

MODELO DE CONFIRMACION PARA OPERACIONES SWAP

Señores _____

Ciudad _____

Estimados señores:

Por medio de la presente Confirmación, la cual se expide de acuerdo con los términos del Contrato Marco celebrado previamente entre las Partes, se perfecciona la Operación con Derivado convenida con ustedes el día de hoy, ____ de _____ del año _____ consistente en:

1. Tipo de Operación con Derivado: Swap
2. Descripción de la transacción:
Tipo de Swap: Peso- Peso__ Peso-Dólar __ tasa de cambio al inicio____ (si Peso-Dólar)
3. Condiciones:

Valor Nominal en Pesos _____
 Valor Nominal en Dólares _____ (si Peso-Dólar)

_____ recibe tasa de interés _____ en _____
 _____ recibe tasa de interés _____ en _____

Periodo de Ajuste _____ Días ¹ .
 Número de Periodos de Ajuste _____

Fecha de Revisión	Fecha de Cumplimiento	Amortizaciones	Fecha Amortización de Índice
_____	_____	_____	_____
_____	_____	_____	_____
_____	_____	_____	_____
_____	_____	_____	_____
_____	_____	_____	_____

Base de Liquidación _____

Tasa A: _____

Tasa B: _____

4. Cumplimiento:

Forma de Liquidación en las Fechas de Cumplimiento

Flujo de interés A = (Valor Nominal *Tasa A*Período de Ajuste)/número de días en año en la base de liquidación

Donde, Tasa A debe estar expresada en términos nominal anual vencido

¹ Si la base de liquidación es diferente el número de días de cada Período de Ajuste variará dependiendo de las Fechas de Cumplimiento.

Flujo de interés B = (Valor Nominal*Tasa B*Período de Ajuste)/número de días en año en la base de liquidación

Donde, Tasa B debe estar expresada en términos nominal anual vencido.

En caso de una Operación Peso-Dólar, el flujo en Dólares se liquidará en Pesos multiplicándolo por la TRM o Tasa Spot de Mercado vigente en la Fecha de Cumplimiento respectiva.

Neteo = Valor Absoluto (Flujo de Interés A – Flujo de Interés B).

Forma de liquidación en caso de liquidación anticipada

Forma de pago del Neteo _____

Atentamente,

Acepto,

**FUNCIONARIO AUTORIZADO
DE LA ENTIDAD FINANCIERA,**

**FUNCIONARIO AUTORIZADO
DE EL CLIENTE,**

Nombre:

Cargo:

C.C.

Domicilio:

Nombre:

Cargo:

C.C.

Domicilio: