

Metodología del indicador RIX

1. COMPOSICIÓN DEL RIX

Será integrado por todas las operaciones cerradas en la rueda REPO, solamente entre Agentes MAE EF, de todas las especies, en el horario de 10:00hs a 17:00hs.

Serán excluidas las operaciones donde BCRA (Banco Central de la República Argentina) sea contraparte.

Sólo serán consideradas las operaciones overnight (a plazo futuro del próximo día hábil). Transacciones con fecha de liquidación de 2 ó más días hábiles, serán descartadas.

Aquellas operaciones con tasa 0 (cero) serán descartadas.

2. CALCULO DEL RIX

Se construirá con las operaciones cerradas, con las tasas implícitas pactadas y ponderadas por el monto transado en pesos en la liquidación spot del Repo.

En operaciones que se hayan considerado y, durante la rueda, se hayan dado de baja, se procederá a reconstruir el índice a fin de reflejar esta novedad.

En operaciones cuyo monto sea superior a \$ 300.000.000,00 (trescientos millones), sólo ponderarán hasta este monto.

En una segunda etapa MAE incluirá en la Rueda una MMP (Media Móvil Ponderada) de las últimas cinco anotaciones, que muestre la dinámica de las últimas cotizaciones y el Mercado pueda anticipar algún cambio de tendencia.

3. PUBLICACIÓN DEL RIX

Será publicado en la rueda REPO (on line), a medida que se vaya construyendo.

Estará disponible en la Pizarra de datos del módulo Negociación, debiendo abrirse la Pizarra RIX. El índice se mostrará según la hora de la última operación pactada.

El registro más actual permanecerá en la primera fila de la Pizarra.

MAE informará diariamente el valor del RIX a través de SIOPEL y será publicado en la web del MAE a partir de las 17:00hs.

Comunicado N° 9.668 del 18/04/2017

El MAE se dirige a los Sres. Agentes a fin de informarles que a partir del 17 de Abril de 2017, se ha eliminado el tope de \$ 300.000.000,00 (trescientos millones) en la ponderación de las operaciones de Repo para el armado del MAE Repo Index ("RIX").

Por lo tanto, a partir de esta fecha, la totalidad del monto transado en cada operación, es considerada para la composición de este indicador.

También se han agregado nuevas columnas, en la Pizarra de Siopel, que son "Última tasa", "Monto (miles)" que indican la última tasa operada y el monto de la operación spot de esa transacción. Y también la columna "Monto acum. (Miles)" que refleja el monto acumulado del total operado en el día.

Esta pizarra se actualiza on line, real time, a medida que se cierran operaciones de Pase en la rueda Repo.