

Fecha de Publicación: 13 de Julio de 2010
Fecha de Información: 09 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\$807,2 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	89,9	94,3	10,0	38,0	59,3	26,9	25,0
15-35	174,2	223,7	49,0	39,0	82,7	43,2	92,0
36-60	39,8	71,5	0,0	0,0	71,5	39,8	0,0
61-90	34,0	14,8	0,0	0,0	14,8	34,0	0,0
91-180	30,8	28,0	13,0	0,0	10,0	25,8	5,0
>180	0,0	6,2	0,0	0,0	6,2	0,0	0,0
Total	368,7	438,6	72,0	77,0	244,6	169,7	122,0

* 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 %	-1,1 %	-0,5 %
15-35	-0,8 %	-0,1 %	-0,6 %	-0,4 %
36-60	-	-0,2 %	-0,5 %	-0,3 %
61-90	-	0,4 %	-0,1 %	0,0 %
91-180	0,4 %	0,7 %	-0,1 %	0,3 %
>180	-	1,8 %	-	1,8 %
Total	-0,6 %	0,0 %	-0,5 %	-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

Sector	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	215	1422	1404	18	242	1582	1519	8	115	1026	1084
Intragruppo y off-shore***	0	0	890	592	0	0	947	377	0	0	663	264
Otros	215	15	316	632	242	18	322	955	115	8	187	527
Total	230	230	2628	2628	259	259	2852	2852	123	123	1875	1875

* 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