thông	X		TS	Tài chính- Ngân hàng	Tài chính quốc tế Quản trị ngân hàng Tài chính phát triển
26	TS. Nguyễn Thanh Dương		X	TS	Tài chính- Ngân hàng	Quản lý Ngân sách nhà nước Thuế

27	TS. Lê Hữu Nam	X		TS	Luật chuyên sâu về Tài chính-Ngân hàng và thị trường chứng khoán	Đầu tư tài chính và Thị trường chứng khoán Luật kinh doanh chứng khoán và đầu tư tài chính
28	TS. Lê Ngọc Minh		X	TS		Quản trị Ngân hàng

Các giảng viên thỉnh giảng có hợp đồng trách nhiệm kèm theo

3.2 Năng lực đội ngũ trực tiếp tham gia đào tạo chuyên ngành, hướng dẫn NCS và tham gia Hội đồng chấm chuyên đề, luận án Tiến sĩ chuyên ngành Kinh tế Tài chính-Ngân hàng

Theo bảng danh mục giảng viên tham gia đào tạo sau đại học nêu trên có gần 70% là giảng viên cơ hữu, trong đó số giảng viên tham gia trực tiếp giảng các môn chuyên ngành Kinh tế Tài chính Ngân hàng và tham gia Hội đồng chuyên ngành hoặc hướng dẫn NCS chuyên ngành Tài chính-Ngân hàng gồm:

A- Đội ngũ giảng viên cơ hữu:

1/ GS.TS. Nguyễn Thị Cành (Tốt nghiệp ĐH Kinh tế Tài chính-Liên Bang Nga, Nghiên cứu sau Tiến sĩ tại Singapore, Châu Âu và Mỹ), Trưởng Bộ môn Tài chính Ngân hàng, Khoa Kinh Tế, có khả năng hướng dẫn độc lập hoặc hướng dẫn chính NCS và tham gia các Hội đồng chuyên ngành

2/ TS. Trần Viết Hoàng (Tốt nghiệp ĐH Kinh tế Tài chính-Liên Bang Nga, nghiên cứu một số công trình tại Việt nam), Phó Bộ môn Tài chính-Ngân hàng, Khoa Kinh Tế, có khả năng đồng hướng dẫn (chính hoặc phụ NCS) và tham gia các Hội đồng chuyên ngành

3/ TS. Trương Quang Thông (Tốt nghiệp Tiến sĩ tại Việt nam, sau tiến sĩ tại Cộng hòa Pháp), Giảng viên Bộ môn Tài chính-Ngân hàng, Khoa Kinh Tế, có khả năng đồng hướng dẫn NCS và tham gia các Hội đồng chuyên ngành

4/ TS. Lê Hồng Nhật (Tốt nghiệp tiến sĩ tại ĐH Stanford Mỹ, sau tiến sĩ tại Úc, giảng kinh tế học ứng dụng trong ngành Tài chính-Ngân hàng), Giảng viên Bộ môn Kinh tế học, Khoa Kinh Tế, có khả năng đồng hướng dẫn NCS và tham gia các Hội đồng chuyên ngành

5/ TS. Phan Đức Dũng (tốt nghiệp tiến sĩ ngành Kế toán Tài chính), Giảng viên Kế toán Tài chính, Khoa Kinh Tế, có khả năng đồng hướng dẫn NCS và tham gia các Hội đồng chuyên ngành

6/ PGS.TS Nguyễn Văn Luân (Chủ nhiệm Khoa Kinh Tế), PGS Kinh Tế Học vi mô ứng dụng trong Tài chính-Ngân hàng, có khả năng hướng dẫn chính NCS và tham gia các Hội đồng chuyên ngành

7/ PGS.TS. Nguyễn Văn Trình (Phó CN Khoa Kinh Tế), PGS Kinh Tế Học vi mô, ứng dụng trong ngành Tài chính-Ngân hàng, có khả năng đồng hướng dẫn NCS và tham gia các hội đồng chuyên ngành

8/ TS. Nguyễn Tiến Dũng (Phó CN Khoa Kinh Tế), TS. Kinh Tế học vi mô, ứng dụng trong ngành Tài chính-Ngân hàng, có khả năng đồng hướng dẫn NCS và tham gia các Hội đồng chuyên ngành

9/ TS. Lê Hữu Nam, TS Luật Chứng khoán, Tài chính-NH, có khả năng đồng hướng dẫn NCS và tham gia các Hội đồng chuyên ngành-Thị trường chứng khoán

10/ NCS Hoàng Công Gia Khánh –cán bộ giảng dạy Bộ môn Tài chính- Ngân hàng-Khoa Kinh tế (đang chờ bảo vệ luận án chuyên ngành tài chính-ngân hàng tại Hội Đồng cấm luận án cấp nhà nước-ĐH kinh tế TP.HCM), có thể tham gia đào tạo sau đại học và NCS chuyên ngành Kinh tế tài chính-Ngân hàng vào năm 2007

11/ NCS Cung Trần Việt- cán bộ giảng dạy Bộ môn Tài Chính Ngân hàng-Khoa Kinh tế sẽ bảo vệ năm 2007 (Thạc sĩ chuyên ngành Tài chính tại Úc), có thể tham gia đào tạo sau đại học chuyên ngành Tài chính-Ngân hàng vào năm 2008

B. Các GS, PGS, TS-giảng viên thỉnh giảng tham gia hướng dẫn NCS, tham gia Hội đồng chuyên ngành Kinh tế Tài chính Ngân hàng:

1/GS.TS Nguyễn Thanh Tuyền-GS lâu năm chuyên ngành Tài chính-Ngân hàng, có khả năng hướng dẫn độc lập hoặc hướng dẫn chính NCS và tham gia các Hội đồng chuyên ngành

2/GS.TS Dương Thị Bình Minh-GS ngành Tài chính-Ngân hàng, có khả năng hướng dẫn độc lập hoặc hướng dẫn chính NCS và tham gia các Hội đồng chuyên ngành

3/ PGS.TS Ngô Hương, PGS chuyên ngành Tài chính-Ngân hàng, có khả năng hướng dẫn chính NCS và tham gia các Hội đồng chuyên ngành

4/PGS.TS Nguyễn Thị Nhung, PGS chuyên ngành Tài chính-Ngân hàng, có khả năng hướng dẫn chính NCS và tham gia các Hội đồng chuyên ngành

5/TS. Hồ Diệu, TS kinh nghiệm lâu năm ngành Tài chính-Ngân hàng, có khả năng hướng dẫn chính NCS và tham gia các Hội đồng chuyên ngành

6/ TS. Peter Phan Kiên đang giảng dạy ngành Tài chính-Ngân hàng tại ĐH New South Wales, mong muốn được hợp tác, và có nguyện vọng về Bộ môn Tài chính-Ngân hàng khi kết thúc hợp đồng giảng dạy tại Úc, có khả năng đồng hướng dẫn NCS và tham gia các hội đồng chuyên ngành

7/TS. Nguyễn Thanh Dương, TS chuyên ngành Tài chính-Ngân hàng, có khả năng đồng hướng dẫn NCS và tham gia các hội đồng chuyên ngành

8/TS. Nguyễn Hồng Thắng, TS chuyên ngành Tài chính-Ngân hàng, có khả năng đồng hướng dẫn NCS và tham gia các hội đồng chuyên ngành

9/TS Nguyễn Văn Thuận, TS chuyên ngành Tài chính-Ngân hàng, có khả năng đồng hướng dẫn NCS và tham gia các hội đồng chuyên ngành

.....

3.3. Công tác nghiên cứu khoa học phục vụ đào tạo chuyên ngành.

Trong thời gian qua Bộ môn Tài chính-Ngân hàng đã thực hiện nhiều đề tài nghiên cứu khoa học trong nước cũng như các dự án hợp tác quốc tế có khả năng ứng dụng vào thực tế điều hành của ngành tại Việt Nam và phục vụ công tác đào tạo chuyên ngành bao gồm:

A-Các đề tài nghiên cứu trong nước:

1/ Đề tài cấp Bộ: Tác động của đầu tư vốn Ngân sách đối với thu hút đầu tư tư nhân và FDI, đề tài cấp Bộ thực hiện năm 2003-2004, đã bảo vệ, Đề tài do GS.TS Nguyễn Thị Cảnh làm chủ nhiệm

2/ Đề tài cấp Đại học Quốc gia: Đánh giá hiệu quả các mô hình tín dụng phục vụ người nghèo tại Tiền Giang, thực hiện năm 2004-2005, đã bảo vệ. Đề tài do TS. Trần Việt Hoàng làm chủ nhiệm

3/Đề tài cấp cơ sở: Nâng cao năng lực cạnh tranh của các ngân hàng thương mại Việt nam, thực hiện năm 2005, đã bảo vệ. Đề tài do TS. Trương Quang Thông làm chủ nhiệm

4/ Đề tài cấp cơ sở: Chính sách tỷ giá tại Việt nam, thực hiện 2005-2006, chờ bảo vệ. Đề tài do NCS, ThS. Hoàng Công Gia Khánh làm chủ nhiệm

5/ Đề tài cấp cơ sở: Thị trường tài chính phi chính thức tại Việt nam, thực hiện năm 2006, sắp hoàn thành, Đề tài do Th.S Hoàng Thọ Phú làm chủ nhiệm

B-Các đề tài hợp tác quốc tế:

1/ Nghiên cứu các nhân tố tác động đến khả năng cạnh tranh của các doanh nghiệp thực phẩm Việt nam (theo các mô hình mô phỏng thông qua các chỉ số tài chính)- thực hiện 2003-2005, kết thúc năm 2005. Đề tài do Trung tâm Nghiên cứu Phát triển Quốc tế Canada (CRID) tài trợ. Đề tài do GS.TS. Nguyễn Thị Cảnh làm chủ nhiệm;

2/ Đánh giá chính sách đầu tư ưu đãi qua thuế thu nhập doanh nghiệp tại Việt nam, thực hiện và kết thúc trong năm 2004-Dự án do Cơ quan Hỗ trợ Phát triển Quốc tế Hoa kỳ (USAID) tài trợ. Dự án do GS.TS. Nguyễn Thị Cảnh làm chủ nhiệm;

3/ Đánh giá chính sách tín dụng cấp tỉnh tại Việt nam-Thực hiện năm 2005, kết thúc tháng 6/2006-Dự án do cơ quan Hỗ trợ Phát triển Quốc tế Hoa kỳ tài trợ. Dự án do GS.TS. Nguyễn Thị Cảnh làm chủ nhiệm

C-Hướng nghiên cứu và hợp tác quốc tế trong thời gian tới:

(1) Tiếp tục đăng ký các đề tài cấp Bộ, cấp cơ sở có nguồn vốn từ ngân sách. Những đề tài này sẽ tập trung vào lĩnh vực Tài chính công, Thị trường tài chính, Hệ thống ngân hàng, chính sách Tài chính-Tiền tệ của thời kỳ hậu WTO. Tạo cơ hội cho cán bộ giảng viên trẻ, NCS chủ trì hoặc tham gia phần nhiều;

(2) Tiếp tục hợp tác quốc tế với các Viện, Trường nước ngoài thực hiện các dự án có nguồn vốn hỗ trợ từ các tổ chức quốc tế nghiên cứu phát triển hệ thống tài chính, chính sách tài chính công thời kỳ hậu TWO tại Việt nam. Các đối tác đã, đang và sẽ hợp tác nghiên cứu tiếp gồm:

- Dự án nâng cao năng lực cạnh tranh Việt nam-Quỹ Châu Á và Cơ quan hỗ trợ phát triển Hoa Kỳ phối hợp;

- Các dự án của World Bank, ADB, UNDP tại Việt nam;

- Dự án với Đại học Paris 6, Cộng Hoà Pháp về Tài chính Quốc tế và phát triển hệ thống Ngân hàng;

- Dự án phối hợp nghiên cứu với các trường Đại học Mỹ gồm ĐH Nevada, ĐH Florida về lĩnh vực tài chính doanh nghiệp và thị trường tài chính

- Ngoài thực hiện hợp tác nghiên cứu sẽ có các hợp tác đào tạo, trao đổi giảng viên, sinh viên, học viên cao học, nghiên cứu sinh, và chương trình đào tạo với các trường

ĐH của Mỹ, Pháp, Đức, Úc và Singapore theo các thỏa thuận song phương giữa Khoa Kinh tế và các trường đối tác

(3) Nghiên cứu, tư vấn tài chính-ngân hàng theo đơn đặt hàng của các đơn vị doanh nghiệp, ngân hàng, các quỹ đầu tư và cơ quan quản lý nhà nước.

IV. ĐỊNH HƯỚNG DANH MỤC CHUYÊN ĐỀ TIẾN SĨ

NCS phải tham gia các đề tài nghiên cứu khoa học thuộc ba lĩnh vực của chuyên ngành Kinh tế Tài Chính – Ngân hàng gồm: Tài chính công – Tài chính phát triển, Tài chính doanh nghiệp – Thị trường tài chính, và Tiền tệ – Ngân hàng.

A. Những đề tài nghiên cứu thuộc lĩnh vực Tài chính công-Tài chính phát triển, bao gồm

1. Đánh giá các chính sách thuế, phương pháp định phí, chính sách phí dịch vụ công; Đánh giá tác động của các chính sách thuế/phí đến đầu tư, tiết kiệm, tiêu dùng...
2. Đánh giá, thẩm định chính sách chi tiêu công, lựa chọn danh mục đầu tư, chi tiêu công...
3. Đánh giá môi trường đầu tư liên quan đến tài chính công, hiệu quả của chính sách thuế,
4. Những vấn đề liên quan đến vay nợ trong và ngoài nước và phát hành trái phiếu chính phủ, quản lý nợ, quản lý vốn ODA;
5. Những vấn đề dự toán và quản lý Ngân sách...
6. Đánh giá Mô hình tín dụng nhỏ cho các đối tượng nghèo,
7. Vai trò đầu tư với tăng trưởng kinh tế, mối quan hệ giữa phát triển tài chính và phát triển kinh tế, các mô hình định lượng thể hiện mối quan hệ giữa phát triển tài chính, mối quan hệ giữa đầu tư...
8. Phát triển hệ thống tài chính, các định chế tài chính trung gian, phát triển các mô hình quỹ, công ty tài chính, công cụ tài chính, đầu tư tài chính và phát triển kinh tế, khủng hoảng tài chính và khủng hoảng kinh tế...
9. Những vấn đề liên quan đến xây dựng nền tài chính công bền vững trong giai đoạn hội nhập-hậu WTO

B. Những đề tài nghiên cứu thuộc tài chính doanh nghiệp – Thị trường tài chính bao gồm:

1. Các vấn đề liên quan đến các nội dung trong doanh nghiệp như chính sách tài trợ, huy động các nguồn vốn, hiệu quả sử dụng vốn, chính sách cổ tức. Vận dụng các mô hình quản trị tài chính hiện đại vào điều kiện đặc thù của các doanh nghiệp Việt nam;
2. Phương pháp định giá doanh nghiệp, cổ phần hóa, cấu trúc sở hữu theo các hình thức tổ chức công ty;

3. Những vấn đề liên quan đến chi phí tài chính, chi phí vốn, chi phí giao dịch trong nền kinh tế chuyển đổi Việt Nam
4. Phát triển các sản phẩm, công cụ tài chính, phát triển thị trường tài chính gồm cả thị trường sơ cấp, thứ cấp, thị trường quyền chọn...Phân tích thị trường tài chính Việt nam so sánh với thị trường tài chính khu vực và quốc tế
5. Phát triển các sản phẩm của thị trường tài chính phù hợp với xu thế hội nhập, những dự báo xu hướng thị trường thời kỳ hậu TWO...
6. Phân tích đầu tư tài chính, quản trị danh mục đầu tư, các công cụ phái sinh..., khả năng phát triển thị trường quyền chọn trong điều kiện Việt nam
7. Các phương pháp đánh giá rủi ro, phân tích và quản lý rủi ro trong đầu tư tài chính...Nghiên cứu đánh giá, dự báo các rủi ro tiềm ẩn trong thị trường tài chính Việt nam.....

