国际金融学本科课程教学大纲

编制人：张敏锋

审定人：乔红芳

开课部门：金融与统计系

编制时间：2019年6月30日

一、课程基本信息

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 课程名称 | 中文 | 国际金融学 | | |
| 英文 | International Finance | | |
| 课程代码 | 18803040300 | | 课程性质 | 专业必修课 |
| 课程学分 | 3 | | 课程学时 | 48 |
| 适用专业 | 经济与金融 | | 课程组负责人 | 张敏锋 |
| 课程组成员 |  | | | |
| 先修课程 | 宏观经济学、金融学 | | | |
| 选用教材 | 陈雨露. 国际金融（第六版）. 北京：中国人民大学出版社，2019. | | | |
| 参考书目 | 姜波克，杨长江. 国际金融学（第五版）. 北京：高等教育出版社，2019.  刘 园. 国际金融实务（第三版）. 北京：高等教育出版社，2017. | | | |
| 推荐教材 | 陈雨露. 国际金融（第六版）. 北京：中国人民大学出版社，2019. | | | |

二、课程目标

**（一）课程具体目标**

|  |  |
| --- | --- |
| **序 号** | **课程具体目标** |
| 课程目标1 | 掌握国际金融学科相关的基本概念、国际金融的基本构架与运行方式、国际金融的基本业务等 |
| 课程目标2 | 掌握观察和分析国际金融问题的正确方法，培养解决国际金融实际问题的能力 |
| 课程目标3 | 树立正确的国际金融意识和理念，提高在国际金融学科的素养 |
| 课程目标4 |  |

**（二）课程目标与毕业要求的关系**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **课程目标** | **支撑的毕业要求** | **支撑的毕业要求指标点** |
| 课程目标1 | 毕业要求1：知识要求 | 1.1 工具性知识。熟练掌握使用外语阅读国际金融市场的信息；熟练运用现代信息管理技术进行国际金融市场数据的检索、数据处理、设计模型等。  1.2 专业知识。牢固掌握国际金融的基础知识、基本理论与基本技能；特别是外汇与汇率、国际金融市场、外汇衍生品交易和风险管理、国际收支、国际储备、宏观经济政策、汇率制度等方面内容。 |
| 课程目标2 | 毕业要求3：能力要求 | 3.1 获取知识的能力。能够掌握有效的学习方法，适应国际金融理论和实践快速发展的客观情况，与时俱进。  3.2 实践应用能力。能够在国际金融实践活动中灵活运用所掌握的专业知识，特别是对汇率走势和国际金融市场产品有深刻见解，为政府、企业、金融机构等部门解决实际问题。 |
| 课程目标3 | 毕业要求2：素质要求 | 2.1 思想道德素质 遵守宪法、法律和法规，遵守公民道德规范。培养良好的职业操守和职业道德，具备社会责任感和人文关怀意识。  2.2 专业素质。具有金融专业思维和较强的学科意识。熟悉国家有关国际金融的方针、政策和法律法规，树立正确的国际金融意识和理念。 |

三、课程教学要求与重难点

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **课程内容框架** | **教学要求** | **教学重点** | **教学难点** |
| 1 | 绪论 国际金融学概论 | 1.了解国际金融学的理论发展  2.掌握国际金融学的主要研究对象  3.熟悉国际金融学的主要业务 | 1.理解国际金融学的基本框架和主要内容  2.结合实际阐释学习国际金融学的价值 | 1.国际金融学的理论框架  2.国际金融学学习目标 |
| 2 | 第一章 外汇与外汇汇率 | 1.掌握外汇含义和汇率标价法  2.了解汇率的主要分类  3.掌握汇率的决定与变动及其经济影响  4.熟悉人民币汇率制度 | 1.汇率标价法  2.汇率套算  3.纸币条件下汇率波动的影响因素及其经济影响  4.人民币汇率制度 | 1.不同交易者的买入价和卖出价  2.实务中汇率走势的影响因素  3.人民币汇率制度改革 |
| 3 | 第二章 外汇市场 | 1.了解外汇市场的起源、功能和特点  2.熟悉外汇市场结构  3.掌握外汇市场交易交易活动和产品 | 1.全球外汇市场的特征  2.即期、远期和掉期外汇产品 | 1.即期、远期和掉期外汇产品的联系与区别  2.掌握全球和我国外汇市场发展情况 |
| 4 | 第三章 外汇衍生产品市场 | 1.熟悉外汇衍生产品的特征  2.掌握远期、期货、期权、互换等主要外汇衍生产品的交易机制和交易方法  3.了解外汇衍生产品市场的现状和未来 | 1.远期外汇交易  2.期货外汇交易  3.期权外汇交易  4.互换外汇交易 | 1.利率平价定理  2.期货保证金运作  3.看涨期权和看跌期权  4.互换利率计算 |
| 5 | 第四章 离岸金融市场 | 1.熟悉离岸金融市场  2.掌握欧洲货币市场的产生、特点和影响  3.了解欧洲债券市场 | 1.离岸金融市场产生和主要产品  2.离岸金融市场的价值和作用 | 1.离岸市场与在岸市场的区别  2.我国如何发展离岸市场 |
| 6 | 第五章 国际资产投资组合 | 1.了解国际金融市场一体化的收益和风险  2.熟悉国际金融市场上的机构投资者  3.掌握国际组合投资的原理和渠道 | 1.国际组合投资的基本原理  2.国际组合投资与金融市场一体化 | 1.如何进行国际组合投资  2.金融市场一体化 |
| 7 | 第六章 外汇风险管理 | 1.熟悉外汇风险种类及其成因  2.熟悉汇率预测技术  3.熟悉评估外汇风险的操作技术与步骤  4.掌握常用外汇风险管理方法 | 1.外汇风险种类  2.外汇风险计量和预测  3.外汇风险管理办法 | 1.不同外汇风险的区别  2.套期保值管理外汇风险 |
| 8 | 第七章 跨国银行业务与经营 | 1.了解跨国银行兴起的原因和三次浪潮  2.掌握跨国银行的组织构架和主要业务  3.掌握跨国银行设立的模式及其决定因素  4.了解我国跨国银行发展的特点 | 1.跨国银行的组织构架和主要业务  2.跨国银行的设立 | 1.跨国银行与国内银行的区别与联系  2.我国商业银行如何国际化 |
| 9 | 第八章 国际收支 | 1.掌握国际收支构成和国际收支平衡表编制方法  2.熟悉收支平衡表内容，学习国际收支项目分析  3.熟悉主要国际收支理论 | 1.国际收支及其平衡表构成  2.国际收齐平衡表编制  3.国际收支平衡表分析 | 1.国际收支及其平衡表  2.我国国际收支分析 |
| 10 | 第九章 开放经济下的宏观经济政策 | 1.理解开放条件下内外均衡的关系及政策搭配的重要性  2.掌握开放条件下的宏观经济均衡分析框架  3.了解我国的宏观经济政策实践 | 1.IS-LM-BP模型  2.开放经济的宏观经济政策工具及其政策搭配  3.我国开放条件下的宏观经济政策 | 1.开放经济的宏观经济政策  2.IS-LM-BP模型的应用 |
| 11 | 第十章 汇率制度选择 | 1.掌握比较固定汇率制度和浮动汇率制度的利弊  2.熟悉最适货币区理论与实践  3.了解国际货币体系演进历史  4.了解各国在汇率制度选择上的其他探索 | 1.固定汇率制度  2.浮动汇率制度  3.我国的汇率制度 | 1.固定汇率制度和浮动汇率制度的利弊比较  2.我国的汇率制度改革 |
| 12 | 第十一章 国际资本流动与金融稳定 | 1.掌握不同期限国际资本流动对相关国家的影响  2.掌握国际资本流动影响金融稳定的主要机制  3.掌握组合使用宏观经济政策工具控制国际资本流动的不利影响  4.了解国际资本流动的发展过程和近期趋势 | 1.国际资本流动与金融稳定  2.国际资本流动的不利影响的调控措施 | 1.短期和中长期国际资本流动的不同影响  2.宏观经济调控与国际资本流动 |
| 13 | 第十二章 金融危机的防范与管理 | 1.了解全球范围内的金融危机发生情况及主要案例  2.掌握金融危机发生发展机制的主流理论  3.了解国际经济协调的主要平台  4.理解国际协调平台的作用 | 1.历次国际金融危机及其教训  2.金融危机理论  3.国际经济协调平台建设及如何防范金融危机的措施 | 1.金融危机的解释  2.国际经济协调平台与金融危机防范 |

四、课程教学内容、教学方式、学时分配及对课程目标的支撑情况

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **课程内容框架** | **教学内容** | **教学方式** | **学时** | **支撑的**  **课程目标** |
| 1 | 绪论 国际金融学概论 | 第一节 全球化与国家金融学 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标1、3 |
| 第二节 变革中的国际金融市场 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标2、3 |
| 第三节 为什么要学好国际金融学 | 讲授、课堂讨论 | 1 | 课程目标1、3 |
| 2 | 第一章 外汇与外汇汇率 | 第一节 外汇 | 讲授、课堂讨论 | 0.5 | 课程目标1 |
| 第二节 外汇汇率 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标  1、2 |
| 第三节　汇率的经济分析I——汇率决定与变动 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1.5 | 课程目标  1、2 |
| 第四节　汇率的经济分析Ⅱ——汇率变化的经济影响 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标1、2 |
| 第五节　人民币汇率 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标  2、3 |
| 3 | 第二章 外汇市场 | 第一节 外汇市场概述 | 讲授、课堂讨论 | 0.5 | 课程目标1 |
| 第二节 外汇市场环境与结构 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标  1、2 |
| 第三节 外汇市场交易活动与交易产品 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 2 | 课程目标1、2 |
| 第四节 中国的外汇市场 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 0.5 | 课程目标2、3 |
| 4 | 第三章 外汇衍生产品市场 | 第一节 外汇衍生交易的特征 | 讲授、课堂讨论 | 0.5 | 课程目标1 |
| 第二节 外汇衍生产品的交易机制 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 4 | 课程目标  1、2 |
| 第三节　外汇衍生产品市场的现状及发展 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 0.5 | 课程目标  1、3 |
| 5 | 第四章 离岸金融市场 | 第一节　欧洲货币市场 | 讲授讲授、课堂讨论 | 1.5 | 课程目标  1、2 |
| 第二节　欧洲债券市场 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 0.5 | 课程目标1、2 |
| 6 | 第五章 国际资产投资组合 | 第一节　国际组组合投资概览 | 讲授、课堂讨论 | 1 | 课程目标1 |
| 第二节 国际组合投资与金融市场一体化 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标  2、3 |
| 7 | 第六章 外汇风险管理 | 第一节 外汇风险概述 | 讲授、课堂讨论 | 1 | 课程目标1 |
| 第二节 汇率预测技术 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标1、2 |
| 第三节 外汇风险计量 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 2 | 课程目标1、2 |
| 第四节 外汇风险管理技术 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 2 | 课程目标2、3 |
| 8 | 第七章 跨国银行业务与经营 | 第一节　跨国银行的产生与发展 | 讲授、课堂讨论 | 0.5 | 课程目标1 |
| 第二节 跨国银行的组织架构 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 0.5 | 课程目标  1、2 |
| 第三节　跨国银行的业务与监督 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 0.5 | 课程目标  1、2 |
| 第四节 我国跨国银行的发展现状 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 0.5 | 课程目标2、3 |
| 9 | 第八章 国际收支 | 第一节 国际收支与国际收支平衡表 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 3 | 课程目标1、2 |
| 第二节　国际收支项目分析 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标  1、2 |
| 第三节　国际收支理论 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 2 | 课程目标  1、3 |
| 10 | 第九章 开放经济下的宏观经济政策 | 第一节 开放经济的宏观分析框架 | 讲授、课堂讨论 | 2 | 课程目标1 |
| 第二节 内外均衡冲突与政策搭配 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标  1、2 |
| 第三节 固定和浮动汇率制下的宏观经济政策效应 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 3 | 课程目标2、3 |
| 11 | 第十章 汇率制度选择 | 第一节　国际货币体系沿革：固定汇率制和浮动汇率制 | 讲授、课堂讨论 | 1.5 | 课程目标1 |
| 第二节　最适货币区的理论与实践 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 0.5 | 课程目标1、2 |
| 第三节　“美元化”道路 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 0.5 | 课程目标1、2 |
| 第四节　汇率目标区方案 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 0.5 | 课程目标1、2 |
| 12 | 第十一章 国际资本流动与金融稳定 | 第一节　国际资本流动概述 | 讲授、课堂讨论 | 1 | 课程目标1 |
| 第二节　中长期国际资本流动与金融稳定 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 0.5 | 课程目标1、2 |
| 第三节　短期国际资本流动与金融稳定 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 0.5 | 课程目标1、2 |
| 第四节　国际资本流动影响金融稳定的主要机制 | 讲授、课堂讨论 | 0.5 | 课程目标1、2 |
| 第五节　控制国际资本流动的不利影响 | 讲授、课堂讨论 | 0.5 | 课程目标1、2 |
| 12 | 第十二章 金融危机的防范与管理 | 第一节 全球视角下的金融危机概览 | 讲授、课堂讨论 | 1 | 课程目标1 |
| 第二节 金融危机的理论解释 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标1 |
| 第三节 国际经济政策协调和主要协调平台 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标1、3 |

五、课程目标与考核内容

|  |  |
| --- | --- |
| **课程目标** | **考核内容** |
| 课程目标1 | 国际金融学理论知识和方法的理解和掌握情况 |
| 课程目标2 | 运用国际金融学理论知识和方法解决实务问题的能力 |
| 课程目标3 | 国际金融意识和理念，有关国际金融学前沿问题及相关实践的了解情况 |

六、考核方式与评价细则

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **考核方式** | **比例** | **考核/评价细则** |
| 课堂表现 | 15% | 考勤记录和课堂表现情况加分、扣分记录 |
| 平时作业 | 15% | 教师批改的课程作业 |
| 期末考试 | 70% | 笔试，包含选择题、判断题、简答题、业务题等题型，考核基本知识的掌握和运用情况 |