

Fecha de Publicación: 11 de Junio de 2010
Fecha de Información: 09 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\$773 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	179.5	88.9	27.0	99.4	31.9	50.1	30.0
15-35	160.6	179.0	90.3	49.5	53.8	76.1	35.0
36-60	7.1	33.7	22.0	0.0	11.7	7.1	0.0
61-90	31.0	15.9	0.0	0.0	15.9	31.0	0.0
91-180	14.6	17.2	0.0	0.0	17.2	14.6	0.0
>180	5.0	40.6	22.6	5.0	18.0	0.0	0.0
Total	397.8	375.4	161.8	153.9	148.6	178.9	65.0

* 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	-4.4 %	3.6 %	1.8 %	1.4 %
15-35	0.1 %	0.7 %	0.2 %	0.4 %
36-60	-	1.1 %	0.0 %	0.9 %
61-90	-	1.5 %	0.7 %	1.0 %
91-180	-	2.0 %	1.0 %	1.6 %
>180	-	2.6 %	1.8 %	2.4 %
Total	-2.0 %	1.6 %	1.0 %	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	1948	2287	11	46	1490	1352	12	52	1166	1351
Intragruppo y off-shore***	0	1	1645	880	10	0	849	387	0	0	870	286
Otros	150	13	411	837	35	11	297	897	52	12	287	686
Total	164	164	4004	4004	56	56	2636	2636	64	64	2323	2323

* 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