

CAPITULO DÉCIMO VIGILANCIA

APARTADO PRIMERO DISPOSICIONES GENERALES

1000.00

La Cámara de Compensación vigilará el cumplimiento del Reglamento y del Manual Operativo, así como a la normatividad aplicable en general, por parte de los Socios Liquidadores y de los Operadores que administren Cuentas Globales y el personal acreditado en términos de lo dispuesto en este Capítulo.

Asimismo, vigilará que los empleados, directivos, y miembros del Comité Técnico de los Socios Liquidadores y los empleados, directivos y miembros del Consejo de Administración de los Operadores que administren Cuentas Globales cumplan, según les corresponda, con los ordenamientos señalados en el párrafo anterior.

1001.00

Las funciones de vigilancia serán desempeñadas por la Cámara de Compensación a través de los medios siguientes:

- I. Seguimiento de los sistemas de compensación y liquidación y sistema de administración de cuentas.
- II. Auditorías a los Socios Liquidadores y a los Operadores que administren Cuentas Globales.
- III. Requerimientos de información.
- IV. Valuación de riesgos y escenarios extremos.
- V. Cualquier otro sistema o medio que determine el Comité Técnico.

1002.00

Los sistemas de compensación y liquidación serán aquellos que la Cámara de Compensación disponga con el fin de monitorear el registro de las Operaciones, los Contratos Abiertos y demás actividades desempeñadas por los Socios Liquidadores y, en su caso, por los Operadores.

1003.00

Las auditorías consistirán en revisiones a los Socios Liquidadores y a los Operadores que administren Cuentas Globales, con el fin de verificar que cumplen con los requisitos establecidos en el Reglamento, en el Manual Operativo, en la normatividad aplicable así como en sus planes generales de funcionamiento y manuales de políticas, procedimientos de operación, control de riesgos y liquidez.

1004.00

Los requerimientos de información consistirán en la solicitud de documentos relacionados con las actividades de los Socios Liquidadores y Operadores que administren Cuentas Globales, que permitan verificar el cumplimiento a la normatividad aplicable. La información requerida deberá proporcionarse con la periodicidad y en los términos que establezca la Cámara de Compensación.

1005.00

La Cámara de Compensación determinará las personas y las áreas encargadas de llevar a cabo las actividades de vigilancia.

1006.00

Los Socios Liquidadores y los Operadores que administren Cuentas Globales sujetos a la inspección y vigilancia de la Cámara de Compensación estarán obligados a prestarle todo el apoyo que les requiera, proporcionando los datos, informes, registros, libros de actas, documentos, correspondencia, y en general, la documentación que la misma estime necesaria, pudiendo tener acceso a sus oficinas, locales y demás instalaciones.

En la documentación a que se refiere el párrafo anterior, queda comprendida la información contenida en los sistemas automatizados de procesamiento y conservación de datos, así como los procedimientos técnicos establecidos para ese objeto, ya sean archivos magnéticos, archivos de documentos microfilmados, procedimientos ópticos para su consulta o de cualquier otra naturaleza.

APARTADO SEGUNDO AUDITORIAS

SECCION PRIMERA DISPOSICIONES GENERALES

1007.00

Para efectos del Reglamento se entenderá como auditoría la revisión, examen y verificación de los contratos, manuales, registros y sistemas operativos y contables de los Socios Liquidadores y de los Operadores que administren Cuentas Globales, con el fin de comprobar el cumplimiento de sus obligaciones contenidas en el Reglamento y en el Manual Operativo.

1008.00

Las auditorías podrán ser llevadas a cabo en cualquier tiempo por la Cámara de Compensación, a través de su personal o de auditores que la misma contrate para tales efectos, de acuerdo con los requisitos que establezca el Subcomité de Auditoría y conforme a lo dispuesto en el presente Capítulo.

1009.00

En ningún caso podrán ser auditores aquellas personas que se encuentren en alguno de los siguientes supuestos:

- I. Dependan de cualquier forma por razón de su empleo, cargo o comisión, o participen en el capital de algún Operador que administre Cuentas Globales o en el patrimonio de algún Socio Liquidador o de las entidades financieras que participen en dicho capital o patrimonio.
- II. Sean cónyuge o tengan parentesco civil o por consanguinidad en línea recta sin limitación de grado, colateral dentro del cuarto grado o por afinidad dentro del segundo grado, con los accionistas, consejeros o directivos del Socio Liquidador o del Operador que administre Cuentas Globales a auditar.
- III. Sean cónyuge o tengan parentesco por consanguinidad en línea directa sin limitación de grado, colateral dentro del cuarto grado o por afinidad dentro del segundo grado, con los directivos, fideicomitentes o integrantes de los comités o subcomités de la Cámara de Compensación.
- IV. Tengan litigio pendiente con la Bolsa, la Cámara de Compensación, con el Socio Liquidador o con el Operador que administre Cuentas Globales a auditar.
- V. Sean auditores externos de la Cámara de Compensación, del Socio Liquidador o del Operador que administre Cuentas Globales a auditar.

1010.00

El Subcomité de Auditoría deberá aprobar la selección y contratación de los auditores, pudiendo en su caso conformar un padrón de auditores que cumplan con los requerimientos que dicho Subcomité establezca para llevar a cabo las auditorías a los Socios Liquidadores.

1011.00

La auditoría podrá llevarse a cabo por personas morales, pero en todo caso deberá designarse un responsable de elaborar y firmar el dictamen de la auditoría respectiva en su carácter de persona física.

1012.00

El Subcomité de Auditoría deberá emitir criterios mínimos que deberán cumplir los auditores para conformar los programas de auditoría que ejecutarán a los Socios Liquidadores y a los Operadores que administren Cuentas Globales.

1013.00

Las auditorías se realizarán por orden expresa de la Cámara de Compensación, debiendo notificar por escrito en forma indubitable la orden y práctica de las mismas a cualquier representante legal con facultades de administración, en las oficinas del auditado.

1014.00

El escrito de notificación de la auditoría deberá contener:

- I. Lugar y fecha de su expedición.

- II. Denominación de la institución fiduciaria del Socio Liquidador o denominación del Operador que administre Cuentas Globales a quien se dirija.
- III. Firma del Director General.
- IV. Transcripción del acuerdo del Comité Técnico por el que se ordena la auditoría.
- V. Lugar o lugares en que deba efectuarse.
- VI. Nombres de las personas designadas para practicar la auditoría.
- VII. Indicación de los aspectos o temas específicos objeto de la auditoría y, en su caso, ejercicios sociales totales o parciales que abarcará la auditoría.
- VIII. Apercibimiento de aplicación de una medida preventiva en caso de negarse a la práctica de la auditoría.

1015.00

El representante legal que reciba el escrito de notificación deberá firmar de recibido una copia del mismo, asentando su nombre, la fecha y la hora de la notificación.

Una vez efectuada la notificación en términos de los artículos anteriores y habiendo acreditado ante dos testigos la identidad de los auditores, el auditado estará obligado a permitir el inicio de la auditoría conforme a lo establecido en el presente Capítulo. Los testigos designados deberán firmar en tal calidad el escrito de notificación.

1016.00

Antes de iniciar la auditoría, el auditor deberá levantar una acta circunstanciada en la que se consignen todos los hechos verificados con motivo de la notificación del inicio de la misma.

El acta a que hace referencia el párrafo anterior deberá estar firmada por el auditor, el representante legal del Socio Liquidador o del Operador que administre Cuentas Globales, así como por dos testigos. En caso de que alguna de las personas antes mencionadas se niegue a firmar, el auditor deberá asentar este hecho.

1017.00

Diariamente los auditores podrán levantar actas parciales en las que consignen todos los hechos verificados durante el día. Las actas parciales deberán estar firmadas por el auditor, el representante legal del Socio Liquidador o del Operador que administre Cuentas Globales y por dos testigos. En caso de que alguna de las personas antes mencionadas se niegue a firmar, el auditor deberá asentar este hecho.

1018.00

Una vez finalizada la auditoría, el auditor deberá levantar una acta circunstanciada en la que se exprese la terminación de la misma.

El acta a que hace referencia el párrafo anterior deberá estar firmada por el auditor, el representante legal del Socio Liquidador o del Operador que administre Cuentas Globales, así como por dos testigos. En caso de que alguna de las personas antes mencionadas se niegue a firmar, el auditor deberá asentar este hecho.

1019.00

De toda auditoría deberá formularse un informe general firmado por el auditor, el cual se presentará a la Cámara de Compensación dentro del plazo que establezca el Subcomité de Auditoría, remitiendo una copia del informe al auditado.

El informe comprenderá los aspectos cuantitativos y cualitativos determinados durante la auditoría y deberán reunir los requisitos que se establecen en el artículo 1020.00

En la preparación de los informes no deberá intervenir el personal del auditado.

1020.00

Los informes generales de las auditorías deberán contener, en lo conducente:

- I. Aspectos o temas específicos objeto de la auditoría practicada y las fechas o los plazos que abarcó.
- II. Los resultados de la auditoría, con una exposición objetiva de las situaciones, pruebas realizadas y hechos determinados.
- III. Los comentarios del auditor, incluyendo su opinión razonada sobre la manera en que el auditado cumple, en relación con el objeto de la auditoría, con las obligaciones establecidas en el Reglamento, en el Manual Operativo y en la normatividad aplicable.
- IV. Las recomendaciones sobre las medidas que deberá adoptar el auditado para facilitar revisiones posteriores así como la inclusión de medidas precautorias para mejorar su desempeño.
- V. El estado de cualquier otro asunto relevante que se presente o conozca que pueda afectar de manera directa o indirecta el desempeño del Socio Liquidador o del Operador que administre Cuentas Globales.
- VI. Las conclusiones y calificaciones sobre el desempeño del auditado, así como las salvedades o excepciones que deriven de su revisión.
- VII. Fecha, nombre y firma del auditor.

El auditor, para respaldar los hechos consignados en los informes, deberá acompañar copia de los documentos que los acrediten, así como todas las actas que se hayan levantado durante el desahogo de la auditoría.

1021.00

El Comité Técnico establecerá las cuotas de auditoría anuales para los Socios Liquidadores y para los Operadores que administren Cuentas Globales.

1022.00

Los auditores y el personal de los mismos tendrán la obligación de observar la mayor confidencialidad respecto de aquella información a la que tengan acceso derivada de sus funciones de auditoría. Dicha obligación deberá incluirse en los contratos que celebre la Cámara de Compensación con los auditores y su incumplimiento dará lugar a la imposición de las penas convencionales previstas en los contratos mencionados y a las sanciones establecidas en las leyes aplicables.

1023.00

Una vez iniciada una auditoría, ésta no podrá suspenderse sin autorización expresa del Comité Técnico.

1024.00

Una vez concluida una auditoría, la Cámara de Compensación podrá iniciar un procedimiento disciplinario si resulta presuntamente alguna violación a la normatividad aplicable por parte del Socio Liquidador o del Operador que administre Cuentas Globales auditado. Asimismo, deberá informar a las Autoridades los resultados del mismo.

**SECCION SEGUNDA
OBLIGACIONES DE LOS SOCIOS LIQUIDADORES Y DE LOS
OPERADORES QUE ADMINISTREN CUENTAS GLOBALES**

1025.00

Los Socios Liquidadores y los Operadores que administren Cuentas Globales auditados deberán facilitar el cumplimiento de cada auditoría otorgando a los auditores, de acuerdo con el objeto de la auditoría, acceso irrestricto a toda la información que haya sido procesada a su nombre directa o indirectamente, por cualquier proveedor externo de servicios financieros sobre alguno de los aspectos siguientes:

- I. Sistema de administración de cuentas.
- II. Sistema de control de riesgos.
- III. Transferencia de fondos para la liquidación.
- IV. Valores aportados a la Cámara de Compensación.
- V. Otros servicios y sistemas relacionados con su operación.

Para efectos de lo anterior, los Socios Liquidadores y los Operadores que administren Cuentas Globales tendrán un plazo de 2 (dos) Días Hábiles para proporcionar la información en poder de proveedores externos solicitada por el auditor, por medio del acta parcial de ese día. El plazo se contará a partir de la fecha en que sea requerida la información por parte del auditor.

1026.00

Los Socios Liquidadores y los Operadores que administren Cuentas Globales auditados, cuando se encuentren sujetos a un proceso de revisión deberán, a fin de dar cumplimiento a la obligación contenida en el artículo 1025.00, poner a disposición de los auditores el equipo de cómputo así como al personal especializado necesario para la práctica de la auditoría por lo que se refiere a la consulta, reproducción o interpretación de reportes en los que conste la información almacenada.

