

INDICADORES DEL MERCADO DE PRODUCTOS DERIVADOS

BOLETÍN DE SWAPS / SWAPS BULLETIN

7 DE NOVIEMBRE DE 2017

Plazo <i>Maturity</i>	Número de Operaciones <i>Number of Trades</i>	Volumen Operado <i>Volume</i>	Importe Ncional <i>Nocional Amount</i>	Precio de Liquidación <i>Settlement Price</i>	Interés Abierto <i>Open Interest</i>
SWAPS DE TIIE 28 / 28-DAY TIIE SWAPS					
39X1	2	5,000	500,000,000.00	7.25	434,306
TOTAL SWAPS	2	5,000	500,000,000.00		434,306

La información operativa mostrada corresponde únicamente a lo operado en el día.

La información contenida en los Indicadores del Mercado de Productos Derivados, ha sido preparada con técnicas confiables, utilizando la información más oportuna disponible, con fines de carácter informativo. No obstante lo anterior, MexDer, Mercado Mexicano de Derivados, S.A. de C.V., no se hace responsable por eventuales errores tipográficos o de captura que puedan ser publicados, ni se hace responsable por el uso o interpretación que terceros pudieran hacer por la información publicada. Las decisiones de compra o venta de productos derivados basadas en la información contenida en las gráficas, textos y cuadros de los Indicadores del Mercado de Productos Derivados, son responsabilidad exclusiva del lector, por lo que dicha información no debe ser considerada como recomendación de compra o venta de alguno de los instrumentos que aquí se publican.

Así mismo, MexDer, Mercado Mexicano de Derivados, S.A. de C.V. no es ni será responsable y, por lo tanto, no se encuentra obligado ni asume ningún compromiso de garantizar o indemnizar a ninguna de las partes (y/o cualquier otro tercero) involucradas en las operaciones derivadas, a quienes se les pudiera causar daños y/o perjuicios directos o indirectos, que resulten de (incluyendo sin limitar): (i) la comisión de cualquier error, omisión o retraso en el cálculo y difusión de los productos derivados; (ii) la suspensión del cálculo, utilización y/o difusión de los productos derivados; (iii) los ajustes, cambios o modificaciones a la metodología de los productos derivados; (iv) el comportamiento y rendimiento de los productos derivados, y (v) la suspensión de operaciones o incrementos en los gastos de operación de los productos derivados." Indicadores del Mercado de Productos Derivados, es una publicación diaria, editada por MexDer, Mercado Mexicano de Derivados, S.A. de C.V., Paseo de la Reforma número 255, Colonia Cuauhtémoc, C.P. 06500, México, D.F. Tel. (55) 53429900. Editor Responsable: MexDer.

MexDer, Mercado Mexicano de Derivados, S.A. de C.V. are not responsible for any errors included herein, nor for the use or interpretation of this information by third parties. Any decision to buy or sell derivatives products, whether futures contracts, options, or their underlying assets, based on the information contained in the graphs, texts and tables presented here, is the sole responsibility of the reader. This information should not be considered a recommendation to buy or sell any of the instruments mentioned in this document.

Resumen de Interés Abierto por nodos Open Interest Resume by nodes

7 DE NOVIEMBRE DE 2017

Nodo Representativo <i>Representative Node</i>	Plazo al Vencimiento <i>Time to Maturity</i>	Interés Abierto <i>Open Interest</i>
3X1	[1 , 84]	0
6X1	[85 , 168]	530,000
9X1	[169 , 252]	85,000
13X1	[253 , 364]	240,264
26X1	[365 , 728]	1,955,492
39X1	[729 , 1092]	601,257
52X1	[1093 , 1456]	449,154
65X1	[1457 , 1820]	869,157
91X1	[1821 , 2548]	759,598
130X1	[2549 , 3640]	768,790
195X1	[3641 , 5460]	191,750
260X1	[5461 , 7280]	109,950
390X1	[7281 , 10920]	0
		6,560,412

