

Tp. Hồ Chí Minh, ngày tháng năm 2018

ĐỀ CƯƠNG CHI TIẾT HỌC PHẦN

(Dành cho CTĐT thạc sĩ theo định hướng Nghiên cứu)

1. THÔNG TIN CHUNG VỀ HỌC PHẦN

1.1. Tên học phần: Quản trị ngân hàng nâng cao

Tên tiếng Anh: Advanced bank management

- Mã học phần: Số tín chỉ: 03
- Áp dụng cho ngành/chuyên ngành đào tạo: Tài chính – Ngân hàng
 - + Bậc đào tạo: Cao học (định hướng ứng dụng)
 - + Hình thức đào tạo: Chính quy
 - + Yêu cầu của học phần: Bắt buộc

1.2. Khoa/Bộ môn/Giảng viên phụ trách học phần:

Tên	Chức danh	Bộ môn	Email
Trần Huy Hoàng	PGS.TS	Ngân Hàng	hoangth@ufm.edu.vn
Lê Thị Thúy Hằng	TS	Ngân Hàng	hangleufm@gmail.com

1.3. Mô tả học phần:

- Mô tả học phần: Học phần nhằm cung cấp kiến thức nâng cao về quản trị ngân hàng, giới thiệu chuẩn mực Basel trong quản trị kinh doanh ngân hàng nâng cao. Học phần chú trọng vào các nội dung quản trị tín dụng, tài sản và nợ, thanh khoản và rủi ro hoạt động theo chuẩn mực Basel. Học phần cũng cung cấp việc vận dụng chuẩn mực Basel trong quản trị kinh doanh ngân hàng tại Việt Nam.

- Phân bổ giờ tín chỉ đối với các hoạt động:

- + Nghe giảng lý thuyết: 20 tiết
- + Làm bài tập trên lớp: 15 tiết
- + Thảo luận: 10 tiết
- + Tự học: 90 tiết

1.4 Các điều kiện tham gia học phần:

- Các học phần tiên quyết:
- Các học phần học trước:
- Các học phần học song hành:
- Các yêu cầu khác đối với học phần (nếu có):

2. MỤC TIÊU CỦA HỌC PHẦN

- Sinh viên hiểu được các kiến thức về quản trị ngân hàng thương mại và các tổ chức tín dụng trên cơ sở kế thừa các kiến thức ở bậc đại học, bổ sung thêm những nội dung mới và cập nhật những kiến thức cao cấp chưa được giảng dạy ở bậc đại học. Học viên hiểu được hoạt động quản trị ngân hàng hiện đại trong điều kiện rủi ro có tính đa dạng, phức tạp hơn. Am hiểu được các chuẩn mực quốc tế về quản trị trong kinh doanh ngân hàng.

- Người học phân tích được các phương pháp quản trị về mặt kỹ thuật như quản trị vốn tự có, quản trị tài sản – nợ, quản trị thanh khoản, quản trị tín dụng và đầu tư của các NHTM và TCTD.

3. CHUẨN ĐẦU RA

3.1 Chuẩn đầu ra của học phần

Mục tiêu		Chuẩn đầu ra học phần	Đáp ứng chuẩn đầu ra CTĐT
Kiến thức	Ks1	Hiểu được hoạt động kinh doanh của ngân hàng và vận dụng được chuẩn mực Basel trong quản trị kinh doanh ngân hàng.	Đáp ứng chuẩn đầu ra CTĐT về các kiến thức cơ sở và chuyên ngành Tài chính – Ngân hàng: K3, K4, K5, K7 K3: Đạt được kiến thức về lý thuyết chuyên ngành chuyên sâu để có thể phát triển kiến thức mới và tiếp tục nghiên cứu ở trình độ tiến sĩ.
	Ks2	Phân tích và vận dụng được quản trị vốn tự có và sự an toàn ngân hàng theo chuẩn mực Basel	K4: Phân tích, phát hiện và giải quyết các vấn đề chuyên sâu lĩnh vực tài chính- ngân hàng, từ đó tăng cường khả năng sáng tạo và khám phá kiến thức mới.
	Ks3	Vận dụng lý thuyết vào quản trị tín dụng, quản trị tài sản-nợ, quản trị thanh khoản theo chuẩn mực Basel	K5: Phân tích được các thay đổi của chính sách kinh tế, tài chính tiền tệ trong bối cảnh hội nhập quốc tế.
	Ks4	Xây dựng và triển khai có hiệu quả kế hoạch quản trị rủi ro thị trường, quản trị rủi ro hoạt động và quản trị kết quả kinh doanh ngân hàng.	K7: Vận dụng các lý thuyết, mô hình tài chính hiện đại trong nghiên cứu các vấn đề lĩnh vực TC-NH.

