**UNIVERSIDAD EAFIT**

**MAESTRIA ADMINISTRACIÓN FINANCIERA**

**MERCADOS FINANCIEROS – 2023 I**

**TALLER RENTA FIJA**

**DOCENTE: JUAN FELIPE CARDONA**

NOMBRE: \_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_

1. De acuerdo con la siguiente información, realizar:

 

TIR o tasa negociación: 11.90% TIR o tasa negociación: 12.50%

Valor Nominal $: 500.000.000 Valor Nominal $: 500.000.000

Suponga que va a comprar ambos papeles el 06-03-2023, por lo tanto, es necesario valorarlos. Calcular:

Precio sucio

Precio limpio

Cupón corrido

Duración macaulay

Duración modificada

DVO01

1. Suponga que después de comprar ambos papeles el 06-03-2023 (punto anterior), los va a vender el 06-04-2023, ambos a una tasa 100 pbs por debajo de la tasa de compra de cada uno. Calcular:

Precio sucio

Precio limpio

Cupón corrido

Duración macaulay

Duración modificada

DVO01

Calcular la TIR de tenencia de ambos títulos dado el escenario planteado y explicar su resultado a la luz de la sensibilidad de los títulos.

1. Calcule precio sucio y precio limpio del siguiente TES en UVR:

Fecha Negociación: 06-03-2023

Tasa negociación (TIR): 3.25%

Nominal: 20.000.000 unidades UVR





Nota: Se debe tomar el valor de la UVR vigente el 06-03-2023