

Formato de Registro Swaps

Fecha Negociación	DD/MM/YY	
Hora Negociación	DD/MM/YY	
Fecha de Inicio	T+0	
	T+2	
	OTRO	

Producto	ⁱ TASA 1	
	TASA 2	
	MONEDA TASA 1	
	MONEDA TASA 2	
	SPREAD	
	OTRO	
	ⁱⁱ Referencia 1	
	Referencia 2	

PAGADOR TASA 1	PAGADOR TASA 2	MONTO	TASA FIJA	Fecha Vencimiento
PAGADOR TASA 1	PAGADOR TASA 2	MONTO	TASA FIJA	Fecha Vencimiento

Fechas de Pago	DD/MM/YY
	DD/MM/YY
	DD/MM/YY
	DD/MM/YY
	DD/MM/YY
	DD/MM/YY

- Horario de Registro en el sistema: 7 am – 5 pm
- Si se solicita un registro después del cierre del sistema, siguiendo el debido procedimiento especificado en el Boletín No 002, publicado en la página de internet , se realizara dicho registro a los 15 minutos de apertura de mercado del siguiente día hábil.

NOTA: No se hará el registro de solicitudes que no hayan sido confirmadas telefónicamente o siguiendo el procedimiento mencionado.

ⁱ **TASA 1 y 2:** hace referencia al tipo de tasa y de subyacente. Ej: Cop/LIBOR, Tasa1 fija pesos; Tasa2 variable libor.

ⁱⁱ **Referencia:** hace mención a la tasa variable que fija para el primer periodo de amortización del swap. Ej: en Cop/LIBOR, la referencia debe ser la LIBOR 6M vigente del día del cierre y que fija para el primer semestre del swap.