

Fecha de Publicación: 7 de Septiembre de 2010
Fecha de Información: 03 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\$1006,9 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,8%.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	114,6	191,5	23,3	78,0	154,2	22,6	14,0
15-35	291,3	176,8	78,8	132,8	70,8	131,2	27,3
36-60	48,2	8,0	0,0	30,0	8,0	18,2	0,0
61-90	56,9	70,6	5,0	0,0	25,6	16,9	40,0
91-180	27,4	11,5	0,0	0,0	11,5	27,4	0,0
>180	5,0	5,1	0,0	0,0	5,1	5,0	0,0
Total	543,3	463,6	107,1	240,8	275,2	221,3	81,3

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

* 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	1995	10	495	1806	1556	16	167	1622	1699
Intragrupa y off-shore***	0	0	1087	787	0	0	746	604	0	0	911	635
Otros	437	6	500	846	495	10	453	845	167	16	502	701
Total	443	443	3628	3628	505	505	3005	3005	183	183	3035	3035

* 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