

Atividade 6: Risco Cambial (Solução)

1)

1%

-8%

14,5%

2)

Captar recursos emitindo CD nos EUA a 8%.

Comprar CD na Alemanha a 4%.

Vender Euro a termo a \$0,64.

2,93%

\$0,62308

3)

9,61%

1,26%

8,87%

4)

C)

\$72.670

\$70.000 (sem a correlação)

5)

R\$ 3.720.000

R\$111.000

Saída de caixa de R\$ 3.6029.000

R\$ 1,8045

6)

R\$ 1.780.000

R\$ 24.500

Entrada de caixa de R\$ 1.804.500

R\$ 1,8045

7)

4,3%

0,94%

8,48%

8)

Emitir CD nos EUA a 7%

Comprar CD na Alemanha a 5%

Vender euro a termo a \$1,10

8,5%

\$1,01905

9)

14,45%

0,52%

12,75%

10)

Moeda	Posição Líquida
Euro	70.000
Libra esterlina	23.000
lène	- 31.000

Ganho de \$700

Ganho de \$300

Perda de \$620