

**CAPITULO OCTAVO
MEDIDAS PREVENTIVAS Y DECLARACIÓN
DE SITUACIONES DE EMERGENCIA**

**APARTADO PRIMERO
DISPOSICIONES GENERALES**

800.00

La Cámara de Compensación está facultada para imponer medidas preventivas en aquellos casos en que resulte que un Socio Liquidador o un Operador que administre Cuentas Globales, ha incurrido en alguna de las siguientes conductas:

- I. Que ha incumplido con las obligaciones derivadas de su Operación, incluyendo las cuotas y comisiones.
- II. Que ha incumplido con las obligaciones contenidas en el Reglamento, en el Manual Operativo y/o en cualquier otra disposición emitida por las Autoridades, por la Bolsa o por la propia Cámara de Compensación.
- III. Que se encuentra en condiciones financieras u operacionales anormales.
- IV. Que por la forma de conducir sus operaciones, no le puede ser permitido continuar realizando las mismas.

801.00

El Socio Liquidador o el Operador que administre Cuentas Globales, que se encuentre imposibilitado para cumplir cualquiera de las obligaciones asumidas en términos del Fideicomiso Asigna, del Reglamento, del Manual Operativo, de la normativa expedida por la Bolsa o por las Autoridades, deberá notificar en forma fehaciente e inmediata de esa situación a la Cámara de Compensación.

**APARTADO SEGUNDO
MEDIDAS PREVENTIVAS**

802.00

El Presidente o, en su ausencia, el Director General estará facultado para dictar y ejecutar medidas preventivas cuando resulte que la condición financiera u operativa de un Socio Liquidador o de un Operador que administre Cuentas Globales, así lo exija. La Cámara de Compensación tendrá las más amplias facultades para imponer, en forma simultánea o sucesiva, una o varias de las siguientes medidas:

- I. Imponer al Socio Liquidador o al Operador que administre Cuentas Globales, restricciones en la Operación, mismas que podrán consistir en:
 - a) Prohibir la celebración de Operaciones que incrementen el número de Contratos Abiertos.
 - b) Solicitar el cierre total o parcial de sus Contratos Abiertos.

- II. Exigir el incremento en el monto de su patrimonio mínimo o de su capital mínimo, por encima de lo establecido en las Reglas.
- III. Ordenar al Socio Liquidador o al Operador que administre Cuentas Globales, la transferencia de administración de los Contratos Abiertos en las Cuentas de Clientes, o en su caso, Cuentas de Grupo cumplidos, incluyendo los derechos y obligaciones inherentes a los mismos, así como los Excedentes de Aportaciones Iniciales Mínimas.

El Presidente o, en su caso, el Director General deberá informar en el mismo Día Hábil, de las medidas preventivas adoptadas al Subcomité de Admisión y Administración de Riesgos, a la Bolsa y a las Autoridades.

803.00

Las medidas preventivas enunciadas en la fracción I. del artículo 802.00 deberán ser aplicadas cuando se presente alguno de los siguientes supuestos:

- I. Cuando un Socio Liquidador no cumpla con los requisitos de patrimonio mínimo establecidos por las Autoridades.
- II. Cuando la celebración de Operaciones traiga como consecuencia que un Cliente mantenga un número de Contratos Abiertos que exceda las Posiciones Límite establecidas, salvo en el supuesto establecido en el artículo 336.00
- III. Cuando el Socio Liquidador corra el riesgo de incumplir con sus obligaciones al momento en que uno o varios Clientes incumplan con sus propias obligaciones.
- IV. Cuando las Autoridades así lo soliciten.

804.00

Lo establecido en el artículo 802.00 será sin perjuicio de la facultad de la Cámara de Compensación de requerir al Socio Liquidador la presentación de información adicional sobre su situación financiera, sus procedimientos de control de riesgos; así como información financiera de los Clientes a quienes les compense y liquide Operaciones.

805.00

El Presidente o, en su ausencia el Director General, levantará las medidas preventivas decretadas cuando a su juicio cesen las causas que hubieren dado origen a ellas, debiendo informar al Subcomité de Admisión y Administración de Riesgos, a la Bolsa y a las Autoridades el mismo Día Hábil.

APARTADO TERCERO DECLARACIÓN DE SITUACIONES DE EMERGENCIA

806.00

La declaración de una situación de emergencia deberá ser solicitada a la Bolsa por la Cámara de Compensación, misma que una vez decretada le permitirá imponer las medidas preventivas y/o de emergencia que se establecen en el presente Capítulo, sin perjuicio de la aplicación de otras medidas establecidas en el Reglamento.

807.00

A fin de mantener la integridad financiera del mercado, el Presidente o, en su ausencia, el Director General podrá solicitar a la Bolsa que declare la existencia de una situación de emergencia cuando:

- I. Se incremente el número de Contratos Abiertos y/o la variación del Precio Futuro o Prima de tal forma que las condiciones imperantes en el mercado y/o en el sistema financiero lo justifiquen.
- II. Se aumente en forma inesperada la volatilidad de uno o varios de los Activos Subyacentes, o bien ocurra un cambio en alguna de las variables que incida en la determinación del Precio Futuro o Prima y ello pueda implicar un riesgo sistémico.
- III. Sucedan acontecimientos económicos que puedan incidir en la liquidez y solvencia de los Socios Liquidadores o afectar el sistema financiero en general.

808.00

Cuando la Bolsa declare una situación de emergencia el Presidente o, en su ausencia, el Director General podrá imponer, una o varias de las siguientes medidas, simultánea o sucesivamente,:

- I. Incrementar el monto ordinario de Aportación Inicial Mínima exigido a los Socios Liquidadores.
- II. Realizar una Liquidación Extraordinaria en términos del Capítulo Séptimo.
- III. Establecer en coordinación con la Bolsa, Posiciones Límites inferiores a las establecidas.
- IV. Previa resolución favorable del Presidente o, en su ausencia, del Director General, ordenar que la liquidación en especie de los Contratos de Futuro y Contratos de Opción exigibles en la Fecha de Vencimiento se realice en efectivo en términos del artículo 726.00
- V. Imponer en coordinación con la Bolsa, restricciones a la operación en términos del artículo 802.00

809.00

En caso que el Presidente o, en su caso, el Director General haga uso de las facultades que se consignan en los artículos 807.00 y 808.00, deberá informarlo al Comité Técnico y a las Autoridades el mismo día en que esto ocurra.

810.00

El Presidente o, en su caso, el Director General, levantará las medidas decretadas por una situación de emergencia a petición expresa del Comité Técnico o cuando la Bolsa así lo determine, debiendo informarlo a las Autoridades el mismo día en que esto ocurra.

811.00

La Cámara de Compensación contará con un plan de contingencia en el que se considerarán las medidas operativas, el equipo de respaldo y las facilidades operativas necesarias en las instalaciones de los Socios Liquidadores, que permitan cubrir aquellos eventos que afecten la realización normal de sus actividades, desde sus propias instalaciones.

La Cámara de Compensación podrá decretar la realización de simulacros del plan de contingencia operativa durante Días Hábiles o días inhábiles; será obligación de los Socios Liquidadores y Operadores participar en términos de lo establecido en dicho plan.

812.00

El plan de contingencia elaborado por la Cámara de Compensación contendrá las políticas y procedimientos a seguir por el personal de la Cámara de Compensación y por los Socios Liquidadores, que permitan mantener la continuidad en la compensación, liquidación, vigilancia y registro contable de las Operaciones celebradas en la Bolsa, minimizando el costo y el impacto que se deriven de previsible situaciones de contingencia.

813.00

El plan de contingencia de la Cámara de Compensación deberá establecer políticas y procedimientos de seguridad encaminados a evitar que se interrumpa, altere o impida el flujo de información y procesamiento relacionado con las Operaciones celebradas en Bolsa. Deberá establecerse medidas para enfrentar caídas de sistemas, fallas en la interconexión de los mismos, acometidas en la energía eléctrica, imposibilidad de acceso al área de negociación, recuperación de archivos de información y ocurrencia de desastres.

814.00

En situaciones de contingencia y a solicitud de la Cámara de Compensación, los Socios Liquidadores deberán prestar sus instalaciones físicas, infraestructura de sistemas y medios de comunicación con el fin de evitar la interrupción en el procesamiento de la información de los Contratos negociados.

815.00

El Presidente, o en su ausencia, el Director General, podrá decretar una situación de contingencia.

El Presidente, o en su ausencia, el Director General determinará la duración del plan de contingencia y decretará su terminación.

**APARTADO CUARTO
PLAN DE CONTINGENCIA**

816.00

La Cámara de Compensación contará con un plan de contingencia, en el cual incluirá las medidas operativas que considere necesarias aplicables al personal de la Cámara de Compensación, de los Socios Liquidadores y de los Operadores Administradores de Cuentas Globales, con la finalidad de cubrir aquellas limitaciones que afecten la realización normal de la negociación de Contratos en una situación de contingencia.