

Matemática Financiera

Guía N°6: Activos de Renta Fija

Problema 1: Suponer que un bono es amortizable exactamente en 3 años y que paga un cupón anual del 6 % del valor nominal igual a \$100000. Obtener el precio del título si la tasa de interés efectiva anual $i(t) = i$ es del

- a) 7 %, b) 6 %, c) 3 %.

Problema 2: Suponer que un bono es amortizable dentro de 7 años y que paga un cupón del 8 % anual pagadero semestralmente. Si el valor nominal de este título es de \$1000, obtener el precio del título si la tasa de interés efectiva anual es del

- a) 8 %, b) 8,16 %.

Problema 3: Considerar un bono amortizable en 7 años, que paga un cupón anual del 3 % y cuyo valor nominal es de \$10000. Suponer que la tasa de interés efectiva anual es i .

- a) Escribir una expresión general para el valor inicial del bono.
b) Determinar el valor i para que el bono cotice a la par.
c) Determinar el valor del bono a la par justo antes del pago de la segunda cuota, e inmediatamente después del pago.

Problema 4: Suponer que la fecha actual es el 8 de marzo de 2000.

- a) Calcular el cupón corrido de un título cuyo valor nominal es \$1000, cuyo cupón anual es del 3,25 % y que amortiza el 31 de enero de 2005.
b) Calcular el precio del mismo si su precio ex-cupón es del 91,621 %.

Problema 5: Suponer que precio ex-cupón a 8 de marzo de 2000 del bono cuyo valor nominal es \$1000 era del 91,621 %. Suponer además, que los cupones, que se devengan anualmente, son del 3,25 % y que el bono amortiza el 31 de enero de 2005.

- a) Calcular los flujos de caja restantes.
b) Calcular su T.I.R.