

Fecha de Publicación: 16 de Julio de 2010
Fecha de Información: 14 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\$1207,1 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	205,9	103,2	27,5	86,5	45,7	89,4	30,0
15-35	192,9	366,4	290,0	57,0	23,4	82,9	53,0
36-60	43,9	49,9	22,0	0,0	27,9	43,9	0,0
61-90	52,0	17,3	0,0	0,0	17,3	52,0	0,0
91-180	26,2	15,5	0,0	0,0	3,5	14,2	12,0
>180	62,5	71,6	50,0	0,0	6,6	47,5	15,0
Total	583,4	623,7	389,5	143,5	124,2	329,9	110,0

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

Sector	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	225	1868	1657	9	114	1237	1302	6	198	1286	1058
Intragrupa y off-shore***	0	0	956	553	0	0	745	333	0	0	697	478
Otros	225	16	416	1030	114	9	291	639	198	6	204	651
Total	241	241	3240	3240	123	123	2273	2273	205	205	2188	2188

* 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