C. Những đề tài nghiên cứu thuộc lĩnh vực Tiền tệ – Ngân hàng, gồm:

1. Chính sách tiền tệ, chính sách tỷ giá hối đoái, chính sách lãi suất, huy động vốn, chính sách tín dụng...Hướng thay đổi của chính sách trong giai đoạn hậu TWO
2. Xu hướng và hiệu quả hoạt động tín dụng, hoạt động huy động vốn của hệ thống ngân hàng thương mại trong giai đoạn chuyển đổi và bối cảnh hội nhập, nhất là khi Việt nam thực hiện các cam kết mở cửa thị trường tài chính, cho các ngân hàng nước ngoài hoạt động bình đẳng như các ngân hàng trong nước...
3. Chiến lược phát triển sản phẩm, dịch vụ ngân hàng theo xu hướng hội nhập...
4. Thẩm định tín dụng, đánh giá rủi ro tín dụng, nợ xấu, dự phòng rủi ro, những khuyến cáo cho các ngân hàng thương mại Việt nam
5. Phương pháp đánh giá hiệu quả hoạt động của các ngân hàng thương mại và hệ thống ngân hàng nói chung theo khung phân tích CAMELL,
6. Đánh giá năng lực cạnh tranh của các ngân hàng thương mại trong bối cảnh hội nhập quốc tế

V. ĐIỀU KIỆN CƠ SỞ VẬT CHẤT PHỤC VỤ ĐÀO TẠO

5.1 Tài liệu trực tiếp phục vụ giảng dạy

DANH MỤC GIÁO TRÌNH TÀI LIỆU GIẢNG DẠY ĐANG CĨ TRONG THƯ VIỆN KHOA KINH TẾ

STT	Tên tài liệu giảng dạy	Tên tác giả	Tên NXB, năm xuất bản	Tiếng
------------	-------------------------------	--------------------	------------------------------	--------------

1	Giáo trình Triết học cho CH&NCS không chuyên ngành Triết học. 3 tập	Tập thể tác giả – Bộ GD&ĐT	NXB CTQG, HN, 2001.	Tiếng Việt
2	New Headway. Upper Intermediate.	Tập thể tác giả - Oxford University	Oxford University Press 2001	Tiếng Anh
3	Các phương pháp nghiên cứu kinh tế	Pervez N. Ghauri và các tác giả khác	NXB Quốc tế, London, 1995	Tiếng Anh
4	Phương pháp luận nghiên cứu khoa học	GS. Nguyễn Văn Lê	NXB Trẻ, TP.HCM, 2001	Tiếng Việt
5	Phương pháp nghiên cứu khoa học/ Phương pháp luận nghiên cứu khoa học kinh tế	Phượng Kỳ Sơn Nguyễn Thị Cành	NXB CTQG, HN 2001 NXB ĐHQG TP.HCM, 2004	Tiếng Việt
6	Giáo trình Hệ thống thông tin Quản lý	Trương Văn Tú, Trần Thị Song Minh	NXB TK, Hà Nội 2001	Tiếng Việt
7	Giáo trình Tin học ứng dụng	Hàn Viết Thuận	NXB TK, Hà Nội 1999	Tiếng Việt
8	Management Information Systems	Jame A. Obrien	Prentice Hall, 1996.	Tiếng Anh
9	Giáo trình Tin học quản lý dùng cho Sau đại học	Tạ Minh Châu, Nguyễn Văn Sĩ	NXB TK, 1998	Tiếng Việt
10	Tài chính công - Tài liệu biên dịch Khoa Kinh tế ĐHQG Tp.HCM, 2003	Bộ môn TC – NH Khoa Kinh tế ĐHQG HCM	NXB ĐHQG TP HCM, 2003	Tiếng Việt
11	Quản lý tài chính Nhà nước		NXB Tài chính 2000	Tiếng Việt
12	Economics of Money, Banking, Financial Markets – Fifth edition	Frederic S. Miskin	Mc GrawHill 1998	Tiếng Anh
13	Lý thuyết tài chính tiền tệ. 2003	Tài liệu biên soạn Khoa Kinh tế ĐHQG TP.HCM,	NXB ĐHQG TP HCM, 2003	Tiếng Việt
14	Giáo trình thuế,	GS.TS. Nguyễn Thanh Tuyền, TS. Nguyễn Ngọc Thanh	NXB Tài chính 2001	Tiếng Việt
15	Principles of Corporate Finance. Sixth edition.	Brealey and Myers.	Mc Graw Hill. 2000.	Tiếng Anh
16	Essentials of Investment	Bodie Kane Marcus	Mc Graw Hill – 2002	Tiếng Anh

17	Giáo trình Quản trị tài chính	Tài liệu biên soạn Khoa Kinh tế ĐHQG Tp.HCM,	NXB ĐHQG TP HCM, 2003	Tiếng Việt
18	Quản trị ngân hàng thương mại.	GS.TS. Lê Văn Tề	Nhà Xuất bản Thống kê, 2003.	Tiếng Việt
19	Phân tích kinh tế các dự án đầu tư	Harold Bierman, Jr. Seymour Smidt	Nhà Xuất bản Thống kê 2001	Tiếng Việt
20	Tài chính quốc tế hiện đại.	Nguyễn Văn Tiến.	Nhà xuất bản Thống kê, 2001.	Tiếng Việt
21	Managerial Accounting (Sixth edition)	Ray H. Garrison	IRWIN 1990	Anh
22	Cost Accounting: (Eight edition)	Charles T. Horngren, George Foster, Srikant M. Datar	Prentice Hall 1994	Tiếng Anh
23	Futures, Options and Swaps, 3 rd edition,	Kolb W. Robert	Blackwell Publisher 1999	Tiếng Anh
24	Options, Futures, and Other Derivatives, 4 th edition,	Hull C. John	Prentice Hall 2000	Tiếng Anh
25	Investment Management	Frank J. Fabozzi	Mc Graw Hill – 2001	Tiếng Anh
26	Portfolio Management, theory and application –	James L	Mc Graw Hill – 2000	Tiếng Anh
27	Financial Institutions Management	Anthony Saunders	Mc Graw Hill – 1997	Tiếng Anh
28	Public Finance, 4 th Edition	Eleanor Brown, Robert L. Moore	Irwin, 1996	Tiếng Anh
29	Modeling Monetary Economics	Bruce Champ, Scott Freeman	Cambridge 2001	Tiếng Anh
30	Applied Econometrics	Lardaro	Harper Collins 1993	Tiếng Anh
31	Public Finance	Harvey S. Rosen	Mc Graw Hill – 2002	Tiếng Anh
32	Project Management	Gray Larson	Mc Graw Hill – 2001	Tiếng Anh
33	Managerial Accounting	Lane K. Anderson, Harold M. Sollenberger	South-Wester Publishing Co. 2000	Tiếng Anh
34	Marketing căn bản. Bản dịch.	Kotler, Philip.	Nhà xuất bản Thống kê, Hà	Tiếng Việt

			Nội, 2000.	
35	Marketing bancaire.	Lamarque, E.	Dunod, Paris, 1999.	Tiếng Anh
36	Financial Services Marketing.	Harrison, Tina.	Pearson Education, 2000.	Tiếng Anh
37	Services Marketing.	Lovelock, Christopher.	Prentice Hall, 2001.	Tiếng Anh
38	International Finance.	Ephraim Clark, Michel Levasseur and Patrick Rousseau.	International Thomson Business Press, 1998.	Tiếng Anh
39	Money and Capital Markets: the Financial System in the Economy. 4 th Edition	Rose, Peter S.	Irwin Pl. 1992	Tiếng Anh
40	Mergers, Acquisitions and Corporate Restructurings, 3 rd edition	John Wiley & Sons,	,Prentice Hall, 2002	Tiếng Anh
41	Mergers, Acquisitions, and Other Restructuring Activities: An Integrated Approach to Process, Tools, Cases, and Solutions, Second Edition (Mergers, Acquisitions, and other Restructuring Activities) by		Donald DePamphilis 2001	Tiếng Anh
42	The Complete Guide to Mergers and Acquisitions : Process Tools to Support M&A Integration at Every Level	<u>Timothy J. Galpin</u> , <u>Mark Herndon</u> 2002		Tiếng Anh
43	The Art of Risk Management	Cupl C.L	New York . 2002	Tiếng Anh
44	The theory and practice of insurance	Outrevile J.F	London. Kluwer academic Publisher 1998	Tiếng Anh
45	Risk management and insurance 7 th Edition	William C.A, Young P.C	McGraw Hill 1995	Tiếng Anh
46	Value at Risk –International Edition 2th	Philippe Jorion –	Mc. Graw Hill2002	Tiếng Anh
47	The professional Handbook of	William. Deboral –	Mc. Graw Hill	Tiếng

	Risk Management-		2000	Anh
48	Financial Engineering and Risk Management	Stuz Rene.	South Westen Publisher 2000	Tiếng Anh
49	Financial Management	Eugene F. Brigham & Michael C. Ehrhardt	Thomson, 2005	Tiếng Anh
50	Porfolio Management	Frank K. Reilly	Thomson, 2005	Tiếng Anh
51	Investment Analysis	Keith C. Brow	Thomson,2005	Tiếng Anh
52	Tax	Richard R	Thomson, 2005	Tiếng Anh
53	Tài chính công	GS.TS Nguyễn Thị Cành, cùng các TG	ĐH Quốc gia TP.HCM, 2006	Tiếng Việt

5.2 Hệ thống phòng học và thư viện phục vụ đào tạo:

Khoa Kinh tế có đầy đủ phòng học với các trang thiết bị hiện đại như: Máy tính, LCD, Projector, ... Khoa có một thư viện với 5000 đầu sách bằng tiếng Anh và tiếng Việt đủ các chuyên ngành, trong đó đặc biệt có nhiều tài liệu dành cho tài chính ngân hàng. Ngoài ra, bộ môn Tài chính Ngân hàng hiện đang hợp tác với nhà xuất bản Thomson Hoa Kỳ dịch một số sách chuyên ngành Tài chính-Ngân hàng ra tiếng Việt Cán bộ giảng dạy và NCS cũng có thể sử dụng Thư viện trung tâm của ĐH quốc gia để tra cứu tài liệu phục vụ nghiên cứu.

VI. ĐỀ CƯƠNG CHI TIẾT CÁC MÔN HỌC CHUYỂN ĐỔI

6.1. ĐỀ CƯƠNG MÔN HỌC CHUYỂN ĐỔI THI NCS

Tên môn học : **TÀI CHÍNH PHÁT TRIỂN**

-Mã số môn học: LTTC 601

-Số đơn vị học trình: 3(2LT, 1 TL)

- **Giảng viên phụ trách: GS.TS. Nguyễn Thị Cành,
TS. Nguyễn Hồng Nhật
TS. Trương Quang Thông**

Mô tả môn học: Tài chính phát triển là môn học nghiên cứu các vấn đề tài chính của các nước đang phát triển. Việt nam là nước đang phát triển, (thuộc nhóm nước đang phát triển có thu nhập thấp và có nền kinh tế chuyển đổi). Trong bối cảnh toàn cầu hóa và hội nhập quốc tế, có nhiều vấn đề liên quan đến lĩnh vực tài chính ngân hàng còn rất mới mẻ, thị trường tài chính mới sơ khai cần được quan tâm đầu tư phát triển cho phù hợp với sự phát triển đa dạng của các thị trường tài chính khu vực và thế giới..

Trong phạm vi thời lượng là 3 đơn vị học trình hay 3 tín chỉ (45 tiết học). Nội dung của môn học này sẽ tập trung vào 5 vấn đề hay 5 chuyên đề (bài giảng) chính yếu của “Tài chính phát triển” đó là:

Bài 1: Thị trường tài chính và các kênh huy động vốn;

Bài 2: Các chỉ tiêu đánh giá mức độ lành mạnh (sức khoẻ) của hệ thống tài chính

Bài 3: Các công cụ quản lý rủi ro của thị trường tài chính;

Bài 4: Khủng hoảng tài chính khu vực: Bài học kinh nghiệm cho Việt nam

Bài 5: Phát triển tài chính với phát triển kinh tế

Mỗi chuyên đề (bài giảng) trên sẽ được thực hiện trong từ 7 (8)-10 tiết, trong đó có 60-70% số tiết trình bày lý thuyết và 30-40% số tiết thực hành (bài tập nghiên cứu tình huống, viết bài tiểu luận và thảo luận). Mỗi chuyên đề sẽ do một giáo viên có trình độ tiến sĩ trở lên và có kinh nghiệm nghiên cứu thực tế đảm nhiệm. Dưới đây là đề cương chi tiết của từng chuyên đề.

Mục tiêu môn học: Mục đích của môn học tài chính phát triển là giới thiệu cho học viên những vấn đề tài chính mà các nước đang phát triển đang phải đối diện trong quá trình phát triển và điều hành chính sách của phát triển nền kinh tế theo xu hướng hội nhập và toàn cầu hóa

Nội dung môn học

Chương	Nội dung	Số tiết			Tài liệu tham khảo
		TS	L T	T H	
1. Chuyên đề 1: Thị trường tài chính và các kênh huy động vốn	<p>Bài học bắt đầu bằng việc giới thiệu một bức tranh tổng quan về hệ thống tài chính, những thể chế và các thành phần của nó. Học viên sẽ được làm quen với những khái niệm cơ bản về công cụ, thị trường, thể chế và cơ sở hạ tầng tài chính mà chúng ta thường gặp trong những nền kinh tế tiên tiến. Sau đó sẽ chuyển sang nghiên cứu các thành tố của một hệ thống tài chính và phân tích cách thức nhà nước can thiệp vào thị trường tài chính ở các nước chuyển đổi và đang phát triển. Ở đây vai trò của nhà nước trong việc tạo lập và hỗ trợ thị trường tài chính được nhấn mạnh, đặc biệt trong bối cảnh của các nền kinh tế chuyển đổi.</p> <p>1.1: Giới thiệu hệ thống tài chính 1.1.1. Hệ thống tài chính 1.1.2. Các thị trường tài chính 1.1.3.4. Trung Gian Tài Chính</p> <p>1.2. Chức năng của hệ thống tài chính</p> <ul style="list-style-type: none"> • Cầu nối giữa tiết kiệm và đầu tư • Tập trung, phân tán, giảm bớt rủi ro • Giám sát doanh nghiệp • Vận hành hệ thống thanh toán <p>1.3. Cấu trúc một hệ thống tài chính</p> <p style="padding-left: 40px;">Thị trường tài chính Tổ chức tài chính Công cụ tài chính Cơ sở hạ tầng tài chính</p> <p>1.4. Vai trò của nhà nước trong việc phát triển hệ thống tài chính Bài tập: (1) Thảo luận về thị trường tài chính và các kênh huy động vốn tại Việt nam hiện nay (2) Vai trò của Nhà nước Việt nam trong phát triển thị trường tài chính và hệ thống tài chính</p>	7	4	3	Xem phần dưới

<p>2. Chuyên đề 2: Các chỉ tiêu đánh giá mức độ lành mạnh của hệ thống tài chính</p>	<p>Chuyên đề giới thiệu khung phân tích CAMELS được các nhà kinh tế tài chính và IMF giới thiệu để đánh giá mức độ lành mạnh của một hệ thống tài chính nhìn từ góc độ vi mô và vĩ mô, mối quan hệ giữa các chỉ số tài chính vi mô và các chỉ số kinh tế vĩ mô. Qua việc xem xét đánh giá của khung phân tích này có thể xem xét thực tế hệ thống tài chính Việt nam hiện đang ở mức độ lành mạnh hay kém lành mạnh ở mức nào. Nội dung bài giảng gồm:</p> <p>2.1 Giới thiệu Bảng tổng hợp các chỉ tiêu đánh giá mức độ lành mạnh (sức khỏe) của hệ thống tài chính- Macroprudential Indicators of Financial System Soundness</p> <p>2.2 Các chỉ số tổng hợp vi mô (Aggregated Microprudential Indicators)</p> <p>2.2.1 Đảm bảo đủ vốn (vốn tối thiểu):</p> <ul style="list-style-type: none"> - Các tỷ lệ vốn tổng hợp; - Tần suất phân bố tỷ lệ vốn <p>2.2.2 Chất lượng tài sản</p> <ul style="list-style-type: none"> - Định chế tín dụng; - Chủ thể vay mượn; <p>2.2.3 Quản trị lành mạnh tài chính</p> <p>2.2.4 Thu nhập và khả năng sinh lời:</p> <ul style="list-style-type: none"> - Tỷ suất sinh lời trên tài sản (ROA); - Tỷ suất sinh lời trên vốn sở hữu (ROE); - Các tỷ lệ thu nhập và chi phí; - Các chỉ số cấu trúc khả năng sinh lời <p>2.3 Các chỉ số vĩ mô</p> <p>2.3.1 Tăng trưởng kinh tế:</p> <p>2.3.2 Cán cân thanh toán:</p> <p>2.3.3 Lạm phát:</p> <p>2.3.4 Tỷ suất hối đoái và lãi suất:</p> <p>Bài tập: Thu thập dữ liệu về các chỉ số vi mô và vĩ mô qua đó có thể đánh giá mức độ lành mạnh của hệ thống tài chính Việt nam hiện nay (làm vi ệc theo nhóm)</p>	8	5	3	
---	---	---	---	---	--

<p>3. Bài 3: Các công cụ quản lý rủi ro của thị trường tài chính</p>	<p>Mục tiêu của bài giảng là cung cấp cho học viên tìm hiểu về các dạng rủi ro, nguyên nhân của rủi ro, cách thức đo lường rủi ro và biện pháp phòng ngừa rủi ro. Từ cơ sở lý thuyết, học viên có thể vận dụng thực tế các dạng rủi ro tài chính tại Việt nam, ứng với mỗi dạng tìm biện pháp phòng ngừa rủi ro thích hợp qua bài tập tình huống.</p> <p>3.1 Các loại rủi ro</p> <ul style="list-style-type: none"> ▪ .Rủi ro kinh doanh:biến thiên về giá thành, giá bán,doanh số,cạnh tranh v.v... ▪ .Rủi ro tài chính: lãi suất vay nợ,giá cổ phiếu v.v. ▪ .Rủi ro thể chế ▪ .Rủi ro sức mua do lạm phát ▪ .Rủi ro tỷ giá hối đoái ▪ .Rủi ro thị trường,rủi ro dự án,rủi ro quốc gia v.v... <p>3.2 Các dạng rủi ro tài chính và phương pháp đo lường rủi ro tài chính (rủi ro thị trường, rủi ro tín dụng, rủi ro thanh khoản, rủi ro tiềm năng)</p> <p>3.3 Các rủi ro tiềm tàng của phát triển tài chính</p> <ul style="list-style-type: none"> - Chất lượng phát triển tài chính thấp - Không phân bổ nguồn lực một cách hiệu quả; trái lại có thể gây nên gánh nặng nợ nần - Không có khả năng “tiêu hoá” các nguồn tài chính huy động được (vd: viện trợ) - Hệ thống tài chính không bền vững (vd: sự sụp đổ của hệ thống HTX tín dụng, nợ xấu của NHTMQD, tăng cung tiền dẫn đến nguy cơ đầu cơ và lạm phát) - Phát triển tài chính không tương thích với điều kiện kinh tế, với hệ thống thể chế và chính sách quốc gia <p>3.4 Tập trung và phân tán rủi ro</p> <ul style="list-style-type: none"> • Các giao dịch tài chính thường đi đôi với rủi ro • Một hệ thống tài chính hoạt động tốt giúp đánh giá, tập trung, chuyển hóa, và phân tán rủi ro <ul style="list-style-type: none"> - “Sàng lọc” rủi ro (screening) <ul style="list-style-type: none"> - Quản lý rủi ro (các công cụ phái sinh) - giảm rủi ro (đa dạng hóa danh mục đầu tư, các quỹ đầu tư) <p>3.5 Các công cụ quản lý rủi ro</p> <p>Trnh? Đa dạng hóa; Phòng ngừa (Hedging); Bảo hiểm</p> <p>Chiến lược quản lý rủi ro</p> <p>Bài tập tình huống: Nhận diện các dạng rủi ro tại Việt nam- Các dạng rủi ro tài chính</p> <p>Biện pháp phòng ngừa cho từng loại rủi ro</p>	10	7	3	
--	--	----	---	---	--

<p>4. Chuyên đề 4: Khủng hoảng tài chính khu vực: Bài học kinh nghiệm cho Việt nam</p>	<p>Trong bài giảng này sẽ giới thiệu qua về lịch sử các cuộc khủng hoảng tài chính trên thế giới, phân loại các loại khủng hoảng, đặc biệt trình bày sâu về cuộc khủng hoảng tài chính khu vực mới đây, nguyên nhân của các cuộc khủng hoảng và những bài học kinh nghiệm cho Việt nam.. Bài giảng này gồm những nội dung sau:</p> <p>4.1- Khủng hoảng tài chính, tiền tệ-Những vấn đề lý thuyết và phân loại</p> <ul style="list-style-type: none"> - Khủng hoảng tiền tệ và vấn đề tỷ giá hối đoái; - Khủng hoảng tín dụng và nợ <p>4.1-Tổng quan về lịch sử khủng hoảng tài chính trên thế giới</p> <ul style="list-style-type: none"> - Các nước phát triển; - Các nước nam Mỹ; - Các nước chuyển đổi kinh tế; - Nhận định và so sánh qua các cuộc khủng hoảng tài chính (những điểm chung và sự khác biệt). <p>4.2- Khủng hoảng tài chính tài Nam Á</p> <ul style="list-style-type: none"> - Diễn biến và nguyên nhân; - Những nguyên nhân dẫn đến khủng hoảng tài chính; - Những yếu kém của lĩnh vực tài chính là nguy cơ đưa đến các cuộc khủng hoảng; - Tác động tiêu cực của khủng hoảng tài chính đến tăng trưởng kinh tế của các nước trong khu vực và kinh tế thế giới <p>4.3- Bài học kinh nghiệm cho Việt nam</p> <ul style="list-style-type: none"> - Những bài học được rút ra từ kinh nghiệm các nước; - Những chính sách tài chính cần quan tâm để tránh khủng hoảng <p><u>Bài tập tình huống:</u> giải quyết các vấn đề vay và trả nợ, về tỷ giá để hạn chế các rủi ro dẫn đến khủng hoảng</p>	10	7	3	
--	---	----	---	---	--

<p>5. Chuyên đề 5: Phát triển tài chính và phát triển kinh tế</p>	<p>Chuyên đề này sẽ giới thiệu cho học viên hệ thống các chỉ số phát triển tài chính và phát triển kinh tế. Mỗi quan hệ nhân quả của các chỉ tiêu này như thế nào qua phân tích các mô hình (vận dụng các mô hình kinh tế lượng) để đánh giá mối quan hệ và tác động qua lại. Từ các kết quả phân tích có thể cho các dự báo và gợi ý chính sách phát triển tài chính nên như thế nào trong giai đoạn tới. Nội dung chuyên đề 5 gồm:</p> <p>5.1- Khái niệm các chỉ số về phát triển tài chính</p> <ul style="list-style-type: none"> - Các chỉ số phát triển; - Cách thức đo lường. <p>5.2-Mối quan hệ giữa phát triển tài chính và phát triển kinh tế</p> <ul style="list-style-type: none"> - Mối quan hệ tương quan; - Quan hệ nhân quả; - Cơ sở lý thuyết của quan hệ nhân quả giữa phát triển tài chính và quan hệ kinh tế qua mô hình định lượng; - Hiệu quả hoạt động tài chính với tăng tiết kiệm và đầu tư; - Phát triển tài chính với tăng năng suất; - Các thước đo khác về phát triển tài chính (chỉ số phát triển /GDP); - Phát triển tài chính với giảm nghèo và ổn định kinh tế. <p>5.3-Kinh nghiệm phát triển tài chính với tăng trưởng kinh tế ở một số nước và Việt nam.</p> <ul style="list-style-type: none"> - Kinh nghiệm của các nước Asian; Trung Quốc Đài Loan; - Thực tiễn Việt nam; - So sánh <p>Bài tập tình huống: Xác định các chỉ số phát triển tài chính của Việt nam, mối quan hệ của phát triển tài chính với tăng trưởng kinh tế, bình luận và các gợi ý chính sách của bạn. Phân theo nhóm, áp dụng các mô hình khác nhau đưa ra kết quả và so sánh chung.</p>	10	7	3	
	Tổng cộng	45	30	15	

Tài liệu tham khảo

- 1) Frederic S. Miskin - Economics of Money, Banking, Financial Markets – Fifth edition – 1998
- 2) Frank J. Fabozzi – Investment Management - Second Edition – 2000
- 3) David Blake – Phân Tích Thị Trường Tài Chính (bản dịch) – 2000.
- 4) Cheol S. Sun & Bruce G. Resnick – International Financial Management – 2000.
- 5) Martin Neil Baily & Philip Friedman - Macroeconomics, Financial Markets And The International Sector - 1993]
- 6) Manuel F. Montes & Vladimir V. Popov: The Asian crisis turns global, 1999
- 7) IMF- Macprudential Indicators of Financial System Soundness, 2005
- 8) Bài giảng Tài chính phát triển-Chương trình Fulbright, 2004-2005

Phương pháp đánh giá môn học:

- Điểm kiểm tra, tiểu luận hoặc thuyết trình, trọng số: 30%.
- Điểm thi hết môn trọng số: 70%.

6.2. ĐỀ CƯƠNG MÔN HỌC CHUYÊN ĐỒ THI NCS

- Tên môn học : **TÀI CHÍNH CÔNG**
- Mã số môn học: TCC 602
 - Số đơn vị học trình: 3 (2 LT, 1TL)
 - Giảng viên môn học: GS - TS Nguyễn Thị Cành
 GS - TS Dương Thị Bình Minh

-Mô tả môn học: Môn học tài chính công nâng cao cho các lớp cao học sẽ đề cập đến các nội dung chuyên sâu của tài chính công.

-Mục tiêu môn học: Mục đích của môn học là giới thiệu những nội dung chính yếu về tài chính công, những vấn đề về quan điểm, thực tiễn vận dụng lý thuyết trong ban hành chính sách tài chính công, các công cụ phân tích, đánh giá chính sách, cơ sở và quan điểm hình thành chính sách thuế, chính sách chi tiêu quốc gia, giới thiệu kinh nghiệm quốc tế và thực tiễn Việt Nam nhằm giúp cho học sinh nắm bắt những vấn đề vừa cơ bản, vừa mở rộng, những vấn đề cơ sở lý luận và kỹ thuật phân tích tài chính công.

-Nội dung môn học

Chương	Nội dung	Số tiết			Tài liệu tham khảo
		T S	L T	TH	
1. Giới thiệu môn học	1.1- Một số khái niệm về tài chính công 1.2- Mục đích, ý nghĩa của môn học tài chính công 1.3-Khái niệm và bản chất của tài chính công 1.4. Tài chính công và các quan điểm về tài chính công -Cơ sở pháp lý hình thành chính phủ -Các mô hình tổ chức Chính phủ và tài chính công -Các quan điểm về tài chính công 1.5-Các nội dung cơ bản của môn học tài chính công -Nội dung mang tính cơ sở nền tảng -Nội dung về Ngân sách nhà nước và quản lý NSNN -Nội dung về thuế Câu hỏi thảo luận	6	4	2	

<p>2 Một số công cụ phân tích tài chính công</p>	<p>2.1-Phân tích thực chứng 2.1.1-Vai trò của lý thuyết 2.1.2-Các phương pháp phân tích theo kinh nghiệm 2.2-Phân tích quy chuẩn 2.2.1-Kinh tế học công cộng 2.2.2-Định lý cơ bản của kinh tế học công cộng 2.3-Phân tích chi phí-lợi ích 2.3.1-Giá trị hiện tại 2.3.2-Đánh giá dự án của khu vực tư nhân (Suất chiết khấu nội sinh, tỷ lệ lợi ích-chi phí) 2.3.3-Suất chiết khấu của khu vực kinh tế công cộng (Suất chiết khấu khu vực tư nhân và Suất chiết khấu xã hội) 2.3.4-Đánh giá lợi ích-chi phí xã hội Các bài tập tình huống</p>	10	7	3	
<p>3. Phân tích chi tiêu công cộng</p>	<p>3.1-Hàng hóa công, ngoại tác và chính sách của chính phủ 3.1.1-Định nghĩa hàng hóa công 3.1.2-Hàng hóa công và chọn lựa công 3.2-Các chi tiêu công cộng 3.2.1-Mục đích của các chi tiêu công cộng 3.2.1-Phương hưởng của các chi tiêu công cộng 3.3. Ngoại tác 3.4. Chính sách thuế và trợ cấp đối với ngoại tác Các bài tập giả định và liên hệ thực tế</p>	8	5	3	

<p>4. Cơ sở lý luận về phân tích thuế</p>	<p>4.1-Phân phối lại thu nhập-Một số vấn đề và quan điểm 4.1.1-Phân phối thu nhập 4.1.2-Nguyên nhân cơ bản cho việc phân phối lại thu nhập 4.2- Đánh thuế và phân phối lại thu nhập 4.2.1-Phạm vi ảnh hưởng của thuế 4.2.2-Mô hình cân bằng một phần 4.2.3-Mô hình cân bằng tổng quát 4.3-Hiệu quả của việc đánh thuế 4.3.1-Gánh nặng thuế tăng thêm 4.3.2-Đo lường gánh nặng thuế tăng thêm 4.3.3-Đánh thuế phân biệt đầu vào 4.3.4-Vấn đề đánh thuế hiệu quả 4.4-Đánh thuế hiệu quả và công bằng 4.4.1-Đánh thuế vào hàng hóa tối ưu 4.4.2-Phí của người tiêu dùng tối ưu 4.4.3-Đánh thuế thu nhập tối ưu Bài tập: Vận dụng lý thuyết đánh giá chính sách thuế tại Việt nam</p>	12	8	4	
<p>5</p>	<p>Tín dụng Nhà nước và Quản lý nợ tại Việt nam 5.1 Bản chất của tín dụng nhà nước, đặc điểm, vai trò của tín dụng nhà nước 5.1.1-Bản chất TDNN 5.1.2- Đặc điểm tín dụng nhà nước 5.1.3-Vai trò TDNN 5.2-Quản lý các khoản nợ nhà nước 5.2.1-Chính sách nợ và trả nợ nhà nước 5.2.2-Các thị trường vay nợ của nhà nước 5.2.3-Các hình thức vay nợ của NN 5.2.3-Cơ chế quản lý vay nợ của NN 5.3- Quản lý các khoản cho vay của NN 5.3.1-Sử dụng vốn tín dụng NN ở trong nước 5.3.2-Cho nước ngoài vay Câu hỏi thảo luận và làm bài tập tình huống</p>	9	6	3	
	<p>Tổng</p>	<p>45</p>	<p>30</p>	<p>15</p>	

Tài liệu tham khảo:

1. “Quản lý tài chính Nhà nước”, NXB Tài chính 2000
2. “Tài chính công” Tài liệu biên dịch Khoa Kinh tế ĐHQG Tp.HCM, 2003,.
3. David Hyman: Public Finance-University of North Carolina, 2002
4. Harvey Rosen: Public Finance- University of Princeton, 2003
5. Giáo trình “Tài chính Công” chương trình Fulbright
6. Giáo trình: Tài chính công-Đại học kinh tế TP.HCM, 2005
7. Tài chính công-Khoa Kinh Tế ĐH Quốc Gia TP.HCM, 2006

Phương pháp đánh giá môn học:

- Điểm Kiểm tra hoặc tiểu luận hoặc thuyết trình, trọng số: 30%.
- Điểm thi hết môn trọng số: 70%.

6.3. ĐỀ CƯƠNG MÔN HỌC CHUYÊN ĐỒ THI NCS

Tên môn học : **TÀI CHÍNH DOANH NGHIỆP NÂNG CAO (Quản trị tài chính)**

- Mã số môn học: TCDN 606
- Số đơn vị học trình: 3 (2 lt, 1 tl)
- Giảng viên môn học: TS Nguyễn Văn Thuận
TS Nguyễn Hồng Thắng

- **Mô tả môn học:** Cung cấp cho học viên những kiến thức cơ bản về các lý thuyết hiện đại của tài chính công ty. Sinh viên sẽ được cung cấp nền tảng lý thuyết kết hợp với thực hành để nắm vững những kiến thức cơ bản về: mô hình định giá tài sản vốn CAPM, lý thuyết về cơ cấu vốn của Merton và Modigliani (M&M), lý thuyết về chính sách cổ tức, huy động vốn trên thị trường chứng khoán.

