Metodología de valoración Option Adjusted Spread (OAS) para títulos garantizados

## Metodología de valoración Option Adjusted Spread (OAS) para títulos garantizados con hipotecas

Temas de Estabilidad Financiera

Número:

8

DOI:

https://doi.org/10.32468/tef.8

**Publicado:** 

Miércoles, 1 Diciembre 2004 Descargar documento

## Lo más reciente

Productividad y eficiencia de los hospitales públicos en Colombia por niveles de complejidad: Nueva evidencia 2007 - 2021

Diego Vásquez-Escobar

Estructura tributaria y desempeño de las firmas colombianas

Juan Esteban Carranza-Romero, Alejandra González-Ramírez, Mauricio Villamizar-Villegas Presupuesto de la nación y el balance fiscal del gobierno central: ¿cómo se relacionan y qué los diferencia?

Hernán Rincón-Castro, Steven Zapata-Álvarez

Otras Publicaciones

Explicación detallada de la metodología de valoración OAS que permite calcular el valor de la opción de prepago en puntos básicos. Esta se mide como la diferencia entre el spread estático (SS) y el spread ajustado. Asimismo, se realiza una aplicación para Colombia de la metodología. Finalmente, el cálculo del valor de la opción de prepago a través la metodología OAS permite determinar las conclusiones del estudio.