

Fecha de Publicación: 21 de Julio de 2010
Fecha de Información: 16 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\$747,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 01%.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	121,5	92,5	10,0	1,1	57,5	95,4	25,0
15-35	219,5	223,0	168,0	110,0	11,0	65,5	44,0
36-60	5,9	4,4	0,0	0,0	4,4	5,9	0,0
61-90	9,9	0,5	0,0	0,0	0,5	9,9	0,0
91-180	6,5	28,7	20,0	0,0	3,7	1,5	5,0
>180	9,2	25,6	15,0	0,0	5,6	4,2	5,0
Total	372,4	374,8	213,0	111,1	82,8	182,3	79,0

* 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	0,8 %	0,8 %	0,0 %	0,4 %
15-35	4,3 %	0,6 %	0,3 %	1,0 %
36-60	-	1,7 %	0,3 %	0,9 %
61-90	-	2,0 %	0,3 %	0,4 %
91-180	1,2 %	1,4 %	0,5 %	1,4 %
>180	1,8 %	2,2 %	1,3 %	2,0 %
Total	2,8 %	0,9 %	0,2 %	0,9 %

*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	226	1896	1680	10	112	1463	1436	7	198	1395	1124
Intragrupa y off-shore***	0	0	958	568	0	1	766	428	0	0	729	478
Otros	226	15	437	1042	112	9	384	750	198	7	228	750
Total	241	241	3290	3290	122	122	2613	2613	205	205	2352	2352

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo