



Ciudad de México, a 11 de abril de 2024.

AVISO A SOCIOS LIQUIDADORES, OPERADORES Y PÚBLICO EN GENERAL

MODIFICACIÓN A LAS CONDICIONES GENERALES DE CONTRATACIÓN DE LOS CONTRATOS DE FUTURO SOBRE EL S&P/BMV ÍNDICE DE PRECIOS Y COTIZACIONES DE LA BOLSA MEXICANA DE VALORES (LIQUIDACIÓN EN EFECTIVO)

Con fundamento en el último párrafo del artículo 4021.00 del Reglamento Interior de MexDer, Mercado Mexicano de Derivados, S.A. de C.V., (“MexDer”), la Dirección General de MexDer da a conocer la modificación de las Condiciones Generales de Contratación del Contrato de Futuro sobre el S&P/BMV Índice de Precios y Cotizaciones de la Bolsa Mexicana de Valores (Liquidación en Efectivo) autorizada por Banco de México, mediante oficio REF.: S40/12/2024 de fecha 26 de enero del presente año, en términos del Anexo Único que se adjunta al presente aviso.

Cabe señalar que las referidas modificaciones tienen como propósito actualizar las Condiciones Generales de Contratación conforme a la realidad operativa.

Finalmente, se informa que la modificación antes señalada entrará en vigor el próximo 18 de abril de 2024.

Atentamente,

(Rúbrica)

José Miguel De Dios Gómez
Director General



**Condiciones Generales de Contratación del
Contrato de Futuro sobre el S&P/BMV Índice de Precios y
Cotizaciones de la Bolsa Mexicana de Valores
(Liquidación en Efectivo)**

I. a II. ...

III. CARACTERÍSTICAS Y PROCEDIMIENTOS DE NEGOCIACIÓN.

1. a 2. ...

3. Horario de negociación a Precio de Liquidación Diaria.

...

El periodo en el que MexDer recibirá Posturas en firme para negociar **a la al Tasa Precio** de Liquidación Diaria será de 15:20 a 15:30 horas.

...

4. a 6. ...

IV. LIQUIDACIÓN DIARIA Y LIQUIDACIÓN AL VENCIMIENTO.

1. a 2. ...

3. Cálculo del Precio de Liquidación Diaria.

Finalizada una sesión de negociación, MexDer calculará los Precios de Liquidación Diaria para cada Serie, de acuerdo con el orden de prelación y la metodología siguientes:

a) a b) ...

c) Si durante la sesión de remate no se hubiese celebrado operación alguna para una Fecha de Vencimiento de un Contrato de Futuro, el Precio de Liquidación Diaria será el que resulte conforme a la fórmula siguiente:

Donde:

PL_t = Precio de liquidación del Contrato de Futuro sobre el S&P/BMV IPC en el día t, redondeado a la Puja más cercana.

$$PL_t = IPC_t \left(1 + (i_{t,M} - d_t) \frac{M}{360} \right)$$

IPC_t = Valor del S&P/BMV IPC al cierre del día t.

$i_{t,M}$ = Tasa de Interés, obtenida a partir de la Curva "Cero" de la Tasa de Interés Interbancaria de Equilibrio (TIIE)

proporcionada por el proveedor de precios (*price vendor*) que contrate MexDer.

d_t = Tasa de dividendos esperada anual, representada por la tasa observada en el ejercicio anterior y proporcionada por la BMV.

M = Número de días por vencer del Contrato de Futuro.

t = Día de la valuación o de liquidación.

...

4. ...

V. a VI. ...

* * * * *