Hedging Alternatives for the Mortgage Stabilization Fund (FRECH): European Cap Options for the Real Interest Rate

Borradores de Economia
Número:
265
Publicado:
Miércoles, 1 Octubre 2003
Clasificación JEL:
G23, C23
Palabras clave:
Administradora de Fondos de Pensiones (AFP), Rentabilidad, Cointegración panel
Descargar documento

Lo más reciente

La Fecundidad en Colombia: Evolución Reciente y Factores Socioeconómicos Asociados
Juliana Jaramillo-Echeverri, Adriana Sofía Rodríguez
Movilidad espacial, oportunidad económica, y crimen
Gaurav Khanna, Carlos Alberto Medina-Durango, Anant Nyshadham, Daniel Ramos-Menchelli, Jorge Andrés Tamayo-Castaño, Audrey Tiew
Pronosticando inflaciones de canastas de alimentos desagregadas en Colombia usando un modelo XGBoost
Cesar Anzola-Bravo, Poveda-Olarte Paola
Otras Publicaciones

The World Bank has proposed an alternative hedging instrument to be offered by the FRECH, instead of the collar-swap currently available. The suggested derivative corresponds to a European Cap option for the real interest rate, which could give greater fl