

FUNDACIÓN UNIVERSITARIA SAN MARTÍN

Nombre: _____

Profesor: FERNANDO DE JESÚS FRANCO CUARTAS

Asignatura: Ingeniería Financiera.

Previa: 02.

13/10/2010

- 1) Si la tasa de mercado Oscila 19 PB, determine la sensibilidad diaria que experimentaría la inversión realizada por un colombiano que adquiere hoy, 12 de Octubre de 2010, un titulo de deuda pública interna a precio sucio con vencimiento a 7 años, emitido el 15 de Junio del 2009. Dicho titulo se adquirió con prima, a la par ó con descuento. Argumente. **Valor 30%**
- 2) El día 12/10/2010 la tasa de mercado para los TES, TFIT04170413 y el TFIT06141113, se incrementaron 12PB, teniendo en cuenta el método alternativo para determinar el impacto en el precio de mercado de cada titulo, si ud está liquido, que decisión toma: irse en posición larga ó corta , en cuál titulo ¿ Argumente su respuesta? **Valor 40%**
- 3) A la fecha: ¿Cuál titulo es más sensible en su precio, el TES20 ò el TES24? Argumente desde la variación relativa de cada titulo. **Valor 30%**