

Fecha de Publicación: 17 de Agosto de 2010
Fecha de Información: 12 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\$1038,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,4%.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	77,0	110,7	55,0	17,0	55,7	60,0	0,0
15-35	308,2	395,1	190,4	151,1	96,7	49,2	108,0
36-60	43,9	17,1	0,0	5,0	17,1	38,9	0,0
61-90	38,0	14,7	0,0	5,5	14,7	32,5	0,0
91-180	4,7	12,0	3,0	0,0	9,0	4,7	0,0
>180	1,9	15,0	10,0	0,0	5,0	1,9	0,0
Total	473,8	564,5	258,4	178,6	198,1	187,2	108,0

* 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	-	0,9 %	-0,1 %	0,5 %
15-35	-0,1 %	0,3 %	0,2 %	0,2 %
36-60	-	1,0 %	0,2 %	0,5 %
61-90	-	1,2 %	0,4 %	0,7 %
91-180	-	1,3 %	0,5 %	1,1 %
>180	-	2,0 %	1,1 %	1,9 %
Total	-0,1 %	0,6 %	0,1 %	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**	10	241	2145	1811	19	70	1332	1615	7	222	1633	1165
Intragrupa y off-shore***	0	0	925	635	8	0	1145	559	0	0	604	513
Otros	241	10	433	1057	62	19	323	626	222	7	283	842
Total	252	252	3503	3503	89	89	2800	2800	229	229	2520	2520

* 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