**التمرين الأول:** إذا كانت أسعار العملات الأجنبية المعلنة لشراء وبيع العملات التالية كما يلي:

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | **Offer** | **Bid** |  |
| **EUR** | **1.3456** | **1.3371** | **USD** |
| **GBP** | **1.9306** | **1.9213** | **USD** |
| **USD** | **1.1608** | **1.1521** | **CHF** |
| **USD** | **104.33** | **103.71** | **JPY** |
| **USD** | **1.2711** | **1.2690** | **AUD** |
| **USD** | **1.2544** | **1.2508** | **CAD** |
| **USD** | **5.7096** | **5.6349** | **DKK** |
| **USD** | **7.0099** | **7.8932** | **SEK** |

**المطلوب:** 1**-**كبنك مصدر للنشرة بأي سعر تشتري اليورو مقابل الدولار الأمريكي.

2- كعميل بأي سعر تشتري اليورو مقابل الدولار الأمريكي.

3- كبنك مصدر للنشرة بأي سعر تبيع اليورو مقابل الدولار الأمريكي.

4-كعميل بأي سعر تبيع اليورو مقابل الدولار الأمريكي.

5- كبنك مصدر للنشرة بأي سعر تشتري الجنيه الإسترليني مقابل الدولار الأمريكي.

6- كعميل بأي سعر تبيع الجنيه الإسترليني مقابل الدولار الأمريكي.

7- كعميل بأي سعر تشتري الجنيه الإسترليني مقابل الدولار الأمريكي.

8- كبنك محلي مراسل للبنك الأجنبي بأي سعر تشتري الفرنك السويسري مقابل الدولار الأمريكي.

9- كبنك مصدر للنشرة بأي سعر تشتري الفرنك السويسري مقابل الدولار الأمريكي.

**التمرين الثاني :** إذا كانت لديك الأسعار التالية المعطاة على طريقة التسعير الأوروبية:

offer bid

$ 1.1560 1.1520 CHF

$ 1.2690 1.2650 AUD

المطلوب: أحسب اتجاهي التقاطع لما يلي:

1- CHF/AUD للعميل.

2- AUD/CHF للعميل.

**التمرين الثالث:** إذا كانت أسعار العملات الأجنبية في السوق كما يلي:

SPOT FORWARD (3)MONTHS

SEK 6.8910-80 $ 150-160

DKK 5.6340-90 $ 180-170

JPY 103.21-91 $ 90-80

**المطلوب:** أحسب الأسعار الآجلة لكل من:

1-الكرونا السويدي مقابل الدولار الأمريكي لثلاثة أشهر.

2- الكرونر الدانماركي مقابل الدولار الأمريكي لثلاثة أشهر.

3-الين الياباني مقابل الدولار الأمريكي لثلاثة أشهر.

**التمرين الرابع:** إذا كان لدى أحد المستثمرين الامريكيين مبلغ مليون دولار أمريكي يرغب في استثماره لمدة عام وكانت أسعار الفائدة على الدولار الأمريكي 1% سنويا في حين أسعار الفائدة على الكرونا السويدي3.5% وإذا كان السعر الآني للكرونا السويدي مقابل الدولار الأمريكي6.8930 كورنا سويدي لكل دولار أمريكي.

**المطلوب:** بأي عملة يستثمر هذا الأمريكي المبلغ الفائض عن حاجته بالدولار الأمريكي أو بالكرونا السويدي.إذا كان السعر الآجل للكرونا السويدي مقابل الدولار الأمريكي7.0636 كورنا سويدي لكل دولار أمريكي.

**التمرين الخامس:** إذا كانت أسعار العملات الأجنبية المعروضة في الأسواق التالية كما يلي:

offer bid

$ 1.1540 1.1520 CHF MARKET (1)

EUR 1.5420 1.5400 CHF MARKET (2)

EUR 1.3390 1.3370 $ MARKET (3)

إذا كانت العميل يرغب في بيع مليون CHF مقابل شراء EUR

**المطلوب:**

1-إلى أي الأسواق يذهب العميل ولماذا؟

2-هل هناك فرصة للعميل لتحقيق اربتراج عملات من هذه الأسواق وكيف؟