

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

[Educación e inclusión financieras en América Latina y el Caribe: programas de los bancos centrales y las superintendencias financieras](#)

María José Roa-García, Gloria Amparo Alonso Masmela, Nidia García Bohórquez, Diego A. Rodríguez-Pinilla

[Deuda Pública, Expectativas sobre el Déficit Fiscal y su Transmisión al Componente Cíclico de las Tasas de Interés de Largo Plazo](#)

José Vicente Romero-Chamorro, Hernando Vargas-Herrera

[Borradores de Economía - Corto vs mediano plazo: movimientos del tipo de cambio, inversión y la composición por monedas de las hojas de balance](#)

Juan Camilo Medellín-Martínez, Sergio Restrepo Ángel

[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.