

Fecha de Publicación: 5 de Agosto de 2010
Fecha de Información: 03 de Agosto 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\$974,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 01%.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	138,7	54,5	7,0	37,0	37,5	91,7	10,0
15-35	293,7	280,1	125,3	162,3	102,8	79,3	52,0
36-60	4,8	59,5	56,5	0,0	3,0	4,8	0,0
61-90	7,0	34,1	30,0	0,0	4,1	7,0	0,0
91-180	42,0	51,8	15,0	0,0	36,8	42,0	0,0
>180	0,2	8,6	5,0	0,0	3,6	0,2	0,0
Total	486,3	488,7	238,8	199,3	187,9	224,9	62,0

* 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	-0,1 %	-0,3 %	1,1 %	0,7 %
15-35	0,2 %	0,0 %	-0,5 %	-0,2 %
36-60	-	0,0 %	-0,4 %	0,0 %
61-90	-	12,6 %	0,0 %	10,4 %
91-180	-	1,5 %	0,1 %	0,8 %
>180	-	2,1 %	1,5 %	2,1 %
Total	0,2 %	1,2 %	0,1 %	0,6 %

* 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	257	1466	1356	10	260	1732	1598	16	60	1091	1396
Intragrupa y off-shore***	0	0	764	512	0	0	824	452	0	0	1057	475
Otros	257	10	341	703	260	10	353	859	60	16	212	489
Total	267	267	2571	2571	269	269	2909	2909	76	76	2360	2360

* 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