Boletín de Swaps - Precios e Interés Abierto

Swaps Bulletin - Prices and Open Interest

7 DE NOVIEMBRE DE 2017

Vencimiento <i>Maturity</i>	Precio de Liquidación Anterior <i>Previous Settlement Price</i>	Precio de Liquidación <i>Settlement Price</i>	Interés Abierto <i>Open Interest</i>
SWAPS DE TIE 28 / 28-DAY TIE SWAPS			
2X1	7.40	7.40	----
3X1	7.42	7.43	----
4X1	7.43	7.44	----
5X1	7.44	7.46	----
6X1	7.45	7.47	530,000
7X1	7.46	7.48	----
8X1	7.47	7.49	----
9X1	7.47	7.50	85,000
10X1	7.47	7.50	----
11X1	7.47	7.50	----
12X1	7.47	7.50	----
13X1	7.47	7.49	240,264
14X1	7.46	7.48	----
15X1	7.45	7.47	----
16X1	7.44	7.46	304,000
17X1	7.43	7.45	200
18X1	7.41	7.44	----
19X1	7.40	7.43	----
20X1	7.38	7.41	----
21X1	7.37	7.40	----
22X1	7.35	7.39	----
23X1	7.34	7.38	14,500
24X1	7.32	7.37	1,000
25X1	7.31	7.36	672,213
26X1	7.30	7.34	963,579
27X1	7.29	7.34	----
28X1	7.28	7.33	----
29X1	7.28	7.32	----
30X1	7.27	7.31	45,600
31X1	7.26	7.30	500
32X1	7.25	7.30	49,500
33X1	7.25	7.29	35,800
34X1	7.24	7.28	1,019
35X1	7.23	7.27	2,000
36X1	7.23	7.27	32,500
37X1	7.22	7.26	29
38X1	7.21	7.25	3
39X1	7.21	7.25	434,306
40X1	7.21	7.24	10,019
41X1	7.20	7.24	2,000
42X1	7.20	7.24	----
43X1	7.20	7.24	9,000
44X1	7.20	7.24	----
45X1	7.20	7.23	35,019
46X1	7.20	7.23	37,870
47X1	7.19	7.23	----
48X1	7.19	7.23	----
49X1	7.19	7.23	5,500
50X1	7.19	7.23	27
51X1	7.19	7.23	40,000
52X1	7.19	7.23	309,719
53X1	7.19	7.23	27,000
54X1	7.19	7.23	1,500
55X1	7.19	7.23	5,500
56X1	7.19	7.23	1,269
57X1	7.19	7.23	----

Boletín de Swaps - Precios e Interés Abierto

Swaps Bulletin - Prices and Open Interest

7 DE NOVIEMBRE DE 2017

Vencimiento <i>Maturity</i>	Precio de Liquidación Anterior <i>Previous Settlement Price</i>	Precio de Liquidación <i>Settlement Price</i>	Interés Abierto <i>Open Interest</i>
58X1	7.19	7.23	----
59X1	7.20	7.23	13,800
60X1	7.20	7.23	300
61X1	7.20	7.23	750
62X1	7.20	7.23	18,519
63X1	7.20	7.23	----
64X1	7.20	7.24	1,300
65X1	7.20	7.24	799,219
66X1	7.21	7.24	115,000
67X1	7.21	7.24	----
68X1	7.22	7.25	15,000
69X1	7.22	7.25	----
70X1	7.22	7.26	----
71X1	7.23	7.26	23,019
72X1	7.23	7.26	----
73X1	7.23	7.27	----
74X1	7.24	7.27	17,500
75X1	7.24	7.27	381,000
76X1	7.24	7.28	----
77X1	7.25	7.28	19
78X1	7.25	7.29	30,000
79X1	7.26	7.29	----
80X1	7.26	7.30	5,600
81X1	7.26	7.30	8,020
82X1	7.27	7.30	100,200
83X1	7.27	7.31	----
84X1	7.27	7.31	----
85X1	7.28	7.32	----
86X1	7.28	7.32	21
87X1	7.29	7.32	----
88X1	7.29	7.33	15,000
89X1	7.29	7.33	----
90X1	7.30	7.33	19
91X1	7.30	7.34	49,200
92X1	7.30	7.34	----
93X1	7.31	7.34	----
94X1	7.31	7.35	----
95X1	7.31	7.35	----
96X1	7.32	7.35	----
97X1	7.32	7.36	----
98X1	7.32	7.36	----
99X1	7.33	7.36	----
100X1	7.33	7.37	----
101X1	7.33	7.37	3,000
102X1	7.34	7.37	111,800
103X1	7.34	7.37	----
104X1	7.34	7.38	----
105X1	7.35	7.38	----
106X1	7.35	7.38	----
107X1	7.35	7.39	----
108X1	7.35	7.39	----
109X1	7.36	7.39	125,000
110X1	7.36	7.39	23,300
111X1	7.36	7.40	41,000
112X1	7.37	7.40	3,000
113X1	7.37	7.40	----
114X1	7.37	7.41	92,750

