

Fecha de Publicación: 20 de Agosto de 2010
Fecha de Información: 18 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\$878,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 1,2%.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	195,8	222,6	114,0	39,5	27,6	75,3	81,0
15-35	203,3	156,7	57,0	82,0	56,7	78,3	43,0
36-60	21,0	8,9	0,0	0,0	8,9	21,0	0,0
61-90	2,7	5,1	0,0	0,0	5,1	2,7	0,0
91-180	14,1	39,1	15,0	0,0	19,1	9,1	5,0
>180	7,1	2,5	0,0	7,0	2,5	0,1	0,0
Total	443,9	434,8	186,0	128,5	119,8	186,4	129,0

* 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	0,0 %	1,5 %	1,1 %	1,0 %
15-35	2,9 %	1,4 %	1,0 %	1,4 %
36-60	-	1,8 %	1,2 %	1,4 %
61-90	-	2,2 %	0,8 %	1,7 %
91-180	1,4 %	1,7 %	1,5 %	1,6 %
>180	-	2,6 %	1,8 %	2,0 %
Total	1,0 %	1,5 %	1,1 %	1,2 %

* 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	16 al 20 de Agosto				23 al 27 de Agosto				30 de Ago. al 3 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	14	73	1454	1683	10	224	1792	1433	3	415	1491	1484
Intragrupa y off-shore***	8	1	1189	619	0	0	743	536	0	0	869	555
Otros	65	13	328	668	224	10	331	897	415	3	335	656
Total	87	87	2970	2970	234	234	2866	2866	418	418	2696	2696

* 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