

*Guardar con el Nombre EJEMPLO.PRG

/*

NOTA: las opciones del procedimiento son:

lambda: corresponde al parámetro de posicionamiento de nodos a la derecha y se pide elegir uno de los siguientes valores: $\lambda=0.94$ o $\lambda=1.0$ o $\lambda=1.2$, el más adecuado es el que genera una curva de tasa spot más suave (ver documento).

dian: corresponde al número del día para el cual se quiere hacer la estimación, si por ejemplo se cuenta con 20 días y se quiere hacer la estimación para el segundo, se asigna la opción $\text{dian}=2$.

overnight: si se quiere o no estimar con tasa overnight

vto: si se quiere o no expresar la fecha de vencimiento en números enteros. Se recomienda usar siempre FECHAS

salida: si se quiere o no un out-put detallado

*/

allo 1000

OPEN DATA c:\colsemm.xls

DATA(FORMAT=xls,ORG=rows) /

OPEN DATA c:\colsemc.xls

DATA(FORMAT=xls,ORG=rows) /

OPEN DATA c:\colsemy.xls

DATA(FORMAT=xls,ORG=rows) /

OPEN DATA c:\colsemp.xls

DATA(FORMAT=xls,ORG=rows) /

*print /

source(noecho) c:\dboor.src

@bspline(dian=12,overnight=si,vto=fechas,salida=deta)