

Fecha de Publicación: 28 de Mayo de 2010
Fecha de Información: 26 de Mayo de 2010¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$936 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.3%.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	200.1	84.0	55.5	133.5	13.5	51.6	15.0
15-35	186.7	339.6	271.8	104.3	36.8	51.4	31.0
36-60	10.2	4.2	0.0	0.0	4.2	10.2	0.0
61-90	12.2	2.9	0.0	0.0	2.9	12.2	0.0
91-180	27.0	50.5	45.0	0.0	5.5	27.0	0.0
>180	2.1	16.1	15.0	0.0	0.0	1.0	1.1
Total	438.3	497.4	387.3	237.8	63.0	153.4	47.1

* 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	1.4 %	1.4 %	1.0 %	1.1 %
15-35	1.2 %	1.4 %	1.2 %	1.3 %
36-60	-	2.3 %	1.4 %	1.7 %
61-90	-	2.8 %	1.5 %	1.8 %
91-180	-	1.9 %	1.5 %	1.8 %
>180	2.0 %	1.7 %	3.2 %	1.9 %
Total	1.3 %	1.5 %	1.2 %	1.3 %

*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

Sector	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	2370	2329	10	83	1523	1914	8	139	1427	1982
Intragruppo y off-shore***	0	0	1216	618	11	0	1346	557	0	0	1399	504
Otros	83	19	627	1266	72	10	332	729	139	8	374	715
Total	103	103	4213	4213	92	92	3201	3201	147	147	3201	3201

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(360/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo