

Fecha de Publicación: 30 de Julio de 2010
Fecha de Información: 28 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\$831,2 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	116,1	84,8	0,0	26,5	74,8	79,6	10,0
15-35	186,4	299,0	113,5	104,5	142,5	38,9	43,0
36-60	7,0	7,1	0,0	0,0	7,1	7,0	0,0
61-90	20,6	26,5	0,0	1,0	26,5	19,6	0,0
91-180	41,1	15,7	0,0	0,0	15,7	41,1	0,0
>180	2,0	24,8	10,0	0,0	14,8	2,0	0,0
Total	373,3	457,9	123,5	132,0	281,4	188,3	53,0

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

* 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	189	1731	1496	7	254	1342	1216	7	260	1443	1380
Intragrupa y off-shore***	0	0	853	621	0	0	666	469	0	0	786	353
Otros	189	6	406	873	254	7	322	645	260	7	243	739
Total	195	195	2991	2991	261	261	2330	2330	267	267	2472	2472

* 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