

Ciudad de México, a 16 de enero de 2026.

AVISO A SOCIOS LIQUIDADORES, OPERADORES Y PÚBLICO EN GENERAL

DECLARACIÓN DE SITUACIÓN EXTRAORDINARIA

Con fundamento en lo dispuesto por los artículos 7032.00 y 7033.00 fracción II del Reglamento Interior (“Reglamento”) de esta Bolsa de Derivados, la Dirección General de MexDer, Mercado Mexicano de Derivados, S.A. de C.V. (“MexDer”), informa que, a partir de esta fecha decreta la existencia de una situación extraordinaria respecto de las Condiciones Generales de Contratación (“CGCs”) del Contrato de Futuro sobre el Euro (Liquidación en Efectivo), toda vez que resulta necesario actualizar el nombre de la curva utilizada para realizar el cálculo del Precio de Liquidación Diaria, contenida en el inciso d) del numeral 3, de la sección IV. Liquidación Diaria y Liquidación al Vencimiento. Dicha curva es utilizada como insumo para el cálculo del Precio de Liquidación Diaria en caso de que no se hayan celebrado operaciones durante la sesión de negociación o resultado de una subasta y no existan posturas de compra y venta en firme, vigentes al final de la sesión de negociación o en la subasta. Lo anterior, en términos del documento que se agrega al presente aviso identificado como **Anexo Único**.

Cabe destacar que esta situación extraordinaria ha sido notificada a los Socios Liquidadores, Operadores y Participantes del Mercado a través del Sistema Electrónico de Negociación, en términos de lo dispuesto por el artículo 7034.00 del Reglamento. Dicha situación permanecerá vigente hasta que las modificaciones a las CGCs del Contrato de Futuro sobre el Euro sean aprobadas por las Autoridades, lo cual se comunicará oportunamente por este mismo medio.

Atentamente,

(Rúbrica)

José Miguel De Dios Gómez
Director General



Condiciones Generales de Contratación del Contrato de Futuro sobre el Euro (Liquidación en Efectivo)

I. a III. ...

IV. LIQUIDACIÓN DIARIA Y LIQUIDACIÓN AL VENCIMIENTO.

1. a 2. ...

3. Cálculo del Precio de Liquidación Diaria.

...

a) a c) ...

- d) En caso de que no se hayan recibido posturas de compra y venta en firme para la realización de la subasta, señalada en el inciso IV.3.c) anterior, o 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:

$$PL_t = S_t^{MXPUSD} S_t^{USDEUR} \left(\frac{1 + i_{t,M}^{THEIRS} \left(\frac{M}{360} \right)}{1 + i_{t,M}^{ESTR} \left(\frac{M}{360} \right)} \right)$$

PL_t = Precio de Liquidación del Contrato de Futuro sobre el Euro en el día t , redondeado a la puja más cercana.

S_t^{MXPUSD} = Tipo de cambio SPOT determinado en el día t , (ajustado por la diferencia en días naturales de la fecha valor de dicho tipo de cambio y la fecha valor de operaciones a 24 horas) publicado por el Proveedor de Precios contratado por MexDer.

S_t^{USDEUR} = Tipo de cambio Dólar /EURO valor Spot determinado en el día t , publicado por el Proveedor de Precios contratado por MexDer (ajustado por la diferencia en días naturales de la fecha valor de operaciones a 24 horas).

$i_{t,M}^{THEIRS}$ = Tasa de rendimiento observada el día t , proveniente de la curva **PRTIIEF-IRMXP-TIIE28-IRS**, para el plazo de vigencia del futuro, publicada por el Proveedor de Precios contratado por MexDer.

$i_{t,M}^{ESTR}$ = Tasa de rendimiento observada el día t , proveniente de la curva ESTR, para el plazo de vigencia del futuro, publicada por el Proveedor de Precios contratado por MexDer.

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

t = Día de la valuación o de liquidación.

No obstante lo previsto en los incisos anteriores, en caso de que algún participante del mercado presente a la Bolsa, en tiempo y forma la impugnación sobre el Precio de Liquidación Diaria de alguna Serie, MexDer revisará el proceso de cálculo de este y en caso de que no refleje adecuadamente los niveles que prevalecían durante el periodo del Cálculo del Precio de Liquidación Diaria la Bolsa dará respuesta siguiendo los procedimientos establecidos en su reglamento.

4. ...

V. a VI. ...

* * * * *