

Fecha de Publicación: 02 de Junio de 2010
Fecha de Información: 31 de Mayo 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\$268 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	22.0	10.7	0.0	0.0	3.7	15.0	7.0
15-35	79.0	55.0	0.0	10.0	13.0	27.0	42.0
36-60	6.8	4.8	0.7	0.0	4.0	6.8	0.0
61-90	1.3	1.5	0.0	0.0	1.5	1.3	0.0
91-180	30.0	53.5	0.0	0.0	23.5	0.0	30.0
>180	0.0	3.1	0.0	0.0	3.1	0.0	0.0
Total	139.1	128.7	0.7	10.0	48.9	50.1	79.0

* 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 %	1.2 %	0.5 %	0.4 %
15-35	0.2 %	1.8 %	0.5 %	0.5 %
36-60	-	1.6 %	1.0 %	1.2 %
61-90	-	2.2 %	1.0 %	1.6 %
91-180	1.6 %	2.2 %	-	1.9 %
>180	-	2.0 %	-	2.0 %
Total	0.7 %	1.9 %	0.6 %	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	31 de May. al 4 de Junio				7 al 11 de Junio				14 al 18 de Junio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	12	84	1738	1943	11	147	1564	2048	7	41	1131	1127
Intragruppo y off-shore***	11	0	1357	705	0	0	1424	555	7	0	799	240
Otros	73	12	343	790	147	11	405	790	34	7	167	730
Total	96	96	3438	3438	158	158	3393	3393	48	48	2097	2097

* 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