

# Tarea Exámen

## Productos Financieros Derivados

Universidad Marista

October 21, 2021

### 1 Instrucciones

El alumno deberá de hallar los factores de descuento correspondientes a los vencimientos de los instrumentos mencionados a continuación implementando un algoritmo de BootStrapping considerando las siguientes características:

- Convención de conteo de días ACT/365
- Convención de las tasas presentadas: Linear
- No existen días inhábiles.
- La curva se interpola de forma log- linear
- Tasas Libor y swap expresadas en porcentaje
- instrumentos:
  1. Libor 3M 0.2
  2. Libor 6M 0.4
  3. Libor 9M 0.6
  4. Futuro Libor 3M (6M, 12M) 99.2
  5. Futuro Libor 3M (9M, 15M) 99.56
  6. Swap Libor 3M/6M 2Y 0.75
  7. Swap Libor 3M/6M 3Y 0.79
  8. Swap Libor 3M/6M 4Y 0.82
  9. Swap Libor 3M/6M 5Y 0.83
  10. Swap Libor 3M/6M 6Y 0.834
  11. Swap Libor 3M/6M 9Y 0.841
  12. Swap Libor 3M/6M 10Y 0.846
  13. Swap Libor 3M/6M 15Y 0.8502
  14. Swap Libor 3M/6M 20Y 0.9
- La frecuencia de pago de los Swaps es de 6 Meses.