

Fecha de Publicación: 24 de Agosto de 2010
Fecha de Información: 20 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\$712,6 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	164,3	145,9	34,0	46,5	31,9	37,8	80,0
15-35	140,7	161,6	87,2	85,0	45,4	26,7	29,0
36-60	20,6	20,6	10,0	0,0	10,6	20,6	0,0
61-90	0,5	5,1	0,0	0,0	5,1	0,5	0,0
91-180	10,5	32,9	0,0	0,0	32,9	10,5	0,0
>180	3,9	5,9	0,0	0,0	2,7	0,7	3,2
Total	340,5	372,1	131,2	131,5	128,7	96,8	112,2

* 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 %	1,8 %	0,0 %	0,5 %
15-35	2,5 %	0,9 %	0,4 %	0,9 %
36-60	-	0,7 %	0,4 %	0,6 %
61-90	-	1,6 %	0,5 %	1,5 %
91-180	-	1,5 %	1,5 %	1,5 %
>180	1,1 %	2,7 %	1,8 %	1,8 %
Total	0,7 %	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	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**	13	74	1438	1668	11	228	1929	1539	3	415	1612	1609
Intragrupa y off-shore***	8	1	1189	629	0	0	789	602	0	0	895	586
Otros	66	12	313	643	228	11	361	938	415	3	384	696
Total	88	88	2940	2940	238	238	3079	3079	418	418	2891	2891

* 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