Kỹ năng	Ss1	Phân tích, tổng hợp, đánh giá dữ liệu và thông tin về các báo cáo tài chính ngân hàng.	<p>Đáp ứng chuẩn đầu ra CTĐT về Kỹ năng nghề nghiệp, Kỹ năng cá nhân làm việc với mọi người (kỹ năng cứng và kỹ năng mềm): S1, S2, S3, S4, S6</p> <p>S1: Kỹ năng phân tích, tổng hợp, đánh giá dữ liệu và thông tin về tài chính ngân hàng để đưa ra giải pháp xử lý các vấn đề thực tiễn liên quan đến lĩnh vực tài chính – ngân hàng</p> <p>S2: Có kỹ năng độc lập nghiên cứu, bước đầu có thể hình thành ý tưởng khoa học, phát hiện, khám phá và thử nghiệm kiến thức mới trong lĩnh vực TC-NH.</p> <p>S3: Có kỹ năng trong việc truyền đạt tri thức dựa trên các kết quả nghiên cứu thuộc lĩnh vực tài chính ngân hàng, có kỹ năng thảo luận các vấn đề thực tiễn với nhà chuyên môn và khoa học hoặc với người cùng ngành tài chính ngân hàng và với những người khác.</p> <p>S4: Có kỹ năng tổ chức, quản trị và quản lý các hoạt động nghề nghiệp tiên tiến liên quan trong lĩnh vực Tài chính - Ngân hàng.</p> <p>S6: Có được kỹ năng phối hợp, điều hành thảo luận nhóm</p>
	Ss2	Có sáng kiến cải tiến và thử nghiệm kiến thức mới trong hoạt động ngân hàng.	
	Ss3	Có kỹ năng thảo luận các vấn đề liên quan hoạt động quản trị ngân hàng thương mại với nhà chuyên môn và khoa học hoặc với người cùng ngành tài chính ngân hàng	
	Ss4	Có kỹ năng tổ chức, quản trị, phối hợp, điều hành thảo luận nhóm và quản lý các tổ chức tín dụng.	
Năng lực tự chủ, tự chịu trách nhiệm	As1	Có khả năng nghiên cứu trong việc quản trị hoạt động ngân hàng thương mại	<p>Đáp ứng chuẩn đầu ra CTĐT về Thái độ/năng lực cá nhân với xã hội (Kỹ năng và phẩm chất giữa các cá nhân): A1, A2, A3, A4, A6</p> <p>A1: Năng lực tự nghiên cứu, khám phá các vấn đề mới liên quan lĩnh vực TC-NH.</p> <p>A2: Năng lực đưa ra những sáng kiến quan trọng để giải quyết các vấn đề thực tiễn phát sinh trong lĩnh vực Tài chính – Ngân hàng.</p> <p>A3: Thích nghi, tự định hướng và hướng dẫn người khác trong lĩnh vực Tài chính – Ngân hàng.</p>
	As2	Thích nghi với môi trường công việc, tự định hướng và hướng dẫn người khác trong lĩnh vực Tài chính – Ngân hàng.	
	As3	Có các sáng kiến quan trọng trong việc quản trị hoạt động ngân hàng thương mại	
	As4	Có tinh thần trách nhiệm nghề nghiệp, tuân thủ đúng các quy trình quy định trong tác nghiệp.	

	As5	Phẩm chất đạo đức trung thực trong công việc.	A4: Năng lực dẫn dắt chuyên môn; đưa ra được những kết luận mang tính chuyên gia trong lĩnh vực Tài chính – Ngân hàng. A6: Phẩm chất đạo đức, trách nhiệm nghề nghiệp.
--	------------	---	---

3.2 Ma trận liên kết nội dung của học phần với chuẩn đầu ra của học phần

TT	Nội dung	Chuẩn đầu ra môn học		
		Kiến thức	Kỹ năng	Thái độ
1	Chương 1: Giới thiệu về dịch vụ tài chính và quản trị ngân hàng 1.1. Giới thiệu hoạt động kinh doanh của ngân hàng 1.2. Ngân hàng là một tổ chức đặc biệt 1.3. Giới thiệu Basel và chuẩn mực Basel trong quản trị kinh doanh ngân hàng 1.4. Câu hỏi và bài tập tình huống	K s1	S s1 S s2 S s3 S s4	A s1 A s2 A s4 A s5
2	Chương 2: Quản trị vốn tự có và sự an toàn ngân hàng theo chuẩn mực Basel 2.1. Giới thiệu vốn của ngân hàng 2.2. Vốn tự có và chuẩn mực Basel 2.3. Chi phí vốn tự có 2.4. Quản trị an toàn vốn 2.5. Câu hỏi và bài tập tình huống	K s1 K s2	S s1 S s2 S s3 S s4	A s1 A s2 A s3 A s4 A s5
3	Chương 3: Quản trị tín dụng theo chuẩn mực Basel 3.1. Rủi ro tín dụng 3.2. Quản lý khoản vay 3.3. Định giá khoản vay 3.4. Quản trị khoản vay có vấn đề 3.5. Câu hỏi và bài tập tình huống	K s1 K s3	S s1 S s2 S s3 S s4	A s1 A s2 A s3 A s4 A s5
4	Chương 4: Quản trị tài sản-nợ theo chuẩn mực Basel 4.1. Nợ ngân hàng và quản trị nợ 4.2. Tài sản và quản trị tài sản 4.3. Quản trị tài sản –nợ theo chuẩn mực Basel	K s1 K s3	S s1 S s2 S s3 S s4	A s1 A s2 A s3 A s4

TT	Nội dung	Chuẩn đầu ra môn học		
		Kiến thức	Kỹ năng	Thái độ
	4.4. Câu hỏi và bài tập tình huống			A s5
5	<p>Chương 5: Quản trị thanh khoản và chuẩn mực Basel</p> <p>5.1. Giới thiệu</p> <p>5.2. Vấn đề thanh khoản của ngân hàng</p> <p>5.3. Đo lường và quản trị trạng thái thanh khoản</p> <p>5.4. Thanh khoản từ phía tài sản</p> <p>5.5. Thanh khoản từ phía nguồn vốn</p> <p>5.6. Quy định về dự trữ và quản trị khả năng thanh khoản của ngân hàng</p> <p>5.7. Câu hỏi và bài tập tình huống</p>	<p>K s1</p> <p>K s3</p>	<p>S s1</p> <p>S s2</p> <p>S s3</p> <p>S s4</p>	<p>A s1</p> <p>A s2</p> <p>A s3</p> <p>A s4</p> <p>A s5</p>
6	<p>Chương 6: Quản trị rủi ro thị trường theo chuẩn mực Basel</p> <p>6.1. Giới thiệu</p> <p>6.2. Quản trị rủi ro lãi suất</p> <p>6.3. Quản trị rủi ro tỷ giá</p> <p>6.4. Quản trị danh mục đầu tư</p> <p>6.5. Câu hỏi và bài tập tình huống</p>	<p>K s1</p> <p>K s2</p> <p>K s3</p> <p>K s4</p>	<p>S s1</p> <p>S s2</p> <p>S s3</p> <p>S s4</p>	<p>A s1</p> <p>A s2</p> <p>A s3</p> <p>A s4</p> <p>A s5</p>
7	<p>Chương 7: Quản trị rủi ro hoạt động theo chuẩn mực Basel</p> <p>7.1. Giới thiệu</p> <p>7.2. Rủi ro hoạt động trong kinh doanh ngân hàng</p> <p>7.3. Nguyên nhân rủi ro hoạt động</p> <p>7.4. Chuẩn mực Basel trong quản trị rủi ro hoạt động</p> <p>7.5. Câu hỏi và bài tập tình huống</p>	<p>K s1</p> <p>K s2</p> <p>K s3</p> <p>K s4</p>	<p>S s1</p> <p>S s2</p> <p>S s3</p> <p>S s4</p>	<p>A s1</p> <p>A s2</p> <p>A s3</p> <p>A s4</p> <p>A s5</p>
8	<p>Chương 8: Các tỷ lệ an toàn trong kinh doanh ngân hàng</p> <p>8.1. Các tỷ lệ an toàn theo chuẩn mực Basel</p> <p>8.2. Các tỷ lệ an toàn theo chuẩn mực quốc tế khác</p> <p>8.3. Câu hỏi và bài tập tình huống</p>	<p>K s1</p> <p>K s2</p> <p>K s3</p> <p>K s4</p>	<p>S s1</p> <p>S s2</p> <p>S s3</p> <p>S s4</p>	<p>A s1</p> <p>A s2</p> <p>A s3</p> <p>A s4</p> <p>A s5</p>