Boletín de Swaps - Precios e Interés Abierto

Swaps Bulletin - Prices and Open Interest

7 DE NOVIEMBRE DE 2017

Vencimiento <i>Maturity</i>	Precio de Liquidación Anterior <i>Previous Settlement Price</i>	Precio de Liquidación <i>Settlement Price</i>	Interés Abierto <i>Open Interest</i>
115X1	7.38	7.41	----
116X1	7.38	7.41	----
117X1	7.38	7.41	----
118X1	7.39	7.42	----
119X1	7.39	7.42	----
120X1	7.39	7.42	----
121X1	7.39	7.43	----
122X1	7.40	7.43	----
123X1	7.40	7.43	----
124X1	7.40	7.43	----
125X1	7.41	7.44	----
126X1	7.41	7.44	----
127X1	7.41	7.44	----
128X1	7.41	7.44	----
129X1	7.42	7.45	----
130X1	7.42	7.45	368,940
131X1	7.42	7.45	----
132X1	7.43	7.45	----
133X1	7.43	7.46	----
134X1	7.43	7.46	----
135X1	7.43	7.46	----
136X1	7.44	7.46	----
137X1	7.44	7.47	----
138X1	7.44	7.47	----
139X1	7.44	7.47	----
140X1	7.44	7.47	----
141X1	7.45	7.48	----
142X1	7.45	7.48	----
143X1	7.45	7.48	----
144X1	7.45	7.48	----
145X1	7.46	7.49	----
146X1	7.46	7.49	----
147X1	7.46	7.49	----
148X1	7.46	7.49	----
149X1	7.47	7.50	----
150X1	7.47	7.50	----
151X1	7.47	7.50	----
152X1	7.47	7.50	----
153X1	7.48	7.51	----
154X1	7.48	7.51	----
155X1	7.48	7.51	----
156X1	7.48	7.51	19,200
157X1	7.49	7.51	----
158X1	7.49	7.52	----
159X1	7.49	7.52	----
160X1	7.49	7.52	----
161X1	7.49	7.52	----
162X1	7.50	7.53	----
163X1	7.50	7.53	----
164X1	7.50	7.53	----
165X1	7.50	7.53	----
166X1	7.50	7.53	----
167X1	7.51	7.54	----
168X1	7.51	7.54	----
169X1	7.51	7.54	----
170X1	7.51	7.54	----
171X1	7.51	7.54	15,000

Boletín de Swaps - Precios e Interés Abierto

Swaps Bulletin - Prices and Open Interest

7 DE NOVIEMBRE DE 2017

Vencimiento <i>Maturity</i>	Precio de Liquidación Anterior <i>Previous Settlement Price</i>	Precio de Liquidación <i>Settlement Price</i>	Interés Abierto <i>Open Interest</i>
172X1	7.52	7.55	----
173X1	7.52	7.55	----
174X1	7.52	7.55	----
175X1	7.52	7.55	----
176X1	7.52	7.55	----
177X1	7.53	7.56	----
178X1	7.53	7.56	----
179X1	7.53	7.56	69,000
180X1	7.53	7.56	----
181X1	7.53	7.56	----
182X1	7.54	7.57	----
183X1	7.54	7.57	----
184X1	7.54	7.57	----
185X1	7.54	7.57	----
186X1	7.54	7.57	----
187X1	7.55	7.58	8,200
188X1	7.55	7.58	----
189X1	7.55	7.58	----
190X1	7.55	7.58	----
191X1	7.55	7.58	12,000
192X1	7.55	7.58	----
193X1	7.56	7.59	----
194X1	7.56	7.59	----
195X1	7.56	7.59	68,350
196X1	7.56	7.59	----
197X1	7.56	7.59	----
198X1	7.57	7.60	----
199X1	7.57	7.60	----
200X1	7.57	7.60	----
201X1	7.57	7.60	----
202X1	7.57	7.60	----
203X1	7.57	7.60	----
204X1	7.58	7.61	----
205X1	7.58	7.61	----
206X1	7.58	7.61	----
207X1	7.58	7.61	----
208X1	7.58	7.61	----
209X1	7.58	7.61	----
210X1	7.59	7.62	----
211X1	7.59	7.62	----
212X1	7.59	7.62	----
213X1	7.59	7.62	----
214X1	7.59	7.62	----
215X1	7.59	7.62	----
216X1	7.60	7.63	----
217X1	7.60	7.63	----
218X1	7.60	7.63	----
219X1	7.60	7.63	----
220X1	7.60	7.63	----
221X1	7.60	7.63	----
222X1	7.61	7.64	----
223X1	7.61	7.64	----
224X1	7.61	7.64	----
225X1	7.61	7.64	----
226X1	7.61	7.64	----
227X1	7.61	7.64	----
228X1	7.62	7.65	----

Boletín de Swaps - Precios e Interés Abierto

Swaps Bulletin - Prices and Open Interest

7 DE NOVIEMBRE DE 2017

Vencimiento <i>Maturity</i>	Precio de Liquidación Anterior <i>Previous Settlement Price</i>	Precio de Liquidación <i>Settlement Price</i>	Interés Abierto <i>Open Interest</i>
229X1	7.62	7.65	----
230X1	7.62	7.65	----
231X1	7.62	7.65	----
232X1	7.62	7.65	----
233X1	7.62	7.65	----
234X1	7.62	7.65	----
235X1	7.63	7.66	----
236X1	7.63	7.66	----
237X1	7.63	7.66	----
238X1	7.63	7.66	----
239X1	7.63	7.66	----
240X1	7.63	7.66	----
241X1	7.64	7.67	----
242X1	7.64	7.67	34,800
243X1	7.64	7.67	9,800
244X1	7.64	7.67	----
245X1	7.64	7.67	7,800
246X1	7.64	7.67	15,000
247X1	7.64	7.67	----
248X1	7.65	7.68	----
249X1	7.65	7.68	----
250X1	7.65	7.68	----
251X1	7.65	7.68	----
252X1	7.65	7.68	----
253X1	7.65	7.68	----
254X1	7.65	7.68	----
255X1	7.66	7.69	----
256X1	7.66	7.69	----
257X1	7.66	7.69	----
258X1	7.66	7.69	----
259X1	7.66	7.69	----
260X1	7.66	7.69	42,550
261X1	7.66	7.69	----
262X1	7.67	7.70	----
263X1	7.67	7.70	----
264X1	7.67	7.70	----
265X1	7.67	7.70	----
266X1	7.67	7.70	----
267X1	7.67	7.70	----
268X1	7.67	7.70	----
269X1	7.68	7.71	----
270X1	7.68	7.71	----
271X1	7.68	7.71	----
272X1	7.68	7.71	----
273X1	7.68	7.71	----
274X1	7.68	7.71	----
275X1	7.69	7.72	----
276X1	7.69	7.72	----
277X1	7.69	7.72	----
278X1	7.69	7.72	----
279X1	7.69	7.72	----
280X1	7.69	7.72	----
281X1	7.69	7.72	----
282X1	7.70	7.73	----
283X1	7.70	7.73	----
284X1	7.70	7.73	----
285X1	7.70	7.73	----

