

MỤC LỤC

	Trang
Trang phụ bì	
Lời cam đoan	
Mục lục	
Danh mục các ký hiệu, chữ viết tắt	
Danh mục các bảng, biểu	
Danh mục các hình vẽ, đồ thị	
LỜI MỞ ĐẦU	1
CHƯƠNG 1: LÝ LUẬN TỔNG QUAN VỀ HOẠT ĐỘNG KINH DOANH NGOẠI TỆ CỦA NGÂN HÀNG THƯƠNG MẠI	
1.1. Hoạt động kinh doanh ngoại tệ của Ngân hàng Thương mại.....	4
1.1.1 Sự ra đời và phát triển của hoạt động kinh doanh ngoại tệ.....	4
1.1.2 Chức năng và vai trò của hoạt động kinh doanh ngoại tệ	5
1.1.2.1 Chức năng của hoạt động kinh doanh ngoại tệ	6
1.1.2.2 Vai trò của hoạt động kinh doanh ngoại tệ.....	6
1.1.3 Các yếu tố chính trong hoạt động kinh doanh ngoại tệ	6
1.1.3.1 Thị trường hối đoái.....	6
1.1.3.2 Tỷ giá hối đoái	7
1.1.3.3 Hàng hoá của thị trường hối đoái.....	8
1.1.4 Các đối tượng tham gia trên thị trường hối đoái.....	9
1.1.4.1 Ngân hàng Thương mại.....	9
1.1.4.2 Các nhà môi giới	9
1.1.4.3 Ngân hàng Trung ương.....	9
1.1.4.4 Các công ty, định chế tài chính phi ngân hàng	10
1.1.5 Các nghiệp vụ kinh doanh ngoại tệ trên thị trường hối đoái.....	10
1.1.5.1 Nghiệp vụ giao ngay (Spot)	10

1.1.5.2	Nghiệp vụ kỳ hạn (Forward).....	12
1.1.5.3	Nghiệp vụ hoán đổi ngoại tệ (Swap)	14
1.1.5.4	Nghiệp vụ quyền chọn (Option).....	17
1.1.5.5	Nghiệp vụ tương lai (Future).....	22
1.1.6.6	Nghiệp vụ kinh doanh chênh lệch giá (Arbitrage).....	25
1.2.	Một số vấn đề về nâng cao hiệu quả hoạt động kinh doanh ngoại tệ của Ngân hàng Thương mại.....	27
1.3.	Quản lý rủi ro đối với hoạt động kinh doanh ngoại tệ của Ngân hàng Thương mại.....	28

CHƯƠNG 2: THỰC TRẠNG HOẠT ĐỘNG KINH DOANH NGOẠI TỆ TẠI NGÂN HÀNG TMCP XUẤT NHẬP KHẨU VN

2.1.	Giới thiệu về Ngân hàng TMCP Xuất Nhập Khẩu Việt Nam	32
2.1.1	Quá trình hình thành và phát triển.....	32
2.1.2	Cơ cấu tổ chức.....	34
2.1.3	Các hoạt động kinh doanh chủ yếu của Eximbank.....	35
2.2.	Tình hình hoạt động kinh doanh ngoại tệ tại Ngân hàng TMCP Xuất Nhập Khẩu VN	36
2.2.1	Giới thiệu về Phòng Kinh doanh Tiền tệ Eximbank	36
2.2.2	Thực trạng hoạt động kinh doanh ngoại tệ tại Eximbank	38
2.2.2.1	Phân tích tình hình hoạt động kinh doanh ngoại tệ tại Eximbank...38	
2.2.2.2	Những thuận lợi trong hoạt động kinh doanh ngoại tệ tại Eximbank	46
2.2.2.3	Những khó khăn, tồn tại.....	57

