

Fecha de Publicación: 3 de Agosto de 2010
Fecha de Información: 30 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\$606,9 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	24,6	83,1	29,0	0,0	54,1	24,6	0,0
15-35	146,4	184,3	96,8	24,0	75,4	110,4	12,0
36-60	1,3	41,6	7,0	0,0	34,6	1,3	0,0
61-90	25,3	22,3	0,0	0,0	22,3	25,3	0,0
91-180	43,6	34,3	5,0	0,0	29,3	43,6	0,0
>180	0,0	0,2	0,0	0,0	0,2	0,0	0,0
Total	241,1	365,8	137,8	24,0	215,9	205,1	12,0

* 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	-	-0,4 %	-1,0 %	-0,6 %
15-35	-0,2 %	0,2 %	-1,0 %	-0,4 %
36-60	-	0,3 %	-0,6 %	0,3 %
61-90	-	0,7 %	-0,3 %	0,2 %
91-180	-	0,7 %	0,1 %	0,4 %
>180	-	3,8 %	-	3,8 %
Total	-0,2 %	0,2 %	-0,7 %	-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**	7	189	1752	1497	6	256	1402	1253	8	260	1575	1516
Intragruppo y off-shore***	0	0	853	641	0	0	671	472	0	0	821	383
Otros	189	7	407	874	256	6	351	699	260	8	279	776
Total	196	196	3012	3012	262	262	2424	2424	268	268	2675	2675

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo