

ASUNTO:

NUEVO PLAZO PARA REGISTROS SWAPS CON TASA SOFR

SET-ICAP FX S.A, sociedad administradora del Sistema Electrónico de Transacciones e Información del Mercado de Divisas "SET-FX", se permite informar a todos sus afiliados que a partir del próximo miércoles 25 de enero se adiciona la opción "SF12M" correspondiente al plazo "12 meses" en el registro de operaciones Swaps para la tasa SOFR (Secured Overnight Financing Rate).

Registros Derivados - Registrar transacción

Spot Next Day Fix Forward Swap Opciones IRS/CCS Otros derivados

IMC's Clientes IRS CCS

Clase: COMPRA Hecho por: Yo CTBB Mi usuario: DANIELP Empleados

Contraparte: Nit - Real o Vigilado ID: 800.021.308-5 DRUMMOND Nuevo ID

Beneficiario ID:

Comentario Tercero Offshore

Par de monedas: COP COP Peso Dolar Cumplimiento: NON-DELIVERY

Inicio primer flujo: T+2 Calendario: CO-NY Jue 19-Ene-2023 Opcionalidad: NO

Plazo: Libre Vencimiento sin ajustar:

Fecha de pago: Modify following business: SI Segundo monto: COP

Monto COP: (Unidades) Conteo de días Periodicidad Tipo: BULLET

Tasa de interés COP: V SF12M + Negociado en:

Tasa de interés COP: V SF12M + 0000 ACT/360 Fecha anterior

Editar Nuevo Limpiar

En este sentido, las entidades que registren este tipo de operaciones en el Sistema SET-FX deben tener en cuenta que se incluirá el nuevo valor "SF12M" en los siguientes campos y posiciones de las interfaces de conexión:

Archivo Plano (Trasmo)

Posiciones: 688 y 696

API

Mensaje: "orden_transacción" "clase_mensaje=5"
Campos: "datos_reajuste_tasa" y "referencia_titulo"

XML

Campos:

- `<codigo_tasa_referencial_extendido>SF12M</codigo_tasa_referencial_extendido>`
- `<codigo_tasa_referencial_extendido_2>SF12M</codigo_tasa_referencial_extendido_2>`

Estaremos atentos a resolver cualquier inquietud que pueda presentarse al respecto.

Cordialmente,

(Original Firmado)

JUAN DAVID BENAVIDES MONTEALEGRE

Director Comercial