

אגח ONL

פרק 4 - ממשלתיות לא צמודות

תוכן העניינים

1. כללי 1

ממשלתיות לא צמודות:

שאלות:

- (1) איגרת חוב לארבע שנים נסחרת במחיר של 105 ומחלקת ריבית שנתית של 3%. מהי התשואה השנתית ברוטו לפדיון?

 - א. 1.50%
 - ב. 1.60%
 - ג. 1.40%
 - ד. אין תשובה נכונה.
 - ה. 1.70%
- (2) נתונה איגרת חוב שקלית עם טווח לפדיון של 4 שנים. האיגרת מחלקת קופון של 4% ונסחרת בתשואה של 1.1%. מהו מחיר האיגרת בשוק?

 - א. 115.5
 - ב. 106.5
 - ג. 102.1
 - ד. אין תשובה נכונה.
 - ה. 111.29
- (3) נתונה איגרת חוב שקלית לארבע שנים המחלקת קופון שנתי של 3%. רשום בטבלת התשובות מה יהיה מחיר האיגרת כשהתשואה הנדרשת על ידי המשקיעים עומדת על 4% ועל 6% בהתאמה.
- (4) נתונה איגרת חוב שקלית ל-10 שנים המחלקת קופון שנתי של 4% ותשלם את הקרן בתום התקופה בתשלום אחד. חשב מחיר האיגרת כשהתשואה הנדרשת על ידי המשקיעים עומדת על 4% ועל 6% בהתאמה כעת, שנה לפי הקופון הראשון.
- (5) אג"ח לא צמודה לשנתיים משלמת ריבית שנתית של 6% המשולמת כל חצי שנה. האג"ח נסחרת בתשואה שנתית לפדיון של 2%. מהו מחיר האיגרת בשוק?

 - א. אף תשובה אינה נכונה.
 - ב. 103.05
 - ג. 107.82
 - ד. 102.07
 - ה. 101.68

6) אג"ח לא צמודה לשנתיים משלמת ריבית שנתית של 8% המשולמת כל חצי שנה. האג"ח נסחרת בתשואה שנתית לפדיון של 3.75%. מהו שער האיגרת?

א. 106.21.

ב. 108.18.

ג. 99.09.

ד. אף תשובה אינה נכונה.

ה. 108.04.

7) אג"ח לא צמודה ל-2 שנים משלמת ריבית שנתית של 5% המחולקת אחת לרבעון. שער האיגרת בשוק 106.2. מהי התשואה השנתית לפדיון?

א. 0.459%.

ב. 1.815%.

ג. 1.848%.

ד. 0.437%.

ה. 1.758%.

8) אג"ח לא צמודה ל-3 שנים משלמת ריבית רבעונית של 0.75%. האג"ח נסחרת בתשואה שנתית לפדיון של 3%. מהו שער האיגרת?

א. 100.11.

ב. 101.21.

ג. 100.18.

ד. 100.63.

ה. 99.99.

תשובות סופיות:

(1) ה.

(2) ה

(3) 89.6 : 6% , 90.3 : 4%

(4) 85.2 : 6% , 100 : 4%

(5) ג'.

(6) ב'.

(7) ג'.

(8) א'.