

Fecha de Publicación: 25 de Agosto de 2010
Fecha de Información: 23 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\$700,5 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	40,0	44,8	0,0	3,0	44,8	37,0	0,0
15-35	172,6	242,4	194,0	91,0	27,4	60,6	21,0
36-60	78,9	9,9	0,0	0,0	9,9	78,9	0,0
61-90	0,2	12,6	0,7	0,0	11,9	0,2	0,0
91-180	61,1	30,3	14,0	0,0	16,3	61,1	0,0
>180	5,0	2,5	0,0	5,0	2,5	0,0	0,0
Total	357,8	342,7	208,7	99,0	113,0	237,8	21,0

* 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	-	1,6 %	-0,1 %	0,8 %
15-35	4,4 %	0,2 %	0,0 %	0,4 %
36-60	-	0,6 %	0,2 %	0,3 %
61-90	-	0,9 %	0,0 %	0,9 %
91-180	-	1,0 %	0,3 %	0,5 %
>180	-	1,9 %	2,2 %	2,1 %
Total	4,4 %	0,5 %	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	23 al 27 de Agosto				30 de Ago. al 3 de Septiembre				6 al 10 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	10	226	1943	1553	3	415	1637	1640	3	495	1416	1318
Intragrupa y off-shore***	0	0	789	602	0	0	895	589	0	0	716	440
Otros	226	10	376	951	415	3	415	718	495	3	277	652
Total	236	236	3107	3107	418	418	2947	2947	498	498	2410	2410

* 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