

Możesz obejrzyć ten test, ale gdyby to była prawdziwa próba, zostałbyś zablokowany, ponieważ:

Quiz nie jest dostępny

Pytanie **1**

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty: 2,00

Bank A oferuje lokatę z kapitalizacją ciągłą wg stopy procentowej $r_A=8\%$, a bank B lokatę z kapitalizacją prostą wg stopy procentowej r_B . Warunki oprocentowania w obu bankach są równoważne, a inflacja wynosi 3% w skali roku. Ile wynosi różnicą między realną efektywną stopą procentową w banku A, a realną efektywną stopą procentową w banku B?

Odpowiedź:

Pytanie **2**

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty: 2,00

Dane są dwa walory z parametrami $\sigma_1 = 0,2$, $\rho = 0,5$. Dla jakiego σ_2 portfel o minimalnej wariancji nie wymaga krótkiej sprzedaży?

Odpowiedź: od

do

Pytanie **3**

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty: 2,00

Trzyletnia obligacja o nominale 100 zł kosztuje 97 zł i wypłaca coroczny kupon w wysokości 67zł. Ile wynosi jej stopa YTM?

Odpowiedź:

Pytanie **4**

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty: 2,00

Stopa procentowa wynosi 8% w skali roku. Przez 40 lat na końcu początku roku (czyli w momentach $t=0, 1, \dots, 39$) wpłacamy do banku pewną kwotę. Chcemy po 40 latach (czyli w chwili $t=40$) uzyskać kwotę 1 miliona złotych. Ile powinna wynosić pierwsza wpłata jeśli co roku możemy ją powiększać o 6%?

Odpowiedź:

Pytanie **5**

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty: 2,00

Dane są dwie obligacje o nominatach równych 100 zł: jednoroczna o cenie 98 zł i płaconym po roku kuponie równym 2 zł oraz dwuletnia o cenie 96 zł i płaconych po każdym roku kuponach równych 2 zł. Ile wynosi (w ujęciu rocznym) dwuletnia stopa spot?

Odpowiedź:

Pytanie **6**

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty: 2,00

Bank A oferuje lokatę z kapitalizacją 3 razy w roku z góry wg stopy procentowej $r_A = 16\%$, a bank B lokatę z kapitalizacją 3 razy w roku z dołu wg stopy procentowej r_B . Ile wynosi r_B jeśli warunki oprocentowania są w skali roku równoważne?

Odpowiedź:

Pytanie **7**

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty: 2,00

Cena bonu rocznego o nominale 1 zł wynosi 0,97 zł, a trzyletniego o tym samym nominale 0,91 zł. Ile wynosi (w ujęciu rocznym) stopa forward na okres od 1 do 3 roku przy zastosowaniu modelu kapitalizacji prostej?

Odpowiedź:

Pytanie **8**

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty: 2,00

Ile wynosi stopa par dla dwuletniej obligacji płaćcej kupon raz w roku, jeśli roczna stopa spot wynosi 6%, a dwuletnia 4%?

Odpowiedź:

Pytanie **9**

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty: 2,00

Dane są dwa walory z parametrami $\mu_1 = 14\%$, $\sigma_1 = 0,1$, $\mu_2 = 19\%$, $\sigma_2 = 0,3$, $\rho = -0,7$. Ile wynosi (w procentach) wartość oczekiwana portfela o minimalnej wariancji?

Odpowiedź:

Pytanie **10**

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty: 2,00

Pewną kwotę ulokowano na trzy lata na lokacie z odsetkami dopisywanymi co pół roku (z dołu). Przez pierwsze 2 półrocza oprocentowanie wynosiło 7% w skali roku, a w następnych było o 1 punkt procentowy niższe. Przy jakim stałym oprocentowaniu przy tej samej kapitalizacji posiadana na koniec lokaty kwota byłaby identyczna?

Odpowiedź: