外汇交易实务本科课程教学大纲

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 | 外汇交易实务 | | |
| 英文 | Foreign Exchange Transaction Practice | | |
| 课程代码 | 18823050200 | | 课程性质 | 专业选修课程 |
| 课程学分 | 2 | | 课程学时 | 32 |
| 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 | 金融学、国际金融学、计量经济学 | | | |
| 选用教材 | 刘园，王戈宏. 外汇交易与管理（第二版）. 北京：首都经济贸易大学出版社，2011. | | | |
| 参考书目 | 王梓仲. 外汇交易实务. 北京：北京理工大学出版社，2013.  刘金波. 外汇交易原理与实务. 北京：人民邮电出版社，2018. | | | |
| 推荐教材 | 刘园，王戈宏. 外汇交易与管理（第二版）. 北京：首都经济贸易大学出版社，2011. | | | |

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 | 掌握外汇交易实务相关的基本概念、外汇实务交易的基本业务等 |
| 课程目标2 | 掌握分析外汇交易问题的正确方法，培养解决外汇交易实际问题的能力 |
| 课程目标3 | 树立正确的外汇交易理念，提高学生的交易心理素质和交易纪律 |

**（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外汇市场的信息；熟练运用现代信息管理技术进行国际外汇市场数据的检索、数据处理、模型设计等。  1.2 专业知识。牢固掌握外汇交易的基础知识、基本理论与基本技能；特别是在即期外汇市场、远期外汇市场、掉期外汇市场、期货外汇市场、期权外汇市场和互换外汇市场操作和分析的能力。 |
| 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，适应国际外汇市场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。能够在国际外汇交易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外汇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。在外汇交易中严格遵守宪法、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。熟悉国家有关外汇的方针、政策和法律法规，正确的金融交易理念，提高学生的心理素质和交易纪律。 |

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 外汇交易实务导论 | 1.熟悉汇率决定理论的发展  2.掌握外汇交易实务的主要研究对象  3.了解国内外外汇市场的发展和特点 | 1.汇率决定理论  2.外汇交易实务课程的基本框架和主要内容  3.结合实际阐释学习外汇交易实务的价值和要求 | 1.汇率决定理论  2.引导学生树立这门课程正确的学习观 |
| 2 | 第一章 外汇和外汇市场 | 1.熟悉外汇的概念和种类  2.掌握外汇市场的特点和作用  3.了解世界主要外汇市场的功能与地位，把握我国外汇市场的现有格局和变化趋势。 | 1.外汇相关概念  2.外汇市场的特点和类型  3.国内外主要外汇市场的情况 | 1.外汇动态概念和静态概念的对比  2.国内外不同外汇市场的对比 |
| 3 | 第二章 外汇交易概述 | 1.理解外汇交易的概念  2.掌握外汇交易的基本原理  3.熟悉外汇行情分析和预测的办法 | 1.外汇交易基本内涵  2.外汇交易的规则和程序  3.外汇行情分析与预测 | 1.不同外汇市场的交易规则  2.外汇行情预测方法 |
| 4 | 第三章 外汇基本面分析 | 1.了解汇率基本面分析的含义  2.掌握汇率基本面分析的基本方法  3.熟悉利用数据进行汇率分析判断的一般方法 | 1.外汇基本面分析的基本经济指标  2.主要货币的基本面分析 | 1.各国经济政治体制情况  2.经济数据与外汇汇率之间的关系 |
| 5 | 第四章 外汇技术面分析 | 1.了解汇率技术分析的含义2.理解汇率技术分析的三大前提条件  3.掌握外汇技术分析的基本方法 | 1.技术分析的理论假设  2.K线技术分析  3.技术指标分析  4.经典理论分析 | 1.技术分析与实际走势的应用  2.经典理论的应用 |
| 6 | 第五章 外汇交易心理及技巧 | 1.了解行为金融学理论发展  2.熟悉行为金融学在外汇交易中的应用  3.掌握基本的外汇交易技巧和风险管理方法 | 1.熟悉行为金融学基本内容  2.行为金融学与外汇交易  3.外汇交易技巧与风险管理 | 1.行为金融学在外汇交易中的应用  2.外汇交易技巧 |
| 7 | 第六章 即期外汇交易 | 1.理解即期外汇交易的基本原理  2.掌握汇率的换算方法和技巧  3.运用即期外汇交易进行外汇抛补、套期保值和投机的实际操作 | 1.汇率的换算方法  2.即期外汇交易的操作 | 1.汇率的报价  2.即期外汇交易的各类实际操作 |
| 8 | 第七章 远期外汇交易 | 1.熟悉远期外汇交易的概念和原理  2.理解远期汇率的影响因素和决定依据  3.掌握实际远期外汇交易操作的技巧 | 1.远期外汇交易的分类及作用  2.远期汇率的计算和报价  3.远期外汇交易操作 | 1.远期汇率的决定  2.远期汇率的报价 |
| 9 | 第八章 外汇掉期交易 | 1.了解外汇市场上掉期交易的逻辑原理  2.熟悉掉期汇率的计算方法  3.掌握掉期交易的操作技巧 | 1.掉期交易的类型  2.掉期汇率的计算  3.掉期交易操作 | 1.掉期交易的报价  2.不同掉期汇率计算方法的比较 |
| 10 | 第九章 外汇期货交易 | 1.理解外汇期货交易的含义和特点  2.熟悉外汇期货交易的程序与规则  3.掌握外汇期货交易的操作技巧  4.了解外汇期货交易与远期交易间的异同 | 1.外汇期货交易的特征  2.外汇期货交易的基本规则和程序  3.外汇期货交易的操作 | 1.外汇期货交易保证金运作  2.套期保值与投机的比较 |
| 11 | 第十章 外汇期权交易及互换交易 | 1.熟悉外汇期权交易和互换交易的内在逻辑和特点  2.学会实际操作外汇期权交易、互换交易的方法和技巧 | 1.外汇期权的类型  2.外汇期权交易的规则与操作  3.互换交易的种类 | 1.外汇期权交易盈亏分析与交易策略  2.不同互换交易的利率计算 |
| 12 | 第十一章 外汇管理 | 1.熟悉外汇管理相关的法律法规  2.掌握外汇管理相关领域的措施和手段  3.了解我国外汇管理方式的发展与趋势 | 1.经常项目外汇管理  2.资本项目外汇管理  3.外汇储备管理  4.外汇市场调控管理 | 1.法律条款的理解  2.我国外汇管理的重点和难点 |

