

Fecha de Publicación: 04 de Agosto de 2010
Fecha de Información: 02 de Agosto de 2010¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$680,3 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	88,8	76,3	18,0	66,0	43,3	7,8	15,0
15-35	193,5	170,1	48,8	98,8	101,4	74,7	20,0
36-60	8,1	10,4	0,0	0,0	10,4	8,1	0,0
61-90	13,1	7,6	0,0	0,0	7,6	13,1	0,0
91-180	33,4	41,7	28,0	0,0	13,7	33,4	0,0
>180	22,0	15,3	1,0	22,0	14,3	0,0	0,0
Total	358,9	321,4	95,8	186,8	190,6	137,1	35,0

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

* 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	2 al 6 de Agosto				9 al 13 de Agosto				16 al 20 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	256	1454	1283	9	260	1607	1559	13	60	1069	1395
Intragrupa y off-shore***	0	0	697	508	0	0	824	419	0	0	1057	460
Otros	256	10	341	700	260	9	319	772	60	13	211	482
Total	266	266	2491	2491	269	269	2750	2750	73	73	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