

Fecha de Publicación: 9 de Septiembre de 2010
Fecha de Información: 07 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\$894,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,7%.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	252,7	135,9	76,9	164,0	54,1	83,7	5,0
15-35	170,7	224,0	74,8	89,7	120,2	52,1	29,0
36-60	5,1	21,4	10,0	1,0	8,9	1,6	2,5
61-90	26,7	42,6	0,0	0,0	42,6	26,7	0,0
91-180	0,0	5,5	0,0	0,0	5,5	0,0	0,0
>180	0,0	9,8	9,6	0,0	0,2	0,0	0,0
Total	455,2	439,1	171,2	254,7	231,4	164,1	36,5

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

* 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	6 al 10 de Septiembre				13 al 17 de Septiembre				20 al 24 de Septiembre			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Sector Financiero**	11	486	1881	1652	42	207	1776	1756	7	141	1436	1359
Intragrupa y off-shore***	0	0	815	651	0	0	942	747	0	0	948	600
Otros	486	11	439	832	207	42	508	724	141	7	244	670
Total	497	497	3134	3134	248	248	3226	3226	149	149	2628	2628

* 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