

Fecha de Publicación: 18 de Agosto de 2010
Fecha de Información: 13 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\$640,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,8%.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	69,7	46,1	10,0	25,2	16,1	24,5	20,0
15-35	134,8	223,8	130,0	55,0	43,8	29,8	50,0
36-60	56,0	13,2	0,0	0,0	13,2	56,0	0,0
61-90	23,3	25,5	2,5	0,0	6,5	6,8	16,5
91-180	6,7	9,0	0,0	0,0	8,6	6,3	0,4
>180	17,3	14,8	10,0	10,0	4,0	6,5	0,8
Total	307,7	332,5	152,5	90,2	92,4	129,9	87,7

* 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	1,7 %	1,1 %	-0,1 %	0,6 %
15-35	1,5 %	0,3 %	0,7 %	0,6 %
36-60	-	1,4 %	0,6 %	0,8 %
61-90	1,0 %	1,7 %	0,8 %	1,2 %
91-180	1,4 %	1,8 %	0,8 %	1,3 %
>180	1,4 %	2,2 %	1,8 %	2,0 %
Total	1,5 %	0,6 %	0,6 %	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	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	2121	1810	19	69	1410	1645	9	222	1648	1183
Intragrupa y off-shore***	0	0	925	635	8	1	1147	583	0	0	612	513
Otros	241	10	432	1032	61	18	331	660	222	9	293	857
Total	251	251	3477	3477	88	88	2888	2888	231	231	2553	2553

* 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