

CAPÍTULO TERCERO CONDICIONES GENERALES DE CONTRATACIÓN

APARTADO PRIMERO PROCEDIMIENTO DE ALTA DE CONTRATOS

300.00

El procedimiento de alta de Contratos no listados previamente en la Bolsa, se llevará a cabo mediante la entrega de una solicitud de alta de Contratos por parte de la Bolsa a la Cámara de Compensación, misma que deberá contener los requisitos establecidos en las Condiciones Generales de Contratación.

301.00

La solicitud a la que hace referencia el artículo 300.00 será evaluada por la Cámara de Compensación dentro de los tres Días Hábiles siguientes a su recepción, con el fin de que la misma determine el plazo necesario para realizar el alta del Contrato dentro del sistema de compensación y liquidación. Una vez notificado dicho plazo a la Bolsa, la misma deberá expresar su conformidad o, en su caso, solicitar que la Cámara de Compensación lo reduzca.

APARTADO SEGUNDO PROCEDIMIENTO DE ALTA DE SERIES

302.00

El procedimiento de registro de Series de Contratos listados se llevará a cabo mediante la entrega de una solicitud de registro de Series por parte de la Bolsa a la Cámara de Compensación, misma que deberá contener los requisitos y condiciones establecidos en las Condiciones Generales de Contratación.

303.00

La solicitud a que hace referencia el artículo 302.00, deberá ser entregada a la Cámara de Compensación con por lo menos un Día Hábil de anticipación al registro de la Serie de Contrato en el sistema de compensación y liquidación.

304.00

La Cámara de Compensación verificará que la información contenida en la solicitud sea correcta, en caso contrario notificará a la Bolsa con el fin de que proceda a su modificación. La recepción oficial de la solicitud se llevará a cabo hasta el momento en que la solicitud cumpla con todos los requisitos necesarios.

305.00

Las Series serán registradas el día en que sean listadas en la Bolsa, a través de la recepción de las mismas en el intercambio de información diario al momento de establecer comunicación entre los sistemas.

305.01

La Cámara de Compensación establecerá las Posiciones Límite de los Contratos, conforme a los criterios que establezca el Subcomité de Admisión y Administración de Riesgos, siendo éstos los límites a partir de los cuales, no podrán incrementar

el número de Contratos Abiertos o, en su caso, a partir del cual los Socios Liquidadores y Operadores Administradores de Cuentas Globales, deberán dar un especial seguimiento a las actividades en la Bolsa y en la Cámara de Compensación de los Clientes que se encuentren en tal supuesto.

No obstante lo anterior, la Cámara de Compensación, durante la sesión de negociación, podrá reducir las posiciones límite de acuerdo con el volumen que se hubiere operado en el mercado.

305.02

Los Socios Liquidadores y los Operadores Administradores de Cuentas Globales deberán notificar por escrito a la Cámara de Compensación, cada vez que ésta así lo requiera y tanto para cuentas nuevas como para modificación de cuentas ya existentes, las posiciones límite impuestas a cada Cliente, informando el número de Contratos individuales y en posiciones opuestas, por Clase, Serie y Cliente, identificando el número de cuenta, los Excedentes de Aportaciones Iniciales Mínimas y los límites a las posiciones aplicables al Cliente.

305.03

La Cámara de Compensación podrá establecer límites inferiores a las Posiciones Límite en los casos siguientes:

- I. Cuando a juicio de la Cámara de Compensación, una posición represente una concentración excesiva que ponga en riesgo la adecuada formación de precios.
- II. Cuando a juicio de la Cámara de Compensación, la medida coadyuve a preservar la seguridad de los Clientes, Socios Liquidadores y Operadores, Cámara de Compensación y de la propia Bolsa.

305.04

La Cámara de Compensación impondrá la prohibición de apertura de posiciones nuevas a un Socio Liquidador u Operador cuando:

- I. Reduzca su patrimonio o capital por debajo de los requerimientos establecidos para la celebración de operaciones en Bolsa.
- II. No cierre los Contratos Abiertos de Clientes incumplidos y por tal motivo no pueda disponer de los fondos aportados por dicho Cliente, con la finalidad de cubrir el incumplimiento.
- III. Exceda o no reduzca el número de Contratos Abiertos a las Posiciones Límite determinadas conforme a las Condiciones Generales de Contratación.
- IV. Por cualquier otro motivo que la Cámara de Compensación lo estime necesario.

305.05

El Operador que administre Cuentas Globales deberá informar al Socio Liquidador y a la Cámara de Compensación cuando un Cliente que participe en una Cuenta Global exceda las posiciones límite o participe en más de una de las mencionadas cuentas. El Socio Liquidador que administre Cuentas Globales tendrá la misma obligación ante la Cámara de Compensación.

305.06

Los Socios Liquidadores y Operadores, administradores de Cuentas Globales, tienen la obligación de cumplir con los límites que la Cámara de Compensación establezca, a propuesta del Subcomité de Admisión y Administración de Riesgos, los cuales son:

- I. El límite de operación a partir del cual se informará a la Cámara de Compensación la identidad de los Clientes en la Cuenta Global;
- II. El límite de su posición abierta en la Cuenta Global;
- III. El límite de todas las posiciones abiertas netas por Activo Subyacente que podrá tener con la Cámara de Compensación.

Asimismo, tienen la obligación de informar a la Cámara de Compensación, cuando alguno o algunos de sus Clientes de la Cuenta Global sobrepasen los límites antes mencionados.

El límite de operación podrá consistir conjunta o indistintamente en lo siguiente:

1. El establecimiento de límites inferiores a las posiciones límite determinadas conforme a las Condiciones Generales de Contratación.
2. La prohibición de abrir posiciones nuevas.
3. Ordenar el cierre de posiciones.
4. La imposición de límites operativos.

305.07

La Cámara de Compensación podrá solicitar a la Bolsa la suspensión preventiva de un Socio Liquidador o de un Operador que administre Cuentas Globales, cuando no cierre los Contratos Abiertos de un Cliente que la Cámara de Compensación haya detectado y solicitado cerrar evitando no rebasar las Posiciones Límite y que tenga Contratos Abiertos con distintos Socios Liquidadores y Operadores.

APARTADO TERCERO POSICIONES LIMITE Y POSICIONES DE COBERTURA

306.00

Los Socios Liquidadores que deseen solicitar autorización para mantener una posición abierta superior a la Posición Límite establecida, en términos del Reglamento, para una Serie, deberán enviar una carta dirigida al Director General que contenga la siguiente información:

- I. Posición que desean cubrir.
- II. Número de Contratos que desean mantener abiertos señalando Clase y Serie de los mismos.
- III. Plazo de la cobertura.
- IV. Declaración bajo protesta de decir verdad de que dicha información refleja la verdad y que cualquier dato falso conllevará a la imposición de la medida disciplinaria correspondiente.

Cuando la solicitud a que hace referencia el presente artículo, se solicite a nombre de un Cliente, esta declaración deberá de ser firmada por el Cliente con el “visto bueno” del Socio Liquidador.

307.00

Será responsabilidad del Socio Liquidador notificar a la Cámara de Compensación el momento en que deje de tener aplicación la posición de cobertura, debiendo sujetarse a las Posiciones Límites establecidas en términos del Reglamento.

308.00

El Socio Liquidador documentará y mantendrá a disposición de la Cámara de Compensación, la información relativa a la existencia de posiciones en otros mercados distintos a la Bolsa, o de otro tipo de operaciones de naturaleza mercantil que motiven la creación de posiciones de cobertura.