

Ciudad de México, a 12 de noviembre de 2024.

AVISO A SOCIOS LIQUIDADORES, OPERADORES Y PÚBLICO EN GENERAL

Operaciones de Bloque

Con fundamento en los artículos 10066.21 y 10066.22 del Reglamento Interior (“Reglamento”) de MexDer, Mercado Mexicano de Derivados, S.A. de C.V. (“MexDer”), se dan a conocer las nuevas características para la celebración de operaciones de bloque, que deberán ser reportados a la Bolsa en un plazo no mayor a 10 minutos después de haber sido pactadas, las cuales sustituyen a las publicadas por este mismo medio con fecha 5 de noviembre de 2024 y que quedarán en los términos que a continuación se presentan:

- 1) Para los **Contratos de Futuro sobre la TIE de Fondeo (TIEF)** el volumen mínimo será de 1,000 Contratos y el número de Pujas por arriba o por abajo de los corros permitido para registrar una operación de bloque será de 4.
- 2) Para los **Contratos de Futuro sobre el CE91** el volumen mínimo será de 5,000 Contratos para las Series individuales y 3,000 Contratos para las Series engrapadas y el número de Pujas por arriba o por abajo de los corros permitido para registrar una operación de bloque será de 4.
- 3) Para los **Contratos de Futuro sobre el Bono M3** el volumen mínimo será de 500 Contratos y el número de Pujas por arriba o por abajo de los corros permitido para registrar una operación de bloque será de 5.
- 4) Para los **Contratos de Futuro sobre el Bono M10** el volumen mínimo será de 500 Contratos y el número de Pujas por arriba o por abajo de los corros permitido para registrar una operación de bloque será de 11.
- 5) Para los **Contratos de Futuro sobre el Bono M20** el volumen mínimo será de 300 Contratos y el número de Pujas por arriba o por abajo de los corros permitido para registrar una operación de bloque será de 12.
- 6) Para los **Contratos de Futuro sobre el Bono MR26** el volumen mínimo será de 500 Contratos y el número de Pujas por arriba o por abajo de los corros permitido para registrar una operación de bloque será de 12.
- 7) Para los **Contratos de Futuro sobre el Bono JN27** el volumen mínimo será de 500 Contratos y el número de Pujas por arriba o por abajo de los corros permitido para registrar una operación de bloque será de 12.
- 8) Para los **Contratos de Futuro sobre el Bono MY29** el volumen mínimo será de 500 Contratos y el número de Pujas por arriba o por abajo de los corros permitido para registrar una operación de bloque será de 12.
- 9) Para los **Contratos de Futuro sobre el Bono MY31** el volumen mínimo será de 300 Contratos y el número de Pujas por arriba o por abajo de los corros permitido para registrar una operación de bloque será de 14.

- 10) Para los **Contratos de Futuro sobre el Bono NV36** el volumen mínimo será de 300 Contratos y el número de Pujas por arriba o por abajo de los corros permitido para registrar una operación de bloque será de 14.
- 11) Para los **Contratos de Futuro sobre el Bono NV42** el volumen mínimo será de 200 Contratos y el número de Pujas por arriba o por abajo de los corros permitido para registrar una operación de bloque será de 18.
- 12) Para los **Contratos de Futuro sobre el Bono NV47** el volumen mínimo será de 200 Contratos y el número de Pujas por arriba o por abajo de los corros permitido para registrar una operación de bloque será de 18.
- 13) Para los **Contratos de Futuro sobre el DEUA** el volumen mínimo será de 200 Contratos y el número de Pujas por arriba o por abajo de los corros permitido para registrar una operación de bloque será de 1,500, es decir 0.15 pesos en el Precio.
- 14) Para los **Contratos de Futuro sobre el EURO** el volumen mínimo será de 200 Contratos y el número de Pujas por arriba o por abajo de los corros permitido para registrar una operación de bloque será de 1,000, es decir 0.10 pesos en el Precio.
- 15) Derivado del segundo párrafo de la Disposición 5.2 de la Circular 4/2012 “Operaciones Derivadas” emitida por el Banco de México, se dan a conocer los volúmenes mínimos que deberán cumplir las operaciones de **Intercambio sobre Tasas de Interés Nominales Fijas y Tasas de Interés Nominales Variables (TIIE28)**.

En la tabla que se muestra a continuación, se establece el número de Pujas por arriba o por abajo de los corros permitidos para registrar una operación de bloque:

| Rango | | | Volumen | Pujas |
|-------|---|-------|---------|---------------|
| 2x1 | a | 6x1 | 20,000 | 375 (0.0375%) |
| 7x1 | a | 13x1 | 10,000 | 500 (0.05%) |
| 14x1 | a | 52x1 | 2,500 | 625 (0.0625%) |
| 53x1 | a | 130x1 | 1,300 | 750 (0.075%) |
| 131x1 | a | 390x1 | 1,000 | 875 (0.0875%) |

- 16) Para los Contratos de **Intercambio sobre Tasas de Interés Nominales Fijas y Tasas de Interés Nominales Variables (TIIE de Fondeo)** se dan a conocer los volúmenes mínimos que deberán cumplir las operaciones.

En la tabla que se muestra a continuación, se establece el número de Pujas por arriba o por abajo de los corros permitidos para registrar una operación de bloque:

| Rango | | Volumen | Pujas |
|-------|---------|---------|---------------|
| 2F1 | a 6F1 | 20,000 | 375 (0.0375%) |
| 7F1 | a 13F1 | 10,000 | 500 (0.05%) |
| 14F1 | a 52F1 | 2,500 | 625 (0.0625%) |
| 53F1 | a 130F1 | 1,300 | 750 (0.075%) |
| 131F1 | a 390F1 | 1,000 | 875 (0.0875%) |

- 17) Para los **Contratos de Futuro sobre el S&P/BMV IPC** el volumen mínimo será de 100 Contratos y la cantidad de puntos del Índice por arriba o por abajo del punto medio de los corros permitido para registrar una operación de bloque será de 150.
- 18) Para los MINI Contratos de Futuro sobre el S&P/BMV IPC el volumen mínimo será de 500 Contratos y la cantidad de puntos del Índice por arriba o por abajo del punto medio de los corros permitido para registrar una operación de bloque será de 150.
- 19) Para los Contratos de Futuro sobre Acciones Individuales el volumen mínimo estará en función al Precio Futuro de acuerdo con la tabla que se muestra a continuación. El precio registrado podrá estar hasta 3% por arriba o por debajo de los corros de compra y venta al momento de reportar la operación.

| Rango del Precio Futuro | Volumen |
|-------------------------|------------------|
| \$0.01 - \$10.00 | 10,000 contratos |
| \$10.01 - \$25.00 | 4,000 contratos |
| \$25.01 - \$50.00 | 2,000 contratos |
| \$50.01 - \$100.00 | 1,000 contratos |
| \$100.01 - \$200.00 | 500 contratos |
| \$200.01 + | 250 contratos |

- 20) Para los Contratos de Opción sobre el Contrato de Futuro del S&P/BMV IPC derivados de transacciones “cubiertas”, el volumen mínimo será de 50 Contratos y el porcentaje por arriba o por abajo de los corros permitido para registrar una operación de bloque será determinado por MexDer con base en el nivel de los Contratos de Futuro del S&P/BMV IPC y a la delta correspondiente de dicha transacción “cubierta”. Para los Contratos de Futuro del S&P/BMV IPC derivados de transacciones “cubiertas” el volumen mínimo será de 10 Contratos y el precio permitido para registrar una operación de bloque deberá de estar dentro de los corros.
- 21) Para los Contratos de Opción sobre Acciones Individuales el volumen mínimo será de 5,000 Contratos y el precio registrado podrá estar hasta 10% por abajo o por arriba de los corros de compra y venta al momento de reportar la operación.
- 22) Para los Contratos de Opción sobre el Contrato de Futuro del S&P/BMV IPC el volumen mínimo será de 200 Contratos y el precio registrado podrá estar hasta 10% por abajo o por arriba de los corros de compra y venta al momento de reportar la operación.



23) Para los Contratos de Opción sobre el Dólar de los Estados Unidos de América el volumen mínimo será de 200 Contratos y el precio registrado podrá estar hasta 30% por abajo o por arriba de los corros de compra y venta al momento de reportar la operación.

Para todos los casos antes señalados, cuando al momento de reportar una operación de bloque a la Bolsa no existan precios o tasas de compra y/o venta en la Clase y Serie específicas de la Operación, la Bolsa verificará que el precio o tasa de ésta sea justo y razonable.

Asimismo, se informa que en términos del artículo 10066.22 del Reglamento, también serán consideradas como Operaciones de Bloque aquellas Operaciones de Cruce y Operaciones de Autoentrada que, en virtud de su volumen, cumplan con el número mínimo de Contratos señalados anteriormente.

El horario máximo para reportar operaciones de bloque a la Bolsa será de 30 minutos posteriores a la hora de cierre de negociación del Contrato respectivo.

Lo señalado en este aviso entrará en vigor a partir del día **13 de noviembre de 2024**.

Atentamente,

(Rúbrica)

Lic. José Miguel De Dios Gómez
Director General