1 )

el código busca primero un bono con duration mas o menos de 6 y después cambia la tasa para tener precio de VN

Todo con recursión

con el bono que va creando hace esto:

A screen shot of a computer program

Description automatically generated

y Llegué a este bono

A screenshot of a computer

Description automatically generated

2)

Con mi código:

A computer screen shot of a program code

Description automatically generated

No da super exacto la duration correcta con Duration2 pero…

A computer screen shot of a computer program

Description automatically generated

Pero lógicamente la duration es más larga con reinversión a una tasa más baja porque tarda mas tiempo en compensarse lo que se descuenta a una tasa más alta.