

Fecha de Publicación: 30 de Junio de 2010
Fecha de Información: 25 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\$459 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1.0%.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	54.3	32.4	26.5	19.5	5.9	34.8	0.0
15-35	116.3	199.5	90.3	59.5	68.2	15.9	41.0
36-60	16.8	0.4	0.0	0.0	0.4	16.8	0.0
61-90	6.9	2.4	0.0	0.0	2.4	6.9	0.0
91-180	12.5	8.1	5.0	0.0	3.1	12.5	0.0
>180	0.0	9.1	0.0	0.0	9.1	0.0	0.0
Total	206.8	251.8	121.8	79.0	89.1	86.8	41.0

* 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	-	2.2 %	-0.2 %	0.0 %
15-35	0.3 %	0.7 %	2.5 %	1.1 %
36-60	-	1.3 %	0.1 %	0.1 %
61-90	-	2.5 %	0.7 %	1.2 %
91-180	-	1.9 %	0.9 %	1.3 %
>180	-	2.2 %	-	2.2 %
Total	0.3 %	0.9 %	1.2 %	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	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**	19	55	1583	1578	11	233	1984	1845	7	192	938	1072
Intragrupa y off-shore***	0	0	947	527	0	0	1155	809	0	0	745	346
Otros	55	19	393	817	233	11	296	781	192	7	218	483
Total	74	74	2922	2922	244	244	3435	3435	199	199	1901	1901

* 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