

CAPITULO NOVENO INFORMACIÓN

APARTADO PRIMERO DISPOSICIONES GENERALES

900.00

El intercambio de información previo al inicio de cualquier sesión de negociación entre el sistema de compensación y liquidación de la Cámara de Compensación y el sistema de negociación de la Bolsa se efectuará a partir de las 6:30 y hasta las 6:45 horas.

La Cámara de Compensación y la Bolsa confirmarán diariamente que toda la información relativa a Socios Liquidadores, Operadores y Contratos sea la correcta.

901.00

La Cámara de Compensación y la Bolsa contarán con una base de datos que contendrá la información necesaria para realizar los análisis que fundamenten la toma de decisiones en la administración de riesgos, así como la reconstrucción y análisis de las Operaciones para una fecha determinada. Asimismo, estarán facultadas para la difusión de información e indicadores sobre la actividad del mercado de derivados.

902.00

La Cámara de Compensación y la Bolsa respaldarán toda la información que generen o reciban microfilmada o grabada en cintas y/o discos ópticos y mantendrán la información por al menos cinco años.

Asimismo, mantendrán un archivo donde se almacenará la información registrada en papel, tales como reportes, actas, y todo tipo de documentación que avale y respalde las operaciones propias de la Cámara de Compensación.

903.00

La Cámara de Compensación y la Bolsa tendrán a disposición de las Autoridades toda la información almacenada en caso de ser requerida para cualquier tipo de aclaración y auditorías.

904.00

Los Socios Liquidadores y los Operadores que administren Cuentas Globales deberán mantener toda la información correspondiente a sus Operaciones, a la compensación y liquidación a nivel de Clientes individuales, así como toda aquella información de tipo financiera y administrativa al menos por 5 (cinco) años.

APARTADO SEGUNDO
REPORTES DEL SISTEMA DE COMPENSACIÓN Y LIQUIDACIÓN

905.00

Para efectos de lo establecido en el presente Apartado, los reportes generados por el sistema de compensación y liquidación podrán ser emitidos con la siguiente frecuencia (Frec.):

- I. Diario (D)
- II. Semanal (S)
- III. Mensual (M)
- IV. Anual (A)
- V. Eventual (R)
- VI. Al vencimiento de una Serie (T)
- VII. Especial (E)

906.00

Los Reportes que cada uno de los Socios Liquidadores recibirá generados por el sistema de compensación y liquidación son los siguientes:

Rep. ID	Frec.	Descripción
MA01	D	Importe de los valores depositados como Aportación Inicial Mínima.
MA45	D	Fondo de Compensación.
MD01	R/T	Detalle liquidación en especie de los Contratos de Opción.
MD55	D	Contratos Futuros pendientes de liquidación por entrega.
MP01	D	Resumen de la posición abierta en Contratos de Opción del Socio Liquidador y del Operador por Cuenta y por Contrato.
MP02	D	Posiciones abiertas en Contratos de Opción a nivel subcuenta por Serie.
MP03	D	Resumen de la Posición abierta del Socio Liquidador, Operador y Formador de Mercado por cuenta-subcuenta y por Contrato.
MP51	D	Resumen de la posición abierta del Socio Liquidador, Operador y Formador de Mercado por Cuenta y por Contrato.
MP52	D	Posición de Futuros a nivel subcuenta por Serie.
MS01	D	Síntesis de la Liquidación Diaria del Socio Liquidador.
MS05	D	Intereses diarios sobre saldos en efectivo invertidos y tasa aplicada.
MS11	D	Detalle de la liquidación diaria, desglosado en Cuenta Propia, de Terceros y Formador de Mercado para todos los Socios Liquidadores y Operadores.

MS22	D	Requerimiento de Aportaciones Iniciales Mínimas por tipo de Contrato y Cuenta acorde a las posiciones del Socio Liquidador y del Operador.
MS32	D	Aportaciones Iniciales Mínimas (Liquidación Extraordinaria).
MS79	R	Instrucciones de débitos por Liquidación Extraordinaria.
MS49	D	Instrucciones de débito por Liquidación Diaria.
MS50	D	Instrucciones de crédito por Liquidación Diaria.
MS59	T	Instrucciones de débito por liquidación en especie del Activo Subyacente.
MS60	T	Instrucciones de crédito por liquidación en especie del Activo Subyacente.
MT02	R/T	Detalle Ejercicio/ Asignación por Socio Liquidador y Operador.
MT05	D	Detalle Operación por Cuenta, por Socio Liquidador y Operador en Contratos de Opción.
MT12	D	Comisiones en Contratos de Opción. Por Socio Liquidador, Operador, Cuenta y subcuenta.
MT48	M	Resumen mensual de cobro de comisiones.
MT49	D/M	Reporte diario y resumen mensual del impuesto al valor agregado sobre comisiones.
MT55	D	Posición neta por Contrato y pérdidas y ganancias por variación de precios, desglosado por Cuenta.
MT62	D	Relación de Operaciones realizadas y comisiones por cobrar al Socio Liquidador, Operador y Formador de Mercado por cada Cuenta.
MT82	T	Relación de entregas y recepciones de Activos Subyacentes.
MX01	T	Detalle del Ejercicio automático al vencimiento de Contratos de Opción propuesto por la Cámara de Compensación a los Socios Liquidadores.
MX11	T	Detalle del Ejercicio automático al vencimiento de Contratos de Opción sobre Contratos de Futuro propuesto por la Cámara de Compensación a los Socios Liquidadores.

907.00

La Cámara de Compensación generará a través del sistema de compensación y liquidación los siguientes reportes:

Rept. ID	Frec.	Descripción
CA03	D	Aportaciones Iniciales Mínimas en valores por tipo de valor.
CA10	D	Aportaciones Iniciales Mínimas en valores por Socio Liquidador.
CA75	D	Requerimientos de Aportación al Fondo de Compensación.
CD01	R/T	Detalle del Ejercicio / Asignación.
CD02	R/T	Reporte del Ejercicio / Asignación por Cuenta, Socio Liquidador y Operador.
CD51	R/T	Detalle de Entrega / Asignación PEPS.
CD52	R/T	Reporte de la asignación de entregas PEPS.
CD54	R/T	Reporte de posiciones para asignación PEPS.

CD59	T	Liquidaciones de Contratos de Futuro en especie pendientes de ejecución.
CE01	D	Resumen de pérdidas y ganancias en Contratos de Futuro.
CF01	E	Relación de Socios Liquidadores y Operadores.
CF03	E	Relación de Depositantes.
CF04	E	Relación de Series Listadas.
CF07	D	Tabla del status diario de Contratos de Opción.
CF10	D	Reporte de Operaciones a detalle.
CF11	D	Clases listadas.
CF13	D	Relación de transferencias de posiciones.
CF14	D	Relación de modificaciones de posición.
CF15	R/M	Ejercicio de Opciones
CF16	R	Liquidaciones en especie.
CF17	D	Relación de transferencias no realizadas.
CF20	D	Relación de transferencias de Cuentas.
CF22	E	Reporte de ajuste de Contratos.
CF24	D	Precios de liquidación de Contratos de Futuro y de Contratos de Opción.
CF29	E	Relación de cuentas bancarias de liquidación de los Socios Liquidadores.
CF30	E	Relación de cuentas bancarias de la Cámara de Compensación.
CF99	D	Huellas de auditoría.
CH05	D	Resumen diario de negociación y Contratos Abiertos.
CH15	S	Resumen semanal de negociación y Contratos Abiertos.
CH25	M	Resumen mensual de negociación y Contratos Abiertos.
CH35	A	Resumen anual de negociación y Contratos Abiertos.
CP01	D	Posiciones Abiertas en Contratos de Opción por Socio Liquidador, desglosado por Cuenta.
CP02	D	Posiciones Abiertas en Contratos de Opción por Serie desglosado por Cuenta y subcuenta, Socios Liquidadores y Operadores.
CP51	D	Posiciones Abiertas en Contratos de Futuro por Socio Liquidador, desglosado por Cuenta, Socios Liquidadores y Operadores.
CP52	D	Posiciones Abiertas por Serie desglosado por Cuenta y Socios Liquidadores.
CP53	D	Participación por Socio Liquidador en el total de Contratos Abiertos por Cuenta en cada Serie.
CP55	R/T	Reporte de Posiciones Largas PEPS.
CR02	D	Valores teóricos.
CR05	D	Valores teóricos intradía.
CR06	D	Relación de Aportaciones Iniciales Mínimas respecto al valor neto de capital.
CS01		Resumen de la Liquidación Diaria por Socio Liquidador, desglosado por Cuenta.
CS03	D	Resumen del Requerimiento de Aportaciones Iniciales Mínimas por Socio Liquidador, desglosado por Cuenta.
CS06	D	Liquidación Extraordinaria, por Socios Liquidadores y Operadores, desglosado por Cuenta.

