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

Settlement liquidity in the Colombian large-value payment system: the role of reserve requirements
Fredy Gamboa-Estrada, Freddy Cepeda-López, Javier Iván Miguélez-Márquez
Geopolitical risk and emerging market sovereign risk premia
Fredy Gamboa-Estrada, José Vicente Romero
Assessing the effects of recent provisioning rules on consumer credit allocation in Colombia
Fredy Gamboa-Estrada, Diego Cuesta, Camilo Sanchez-Quinto
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.