

Fecha de Publicación: 02 de Agosto de 2010

Fecha de Información: 29 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\$946,9 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	187,6	86,5	5,9	53,0	13,8	67,8	66,8
15-35	296,8	279,7	186,0	82,5	28,7	149,3	65,0
36-60	12,2	12,8	0,0	0,0	11,0	10,4	1,8
61-90	8,3	7,9	0,0	0,0	7,9	8,3	0,0
91-180	35,4	9,4	0,0	0,0	9,4	35,4	0,0
>180	0,0	10,4	10,0	0,0	0,4	0,0	0,0
Total	540,3	406,7	201,9	135,5	71,2	271,2	133,6

* 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	-0,1 %	2,4 %	-1,1 %	-0,5 %
15-35	-0,5 %	-0,4 %	-1,0 %	-0,7 %
36-60	-0,6 %	0,4 %	-0,4 %	0,0 %
61-90	-	0,8 %	-0,4 %	0,2 %
91-180	-	2,0 %	0,1 %	0,5 %
>180	-	2,4 %	-	2,4 %
Total	-0,3 %	0,2 %	-0,9 %	-0,5 %

* 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**	7	189	1752	1497	6	255	1392	1234	7	260	1562	1453
Intragrupa y off-shore***	0	0	853	641	0	0	671	472	0	0	792	383
Otros	189	7	407	874	255	6	333	689	260	7	245	763
Total	196	196	3012	3012	261	261	2395	2395	267	267	2599	2599

* 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