1027.00

Los auditores, en ejercicio de sus funciones y para el mejor cumplimiento de las comisiones encomendadas, podrán copiar la documentación que obre en poder de las personas sujetas a inspección y vigilancia de la Cámara de Compensación, la cual previo cotejo con su original, se anexará a los informes que rindan o a las actas que levanten con motivo de la auditoría.

Cuando en la práctica de una auditoría se conozca un hecho que no pueda ser acreditado con la documentación del Socio Liquidador o del Operador que administre Cuentas Globales auditado, el representante legal o el personal acreditado de éste, considerando la índole de las funciones que desempeñe y a requerimiento expreso de los auditores, deberá rendir de inmediato un informe que describa o precise el hecho de referencia.

1028.00

El incumplimiento a la obligación de aceptar y permitir la práctica de una auditoría ordenada por la Cámara de Compensación o de rendir los informes complementarios o entregar la información que se haya solicitado, dará lugar a la aplicación de medidas disciplinarias en los términos previstos en el Reglamento y se presumirá que dicho Socio Liquidador u Operador que administre Cuentas Globales se encuentra en alguno de los supuestos señalados en los artículos 80000 y/o 802.00

APARTADO TERCERO INFORMACIÓN

SECCION PRIMERA OBLIGACIONES DE LOS SOCIOS LIQUIDADORES Y DE LOS OPERADORES QUE ADMINISTREN CUENTAS GLOBALES

1029.00

Los Socios Liquidadores y los Operadores que administren Cuentas Globales estarán obligados a proporcionar a la Cámara de Compensación, a través de los medios y con las especificaciones que establezca el Reglamento y el Manual Operativo, cualquier tipo de información operativa, financiera, contable y legal, debiendo entregarla en la forma y con la periodicidad que en los mismos se determine.

La Cámara de Compensación podrá requerir a un Socio Liquidador o a un Operador que administre Cuentas Globales en cualquier tiempo que presente con mayor frecuencia la información señalada en el párrafo anterior, así como la relativa al cumplimiento de los requerimientos de patrimonio o de capital. De igual manera, estará facultada para solicitar a cualquier Socio Liquidador u Operador que Administre Cuentas Globales, la presentación de información adicional en la forma y con las especificaciones que determine la propia Cámara de Compensación.

Los Socios Liquidadores y los Operadores que administren Cuentas Globales tendrán el derecho de corregir o modificar la información que proporcionen, siempre que lo hagan dentro del horario y en los plazos establecidos para la entrega de dicha información.

1030.00

En caso que un Socio Liquidador o un Operador que administre Cuentas Globales no proporcione la información a que se refiere el artículo 1029.00, o no lo haga en la forma y con la periodicidad que se establezca, o la información que proporcione no cumpla con las especificaciones establecidas, se hará acreedor a las medidas disciplinarias y medidas preventivas establecidas en el Reglamento.

1031.00

Cuando por caso fortuito o de fuerza mayor, un Socio Liquidador o un Operador que administre Cuentas Globales, no pueda proporcionar, corregir o modificar por los medios aprobados y dentro del horario y plazo establecido al efecto, la información que se le hubiera requerido, la Cámara de Compensación estará facultada para autorizar a dicho Socio Liquidador u Operador que administre Cuentas Globales, a proporcionar, modificar o corregir la información a través de medios distintos a los aprobados, o bien, podrá extender el horario y plazo correspondientes conforme lo exijan las circunstancias del caso.

1032.00

Los Socios Liquidadores y los Operadores que administren Cuentas Globales, tendrán la obligación de pactar con sus Clientes en los contratos de intermediación, la facultad para proporcionar la información relativa a las operaciones de dichos Clientes, a la Bolsa, a la Cámara de Compensación, a entidades supervisoras y reguladoras de otros países por conducto de las Autoridades; así como a los demás Socios Liquidadores y Operadores que administren Cuentas Globales, en los casos de incumplimiento de Contratos de Futuro y Contratos de Opción, cesión de Contratos Abiertos por cuenta de un Socio Liquidador que lleve a cabo la Cámara de Compensación y en cualquier otro supuesto que autorice la Comisión Nacional Bancaria y de Valores.

SECCIÓN SEGUNDA INFORMACIÓN OPERATIVA

1033.00

Los Socios Liquidadores y los Operadores que administren Cuentas Globales, deberán entregar a la Cámara de Compensación, cada vez que ésta así lo requiera, en términos del Reglamento y del Manual Operativo lo siguiente:

- I. Respecto de cada Operación que celebren, un reporte que especifique el número de Cuenta MexDer en la que fue realizada la operación, indicando el volumen, precio, folio y hora.
- II. Respecto de cada Orden ejecutada en la Bolsa, un reporte que contenga el número de folio, hora y minuto, si se trató de una de compra o de una venta, volumen, precio o tasa, subcuenta y cuenta.
- III. Las modificaciones a la asignación de Operaciones entre Cuentas y subcuentas de un mismo Socio Liquidador y/u Operador que administre Cuentas Globales.
- IV. La información relativa a la recepción de Ordenes de Clientes y/u Operador que administre Cuentas Globales.
- V. Las transferencias de Contratos Abiertos entre Socios Liquidadores.
- VI. La identidad del Cliente o Clientes.

1034.00

Los Socios Liquidadores y Operadores que administren Cuentas Globales deberán mantener registros de las Órdenes y Operaciones ejecutadas por un período de al menos 5 (cinco) años.

1035.00

Antes de iniciar operaciones con un Cliente nuevo o administrador de Cuentas Globales cuya Cuenta Global que administre sea nueva, los Socios Liquidadores deberán proporcionar a través del sistema de Cuenta MexDer, administrado por la Bolsa, la información siguiente:

- I. Nombre del Cliente o en su caso identificación de la Cuenta Global.
- II. Fecha de nacimiento o de constitución, según sea el caso. Tratándose de Cuentas Globales, la fecha de su registro en el sistema de Cuenta MexDer.
- III. Registro federal de contribuyentes o su equivalente en el caso de personas extranjeras, lo cual no será aplicable tratándose de Cuentas Globales.
- IV. Dirección, número de teléfono y fax.

- V. En el caso de personas morales, la información relativa a los incisos anteriores de sus representantes legales.

La documentación donde conste la información antes señalada deberá mantenerse disponible por parte de los Socios Liquidadores.

SECCIÓN TERCERA INFORMACIÓN FINANCIERA Y CONTABLE

1036.00

Los Socios Liquidadores deberán entregar diariamente a la Cámara de Compensación y al Contralor Normativo, un reporte en el que señalen su nivel de patrimonio mínimo para realizar Operaciones, señalando la segmentación de los activos que lo constituyan.

Los Operadores que administren Cuentas Globales deberán entregar diariamente a la Cámara de Compensación y al Contralor Normativo, un reporte en el que señalen su nivel de Capital Mínimo para realizar operaciones, señalando la segmentación de los activos que lo constituyan.

1037.00

Los Socios Liquidadores y los Operadores que administren Cuentas Globales, deberán entregar a la Cámara de Compensación sus estados financieros en forma mensual, dentro del mes siguiente a la fecha de cierre del mes correspondiente. Los estados financieros deberán contener la información sobre las inversiones realizadas en el fondo de Excedentes de Aportaciones Iniciales Mínimas y el fondo de patrimonio mínimo.

1038.00

Los Socios Liquidadores y los Operadores que administren Cuentas Globales, deberán entregar a la Cámara de Compensación sus estados financieros anuales dictaminados, dentro de los 5 (cinco) meses siguientes al cierre del ejercicio social respectivo, los cuales tendrán que incluir aquellos elementos adicionales que determine la Cámara de Compensación en materia de productos derivados.

La Cámara de Compensación establecerá los elementos adicionales que deben comprender las auditorías propias de la actividad con Contratos que deberán agregarse a las auditorías contables a que se refiere el párrafo anterior, para ser aceptadas como válidas por la misma.

Siempre que los estados financieros anuales dictaminados carezcan de los elementos adicionales a que se refiere el presente artículo, se considerará como una violación al Reglamento y se aplicarán las medidas disciplinarias previstas en el mismo.

SECCIÓN CUARTA

INFORMACIÓN LEGAL

1039.00

Los Socios Liquidadores deberán informar a la Cámara de Compensación, dentro de los 5 (cinco) Días Hábiles posteriores a la fecha en que ocurra cualquiera de los eventos siguientes:

- I. Cualquier cambio relacionado con el cumplimiento de los requisitos que, para ser Socio Liquidador u Operador que administre Cuentas Globales, se establecen en el Reglamento y el Manual Operativo, así como cualquier cambio de la información que haya proporcionado a la Cámara de Compensación durante el proceso de admisión.
- II. Cualquier requerimiento que le formulen las Autoridades en términos de la Regla cuadragésima primera.
- III. En caso que un Socio Liquidador o que un Operador que administre Cuentas Globales revoque, suspenda o limite las facultades de sus representantes o realice cualquier modificación en la estructura de su Personal Acreditado proporcionada previamente ante la Cámara de Compensación, deberá comunicarlo en forma fehaciente a la Cámara de Compensación, misma que, en tanto no reciba dicha comunicación, presumirá que las personas acreditadas cuentan con facultades suficientes para obligar al Socio Liquidador u Operador que administre Cuentas Globales, correspondiente.
- IV. En caso que un Socio Liquidador u Operador que administre Cuentas Globales, designe a un nuevo representante legal que cuente con facultades suficientes para celebrar las operaciones y los actos necesarios en relación a su actividad en la Cámara de Compensación, deberá entregar un escrito expedido por su delegado fiduciario o representante, en el que conste la firma del representante. El escrito deberá entregarse junto con un testimonio o una copia certificada de la escritura pública en que conste el otorgamiento de dichas facultades.

1040.00

Los Socios Liquidadores deberán informar a la Cámara de Compensación dentro de los 5 (cinco) Días Hábiles posteriores a que ocurra cualquiera de los eventos siguientes:

- I. Las resoluciones por las que se acuerde, según sea el caso, su fusión, escisión, transformación, sustitución de fiduciaria, disolución y liquidación o cualquier otra resolución que afecte la estructura corporativa o contractual de la institución fiduciaria que administre al Socio Liquidador o de la persona moral fideicomitente del Socio Liquidador.
- II. Las resoluciones por las que se acuerde su transformación, sustitución de fiduciario, liquidación o cualquier otra resolución que afecte su estructura organizacional.

- III. El cambio en la ubicación de las oficinas del Socio Liquidador, así como los números telefónicos y de transmisión facsimilar de sus principales funcionarios.
- IV. Cualquier acción disciplinaria que sea impuesta por la Bolsa o las Autoridades en su contra o en contra de su personal acreditado.
- V. El inicio de cualquier procedimiento de concurso mercantil que se lleve en su contra o, en su caso, en contra de los fideicomitentes de su patrimonio mínimo o personal acreditado, así como de cualquier sentencia definitiva por algún delito en contra de cualesquiera de las personas mencionadas.

SECCIÓN QUINTA OBLIGACIONES DE LA CÁMARA DE COMPENSACIÓN

1041.00

La Cámara de Compensación deberá contar con sistemas de transmisión de información a los Socios Liquidadores respecto al número y monto de Contratos compensados y liquidados diariamente y aquellos que hayan sido liquidados en la Fecha de Vencimiento, clasificados por Clase y Serie de Contrato y las Operaciones efectuadas por el Socio Liquidador.

1042.00

La Cámara de Compensación deberá celebrar con la Bolsa un contrato en el que se regulen las relaciones entre ambas instituciones, debiendo pactarse expresamente la obligación de la Cámara de Compensación de sujetarse en todo lo que le sea aplicable al reglamento interior y al manual operativo de la Bolsa, particularmente por lo que se refiere a la información que deba entregar ésta a la Bolsa, en su carácter de entidad que se encuentra bajo la vigilancia de la misma.

1043.00

La Cámara de Compensación deberá informar a la Bolsa y a los Socios Liquidadores, el número y monto de Contratos compensados y, en su caso, liquidados diariamente clasificados por Clase y Serie, así como las Operaciones efectuadas por cada Socio Liquidador.

1044.00

La Cámara de Compensación informará a la Bolsa dentro de un plazo no mayor a 30 (treinta) minutos, la confirmación o rechazo de las operaciones ejecutadas en la sesión de negociación correspondiente, así como el número de Contratos Abiertos por Serie y los valores teóricos al cierre de cada sesión de negociación.

Por su parte, la Bolsa informará a la Cámara de Compensación todas las modificaciones o cancelaciones de transacciones ejecutadas en la misma para realizar los ajustes correspondientes dentro del horario establecido en el Manual Operativo.

1045.00

La Cámara de Compensación estará obligada a informar a la Bolsa y a la Comisión Nacional Bancaria y de Valores, el mismo Día Hábil en que se apliquen medidas preventivas.

