



México, D.F., a 5 de mayo de 2016.

AVISO DE SITUACIÓN EXTRAORDINARIA

La Dirección General de MexDer, Mercado Mexicano de Derivados, S.A. de C.V. (en lo sucesivo "MexDer"), con fundamento en los artículos 7032.00 y 7033.00 fracción II de su Reglamento Interior y considerando el acuerdo respectivo adoptado por el Comité de Admisión y Nuevos Productos durante la sesión celebrada el pasado 19 de enero con la finalidad de modificar los Términos Específicos de los Contratos de Futuro sobre Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal a Tasa Fija con Emisión Específica, Emisiones M181213, M241205, M310529, M421113 y M210610, declaró el día de hoy la existencia de una Situación Extraordinaria y adoptó la resolución de modificar el mecanismo para calcular el Precio de Liquidación al Vencimiento de los Términos Específicos de los Contratos de Futuro sobre Bonos de Desarrollo del Gobierno Federal a Tasa Fija con Emisión Específica listados en esta Bolsa de Derivados, aumentando un último párrafo al numeral 8. Precio de Liquidación al Vencimiento, de conformidad con lo siguiente:

"Dado que el Precio de Liquidación al Vencimiento está valuado al último Día Hábil de cada vencimiento, cuando se realice una liquidación durante el periodo de entrega y previo a la Fecha de Vencimiento, la Cámara de Compensación deberá calcular el precio de liquidación en especie, de conformidad con lo siguiente:

$$PS_t = \frac{PL}{\left(1 + T * \frac{DxV_t}{360}\right)} + VPC$$

Donde:

PL: Precio de Liquidación del Contrato de Futuro sobre el Bono M (Indicar Emisión).

t : Día de Entrega.

PSt: Precio sucio del bono en el día t redondeado a cinco decimales.

VPC : Valor presente de los cupones cortados a la fecha de Entrega redondeado a seis decimales.

T: Tasa de fondeo gubernamental G2i (Préstamo de bonos M con impuesto) al día t redondeada a 8 decimales.

DxVt : Número de días por vencer del día t al vencimiento del contrato del Futuro sobre el Bono M (Indicar Emisión)."

La mencionada Situación Extraordinaria fue notificada a los participantes del Mercado a través del Sistema Electrónico de Negociación de conformidad con el artículo 7034.00 del Reglamento Interior de MexDer y se mantendrá vigente hasta la fecha en que entre en vigor la modificación a los Términos Específicos de los Contratos de Futuros de Bonos Específicos que alude el párrafo anterior y Asigna realice las modificaciones pertinentes a su Reglamento Interior y Manual de Políticas y Procedimientos, lo cual en su momento, será debidamente informado a los participantes del Mercado, de conformidad con lo establecido en el artículo 7035.00 del Reglamento Interior de MexDer.

Atentamente,

(Rúbrica)

Lic. José–Oriol Bosch Par
Director General