

Fecha de Publicación: 12 de Agosto de 2010
Fecha de Información: 10 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\$1063,3 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	116,5	25,9	17,0	68,1	8,9	48,4	0,0
15-35	269,0	394,6	158,0	181,8	166,6	17,2	70,0
36-60	37,3	21,6	20,0	0,0	1,6	37,3	0,0
61-90	18,1	11,8	0,0	0,0	11,8	18,1	0,0
91-180	24,1	62,8	50,0	0,0	12,8	24,1	0,0
>180	10,2	71,5	68,0	0,0	3,5	10,2	0,0
Total	475,2	588,2	313,0	249,9	205,2	155,3	70,0

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

* 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	9 al 13 de Agosto				16 al 20 de Agosto				23 al 27 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	260	2121	1807	17	69	1267	1499	6	221	1525	1083
Intragrupa y off-shore***	0	0	925	611	8	0	1073	544	0	0	571	496
Otros	260	11	428	1057	62	17	280	576	221	6	254	771
Total	271	271	3474	3474	87	87	2620	2620	227	227	2350	2350

* 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