Fecha de Publicación: 10 de Septiembre de 2010
Fecha de Información: 08 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$1062,7 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,9%.[2]

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero**		Intragrupo y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	93,4	216,4	178,1	29,5	8,3	33,9	30,0
15-35	261,3	296,3	147,0	92,0	98,3	118,3	51,0
36-60	0,5	11,0	0,0	0,0	11,0	0,5	0,0
61-90	3,0	48,3	4,1	0,0	42,1	0,9	2,1
91-180	103,4	23,9	0,0	100,0	23,9	3,4	0,0
>180	1,2	4,1	0,0	0,0	4,1	1,2	0,0
Total	**462,8**	**599,9**	**329,2**	**221,5**	**187,6**	**158,2**	**83,1**

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

Sectores	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**	10	473	1886	1720	43	207	1852	1899	7	143	1450	1373
Intragrupo y off-shore***	0	0	886	656	0	0	1049	771	0	0	948	600
Otros	473	10	436	832	207	43	513	745	143	7	258	684
Total	**483**	**483**	**3208**	**3208**	**250**	**250**	**3415**	**3415**	**151**	**151**	**2657**	**2657**

* 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