

Fecha de Publicación: 31 de Mayo de 2010
Fecha de Información: 27 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\$886 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.2%.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	152.6	53.7	25.9	85.0	7.8	47.6	20.0
15-35	355.5	143.5	51.0	175.5	40.5	128.0	52.0
36-60	4.0	12.8	0.0	0.0	12.8	4.0	0.0
61-90	36.5	7.3	0.0	0.0	7.3	36.5	0.0
91-180	0.0	48.8	35.0	0.0	13.8	0.0	0.0
>180	6.9	64.7	58.0	0.0	0.7	0.9	6.0
Total	555.5	330.8	169.9	260.5	83.0	217.0	78.0

* 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	0.5 %	1.5 %	1.1 %	1.1 %
15-35	1.1 %	1.4 %	1.0 %	1.1 %
36-60	-	2.1 %	1.0 %	1.9 %
61-90	-	2.4 %	1.4 %	1.6 %
91-180	-	1.7 %	-	1.7 %
>180	1.3 %	1.8 %	2.0 %	1.7 %
Total	1.0 %	1.6 %	1.1 %	1.2 %

*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	24 al 28 de Mayo				31 de May. al 4 de Junio				7 al 11 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	19	83	2371	2349	10	83	1614	1913	11	146	1522	2022
Intragruppo y off-shore***	0	0	1216	618	11	0	1347	627	0	0	1424	535
Otros	83	19	627	1247	72	10	330	750	146	11	380	768
Total	102	102	4214	4214	93	93	3291	3291	157	157	3325	3325

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**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