**APARTADO CUARTO
EVALUACIÓN DE RIESGOS****1046.00**

La Cámara de Compensación tiene como una de sus funciones vigilar por la integridad financiera del mercado, de ella misma así como la de los Socios Liquidadores; para ello desarrollará una serie de funciones encaminadas a contribuir al control de los principales riesgos a los que se encuentran expuestos los Socios Liquidadores y sus Clientes en la operación con derivados.

1047.00

Para realizar las funciones de control de riesgo adicionales al establecimiento de Aportaciones Iniciales Mínimas y Aportaciones al Fondo de Compensación entre otros, la Cámara de Compensación desarrollará las siguientes actividades:

- I. Evaluación del riesgo mercado en las Cuentas Propias y en las posiciones de Clientes seleccionados.
- II. Vigilancia de las Posiciones Límite.
- III. Derogado.
- IV. Determinar los descuentos aplicables a los títulos aceptados como Aportaciones Iniciales Mínimas.

1048.00

Para realizar la valuación del riesgo mercado, la Cámara de Compensación solicitará a sus Socios Liquidadores la información de los Contratos Abiertos que mantengan los Clientes seleccionados, así como de las respectivas operaciones que realicen durante los horarios de operación. La Cámara de Compensación llevará un cálculo a tiempo real de las pérdidas o ganancias de cada una de las Cuentas que sean enviadas por los Socios Liquidadores.

1049.00

La valuación del riesgo mercado, y de las pérdidas y ganancias que se vayan observando en las Cuentas a las que diariamente se les de seguimiento, serán calculadas de acuerdo al método que defina la Cámara de Compensación.

1050.00

La Cámara tendrá la obligación de vigilar que las Posiciones Límite establecidas, no sean rebasadas por los Socios Liquidadores o por alguno de sus Clientes y por los Operadores que administren Cuentas Globales o por alguno de sus Clientes.

1051.00

En caso de que las Posiciones Límite sean sobrepasadas por los Contratos Abiertos de algún Socio Liquidador, Operador u Operador que administre Cuentas Globales, la Cámara de Compensación procederá a solicitar que sean cerrados hasta alcanzar el límite máximo establecido. Para realizar lo anterior, la Cámara de Compensación le establecerá un plazo y en caso de no realizar las operaciones señaladas por la misma, dicha omisión será considerada como un incumplimiento.

De igual forma, en caso de incumplimiento en las Posiciones Límite, la Cámara de Compensación notificará a la Bolsa para que ella actúe de acuerdo a lo establecido en su reglamento.

1052.00

En caso que la posición abierta de un Cliente sea superior a la Posición Límite establecida, la Cámara de Compensación notificará al Socio Liquidador, Operador u Operador que administre Cuentas Globales respectivo, para que éste proceda a cerrar el número de Contratos Abiertos que rebasen dicho límite. En caso que el Cliente mantenga una cuenta abierta con más de un Socio Liquidador y/u Operador que administre Cuentas Globales y esté violando el límite de Contratos Abiertos por Cliente, la Cámara de Compensación notificará a todos los Socios Liquidadores y/u Operadores que administren Cuentas Globales con los que el Cliente esté realizando Operaciones y les solicitará procedan a cerrar el número de Contratos que ella misma les indique.

El criterio que utilizará la Cámara de Compensación para determinar el número de Contratos que cada uno de los Socios Liquidadores y/u Operadores que administren Cuentas Globales, deberá cerrar a un Cliente será el cálculo a prorrata. La Cámara de Compensación notificará el plazo con el que contará cada uno de los Socios Liquidadores y/u Operadores que administren Cuentas Globales, para cumplir con la obligación.

1053.00

Para poder agregar los Contratos Abiertos de un mismo Cliente con dos o más Socios Liquidadores y Operadores, la Bolsa asignará un número de Cuenta MexDer a cada Cliente, independientemente de los Socios Liquidadores con los cuales esté operando. Este número de cuenta será intransferible y asignado al momento en que el Cliente solicite a un Socio Liquidador la realización por primera vez de la compensación y liquidación de una Operación con Contratos de Futuro y/o Contratos de Opción.

El Socio Liquidador a través del cual el Cliente o el administrador de Cuentas Globales realice la compensación y liquidación de sus Operaciones con Contratos de Futuro y/o Contratos de Opción, será el responsable de solicitar a la Bolsa el registro y asignación del número de Cuenta MexDer.