

**Problema 1**

En base a las siguientes cotizaciones de Swaps para los distintos años que se muestran a continuación:

Swap (años)	Tasa Swap (lineal)
1	3.0%
3	3.5%
5	5.0%
10	7.0%
15	10.0%

- Construya los flujos de caja para cada uno de los instrumentos antes mencionados.
- Construya la curva cero a partir del método de Bootstrapping.
- Encuentre las tasas cero para los años 2, 4, 7 y 12 (composición anual ACT/360) utilizando interpolación log-lineal.

**Problema 2**

Valore un Swap fijo-flotante cuya tasa es de un 5% anual y comienza a regir en un año más a partir de hoy. El intercambio de flujos (anuales) dura 3 años a partir de la fecha de inicio del swap. A continuación se muestran las tasas cero anual 30/360 para los siguientes 4 años.

Año	1	2	3	4
Tasa cero	4.00%	5.00%	6.00%	8.00%