

Fecha de Publicación: 3 de Septiembre de 2010
Fecha de Información: 01 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\$880,5 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,5%.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	108,4	54,0	0,0	84,0	54,0	24,4	0,0
15-35	226,0	271,8	91,0	112,5	118,8	51,5	62,0
36-60	37,2	1,9	0,0	0,0	1,9	37,2	0,0
61-90	32,5	11,8	0,0	0,0	11,8	32,5	0,0
91-180	38,6	90,6	11,2	0,0	79,4	38,6	0,0
>180	3,0	4,6	0,0	3,0	4,6	0,0	0,0
Total	445,7	434,8	102,2	199,5	270,6	184,2	62,0

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

* 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	435	2024	1997	9	494	1761	1509	14	167	1510	1500
Intragrupa y off-shore***	0	0	1087	770	0	0	726	596	0	0	878	560
Otros	435	7	502	847	494	9	429	812	167	14	346	674
Total	442	442	3614	3614	503	503	2916	2916	181	181	2734	2734

* 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