



c/ Hãy niêm yết tỷ giá mua vào bán ra của N
mua bán trực tiếp với nhau tại tỷ giá 1AUD :
phí 0,05% trị giá giao dịch đối với người mu

Câu 2 : Một công ty NK ký một hợp đồng kỳ
USD tại TG kỳ hạn 16.478 USD/VND. Còn
mới đến hạn nhưng hôm nay công ty đã cần
tiền hàng NK. Hỏi có những PA nào nhà NK
Biết các thông số thị trường hiện hành như
- Tỷ giá giao ngay USD/VND = 16469 – 164
- Tỷ giá hoán đổi 1 tháng = 10 – 13
- Mức lãi suất 1 tháng của VND 10,68 – 10,1
- Mức lãi suất 1 tháng của USD : 8,82 – 8,91

Câu 3 :

Một nhà XK Úc cân nhắc sử dụng hợp đồng
đồng quyền chọn bán để phòng ngừa rủi ro
là 100.000 USD thời hạn 9 tháng. Các thông

- TG KH 9 tháng : F (AUD/USD) = 0,7667
- TG quyền chọn 9 tháng (AUD/USD) 0,767
- Phí quyền chọn 241 AUD
- Mức lãi suất của USD 5,25%/năm
- Mức lãi suất của VND 4,75%/năm

Câu hỏi

a/ Vẽ đồ thị tuyến thu nhập từ bán 100.000
b/ Vẽ đồ thị tuyến lãi lỗ của hợp đồng kỳ hạn
c/ Vẽ đồ thị tuyến thu nhập từ bán 100.000
chọn
d/ Vẽ đồ thị tuyến lãi lỗ của hợp đồng quyền