
中国计量学院

2010 ~ 2011 学年 第 2 学期

《外汇模拟交易实习》

—— 指导书

二级学院（部、中心） 经济与管理学院

学 科 （ 专 业 ） 应用经济学

课 程 名 称 外汇模拟交易

授 课 对 象 08 国贸

教 材 名 称 无

2011 年 4 月 18 日

第一章 本课程实验的意义、目的和要求

外汇交易模拟实习是国际经济与贸易专业一个重要的实践性教学环节,通过该实习将可使学生熟悉和了解外汇交易的基本操作程序,从而增强感性认识、巩固和深化已学过的理论、方法,增强发现问题、分析问题和解决问题的能力。通过利用外汇交易模拟软件和互联网技术,构建高仿真的外汇交易环境,使学生在其中亲身体验开放经济环境和信息技术条件下外汇交易的风险和乐趣,提高学生国际金融实际业务的素质和技能。

本实验的目的在于:

1. 通过仿真的环境模拟,巩固课堂教学,深化学生在《国际金融》专业课程中学到的投资和交易的基本程序与方法,使学生初步掌握外汇交易业务的操作流程,把握外汇交易的基本特点与交易常识;

2. 通过上机操作,训练学生实际动手能力,能够学习汇率预测的基本分析方法,提高外汇投资技巧与决策能力;

3. 帮助学生在实验中获取知识,在实践中增长才干,巩固、深化书本、课堂所学的理论业务知识,为学生走向社会提供一个理论结合实际的实验环境,缩短与社会实践的差距,为专业实习乃至将来的工作积累必要的经验。

本实验的基本要求是:

1、具备模拟外汇交易的委托系统及实时行情终端;预先在实训室为学生开户,教师给学生进行操作示范,学生能熟练运用本校外汇交易实训室的模拟外汇交易平台,能独立进行模拟外汇实盘交易和外汇保证金交易。

2、学生初步掌握各种外汇交易业务的操作流程。

第二章 课程实验要求的储备知识

本课程实验要求学生已经学习了金融学的相关专业课程，具备相关知识，如《国际金融》、《证券投资》、《国际结算》、《货币金融学》等，掌握投资的基本概念和交易方法。

具体的储备知识包括：

1. 外汇及汇率的基本知识

外汇和汇率的概念；外币现钞与现汇的区别；汇率的种类及各种汇率的计算方法；世界主要国家的货币符号及特点；世界主要外汇市场

2. 外汇交易的相关知识

即期交易与远期交易的概念和特点；外汇保证金制度的概念和特点；外汇交易的盈亏计算；外汇交易的各种术语及相关解释；外汇保证金交易的基本原理及程序；

3. 外汇交易的技术分析与基本面分析

掌握各种技术指标的含义及分析方法；掌握各种外汇交易基本面的分析方法

第三章 分试验的主要指导内容

实验一 外汇实盘模拟交易入门

实验目的：

- 一、熟悉外汇交易币种、交易汇率类型及有关汇市报价；
- 二、掌握现货外汇交易（实盘交易）的基本流程、分析方法及相关术语；
- 三、能够解读外汇行情、利用分析软件对外汇走势作出合理判断，并顺利实现外汇买卖的即时与委托交易的模拟操作。

实验要求：

- 一、登录世华财讯，用户注册，建立个人资料，选择班级、院系、活动等。
- 二、进入外汇模拟交易界面，如果是简版的直接会进入下单处。
- 三、分析外汇行情，做出买卖外汇的即时交易或委托交易决策并正确进行下单或撤单等操作；

四、实验步骤

登录网站，输入用户名与密码，选择活动即可进入。可进行修改密码和个人资料的更新。

实盘交易即现货外汇交易，是大银行间，以及大银行代理大客户的交易，买卖约定成交后，最迟在两个营业日内完成资金交割。本实验的核心是介绍国内银行面向个人推出的、适于大众投资者参与的个人外汇交易。

个人外汇交易指个人委托银行，参照国际外汇市场实时汇率，把一种外币买卖成另一种外币的交易行为。由于该交易要求投资者必须持有足额的要卖出外币，才能进行交易，较国际上流行的外汇保证金交易，它缺少保证金交易的卖空机制和融资杠杆机制，因此被称为实盘交易。

