

PGS.TS. NGUYỄN MINH KIỀU
ĐẠI HỌC MỞ TP. HCM
VÀ CHƯƠNG TRÌNH GIẢNG DẠY KINH TẾ FULBRIGHT

QUẢN TRỊ RỦI RO TÀI CHÍNH

(LÝ THUYẾT - BÀI TẬP VÀ BÀI GIẢI)



NHÀ XUẤT BẢN TÀI CHÍNH

PGS. TS NGUYỄN MINH KIỀU
Khoa Sau Đại học – Đại học mở TP. HCM và
Chương trình Giảng dạy Kinh tế Fulbright

QUẢN TRỊ RỦI RO TÀI CHÍNH

NHÀ XUẤT BẢN TÀI CHÍNH

**HOAN NGHÊNH BẠN ĐỌC
GÓP Ý PHÊ BÌNH**

VỀ TÁC GIẢ

PGS. TS NGUYỄN MINH KIỂU hiện phụ trách Khoa Sau Đại học – Đại học Mở TP. HCM – *nơi chuyên đào tạo Cao học chuyên ngành Tài chính Ngân hàng & Cao học Quản trị Kinh doanh có uy tín hiện nay*. Trước đó, ông là Trưởng Bộ Môn Kinh Doanh Tiền Tệ của Khoa Ngân hàng thuộc Trường Đại học Kinh Tế Thành phố Hồ Chí Minh. Ông còn là giảng viên chính môn Phân tích Tài chính và đồng Giảng viên môn Tài chính phát triển của Chương Trình Giảng Dạy Kinh Tế Fulbright – Chương trình liên kết giữa Harvard University và Đại học Kinh Tế TP. Hồ Chí Minh.

Tốt nghiệp Cử nhân Kinh tế chuyên ngành Ngân hàng năm 1986, ông được Đại học Kinh Tế giữ lại làm cán bộ giảng dạy của trường từ năm 1987. Năm 1995 ông trúng tuyển và tham gia vào Chương Trình Phát Triển Quản Lý Thụy Sĩ – AIT – Việt Nam (SAV) và được tuyển chọn sang học chương trình Thạc sĩ Quản Trị Kinh Doanh (MBA) tại Viện Công nghệ Châu Á (AIT), Thái Lan. Năm 1997 sau khi nhận bằng MBA, ông tiếp tục giảng dạy tại Đại học Kinh Tế đồng thời làm nghiên cứu và giảng dạy cho chương trình SAV. Năm 1998 ông nhận được học bổng của Chương trình SAV và được tuyển chọn vào học chương trình Tiến sĩ Quản Trị Kinh Doanh (DBA) tại Southern Cross University, Australia. Năm 2001 sau khi nhận bằng DBA ông trở về Việt Nam giảng dạy cho Đại học Kinh Tế và Chương trình Fulbright. Hiện nay, ông đang phụ trách Khoa Sau Đại học – Đại học Mở TP. HCM – *nơi chuyên đào tạo Cao học chuyên ngành Tài chính Ngân hàng & Cao học Quản trị Kinh doanh có uy tín hiện nay*. Ngoài ra, ông còn giảng dạy Tài chính công ty, Quản trị tài chính và Tài chính quốc tế cho các chương trình do đại học nước ngoài mở ở Việt Nam như CFVG, UBI, Curtin, Cao học Hà Lan, và tham gia giảng dạy và tư vấn cho các doanh nghiệp và ngân hàng thương mại Việt Nam.

LỜI MỞ ĐẦU

Sau khi các quyển sách của tôi về tài chính và ngân hàng đã xuất bản và nhận được sự ủng hộ nhiệt tình và đánh giá cao của các bạn sinh viên và các nhà quản lý doanh nghiệp, nhiều độc giả mong muốn tôi tiếp tục viết và xuất bản quyển "Quản trị rủi ro tài chính" như là một chuỗi sách tham khảo về lĩnh vực tài chính và ngân hàng nhằm tiếp tục phục vụ bạn đọc. Đáp ứng lại sự ủng hộ nhiệt tình của bạn đọc, nhất là các bạn sinh viên, tôi hứa sẽ nhanh chóng hoàn tất quyển sách này và sớm xuất bản phục vụ các bạn. Thời gian qua có nhiều bạn đọc nói với tôi rằng đã đi tìm kiếm quyển sách này nhưng không thấy bày bán ở các hiệu sách. Tôi thành thật xin các bạn thứ lỗi cho sự chậm trễ này và mong các bạn hiểu cho sự chậm trễ này là cần thiết cho lần xuất bản đầu tiên với mong muốn phục vụ bạn đọc thật tốt.

Ngay ở lần xuất bản đầu tiên này, quyển sách đã có nhiều điểm mới, cần thiết và độc đáo mà bạn không thể đọc được ở các sách khác cùng chủ đề này đã được xuất bản. Với nội dung bao gồm 8 chương được trình bày theo văn phong đơn giản, mạch lạc và chi tiết, quyển sách này có thể là cẩm nang giúp bạn tự học và hoàn chỉnh thêm kiến thức của mình về các giải pháp và công cụ quản lý rủi ro tài chính, bao gồm rủi ro tín dụng, rủi ro lãi suất và đặc biệt là rủi ro tỷ giá. Điểm nhấn trong quyển sách này là tất cả các chương đều được cập nhật hóa, sát thực với công việc và trang bị kiến thức và hướng dẫn kỹ năng thực hành cần thiết cho nhân viên và cán bộ quản lý ở các doanh nghiệp cũng như ngân hàng.

Với những nỗ lực nghiên cứu và kinh nghiệm tiếp cận thực tiễn, tôi hy vọng ngay lần xuất bản đầu tiên này bạn đọc sẽ ủng hộ và hoàn toàn hài lòng với quyển sách này. Một lần nữa, xin chân thành cảm ơn sự ủng hộ nhiệt tình của bạn đọc đối với những quyển sách của tôi đã được xuất bản và mong được tiếp tục phục vụ các bạn thông qua quyển "Quản trị rủi ro tài chính" chứa đựng nhiều vấn đề mới mẻ và độc đáo này.

MỤC LỤC TÓM TẮT

- Lời mở đầu

Phần 1 : CĂN BẢN VỀ RỦI RO TÀI CHÍNH VÀ CÔNG CỤ PHÁI SINH

- *Chương 1* : Nhận dạng các loại rủi ro tài chính,
- *Chương 2* : Các công cụ tài chính phái sinh – Công cụ quản lý rủi ro tài chính.
- *Chương 3* : Các công cụ phái sinh trên thị trường ngoại hối.

Phần 2 : ĐỊNH GIÁ VÀ QUYẾT ĐỊNH ĐẦU TƯ

- *Chương 4* : Quản lý rủi ro tín dụng,
- *Chương 5* : Quản lý rủi ro lãi suất.
- *Chương 6* : Quản lý rủi ro tỷ giá của doanh nghiệp.
- *Chương 7* : Quản lý rủi ro tỷ giá của ngân hàng.
- *Chương 8* : Thực trạng quản lý rủi ro tài chính ở Việt Nam.
- Tài liệu tham khảo.

Phần 1

CĂN BẢN VỀ RỦI RO TÀI CHÍNH VÀ CÔNG CỤ PHÁI SINH

