

Trabalho Renda Fixa – FGV

Considere as informações abaixo no cálculo dos exercícios propostos:

Tabela do DI-1dia BM&F em 12/03/2013

Ticker	Data	DU	Taxa
j13	01/04/2013	13	7,00
k13	02/05/2013	35	7,05
M13	03/06/2013	56	7,10
n13	01/07/2013	76	7,21
v13	01/10/2013	142	7,57
f14	02/01/2014	206	7,81
j14	01/04/2014	267	7,96
n14	01/07/2014	328	8,16
v14	01/10/2014	394	8,32
f15	02/01/2015	459	8,51

VNA LFT: 5.519,426988

VNA NTN-B: 2.261,808772

Exercício 1: Calcule as taxas a termo para os períodos maio/13, junho/13, ano 2014.

Exercício 2: Calcule o preço de uma LTN vencimento Jan/15 considerando o prêmio de 12,0 pontos base e liquidação em 12/03/2013.

Exercício 3: Considerando o exercício anterior calcule os seguintes preços após 200 dias úteis:

- Preço de mercado considerando o DI-1dia : 9,05%a.a e 10 pontos base;
- Preço de carregamento considerando o CDI médio no período = 8,25%a.a;
- Preço na curva;
- Rentabilidade e resultado líquido no período.

Exercício 4: Calcule o Pu e o volume financeiro de um lote de 20.000 LFTs com vencimento 01/09/2018 e liquidação em 12/03/2013 (1.377 du).

Exercício 5: Calcule o fluxo, o PU e o volume financeiro de um lote de 8.000 NTN-B vencimento 15/05/2015, ao preço de 3,02%a.a, com liquidação em 12/03/2013.

Fluxo Financeiro:

Data	Cupom	DU
15/05/2013	2,956301	44
18/11/2013	2,956301	175
15/05/2014	2,956301	296
17/11/2014	2,956301	427
15/05/2015	102,956301	549