

Fecha de Publicación: 9 de Julio de 2010
Fecha de Información: 07 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\$735,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 01%.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	150,4	101,1	35,5	86,5	45,6	43,9	20,0
15-35	93,8	224,7	132,5	51,5	62,2	12,3	30,0
36-60	25,4	9,1	0,0	0,0	9,1	25,4	0,0
61-90	27,5	16,1	0,0	0,0	16,1	27,5	0,0
91-180	16,6	51,9	50,0	0,0	1,9	16,6	0,0
>180	0,6	18,1	17,0	0,0	1,1	0,6	0,0
Total	314,3	421,0	235,0	138,0	136,0	126,3	50,0

* 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 %	1,6 %	0,1 %	0,6 %
15-35	3,6 %	0,0 %	-1,1 %	0,3 %
36-60	-	0,4 %	-0,5 %	-0,3 %
61-90	-	0,3 %	-0,2 %	0,0 %
91-180	-	11,0 %	0,0 %	8,3 %
>180	-	1,4 %	1,6 %	1,5 %
Total	2,2 %	2,2 %	-0,2 %	1,3 %

*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	196	1422	1422	17	240	1435	1278	7	112	978	1044
Intragruppo y off-shore***	0	0	890	592	0	0	822	335	0	0	653	260
Otros	196	15	334	632	240	17	231	875	112	7	166	494
Total	212	212	2646	2646	257	257	2488	2488	119	119	1797	1797

* 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