

Fecha de Publicación: 07 de Julio de 2010
Fecha de Información: 02 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\$685,4 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	175,5	122,8	56,0	47,3	6,8	68,2	60,0
15-35	128,2	133,7	37,3	102,0	80,4	10,2	16,0
36-60	29,7	11,6	0,0	0,0	11,6	29,7	0,0
61-90	30,4	4,3	0,0	0,0	4,3	30,4	0,0
91-180	18,7	25,7	0,0	0,0	25,7	18,7	0,0
>180	0,0	4,8	0,0	0,0	4,8	0,0	0,0
Total	382,4	303,0	93,3	149,3	133,7	157,1	76,0

* 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 %	0,3 %	-0,4 %	-0,1 %
15-35	0,5 %	0,3 %	-0,4 %	0,0 %
36-60	-	0,9 %	0,2 %	0,4 %
61-90	-	1,4 %	0,0 %	0,2 %
91-180	-	1,0 %	0,2 %	0,6 %
>180	-	2,6 %	-	2,6 %
Total	0,1 %	0,5 %	-0,3 %	0,1 %

*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	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	223	2225	1965	15	192	1253	1384	16	237	1341	1183
Intragruppo y off-shore***	0	0	1194	947	0	0	890	464	0	0	790	320
Otros	223	11	367	874	192	15	297	591	237	16	187	816
Total	235	235	3786	3786	206	206	2440	2440	253	253	2319	2319

* 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