**《从零开始学炒期货》教学大纲**

**一、课程基本信息**

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **课程类别** | 选修课程 | | **课程性质** | 理论 | **课程属性** | 通选 | |
| **课程名称** | 从零开始学炒期货 | | | **课程英文名称** | Introduction of Future Investment | | |
| **课程编码** | FX03TX05C | | | **适用专业** | 金融学,投资学,互联网金融等 | | |
| **考核方式** | 大作业 | | | **先修课程** | 金融学、货币银行学、投资学等 | | |
| **总学时** | 32 | **学分** | | 2 | **理论学时** | | 32 |
| **实验学时/实训学时/ 实践学时/上机学时** | | | | 实训学时、上机学时：0 | | | |

**二、课程简介**

本课程为通选课，主要面向所有对期货投资感兴趣的同学，尤其是金融、投资相关专业的学生。本课程为期货投资入门级，目的是引导同学对期货投资交易有基本的了解和能够进行简单的投资交易。

本课程必须先修课程为金融学、经济学、货币银行学、投资学等经济金融相关专业课程。 课程定位于初级水平，要求学生能了解期货市场主要交易品种，掌握期货投资的基本交易制度。并能够进行基本的期货投资模拟交易实操。

期货投资属于专业技能类课程，应用性较强，强调理论与实际操作并重，着重培养学生运用所学金融理论知识和技术指标进行实际交易的能力。通过本课程的理论基础学习和操作演练，使学生能够掌握期货投资的基本交易制度和基本的投资交易实操应用能力。

**三、课程教学目标**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **课程教学目标** | | **支撑人才培养规格指标点** | **支撑人才培养规格** |
| **知**  **识**  **目**  **标** | **目标1：**   1. 了解期货与现货投资区别 2. 了解期货投资品种特性；   3、了解期货各品种的上下游产业链关系；  4、掌握期货投资的基本交易制度；  5、了解期货投资的基本面分析；  6、掌握期货投资的技术分析； | 5-1：培养拥有宽厚扎实的经济、金融学和投资理论基础，以及基本的期货投资交易应用能力；  6-2：熟练运用现代投资应用软件； | 5.专业知识  6.工具性知识 |
| **能**  **力**  **目**  **标** | **目标2：**  1、能够理解期货投资与现货的优缺点。  2、能够熟练使用期货行情软件进行模拟交易。  3、能够运用技术指标，基本面分析进行期货投资分析； | 9-1：能够在金融投资实践活动中灵活运用所掌握的专业知识；  9-2：能够对各种国内外的金融信息加以甄别、整理和加工，从而为实际期货投资分析提供有用高效信息； | 9.实践应用能力 |
| **素**  **质**  **目**  **标** | **目标3：**  培养学生自主学习的意识，促使学生积极、主动地去探索、去思考，将外在的知识观念转化为其内部的精神财富；培养学生良好的信息素养，把信息技术作为支持终身学习和合作学习的手段；培养学生拥有和保持对新生事物开展探索的兴趣、勇气和精力，并积极和反复试错；特别是培养学生对投资领域的前沿知识、新兴产品的学习能力。 | 3-1：了解国内外期货投资发展动态  3-3：具备良好的职业道德和职业精神  3-4：具有一定的期货投资风险管理意识 | 3.专业素质 |

**四、课程主要教学内容、学时安排及教学策略**

**（一）理论教学**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **教学模块** | **学时** | **主要教学内容与策略** | **学习任务安排** | **支撑课程目标** |
| 模块一：期货市场概述 | 4 | **重点：**期货市场对现货大宗商品的意义、期货品种及特性  **难点：**期货市场与大宗商品现货的区别。  **思政元素：**介绍期货市场存在对大宗商品现货商的意义和必要性。期货市场操纵对社会行业的危害。  **教学方法与策略：**线下教学。主要通过期货市场历史发展时间线索，讲述期货市场来源以及存在的意义。 | 课堂：随堂练习 | 目标1  目标3 |
| 模块二：期货行情软件下载及应用 | 4 | **重点：**期货行情软件下载、及应用  **难点：**期货行情软件应用。  **教学方法与策略：**线下教学。讲解和演示。 | 课前：预习期货基本知识；  课堂：随堂模拟练习软件的下载及应用  课后：用具体的期货品种进行模拟交易 | 目标1  目标2 |
| 模块三：期货基本交易制度 | 4 | **重点：**了解各期货品种合约规则：交易单位、报价单位、最小变动价位、交割标准等；  熟悉期货交易制度；  熟悉期货各品种交割制度；  熟悉期货风险控制制度；  熟悉期货交易风险控制原则；  **难点：**期货交易制度；  期货风险控制制度；  期货交易风险控制原则；  **教学方法与策略：**线下教学。对于期货合约基本制度及交易规则予以讲授；并运用演示法和案例法进行进一步形象解释说明，辅以启发式提问拓宽学生学习思路。 | 课前：预习期货基本交易制度知识  课堂：随堂练习期货交易原则  课后：用具体期货品种做进一步的模拟交易进行知识巩固 | 目标1  目标2 |
| 模块四：期货技术分析方法 | 6 | **重点：**K线，MACD、MA指标  **难点：**K线，MACD、MA指标在期货交易中的应用。  **教学方法与策略：**线下教学。对于K线，MACD、MA指标原理在课堂上予以讲授，对于K线，MACD、MA指标的应用部分安排上机实践。课堂主要运用演示法和案例法开展教学，辅以启发式提问拓宽学生学习思路。 | 课堂：随堂练习掌握K线，MACD、MA指标的应用  课后：用具体期货品种进行模拟交易以加深对课堂知识做进一步的掌握巩固 | 目标1  目标2 |
| 模块五：期货产业链分析方法 | 6 | **重点：**期货各品种产业链上下游分析方法；  **难点：**运用期货品种产业链以及库存，进出口对期货价格的影响；并分析来判断期货品种价格的涨跌。  **教学方法与策略：**线下教学。对于原理在课堂上予以讲授，对于应用部分安排上机实践。课堂运用主要运用演示法和举例说明法开展教学，辅以启发式提问拓宽学生学习思路。 | 课前：预习各期货品种产业链关系；  课堂：随堂练习掌握期货各品种上下游产业链以及库存，进出口对期货价格的影响；  课后：运用基本面分析法分析具体期货品种价格涨跌，并进行模拟交易；以进一步巩固本节知识点； | 目标1  目标2 |
| 模块六：期货套期保值业务 | 4 | **重点：**期货套期保值业务原理；以及套期保值策略应用。  **难点：**套期保值策略应用。  **教学方法与策略：**线下教学。对于原理在课堂上予以讲授，对于期货套期保值业务策略应用部分安排上机实践。课堂运用主要运用演示法和举例说明法开展教学，辅以启发式提问拓宽学生学习思路。 | 课堂：随堂练习掌握期货套期保值策略  课后：应用套期保值策略对具体期货品种进行模拟应用，以进一步巩固本节知识点； | 目标1  目标2 |
| 模块七：期货模拟交易 | 4 | **重点：**综合运用技术分析法和基本面分析法进行模拟交易；  **难点：综合运用**技术分析法和基本面分析的对具体期货品种价格趋势的分析判断。  **教学方法与策略：**线下教学。对于原理在课堂上予以讲授，对于应用过程部分安排上机实践。课堂运用主要运用演示法和举例说明法开展教学，辅以启发式提问拓宽学生学习思路。 | 课堂：随堂练习掌握技术分析和基本面分析在期货交易中的应用；  课后：用多个期货品种进行模拟练习，以进一步巩固本节知识点； | 目标1  目标2 |

