

Fecha de Publicación: 04 de Junio de 2010
Fecha de Información: 02 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\$1,079 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.8%.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	185.8	37.0	0.0	163.2	37.0	22.6	0.0
15-35	281.5	302.1	227.2	204.6	48.9	50.9	26.0
36-60	41.2	18.1	0.0	0.0	18.1	41.2	0.0
61-90	34.6	6.2	0.0	0.0	6.2	34.6	0.0
91-180	19.9	59.1	38.0	2.4	21.1	17.5	0.0
>180	41.7	51.8	40.0	0.0	11.8	41.7	0.0
Total	604.8	474.3	305.2	370.2	143.1	208.6	26.0

* 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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	-	0.7 %	0.7 %	0.7 %
15-35	0.2 %	0.9 %	0.3 %	0.5 %
36-60	-	1.3 %	1.0 %	1.1 %
61-90	-	2.1 %	1.3 %	1.4 %
91-180	-	1.7 %	1.4 %	1.6 %
>180	-	1.6 %	1.5 %	1.5 %
Total	0.2 %	1.1 %	0.7 %	0.8 %

*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	83	1911	1946	13	148	1676	2086	8	42	1181	1160
Intragrupa y off-shore***	0	0	1370	874	0	0	1434	636	7	0	799	250
Otros	83	13	333	794	148	13	424	811	35	8	199	770
Total	96	96	3615	3615	161	161	3534	3534	50	50	2180	2180

* 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 intragrupo