

2008国际商务师考试每日一练：2月2日习题商务师考试 PDF
转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/567/2021_2022_2008_E5_9B_BD_E9_99_85_c29_567806.htm

计算:某外国进口商从法国进口纺织设备，价款共计50万法郎，三个月后付款，该进口商为防止三个月后法郎外汇上涨，在巴黎市场签订以美元购买50万三个月远期法国法郎的合同，合同签订当天的外汇牌价为：即期汇率 3个月远期 1美元兑换法郎 6.556070 360330 请问该进口商3个月后交割时应支付多少美元？解析：计算远期汇率的正确方法是：如果远期价差前小后大，即升水，就用即期汇率加上对应的远期价差；如果是前大后小，即贴水，就用即期汇率减去远期价差。由于本题中3个月远期价差是前大后小，故采取减法。报出的3个月远期和即期汇率的价差表示贴水点数，点数表示万分之一，即小数点后的第四位数。即3个月远期汇率为： $6.5560 - 0.0360 = 6.5200$ $6.5570 - 0.0330 = 6.5240$ 这笔交易对银行来说，就是用法郎买入美元，银行本着低价买进高价卖出的原则，所以使用的3个月远期汇率应是6.5200法郎买进1美元，而不是6.5240法郎买进1美元。所以三个月后出口商支付 $500,000 \div 6.5200 = 76,687.12$ 美元

。"#F8F8F8" 100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问 www.100test.com