

Fecha de Publicación: 23 de Julio de 2010
Fecha de Información: 21 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\$764,0 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	83,4	77,4	28,0	52,5	49,4	30,9	0,0
15-35	243,6	217,2	155,0	58,8	20,2	142,8	42,0
36-60	11,9	4,0	0,0	0,0	4,0	11,9	0,0
61-90	16,9	21,1	15,0	0,0	6,1	16,9	0,0
91-180	0,3	5,8	0,0	0,0	5,8	0,3	0,0
>180	1,1	81,3	43,0	0,0	38,3	1,1	0,0
Total	357,2	406,9	241,0	111,3	123,8	203,9	42,0

* 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	-	1,7 %	-0,3 %	0,7 %
15-35	0,9 %	1,4 %	0,4 %	0,8 %
36-60	-	0,8 %	-0,1 %	0,1 %
61-90	-	1,0 %	0,5 %	0,8 %
91-180	-	1,7 %	1,4 %	1,7 %
>180	-	1,8 %	1,6 %	1,8 %
Total	0,9 %	1,5 %	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	19 al 23 de Julio				26 al 30 de Julio				2 al 6 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	115	1537	1449	7	194	1446	1244	5	257	1100	1059
Intragrupa y off-shore***	0	1	766	490	0	0	768	478	0	0	611	398
Otros	115	10	386	751	194	7	309	800	257	5	229	483
Total	125	125	2690	2690	201	201	2522	2522	262	262	1940	1940

* 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