


中国十大品牌教育集团 中国十佳网络教育机构



- 自考名师全程视频授课，图像、声音、文字同步传输，享受身临其境的教学效果；
- 权威专家在线答疑，提交到答疑板的问题在 24 小时内即可得到满意答复；
- 课件自报名之日起可反复观看，不限时间、地点、次数，直到当期考试结束后一周关闭；
- 付费学员赠送 1G 超大容量电子信箱；及时、全面、权威的自考资讯全天 24 小时滚动更新；
- 一次性付费满 300 元，即可享受九折优惠；累计实际交费金额 500 元或支付 80 元会员费，可成为银卡会员，购课享受八折优惠；累计实际交费金额 1000 元或支付 200 元会员费，可成为金卡会员，购课享受七折优惠（以上须在同一学员代码下）；

英语/高等数学预备班：英语从英文字母发音、国际音标、基本语法、常用词汇、阅读、写作等角度开展教学；数学针对有高中入学水平的数学基础的同学开设。通过知识点精讲、经典例题详解、在线模拟测验，有针对性而快速的提高考生数学水平。[立即报名！](#)

基础学习班：依据全新考试教材和大纲，由辅导老师对教材及考试中所涉及的知识进行全面、系统讲解，使考生从整体上把握该学科的体系，准确把握考试的重点、难点、考点所在，为顺利通过考试做好知识上、技巧上的准备。[立即报名！](#)

真题串讲班：教育部考试中心已经启动了自考的国家题库建设，熟练掌握自考历年真题成为顺利通过考试的保障之一。自考 365 网校与权威自考辅导专家合作，推出真题串讲班网上辅导课程。通过对课程的整体情况分析及近 3 次考试的真题讲解，全面梳理考试中经常出现的知识点，并对重点难点问题配合典型例题扩展讲解。串讲班课程在考前一个月左右开通。[立即报名！](#)

习题班：自考 365 网校与北大燕园合作推出，每门课程均涵盖该课程全部考点、难点，在线测试系统按照考试难度要求自动组卷、全程在线测试、提交后自动判定成绩。我们相信经过反复练习定能使您迅速提升应试能力，使您考试梦想成真！[立即报名！](#)

自考实验班：针对高难科目开设，签协议，不及格退还学费。全国限量招生，报名咨询 010-82335555 [立即报名！](#)

浙江省 2009 年 1 月高等教育自学考试 国际金融实务试题 课程代码：02636

一、单项选择题（本大题共 15 小题，每小题 2 分，共 30 分）

在每小题列出的四个备选项中只有一个是符合题目要求的，请将其代码填写在题后的括号内。错选、多选或未选均无分。

1. 国际标准 ISO-4217 货币代码中加拿大元的标准写法为（ ）

- A. AUD
- B. CAD
- C. Funds
- D. CHF

2. 对外汇行情起承上启下作用的外汇市场是（ ）

- A. 东京市场
- B. 纽约市场
- C. 悉尼市场
- D. 惠灵顿市场

3. 大部分即期外汇买卖采用的交割日类型为（ ）

- A. 标准交割日
- B. 隔日交割日
- C. 选择交割日
- D. 固定交割日

4. 外汇交易中，投机者先卖后买，并且在抛售外汇时，实际上手中并无外汇，这种投机活动被称为（ ）

- A. 空头
- B. 多头
- C. 买空
- D. 卖空

- 5.套汇交易所采用的汇率是（ ）
- A.信汇汇率 B.票汇汇率
C.电汇汇率 D.行汇汇率
- 6.建设工程企业融资比较适合互换类型是（ ）
- A.固定型互换 B.增长型互换
C.减弱型互换 D.起伏型互换
- 7.镜像互换期权指的是（ ）
- A.固定利率方有权延展合约有效期 B.固定利率支付方有权取消互换
C.固定利率方有权缩短合约有效期 D.固定利率接受方有权取消互换
- 8.标志着金融期货进入交易市场的时间为（ ）
- A.1865 年 B.1972 年
C.1975 年 D.1982 年
- 9.整日以极微小的价差买进或卖出，赚取一两个刻度的交易者被称为（ ）
- A.抢帽子者 B.日交易者
C.基差交易者 D.价差交易者
- 10.下列属于中长期债券期货合约的是（ ）
- A.短期国库券期货合约 B.欧洲美元期货合约
C.政府国民抵押协会证券期货合约 D.定期存单期货合约
- 11.在到期日前任何一天都可以行使的期权是（ ）
- A.欧式期权 B.美式期权
C.看涨期权 D.看跌期权
- 12.表示交割日市场上到期日汇率与当日的汇差之 SAFEBBA 词汇是（ ）
- A.OER B.SSR
C.SFS D.CFS
- 13.经济主体对资产负债表进行会计处理中，在将功能货币转换成记账货币时，因汇率变动而呈现账面损失的外汇风险称为（ ）
- A.经济风险 B.经营风险
C.会计风险 D.交易风险
- 14.欧洲货币市场是（ ）
- A.经营欧洲货币单位的国家金融市场 B.经营欧洲国家货币的国际金融市场
C.欧洲国家国际金融市场的总称 D.经营境外货币的国际金融市场
- 15.跟单托收中的 D/A 指的是（ ）
- A.信托收据 B.承兑交单
C.承兑汇票贴现 D.远期付款交单

