

CLASSE 5

Prof. GABRIELE BONACCI - distinta di negoziazione ¥

Il listino che appare nella mattinata sui terminali della banca presenta questi cambi.

Nome	Bid	Ask
Corona Ceca	24,94780	25,01260
Corona Danese	7,44970	7,45070
Corona Islandese	100,80000	101,12000
Corona Norvegese	7,87000	7,87660
Corona Svedese	9,36240	9,36740
Dollaro Australiano	1,64360	1,64460
Dollaro Canadese	1,51270	1,51350
Dollaro Usa	1,52140	1,52170
F. Svizzero	1,57640	1,57660
Sterlina Britannica	0,76680	0,76710
Yen Giapponese	156,83000	156,87000

Sulla base di queste indicazioni avvengono le operazioni che seguono:

In data 1 marzo la Ditta Toscano di Pieve S. Stefano ha negoziato con la locale agenzia del Monte dei Paschi di Siena le seguenti divise estere:

- GBP 16.000 al 15/5 su Wintrew di Londra
- GBP 2.000 a tre mesi data (emessa il 3/2) su Mose di Eastbourne
- GBP 7.000 a 60 giorni vista su Jannot di Edimburgo

Determinare il netto ricavo in EURO e presentare la distinta di negoziazione sapendo che la Banca applica le seguenti condizioni:

- cambi considerando uno spread di 5 centesimi
- tasso 7% giorni viaggio 30 sulle divise britanniche
- commissione valutaria 4,5‰ con un massimo di € 120
- oneri e spese forfetarie € 2,00 a divisa.

Il signor Rossi di Milano di ritorno da un viaggio all'estero, provvede a cambiare la seguente valuta estera:

- dollari americani 3.000 in banconote
- franchi svizzeri 5.000 in traveller's chèque.

La banca gli applica le seguenti condizioni:

- cambio banconote -----> spread 8 centesimi
- cambio chèque considerando un tasso del 6% e 35 giorni viaggio
- spese addebitate € 5 complessivamente

Determinare il controvalore in € della valuta straniera venduta.

Determinare se i due seguenti operatori italiani hanno avuto un utile o una perdita dovuta alla volatilità dei cambi (e di quanto) sapendo che al momento in cui era stato stipulato il contratto, la tabella dei cambi era: **EUR/USD 1,295/1,3410 - EUR/CAD 1,4742/1,4968** (fare riferimento alla tabella dei cambi in cima alla pagina)

- esportatore che deve incassare 50.000 dollari americani
- importatore che deve pagare 25.000 dollari canadesi

CLASSE 5

Prof. GABRIELE BONACCI - distinta di negoziazione §

Il listino che appare nella mattinata sui terminali della banca presenta questi cambi.

Nome	Bid	Ask
Corona Ceca	24,94780	25,01260
Corona Danese	7,44970	7,45070
Corona Islandese	100,80000	101,12000
Corona Norvegese	7,87000	7,87660
Corona Svedese	9,36240	9,36740
Dollaro Australiano	1,64360	1,64460
Dollaro Canadese	1,51270	1,51350
Dollaro Usa	1,52140	1,52170
F. Svizzero	1,57640	1,57660
Sterlina Britannica	0,76680	0,76710
Yen Giapponese	156,83000	156,87000

Sulla base di queste indicazioni avvengono le operazioni che seguono:

In data 1 marzo la Ditta Toscano di Pieve S. Stefano ha negoziato con la locale agenzia del Monte dei Paschi di Siena le seguenti divise estere:

- AUD 16.000 al 15/5 su Wintrew di Londra
- AUD 2.000 a tre mesi data (emessa il 3/2) su Mose di Eastbourne
- AUD 7.000 a 60 giorni vista su Jannot di Edimburgo

Determinare il netto ricavo in EURO e presentare la distinta di negoziazione sapendo che la Banca applica le seguenti condizioni:

- cambi considerando uno spread di 6 centesimi
- tasso 8% giorni viaggio 35 sulle divise extraeuropee
- commissione valutaria 4,5‰ con un massimo di € 120
- oneri e spese forfetarie € 2,00 a divisa.

Il signor Bianchi di Modena di ritorno da un viaggio all'estero, provvede a cambiare la seguente valuta estera:

- franchi svizzeri 3.000 in banconote
- dollari americani 5.000 in traveller's chèque.

La banca gli applica le seguenti condizioni:

- cambio banconote -----> spread 8 centesimi
- cambio chèque considerando un tasso del 6% e 35 giorni viaggio
- spese addebitate € 5 complessivamente

Determinare il controvalore in € della valuta straniera venduta.

Determinare se i due seguenti operatori italiani hanno avuto un utile o una perdita dovuta alla volatilità dei cambi (e di quanto) sapendo che al momento in cui era stato stipulato il contratto, la tabella dei cambi era: **EUR/USD 1,295/1,3410 - EUR/CAD 1,4742/1,4968** mentre quella odierna è quella situata in cima alla pagina)

- importatore che deve pagare 50.000 dollari canadesi
- esportatore che deve incassare 25.000 dollari americani