

Fecha de Publicación: 23 de Junio de 2010
Fecha de Información: 21 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\$637 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.1%.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	147.4	56.8	14.0	92.8	21.7	33.5	21.1
15-35	138.9	174.5	81.3	28.0	34.2	51.9	59.0
36-60	51.0	32.8	20.0	0.0	6.7	44.9	6.1
61-90	0.2	3.2	0.0	0.0	3.2	0.2	0.0
91-180	19.4	12.1	0.0	0.0	12.1	19.4	0.0
>180	0.0	0.6	0.0	0.0	0.6	0.0	0.0
Total	356.9	279.9	115.3	120.8	78.4	149.9	86.2

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones 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	3.9 %	0.6 %	0.8 %	1.2 %
15-35	0.6 %	1.3 %	0.9 %	1.0 %
36-60	1.1 %	1.4 %	0.8 %	1.0 %
61-90	-	1.9 %	0.6 %	1.8 %
91-180	-	1.9 %	1.4 %	1.6 %
>180	-	2.6 %	-	2.6 %
Total	1.5 %	1.3 %	0.9 %	1.1 %

*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	21 al 25 de Junio				28 de Jun. al 2 de Julio				5 al 9 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	18	58	1493	1576	9	230	1540	1611	7	189	794	1000
Intragrupa y off-shore***	0	0	947	410	0	0	1119	650	0	0	718	306
Otros	58	18	390	845	230	9	240	638	189	7	199	405
Total	76	76	2830	2830	240	240	2899	2899	196	196	1711	1711

* 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