

Fecha de Publicación: 18 de Junio de 2010
Fecha de Información: 16 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\$959 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0.6%.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	217.9	52.5	1.5	160.7	41.0	47.2	10.0
15-35	283.8	285.7	215.2	46.0	29.5	196.8	41.0
36-60	7.1	4.0	0.0	0.0	4.0	7.1	0.0
61-90	24.9	6.8	0.0	0.0	6.8	24.9	0.0
91-180	8.3	16.1	0.0	0.0	16.1	8.3	0.0
>180	34.1	17.6	5.0	0.0	2.6	24.1	10.0
Total	576.1	382.9	221.7	206.7	100.2	308.4	61.0

* 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 %	0.4 %	0.6 %	0.6 %
15-35	0.2 %	0.8 %	0.1 %	0.4 %
36-60	-	1.4 %	0.3 %	0.7 %
61-90	-	1.5 %	0.7 %	0.8 %
91-180	-	1.7 %	0.8 %	1.4 %
>180	2.4 %	2.3 %	1.4 %	1.8 %
Total	0.6 %	0.9 %	0.4 %	0.6 %

*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	14 al 18 de Junio				21 al 25 de Junio				28 de Jun. al 2 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	42	1893	1502	16	56	1371	1488	9	229	1389	1464
Intragrupa y off-shore***	3	1	912	688	0	0	931	352	0	0	1026	613
Otros	39	11	353	968	56	16	336	798	229	9	216	554
Total	54	54	3158	3158	73	73	2638	2638	237	237	2631	2631

* 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