

TIPO DE LIQUIDACIÓN DE OPERACIONES SWAPS

Artículo 5.4.2.1. Tipo de Liquidación en Operaciones Swaps.

Sin perjuicio de la Liquidación de cualquier concepto asociado a la Operación Swap, las Operaciones Aceptadas por la Cámara correspondientes a Operaciones Swaps serán Liquidadas únicamente mediante Liquidación al Vencimiento con Liquidación por Diferencias y se atenderá tal procedimiento de conformidad con lo dispuesto en el artículo 2.6.11. del Reglamento de la Cámara.

CAPÍTULO TERCERO

LIQUIDACIÓN AL VENCIMIENTO DE LAS OPERACIONES SWAPS

Artículo 5.4.3.1. Liquidación al Vencimiento de Operaciones Swaps con Liquidación por Diferencias provenientes de sistemas de negociación y/o registro o Mecanismo de Contratación.

(Este artículo fue modificado mediante Circular 19 del 22 de noviembre de 2019, publicada en el Boletín Normativo No. 034 del 22 de noviembre de 2019. Rige a partir del 25 de noviembre de 2019).

Al vencimiento de las Operaciones Swaps con Liquidación únicamente al Vencimiento con Liquidación por Diferencias, la Cámara atenderá el siguiente procedimiento:

1. La Cámara obtendrá las Curvas Cero Cupón de Cierre del Proveedor Oficial de Precios para Valoración, y las tasas de interés como Libor e IBR, y la Tasa de cambio Representativa del Mercado se obtendrán de las fuentes oficiales correspondientes.
2. Con base en la información obtenida, realizará la Liquidación por Diferencias, de conformidad con el procedimiento establecido en los artículos 5.4.3.2. al 5.4.3.3. de la presente Circular para todos los