

Fecha de Publicación: 06 de Mayo de 2010
 Fecha de Información: 04 de Mayo de 2010 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$909 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.7%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	144.9	190.1	56.9	67.9	87.2	31.0	46.0
15-35	157.2	349.5	239.6	55.0	61.9	54.2	48.0
36-60	7.6	1.5	0.0	0.0	1.5	7.6	0.0
61-90	2.7	1.5	0.0	0.0	1.5	2.7	0.0
91-180	14.7	0.6	0.0	0.0	0.6	14.7	0.0
>180	11.3	27.9	20.0	0.0	0.7	4.2	7.2
Total	338.4	571.1	316.5	122.9	153.4	114.3	101.2

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operacines con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2.0 %	1.5 %	1.5 %	1.6 %
15-35	1.6 %	1.9 %	1.6 %	1.8 %
36-60	-	2.5 %	1.5 %	1.7 %
61-90	-	2.8 %	1.6 %	2.0 %
91-180	-	3.0 %	1.8 %	1.9 %
>180	1.5 %	2.4 %	2.0 %	2.1 %
Total	1.8 %	1.8 %	1.6 %	1.7 %

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	3 al 7 de Mayo												10 al 14 de Mayo				17 al 21 de Mayo							
	Delivery				NDF				Delivery				NDF				Delivery				NDF			
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V						
Sector Financiero**	10	191	1841	2338	11	215	1559	2115	9	56	1056	1363												
Intragruppo y off-shore***	0	0	1310	715	0	0	1197	445	0	0	862	262												
Otros	191	10	592	690	215	11	520	716	56	9	325	616												
Total	202	202	3742	3742	225	225	3276	3276	65	65	2242	2242												

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo