

Investimentos

Quizz #6 (01/Mar/12)

Nome: _____ Número: _____

Para cada uma das questões que se seguem, identifique a hipótese correcta.

1. Sabendo que o preço de um BT a 6 meses é 98.78, a taxa spot a 6 meses é:

- 0,616%
- 1,235%
- 2,485%
- 3,421%
- Nenhuma das anteriores

2. Sabendo que a $r(0;1) = 2.51\%$ e que $r(0;2) = 2.51\%$, então $f(0;1;2)$ será

- 2,12%
- 2,51%
- 2,58%
- 2,84%
- Nenhuma das anteriores

3. Uma obrigação com taxa de cupão de 5% e base de calendário ACT/ACT tem o primeiro cupão irregular, vencendo-se de 01/Mar/12 a 15/Mar/13. Qual o valor do cupão a pagar em 15/Mar/13?

- 0,1776%
- 0,1913%
- 0,1917%
- 0,1918%
- 5%
- 5,1776%
- 5,1913%
- 5,1917%
- 5,1918%

Respostas:

1. A taxa spot a 6 meses é $r(0;0,5) = \left(\frac{100}{98.78}\right)^2 - 1 = 2.485\%$

2. Dado que a yield curve é flat, a taxa forward é igual às taxas spot (2,51%)

3. O cupão a pagar em 15/Mar/13 é $\left(\frac{14}{366} + \frac{365}{365}\right) \times 5\% = 5,1913\%$