Boletín de Swaps - Precios e Interés Abierto

Swaps Bulletin - Prices and Open Interest

7 DE NOVIEMBRE DE 2017

Vencimiento <i>Maturity</i>	Precio de Liquidación Anterior <i>Previous Settlement Price</i>	Precio de Liquidación <i>Settlement Price</i>	Interés Abierto <i>Open Interest</i>
286X1	7.70	7.73	----
287X1	7.70	7.73	----
288X1	7.70	7.73	----
289X1	7.71	7.74	----
290X1	7.71	7.74	----
291X1	7.71	7.74	----
292X1	7.71	7.74	----
293X1	7.71	7.74	----
294X1	7.71	7.74	----
295X1	7.71	7.74	----
296X1	7.72	7.75	----
297X1	7.72	7.75	----
298X1	7.72	7.75	----
299X1	7.72	7.75	----
300X1	7.72	7.75	----
301X1	7.72	7.75	----
302X1	7.72	7.75	----
303X1	7.73	7.76	----
304X1	7.73	7.76	----
305X1	7.73	7.76	----
306X1	7.73	7.76	----
307X1	7.73	7.76	----
308X1	7.73	7.76	----
309X1	7.73	7.76	----
310X1	7.73	7.76	----
311X1	7.74	7.77	----
312X1	7.74	7.77	----
313X1	7.74	7.77	----
314X1	7.74	7.77	----
315X1	7.74	7.77	----
316X1	7.74	7.77	----
317X1	7.74	7.77	----
318X1	7.75	7.78	----
319X1	7.75	7.78	----
320X1	7.75	7.78	----
321X1	7.75	7.78	----
322X1	7.75	7.78	----
323X1	7.75	7.78	----
324X1	7.75	7.78	----
325X1	7.75	7.78	----
326X1	7.76	7.79	----
327X1	7.76	7.79	----
328X1	7.76	7.79	----
329X1	7.76	7.79	----
330X1	7.76	7.79	----
331X1	7.76	7.79	----
332X1	7.76	7.79	----
333X1	7.76	7.79	----
334X1	7.77	7.80	----
335X1	7.77	7.80	----
336X1	7.77	7.80	----
337X1	7.77	7.80	----
338X1	7.77	7.80	----
339X1	7.77	7.80	----
340X1	7.77	7.80	----
341X1	7.77	7.80	----
342X1	7.78	7.81	----

Boletín de Swaps - Precios e Interés Abierto

Swaps Bulletin - Prices and Open Interest

7 DE NOVIEMBRE DE 2017

Vencimiento <i>Maturity</i>	Precio de Liquidación Anterior <i>Previous Settlement Price</i>	Precio de Liquidación <i>Settlement Price</i>	Interés Abierto <i>Open Interest</i>
343X1	7.78	7.81	----
344X1	7.78	7.81	----
345X1	7.78	7.81	----
346X1	7.78	7.81	----
347X1	7.78	7.81	----
348X1	7.78	7.81	----
349X1	7.78	7.81	----
350X1	7.79	7.82	----
351X1	7.79	7.82	----
352X1	7.79	7.82	----
353X1	7.79	7.82	----
354X1	7.79	7.82	----
355X1	7.79	7.82	----
356X1	7.79	7.82	----
357X1	7.79	7.82	----
358X1	7.80	7.83	----
359X1	7.80	7.83	----
360X1	7.80	7.83	----
361X1	7.80	7.83	----
362X1	7.80	7.83	----
363X1	7.80	7.83	----
364X1	7.80	7.83	----
365X1	7.80	7.83	----
366X1	7.80	7.83	----
367X1	7.81	7.84	----
368X1	7.81	7.84	----
369X1	7.81	7.84	----
370X1	7.81	7.84	----
371X1	7.81	7.84	----
372X1	7.81	7.84	----
373X1	7.81	7.84	----
374X1	7.81	7.84	----
375X1	7.82	7.85	----
376X1	7.82	7.85	----
377X1	7.82	7.85	----
378X1	7.82	7.85	----
379X1	7.82	7.85	----
380X1	7.82	7.85	----
381X1	7.82	7.85	----
382X1	7.82	7.85	----
383X1	7.82	7.85	----
384X1	7.83	7.86	----
385X1	7.83	7.86	----
386X1	7.83	7.86	----
387X1	7.83	7.86	----
388X1	7.83	7.86	----
389X1	7.83	7.86	----
390X1	7.83	7.86	----

6,560,412