

Reglamento del Contrato de Futuros sobre LEBAC en pesos

1.1. Activo subyacente: podrán constituir activo subyacente las Letras del Banco Central (LEBAC) en pesos cuyo plazo a vencimiento en la fecha de vencimiento del contrato de futuros sea de un (1) mes, dos (2) meses y tres (3) meses. De esta manera:

- Futuro sobre LEBAC a un (1) mes: se liquidará mediante la entrega/recibo de una Letra cuyo plazo restante, en la fecha de vencimiento del contrato de futuros, sea entre 28 y 35 días.
- Futuro sobre LEBAC a dos (2) meses: se liquidará mediante la entrega/recibo de una Letra cuyo plazo restante, en la fecha de vencimiento del contrato de futuros, sea entre 56 y 63 días.
- Futuro sobre LEBAC a tres (3) meses: se liquidará mediante la entrega/recibo de una Letra cuyo plazo restante, en la fecha de vencimiento del contrato de futuros, sea entre 84 y 98 días.

1.2. Tamaño del contrato: cada contrato será equivalente a \$1.000.000 (pesos argentinos un millón) de Valor Nominal.

1.3. Moneda de negociación y Cotización: Cada contrato será denominado, cotizado, negociado, registrado, ajustado y compensado en pesos. La cotización se realizará en pesos por cada mil pesos de Valor Nominal, con tres decimales.

Dicho precio corresponde a una tasa nominal anual con base a 365 días, aplicando el siguiente cálculo:

$$T = (1000/\text{Precio Cotizado} - 1) * 365/P$$

Donde:

T= Tasa nominal anual con base a 365 días.

P= Plazo de la letra en días corridos.

1.4. Series Disponibles: se podrán listar series con vencimiento en todos los meses del año. El procedimiento de listado será informado por Comunicación.

1.5. Horario habilitado para la negociación: Será determinado por el Directorio del Mercado mediante Comunicación.

1.6. Fecha de vencimiento y último día de negociación: Será el martes previo al tercer miércoles del mes del contrato. Si el martes es inhábil, el vencimiento será el día miércoles. En el caso de que el horario

de finalización de la rueda de negociación sea distinto para el día de vencimiento por cuestiones relacionadas al procedimiento de entrega, tal circunstancia será informada por Comunicación.

1.7. Variación mínima de precio: La variación mínima de los precios del contrato será de \$ 0,005 (pesos cinco milésimos) por cada mil pesos de Valor Nominal, equivalentes a \$5 (pesos cinco) por contrato.

1.8. Variación máxima de precio: Se adoptará un sistema de límites de fluctuación de precios de hasta, cómo máximo, un valor equivalente al 100% de los márgenes exigidos por la Cámara Compensadora. Esta variación máxima no se aplicará los días primero y último de negociación de cada vencimiento, o cuando el día anterior haya sido día no hábil de acuerdo al artículo 1.1.3 del Reglamento Interno de ROFEX.

1.9. Márgenes de garantía y Diferencias diarias: Serán determinados por la Cámara Compensadora.

1.10. Forma de liquidación: las posiciones abiertas al final de la última rueda de negociación serán liquidadas con entrega/recepción del activo subyacente a las 24 hs. hábiles siguientes (T+1), si el día de vencimiento fuera un día martes. Si el día de vencimiento fuera miércoles, las posiciones abiertas al final de la última rueda de negociación, se liquidarán el mismo día (T+0), de acuerdo al procedimiento de entrega establecido por la Cámara Compensadora.

El Mercado publicará el Código de especies elegibles para la entrega en cada vencimiento.

2. Supuestos no Previstos: Cualquier otro aspecto que no se encuentre cubierto en forma específica por las presentes disposiciones, será determinado de acuerdo al Reglamento Interno y Estatuto del Mercado o las resoluciones que el Comité del Contrato o el Directorio puedan adoptar, en virtud de las facultades legales, estatutarias o reglamentarias que se encuentren en vigencia.

3. Emergencia: Si la Gerencia, el Directorio o el Comité del Contrato estimaren que el procedimiento de liquidación de cualquier serie, o cualquier otro aspecto de la negociación del contrato podría ser afectado por hechos o resoluciones del gobierno, de la autoridad de supervisión, de otros organismos o por casos extraordinarios, fortuitos o de fuerza mayor, citarán, en el momento, a una reunión especial del Comité del Contrato o del Directorio y expondrán sobre las condiciones de emergencia. Si el Comité del Contrato o el Directorio determinan que existe una emergencia, se tomarán las resoluciones que consideren apropiadas para preservar o restaurar el normal funcionamiento o continuidad de la negociación del contrato y/o salvaguardar los intereses de los participantes y la normalización, continuidad y subsistencia del mercado y la decisión será efectiva, final y definitiva respecto de todas las partes intervinientes en el contrato.