- **Mục tiêu môn học:** trang bị kiến thức và kỹ năng phân tích cho học viên áp dụng trong thực tiễn quản lý và sử dụng các nguồn lực tài chính

- **Nội dung môn học**

Chương	Nội dung	Số tiết			Tài liệu tham khảo
		TS	L T	TH	
1. Thị trường chứng khoán và định giá chứng khoán	1.1- Quyền pháp lý và ưu đãi của các cổ đông thường 1.1.1. Quyền kiểm soát 1.1.2. Quyền mua 1.2. Các dạng cổ phiếu thường 1.3. Thị trường cho cổ phiếu thông thường 1.4 Định giá cổ phiếu thông thường 1.4.1 Một số thuật ngữ dùng trong mô hình định giá 1.4.2 Cổ tức kỳ vọng 1.5 Cổ phiếu tăng trưởng cố định 1.5.1 Cổ tức và thu nhập tăng thêm 1.5.2 Lãi suất kỳ vọng 1.6 Định giá cổ phiếu tăng trưởng không ổn định 1.7 Điểm cân bằng thị trường 1.8 Giá và lợi nhuận thực tế Các dạng thị trường hiệu quả	7	5	2	

2 .Lợi nhuận, rủi ro và mô hình định giá tài sản vốn CAPM	2.1 Suất sinh lời dự kiến và biến thiên của suất sinh lời dự kiến 2.2 Danh mục 2.2.1 Tỷ trọng danh mục 2.2.2 Suất sinh lời dự kiến 2.2.3 Biến thiên của danh mục 2.3 Rủi ro: rủi ro hệ thống và không hệ thống 2.4 Đa dạng hoá và rủi ro của danh mục 2.5 Rủi ro hệ thống và Beta 2.6 CAPM và đường thị trường chứng khoán 2.7 Đường Thị trường chứng khoán và chi phí vốn	7	5	2	
3. Chi phí vốn	3.1 Khái niệm về chi phí vốn 3.2 Chi phí vốn chủ sở hữu 3.2.1 Phương pháp tăng trưởng cổ tức 3.2.2 Phương pháp đường thị trường chứng khoán 3.3 Chi phí vốn vay và cổ phiếu ưu đãi 3.4 Chi phí vốn bình quân trọng WACC 3.5 Chi phí vốn của dự án và chi nhánh	6	4	2	
4. Huy động vốn	4.1 Bán chứng khoán ra công chúng 4.2 Nhà phát hành 4.3 Chi phí và lợi ích của việc phát hành và niêm yết ra công chúng 4.4 Phát hành cổ phiếu mới và ảnh hưởng tới giá trị công ty 4.5 Quyền và phát hành quyền 4.6 Loãng giá cổ phiếu 4.7 Phát hành trái phiếu	6	4	2	
5. Đòn cân nợ và cơ cấu vốn	5.1 Ảnh hưởng của đòn cân nợ 5.2 Cơ cấu vốn và chi phí vốn chủ sở hữu: lý thuyết M&M về cơ cấu vốn 5.3 Thuyết M&M và Thuế công ty 5.4 Chi phí phá sản 5.5 Cơ cấu vốn tối ưu	6	4	2	

6. Cổ tức và chính sách cổ tức	6.1 Cổ tức tiền mặt và cổ tức cổ phiếu 6.2 Chính sách cổ tức và ảnh hưởng của chính sách cổ tức 6.3 Những yếu tố ảnh hưởng tới tỷ lệ chi trả cổ tức 6.4 Những giả thuyết về chính sách cổ tức 6.4.1 Thông tin chuyển tải bởi cổ tức 6.4.2 Hiệu ứng khách hàng (Clientele effect) 6.5 Xác lập chính sách cổ tức 6.6 Các hình thức cổ tức khác	6	4	2	
7. Chủ đề hiện đại về tài chính công ty	7.1 Thuê mua tài chính 7.2 Quyền lựa chọn (option) 7.2.1 Cơ bản về quyền lựa chọn 7.2.2 Giá trị của quyền lựa chọn 7.2.3 Ứng dụng của quyền lựa chọn trong công ty	4	4		
8	Phần hướng dẫn ôn tập và viết tiểu luận môn học	3	1	2	
		45	29	16	

Tài liệu tham khảo:

- 1- Giáo trình Quản trị tài chính (Đại học Kinh Tế TP.HCM, Đại học Kinh tế quốc dân HN, Đại học Tài chính-Học Viện tài chính)
- 2- Tài liệu biên soạn; Tài Chính doanh nghiệp (khoa Kinh Tế-ĐH Quốc Gia TP.HCM)
- 3- Eugene F. Brigham & Michael C. Ehrhardt, Financial management: theory and Practice, Thomson Publisher, 2005

Phương pháp đánh giá môn học:

- Điểm Kiểm tra hoặc tiểu luận hoặc thuyết trình, trọng số: 25%.
- Điểm thi hết môn trọng số: 75%.

6.4. ĐỀ CƯƠNG MÔN HỌC CHUYÊN ĐỔI THI NCS

- Tên môn học: **QUẢN TRỊ NGÂN HÀNG**
 - Mã số môn học: **QTNH 607**
 - Số đơn vị học trình: **3 (2 lt, 1 tl)**
 - Giảng viên môn học: **TS Hồ Diệu**
 TS Lê Ngọc Minh

- **Mô tả môn học:** là môn học tiếp theo chuyên sâu của Nghiệp vụ ngân hàng, quản trị Ngân hàng và các định chế tài chính trung gian

Mục tiêu: Có kiến thức về quản trị các định chế tài chính trung gian, các ngân hàng Thương mại, đặc biệt là quản trị tài chính của ngân hàng

- **Nội dung môn học**

Chương	Nội dung	Số tiết			Tài liệu tham khảo
		TS	LT	TH	
1. Chức năng và dịch vụ của ngân hàng hiện đại	1.1. Chức năng của ngân hàng thương mại 1.2. Ví dụ về bảng tổng kết tài sản ngân hàng thương mại 1.3. Môi trường cạnh tranh ngân hàng	2	2		
2. Quản trị, thực hiện quyết định và tổ chức nội bộ ngân hàng thương mại	2.1 Ra các quyết định và thực hiện 2.2 Thông tin liên lạc 2.3 Kiểm tra 2.4 Tổ chức ngân hàng	8	6	2	
3. Quyết toán tài sản ngân hàng	3.1 Phân tích bảng quyết toán tài sản ngân hàng 3.2 Khả năng thanh khoản 3.3 Khả năng thanh khoản và qui mô của ngân hàng 3.4 Quản trị tài sản nợ 3.5 Dự trữ sơ cấp 3.6 Dự trữ thứ cấp 3.7 Các chính sách quản trị thanh khoản	4	3	1	
4. Quản trị tích sản của ngân hàng	4.1 Tài sản có của ngân hàng thương mại 4.2 Phân loại thứ tự ưu tiên của tích sản 4.3 Thanh khoản của tài sản có	4	3	1	

5. Quản trị tiêu sản	5.1 Phân loại tiền gửi 5.2 Qui mô của tiền gửi trong hệ thống ngân hàng 5.3 Quản trị tiêu sản về thanh khoản	8	5	3	
6. Quản trị vốn ngân hàng	6.1 Mục đích của vốn 6.2 Biến động vốn 6.3 Xác định nhu cầu về vốn 6.4 Đánh giá các giải pháp lựa chọn tăng vốn	5	3	2	
7. Bảo hiểm rủi ro trong hệ thống ngân hàng	7.1 Các phương pháp điều hành tài sản và nghĩa vụ ngân hàng để bảo hiểm rủi ro thay đổi lãi suất 7.2 Chiến lược điều hành tài sản và nghĩa vụ 7.3 Phân bổ cấu trúc các nguồn vốn trong ngân hàng 7.4 Phòng chống rủi ro thay đổi lãi suất	8	5	3	
8. Các vấn đề cơ bản của hệ thống ngân hàng hiện đại	8.1 Quản trị các hoạt động ngoài bảng quyết toán ngân hàng 8.2 Vấn đề người chủ-người quản lý 8.3 Các phát kiến tài chính 8.4 Cạnh tranh với các định chế tài chính phi ngân hàng	3	2	1	
9	Phần hướng dẫn ôn tập và viết tiểu luận môn học	3	2	1	
		45	30	15	

Tài liệu tham khảo

- Lê Văn Tề. Quản trị ngân hàng thương mại. Nhà Xuất bản Thống kê, 2003.
- Nguyễn Văn Ngôn, Tiền Tệ và Ngân hàng, Đại học Mở và Bán Công TP-HCM, 1992.
- Lê Văn Tư, Các Nghiệp Vụ Ngân hàng Thương mại, Nhà Xuất Bản Thống Kê, 1997.

Phương pháp đánh giá môn học:

- Điểm Kiểm tra hoặc tiểu luận hoặc thuyết trình, trọng số: 25%.
- Điểm thi hết môn trọng số: 75%.

6.5. ĐỀ CƯƠNG MÔN HỌC CHUYÊN ĐỒ THI NCS

- Tên môn học : **TÀI CHÍNH QUỐC TẾ**
- Mã số môn học: TCQT 610
 - Số đơn vị học trình: 3 (1t2 ;1tl)
 - Giảng viên môn học: TS Trương Quang Thông
PGS. TS. Trần Ngọc Thơ
- **Mô tả môn học:** cung cấp cho các học viên các nguyên lý tổng quát về chu chuyển vốn quốc tế mà hạt nhân chính là các công ty đa quốc gia. Các vấn đề về cán cân thanh toán cũng như các nhân tố tác động đến chúng, các vấn đề liên quan đến các đại lượng lạm phát, lãi suất và tỷ giá hối đoái cũng như tác động của chính phủ đối với các đại lượng này cũng sẽ được nghiên cứu. Cuối cùng, vấn đề huy động vốn trên thế giới và vấn đề khủng hoảng nợ trên thế giới cũng sẽ được lần lượt giới thiệu cho các học viên.

Nội dung môn học

Chương	Nội dung	Số tiết			Tài liệu tham khảo
		TS	LT	TH	
1 Cán cân thanh toán	1.1 Cán cân thanh toán 1.2 Giải thích cán cân thanh toán: tài khoản vãng lai và tài khoản vốn 1.3 Các yếu tố ảnh hưởng đến cán cân tài khoản vãng lai. Các biện pháp chấn chỉnh 1.4 Các yếu tố ảnh hưởng đến cán cân tài khoản vốn. 1.5 Các biện pháp điều chỉnh	4	3	1	
2. Đánh giá và quản trị rủi ro quốc tế	2.1 Rủi ro quốc tế 2.2 Lợi ích và rủi ro của danh mục đầu tư quốc tế 2.3 Quản trị rủi ro các nghiệp vụ vãng lai 2.4 Quản trị rủi ro hối đoái 2.5 Quản trị rủi ro tỷ giá	6	4	2	
3. Huy động vốn và đầu tư quốc tế	3.1 Tài trợ và đầu tư trên thị trường trái phiếu quốc tế 3.2 Các thị trường trái phiếu địa phương chủ yếu 3.3 Thị trường Swap	4	3	1	

4. Hoạch định ngân sách vốn và đầu tư trực tiếp nước ngoài (FDI)	1.1. Lợi nhuận và các tiêu chuẩn chấp nhận cho FDI 1.2. Đánh giá rủi ro cho các dự án đầu tư xuyên biên giới 4.3. Lập ngân sách vốn cho các doanh nghiệp FDI	4	3	1	
5. Cấu trúc vốn quốc tế và chi phí sử dụng vốn	1.1. Cấu trúc vốn 1.2. Các đặc điểm của công ty đa quốc gia ảnh hưởng đến chi phí sử dụng vốn 1.3. Các đặc điểm của quốc gia ảnh hưởng đến chi phí sử dụng vốn 5.4. So sánh chi phí sử dụng vốn và mô hình định giá tài sản vốn	8	5	3	
6. Khủng hoảng nợ quốc tế và đánh giá rủi ro quốc gia	6.1. Khủng hoảng nợ quốc tế và quan điểm của những người trong cuộc 6.2. Các tác động của khủng hoảng nợ 6.3. Tác động của tỷ giá thả nổi và lãi suất cho vay đối với cuộc khủng hoảng nợ 6.4. Các giải pháp cho cuộc khủng hoảng nợ 6.5 Đánh giá rủi ro quốc gia	5	3	2	
7	Cấu trúc vốn quốc tế và chi phí sử dụng vốn	8	5	3	
8	Thị trường eurocurrency và eurobonds	3	2	1	
9	Phần hướng dẫn ôn tập và viết tiểu luận môn học	3	2	1	
		45	30	15	

Tài liệu tham khảo

1. Nguyễn Văn Tiến. Tài chính quốc tế hiện đại. Tái bản lần thứ nhất. Nhà xuất bản Thống kê, 2001.
2. Trần Ngọc Thơ và Nguyễn Ngọc Định (đồng chủ biên). Tài chính Quốc tế. Nhà Xuất bản Thống kê, 2000.
3. Ephraim Clark, Michel Levasseur and Patrick Rousseau. International Finance. International Thomson Business Press, 1998.
4. Brealey and Myers. Principles of Corporate Finance. Sixth edition. Mc Graw Hill. 2000.

Phương pháp đánh giá môn học:

- Điểm Kiểm tra hoặc tiểu luận hoặc thuyết trình, trọng số: 25%.
- Điểm thi hết môn trọng số: 75%.

6.6. ĐỀ CƯƠNG MÔN HỌC CHUYÊN ĐỔI THI NCS

Tên môn học : **NGÂN HÀNG TRUNG ƯƠNG VÀ CHÍNH SÁCH TIỀN TỆ**

- Mã số môn học: NHTW 605
- Số đơn vị học trình: 3 (2lt, 1tl)
- Giảng viên môn học: PGS.TS. Ngô Hưởng
PGS.TS. Nguyễn Thị Nhung

- **Mục tiêu môn học:** Môn học này trang bị cho học viên những kiến thức chuyên sâu về cơ chế hoạt động của Ngân hàng Trung ương và chính sách tiền tệ cùng với các công cụ mà Ngân hàng Trung ương sử dụng để thực hiện Chính sách tiền tệ quốc gia.

- **Nội dung môn học:**

Chương	Nội dung	Số tiết			Tài liệu tham khảo
		Tổng số	Lý thuyết	Thực hành, thí nghiệm, thảo luận	
1. Tổng quan về ngân hàng trung ương và chính sách tiền tệ	1.1. Phân tích các chức năng của ngân hàng trung ương 1.2. Vị trí pháp lý của ngân hàng trung ương 1.3. Cơ chế tài chính của ngân hàng trung ương 1.4. Tổ chức, hoạt động của ngân hàng nhà nước Việt Nam 1.5. Chính sách tiền tệ và cơ chế hoạt động của chính sách tiền tệ 1.6. Hệ thống các công cụ của chính sách tiền tệ	6	6	0	
2. Nghiệp vụ phát hành tiền	2.1. Nguyên tắc phát hành tiền 2.2. Các kênh phát hành tiền 2.3. Nghiệp vụ phát hành tiền 2.4. Phát hành tiền của ngân hàng nhà nước Việt nam	4	3	1	

3. Dự trữ bắt buộc	3.1. Cơ chế tác động và ưu nhược điểm của dự trữ bắt buộc 3.2. Quản lý dự trữ bắt buộc 3.3. Dự trữ bắt buộc ở Việt Nam	4	3	1	
4 Hoạt động tín dụng	4.1. Tổng quan về hoạt động tín dụng của ngân hàng trung ương 4.2. Chính sách lãi suất của ngân hàng trung ương 4.3. Nghiệp vụ tín dụng của ngân hàng trung ương 4.4. Kinh nghiệm hoạt động tín dụng của ngân hàng trung ương một số nước 4.5. Hoạt động tín dụng của ngân hàng nhà nước Việt nam	6	5	1	
5. Nghiệp vụ thị trường mở	5.1. Tổng quan về nghiệp vụ thị trường mở 5.2. Cơ chế tác động và ưu nhược điểm của nghiệp vụ thị trường mở 5.3. Kinh nghiệm ở một số nước 5.4. Nghiệp vụ thị trường mở ở Việt Nam	7	5	2	
6. Quản lý ngoại hối	6.1. Tổng quan về quản lý ngoại hối 6.2. Cơ chế quản lý ngoại hối của ngân hàng trung ương 6.3. Quản lý ngoại hối của ngân hàng nhà nước Việt Nam	5	3	2	

7. Các hoạt động khác của ngân hàng trung ương	7.1. Hoạt động thanh toán và vai trò của ngân hàng trung ương trong hoạt động thanh toán 7.2. Thanh tra, giám sát ngân hàng trung ương 7.3. Kiểm soát nội bộ ngân hàng trung ương 7.4. Quan hệ giữa ngân hàng nhà nước Việt nam và các tổ chức tài chính quốc tế	8	5	3	
Ôn tập		5	4	1	
		45	34	11	

Tài liệu tham khảo:

1. Alan S. Blinder, *Central Banking in Theory and Practice*, MIT Press, 1999.
2. [David E. Altig](#), [Bruce D. Smith](#), *Evolution and Procedures in Central Banking*, Cambridge University Press, 2003.
3. [Alex Cukierman](#), *Central Bank Strategy, Credibility, and Independence: Theory and Evidence*, MIT Press, 1992.
4. Hoàng Xuân Quế, *Nghiệp vụ ngân hàng trung ương*, Nhà xuất bản Thống kê, Hà nội 2003.

