

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 operaciones 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