

Fecha de Publicación: 03 de Junio de 2010
Fecha de Información: 01 de Junio 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\$604 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.0%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	122.0	23.2	12.0	87.6	1.2	24.4	10.0
15-35	111.9	265.3	167.5	40.8	72.8	46.2	25.0
36-60	27.4	2.2	0.0	0.0	2.2	27.4	0.0
61-90	19.4	3.5	0.0	0.0	3.5	19.4	0.0
91-180	0.9	26.2	25.0	0.0	1.2	0.9	0.0
>180	0.7	1.4	0.0	0.0	1.4	0.7	0.0
Total	282.4	321.8	204.5	128.4	82.3	119.0	35.0

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	1.2 %	1.0 %	1.0 %	1.0 %
15-35	0.9 %	1.1 %	0.7 %	0.9 %
36-60	-	1.9 %	0.8 %	0.8 %
61-90	-	2.2 %	1.3 %	1.4 %
91-180	-	1.7 %	1.2 %	1.7 %
>180	-	2.3 %	1.7 %	2.1 %
Total	0.9 %	1.2 %	0.9 %	1.0 %

*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	31 de May. al 4 de Junio				7 al 11 de Junio				14 al 18 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	13	75	1799	1954	13	147	1617	2068	8	41	1159	1138
Intragrupa y off-shore***	0	0	1370	765	0	0	1434	583	7	0	799	240
Otros	75	13	341	790	147	13	406	805	34	8	177	757
Total	88	88	3510	3510	160	160	3457	3457	49	49	2135	2135

* 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 intragrupo