

Fecha de Publicación: 9 de Agosto de 2010
Fecha de Información: 05 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\$898,5 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	174,7	62,0	26,5	93,0	15,5	61,7	20,0
15-35	203,2	298,7	146,0	48,5	114,7	116,7	38,0
36-60	13,0	10,2	4,0	0,0	6,2	13,0	0,0
61-90	34,1	34,6	0,0	0,0	11,1	10,6	23,5
91-180	27,1	18,8	2,4	0,3	16,4	26,9	0,0
>180	12,8	9,3	0,0	0,0	9,3	12,8	0,0
Total	464,9	433,6	178,9	141,8	173,2	241,6	81,5

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

* 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**	9	235	1577	1368	10	260	1923	1717	17	61	1112	1425
Intragrupa y off-shore***	0	0	775	568	0	0	866	532	0	0	1057	475
Otros	235	9	343	759	260	10	402	942	61	17	221	490
Total	244	244	2695	2695	270	270	3191	3191	78	78	2390	2390

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo