



Bolsa de Valores de Colombia

BOLETÍN INFORMATIVO

No.018 Bogotá D.C., 05 de abril de 2021

FACTORES DE CONVERSIÓN Y CANASTA DE ENTREGABLES

A partir del día 6 de abril de 2021, la Bolsa de Valores de Colombia pondrá a disposición de los agentes del Mercado de Derivados los Futuros de TES con vencimiento julio de 2021.

A continuación, se informan los factores de conversión y canasta de bonos entregables para cada uno de los contratos, calculados a la fecha del último día de negociación empleando conteo de días **NL/365** y las siguientes tasas de descuento:

Plazo	Tasa
Futuro TES Corto Plazo (TES) - TFIT10040522	7.2%
Futuro TES Mediano Plazo (TEM) - TFIT16240724 - TFIT15260826	7.4%
Futuro TES Largo Plazo (TEL) - TFIT16280428 - TFIT16180930	8.5%

1. FUTURO TES CORTO PLAZO (TES)

1.1. CONTRATO TESN21F

1.1.1. DESCRIPCIÓN

Nominal: COP 250.000.000

Primer día de negociación: 06 – abril – 2021

Último día de negociación: 01 – julio – 2021

Fecha de Vencimiento: 02 – julio – 2021

1.1.2. CANASTA DE ENTREGABLES Y FACTORES DE CONVERSIÓN

TESN21F	
Nemotécnico	Factor de conversión
TFIT10040522	0.998100

2. FUTURO TES MEDIANO PLAZO (TEM)

2.1. CONTRATO TEMN21F

2.1.1. DESCRIPCIÓN

Nominal: COP 250.000.000

Primer día de negociación: 06 - abril - 2021

Último día de negociación: 01 - julio - 2021

Fecha de Vencimiento: 02 - julio - 2021

2.1.2. CANASTA DE ENTREGABLES Y FACTORES DE CONVERSIÓN

TEMN21F	
Nemotécnico	Factor de conversión
TFIT15260826	1.003809
TFIT16240724	1.068797

3. FUTURO TES LARGO PLAZO (TEL)

3.1. CONTRATO TELN21F

3.1.1. DESCRIPCIÓN

Nominal: COP 250.000.000

Primer día de negociación: 06 - abril - 2021

Último día de negociación: 01 - julio - 2021

Fecha de Vencimiento: 02 - julio - 2021

3.1.2. CANASTA DE ENTREGABLES Y FACTORES DE CONVERSIÓN

TELN21F	
Nemotécnico	Factor de conversión
TFIT16280428	0.87408
TFIT16180930	0.952826