

Fecha de Publicación: 8 de Julio de 2010
Fecha de Información: 06 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\$632,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 00%.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	133,1	56,5	3,0	57,0	53,5	76,1	0,0
15-35	157,6	177,7	74,0	99,0	81,7	36,6	22,0
36-60	7,4	33,3	32,3	0,0	1,0	7,4	0,0
61-90	12,6	4,7	0,0	0,0	4,7	12,6	0,0
91-180	19,3	3,4	0,0	0,0	3,4	19,3	0,0
>180	0,7	26,6	25,0	0,0	1,6	0,7	0,0
Total	330,7	302,1	134,3	156,0	145,9	152,7	22,0

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

*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

Sectores	5 al 9 de Julio				12 al 16 de Julio				19 al 23 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	15	193	1347	1425	17	237	1374	1193	7	112	963	1030
Intragrupa y off-shore***	0	0	890	516	0	0	790	325	0	0	649	260
Otros	193	15	337	633	237	17	198	844	112	7	156	479
Total	208	208	2574	2574	254	254	2362	2362	119	119	1768	1768

* 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