

Fecha de Publicación: 19 de Julio de 2010
Fecha de Información: 15 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\$1198,3 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	210,5	109,9	44,5	110,5	59,4	94,0	6,0
15-35	204,4	364,3	255,0	56,0	67,3	106,4	42,0
36-60	66,1	52,3	30,0	0,0	22,3	66,1	0,0
61-90	31,0	8,1	0,0	0,0	8,1	31,0	0,0
91-180	69,5	56,6	20,0	0,0	30,6	63,5	6,0
>180	1,0	24,6	23,0	0,0	1,6	1,0	0,0
Total	582,4	615,9	372,5	166,5	189,4	361,9	54,0

* 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	-0,2 %	-1,3 %	-0,3 %	-0,6 %
15-35	0,5 %	0,5 %	-0,3 %	0,3 %
36-60	-	0,5 %	0,1 %	0,3 %
61-90	-	0,9 %	0,2 %	0,4 %
91-180	0,2 %	1,0 %	0,7 %	0,8 %
>180	-	1,8 %	1,1 %	1,8 %
Total	0,4 %	0,2 %	-0,1 %	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**	15	228	1883	1661	9	112	1404	1377	7	198	1334	1089
Intragruppo y off-shore***	0	0	958	568	0	0	758	428	0	0	727	478
Otros	228	15	417	1030	112	9	348	705	198	7	206	699
Total	243	243	3258	3258	121	121	2510	2510	205	205	2267	2267

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado})^{(360/\text{Plazo})}) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo