

Fecha de Publicación: 09 de Junio de 2010
Fecha de Información: 04 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\$668 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.2%.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	126.1	94.1	67.2	46.0	16.9	70.1	10.0
15-35	141.6	228.9	117.0	55.0	93.9	68.6	18.0
36-60	2.9	5.5	0.0	0.0	5.5	2.9	0.0
61-90	6.0	9.4	0.0	0.0	9.4	6.0	0.0
91-180	17.2	17.9	7.0	9.0	10.9	8.2	0.0
>180	6.0	11.8	0.0	0.0	5.8	0.0	6.0
Total	299.8	367.7	191.2	110.0	142.5	155.8	34.0

* 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	0.0 %	0.9 %	-0.3 %	0.0 %
15-35	-0.2 %	0.2 %	0.0 %	0.1 %
36-60	-	0.8 %	0.3 %	0.6 %
61-90	-	1.6 %	0.6 %	1.2 %
91-180	-	1.5 %	1.0 %	1.2 %
>180	0.7 %	1.9 %	-	1.3 %
Total	0.0 %	0.5 %	0.0 %	0.2 %

*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

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**	14	76	1901	1947	15	149	1817	2256	8	45	1299	1236
Intragrupa y off-shore***	0	0	1370	874	0	1	1588	742	10	0	812	282
Otros	76	14	333	784	149	14	440	846	35	8	253	845
Total	90	90	3604	3604	164	164	3845	3845	53	53	2364	2364

* 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