（二）浮动盈亏

（三）限价汇率

限价汇率是客户在定单中规定的买者愿意买的最高价格或卖者愿意卖的最低价格；

限价定单是按客户确定的价格或履约时间的价格进行外汇合同买卖的定单。

（四）止损汇率

止损定单是指在高于当时市价的某一既定水平停止买进，低于当时市价的某一既定水平停止卖出的指令。相应地，其中所规定的既定水平汇率即为止损汇率。这种定单常用于对冲或形成外汇头寸，最通常的用途是减少亏损。

（五）实盘操作

观察行情，行情有两种分类方式，一种是按名字排序，即点击按币种排序，

或者点击鼠标右键，然后在弹出菜单里面选择要显示的币种；

点击弹出菜单里的自选产品子菜单，可以进行自选产品显示，先选择左边产品列表里面的产品（可以复选），再点击增加按钮，选择好的产品即被添加到右边的已选择产品中，自选产品最多可以显示 8 个，不可以重复选择相同产品。点击确定则自选产品被保存，以后点击自选产品列表即显示。

实验二 外汇保证金交易入门

实验目的：

- 一、熟悉外汇交易币种、交易汇率类型及有关汇市报价；
- 二、掌握外汇保证金的基本流程、分析方法及相关术语；
- 三、能够解读外汇行情、利用分析软件对外汇走势作出合理判断，并顺利实现外汇买卖的即时与委托交易的模拟操作。

实验要求：

- 一、进入世华财讯，用户注册，选择班级、院系、活动等。
- 二、进入外汇模拟交易界面，如果是简版的直接会进入下单处。
- 三、实验步骤：

登录，用户可登录网站，直接从网站进入外汇保证金模拟交易系统进行交易。账户信息，主要展现用户的个人信息，包括：姓名，账户名称，上次登录时间，总浮动盈亏，下单冻结资金，占用保证金，可用保证金，总资产。

委托下单，外汇保证金交易分为即时委托和限价委托两种下单方式。

（一）即时委托是即时下单方式，可以选择产品、交易方式，按照系统提示的委托数量买入符合要求的产品。

即时委托交易方向有开仓或平仓，根据行情价，输入委托手数，点击买入或卖出，进行下单操作，成功后即可按照当前买卖价格立即成交。

（二）限价委托是按照客户设定的委托价格进行交易的下单方式。同时也可以追加获利和追加止损，或两者同时设置。

1. 追加止损交易是客户为了防止损失过多，设定一定的止损价格，当行情价格达到该价位时进行平仓。

客户进入限价委托页面，选择追加止损，并设定止损价格。点击下单后，经过系统验证，止损订单下单成功。

2. 追加获利交易是客户为了获得更多的盈利而设置的盈利价位。当行情达到该价位时进行平仓。

用户进入限价委托页面，选择追加获利，并设定获利价格。点击下单后，经过系统验证，获利订单下单成功。

（三）撤单

用户可在撤单页面撤销在有效期内的未成交委托单。

（四）查询

包括持仓查询、委托查询、成交查询、资金明细等。根据不同需要客户可进行不同的查询功能。

持仓查询供用户查询自己的持仓情况，包括“刷新”、“平仓”、“追加委托”等。

委托查询供用户查询自己的当日委托和历史委托，用户可在委托查询页面通过选择委托状态（包括：全部、未成交、已成交、已撤单、已过期），查看当日和历史的委托情况，历史委托的查询时间段为从开始日期至结束日期。

成交查询供用户查询成交情况。包括当日成交和历史成交。

资金明细供用户查询自己的当日或历史账户的资金明细情况。

此外还有排行榜和广播消息等。

最后对每笔交易记录理由，根据交易记录及交易成绩定期进行分析小结，并最终形成实盘交易模拟部分的实验报告。

第四章 本课程实验的时间安排及考核方法

由于该模拟交易只要下载相关软件，能够上网即可进行，因此，上课时间为一周，其余时间学生可以在宿舍自行上网进行，总的时间长度为三到四周，最后由学生本人上交上份实习报告，详细列出自己模拟交易的成果及体会。

该课程的考核方法为考查，根据学生上交的实习报告，按照五级制的成绩给出成绩。成绩评定时，除参考实习报告写作的质量外，在模拟交易中所得数额居班级前十名的同学有机会评为优秀。