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 外汇交易实务导论 | 第一节 外汇和外汇交易概述 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标1、2 |
| 第二节 为什么要学好外汇交易实务 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标2、3 |
| 2 | 第一章 外汇和外汇市场 | 第一节 外汇 | 讲授、课堂讨论 | 1 | 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 |
| 3 | 第二章 外汇交易概述 | 第一节 外汇交易的概念 | 讲授、课堂讨论 | 1 | 课程目标1 |
| 第二节 外汇交易原理 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标  1、2 |
| 第三节 外汇行情分析与预测 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 2 | 课程目标2、3 |
| 4 | 第三章 外汇基本面分析 | 第一节 外汇基本面分析概述 | 讲授、课堂讨论 | 1 | 课程目标1 |
| 第二节 主要货币的基本面分析 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标  1、2 |
| 5 | 第四章 外汇技术面分析 | 第一节 外汇技术分析概述 | 讲授、课堂讨论 | 0.5 | 课程目标1 |
| 第二节 K线与技术指标分析 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标1、2 |
| 第三节 经典理论分析 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 0.5 | 课程目标1、2 |
| 6 | 第五章 外汇交易心理及技巧 | 第一节 行为经济学 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标  1、3 |
| 第二节 外汇交易技巧 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标  2、3 |
| 7 | 第六章 即期外汇交易 | 第一节 即期外汇交易概述 | 讲授、课堂讨论 | 1 | 课程目标1 |
| 第二节 汇率的换算 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 0.5 | 课程目标1、2 |
| 第三节 即期外汇交易的操作 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 0.5 | 课程目标1、2 |
| 8 | 第七章 远期外汇交易 | 第一节 远期外汇交易概述 | 讲授、课堂讨论 | 1 | 课程目标1 |
| 第二节 远期汇率 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 0.5 | 课程目标  1、2 |
| 第三节 远期外汇交易的操作 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 0.5 | 课程目标  1、2 |
| 9 | 第八章 外汇掉期交易 | 第一节 掉期交易概述 | 讲授、课堂讨论 | 1 | 课程目标1 |
| 第二节 掉期汇率的计算 | 讲授、案例分析、案例分析 | 0.5 | 课程目标  1、2 |
| 第三节 掉期交易操作 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 0.5 | 课程目标  1、2 |
| 10 | 第九章 外汇期货交易 | 第一节 外汇期货交易的含义及特点 | 讲授、课堂讨论 | 0.5 | 课程目标1 |
| 第二节 外汇期货交易的程序与规则 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标  1、2 |
| 第三节 外汇期货交易的操作 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标  1、2 |
| 第四节 外汇期货交易与远期外汇交易的比较 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 0.5 | 课程目标1、2 |
| 11 | 第十章 外汇期权交易及互换交易 | 第一节　外汇期权交易 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1.5 | 课程目标  1、2 |
| 第二节　互换交易 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1.5 | 课程目标1、2 |
| 12 | 第十一章 外汇管理 | 第一节　经常项目外汇管理 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标1、3 |
| 第二节　资本项目外汇管理 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标1、3 |
| 第三节　外汇储备管理 | 讲授、课堂讨论、案例分析 | 1 | 课程目标1、3 |
| 第四节　外汇市场调控管理 | 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 | 掌握外汇交易实务理论知识和方法的情况 |
| 课程目标2 | 运用外汇交易实务理论知识和方法解决实务问题的能力 |
| 课程目标3 | 树立正确的外汇交易理念、交易心理和纪律 |

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 | 20% | 考勤记录和课堂表现情况加分、扣分记录 |
| 平时作业 | 20% | 教师布置的课程作业 |
| 期末考察 | 60% | 期末考察，现场提交一份报告，包括对外汇市场近期走势的分析及交易方案的设计。 |