

MODULO INTEGRAL DE VOLATILIDADES

¿Que es?

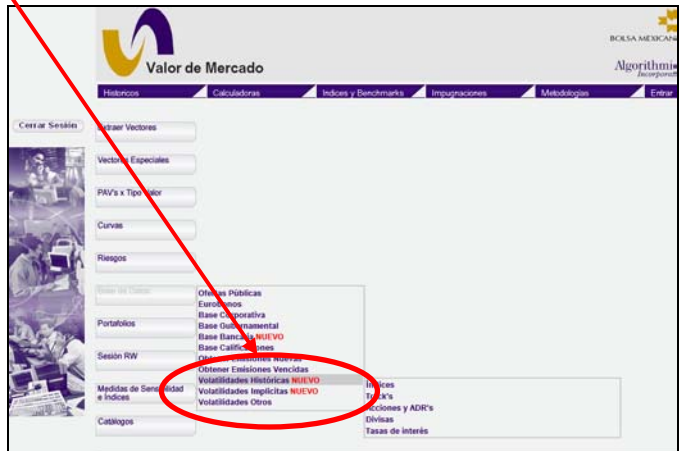
Este reporte se encuentra integrado por las volatilidades implícitas, dinámicas e históricas de diversos Contratos de Opciones, cuyos activos subyacentes sean Índices accionarios, Track's, Acciones, ADR's, Tipos de Cambio, así como Tasas de Interés.

¿Dónde se encuentra?



Valor de Mercado
Bienvenido
Valuación Operativa y Referencias del Mercado S.A. de C.V.
TREV 17 Julio 2006
Tasas de Referencia Valmer

Plazos	Cetes	Bonos	Bonos I	Bancario	Ptos.
1	7.00	7.00	0.00		
28	7.05	7.04	0.01		
91	7.19	7.20	-0.01		
182	7.37	7.39	-0.02		
364	7.50	7.50	0.00		



Valor de Mercado
Historicos, Calculadoras, Indices y Benchmarks, Impugnaciones, Metodologías, Entrar
Crear Sesión, Usar Vectores, Vectores Especiales, PAV's x Tipo de Valor, Curvas, Riesgos, Sesión RW, Medidas de Sensibilidad e Indices, Catálogos

- Volatilidades de Índices
- Volatilidades de Acciones, ADR's y Track's
- Volatilidades de Tasas de Interés
- Volatilidades de Tipo de Cambio
- Volatilidades de Swaptions

Para volatilidades dinámicas e Histórica permite realizar consultas, definiendo ventanas de tiempo.



VOLATILIDAD HISTÓRICA DE ÍNDICES

Volatilidad Histórica | Volatilidad Dinámica | Criterio de Selección

AEX (AMSTERDAM EXCHANGES IND), ASX1 (S&P/ASX 50 INDEX), ASAX1 (ASX/CACQUEM 50 LEADERS IND), BADX (SPAIN BA BARCELONA IND), BEL20 (BEL20 INDEX), BVIX (PSI GENERAL INDEX), CAC (CAC 40 INDEX), COMP (NASDAQ COMPOSITE INDEX), COMP (DOW JONES COMP. AVG), DAX (DAX INDEX), CAC (CAC 40 INDEX), DAX (DAX INDEX), INDU (DOW JONES INDUS. AVG), MEXBOL (MEXICO BOLSA INDEX)

Índice	Fecha Final	Ventana de Tiempo	λ (Lambda)
CAC (CAC 40 INDEX)	18/07/2006	252	0.95
DAX (DAX INDEX)	18/07/2006	500	0.91
INDU (DOW JONES INDUS. AVG)	18/07/2006	100	0.85
MEXBOL (MEXICO BOLSA INDEX)	18/07/2006	62	0.90



VOLATILIDAD IMPLÍCITA DE ÍNDICES

Volatilidad Implícita

Índice	Plazo	Strike	Option	SPOT
CAC (CAC 40 INDEX)	30	4700	CALL	4714.54
DAX (DAX INDEX)	100	5000	PUT	5206.45
INDU (DOW JONES INDUS. AVG)	50	10000	CALL	10799.23
MEXBOL (MEXICO BOLSA INDEX)	300	19000	PUT	18886.47

Calcular

Índice	Volatilidad Implícita	Delta (Δ)	Gamma (Γ)	Vega (V)	Theta (Θ)	Herpesión	Diferencia más cercana Plazo Strike
CAC (CAC 40 INDEX)	0.209761	0.572703	0.000064	0.089507	0.013491	SI	
DAX (DAX INDEX)	0.216155	-0.451756	0.000467	0.147815	0.006959	SI	
INDU (DOW JONES INDUS. AVG)	0.220545	0.822048	0.008181	0.001005	0.000614	NO	60 10200
MEXBOL (MEXICO BOLSA INDEX)	0.228820	-0.364000	0.000100	0.071950	0.000730	NO	322 19000

Mientras que para volatilidades implícitas se utilizan superficies de volatilidades en las que se permite definir distintos "strike" y "plazo".

Para mayor información comunicarse con:

Alejandro Castro Gallardo
Subdirector Desarrollo Comercial
5726 6649
acaastro@valmer.com.mx

Mecanismos de Entrega

- Consulta en Internet
- FTP