

Fecha de Publicación: 28 de Julio de 2010
Fecha de Información: 26 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\$890,7 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	124,8	124,4	80,5	60,5	43,9	64,3	0,0
15-35	199,4	282,8	187,0	111,3	64,8	57,1	31,0
36-60	22,2	44,2	20,0	0,0	24,2	22,2	0,0
61-90	21,8	2,2	0,0	0,0	2,2	21,8	0,0
91-180	53,4	10,2	0,0	0,0	10,2	53,4	0,0
>180	4,4	0,9	0,0	0,0	0,9	4,4	0,0
Total	426,0	464,8	287,5	171,8	146,3	223,2	31,0

* 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	-	1,8 %	-0,6 %	0,6 %
15-35	1,7 %	0,3 %	-0,3 %	0,2 %
36-60	-	0,3 %	-0,3 %	0,1 %
61-90	-	0,8 %	0,1 %	0,2 %
91-180	-	1,1 %	0,0 %	0,2 %
>180	-	2,4 %	1,7 %	1,8 %
Total	1,7 %	0,8 %	-0,3 %	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	26 al 30 de Julio				2 al 6 de Agosto				9 al 13 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	6	192	1638	1463	7	257	1274	1136	7	258	1360	1318
Intragrupa y off-shore***	0	0	853	554	0	0	666	459	0	0	770	343
Otros	192	6	373	847	257	7	252	596	258	7	207	676
Total	198	198	2864	2864	264	264	2191	2191	265	265	2337	2337

* 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