

Cotizaciones del Peso en el CME (Pesos por dólar)

Contrato	Mar-10	Abr-10	May-10	Jun-10	Jul-10	Ago-10	Sep-10	Oct-10	Nov-10	Dic-10
22/02/2010	12.8370	12.8824	12.9324	12.9870	13.0251	13.0762	13.1277	13.1752	13.2275	13.2802
23/02/2010	12.9492	12.9828	13.0336	13.1019	13.1277	13.1796	13.2319	13.2802	13.3333	13.3869
24/02/2010	12.8329	12.9241	12.9744	12.9828	13.0676	13.1191	13.1709	13.2188	13.2714	13.3245
25/02/2010	12.8164	12.8866	12.9366	12.9576	13.0293	13.0804	13.1320	13.1796	13.2319	13.2846
26/02/2010	12.7959	12.8617	12.9116	12.9408	13.0039	13.0548	13.1062	13.1536	13.2057	13.2582
Var. semanal	-0.38%	-0.26%	-0.26%	-0.32%	-0.26%	-0.26%	-0.26%	-0.26%	-0.26%	-0.27%

Cotizaciones del Dólar en el MEX-DER (Pesos por dólar)

Contrato	Mar-10	Abr-10	May-10	Jun-10	Jul-10	Ago-10	Sep-10	Oct-10	Nov-10	Dic-10
22/02/2010	12.8475	12.9200	12.9352	12.9809	13.0382	13.0845	13.1318	13.1928	13.2359	13.2909
23/02/2010	12.9275	12.9850	13.0350	13.0690	13.1290	13.1753	13.2228	13.2844	13.3284	13.3839
24/02/2010	12.8800	12.9308	12.9788	13.0191	13.0773	13.1243	13.1723	13.2349	13.2795	13.3348
25/02/2010	12.8490	12.8984	12.9445	12.9905	13.0487	13.0958	13.1437	13.2052	13.2494	13.3048
26/02/2010	12.8153	12.8320	13.0340	12.9200	12.9957	13.0420	13.0888	13.1484	13.1915	13.2650
Var. semanal	-0.34%	-0.58%	0.69%	-0.50%	-0.40%	-0.40%	-0.40%	-0.40%	-0.39%	-0.26%

Interés abierto del Peso en el CME (# contratos)

Contrato	Mar-10	Abr-10	May-10	Jun-10	Jul-10	Ago-10	Sep-10	Oct-10	Nov-10	Dic-10
22/02/2010	93,821	0	0	2,160	0	0	25	0	0	15
23/02/2010	97,563	0	0	2,231	0	0	25	0	0	15
24/02/2010	98,469	0	0	2,265	0	0	25	0	0	15
25/02/2010	103,879	0	0	2,336	0	0	25	0	0	15
26/02/2010	106,748	0	0	2,371	0	0	25	0	0	15
Var. semanal	15,930	0	0	232	0	0	0	0	0	0

Interés abierto del Dólar en el MEX-DER (# contratos)

Contrato	Mar-10	Abr-10	May-10	Jun-10	Jul-10	Ago-10	Sep-10	Oct-10	Nov-10	Dic-10
22/02/2010	128,803	16,213	149	4,558	261	30	70	20	20	5,511
23/02/2010	116,898	16,165	149	4,558	261	30	70	20	20	5,511
24/02/2010	118,893	16,165	149	18,916	261	30	70	20	20	5,511
25/02/2010	118,578	16,165	149	18,916	261	30	70	20	20	5,511
26/02/2010	110,578	16,165	149	18,916	261	30	70	20	20	5,511
Var. semanal	-21,225	2065	0	15,358	0	0	0	0	0	0

Volumen operado del Peso en el CME (# contratos)

Contrato	Mar-10	Abr-10	May-10	Jun-10	Jul-10	Ago-10	Sep-10	Oct-10	Nov-10	Dic-10
22/02/2010	19,974	0	0	49	0	0	0	0	0	15
23/02/2010	19,233	0	0	103	0	0	0	0	0	15
24/02/2010	17,807	0	0	75	0	0	0	0	0	15
25/02/2010	21,920	0	0	105	0	0	0	0	0	15
26/02/2010	27,544	0	0	68	0	0	0	0	0	15
Total semanal	106,478	0	0	400	0	0	0	0	0	75

Volumen operado del Dólar en el MEX-DER (# contratos)

Contrato	Mar-10	Abr-10	May-10	Jun-10	Jul-10	Ago-10	Sep-10	Oct-10	Nov-10	Dic-10
22/02/2010	21,600	48	0	0	0	0	0	0	0	0
23/02/2010	17,483	0	0	16,358	0	0	0	0	0	0
24/02/2010	5,010	0	0	0	0	0	0	0	0	0
25/02/2010	13,500	0	0	0	0	0	0	0	0	0
26/02/2010	35,095	2,000	40	2,030	0	0	0	0	0	483
Total semanal	92,688	2,048	40	18,388	0	0	0	0	0	483

Análisis de los Futuros del Peso en el CME y de los Futuros del Dólar en el MEX-DER

Contrato	Mar-10	Abr-10	May-10	Jun-10	Jul-10	Ago-10	Sep-10	Oct-10	Nov-10	Dic-10
Día vencimiento	15-Mar-10	19-Abr-10	17-May-10	14-Jun-10	19-Jul-10	16-Ago-10	13-Sep-10	18-Oct-10	15-Nov-10	13-Dic-10
Plazo	10	45	73	101	136	164	192	227	255	283
T.C. teórico (\$) 1/	12.6485	12.6975	12.7387	12.7813	12.8310	12.8690	12.9101	12.9543	12.9869	13.0320
P.Fwd. Cva. (\$) 1/	0.02	0.08	0.11	0.16	0.22	0.26	0.31	0.37	0.41	0.47
P. Swap.CME (\$) 2/	0.00	0.06	0.10	0.19	0.13	0.23	0.28	0.33	0.38	0.33
P. Swap.M-D (\$) 2/	0.02	0.11	0.14	0.17	0.23	0.27	0.31	0.37	0.41	0.46
T. Res.\$ CME 2/	1.60%	4.03%	4.58%	5.88%	3.41%	4.76%	4.95%	5.06%	5.24%	4.37%
T. Res.\$ M-D 2/	7.23%	7.24%	6.18%	5.27%	5.46%	5.46%	5.37%	5.49%	5.55%	5.73%
T. Res.US\$ CME 3/	3.40%	0.93%	0.48%	-0.71%	1.77%	0.50%	0.43%	0.42%	0.34%	1.41%
T. Res.US\$ M-D 3/	-2.23%	-2.25%	-1.11%	-0.10%	-0.25%	-0.18%	0.02%	0.00%	0.04%	0.10%

Fuente: Reuters. 1/: Determinado con tasas de Cetes del mercado secundario, tasas Libor + 0.25 puntos y tipo de cambio spot. 2/: Determinada con tasas Libor + 0.25 puntos, tipo de cambio spot y cotizaciones del CME y Mex-Der, según corresponda. 3/: Determinadas con tasas de Cetes del mercado secundario, tipo de cambio spot y cotizaciones del CME y Mex-Der, según corresponda.

Mario A. Correa • Tel. 5229-2458 • mcorrea@scotiabank.com.mx