

Fecha de Publicación: 27 de Agosto de 2010
Fecha de Información: 25 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\$986,1 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,7%.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	86,3	232,7	168,0	18,0	33,7	37,3	31,0
15-35	260,6	273,7	167,3	144,0	74,4	84,6	32,0
36-60	1,3	2,0	0,0	0,0	2,0	1,3	0,0
61-90	37,1	33,4	6,0	1,3	27,4	35,9	0,0
91-180	14,4	33,8	30,0	0,0	3,8	14,4	0,0
>180	0,7	10,2	8,0	0,0	2,2	0,7	0,0
Total	400,4	585,7	379,3	163,3	143,5	174,1	63,0

* 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	0,1 %	1,5 %	-0,3 %	0,9 %
15-35	0,3 %	0,4 %	0,6 %	0,5 %
36-60	-	1,5 %	-0,7 %	0,7 %
61-90	-	1,0 %	0,8 %	0,9 %
91-180	-	0,8 %	0,5 %	0,7 %
>180	-	2,1 %	1,6 %	2,1 %
Total	0,2 %	0,9 %	0,5 %	0,7 %

*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	1627	4	416	1746	1828	4	495	1486	1377
Intragruppo y off-shore***	0	0	860	663	0	0	983	609	0	0	726	440
Otros	229	10	378	1007	416	4	454	746	495	4	306	701
Total	239	239	3297	3297	420	420	3183	3183	498	498	2518	2518

* 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: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragruppo