



Ciudad de México, a 16 de junio de 2016.

AVISO A SOCIOS LIQUIDADORES, OPERADORES Y PÚBLICO EN GENERAL

Cálculo de las Tasas de Liquidación Diaria en el Contrato de Futuro sobre la TIIE

De conformidad con lo establecido en el numeral 3 de la Sección IV de las Condiciones Generales de Contratación del Contrato de Futuro sobre la Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio a 28 días (TIIE), MexDer, Mercado Mexicano de Derivados, S.A. de C.V., comunica que por lo que se refiere a las Series negociadas en los engrapados de JL17 1X6, EN18 1X6, JL18 1X6, EN19 1X6, JL19 1X6, EN20 1X6, JL20 1X6, EN21 1X12, EN22 1X12, EN23 1X12, EN24 1X12, EN25 1X12, EN26 1X6 las Tasas de Liquidación Diaria se fijarán tomando en cuenta únicamente las operaciones engrapadas. La metodología que se utilizará para la determinación de la pendiente de la curva y de esa forma asignar un precio individual para cada serie involucrada en dichos engrapados, es la siguiente:

$$\text{NodoTeórico} = \text{Nodoi} + 2 * (\text{Engrpi} - \text{Nodoi})$$

Donde:

Engrpi = Tasa del *i-ésimo* engrapado.

Nodoi = Tasa correspondiente al vencimiento inmediato anterior al engrapado.

NodoTeórico= Tasa Teórica correspondiente al vencimiento inmediato posterior al engrapado.

Lo señalado en este aviso entrará en vigor a partir del 16 de junio del año en curso.

Atentamente,

(Rúbrica)

Lic. José-Oriol Bosch Par
Director General