

Fecha de Publicación: 10 de Junio de 2010
Fecha de Información: 08 de Junio 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\$950 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.0%.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	175.5	84.4	17.5	138.0	44.9	15.5	22.0
15-35	149.0	358.3	245.5	79.9	100.8	57.1	12.0
36-60	77.6	10.4	9.5	25.0	0.9	52.6	0.0
61-90	3.6	27.3	25.0	0.0	2.3	3.6	0.0
91-180	27.8	17.1	0.0	5.0	17.1	22.8	0.0
>180	10.6	8.0	0.0	0.0	8.0	10.6	0.0
Total	444.1	505.6	297.5	247.9	174.1	162.2	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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0.0 %	2.3 %	1.8 %	1.7 %
15-35	9.5 %	0.7 %	-0.4 %	0.6 %
36-60	-	0.8 %	0.8 %	0.8 %
61-90	-	1.9 %	0.4 %	1.0 %
91-180	-	1.5 %	1.0 %	1.2 %
>180	-	2.3 %	1.0 %	1.5 %
Total	3.4 %	1.0 %	0.8 %	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	7 al 11 de Junio				14 al 18 de Junio				21 al 25 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	150	1868	2272	10	46	1413	1303	10	49	1095	1292
Intragruppo y off-shore***	0	1	1630	815	10	0	837	353	0	0	865	289
Otros	150	13	411	822	35	10	274	869	49	10	279	657
Total	164	164	3909	3909	55	55	2524	2524	59	59	2238	2238

* 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