

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

[Dinámica Salarial, Desempleo e Inflación: Extendiendo el Modelo Semi-Estructural 4GM](#)

Mario Andrés Ramos-Veloza, Sara Naranjo-Saldarriaga, José Pulido

[Índices de Sentimiento e Incertidumbre de las noticias económicas de Colombia](#)

Rocío Clara Alexandra Mora-Quiñones, Antonio José Orozco-Gallo, Dora Alicia Mora-Pérez

[Billeteras móviles y otros servicios de pago: brechas regionales y su adopción en Colombia](#)

Constanza Martínez-Ventura, Ligia Alba Melo-Becerra

[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.