

Fecha de Publicación: 13 de Septiembre de 2010
Fecha de Información: 09 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\$888,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 0,6%.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	69,6	92,2	58,5	5,0	23,7	54,6	10,0
15-35	269,3	381,3	195,7	129,5	113,4	67,6	72,2
36-60	2,4	26,5	0,0	0,0	26,5	2,4	0,0
61-90	5,5	15,8	0,0	0,0	12,8	2,5	3,0
91-180	12,3	12,1	0,0	0,0	12,1	12,3	0,0
>180	0,1	1,8	0,0	0,0	1,8	0,1	0,0
Total	359,1	529,7	254,2	134,5	190,3	139,4	85,2

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

* 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**	10	488	1856	1738	43	207	1903	1926	8	144	1483	1411
Intragrupa y off-shore***	0	0	920	656	0	0	1049	776	0	0	973	604
Otros	488	10	420	802	207	43	531	781	144	8	267	709
Total	499	499	3196	3196	250	250	3483	3483	152	152	2723	2723

* 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