

Fecha de Publicación: 7 de Julio de 2010
Fecha de Información: 01 de Julio de 2010 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1734,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 00%.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	188,8	203,5	50,0	70,0	92,5	57,8	61,0
15-35	328,1	552,2	172,1	109,0	197,6	36,6	182,5
36-60	116,5	68,5	0,0	0,0	68,5	116,5	0,0
61-90	59,3	9,0	4,7	10,0	4,3	49,3	0,0
91-180	60,3	94,9	0,2	0,0	94,7	60,3	0,0
>180	22,1	30,9	0,0	0,0	24,9	16,1	6,0
Total	775,2	959,0	227,0	189,0	482,5	336,7	249,5

* 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	0,4 %	0,1 %	-0,6 %	-0,1 %
15-35	-0,1 %	0,0 %	-0,4 %	-0,1 %
36-60	-	0,0 %	-0,3 %	-0,2 %
61-90	-	1,8 %	0,0 %	0,2 %
91-180	-	0,8 %	0,3 %	0,6 %
>180	1,6 %	1,4 %	2,0 %	1,7 %
Total	0,0 %	0,2 %	-0,2 %	0,0 %

*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	28 de Jun. al 2 de Julio				5 al 9 de Julio				12 al 16 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	220	2225	1968	10	187	1092	1194	12	236	1218	1129
Intragruppo y off-shore***	0	0	1194	947	0	0	806	380	0	0	773	309
Otros	220	11	370	874	187	10	253	577	236	12	183	736
Total	232	232	3789	3789	196	196	2151	2151	248	248	2174	2174

* 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