**五、学生学习成效评估方式及标准**

考核与评价是对课程教学目标中的知识目标、能力目标和素质目标等进行综合评价。在本课程中，学生的最终成绩是由平时成绩、期末大作业成绩两个部分组成。

1.平时成绩（占总成绩的30%）：采用百分制。平时成绩由平时作业（占10%）和考勤（占10%）和课堂表现（占10%）三个部分组成。评分标准如下表：

|  |  |
| --- | --- |
| **等级** | **评 分 标 准** |
| **1.作业；2.课堂表现 3.考勤** |
| 优秀  （90～100分） | 1.作业书写工整、书面整洁；90％以上的习题解答正确或实验习题结果准确无误。  2.课堂上在探讨问题方面积极发言，善于提出问题，大胆尝试并表达自己的想法及观点。  3.从不迟到、早退、无故旷课。 |
| 良好  （80～89分） | 1.作业书写工整、书面整洁；80％以上的习题解答正确或实验习题结果准确无误。  2.课堂上在探讨问题方面较为主动发言，有提出一定的问题，并能比较有条理地表达自己的想法及观点。  3.早退、无故旷课，迟到次数共少于2次。 |
| 中等  （70～79分） | 1.作业书写较工整、书面较整洁；70％以上的习题解答正确或实验习题结果准确无误。  2.课堂上偶尔对问题的探讨进行发言，提出问题的次数较少，不太踊跃表达自己的想法及观点。  3.早退、无故旷课，迟到次数少于3次。 |
| 及格  （60～69分） | 1.作业书写一般、书面整洁度一般；60％以上的习题解答正确或实验习题结果准确无误。  2.课堂上对问题的探讨发言不积极，极少参与问题的讨论，不敢尝试并表达自己的想法及观点。  3.早退、无故旷课，迟到次数少于5次 |
| 不及格  （60以下） | 1.字迹模糊、卷面书写零乱；超过40％的习题解答不正确或实验习题结果错误。  2.课堂上对问题的探讨发言消极，从不提出问题，不尝试并表达自己的想法及观点。  3.早退、无故旷课，迟到次数超过5次。 |

2.期末考试（占总成绩的70%）：采用百分制。期末报告组成及分值分配情况详见下表：

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **考核**  **模块** | **考核内容** | **支撑目标** | **分值** |
| 期货基础知识 | 期货、套期保值主要概念和原理的理解 | 目标1 | 5 |
| 期货特点 | 目标2 | 5 |
| 期货基本交易规则 | 期货交易时间，交易单位，交割制度； | 目标1 | 10 |
| 期货交易原则； | 目标2 | 10 |
| 期货保证金制度； | 目标3 | 5 |
| 期货技术分析应用 | 经典K线的应用 | 目标1  目标2 | 5 |
| 运用MACD，MA指标分析期货品种走势； | 目标2 | 10 |
| 期货基本面分析应用 | 运用产业链上下游关系分析期货品种涨跌； | 目标1  目标3 | 20 |
| 运用期货品种进出口，库存，特点制定交易策略 | 目标2目标3 | 10 |
| 期货套期保值策略应用 | 运用期货套期保值原理设计期货交易策略 | 目标1  目标2 | 20 |

1. **教学安排及要求**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **序号** | **教学安排事项** | **要 求** |
| 1 | 授课教师 | 职称：讲师 学历（位）：硕士及以上  其他： |
| 2 | 课程时间 | 周次：1-16周  节次：2节/周 |
| 3 | 授课地点 | □教室 实验室 □室外场地  □其他： |
| 4 | 学生辅导 | 线上方式及时间安排：企业微信，一周一次  线下地点及时间安排：授课实验室，上课中 |

**七、选用教材**

刘柯.从零开始学期货投资交易 [M].北京: 中国铁道出版社,2020年6月

**八、参考资料**

[1] 周峰. 从零开始学期货交易策略[M]. 北京: 清华大学出版社,2015年12月

**网络资料**

[1]郑州商品交易所，http://www.czce.com.cn/

大纲执笔人： 陈锦萍

讨论参与人： 赖沛东

系（教研室）主任：赖沛东

学院（部）审核人：赖忠孝