

Fecha de Publicación: 29 de Julio de 2010
Fecha de Información: 27 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\$692,1 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	74,9	62,4	0,0	50,0	62,4	24,9	0,0
15-35	221,8	189,0	122,0	142,0	54,0	66,8	13,0
36-60	6,8	0,9	0,0	0,0	0,9	6,8	0,0
61-90	25,2	49,1	15,0	0,0	26,1	17,2	8,0
91-180	29,3	11,1	0,0	0,0	11,1	29,3	0,0
>180	4,8	16,7	0,0	0,0	16,7	4,8	0,0
Total	362,9	329,2	137,0	192,0	171,2	149,9	21,0

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

* 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	190	1689	1496	7	250	1293	1137	7	258	1396	1370
Intragruppo y off-shore***	0	0	853	604	0	0	666	459	0	0	786	343
Otros	190	6	406	848	250	7	252	616	258	7	243	712
Total	196	196	2949	2949	257	257	2212	2212	265	265	2424	2424

* 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