ASERCA

SAGARPA

## COORDINACIÓN GENERAL DE ADMINISTRACIÓN DE RIESGOS DE PRECIOS

**COTIZACIÓN VIGENTE PARA EL DÍA: 17-enero-17**

## TABLA DE PRECIOS DE PRIMAS DE OPCIONES 'PUT' PARA ARROZ

| PRECIO DE EJERCICIO | | COSTO DE LA PRIMA | COSTO POR TONELADA | COSTO POR CONTRATO | |
|---|---|---|---|---|---|
| DLRS / QUINTAL | US DLRS / TON | CTS / QUINTAL | DÓLARES | DÓLARES | PESOS |
| MARZO 17 | | | | | |
| 9.8 | 216.05 | 24.505 | 5.40 | 490.10 | 10,602.33 |
| 10.0 | 220.46 | 36.465 | 8.04 | 729.30 | 15,776.95 |
| 10.2 | 224.87 | 50.505 | 11.13 | 1,010.10 | 21,851.49 |
| MAYO 17 | | | | | |
| 10.0 | 220.46 | 38.545 | 8.50 | 770.90 | 16,676.88 |
| 10.2 | 224.87 | 50.505 | 11.13 | 1,010.10 | 21,851.49 |
| 10.4 | 229.28 | 63.765 | 14.06 | 1,275.30 | 27,588.56 |
| JULIO 17 | | | | | |
| 10.2 | 224.87 | 51.285 | 11.31 | 1,025.70 | 22,188.97 |
| 10.4 | 229.28 | 62.465 | 13.77 | 1,249.30 | 27,026.11 |
| 10.6 | 233.69 | 75.205 | 16.58 | 1,504.10 | 32,538.20 |
| SEPTIEMBRE 17 | | | | | |
| 10.2 | 224.87 | 60.645 | 13.37 | 1,212.90 | 26,238.67 |
| 10.4 | 229.28 | 70.785 | 15.61 | 1,415.70 | 30,625.84 |
| 10.6 | 233.69 | 81.965 | 18.07 | 1,639.30 | 35,462.98 |
| NOVIEMBRE 17 | | | | | |
| 10.4 | 229.28 | 71.565 | 15.78 | 1,431.30 | 30,963.31 |
| 10.6 | 233.69 | 82.745 | 18.24 | 1,654.90 | 35,800.45 |
| 10.8 | 238.10 | 95.225 | 20.99 | 1,904.50 | 41,200.05 |

## TABLA DE PRECIOS DE PRIMAS DE OPCIONES 'CALL' PARA ARROZ

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| MARZO 17 | | | | | |
| 9.8 | 216.05 | 34.905 | 7.70 | 698.10 | 15,102.00 |
| 10.0 | 220.46 | 26.065 | 5.75 | 521.30 | 11,277.28 |
| 10.2 | 224.87 | 19.305 | 4.26 | 386.10 | 8,352.50 |
| MAYO 17 | | | | | |
| 10.0 | 220.46 | 51.545 | 11.36 | 1,030.90 | 22,301.46 |
| 10.2 | 224.87 | 42.97 | 9.47 | 859.30 | 18,589.24 |
| 10.4 | 229.28 | 35.425 | 7.81 | 708.50 | 15,326.98 |
| JULIO 17 | | | | | |
| 10.2 | 224.87 | 65.845 | 14.52 | 1,316.90 | 28,488.50 |
| 10.4 | 229.28 | 56.485 | 12.45 | 1,129.70 | 24,438.80 |
| 10.6 | 233.69 | 48.425 | 10.68 | 968.50 | 20,951.56 |
| SEPTIEMBRE 17 | | | | | |
| 10.2 | 224.87 | 91.065 | 20.08 | 1,821.30 | 39,400.18 |
| 10.4 | 229.28 | 80.405 | 17.73 | 1,608.10 | 34,788.03 |
| 10.6 | 233.69 | 71.305 | 15.72 | 1,426.10 | 30,850.82 |
| NOVIEMBRE 17 | | | | | |
| 10.4 | 229.28 | 91.585 | 20.19 | 1,831.70 | 39,625.17 |
| 10.6 | 233.69 | 82.225 | 18.13 | 1,644.50 | 35,575.47 |
| 10.8 | 238.10 | 74.165 | 16.35 | 1,483.30 | 32,088.23 |

**ANÁLISIS DE SENSIBILIDAD PARA EL VENCIMIENTO MÁS CERCANO**

| OPCIÓN | PRECIO DE EJERCICIO | VARIACIÓN* | |
|---|---|---|---|
| | | CTS DLRS | % |
| "PUT" | 10.0 | -0.26 | -2.67 |
| "CALL" | 10.0 | 0.36 | 3.64 |

| | QUINTAL | TONELADA |
|---|---|---|
| 1 CONTRATO = | 2,000 | 90.719 |
| 1 TONELADA = | 22.0462 | |

| PRECIO DE LOS FUTUROS | | 13-enero-17 | |
|---|---|---|---|
| VENCIMIENTO | DLRS / QUINTAL | VAR. | US DLRS / TON |
| MARZO 17 | 9.900 | -0.080 | 218.26 |
| MAYO 17 | 10.125 | -0.080 | 223.22 |
| JULIO 17 | 10.340 | -0.075 | 227.96 |
| SEPTIEMBRE 17 | 10.495 | -0.075 | 231.37 |
| NOVIEMBRE 17 | 10.595 | -0.070 | 233.58 |

TIPO DE CAMBIO FIX PUBLICADO POR EL BANCO DE MÉXICO = 21.6330 PESOS/DÓLAR

PRECIO SUGERIDO POR ASERCA:

La información publicada en estas tablas puede variar con respecto al valor real de la operación de las opciones, derivado del comportamiento del mercado

Los costos de cobertura incluyen gastos de comisiones

*Representa el movimiento a la baja en el PUT y a la alza en el CALL que debe tener el precio del futuro para que se empiece a tener compensación

Para mayor información favor de llamar a la Dirección Regional o Ventanilla autorizada de su localidad