二、多项选择题（本大题共 5 小题，每小题 3 分，共 15 分）

在每小题列出的五个备选项中至少有两个是符合题目要求的，请将其代码填写在题后的括号内。错选、多选、少选或未选均无分。

1. 外汇交易员通过路透社资讯系统在终端机上可获得的信息包括（ ）

- A. 市场趋势
- B. 技术图表分析
- C. 叙做外汇买卖
- D. 即时汇率行情
- E. 即时信息

2. 远期外汇价格的决定因素有（ ）

- A. 即期汇率价格
- B. 买入货币与卖出货币间的利率差
- C. 远期期限的长短
- D. 买入货币与卖出货币间的汇率差
- E. 交割时间

3. 以下属于《利率和货币互换协议》主要条款的有（ ）

- A. 交易日
- B. 合同货币
- C. 利率
- D. 费用
- E. 清算账户

4. 反映期货市场流动性和深度的指标有（ ）

- A. 交易价格
- B. 交易日
- C. 交易量
- D. 交割日
- E. 未平仓量

5. 金融风险的计量一般包括（ ）

- A. 故障树法
- B. 蒙特卡罗模拟法
- C. 德尔菲法
- D. 决策树法
- E. 模型测试法

三、判断分析题（本大题共 5 小题，每小题 3 分，共 15 分）

判断下列各题，正确的在题后括号内打“√”，错的打“×”并简述理由。

1. 利率互换是交易双方在不同期限内，交换币种一致、名义本金相同，但付息方式不同的一系列现金流的金融交易。

（ ）

2. 到价单表示顾客限定场内经纪人必须以特定价格或比特定价格更有利的价格买卖期货合约。（ ）

3. 开放订单只能在交易场内出价 3 次，若未成交，则取消委托。（ ）

4. FRA 中的“2×5”是指交易日和即期日之间为二天，交易日至结算日之间的时间为 5 个月。（ ）

5. 外汇风险是指由于汇率波动而使以外币计值的资产、负债、盈利或预期未来现金流量的本币价值发生变动而给外汇交易主体带来的损失。（ ）

四、计算题（本大题共 2 小题，每小题 4 分，共 8 分）

1. 已知即期汇率：EUR/HKD=11.7120/30

掉期率：Spot/1Month 10/20

Spot/2Month 25/40

计算银行报出 1 个月至 2 个月的任选交割日的远期汇率。

2. 已知某一日同一时刻：

伦敦市场汇价 GBP/HKD=15.0685/98

香港市场汇价 GBP/HKD=15.0453/73

计算：以 1000 万港元进行套汇，将能获得多少毛利？

五、名词解释（本大题共 3 小题，每小题 3 分，共 9 分）

1. 远期对远期掉期交易

2. 时间套汇

3. 择期交易

六、简答题（本大题共 2 小题，每小题 5 分，共 10 分）

1. 试简述投机商的含义及其主要表现。

2. 试简述外汇期货与外汇远期的区别。

七、案例分析题（本大题共 13 分）

某美国公司预计 6 月上旬将有 100 万德国马克收入，为防止马克汇率下跌而蒙受损失，4 月 2 日公司买入 8 份 6 月到期的马克看跌期权（欧式期权），协定汇率为 1 马克=0.6440 美元，期权费为 1 马克=0.0003 美元。

问：

若到期日马克即期汇率为 1 美元=1.5408/32 马克或 1 美元=1.5576/96 马克，哪种情况下该公司将执行期权？分别计算两种情况下公司的美元收入。