

Fecha de Publicación: 26 de Agosto de 2010
Fecha de Información: 24 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\$1024,0 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,3%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragruppo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	160,6	52,7	1,0	62,9	21,7	67,7	30,0
15-35	321,7	347,7	197,0	199,5	69,7	41,2	81,0
36-60	42,4	4,5	1,0	0,0	3,5	42,4	0,0
61-90	2,7	5,5	0,0	0,0	5,5	2,7	0,0
91-180	50,1	25,0	0,0	0,0	3,0	28,1	22,0
>180	0,2	11,0	0,0	0,0	11,0	0,2	0,0
Total	577,7	446,3	199,0	262,4	114,3	182,3	133,0

* 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 intragruppo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	0,2 %	2,0 %	-1,1 %	-0,5 %
15-35	1,5 %	0,6 %	0,1 %	0,5 %
36-60	-	0,7 %	0,1 %	0,1 %
61-90	-	0,7 %	0,0 %	0,5 %
91-180	0,5 %	1,4 %	0,3 %	0,5 %
>180	-	1,3 %	2,3 %	1,3 %
Total	1,0 %	0,7 %	-0,3 %	0,3 %

* 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	229	2059	1558	4	415	1678	1688	3	495	1448	1343
Intragruppo y off-shore***	0	0	790	663	0	0	895	591	0	0	716	440
Otros	229	10	379	1007	415	4	434	728	495	3	282	663
Total	239	239	3228	3228	419	419	3007	3007	498	498	2446	2446

* 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 intragruppo