

Fecha de Publicación: 13 de Agosto de 2010
Fecha de Información: 11 de Agosto de 2010¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$878,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,1%.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	80,1	59,9	47,0	39,0	12,9	41,1	0,0
15-35	119,0	344,1	213,5	25,0	97,9	61,3	32,7
36-60	122,6	47,9	0,0	0,0	37,9	112,6	10,0
61-90	36,3	1,5	0,0	0,0	1,5	36,3	0,0
91-180	17,6	46,5	26,7	0,0	9,9	7,6	10,0
>180	1,0	2,1	0,0	0,0	2,1	1,0	0,0
Total	376,7	502,1	287,2	64,0	162,3	260,0	52,7

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

* 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	9 al 13 de Agosto				16 al 20 de Agosto				23 al 27 de Agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	244	2145	1808	17	70	1312	1541	6	222	1555	1104
Intragrupa y off-shore***	0	0	925	635	8	0	1105	559	0	0	586	496
Otros	244	11	430	1057	62	17	290	606	222	6	260	801
Total	255	255	3500	3500	87	87	2706	2706	228	228	2401	2401

* 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 intragrupo