

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

Test nie jest dostępny

Pytanie 1

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty maks.: 1,00

Inwestycja w kolejnych latach generuje następujące przepływy: -1000, 0, 300, 1300. Ile wynosi jest NPV jeśli stopa procentowa wynosi 8%?

Odpowiedź:

Pytanie 2

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty maks.: 1,00

Trzyletnia obligacja o nominale 100 zł kosztuje 98 zł i wypłaca coroczny kupon w wysokości 7 zł. Ile wynosi jej stopa YTM?

Odpowiedź:

Pytanie 3

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty maks.: 1,00

Ile wynosi stopa par dla dwuletniej obligacji płaćcej kupon raz w roku, jeśli roczna stopa spot wynosi 6%, a dwuletnia 8%?

Odpowiedź:

Pytanie 4

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty maks.: 1,00

Cena bonu rocznego o nominale 1 zł wynosi 0,97 zł, a trzyletniego o tym samym nominale 0,93 zł. Ile wynosi (w ujęciu rocznym) stopa forward na okres od 1 do 3 roku przy zastosowaniu modelu kapitalizacji z góry co 1/3 roku?

Odpowiedź:

Pytanie 5

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty maks.: 1,00

Bank A oferuje lokatę z kapitalizacją 3 razy w roku z góry wg stopy procentowej $r_A = 10\%$, 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 6

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty maks.: 1,00

Pewną kwotę ulokowano na rok na lokacie z odsetkami dopisywanymi co miesiąc (z dołu). Przez pierwsze 3 miesiące oprocentowanie wynosiło 6% w skali roku, a w następnych było o 2 punkty procentowe niższe. Przy jakim stałym oprocentowaniu w tej samej kapitalizacji posiadana na koniec lokaty kwota byłaby identyczna?

Odpowiedź:

Pytanie 7

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty maks.: 1,00

Stopa procentowa wynosi 9% w skali roku. Przez 40 lat na początku każdego 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 9%?

Odpowiedź:

Pytanie 8

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty maks.: 1,00

Cena bonu rocznego o nominale 1 zł wynosi 0,95 zł, a trzyletniego o tym samym nominale 0,94 zł. Ile wynosi (w ujęciu rocznym) stopa forward na okres od 1 do 3 roku przy zastosowaniu modelu kapitalizacji z dołu co 1/3 roku?

Odpowiedź:

Pytanie 9

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty maks.: 1,00

Stopa procentowa wynosi 9% w skali roku. Przez 40 lat na początku każdego 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 wszystkie mają być w tej samej wysokości?

Odpowiedź:

Pytanie 10

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty maks.: 1,00

Bank A oferuje lokatę z kapitalizacją prostą wg stopy procentowej $r_A=9\%$, a bank B lokatę z kapitalizacją ciągłą wg stopy procentowej r_B . Warunki oprocentowania w obu bankach są równoważne, a inflacja wynosi 6% w skali roku. Ile wynosi różnica między realną efektywną stopą procentową w banku A, a realną efektywną stopą procentową w banku B?

Odpowiedź:

Pytanie 11

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty maks.: 1,00

Dane są dwie obligacje o nominałach równych 100 zł: jednoroczna o cenie 98 zł i płaconym po roku kuponie równym 4 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 12

Nie udzielono odpowiedzi

Punkty maks.: 1,00

Firma Z jest zainteresowana kredytem o zmiennej stopie procentowej. Bank A oferuje jej kredyt o zmiennej stopie WIBOR+5% lub o stałej 7%. Firma S jest zainteresowana kredytem o stałej stopie procentowej. Bank B oferuje jej kredyt o zmiennej stopie WIBOR+4% lub o stałej 9%. Firmy te decydują się zawrzeć między sobą kontrakt swap. Według jakiej stopy procentowej powinna firma S płacić firmie Z jeśli:

- firma Z płaci firmie S stopę WIBOR+0,5% oraz
- obie firmy powinny po równo skorzystać na poczynionych w ten sposób oszczędnościach?

Odpowiedź: