

Fecha de Publicación: 6 de Septiembre de 2010
Fecha de Información: 02 de Septiembre 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\$616,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.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	60,0	60,1	34,0	22,0	26,1	38,0	0,0
15-35	144,5	250,6	181,5	52,8	46,1	68,8	23,0
36-60	27,3	17,4	0,0	0,4	17,4	26,9	0,0
61-90	17,2	18,3	0,1	0,0	18,2	17,2	0,0
91-180	0,3	12,0	0,1	0,0	11,8	0,1	0,1
>180	3,0	5,7	0,0	0,0	5,7	3,0	0,0
Total	252,2	364,3	215,7	75,2	125,4	153,9	23,1

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

* 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**	6	437	2040	2000	9	495	1792	1532	14	167	1523	1532
Intragrupa y off-shore***	0	0	1092	787	0	0	726	601	0	0	907	560
Otros	437	6	500	846	495	9	452	838	167	14	349	687
Total	443	443	3632	3632	504	504	2970	2970	181	181	2779	2779

* 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: $((\text{Tasa Pactada}/\text{Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo