היבטים פיננסיים בניהול

פרק 3 - 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) 4% : 90.3 , 6% : 89.6.
4) 4% : 100 , 6% : 85.2.
5) ג'.
6) ב'.
7) ג'.
8) א'.