

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

[Documentos de Trabajo Sobre Economía Regional y Urbana - Impacto de los cierres en la vía al llano sobre los precios de los alimentos en Colombia](#)

Jhorland Ayala-García, Yesica Tatiana Lara-Silva, Alejandro Alberto Vargas-Villamil, Lina Romero-Chaparro

[Impacto macroeconómico y fiscal del cambio demográfico](#)

Jesús Alonso Botero-García, Ligia Alba Melo-Becerra, Cristian Castrillón Gaviria, Daniela Gallo

[Uncertainty and monetary policy: the case of the Central Bank of Colombia](#)

Hernando Vargas-Herrera

[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.