

Tarea 3

Fecha Tope de Entrega: 11 de julio de 2025

Hora límite 23:59 y solo formato digital

Pregunta Única

Suponga que su empresa emite el 18-6-2025 un bono bullet por 100 mil millones de pesos a 12 meses plazo con tasa cupón compuesta semi anualmente, igual a 4,4%.

- a) Usando la información de Tasas en Pesos en Canvas, se pide que calibre un proceso de Vasicek para la tasa a 6 meses plazo.
- b) Se pide que simule la trayectoria mensual del precio de mercado de este bono hasta su vencimiento , y encuentren el peor escenario de valor presente al 95%.
- c) Suponga ahora que su empresa tiene la opción de prepagar la deuda en 6 meses más. Reestime el peor escenario de valor presente al 95% bajo estas condiciones.
- d) Encuentre el valor hoy (18 de junio de 2025) de la opción de prepago que el bono de su empresa tiene.