CS07	D	Resumen de movimientos de efectivo por Socio Liquidador y desglosado por Cuenta y fondo.
CS08	D	Relación de requerimientos de Aportaciones intradía.
CS11	D/M	Reporte de Acumulación de Intereses.
CS15	D/M	Reporte Mensual de Intereses por Socio Liquidador, Operador y Cuenta.
CS49	D	Instrucciones al banco liquidador de cargos a Cuentas de Socios Liquidadores por Liquidación Diaria.
CS50	D	Instrucciones al banco liquidador de abonos a Cuentas de Socios Liquidadores por Liquidación Diaria.
CS59	T	Instrucciones al banco liquidador de cargos a Cuentas de Socios Liquidadores por liquidación en especie.
CS60	T	Instrucciones al banco liquidador de abonos a Cuentas de Socios Liquidadores por liquidación en especie.
CS79	R	Instrucciones de crédito Liquidación Extraordinaria.
CT09	R	Rechazo de transacciones de depósito de valores.
CT10	D	Huella de auditoría de depósito de valores.
CT11	D	Instrucciones de depósitos y retiros de Aportaciones Iniciales Mínimas en valores.
CT14	D	Instrucciones de depósitos y retiros de efectivo.
CT15	R	Detalle de la negociación en Contratos de Opción (captura manual contingente).
CT16	R	Detalle de la negociación en Contratos de Futuro (captura manual contingente).
CT43	A	Comisiones por compensación del inicio de año a la fecha.
CT45	M	Reporte mensual de comisiones.
CT46	M	Reporte mensual de comisiones generado por Clase y desglosado por Cuenta.
CT49	M	Reporte mensual del IVA acumulado diario.
CT88	D	Relación de Operaciones canceladas.
CT89	D	Relación de Operaciones rechazadas.
CT90	D	Reporte de Contratos negociados por Clase por Socio Liquidador.
CT97	D	Detalle de la negociación de Contratos de Opción.
CT98	D	Relación de Operaciones pactadas durante la negociación de Contratos de Futuro y Contratos de Opción.
CT99	D	Resumen de la negociación.

908.00

Las notificaciones que realicen los Socios Liquidadores y Operadores que administren Cuentas Globales a la Cámara de Compensación y viceversa podrán llevarse a cabo a través de los siguientes medios, salvo cuando se especifique un medio especial para algún caso en particular:

- I. Personalmente. En caso de realizar alguna notificación por este medio cuya entrega se encuentre sujeta a un plazo o término, se tendrá como fecha de presentación, la del día en que se entregue la notificación en el domicilio respectivo. La recepción de las notificaciones por este medio deberá demostrarse con el debido acuse de recibo de la persona a la que va dirigida o,

Fecha de publicación
25 de agosto de 2009.

en su ausencia, de alguna persona que se encuentre en el domicilio del destinatario.

- II. Por mensajería o correo certificado. En caso de realizar alguna notificación por este medio cuya entrega se encuentre sujeta a un plazo o término, se tendrá como fecha de presentación, la del día en que se entregue la notificación en la empresa de mensajería contratada o en la oficina de correos respectiva. La recepción de las notificaciones por este medio deberá demostrarse con el debido acuse de recibo de la empresa de mensajería contratada o de la oficina de correos.
- III. Sistema de transmisión de documentos por línea telefónica o facsímil, debiendo enviar posteriormente el original por alguno de los medios establecidos en las fracciones anteriores. En caso de realizar alguna notificación por este medio cuya entrega se encuentre sujeta a un plazo o término, se tendrá como fecha de presentación, la del día en que sea debidamente transmitido el escrito al número telefónico que el destinatario le haya hecho saber al remitente. La recepción de las notificaciones por este medio deberá demostrarse con el debido acuse de recibo que emita el facsímil utilizado. Asimismo, el remitente deberá confirmar vía telefónica con el destinatario la recepción del escrito enviado por este medio.