

Fecha de Publicación: 12 de Julio de 2010
Fecha de Información: 08 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\$1060,4 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	106,3	190,6	124,7	8,0	55,9	88,3	10,0
15-35	93,8	393,7	230,5	41,5	139,2	28,3	24,0
36-60	59,3	19,1	3,8	0,0	5,3	49,3	10,0
61-90	64,6	26,0	0,5	0,0	25,5	64,6	0,0
91-180	43,6	46,5	44,0	0,0	2,5	43,6	0,0
>180	0,0	16,9	0,0	0,0	16,9	0,0	0,0
Total	367,6	692,8	403,4	49,5	245,3	274,1	44,0

* 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 %	0,2 %	-0,9 %	-0,4 %
15-35	-1,0 %	-0,3 %	-0,6 %	-0,4 %
36-60	0,4 %	1,0 %	-0,6 %	-0,3 %
61-90	-	0,3 %	-0,2 %	-0,1 %
91-180	-	0,3 %	-0,2 %	0,1 %
>180	-	1,8 %	0,8 %	1,8 %
Total	-0,4 %	-0,1 %	-0,6 %	-0,3 %

*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**	0	1	170	42	2	2	176	276	0	2	50	29
Intragruppo y off-shore***	0	0	0	129	0	0	156	23	0	0	7	3
Otros	1	0	42	42	2	2	99	133	2	0	12	37
Total	1	1	212	212	5	5	431	431	2	2	68	68

* 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