

אגח ONL

פרק 9 - מקדם תשואה

תוכן העניינים

1. כללי.....1

מקדם תשואה:

שאלות:

(1) מהי הטענה הנכונה ביותר:

- א. מקדם התשואה של המק"מ תמיד שווה ל-1.
- ב. מקדם התשואה של המק"מ תמיד גדול מ-1.
- ג. מקדם תשואת המק"מ תמיד קטן מ-1.
- ד. מקדם תשואת המק"מ קטן או שווה ל-1.
- ה. מקדם תשואת המק"מ תמיד גדול או שווה ל-1.

(2) מהי הטענה הנכונה ביותר?

- א. הקטנת גובה הקופון מגדילה את מקדם התשואה.
- ב. הקטנת התשואה לפדיון מגדילה את מקדם התשואה.
- ג. הקטנת תדירות חלוקת הקופונים מגדילה את מקדם התשואה.
- ד. הקטנת טווח לפדיון מגדילה את מקדם התשואה.
- ה. ככל שהמח"מ קצר יותר כך קטן מקדם התשואה.

(3) מהי הטענה הנכונה ביותר?

- א. הקטנת תדירות חלוקת הקופונים מגדילה את מקדם התשואה.
- ב. הקטנת טווח לפדיון מקטינה את מקדם התשואה.
- ג. הקטנת התשואה לפדיון מקטינה את מקדם התשואה.
- ד. הקטנת גובה הקופון מגדילה את מקדם התשואה.
- ה. אף תשובה אינה נכונה.

(4) מהי הטענה הנכונה ביותר?

- א. גודלו של מקדם התשואה ביחס הפוך לטווח לפדיון ומח"מ האיגרת.
- ב. גודלו של מקדם התשואה ביחס ישר לאורך המח"מ וקופון האג"ח.
- ג. גודלו של מקדם התשואה ביחס הפוך לאורכו של המח"מ ותשואת האג"ח.
- ד. גודלו של מקדם התשואה ביחס ישר לגובה תדירות חלוקת הקופונים והטווח לפדיון של האג"ח.
- ה. גודלו של מקדם התשואה ביחס ישר לגובה תדירות חלוקת הקופונים והמח"מ של האג"ח.

- 5) בבורסה נסחרת אג"ח שקלית לחמש שנים של חברת "דנאל" בשער של 114.5. האג"ח נושאת ריבית שנתית נקובה של 7.5%. מהו מקדם התשואה של האיגרת?

תשובות סופיות:

- 1) ה.
- 2) ד.
- 3) ג.
- 4) א.
- 5) 0.22.