



BOLETÍN INFORMATIVO

Bogotá D.C., Septiembre 9 de 2020

No. 053

bvc se permite informar a todos los miembros del Mercado de Derivados los Strikes que estarán disponibles para las opciones sobre la TRM que se crearán para el vencimiento de Septiembre de 2021. Se listarán un mínimo de 101 Strikes para dicho vencimiento, tomando como precio de referencia para la generación de la serie de Strikes el precio de cierre del futuro de TRM correspondiente al vencimiento, redondeado al Tick definido para los Strikes:

<i>Futuro</i>	<i>Precio de Cierre</i>	<i>Strike Máximo</i>	<i>Strike Mínimo</i>	<i>Tick de Strike</i>
TRMU21F	3.820	4.320	3.320	10

Es importante mencionar que se podrán generar nuevos Strikes adicionales en razón a la volatilidad del activo subyacente, generación que garantizará el listado de al menos 101 Strikes a partir del precio de cierre diario de dicho activo.