TT	Nội dung	Chuẩn đầu ra môn học		
		Kiến thức	Kỹ năng	Thái độ
9	Chương 9: Quản trị kết quả kinh doanh ngân hàng 9.1. Giới thiệu 9.2. Đánh giá hoạt động ngân hàng sử dụng các tỷ số tài chính 9.3. Mô hình Dupont 9.4. Câu hỏi và bài tập tình huống	K s1 K s2 K s3 K s4	S s1 S s2 S s3 S s4	A s1 A s2 A s3 A s4 A s5

4. NỘI DUNG HỌC PHẦN VÀ KẾ HOẠCH GIẢNG DẠY

Thời gian	Nội dung	Hình thức tổ chức dạy-học			Tự nghiên cứu	Phương pháp giảng dạy	Yêu cầu học viên chuẩn bị trước khi đến lớp	Ghi chú
		GIỜ LÊN LỚP						
		Lý thuyết	Bài tập	Thuyết trình				
Tuần 1: Từ: Đến...	Chương 1: Giới thiệu về dịch vụ tài chính và quản trị ngân hàng	2	1	1	05	Phương pháp đặt và giải quyết vấn đề	<i>Đọc quyển Quản trị ngân hàng thương mại</i>	
Tuần 2: Từ: Đến...	Chương 2: Quản trị vốn tự có và sự an toàn ngân hàng theo chuẩn mục Basel	2	1	1	05	Phương pháp đặt và giải quyết vấn đề	<i>Đọc quyển Quản trị ngân hàng thương mại</i>	
Tuần 3:	Chương 3:	1	2	1	05	Phương	<i>Đọc quyển</i>	

Thời gian	Nội dung	Hình thức tổ chức dạy-học			Tự nghiên cứu	Phương pháp giảng dạy	Yêu cầu học viên chuẩn bị trước khi đến lớp	Ghi chú
		GIỜ LÊN LỚP						
		Lý thuyết	Bài tập	Thuyết trình				
Từ: Đến...	Quản trị tín dụng theo chuẩn mục Basel					pháp đặt và giải quyết vấn đề	<i>Quản trị ngân hàng thương mại</i>	
Tuần 4: Từ: Đến...	Chương 3: Quản trị tín dụng theo chuẩn mục Basel	1	2	1	05	Phương pháp đặt và giải quyết vấn đề	<i>Đọc quyển Quản trị ngân hàng thương mại</i>	
Tuần 5: Từ: Đến...	Chương 4: Quản trị tài sản-nợ theo chuẩn mục Basel	1	2	1	10	Phương pháp đặt và giải quyết vấn đề	<i>Đọc quyển Bank management & Financial services</i>	
Tuần 6: Từ: Đến...	Chương 4: Quản trị tài sản-nợ theo chuẩn mục Basel	1	2	1	10	Phương pháp đặt và giải quyết vấn đề	<i>Đọc quyển Bank management & Financial services</i>	
Tuần 7: Từ: Đến...	Chương 5: Quản trị thanh	2	1	1	10	Phương pháp đặt và giải	<i>Đọc quyển Quản trị ngân hàng</i>	

Thời gian	Nội dung	Hình thức tổ chức dạy-học			Tự nghiên cứu	Phương pháp giảng dạy	Yêu cầu học viên chuẩn bị trước khi đến lớp	Ghi chú
		GIỜ LÊN LỚP						
		Lý thuyết	Bài tập	Thuyết trình				
	khoản và chuẩn mực Basel					quyết vấn đề	<i>thương mại</i>	
Tuần 8: Từ: Đến...	Chương 6: Quản trị rủi ro thị trường theo chuẩn mực Basel	2	1	1	10	Phương pháp đặt và giải quyết vấn đề	<i>Đọc quyển Quản trị ngân hàng thương mại</i>	
Tuần 9: Từ: Đến...	Chương 7: Quản trị rủi ro hoạt động theo chuẩn mực Basel	2	1	1	10	Phương pháp đặt và giải quyết vấn đề	<i>Đọc quyển Quản trị ngân hàng thương mại</i>	
Tuần 10: Từ: Đến...	Chương 8: Các tỷ lệ an toàn trong kinh doanh ngân hàng	2	1	1	10	Phương pháp đặt và giải quyết vấn đề	<i>Đọc quyển Quản trị ngân hàng thương mại</i>	
Tuần 11: Từ: Đến...	Chương 9: Quản trị kết quả kinh	2	1	2	10	Phương pháp đặt và giải quyết vấn đề	<i>Đọc quyển Quản trị ngân hàng thương mại</i>	

Thời gian	Nội dung	Hình thức tổ chức dạy-học			Tự nghiên cứu	Phương pháp giảng dạy	Yêu cầu học viên chuẩn bị trước khi đến lớp	Ghi chú
		GIỜ LÊN LỚP						
		Lý thuyết	Bài tập	Thuyết trình				
	doanh ngân hàng					đề		

5. HỌC LIỆU

5.1 Tài liệu chính:

[1] Trần Huy Hoàng, “Quản trị ngân hàng thương mại”, Nhà xuất bản Lao Động Xã Hội, tái bản năm 2014.

5.2 Tài liệu tham khảo:

[2] Anthony Saunders, Marcia Millon Cornett, “Financial Institutions Management”, 8th edition, MaGrawHill International Edition (AM).

[3] Peter S. Rose, Sylvia C. Hudgins, “Bank management & Financial services”, 9th edition, MaGrawHill (PS).

6. PHƯƠNG PHÁP ĐÁNH GIÁ KẾT QUẢ HỌC TẬP HỌC PHẦN

Phương pháp đánh giá		Tỷ trọng, %	Đáp ứng mục tiêu, chuẩn đầu ra của học phần
Kiểm tra thường xuyên (25%)	Đánh giá thường xuyên 1		K s1; K s2; K s3; K s4; S s1; S s2; S s3; S s4; A a1; A a2; A a3; A a4; A a5
	Tính chuyên cần	5%	
	Thái độ chủ động, tích cực trong học tập	5%	
	Đánh giá thường xuyên 2		K s1; K s2; K s3; K s4; S s1; S s2; S s3; S s4; A a1; A a2; A a3; A a4; A a5
	Thuyết trình nhóm	5%	

	Phát biểu cá nhân	10%	
		
Kiểm tra định kỳ (25%)	Bài kiểm tra 1	25%	K s1; K s2; K s3; K s4; S s1; S s2; S s3; S s4; A a1; A a2; A a3; A a4; A a5
	...		
Thi kết thúc học phần (50%)	Lý thuyết	25%	K s1; K s2; K s3; K s4; S s1; S s2; S s3; S s4; A a1; A a2; A a3; A a4; A a5
	Thực hành	25%	K s1; K s2; K s3; K s4; S s1; S s2; S s3; S s4; A a1; A a2; A a3; A a4; A a5
Tổng cộng		100%	

**Ban Giám hiệu
Duyệt**

Trưởng khoa

Trưởng bộ môn