

ESPECIFICACIONES TÉCNICAS DE LOS CONTRATOS DE DERIVADOS ESTANDARIZADOS

A continuación la definición de especificaciones técnicas de los contratos de derivados a ser negociados inicialmente en la BVC de acuerdo con lo discutido en Comité de Derivados. Especificaciones definitivas pueden modificarse de acuerdo con los requerimientos del Mercado y las recomendaciones del Comité de Derivados.

Producto	Futuro TES
Canasta de entregables	Bonos de Largo plazo - al menos 3 (sesgado al bono líquido con el cupón del nacional)
Ventana de tiempo	Abierta
Subyacente	TES tasa fija en COP
Tamaño del Contrato	COP 200,000,000
Meses listados	Trimestrales (ciclo de marzo).
No. Contratos Vigentes	2
Fluctuación Mínima	0,01 (COP 20.000)
Método de Liquidación	Física
Último día de entrega	Miércoles de la tercera semana del mes
Último día de negociación	Lunes de la tercera semana del mes

Producto	Futuro TRM
Subyacente	Tasa Representativa del Mercado del día (TRM)
Tamaño del Contrato	USD 50,000
Meses listados	Trimestrales (ciclo de marzo) hasta 1 año.
No. Contratos Vigentes	4
Fluctuación Mínima	0,01 (COP 500)
Método de Liquidación	Dinero en COP
Vencimiento del contrato	Miércoles de la segunda semana
Último día de negociación	Martes de la segunda semana

Producto	Futuro Índice (COLCAP)
Subyacente	Precio de Cierre del Índice COLCAP
Tamaño del Contrato	COP 50.000 / unidad de índice
Meses listados	Trimestrales (ciclo de marzo) hasta 1 año.
No. Contratos Vigentes	4
Fluctuación Mínima	0,1 (COP 5.000)
Método de Liquidación	Dinero en COP
Día de liquidación (vencimiento)	Jueves de la primera semana
Último día de negociación	Miércoles de la primera semana

Producto	Futuro Tasa de interés
Subyacente	IBR 1 mes
Tamaño del Contrato	COP 2,000,000,000
Meses listados	Mensual primeros 3 meses, trimestral (ciclo de marzo) hasta 1 año.
No. Contratos Vigentes	6
Fluctuación Mínima	0.001 de Precio
Método de Liquidación	Dinero
Último día de entrega	Miércoles de la cuarta semana del mes (Diciembre 3ra semana)
Último día de negociación	Martes de la cuarta semana del mes (Diciembre 3ra semana)