

外销员考试：外汇业务复习资料(二)外销员考试 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/646/2021_2022__E5_A4_96_E9_94_80_E5_91_98_E8_c28_646062.htm 导读：远期外汇业务

是指在外汇买卖成交时，双方约定交易的货币、金额、汇率，在将来的某个日期再进行实际交割的一种外汇业务。远期

外汇业务 1、概念 远期外汇业务是指在外汇买卖成交时，双方约定交易的货币、金额、汇率，在将来的某个日期再进行实际交割的一种外汇业务。 2、种类 1)固定外汇交割日的远期

外汇买卖 2)选择外汇交割日的远期外汇买卖 3、作用：可以使企业减少外汇风险.有利于有远期外汇收支的企业核算其进出口商品的成本，确定销售价格，事先计算利润。 4、远期

汇率： 1)概念：指在远期外汇交易中，在未来某一日期进行外汇交割的汇率。 2)远期差价：即期汇率与远期汇率的差额 3)远期汇率与利率的关系： A.远期外汇的升贴水受利率水平所制约 其他条件不变情况下，两种货币之间利息率较高的货币，其远期汇率为贴水.利息率较低的货币，其远期汇率为升水.远期汇率和即期汇率的差异，取决于两种货币的利率差异，并大致和利率差异保持平衡。 例:(97年试题) 根据利息平价学说,利率高的货币其远期汇率一般会呈现() A.升水 B.贴水 C.平价 答案:B B.远期汇率的升水 贴水的具体数字可以从两种货币利率差和即期汇率中计算出来。 升水(贴水)的具体数字=即期汇率 × 两地利率差 × (月数/12) 例如，伦敦市场年利率为10%，纽约市场年利率为7%，伦敦市场利率比纽约市场利率高3%，伦敦市场即期汇率为：1英镑=1.9600美元。求英国某银行3个月远期外汇升水的具体数字: $1.96 \times [(10-7)/100]$

$\times 3/12=0.0146$ 美元=1.46美分 1英镑=1.9600美元-0.0146美元=1.9454美元 C.升水(或贴水)的年率也可以从即期汇率与升水(贴水)的具体数字中推导计算。升水(贴水)具体数字折年率=升水(贴水)具体数字/即期汇率/月数/12 =升水(贴水)具体数字 $\times 12$ /即期汇率 \times 月数 4)远期汇率的标价方法 一般情况下, 汇率在一天内也就是在小数点以后的位数变动, 即变动几十个。表示远期汇率的点数有两栏, 分别代表买入价与卖出价。直接标价法买入价在先, 卖出价在后, 间接标价法则相反。如远期汇率下第一栏点数大于第二栏点数, 其实际远期汇率的计算方法则从相应的即期汇率减去远期的点数, 如远期汇率第一栏点数小于第二栏点数, 其实际远期汇率的计算方法则是在相应的即期汇率上再加上远期的点数。例如:

: 2003年3月29日, 香港外汇市场美元对港元的即期汇率为: 1 美元 = 7.7990/7.8380 港元 1个月远期 52/50 (贴水) 这里, 1个月美元远期汇率出现贴水(因为左边的数字大于右边的数字), 计算远期汇率过程如下: 即期汇率: 7.7990 - 7.8380 一个月远期汇率贴水: - 52 50 ----- 一个月远期实际汇率: 7.7938 7.8330 相关推荐: #0000ff>外销员考试: 外汇业务复习资料(一) #0000ff>2011年外销员考试出口外汇常识汇总 #0000ff>2011年外销员考试名词解释题及答案汇总 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