

# Segundo ensayo general para la conversión de **swaps** de Tasas de Interés TIIE 28 a **TIIE de Fondeo.**

## Aspectos generales de la prueba.

ASIGNA Cámara de Compensación y Liquidación, llevará a cabo un ensayo general para la conversión de Swaps de TIIE 28 a TIIE de Fondeo el 25 de octubre del 2024.

El objetivo de este ensayo es simular el proceso de conversión que se llevará a cabo el 22 de noviembre del 2024.

Generalidades:

Al día de la prueba se entregarán las siguientes bases de datos asociadas a los contratos a ser convertidos:

- La primera incluirá los “Unwinds” de los swaps que tengan fecha de vencimiento posterior al 31/12/2025.
- La segunda incluirá los swaps de reemplazo asociados a cada uno de los unwinds del punto anterior; un swap de corto plazo sobre TIIE 28 y un Forward Starting Swap referenciado a la TIIE de Fondeo.

En esta prueba se incluirán como parte del swap de corto plazo sobre TIIE 28 los cupones del swap original a liquidarse posterior al 25 de octubre del 2024 y hasta antes del 01 de enero del 2026.

## Información Operativa del proceso.

1. Entrega de los reportes de liquidación a Socios Liquidadores de forma habitual.
2. Envío a los Socios Liquidadores de la base de datos con la cancelación de los contratos originales. El nombre de esta base es SwapsCancelados.
3. Envío a los Socios Liquidadores la base de datos con los swaps de reemplazo. Esta base contendrá los datos económicos de los dos nuevos contratos y el ajuste de efectivo, la cual está nombrada como SwapsReemplazo.

*Nota: La información (valuación), se entregarán en el mensaje FIXML FTPSWAP (el Socio Liquidador recibirá este insumo de forma habitual a como la recibe en producción).*

El insumo FTPSWAP se entregará el mismo día de la conversión, dependiendo del avance de actividades del Socio Liquidador y Asigna.

## Reportes periódicos de la conversión.

A partir del 05 de septiembre, se envían bases de datos a los Socios Liquidadores en las que se simula el efecto de la conversión, se incluye el Valor Presente Neto (VPN) de los swaps sujetos a conversión, con el siguiente detalle:

- NPV (original swap)
- NPV Short Swap
- NPV FSS Banxico
- NPV Short Swap\_
- NPV FSS Final

Adicionalmente, se incluye el ajuste de efectivo.\*

\*Diferencia entre la valuación del Forward Starting Swap usando la metodología de Banco de México y su valor de apertura.

## Contacto.

Para preguntas o asistencia con las pruebas, por favor contacta al Equipo de Asigna en

[conversionswapsasigna@grupobmv.com.mx](mailto:conversionswapsasigna@grupobmv.com.mx)

