



Futuro del Dólar

Descripción

- Actualmente el peso mexicano es una de las monedas más operadas en el mundo, la tercera más operada de Norte América y la primera de Latinoamérica.
- El Peso se ha convertido en la principal moneda de cobertura para países emergentes de la misma región geográfica, cuyas monedas no tienen suficiente liquidez.
- El nivel de rendimiento de instrumentos financieros nacionales, genera importantes flujos de capital extranjero con lo cual se incrementan las operaciones cambiarias.
- Es un producto muy útil para hacer sintéticos de tasas debido a que contamos con vencimientos Diarios de Futuros, es posible operar Spreads con los vencimientos mensuales.

Características

Subyacente:	Dólar de los Estados Unidos de América
Tamaño del contrato:	\$10,000 Dólares
Periodo del contrato:	Diario, mensual y trimestral hasta por 15 años
Clave de Pizarra:	DA
Unidad de cotización:	Pesos por Dólar
Puja:	0.0001 Pesos
Valor de la Puja:	\$1 Peso
Ratio Puja/Tarifa:	0.31 veces
Margen Inicial Mínimo:	\$12,480 Pesos
Marginación Opuesta:	\$1,170 Pesos
Horario de negociación:	7:30 a 14:00 horas (hora central)
Ultimo dia de negociación:	El lunes en la semana correspondiente al tercer miércoles del mes de vencimiento
Fecha de vencimiento:	El lunes en la semana correspondiente al tercer miércoles del mes de vencimiento
Liquidación al vencimiento:	En especie
Bloomberg <MMDD>	DSA<CRNCY>CT
Reuters MXN/FUTEX1	0#MXP:

Características

- Margen inicial mínimo (*) de \$13,400.00 → Apalancamiento 14:1
- Series listadas:
 - Diarias (hasta por un año);
 - Mensuales;
 - Trimestrales; o
 - Hasta por 15 años.
- La liquidación al vencimiento es valor 48 horas (T + 2)
- Símbolo o Clave de Pizarra Futuro (ejemplo):

DA19 DC20, donde:

19 = Día del vencimiento

DC = mes del vencimiento

20 = año de vencimiento

*El Socio Liquidador puede solicitar Márgenes Excedentes

Aplicación del Futuro del Dólar en MexDer

■ Cobertura:

- Importadores con compromisos en dólares
- Exportadores que reciban flujos en dólares
- Créditos en dólares
- Financiamientos en dólares como compra de infraestructura

■ Arbitraje:

- Futuro de Dólar en MexDer vs Futuro del Peso en CME Group
- Cualquier otra divisa correlacionada con el peso

■ Estrategias:

- Fondeo de Dólares
- Tasas de interés sintéticas en pesos y dólares (Engrapado de divisas)

Ventajas

- El tamaño del contrato en MexDer es más pequeño que el contrato del peso en CME por lo que permite mayor flexibilidad para realizar coberturas más precisas.
- Nivel de interés abierto alto = coberturas reales.
- Cotización, liquidez y profundidad constante en los primeros 9 vencimientos mensuales.
- Vencimientos diarios disponibles.
- La profundidad de los corros de MexDer facilita la negociación de grandes volúmenes en un menor número de ejecuciones.
- Facilidad operativa.

Pantalla de Operación

+/-	Flag	Code	P.O	Symb	Name	Qty	Bid	Ask	Qty	Time	Last	LQty	S	G	Var%	Var	Time	Volume	Cap.	Open	Max	High	Low	
					DOLAR:F20 Unknown or Expired																			
				DEUAFJN20	DA30 FvsU 1	100	0.3691	0.3729	100												0.0000			
				DEUAFMR20	DA30 FvsU 1	100	0.1195	0.1217	100												0.0000			
				DEUAFSP20	DA30 FvsU 1	100	0.6205	0.6259	100												0.0000			
			33	DA17FB20	DOLAR;G20	150	18.8646	18.9204	150												0.0000			
				DEUAB0C0	DOLAR Spread G20H20	1,000	-0.0870	-0.0735	672												0.0000			
				DEUAB0D0	DOLAR Spread G20J20	671	-0.1630	-0.1490	611												0.0000			
				DEUAB0E0	DOLAR Spread G20K20	794	-0.2600	-0.2455	633												0.0000			
			363,738	DA13MR20	DOLAR;H20	150	18.9414	18.9972	150		18.9750		1		0.12%	0.1645	12:50:42	8,738		18.8750	18.9750	18.9750	18.8750	
				DEUAC0D0	DOLAR Spread H20J20	691	-0.0830	-0.0680	1,000												0.0000			
				DEUAC0E0	DOLAR Spread H20K20	647	-0.1795	-0.1645	1,000												0.0000			
				DEUAC0F0	DOLAR Spread H20M20	809	-0.2555	-0.2400	1,000												0.0000			
			44	DA13AB20	DOLAR;J20	150	19.0206	19.0770	150												0.0000			
				DEUAD0E0	DOLAR Spread J20K20	780	-0.1045	-0.0890	625												0.0000			
				DEUAD0F0	DOLAR Spread J20M20	845	-0.1800	-0.1645	554												0.0000			
				DEUAD0G0	DOLAR Spread J20N20	636	-0.2580	-0.2410	515												0.0000			
				DEUAD0H0	DOLAR Spread J20Q20	759	-0.3545	-0.3360	764												0.0000			
			14	DA18MY20	DOLAR;K20	150	19.1172	19.1736	150												0.0000			
				DEUAE0F0	DOLAR Spread K20M20	825	-0.0830	-0.0680	636												0.0000			
				DEUAE0G0	DOLAR Spread K20N20	787	-0.1625	-0.1445	690												0.0000			
				DEUAE0H0	DOLAR Spread K20Q20	698	-0.2585	-0.2400	645												0.0000			
			205,560	DA15JN20	DOLAR;M20	150	19.1910	19.2468	150		19.2266		1		0.00%	0.1661	12:33:26	8,480		19.2266	19.2266	19.2266	19.2266	
				DEUAF0G0	DOLAR Spread M20N20	559	-0.0855	-0.0690	723												0.0000			
				DEUAF0H0	DOLAR Spread M20Q20	679	-0.1820	-0.1630	804												0.0000			
			2	DA13JL20	DOLAR;N20	150	19.2678	19.3278	150		19.2736		1		0.78%	0.1492	12:37:23	1		19.2736	19.2736	19.2736	19.2736	
				DEUAG0H0	DOLAR Spread N20Q20	606	-0.1050	-0.0885	630												0.0000			
				DA17AG20	DOLAR;O20	150	19.3626	19.4232	150												0.0000			
				DA14SP20	DOLAR;U20	25	19.4091	19.5360	25												0.0000			
				DA19OC20	DOLAR;V20	25	19.5023	19.6299	25												0.0000			
				DA13NV20	DOLAR;X20	25	19.5787	19.7072	25												0.0000			
			8,675	DA14DC20	DOLAR;Z20																0.0000			

MexDer en los Vendors

Consulta MexDer en:

- Bloomberg: MMDD <GO>
- Thomson Reuters: 0#MEXDER-MEXICO
- SiBolsa - App

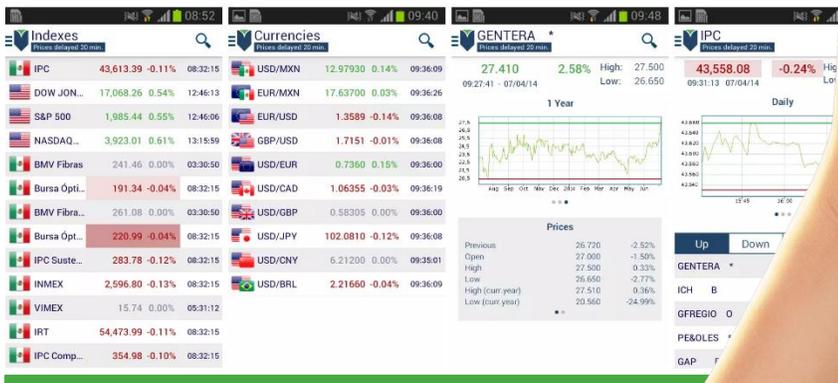
Claves de Consulta en Vendors

	Bloomberg	Thomson Reuters
Consulta General MexDer	MMDD <GO>	MX/FUTEX1
Consulta General Futuros	MMDF <GO> +2 <GO>	MXN/FUTEX1
Consulta General Opciones	MMDO <GO> +3 <GO>	MXN/OPT1
Consulta General SWAPS		MXN/SWAP1
Nodos más comunes SWAPS	MMDD <GO> 6 <GO> 7 <GO>	MXNIRS=XD
S&P/BMV VIX (Índice de Volatilidad México)	SPBMVVIX Index <GO>	.SPBMVVIX
Factores de Conversión		MX/FACTOR1

SiBolsa



AHORA LA **BOLSA**
EN TUS MANOS



Contrataciones:

Productos de Información
ventaspi@grupobmv.com.mx
 +52 (55) 5342 9272



Mercados

Índices	Divisas	M.Primas	MexDer
Futuros IPC			
IPC Mz18	50,310.000	0.22%	11:13:28
IPC Jn18	51,241.000	0.00%	11:13:28
Futuros Mini IPC			
MIP Mz18	50,260.000	0.12%	11:13:28
MIP Jn18	51,241.000	0.00%	09:24:24
Futuros DOLAR			
USDolar Fb18	18.944	0.00%	11:14:49
USDolar Mz18	18.827	0.06%	11:14:50
USDolar Ab18	18.910	0.05%	11:14:49
USDolar My18	19.020	0.07%	11:14:49
Futuros DC24			
DC24 Mz18	116.300	0.00%	09:47:46



MexDer en los Vendors: Contratos de Futuro

FUTUROS

	Bloomberg	Thomson Reuters
DIVISAS		
Dólar de los Estados Unidos de América	DSA<CRNCY>CT	0#MXP:
Contratos diarios del Dólar	DSDAILY<CRNCY>CT	0#MXPD:
Euro (moneda de curso legal de la Unión Europea)	BEA<CRNCY>CT	0#EURO
INDICES		
	<INDEX>	
S&P/BMV IPC	ISA<INDEX>CT	0#IPC:
MINI S&P/BMV IPC	MIPA<INDEX>CT	0#MIP:
ACCIONES		
	SFUT MD	MXN/FUTEX2
DEUDA		
TIIIE de 28 días	DOA<CMDTY>CT	0#TII:
Engrapados TIIIE de 28 días	MMDD <GO> --> 4 --> 7	
Futuro SWAP Entregable 10 años	SWTA<CMDTY>CT	0#SWA10:
Futuro SWAP Entregable 2 años	SWDA<CMDTY>CT	0#SWA02:
CETES de 91 días	GMA<CMDTY>CT	0#CTE:
Bono de 3 años	MAA<CMDTY>CT	0#BNO:
Bono de 10 años	DWA<CMDTY>CT	0#B10:
Bono de 20 años	VYBA<CMDTY>CT	0#B20:
Bono de 30 años	VYCA<CMDTY>CT	0#B30:

MexDer en los Vendors: Contratos de Futuro

FUTUROS

	Bloomberg	Thomson Reuters
BONOS ESPECÍFICOS		
JN20 (M200611)	ZUYA <CMDTY>CT	0#JN20B:
JN21 (M210610)	DTOA <CMDTY>CT	0#JN21B:
JN22 (M220609)	ZUOA <CMDTY>CT	0#JN22B:
DC24 (M241205)	DCYA <CMDTY>CT	0#DC24B:
MR26 (M260305)	MZRA <CMDTY>CT	0#MR26B:
JN27 (M270603)	ZUAA <CMDTY>CT	0#JN27B:
MY31 (M310529)	MYOA <CMDTY>CT	0#MY31B:
NV36 (M361120)	ZTLA <CMDTY>CT	0#NV36B:
NV42 (M421113)	DCLA <CMDTY>CT	0#NV42B:
NV47 (M471107)	ZSSA <CMDTY>CT	0#NV47B:

MexDer en los Vendors: Contratos de Futuro

OPCIONES

	Bloomberg	Thomson Reuters
DIVISAS		
Dólar de los Estados Unidos de América (Da)	MXX<CURRENCY>OMON	0#DA*.XD
INDICES		
S&P/BMV IPC	ISA<INDEX>OMON	0#IPC*.XD
ACCIONES		
ALFA A	ALFAA MM <EQUITY> OMON	0#AL*.XD
ASUR B	ASURB MM <EQUITY> OMON	0#AS*.XD
América Móvil L	AMXL MM <EQUITY> OMON	0#AX*.XD
Cemex CPO	CEMEXCPO MM <EQUITY> OMON	0#CX*.XD
FEMSA UBD	FEMSAUBD <EQUITY> OMON	0#FE*.XD
GAP B	GAPB MM <EQUITY> OMON	0#GP*.XD
GMéxico B	GMEXICOB MM <EQUITY> OMON	0#GM*.XD
KOF UBL	KOF UBL MM <EQUITY> OMON	0#KO*.XD
LALA B	LALAB MM <EQUITY> OMON	0#LL*.XD
Naftac ISHRS	NAFTAC MM <EQUITY> OMON	0#NA*.XD
ORBIA	ORBIA* MM <EQUITY> OMON	0#MC*.XD
PE&OLES	PE&OLES* MM <EQUITY> OMON	0#PE*.XD
PINFRA	PINFRA* MM <EQUITY> OMON	0#PI*.XD
Televisa CPO	TLEVICPO MM <EQUITY> OMON	0#TV*.XD
Walmex V	WALMEX* MM <EQUITY> OMON	0#WA*.XD

Contacta un Socio Liquidador

BBVA

BBVA

Aztryd Marín

quiahuitl.marin@bbva.com

+52 (55) 5621 9370

GBM

GBM
GRUPO
BURSÁTIL
MEXICANO

Patricio de la Vega

derivados@gbm.com.mx

+52 (55) 5480 5815

Santander

 **Santander**

Guillermo Ochoa

futures_options@santander.com.mx

+52 (55) 5269 8764

Scotiabank

 **Scotiabank**

Guillermo Camou

guillermo.camou@scotiabank.com

+52 (55) 9179 5131



Contáctanos

Laura Vázquez

✉ lvazquez@grupobmv.com.mx

☎ +52 (55) 5342 9840

A. Gary Flagler

✉ agary@grupobmv.com.mx

☎ +1 (312) 804 1618

Aron Brener

✉ abrenern@grupobmv.com.mx

☎ +52 (55) 5342 9922

