

Fecha de Publicación: 14 de Julio de 2010
Fecha de Información: 12 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\$1031,7 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	168,7	131,4	15,0	80,0	96,4	68,7	20,0
15-35	168,6	194,5	83,0	97,0	71,5	31,6	40,0
36-60	78,7	117,4	11,3	2,0	90,1	60,7	16,0
61-90	50,5	11,7	0,1	20,0	11,7	30,5	0,0
91-180	72,4	34,9	20,1	0,0	14,8	72,4	0,0
>180	0,0	2,9	0,0	0,0	2,9	0,0	0,0
Total	538,9	492,8	129,5	199,0	287,3	263,9	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 intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0,0 %	-7,4 %	1,8 %	-2,0 %
15-35	2,9 %	1,8 %	-0,5 %	1,1 %
36-60	0,2 %	1,4 %	-0,2 %	0,7 %
61-90	-	0,5 %	-0,2 %	-0,2 %
91-180	-	0,7 %	0,1 %	0,3 %
>180	-	2,3 %	-	2,3 %
Total	1,5 %	-1,0 %	0,5 %	-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

Sectores	12 al 16 de Julio				19 al 23 de Julio				26 al 30 de Julio			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	16	218	1680	1587	8	115	1096	1148	6	198	1197	952
Intragrupa y off-shore***	0	0	947	422	0	0	678	299	0	0	603	478
Otros	218	16	380	998	115	8	225	553	198	6	192	562
Total	234	234	3007	3007	123	123	1999	1999	204	204	1992	1992

* 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