CHƯƠNG 3: MỘT SỐ GIẢI PHÁP NHẪM NÂNG CAO HIỆU QUẢ HOẠT ĐỘNG KDNT TẠI NGÂN HÀNG TMCP XUẤT NHẬP KHẨU VN

3.1.	Mục tiêu và phương hướng cho hoạt động kinh doanh ngoại tệ tại Eximbank trong thời gian tới.....	64
------	--	----

3.2. Một số giải pháp nhằm nâng cao hiệu quả hoạt động kinh doanh ngoại tệ tại Eximbank	64
3.2.1 Đa dạng hoá và hoàn thiện các nghiệp vụ kinh doanh ngoại tệ	65
3.2.2 Mở rộng hoạt động kinh doanh ngoại tệ trên thị trường liên ngân hàng và thị trường quốc tế	68
3.2.3 Tăng cường công tác quản trị hoạt động kinh doanh ngoại tệ	70
3.2.4 Giải pháp về nguồn nhân lực và vốn cho hoạt động kinh doanh ngoại tệ	71
3.2.5 Giải pháp giảm thiểu rủi ro cho hoạt động kinh doanh ngoại tệ	72
3.2.6 Giải pháp về phía khách hàng	75
3.3. Một số kiến nghị với Ngân hàng Nhà nước.....	75
3.4. Một số kiến nghị với khách hàng	80
KẾT LUẬN.....	84
Danh mục tài liệu tham khảo	85
Phụ lục	

DANH MỤC CÁC KÝ HIỆU, CHỮ VIẾT TẮT

Eximbank	Ngân hàng TMCP Xuất Nhập Khẩu Việt Nam
KDNT	Kinh doanh ngoại tệ
NHNN	Ngân hàng Nhà nước
NHNNg	Ngân hàng nước ngoài
NHTM	Ngân hàng Thương mại
TMCP	Thương mại cổ phần
TCTD	Tổ chức Tín dụng
XNK	Xuất Nhập Khẩu
AUD	Dollar Úc
CAD	Dollar Canada
DEM	Mác Đức
EUR	Đồng Euro (đồng tiền chung Châu Âu)
FRF	Franc Pháp
GPB	Bảng Anh
JPY	Yên Nhật
SGD	Dollar Singapore
USD	Dollar Mỹ
VND	Đồng Việt Nam

DANH MỤC CÁC BẢNG, BIỂU

- 2.1 Doanh số mua bán ngoại tệ tại Eximbank.
- 2.2 Doanh số thanh toán quốc tế tại Eximbank.
- 2.3 Doanh số chi trả kiều hối tại Eximbank.
- 2.4 Kết quả hoạt động kinh doanh ngoại tệ tại Eximbank.
- 2.5 Bảng so sánh điểm giao dịch của Eximbank với một số NH TMCP.
- 2.6 Bảng so sánh quy mô vốn của Eximbank với một số NH TMCP.

DANH MỤC CÁC HÌNH VẼ, ĐỒ THỊ

- 1.1 Công thức tính tỷ giá kỳ hạn.
- 1.2 Công thức tính tỷ giá mua kỳ hạn.
- 1.3 Công thức tính tỷ giá bán kỳ hạn.
- 1.4 Công thức tính điểm Swap (Swap point).
- 1.5 Đồ thị biểu diễn vị thế của khách hàng mua quyền chọn mua ngoại tệ.
- 1.6 Đồ thị biểu diễn vị thế của Ngân hàng bán quyền chọn mua ngoại tệ.
- 1.7 Đồ thị biểu diễn vị thế của khách hàng mua quyền chọn bán ngoại tệ.
- 1.8 Đồ thị biểu diễn vị thế của Ngân hàng bán quyền chọn bán ngoại tệ.
- 2.1 Sơ đồ cơ cấu tổ chức của Ngân hàng TMCP Xuất Nhập Khẩu VN.
- 2.2 Đồ thị biểu diễn doanh số mua bán ngoại tệ bằng VND.
- 2.3 Đồ thị biểu diễn doanh số mua bán ngoại tệ chuyển đổi.
- 2.4 Đồ thị biểu diễn doanh số thanh toán quốc tế của Eximbank.
- 2.5 Đồ thị biểu diễn doanh số chi trả kiều hối của Eximbank.
- 2.6 Đồ thị biểu diễn kết quả hoạt động kinh doanh ngoại tệ của Eximbank.
- 2.7 Đồ thị biểu diễn tỷ lệ thu về hoạt động KDNT/tổng thu nhập của Eximbank.