Phương pháp đánh giá môn học:

Điểm Kiểm tra hoặc tiểu luận hoặc thuyết trình, trọng số: 25%.

Điểm thi hết môn trọng số: 75%.

6.7. ĐỀ CƯƠNG MÔN HỌC CHUYÊN ĐỔI THI NCS

Tên môn học : **PHÂN TÍCH THỊ TRƯỜNG TÀI CHÍNH**

- Mã số môn học: TTTC 611
- Số đơn vị học trình: 2(1lt, 1tl)
- Giảng viên môn học: TS Trần Việt Hoàng
TS Nguyễn Hồng Thắng

- **Mục tiêu môn học:** cung cấp khung phân tích các yếu tố tác động lên các thị trường, cập nhật các vấn đề thực tiễn trong quá trình hoạt động của thị trường Ngoài ra môn học còn cung cấp kiến thức về phương thức hoạt động giao dịch kinh doanh trên các thị trường tài chính, những nguyên nhân của rủi ro, sụp đổ của thị trường tài chính và bài học kinh nghiệm. Môn học cung cấp cơ sở để thực hiện xây dựng và quản lý danh mục đầu tư tài chính

- Nội dung môn học

Chương	Nội dung	Số tiết			Tài liệu tham khảo
		TS	LT	TH	
CHƯƠNG 1: PHÂN TÍCH THỊ TRƯỜNG TIỀN	<ol style="list-style-type: none"> 1. Phân tích các chứng khoán định giá trên lãi suất 2. Phân tích các chứng khoán định giá trên nguyên tắc chiết khấu 3. Những thay đổi gần đây của Thị trường tiền tệ hiện nay 	3	2	1	
CHƯƠNG 2: PHÂN TÍCH THỊ TRƯỜNG VỐN - TRÁI PHIẾU	<ol style="list-style-type: none"> 1. Định giá hợp lý các loại trái phiếu 2. Giá trị thuần túy và giá pha tạp 3. Các đại lượng đo hiệu suất lợi nhuận của trái phiếu ví dụ về lợi suất đáo hạn ví dụ về thời gian đáo hạn bình quân ví dụ về trả lãi và vốn 4. Các đường lãi suất 5. Các lý thuyết về đường lãi suất 6. Rủi ro lãi suất 7. Các trái phiếu có lãi suất thả nổi 8. Rủi ro và các phát kiến cải tiến hiện nay trên thị trường trái phiếu 	3	2	1	

CHƯƠNG 3: PHÂN TÍCH THỊ TRƯỜNG VỐN : CỔ PHIẾU	<ol style="list-style-type: none"> 1. Các dạng cổ phiếu công ty 2. Cấu trúc tài chính của công ty 3. Định giá hợp lý cổ phiếu 4. Chính sách cổ tức 5. Phân tích thu nhập 6. Giá trị công ty - ảnh hưởng của các đòn bẩy tài chính 	3	2	1	
CHƯƠNG 4: PHÂN TÍCH THỊ TRƯỜNG NGOẠI TỆ	<ol style="list-style-type: none"> 1. Ngoại tệ 2. Rủi ro tỷ giá hối đoái 3. Định giá hợp lý ngoại tệ 4. Tỷ giá và phân tích biến động tỷ giá 	3	2	1	
CHƯƠNG 5: HỢP ĐỒNG KỶ HẠN VÀ GIAO SAU	<ol style="list-style-type: none"> 1. Các hợp đồng kỳ hạn và giao sau 2. Các hợp đồng tài chính giao sau 3. Định giá hợp lý các hợp đồng kỳ hạn và hợp đồng tài chính giao sau 4. Phân tích các yếu tố tác động 5. Các chiến lược đầu tư và chống đỡ rủi ro với hợp đồng kỳ hạn và giao sau 	3	2	1	
CHƯƠNG 6: PHÂN TÍCH THỊ TRƯỜNG QUYỀN CHỌN	<ol style="list-style-type: none"> 1. Quyền chọn mua 2. Quyền chọn bán 3. Hàng hóa cơ sở 4. Định giá hợp lý các hợp đồng quyền chọn 5. Phân tích các yếu tố tác động lên thị trường quyền chọn 6. Các chiến lược đầu tư và chống đỡ rủi ro với quyền chọn 	3	2	1	
CHƯƠNG 7: ỨNG DỤNG LÝ THUYẾT THỊ TRƯỜNG HIỆU QUẢ VÀ PHÂN TÍCH THỊ TRƯỜNG	<ol style="list-style-type: none"> 1. Phân phối, hoạt động và thông tin hiệu quả 2. Giả thiết thị trường hiệu quả, mô hình trò chơi trung thực và bước đi ngẫu nhiên 3. Giả thiết thị trường thông tin không hoàn hảo 4. Phân tích biến động thị trường ứng dụng các giả thiết 5. Áp dụng thực tế: phân tích biến động thị trường theo tác động của thông tin 	3	2	1	
		30	20	10	

Tài liệu tham khảo:

1. David Blake . Phân tích thị trường tài chính tái bản lần 2 NXB Thống kê 2000.
2. Kolb W. Robert, Futures, Options and Swaps, 3rd edition, 1999 Blackwell Publisher
3. Hull C.John, Options, Futures, and Other Derivatives, 4th edition, 2000 Prentice Hall

Phương pháp đánh giá môn học:

Điểm Kiểm tra hoặc tiểu luận hoặc thuyết trình, trọng số: 25%.

Điểm thi hết môn trọng số: 75%.

6.8. ĐỀ CƯƠNG MÔN HỌC CHUYÊN ĐỒ THI NCS

Tên môn học :	ĐẦU TƯ TÀI CHÍNH
- Mã số môn học:	ĐTTC 608
- Số đơn vị học trình:	2 (1lt, 1 tl)
- Giảng viên môn học:	TS Nguyễn Văn Thuận TS. Peter Pham Kien

- **Mô tả môn học:** kiến thức chuyên sâu về quản trị đầu tư các công cụ tài chính, quản trị danh mục và quản trị rủi ro đầu tư

- **Mục tiêu môn học:** trang bị cho học viên các kiến thức chuyên sâu và cơ chế của hoạt động đầu tư các công cụ tài chính, quản trị và giảm thiểu rủi ro, tạo lợi nhuận tối đa từ hoạt động đầu tư trên các thị trường tài chính

- **Nội dung môn học**

Chương	Nội dung	Số tiết			Tài liệu tham khảo
		TS	LT	TH	
1. Cơ Bản Về Đầu Tư Và Quá Trình Đầu Tư	1.1 Tài sản và tài sản tài chính 1.2 Quá trình đầu tư 1.3 Thị trường tài chính và cấu trúc thị trường tài chính 1.4 Công cụ tài chính 1.5 Cơ chế kinh doanh trao đổi chứng khoán phát hành chứng khoán các thị trường chứng khoán 1.6 Các nhà đầu tư và quá trình đầu tư	3	2	1	
2. Rủi ro và suất sinh lời	2.1 Rủi ro và phí rủi ro 2.2 Phân bổ tài sản giữa các danh mục rủi ro và không rủi ro 2.3 Chiến lược đầu tư thụ động và đường thị trường vốn	3	2	1	
3. Đa dạng hoá hiệu quả	3.1 Đa dạng hoá và rủi ro danh mục 3.2 Phân bổ tài sản với hai tài sản rủi ro 3.3 Danh mục rủi ro tối ưu với một tài sản phi rủi ro 3.4 Đa dạng hóa hiệu quả với nhiều tài sản rủi ro	3	2	1	

4 Thị trường vốn hiệu quả	4.1 Các yếu tố cơ bản của thuyết thị trường vốn hiệu quả 4.2 Áp dụng của các thị trường vốn hiệu quả	3	2	1	
5. Lý thuyết thị trường vốn và định giá thị trường vốn CAPM, APT	5.1 Lượng cầu chứng khoán và giá cân bằng 5.2 Mô hình định giá tài sản vốn CAPM 5.3 CAPM và các áp dụng thực tế 5.4 Thuyết APT	3	2	1	
6. Phân tích và đánh giá đầu tư cổ phiếu	6.1 Khái Quát Về Quá Trình Đánh Giá cổ phiếu 6.2 Các Ảnh Hưởng Kinh Tế Tổng Thể 6.3 Các Yếu Tố Quyết Định Giá Trị 6.4 Đánh giá rủi ro theo thị trường. 6.5 Tỷ lệ tăng trưởng dự tính của cổ tức 6.6 Các phương pháp định giá cổ phiếu	3	2	1	
7. Các phương pháp phân tích đầu tư tài chính	7.1 Phân tích ngành Vai trò của phân tích ngành Ước Lượng Tỷ Lệ Lãi Suất Ngành Ước lượng thu nhập trên cổ phiếu Dự đoán doanh thu ngành Dự đoán tỷ lệ lợi nhuận ngành 7.2 Phân tích báo cáo tài chính 7.3 Phân tích kỹ thuật	3	2	1	
8. Quản trị danh mục đầu tư trái phiếu	8.1 Rủi ro lãi suất 8.2 Quản trị trái phiếu thụ động 8.3 quản trị trái phiếu chủ động 8.4 Hoán đổi lãi suất	3	2	1	
9. Phân tích các phương án đầu tư thay thế	9.1 Hợp đồng quyền lựa chọn 9.2 Giá trị của các quyền lựa chọn 9.3 Chứng khoán tương tự quyền lựa chọn	3	2	1	
10	Quản trị rủi ro: quyết định hedging, VAR (value-at-risk)	3	2	1	
	Tổng cộng	30	20	10	

Tài liệu tham khảo:

1. Bodie Kane Marcus – Essentials of Investment – 2002
2. Richard Pike & Bill Neale - Corporate Finance and Investment –2001
3. Anthony Saunders -Financial Institutions Management – 1997
4. James L - Porfolio management, theory and application –2000
5. Frank J. Fabozzi – Investment Management – 2001

Phương pháp đánh giá môn học:

Điểm Kiểm tra hoặc tiểu luận hoặc thuyết trình, trọng số: 25%.

Điểm thi hết môn trọng số: 75%.

6.9. ĐỀ CƯƠNG MÔN HỌC CHUYÊN ĐỔI THI NCS

Tên môn học : **THUẾ**

- Mã số môn học: TAX 604

- Số đơn vị học trình: 2 (1lt, 1tl)

- Giảng viên môn học: PGS TS Nguyễn Ngọc Hùng
TS Trần Việt Hoàng

- **Mô tả môn học:** trang bị cho học viên kiến thức chuyên sâu về hệ thống thuế Việt nam và so sánh với các nước

- **Mục tiêu môn học:** nắm vững các kỹ năng phân tích đánh giá và áp dụng các sắc thuế trong các lĩnh vực hoạt động kinh tế

- **Nội dung môn học**

Chương	Nội dung	Số tiết			Tài liệu tham khảo
		TS	LT	TH	
1. Thuế- cơ sở kinh tế và công cụ chính sách tài chính của nhà nước	1.1 Thuế- bản chất, chức năng và vai trò trong nền kinh tế 1.1.1. Khái niệm 1.1.2 Chức năng 1.1.3 Vai trò của thuế : công cụ phân phối và ổn định nền kinh tế 1.2 Phân loại thuế 1.2.1 Phân loại theo tính chất kinh tế 1.2.2 Phân loại theo tính chất lũy tiến và lũy thoái 1.2.3 Phân loại theo phân cấp quản lý 1.2.4 Phân loại theo phương thức sử dụng	2	2		
2. Các nguyên tắc xây dựng và đánh giá hệ thống thuế	2.1 Nguyên tắc công bằng 2.2 Nguyên tắc trung lập 2.3 Nguyên tắc hiệu quả 2.4 Nguyên tắc đơn giản 2.5 Các nguyên tắc khác: 2.5.1 Tính đảm bảo 2.5.2 Chi phí thu thuế hợp lý 2.5.3 Linh hoạt và ổn định 2.6 Các tác động ngoại vi 2.7 Sự xung khắc giữa các nguyên tắc	4	3	1	

3. Tác động của thuế lên nền kinh tế.	3.1 Trường phái trọng cung 3.1.1 Mô hình kinh tế học cổ điển 3.1.2 Các chính sách trọng cung 3.1.3 Đường cong Laffer 3.2 Trường phái trọng cầu 3.2.1 Sự thiếu hụt cầu 3.2.2 Chính sách của trường phái kinh tế Keynes	4	3	1	
4. Quá trình phát triển hệ thống thuế Việt nam từ 1945 đến nay và phương hướng phát triển	4.1 Hệ thống thuế Việt nam từ 1945 đến nay 4.2 Định hướng cải cách thuế giai đoạn 2001 - 2010 tại Việt nam 4.2.1 Quan điểm và mục tiêu cơ bản của cải cách thuế 4.2.2 Nội dung chiến lược cải cách chính sách thuế	4	3	1	
5. Các sắc thuế hiện hành tại Việt nam	5.1. Thuế giá trị gia tăng 5.2. Thuế thu nhập doanh nghiệp 5.3. Thuế thu nhập cá nhân 5.4. Thuế xuất khẩu, thuế nhập khẩu 5.5. Thuế tiêu thụ đặc biệt 5.5. Thuế tài nguyên	4	3	1	
6. Cải cách thuế	6.1 Cơ sở lý thuyết của cải cách hệ thống thuế 6.2 Cải cách thuế – kinh nghiệm các nước trên thế giới	3	2	1	
7. Các vấn đề thuế trong quan hệ kinh tế quốc tế	7.1 Vấn đề đánh thuế trùng 7.2 Hiệp định tránh đánh thuế hai lần 7.3 Thuế và vấn đề chuyển giá ở các công ty đa quốc gia	3	2	1	
8. Tác động của chính sách thuế đối với phát triển kinh tế	8.1 Tỷ lệ thuế trong GDP 8.2 Các tác động dây chuyền của thuế	3	2	1	
9	Phần hướng dẫn ôn tập và viết tiểu luận môn học	3	2	1	
Tổng cộng		30	22	8	

Tài liệu tham khảo

- 1- GS.TS. Nguyễn Thanh Tuyền, TS. Nguyễn Ngọc Thanh-Giáo trình thuế, NXB tài chính 2001;
- 2- Bài giảng “Tài chính công”- Chương trình Fulbrigh 2000, 2001, 2002, 2003;
- 3- Sách: Tài chính công- của Khoa Kinh Tế-Đại Học Quốc Gia TP.HCM, 2006.
- 4- Các cam kết của Việt nam với WTO về các loại thuế quan, 2006

Phương pháp đánh giá môn học:

- Điểm Kiểm tra hoặc tiểu luận hoặc thuyết trình, trọng số: 25%.
- Điểm thi hết môn trọng số: 75%.

6.10. ĐỀ CƯƠNG MÔN HỌC CHUYÊN ĐỒ THI NCS

Tên môn học : **QUẢN LÝ NGÂN SÁCH NHÀ NƯỚC**

-Mã số môn học: NSNN 603

-Số đơn vị học trình: 2 (1 lt, 1tl)

-Giảng viên môn học: GS TS Nguyễn Thanh Tuyền
TS. Nguyễn Thanh Dương

- **Mô tả môn học:** Đi sâu nghiên cứu những nội dung cơ bản của tài chính công là ngân sách nhà nước và quản lý ngân sách nhà nước tại Việt nam

- **Mục tiêu môn học:** giới thiệu hệ thống NSNN và quản lý chu trình NSNN, chi đầu tư phát triển của NSNN, chi thường xuyên và các chi khác của NSNN, vấn đề thực hiện cân đối NSNN, hoạt động tín dụng nhà nước, các quỹ tài chính nhà nước và quản lý các quỹ TCNN tại kho bạc nhà nước.

- **Nội dung môn học:**

Chương	Nội dung	Số tiết			Tài liệu tham khảo
		TS	LT	T H	
1. Hệ thống NSNN và quản lý chu trình NSNN	1.1.1-Quan niệm NSNN trong nền kinh tế thị trường 1.1.2-Những nội dung thu, chi chủ yếu của NSNN 1.1.3-Những nguyên tắc cơ bản quản lý NSNN 1.2-Hệ thống NSNN và phân cấp quản lý NSNN 1.2.1-Hệ thống NSNN 1.2.2-Phân cấp quản lý NSNN 1.3-Chu trình NSNN và hệ thống mục lục NSNN 1.3.1-Chu trình NSNN 1.3.2-Mục lục NSNN 1.4-Quản lý chu trình NSNN 1.4.1-Lập NSNN 1.4.2-Chấp hành NSNN 1.4.3-Quyết toán NSNN	2	2		

2. Các nguồn thu của NSNN	2.1-Nguồn thu từ thuế 2.1.1-Các loại thuế và nguồn thu từ thuế 2.1.2- Tỷ lệ thuế trên GDP của các nước và Việt nam 2.2- Phí và lệ phí của NSNN 2.2.1-Bản chất, tác dụng của phí và lệ phí 2.2.2-Các loại phí và lệ phí 2.3-Quản lý thu và sử dụng các khoản phí và lệ phí của NSNN 2.3.1-Đối với các khoản thu phí 2.3.2-Đối với các khoản lệ phí	4	3	1	
3. Đầu tư phát triển của NSNN	3.1-Khái niệm, nội dung và đặc điểm chi đầu tư phát triển 3.1.1-Khái niệm 3.1.2-Đầu tư phát triển 3.1.3-Đặc điểm chi đầu tư phát triển 3.2-Quản lý chi đầu tư xây dựng cơ bản 3.2.1-Những nguyên tắc cấp phát vốn đầu tư XDCB thuộc vốn NSNN 3.2.2-Quản lý cấp phát vốn đầu tư XDCB đối với các dự án thuộc vốn NSNN 3.3- Quản lý vốn ngân sách tại các doanh nghiệp nhà nước 3.3.1-Các quy định về quản lý vốn đối với các DNNN 3.3.2-Các hướng hoàn thiện trong cơ chế giao vốn, chuyển dịch sở hữu vốn nhà nước 3.3.3-Chính sách cổ phần hoá và quản lý vốn nhà nước trong các công ty cổ phần 3.3.4-Quản lý vốn nhà nước trong các công ty liên doanh giữa vốn nhà nước và vốn nước ngoài	4	3	1	

4. Quản lý chi thường xuyên và chi khác của NSNN	4.1-Quản lý chi thường xuyên của NSNN 4.1.1-Nội dung, đặc điểm chi thường xuyên của NSNN 4.1.2-Các nguyên tắc quản lý chi thường xuyên của NSNN 4.1.3-Tổ chức quản lý chi thường xuyên của NSNN 4.2-Quản lý các khoản thu khác của NSNN 4.2.1-Nội dung, tác dụng của các khoản chi khác của NSNN 4.2.2-Tổ chức, quản lý các khoản thu khác của NSNN	3	3	0	
5. Tổ chức thực hiện cân đối NSNN	5.1-Khái niệm và các quan điểm về cân đối NSNN 5.1.1-Khái niệm về cân đối NSNN 5.1.2-Các quan điểm và lý thuyết về cân đối NSNN 5.2-Thâm hụt NSNN 5.2.1-Thực chất thâm hụt NSNN 5.2.2- Những nguyên nhân cơ bản dẫn đến thâm hụt NSNN 5.3-Tổ chức cân đối NSNN ở Việt nam 5.3.1-Nguyên tắc thực hiện cân đối NSNN 5.3.2-Tổ chức cân đối NSNN	3	2	1	
6. Quản lý các quỹ tài chính nhà nước khác	6.1-Các quỹ tài chính nhà nước khác và đặc điểm của chúng 6.1.1-Đặc điểm của các quỹ tài chính nhà nước khác 6.1.2-Các quỹ tài chính nhà nước khác 6.2-Quỹ dự trữ quốc gia 6.3-Quỹ bảo hiểm xã hội 6.4-Một số quỹ tài chính nhà nước khác 6.4.1-Quỹ hỗ trợ phát triển 6.4.2-Quỹ quốc gia giải quyết việc làm 6.4.3-Các quỹ khác	5	4	1	

7. Quản lý các quỹ tài chính tại kho bạc nhà nước	7.1- Quản lý quỹ NSNN tại kho bạc nhà nước 7.2-Quản lý các quỹ tài chính nhà nước khác tại kho bạc nhà nước 7.2.1-Quản lý quỹ dự trữ tài chính của nhà nước 7.2.2-Quản lý tiền, tài sản tạm thu, tạm giữ tại kho bạc nhà nước 7.4-Quản lý và điều hoà vốn trong hệ thống kho bạc nhà nước -Quản lý kho quỹ tại KBNN -Quản lý kho tiền của KBNN -Quản lý quỹ tiền mặt (kể cả ngân phiếu thanh toán)	5	4	1	
8	Phần hướng dẫn ôn tập và viết tiểu luận môn học	4	1	3	
	Tổng cộng	30	23	7	

Tài liệu Tham khảo:

1. “Quản lý tài chính Nhà nước”, NXB Tài chính 2000
2. “Tài chính công” Tài liệu biên dịch Khoa Kinh tế ĐHQG Tp.HCM, 2003
3. Giáo trình “Tài chính Công” chương trình Fulbright
4. Giáo trình Tài chính công-ĐH Kinh Tế TP.HCM

Phương pháp đánh giá môn học:

- Điểm Kiểm tra hoặc tiểu luận hoặc thuyết trình, trọng số: 25%.
- Điểm thi hết môn trọng số: 75%.

**VII. ĐỀ CƯƠNG CHƯƠNG TRÌNH KIẾN THỨC CƠ SỞ
CHUYÊN NGÀNH TÀI CHÍNH NGÂN HÀNG
(Thi đầu vào NCS chuyên ngành Kinh tế TC-NH)
MÔN HỌC
LÝ THUYẾT TÀI CHÍNH TIỀN TỆ**

NỘI DUNG VÀ MỤC TIÊU MÔN HỌC

Mục tiêu chính của môn học là cung cấp cho người học có được các kiến thức cơ bản về khoa học chuyên ngành Tài chính-Ngân hàng, tạo nền tảng tư duy và phát triển các kiến thức nâng cao theo các lĩnh vực chuyên sâu. Nội dung của môn học tập trung nghiên cứu bao trùm toàn bộ những vấn đề về nguyên lý kinh tế tài chính tiền tệ căn bản, giới thiệu các công cụ phân tích chính sách Tài chính-Ngân hàng bao gồm: hệ thống tài chính quốc gia-tài chính nhà nước, tài chính công, cấu trúc của thị trường và tổ chức tài chính, hoạt động của thị trường tài chính, đầu tư tài chính, hệ thống các định chế tài chính trung gian, vai trò của tiền tệ trong nền kinh tế, hoạt động ngân hàng và các chính sách điều hành hoạt động ngân hàng, ...

PHẦN 1 : HỆ THỐNG TÀI CHÍNH QUỐC GIA – TÀI CHÍNH NHÀ NƯỚC

**CHƯƠNG 1 : TIỀN TỆ VÀ TÀI CHÍNH QUỐC GIA – BẢN CHẤT VÀ VAI TRÒ
BẢO ĐẢM SỰ PHÁT TRIỂN CỦA NỀN KINH TẾ**

- 1.1 Tiền tệ. Hệ thống thanh toán
- 1.2 Khái niệm chức năng của hệ thống tiền tệ quốc tế
- 1.3 Tài chính, hệ thống tài chính , vai trò và chức năng của tài chính trong nền kinh tế

CHƯƠNG 2: TÀI CHÍNH CÔNG VÀ CÔNG CỤ PHÂN TÍCH TÀI CHÍNH CÔNG

- 2.1 Tài chính công – hoạt động của chính phủ qua thu chi ngân sách nhà nước
- 2.2 Các công cụ phân tích tài chính công – phân tích thực chứng và phân tích quy chuẩn
- 2.3 Phân tích chi phí lợi ích chi tiêu công

CHƯƠNG 3: CƠ SỞ LÝ LUẬN VÀ KHUNG PHÂN TÍCH THUẾ

- 3.1 Thuế và phân phối thu nhập
- 3.2 Thuế và hiệu quả
- 3.3 Đánh thuế hiệu quả và công bằng
- 3.4 Đánh giá chính sách thuế tại Việt nam
- 3.5 Hệ thống thuế Việt nam

CHƯƠNG 4: NGÂN SÁCH NHÀ NƯỚC VÀ NỢ CHÍNH PHỦ

- 4.1 Hệ thống ngân sách
- 4.2 Cấu trúc ngân sách
- 4.3 Cân đối ngân sách
- 4.4 Nợ chính phủ
- 4.5 Quản lý nợ chính phủ

PHẦN 2 : THỊ TRƯỜNG TÀI CHÍNH

CHƯƠNG 5 : HỆ THỐNG TÀI CHÍNH

- 5.1 Hệ thống tài chính
- 5.2 Thị trường tài chính
- 5.3 Trung Gian Tài Chính
- 5.4 Điều Hành Hệ Thống Tài Chính

CHƯƠNG 6 LÃI SUẤT - PHÂN TÍCH BIẾN ĐỘNG LÃI SUẤT

- 6.1 Lý thuyết lượng cầu tài sản (lý thuyết lựa chọn danh mục)
- 6.2 Khuôn mẫu tiền vay: cung cầu trên thị trường trái phiếu
- 6.3 Sự thay đổi của lãi suất cân bằng
- 6.4 Cấu trúc rủi ro của lãi suất
- 6.5 Cấu trúc kỳ hạn của lãi suất
- 6.6 Chính sách lãi suất và tự do hóa lãi suất tại Việt Nam

CHƯƠNG 7 TỶ GIÁ VÀ THỊ TRƯỜNG NGOẠI HỐI

- 7.1 Thị Trường Ngoại Hối
- 7.2 Phân tích biến động Tỷ Giá Ngoại Hối Trong Xu Hướng Dài Hạn
- 7.3 phân tích biến động Tỷ Giá Ngoại Hối Trong Xu Hướng Ngắn Hạn
- 7.4 Hệ thống tỷ giá các quốc gia
- 7.5 Tự do hóa tài chính và lưu chuyển tiền tệ

PHẦN III: TRUNG GIAN TÀI CHÍNH

CHƯƠNG 8 NGÂN HÀNG

- 8.1 Tổng hợp các chức năng và dịch vụ của ngân hàng hiện đại
- 8.2 Bảng quyết toán tài sản ngân hàng
- 8.3 Hoạt động cơ bản của ngân hàng
- 8.4 Các nguyên lý chung quản trị ngân hàng
- 8.5 Quản trị rủi ro tín dụng
- 8.6 Quản trị rủi ro lãi suất
- 8.7 Các hoạt động ngoài bảng quyết toán tài sản

8.8 Hệ thống Ngân hàng Việt nam

CHƯƠNG 9 CÁC TỔ CHỨC TÀI CHÍNH PHI NGÂN HÀNG

9.1 Các Công Ty Bảo Hiểm

9.2 Các Quỹ Hưu Trí

9.3 Công ty tài chính

9.4 Các Quỹ Hỗ Trợ

9.5 Trung Gian Tài Chính Của Chính Phủ

9.6 Các tổ chức thị trường chứng khoán

9.7 Các ngân hàng đầu tư

9.8 Các công ty môi giới và giao dịch

9.9 Thị trường giao dịch chứng khoán

9.10 Hệ thống định chế tài chính phi ngân hàng tại Việt nam

CHƯƠNG 10 PHÂN TÍCH KINH TẾ CẤU TRÚC TÀI CHÍNH

10.1 Các vấn đề cơ bản của hệ thống tài chính hiện đại

10.2 Chi phí giao dịch

10.3 Chênh lệch thông tin: lựa chọn nghịch và rủi ro đạo đức

10.4 “Vấn đề quả chanh” và lựa chọn nghịch tác động lên cấu trúc tài chính

10.5 Các công cụ giải quyết vấn đề lựa chọn nghịch

10.6 Rủi ro đạo đức và lựa chọn giữa hợp đồng nợ và hợp đồng chủ sở hữu.

10.7 Rủi ro đạo đức và cấu trúc tài chính trong thị trường nợ

PHẦN 4: LÝ THUYẾT TIỀN TỆ VÀ CHÍNH SÁCH NGÂN HÀNG TRUNG ƯƠNG

CHƯƠNG 11 LÝ THUYẾT LƯỢNG CẦU TIỀN TỆ

11.1 Lý Thuyết Định Lượng Tiền Tệ

11.2 Lý Thuyết Ưu Thích Thanh Khoản Của Keynes

11.3 Lý Thuyết Định Lượng Tiền Tệ Hiện Đại Của Friedman

CHƯƠNG 12 TIỀN TỆ VÀ HỆ THỐNG THANH TOÁN QUÁ TRÌNH CUNG TIỀN

12.1 Sự Phát Triển Của Hệ Thống Thanh Toán

12.2 Đo Lường Đánh Giá Tiền Tệ

12.3 Các thành phần tham gia vào quá trình cung tiền

12.4 Ngân hàng trung ương

CHƯƠNG 13 : ĐIỀU HÀNH CHÍNH SÁCH TIỀN TỆ: MỤC TIÊU VÀ ĐỐI TƯỢNG

13.1 Các Mục tiêu của chính sách tiền tệ

13.2 Chiến Lược Của Ngân Hàng Trung Ương: Sử Dụng Chỉ Tiêu Tiền Tệ

13.3 Lựa chọn chỉ tiêu

13.4 Chiến lược của ngân hàng trung ương: người cho vay cuối cùng

TÀI LIỆU THAM KHẢO:

- 9) Frederic S. Mishkin - Economics of Money, Banking, Financial Markets – Fifth edition – 1998
- 10) Peter S. Rose - Commercial Bank Management – Second Edition – 1997
- 11) Frank J. Fabozzi – Investment Management - Second Edition – 2000
- 12) David Blake – Phân Tích Thị Trường Tài Chính (bản dịch) – 2000.
- 13) Cheol S. Sun & Bruce G. Resnick – International Financial Management – 2000.
- 14) Martin Neil Baily & Philip Friedman - Macroeconomics, Financial Markets And The International Sector - 1993
- 15) David N. Hyman- Public Finance- A Contemporary Application of Theory to Policy. The Dryden Press-The US, 2000

VIII. Phụ lục : Tham khảo Mô tả môn học đào tạo bậc Thạc sĩ và Tiến sĩ , chuyên ngành Ngành Tài chính-Ngân hàng (tham khảo từ các trường Đại học Mỹ, Anh, Singapore)

Courses Description in Finance

230. Theory of Finance

Prerequisite: course 408. The primary focus of this course is the valuation of corporate liabilities and other securities under uncertainty. The Capital Asset Pricing Model is presented rigorously and compared with more recent theories of asset pricing such as the Arbitrage Pricing Theory and the Option Pricing Model. Empirical evidence is brought to bear on these theories. A secondary focus is the analysis of problems in corporate finance such as the optimal financing of the corporation and the market for corporate control.

231A. Profit-Sector Financial Policy

Prerequisite: course 230. Identifying and solving financial problems through the use of cases. Stresses the application of financial theory and financial techniques to business problems, using written reports and classroom discussion.

231D. Takeovers, Restructuring and Corporate Governance

Prerequisites: courses 405, 408, and 230. Study of the advantages and disadvantages of corporate mergers, acquisitions, and other forms of restructuring. Both theory and empirical studies are reviewed. Considerable use of case studies and tests of merger performance.

231E. Managing Finance and Financing the Emerging Enterprise

Prerequisites: second-year standing and satisfactory completion of courses 403, 408, and 230. This course emphasizes the financial, control, and investment issues confronting rapidly growing companies in entrepreneurial settings. The main objective of the course is to consider and select financing vehicles which may be appropriate to securing the organization's money requirements.

232A. Security Analysis and Investment Management

Prerequisite: course 230. Topics covered include security valuation, application of portfolio theory to investment decisions and performance evaluation. Basics of fixed income portfolio management strategies are also covered.

232D. Option Markets

Prerequisite: course 230. The course deals with the organization and role of

organized derivative markets, including listed and OTC options and futures:arbitrage and hedging relationships, valuation of derivative trading strategies, and innovations in derivative markets. Students learn fundamentals of hedging and spreading by playing an option trading game and writing a term paper analyzing their trading strategies.

233A. Money and Capital Markets

Prerequisite: course 230. Application of interest theory and flow funds analysis to the price determination process in the markets for bonds, mortgages, stocks, and other financial instruments. Study of funds flow from credit markets. Analysis of costs of capital in individual industries.

233B. Financial Institutions

Prerequisite: course 230. This course will introduce the theory and practice of financial institutions and stock exchanges. Main topics covered are deposit insurance and regulation, international banking, market microstructure, and investment banking.

234A. International Financial Markets

Prerequisites: courses 408, 205A, and 230. Conceptual understanding of the foreign exchange market, the Euro-currency market, the international bond market, and equity markets in various countries. Emphasis is on underlying economic principles, although where relevant, institutional features helpful in understanding the structure and operations of the markets will also be dealt with in detail.

234B. Financial Management of Multinational Corporations

Prerequisite: course 230. The financial management of multinational firms from the perspective of a financial vice president or a financial officer within the company. Topics include measuring foreign exchange risk, managing the risk with both contractual and operating strategies, foreign investment decisions, capital budgeting and cost of capital in an international perspective, political risk, working capital management, and performance evaluation and control.

238. Special Topics in Finance

Prerequisites: course 230, consent of instructor. Intended for master's students. Selected topics in finance theory, empirical studies, and financial policy. May be repeated for credit with instructor change.

239A. Theory of Exchange under Uncertainty

Prerequisites: course 230 and consent of instructor. Foundations of the theory

of exchanges are developed as an introduction to theoretical literature on the pricing of capital assets. Primarily intended for Ph.D. students, but well-prepared master's students may find the course useful in their career preparation.

239B. Theory of Investment under Uncertainty

Prerequisites: courses 230 and 239A, or consent of instructor. Foundations of theory of firm capitalization and investment decisions are developed, with special attention to questions of exchange and allocative efficiency. Primarily intended for Ph.D. students, but well-prepared master's students may find the course useful in their career preparation.*

239C. Empirical Research in Finance

Prerequisites: course 230, training in econometrics, and consent of instructor. In-depth study empirical research in the field of finance, statistical methodologies applied to test market efficiency, and asset pricing theory. Primarily intended for Ph.D. students, but well-prepared master's students may find the course useful in their career preparation.*

239D. Ph.D. Seminar in Corporate Finance

Prerequisites: course 230, courses in the 239 series. Intended for Ph.D. students. Advanced topics in corporate finance theory and empirical research. May be repeated for credit with instructor change.

Course catalog descriptions for courses offered in all currently published terms.

Finance

Department Chairperson: Narayanan, M.P.

Department Website:

<http://www.bus.umich.edu/Academics/Departments/Finance>

FIN 300 Financial Management

3 hours Core Terms Offered: F05, F06, W05, W06

Advisory Prerequisites: **P/A ACCT 272**

Financial Management --- Financial Management. An introduction to the issues, theory, and methodology that comprise a framework for rational decision-making by financial managers. The objective of this course is to use examples, problems, and cases to develop analytical ability and to illustrate the practical application of financial theory and analysis. Topics include present value analysis, capital budgeting, pricing financial assets, firm financial structure and the cost of capital, mergers and acquisitions, and security underwriting.

**FIN
310** **Capital Markets and Portfolio Analysis**

3 hours Elective Terms Offered: W05, W06
Advisory Prerequisites: **FIN 300**

Capital Markets and Portfolio Analysis

The course will focus on the application of financial theory to the issues and problems of stock markets, fixed-income markets, and portfolio management. Main topics, will include: stock market, duration and interest rate risk management, corporate debt market, credit risk management, portfolio optimization and asset allocation, asset pricing models and their implications for investment strategies, and mutual funds and performance evaluation. The course will build upon the analytical skills developed in Financial Management.

**FIN
314** **Corporate Investment Decisions**

3 hours Elective Terms Offered: F05, F06
Advisory Prerequisites: **FIN 300**

Corporate Investment Decisions --- This course focuses on analysis of corporate investment decisions. Since the emphasis is on application of the concepts learnt in the core courses, the course is case-oriented. The course begins with the valuation tools of financing statement analysis, financial forecasting, and cash flow estimation and then shows how to estimate of cost of capital. The major emphasis of the course is valuation in different

contexts such as resource allocation, mergers and acquisitions, and cross-border acquisitions. The course provides the student an opportunity to learn and practice spreadsheet skills. The course also provides an overview of working capital management.

**FIN
315** **Financial Institutions**

3 hours Elective Terms Offered: F05, F06
Advisory Prerequisites: **FIN 300**

Financial Institutions --- This course deals with the management of financial institutions such as commercial banks, savings and loan associations and insurance companies. We will start with some of the basic theories of financial intermediation, institutional features of these organizations and the regulatory framework under which they operate. We will then analyze the key risks faced by these institutions (such as interest rate, liquidity, and credit risk) and how they are managed using various risk-management tools. Students will be introduced to the concept of off-balance sheet banking. We will focus on some of the recent trends in securitizations and other related innovations in banking products. We will use several case studies to analyze the concepts learned in the classroom in an applied setting.

**FIN
316** **Derivative Securities**

3 hours Elective Terms Offered: W05, W06
Advisory Prerequisites: **FIN 300**

Derivative Securities --- This course introduces the student to various derivative securities. The basic derivative securities considered are options, futures, and interest rate swaps. The course covers the basic characteristics of these securities, institutional issues related to each security, pricing and valuation models, and hedging. The binomial and Black-Scholes models for options are discussed in some detail. Depending on time, the course may cover exotic options and other interest rate products such as caps and floors.

**FIN
317** **Corporate Financing Decisions**

3 hours Elective Terms Offered: F05, F06, W05, W06
Advisory Prerequisites: **F 300**

Corporate Financing Decisions --- This course develops the conceptual foundation for making corporate financing decisions. Capital structure theory is explained in detail with an in-depth analysis of market imperfections such as taxes, cost of financial distress, agency and informational issues. The next portion of the course covers different securities used to raise external capital with an emphasis on the institutional aspects of acquiring capital (Initial public offerings, seasoned equity offerings, public debt, convertible debt, private equity & venture capital). The causes and effects of financial distress and the bankruptcy process are explained. Payout policy and different payout strategies (dividends versus stock repurchase) are discussed. The course ends with a brief discussion of risk management. Throughout the course, financial theory will be integrated with the use of specific case studies.

**FIN
318** **Real Estate Fundamentals**

3 hours Elective Terms Offered: F05, F06, W05, W06
Advisory Prerequisites: **F 300**

Real Estate Fundamentals --- This survey of urban real estate theory and practice considers the nature of real estate investment and finance, and the real estate business. Lectures and discussions supplement text and outside reading and classroom work. A local property will be extensively analyzed utilizing discounted cash flow programs and project feasibility techniques. A professional quality analysis report will be prepared for the selected property. Outside experts will speak on key appraisal, finance, brokerage and investment issues.

**FIN
319** **International Finance**

3 hours Elective Terms Offered: W06

Course Prerequisites: **FIN 300**

Advisory Prerequisites: **STRAT 310**

International Finance --- This course is designed to familiarize students with the essential tools and concepts in International Finance. We will start by learning the major characteristics, institutions, and players of the international financial markets. We will then consider the interaction between cross-border trade, capital flows, interest rates, inflation, monetary and fiscal policies, and economic growth, and their impact on those markets. Finally, we will study how these issues affect the choices of investors and corporations. Topics will include the foreign exchange market, international equity and bond markets, hedging foreign exchange risk, currency and financial crises, the valuation of risk less and risky international assets, international capital budgeting and corporate governance, and raising capital in an international setting.

FIN 325 Entrepreneurial Finance

3 hours Elective Terms Offered: W05(A), W06

Entrepreneurial Finance --- This course is open to all BBA students and presents the fundamentals of venture capital and private equity finance. It is focused on financing startup and early stage, technology-based firms, later stage investment and buyouts. The course covers venture capital and private equity market structure and institutional arrangements and the application of financial theory and methods in a venture capital and private equity setting. Four main aspects of venture capital and private equity are covered: valuation, deal structuring, governance, and harvesting. "Live" case studies are used to demonstrate the practical, hands-on application of techniques following their development in class.

FIN 329 Financing Research Commercialization

3 hours Elective Terms Offered: F05, F06

Financing Research Commercialization --- This course is a practicum, offering an opportunity to apply collective team work of a student/mentor alliance to building a launch pad for a technology-based venture. This course is open to Ross School MBA and BBA students as well as all UM graduate students. Student teams will work with mentors and principal investigators (PI) from UM faculty in the Medical School, College of Engineering and other divisions to build a business and marketing plan for a new technology or invention. Projects are based upon disclosures made to UM Office of Technology Transfer, other universities and industrial companies.

([more](#))

FIN 335 Applied Financial Analysis and Portfolio Management

3 hours Elective Terms Offered: W05, W06

Advisory Prerequisites: **ACC 318**

Cross-listed with: **ACC 335**

Applied Financial Analysis and Portfolio Management --- This course takes place in the RSB Financial Research and Trading Room and requires students to manage a real investment fund. The emphasis is on combining the skills acquired in traditional courses with the latest financial technology to develop effective strategies for active portfolio management.

FIN 399 Research Project in Finance

3 hours Elective Terms Offered: F05, F06, M06, S06, W05, W06

Advisory Prerequisites: **JR.STD.**

Research Projects --- Individual and group research projects, supervised by professors, are available to juniors and senior in good academic standing. Information about these projects is available in the Office of Admissions and Student Services. To select a project,

students should consult the appropriate professor about the nature of the research and the number of the credit hours the work would earn. One to three credit hours may be earned. Juniors and Seniors may elect only one research project in a term, and no more than two in a program. No more than six credit hours from research projects may be counted toward a degree. For each project, the student must submit a paper to the faculty supervisor who will evaluate the character and quality of the research and issue a grade. The paper and the supervisor's evaluation will be catalogued and filed in the Business Administration Library.

**FIN
503** **Financial Management**

2.25 Core Terms Offered: F05(B), F06(B)
hours

Course Prerequisites: **No credit in FIN 513, 551, 552, 553**

Advisory Prerequisites: **No credit in FIN 513, 551, 552, 553**

Financial Management --- The course is primarily devoted to the principles of financial valuation. We will first discuss the concept of present value in extensive detail, and then apply the principles of valuation to value (a) real projects (or what is commonly referred to as capital budgeting) and (b) financial securities (stocks and bonds) under certainty. Since financial decision-making virtually always involves risk & uncertainty, we will then introduce the concept of risk, and the relation between risk & return. We will integrate our knowledge of cash flows with our understanding of risk to modify capital budgeting techniques in the presence of risk & uncertainty. The course concludes with an introductory treatment of the effects of financing on capital budgeting decisions. Although the concepts of competitive capital markets and market efficiency will not be covered in a separate session, they will be woven in the fabric of the course.

**FIN
513** **Financial Analysis**

2.25 Core Terms Offered: F05(A), F06(A)
hours

Course Prerequisites: **No credit in FIN 503, 551, 552, 553**

Advisory Prerequisites: **No credit in FIN 503, 551, 552, 553**

Financial Analysis --- This course is primarily devoted to fundamentals of financial analysis as applied to both corporate finance and financial markets. On the corporate side, the course deals with capital budgeting in great detail. Capital budgeting criteria (NPV, IRR) and cash flow estimation are discussed. The concept of risk is then introduced and the CAPM is used to derive cost of equity and then, the weighted average cost of capital. The course also provides an introductory treatment of the effects of financing on capital budgeting decisions. On the financial markets side, the course introduces the student to the concepts of competitive capital markets and market efficiency. The workings of the financial markets are explored using the trading room. The principles of equity valuation are also covered. Finally, term structure and bond valuation are discussed.

FIN 551 Financial Management

3 hours Core Terms Offered: F05, F06, W05, W06

Course Prerequisites: **ACC 501 and OMS 501; No credit in FIN 503, 513, 552, 553**

Financial Management and Policy --- This course is primarily devoted to the principles of financial valuation. We will first discuss the concept of present value in extensive detail, and then apply the principles of valuation to value (a) real projects (or what is commonly referred to as capital budgeting) and (b) financial securities (stocks and bonds) under certainty. Since financial decision-making virtually always involves risk & uncertainty, we will then introduce the concept of risk, and the relation between risk & return. We will integrate our knowledge of cash flows with our understanding of risk to modify capital budgeting techniques in the

presence of risk & uncertainty. The course concludes with an introductory treatment of the effects of financing on capital budgeting decisions.

FIN 565 Real Estate Development

3 hours Elective Terms Offered: W05, W06

Advisory Prerequisites: **BA/ UP 517/Permission of instructor**

Real Estate Development

This course covers project feasibility, location analysis, development decisions, supply and production, market performance, and case studies. Prerequisite: one prior Real Estate course or equivalent experience.

FIN 566 Real Estate Investment

1.5 hours Elective Terms Offered: F06(A)

Course Prerequisites: **No credit in FIN 568**

Advisory Prerequisites: **(enforced prerequisites) = No credit in FIN 568 (Non-enforced Prerequisites)=FIN Core**

Real Estate Finance and Investment I --- This course begins the development of concepts and techniques for structuring real estate financial deals. It introduces mortgage analysis and structuring, the user cost of capital, valuation of income property and taxation of real estate. The objectives of the course are to provide you with the basic skills for analyzing and structuring mortgages and real estate deals and to develop your intuition for indentifying opportunities and avoiding the pitfalls in real estate.

FIN 567 Advanced Topics in Real Estate Finance and Investment

1.5 hours Elective Terms Offered: F06(B)

Course Prerequisites: **No credit in FIN 568**

Advisory Prerequisites: **(enforced prerequisites) = No credit in FIN 568 (Non-enforced Prerequisite)=FIN 566**

Real Estate Finance and Investment II --- This course continues the development of concepts and techniques for structuring real estate financial deals begun in FIN 566. We focus on advanced valuation, risk management, debt structuring, REITs, construction financing and securitization of real estate assets and liabilities. The objectives of the course are to provide you with the more advanced skills for analyzing and structuring mortgages and real estate deals as well as to deepen your intuition for identifying opportunities and avoiding the pitfalls in real estate.

FIN 568 Real Estate Finance & Investment

3 hours Elective Terms Offered: F05, F06

Course Prerequisites: **No credit in FIN 566, 567, and UP 566**

Advisory Prerequisites: **(enforced prerequisites) = No credit in FIN 566, FIN 567, UP 566**

Real Estate Finance and Investment --- This course develops concepts and techniques for structuring real estate financial deals. We focus on valuing and financing residential and income-producing property and consider how the characteristics of the property, the local market, the participants, and the institutional environment influence real estate decisions. The objectives of the course are to provide you with the fundamental skills for analyzing and structuring mortgages and real estate deals and to develop your intuition for identifying opportunities and avoiding the pitfalls in real estate.

FIN 580 Options and Futures in Corporate Decision Making

2.25 hours Elective Terms Offered: F05(A), F05(B), F06(A), F06(B), S06, W05(A), W06(A)

Advisory Prerequisites: **FIN 503 or 513 or 551**

Options and Futures in Corporate Decision Making:

This course introduces students to one of the most important and most technically challenging areas in finance: derivative securities. Derivative securities include options, futures and forward contracts and swaps among other securities. This course examines corporate risk management techniques and how derivatives can be used to manage risk. The course will also cover institutional characteristics of derivatives exchanges, OTC markets and market clearing mechanisms. Finally, we will examine the pricing of derivatives. Particular emphasis will be given to Black-Scholes model and the binomial option-pricing model. Applications will cover real options.

FIN 591 Financial Management

2.25 Elective Terms Offered: W05, W06
hours

Advisory Prerequisites: **CX MBA students only**

Financial Management --- The course is primarily devoted to the principles of financial valuation. We will first discuss the concept of present value in extensive detail, and then apply the principles of valuation to value (a) real projects (or what is commonly referred to as capital budgeting) and (b) financial securities (stocks and bonds) under certainty. Since financial decision-making virtually always involves risk & uncertainty, we will then introduce the concept of risk, and the relation between risk & return. We will integrate our knowledge of cash flows with our understanding of risk to modify capital budgeting techniques in the presence of risk & uncertainty. The course will end with an introductory treatment of international issues in finance, specifically the role of international parity conditions in cross-border capital budgeting decisions. Although the concepts of competitive capital markets and market efficiency will not be covered in a separate session, they will be woven in the fabric of the course.

FIN 608 Capital Markets and Investment Strategy

2.25 Elective Terms Offered: F05(A), F06(A),
hours W05(A), W06(A)

Course Prerequisites: **(No credit in FIN 610) and (FIN 503 or 513 or 551 or 591)**

Advisory Prerequisites: **(ENFORCED)= FIN 503 or FIN 513 or FIN 551 or FIN 591; No credit in FIN 610**

Capital Markets and Investment Strategy --- This course covers portfolio analysis, asset pricing models, and investment strategies. It uses both the lecture and the case method of instruction to develop a practical understanding of some of the more important financial instruments and markets. Security valuation and management of investment strategies are major themes present throughout the course. A fundamental objective of the course is to enable students to gain a robust familiarity with approaches that can be adapted to analysis of broad classes of financial assets and markets. Such skills are indispensable to investment analysis in an economic environment characterized by an unprecedented amount of financial innovation, both in the creation of new securities and in the development and evolution of financial institutions.

FIN 609 Fixed-Income Securities and Markets

1.5 Elective Terms Offered: F05(B), F06(B),
hours W05(B), W06(B)

Course Prerequisites: **(No credit in FIN 610) and (FIN 503 or 513 or 551 or 591)**

Advisory Prerequisites: **(ENFORCED)= FIN 503 or FIN 513 or FIN 551 or FIN 591; No credit in FIN 610**

Fixed Income Securities and Markets --- This course uses both cases and lectures to develop a practical understanding of some of the more important fixed income securities and markets. Derivatives and the management of fixed income securities are major themes

present throughout the course. This course covers the term structure of interest rates, Treasury securities, strips, swaps, and other fixed income derivatives.

**FIN
610** **Investments**

3 hours Elective Terms Offered: M06, W05

Course Prerequisites: **(No credit in FIN 608 or 609)
and (FIN 503 or 513 or 551)**

Investments --- This course considers return and risk characteristics of various financial investment instruments, including common stocks, bonds, convertibles, and options, with emphasis on long-term results. Financial analysis and valuation of corporate securities are covered in some detail. Alternative portfolio management strategies in various security universes will also be covered. Concepts of modern portfolio theory are discussed and related to their implementation in the construction of portfolios for individual investors.

**FIN
612** **Principles of International Finance**

1.5 Elective Terms Offered: F05(A), F06(A)
hours

Advisory Prerequisites: **551/553**

Principles of International Finance

The purpose of this course is to provide the analytical framework required for understanding how changes in international financial conditions influence decisions faced by modern business leaders. The focus will be on interactions between cross board trade and capital flows, inflation, interest rates, exchange rates, monetary and fiscal policy, and economic growth. Exchange rate regimes, debt and currency crisis, and international financial institutions will also be explored. The course is tailored to students seeking careers in international banking and investment or with finance and strategy departments of corporations operating in world markets.

Derivative Instruments --- This is an advanced course in derivative securities, building on what students have learned in FIN 580. It provides an introduction to many of the advanced derivative products being used by firms. Many of these securities are created by dealers as "structured products" for specific clients. Although the variety of such products has increased substantially over the last few years, the basic principles of pricing and hedging tend to remain common across different derivative securities. In addition to introducing students to the features of different securities, the course deals with hedging using the 'Greeks', especially delta. Securities covered in the course include options on futures and on stock indices, exotic options, and interest rate swaps.

FIN 620 Financial Management in the International Corporation

3 hours Elective Terms Offered: W05, W06

Advisory Prerequisites: **FIN 503/513/551**

Financial Management in the International Corp --- Students taking this course should expect to learn the nature and purposes of corporate financial management in an international setting. The course will begin by developing a comprehensive framework within which the financial issues facing a multinational corporation (MNC) are easily positioned. Using this framework, students will then gain skills in the evaluation and financing of international investment projects, including some strategic aspects. Students will learn how to measure and manage in MNC's exposure to foreign exchange rate risks in great detail. Finally, they will also consider issues related to strategic risk management. Topics include consideration of real options and political risk. Students completing this course should expect to be able to confidently undertake decisions regarding capital budgeting, mergers and acquisitions, financing, corporate risk, hedging foreign exchange risks, operating strategy and political risk management in an international context.

FIN 621 Corporate Financial Policy

2.25 Elective Terms Offered: F05(A), F06(A),
hours W05(A), W06(A)

Advisory Prerequisites: **(non-enforced prerequisites)=
FIN 503/513/551 (enforced prerequisites)= no
credit in FIN 616**

Corporate Financial Policy --- This is an advanced corporate finance course with an emphasis on debt and equity management, security issuance, and distribution policy. Topics include descriptions of types of debt and equity, tradeoffs in the choice of an optimal capital structure; the role of capital structure in competitive strategy; the design of capital structure and securities to control information problems and limit conflicts of interest between different classes of security holders; procedures and costs of issuing securities including initial public offerings, and the determinants of optimal payout policy. The course is intended for those with career objectives in financial management, the corporate finance aspects of investment banking, or general management.

FIN 622 Corporate Financial Engineering

1.5 Elective Terms Offered: F05(B), F06(B),
hours W05(B), W06(B)

Advisory Prerequisites: **(non-enforced prerequisites)=
FIN 580, 621 (enforced prerequisites)= no credit in
FIN 616**

Corporate Financial Engineering

The process of creating new instruments is called financial engineering. Finance 622 is an advanced corporate finance course with an emphasis on corporate financial engineering. Topics include the costs and benefits of an alternative means of going public and of raising capital; information, bargaining and misvaluation problems associate with financing new investments; how a firm should manage risk, and the role of financing in limiting conflicts of interest between mangers and

security holders. The course will also cover various instruments firms issue such as callable and convertible securities, warrants, and securities with other imbedded options to manage these problems. The course is intended for those with career objectives that involve corporate finance.

FIN
623 **Venture Capital Finance**

1.5 Elective Terms Offered: F05(A), F06(A)
hours

Cross-listed with: **ES 623**

Venture Capital Finance --- This course covers venture capital market structure and institutional arrangements and the application of financial theory and methods in a venture capital finance setting. It presents and applies the fundamentals of venture capital finance, employing "live" case studies to focus on financing startup and early stage, technology-based firms.

([more](#))

FIN
624 **Private Equity Finance**

1.5 Elective Terms Offered: F05(B), F06(B)
hours

Advisory Prerequisites: **F 623**

Cross-listed with: **ES 624**

Private Equity Finance --- This course presents the fundamentals of private equity finance, focusing on financing mezzanine deals and buyout transactions. The course covers the private equity and buyout market structure, institutional arrangements and application of financial theory and methods in a private equity and buyout setting. The course covers four main aspects of private equity mezzanine investment and buyout transactions: valuation, deal structuring, governance, and harvesting. "Live" case studies are used to demonstrate the practical, hands-on application of techniques following their development in class.

([more](#))

FIN
626 **Global Private Equity**

1.5 Elective Terms Offered: W05(A)
hours

Cross-listed with: **ES 626**

Venture Capital & Private Equity Finance in Transitional Economies --- As the third course in the sequence, this course extends the coverage of venture capital and private equity from the US model to other parts of the globe. Similarities and differences among regions and countries are examined and related to fundamental forces such as political, cultural, legal and regulatory differences. Emphasis is placed on investment characteristics found in emerging markets and in developed markets of the world. Text, cases and live deals are employed to study the issues involved. As with the earlier courses, this course applies simulation and real options technology to the valuation issues involved as well as game theory to the negotiating of contracts among the several categories of players mentioned above. Familiarity with these valuation technologies is a necessary prerequisite for the course.

([more](#))

FIN
627 **Evaluating & Financing Global Projects**

1.5 Elective Terms Offered: W05(A), W06(A)
hours

Advisory Prerequisites: **(non-enforced prerequisites)= FIN 503/513/551 (enforced prerequisites)= no credit in FIN 620**

Evaluating & Financing Global Projects --- Students taking this 7-week module should expect to learn the nature and purposes of corporate financial management in an international setting. The course will begin by developing a comprehensive framework within which the financial issues facing a multinational corporation (MNC) are easily

positioned. Using this framework, students will then gain skills in the evaluation and financing of international investment projects, including some strategic aspects. Students completing this course should expect to be able to confidently undertake decisions regarding capital budgeting, mergers and acquisitions, and financing, in an international context.

FIN 628 Multinational Financial Management

1.5 Elective Terms Offered: W05(B), W06(B)
hours

Advisory Prerequisites: **(non-enforced prerequisites)= FIN 503/513/551 (enforced prerequisites)= no credit in FIN 620**

Multinational Financial Management --- Students taking this module should expect to learn the nature and purposes of corporate financial management in an international setting. Students will learn how to measure and manage a multinational corporation's exposure to foreign exchange rate risks in great detail, including hedging with financial instruments and operational hedge strategies. Finally, they will also consider issues related to strategic risk management. Topics include considerations of real options and political risk. Students completing this course should expect to be able to confidently undertake decisions regarding corporate risk, hedging foreign exchange risks, operating strategy and political risk management in an international context.

FIN 629 Financing Research Commercialization

3 hours Elective Terms Offered: F05, F06

Advisory Prerequisites: **(Advisory Prerequisites)=MBA Core/PI**

Cross-listed with: **ES 629**

Financing Research Commercialization --- This course is a practicum, offering an opportunity to apply collective team work of a student/mentor alliance to building a

services industry, sector by sector, concentrating on balance sheet presentations and overlooking management decision making and risk management. In contrast, this course will emphasize a risk management approach. The key areas covered will be the rationale for the existence of financial intermediaries, interest rate risk (Gap model, duration model, convexity), Market risk (JP Morgan Riskmetrics) and Credit risk (JP Morgan Creditmetrics, Moody's KMV-Merton Model, Altman Z score) of the bank.

FIN 632 Off-Balance Sheet Banking

1.5 Elective Terms Offered: W05(B), W06(B)
hours

Advisory Prerequisites: **FIN 580 and FIN 631**

Off-Balance Sheet Banking --- Continuing with the theme in FIN 631 that modern financial institutions are in the risk management business, this course will focus on other areas of risk management within the banking firm. Liquidity risk, Off balance sheet banking (Loan commitments, letters of credit and Securitization) regulation of banks and consolidation of the financial services industry are the topics that will be covered. Traditionally, Banking courses have focused on an overview of the financial services industry, sector by sector, concentrating on balance sheet presentations and overlooking management decision making and risk management. In contrast this course will emphasize a risk management approach.

FIN 637 Finance and the Sustainable Enterprise

2.25 Elective Terms Offered: F05(B), F06(B), W05(A)
hours

Advisory Prerequisites: **(non-enforced prereqs)=
FIN&BE core**

Finance and the Sustainable Enterprise --- This course deals with unique financial valuation and management issues faced by a sustainable business. We will study the

hours W05(B), W06(B)

Advisory Prerequisites: **FIN 615 and FIN 622 (can be concurrent)**

Corporate Financial Strategy --- This is the capstone course among corporate finance courses. Instead of designing a financial policy for a given business strategy, this course studies the cases in which both the financial strategies that may allow business strategies that could not be pursued otherwise. The course is divided in three. The first segment focuses on the issues in designing a financial strategy for the companies that are growing and expanding rapidly after their IPO. The second segment studies the challenges in designing a financial strategy and a major corporate restructuring at the same time. It includes divestitures, spin-offs, joint ventures, equity carve-outs among other strategies. The final segment focuses on the business strategies that are made possible by innovative corporate financial engineering. Most cases discussed are about fast growing companies, companies that face a rapidly changing environment, or companies with drastic restructuring needs.

FIN 725 Applied Financial Analysis and Portfolio Management

3 hours Elective Terms Offered: F05, W05, W06

Advisory Prerequisites: **ACC 712/permission of instructor**

Cross-listed with: **ACC 725**

Applied Financial Analysis and Portfolio Management --- This course takes place in the Tozzi Finance Center and requires students to manage a real investment fund. The emphasis is on combining the skills acquired in traditional courses with the latest financial technology to develop effective strategies for active portfolio management.

FIN 742 Special Topics

1.5 hours Elective Terms Offered: W06(A)

Special Topics in Finance --- Special Topics courses are used to cover current topics and for faculty members to introduce their current research into the curriculum. Courses are not offered every term, and coverage differs from one offering to the next. When a course is to be offered, the faculty member will provide a course description.

([more](#))

**FIN
750** **Research Projects**

3 hours Elective Terms Offered: F05, F06, M06, S06,
W05, W06

Advisory Prerequisites: **Graduate standing**

Research Projects --- Individual research projects, supervised by faculty, are available to graduate business students in good academic standing. To select a project, students should consult the appropriate professor about the nature of the research and the number of credit hours the work would garner. Students earn one to three credit hours per project and may elect only one research project in a term and no more than three over the course of their program. No more than six credit hours from research projects will count toward degree requirements.

**FIN
871** **Corporate Finance**

1.5 Elective Terms Offered: F05(B), F06(B)
hours

Advisory Prerequisites: **Doctoral standing**

Corporate Finance --- The purpose of the course is to provide a background for understanding the determinants of corporate financial policy and introduce students to current research in finance. The course complements the material in BA 855. The boundaries of the firm, its financial structure and issues of corporate control are discussed by drawing upon theories of agency, incomplete contracting, and property rights. We cover

FIN 885 Research Topics in Finance

1.5 hours Elective Terms Offered: F05(A), F05(B), W05(B), W06(B)

Research Topics in Finance --- Research Topics courses are used to cover current topics. Courses are not offered every term, and coverage differs from one offering to the next. When a course is to be offered, the instructor will provide a course description.

FIN 900 Special Research for Doctoral Applicants & Candidates

6 hours Terms Offered: F05, F06, M06, S06, W05, W06

Advisory Prerequisites: **Applicants and Candidates Only**

Special Research --- Special Research for Doctoral Applicants & Candidates. Individual Research projects for Doctoral Applicants and Candidates are available. See faculty in your area of interest.

FIN 990 Dissertation - Precandidacy

8 hours Terms Offered: F05, F06, M06, S06, W05, W06

Advisory Prerequisites: **Election for dissertation work by doctoral student not yet admitted as a Candidate**

Dissertation - Precandidacy --- Dissertation research at the Precandidacy stage.

FIN 995 Dissertation - Candidacy

8 hours Terms Offered: F05, F06, M06, W05, W06

Course Prerequisites: **Candidate**

Dissertation - Candidacy --- Dissertation research at the candidacy stage.