

Fecha de Publicación: 1 de Septiembre de 2010
Fecha de Información: 30 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\$897,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,3%.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	108,9	34,3	20,5	57,0	6,8	44,9	7,0
15-35	239,4	333,2	251,5	67,5	51,7	141,9	30,0
36-60	49,7	67,9	16,0	0,0	51,9	49,7	0,0
61-90	11,6	1,3	0,0	0,0	1,3	11,6	0,0
91-180	12,9	8,6	0,0	0,0	8,6	12,9	0,0
>180	5,6	24,2	22,6	0,0	1,5	5,6	0,0
Total	428,1	469,5	310,6	124,5	121,8	266,6	37,0

* 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 %	1,6 %	0,0 %	0,3 %
15-35	0,7 %	0,4 %	0,1 %	0,3 %
36-60	-	0,6 %	0,3 %	0,4 %
61-90	-	1,4 %	0,2 %	0,4 %
91-180	-	1,7 %	0,7 %	1,1 %
>180	-	2,4 %	2,3 %	2,3 %
Total	0,6 %	0,5 %	0,1 %	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	30 de Ago. al 3 de Septiembre				6 al 10 de Septiembre				13 al 17 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	7	436	1945	1990	5	495	1689	1431	10	167	1415	1459
Intragrupa y off-shore***	0	0	1087	721	0	0	726	541	0	0	858	499
Otros	436	7	496	817	494	5	351	794	167	10	330	645
Total	443	443	3528	3528	499	499	2766	2766	176	176	2603	2603

* 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 intragrupo