

Fecha de Publicación: 26 de Julio de 2010
Fecha de Información: 22 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\$762,8 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	137,1	71,8	19,5	14,8	12,3	82,3	40,0
15-35	234,5	201,2	87,5	98,5	26,2	48,5	87,5
36-60	14,6	20,7	9,5	0,0	4,2	7,6	7,0
61-90	11,0	4,0	0,0	0,0	4,0	11,0	0,0
91-180	9,6	8,2	0,0	0,0	8,2	9,6	0,0
>180	13,5	36,6	22,0	0,0	6,6	5,5	8,0
Total	420,4	342,5	138,5	113,3	61,5	164,6	142,5

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

* 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	117	1541	1453	8	194	1513	1300	6	257	1166	1066
Intragrupa y off-shore***	0	1	771	494	0	0	778	489	0	0	616	398
Otros	117	9	386	751	194	8	316	817	257	6	232	549
Total	128	128	2698	2698	202	202	2607	2607	263	263	2014	2014

* 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 intragrupo