

Finansal İktisat Alıştırma Soruları 2

- 1) Aylık nominal faiz oranı 0.04 olan bir yatırım 5 yıl sonra hangi değere ulaşır.
- 2) Nominal faiz oranı % 20 olan vadeli bir hesap aşağıdaki senaryolarda hangi değere ulaşır?
 - a) Aylık bindirgeme
 - b) 6 aylık bindirgeme
 - c) Üç aylık bindirgeme
 - d) Günlük bindirgeme
 - e) Sürekli bindirgeme
- 3) İki yıl vadeli yılda bir kupon ödemesi yapan kupon faiz oranı %15 olan 1000 TL nominal bedelli tahvilin aşağıda verilen spot faiz oranlarında değeri nedir? Vadeye kadar getiriyi ve durasyonu hesaplayınız.

Zaman	Spot Faiz (%)
1	18
2	22

- 4) 4 yıl vadeli yılda bir kupon ödemesi yapan tahvil par değerinde satılmaktadır. Tahvilin durasyonunu hesaplayınız. Vadeye kadar getirideki 1 ve 100 baz puanlık değişimin fiyat üzerindeki gerçek etkisini ve durasyon yöntemi ile etkisini bulunuz.
- 5) 4 yıl vadeli 6 ayda bir kupon ödemesi yapan kupon faiz oranı %15 olan 1000 TL nominal bedelli tahvilin aşağıda verilen spot faiz oranlarında değeri nedir?

Zaman	Spot Faiz (%)
6 ay	15
1 yıl	18
1.5 yıl	20
2 yıl	22
2.5 yıl	24
3 yıl	25
3.5 yıl	27
4 yıl	27

- 6) 4 yıl vadeli 6 ayda bir kupon ödemesi yapan tahvil par değerinde satılmaktadır. Tahvilin durasyonunu hesaplayınız. Vadeye kadar getirideki 1 ve 100 baz puanlık değişimin fiyat üzerindeki gerçek etkisini ve durasyon yöntemi ile etkisini bulunuz.